

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

日本債券インデックスe

運用報告書(全体版)

第7期(決算日 2017年1月23日)

受益者のみなさまへ

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

お問い合わせ先

フリーダイヤル:0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

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

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入率	債券先物率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	債組比			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第3期(2013年1月22日)	10,513	0	1.8	344.574	2.3	99.1	0.3	906
第4期(2014年1月22日)	10,676	0	1.6	351.482	2.0	99.2	0.2	1,279
第5期(2015年1月22日)	11,020	0	3.2	364.399	3.7	99.3	0.2	2,908
第6期(2016年1月22日)	11,155	0	1.2	370.303	1.6	99.0	0.5	2,639
第7期(2017年1月23日)	11,362	0	1.9	378.843	2.3	99.3	0.2	2,280

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率
	騰落率	騰落率				
(当期首)	円	%		%	%	%
2016年1月22日	11,155	—	370.303	—	99.0	0.5
1月末	11,249	0.8	373.520	0.9	99.0	0.6
2月末	11,436	2.5	379.830	2.6	99.1	0.6
3月末	11,522	3.3	382.913	3.4	99.1	0.6
4月末	11,619	4.2	386.253	4.3	99.1	0.6
5月末	11,656	4.5	387.599	4.7	99.0	0.6
6月末	11,795	5.7	392.355	6.0	99.3	0.3
7月末	11,692	4.8	389.242	5.1	99.1	0.5
8月末	11,575	3.8	385.240	4.0	99.0	0.5
9月末	11,578	3.8	385.504	4.1	99.4	0.4
10月末	11,543	3.5	384.444	3.8	99.4	0.3
11月末	11,464	2.8	381.967	3.1	99.4	0.3
12月末	11,397	2.2	379.825	2.6	99.4	0.3
(当期末)						
2017年1月23日	11,362	1.9	378.843	2.3	99.3	0.2

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

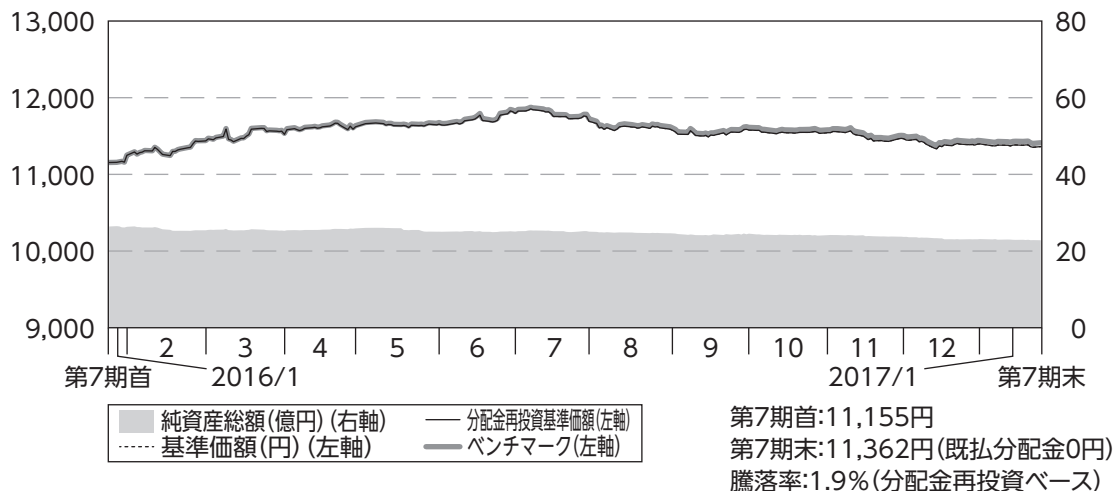
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

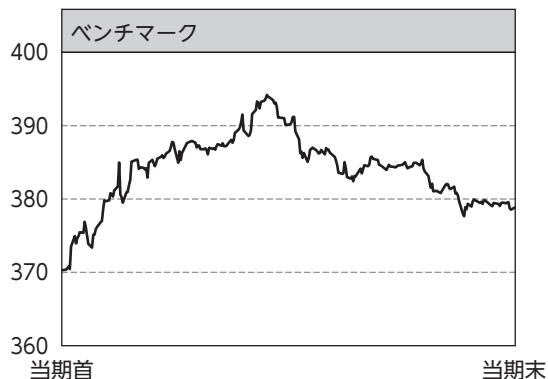


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2016年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

期初より7月上旬にかけて、1月末に日銀がマイナス金利政策の導入を決定したことや6月下旬に英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱派が勝利したことを受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移し、基準価額は上昇しました。その後は9月中旬にかけて、日銀の追加金融緩和が予想を下回る内容となり先行きの金融政策への不透明感が高まったことに加え、米国の早期利上げ観測の高まりを背景に金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。9月下旬以降は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利は徐々に狭いレンジでの推移となり、基準価額は横ばい圏で推移しました。11月上旬から12月中旬にかけては、米大統領選挙で共和党のトランプ候補が勝利したことを受けて米国金利が上昇した影響から金利は上昇基調となり、基準価額は下落しましたが、その後は期末にかけて米国金利の上昇一服から、横ばい圏で推移しました。

投資環境



2016年7月上旬にかけて、日銀がマイナス金利政策を導入したことや英国の国民投票でEU離脱派が勝利したことを受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利は低下しました。その後7月中旬から9月中旬にかけて、金融政策の先行き不透明感などから金利は上昇しました。9月下旬以降は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利は徐々に狭いレンジでの推移となりました。11月上旬から12月中旬にかけては、米大統領選挙で共和党のトランプ候補が勝利したことを受けて米国金利が上昇した影響から金利は上昇基調となりましたが、その後は期末にかけて米国金利の上昇一服から、横ばい圏で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

【「日本債券マザーファンド」の運用状況】

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

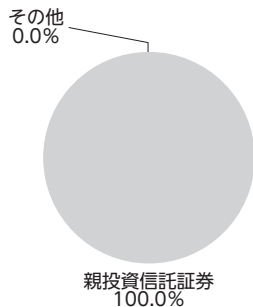
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

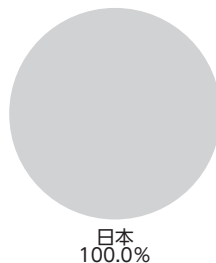
	当期末
	2017年1月23日
日本債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

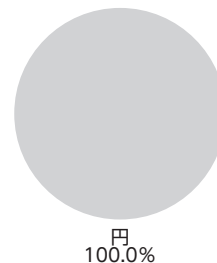
○資産別配分



○国別配分



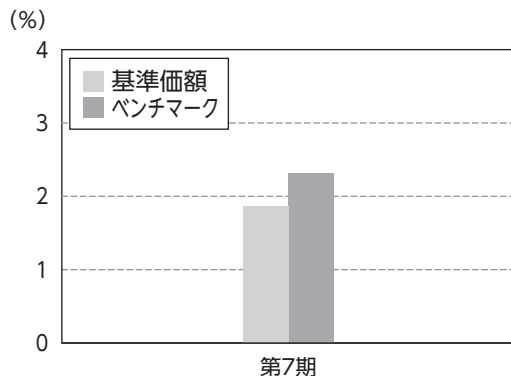
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

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



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

分配金

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

(1万口当たり・税引前)

項目	第7期	
	2016年1月23日～2017年1月23日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	1,362	

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

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

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2016年1月23日～2017年1月23日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	46円	0.401%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{[期中の平均基準価額]} \times \text{信託報酬率}}{\text{期中の平均基準価額}}$ は11,543円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(18)	(0.152)	
(販売会社)	(24)	(0.206)	
(受託会社)	(5)	(0.043)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	47	0.406	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

売買および取引の状況

<親投資信託受益証券の設定、解約状況>

	当 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 302,074	千円 412,838	千口 613,421	千円 832,502

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 377	百万円 377	% 100.0	百万円 377	百万円 377	% 100.0
コール・ローン	1,535	260	16.9	1,535	259	16.9

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<日本債券マザーファンド>

区 分	当 期					
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 167,686	百万円 167,686	% 100.0	百万円 167,686	百万円 167,686	% 100.0
コール・ローン	413,979	66,309	16.0	415,074	66,420	16.0

<平均保有割合 0.8%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 2,004,177	千口 1,692,830	千円 2,280,919

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、236,558,846千口です。

※ 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 2,280,919	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	19,335	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	2,300,254	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 2017年1月23日現在
(A) 資 産	2,300,254,157円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,157,484
日本債券マザーファンド(評価額)	2,280,919,492
未 収 入 金	11,177,181
(B) 負 債	19,307,116
未 払 解 約 金	14,390,902
未 払 信 託 報 酬	4,850,703
未 払 利 息	19
そ の 他 未 払 費 用	65,492
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,280,947,041
元 本	2,007,458,281
次 期 繰 越 損 益 金	273,488,760
(D) 受 益 権 総 口 数	2,007,458,281口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,362円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年1月23日 至 2017年1月23日
(A) 配 当 等 収 益	△3,250円
受 取 利 息	195
支 払 利 息	△3,445
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	30,348,898
売 買 益	60,341,408
売 買 損	△29,992,510
(C) 信 託 報 酬 等	△10,055,630
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	20,290,018
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	38,867,045
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	214,331,697
(配 当 等 相 当 額)	(92,177,860)
(売 買 損 益 相 当 額)	(122,153,837)
(G) 計 (D+E+F)	273,488,760
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	273,488,760
追 加 信 託 差 損 益 金	214,331,697
(配 当 等 相 当 額)	(92,468,146)
(売 買 損 益 相 当 額)	(121,863,551)
分 配 準 備 積 立 金	59,157,063

(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2,366,307,760円、期中追加設定元本額は740,664,711円、期中一部解約元本額は1,099,514,190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)	16,015,884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)	4,274,134円
(C) 収益調整金額	214,331,697円
(D) 分配準備積立金額	38,867,045円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	273,488,760円
(F) 期末残存口数	2,007,458,281口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	1,362円
(H) 分配金額(1万口当たり)	—円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	—円

お知らせ

該当事項はありません。

日本債券マザーファンド

運用報告書

第16期（決算日 2017年1月23日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率 %	円	騰落率 %			
第12期(2013年1月22日)	12,254	2.3	344,574	2.3	99.1	0.3	350,008
第13期(2014年1月22日)	12,498	2.0	351,482	2.0	99.3	0.2	378,127
第14期(2015年1月22日)	12,954	3.6	364,399	3.7	99.4	0.2	356,419
第15期(2016年1月22日)	13,170	1.7	370,303	1.6	99.0	0.5	315,515
第16期(2017年1月23日)	13,474	2.3	378,843	2.3	99.3	0.2	318,745

(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 比	債券先物率 比
	円	騰落率 %	円	騰落率 %		
(当期首) 2016年1月22日	13,170	—	370,303	—	99.0	0.5
1月末	13,282	0.9	373,520	0.9	99.0	0.6
2月末	13,508	2.6	379,830	2.6	99.1	0.6
3月末	13,615	3.4	382,913	3.4	99.1	0.6
4月末	13,734	4.3	386,253	4.3	99.1	0.6
5月末	13,783	4.7	387,599	4.7	99.0	0.6
6月末	13,952	5.9	392,355	6.0	99.3	0.3
7月末	13,835	5.0	389,242	5.1	99.1	0.5
8月末	13,702	4.0	385,240	4.0	99.0	0.5
9月末	13,711	4.1	385,504	4.1	99.4	0.4
10月末	13,674	3.8	384,444	3.8	99.4	0.3
11月末	13,586	3.2	381,967	3.1	99.4	0.3
12月末	13,511	2.6	379,825	2.6	99.4	0.3
(当期末) 2017年1月23日	13,474	2.3	378,843	2.3	99.3	0.2

(注1)騰落率は期首比です。

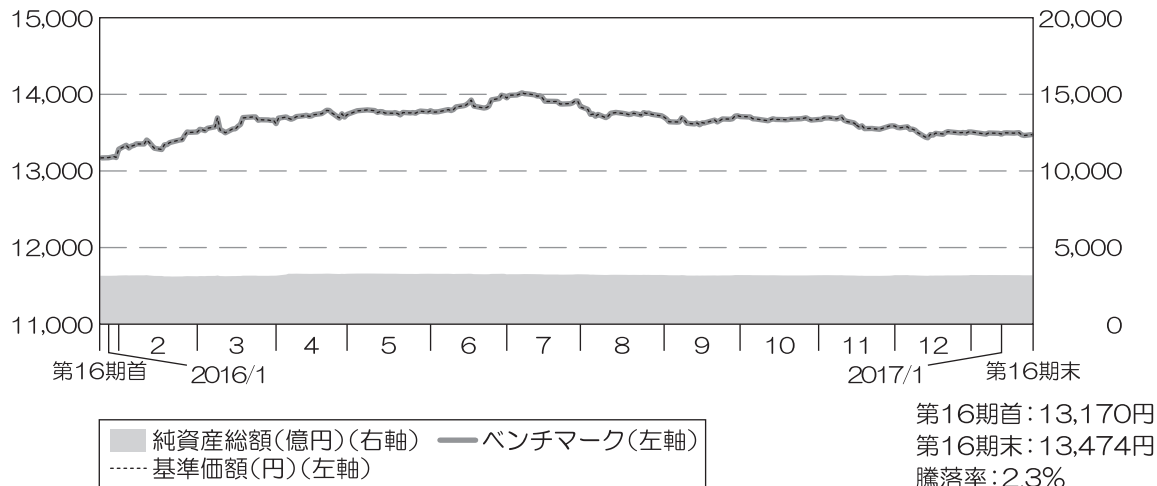
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、2016年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

期初より7月上旬にかけて、1月末に日銀がマイナス金利政策の導入を決定したことや6月下旬に英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱派が勝利したことを受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移し、基準価額は上昇しました。その後は9月中旬にかけて、日銀の追加金融緩和が予想を下回る内容となり先行きの金融政策への不透明感が高まったことに加え、米国の早期利上げ観測の高まりを背景に金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。9月下旬以降は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利は徐々に狭いレンジでの推移となり、基準価額は横ばい圏で推移しました。11月上旬から12月中旬にかけては、米大統領選挙で共和党のトランプ候補が勝利したことを受けて米国金利が上昇した影響から金利は上昇基調となり、基準価額は下落しましたが、その後は期末にかけて米国金利の上昇一服から、横ばい圏で推移しました。

投資環境



2016年7月上旬にかけて、日銀がマイナス金利政策を導入したことや英国の国民投票でEU離脱派が勝利したことを受けてリスク回避姿勢が強まったことなどから、金利は低下しました。その後7月中旬から9月中旬にかけて、金融政策の先行き不透明感などから金利は上昇しました。9月下旬以降は、日銀のイールドカーブ・コントロール政策導入を受けて金利は徐々に狭いレンジでの推移となりました。11月上旬から12月中旬にかけては、米大統領選挙で共和党のトランプ候補が勝利したことを受けて米国金利が上昇した影響から金利は上昇基調となりましたが、その後は期末にかけて米国金利の上昇一服から、横ばい圏で推移しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

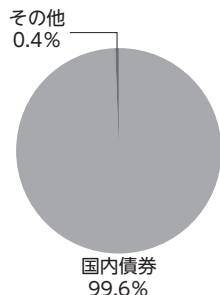
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	第127回利付国債(5年)	日本	1.1%
2	第339回利付国債(10年)	日本	1.1%
3	第116回利付国債(5年)	日本	1.0%
4	第129回利付国債(5年)	日本	1.0%
5	第344回利付国債(10年)	日本	1.0%
6	第338回利付国債(10年)	日本	1.0%

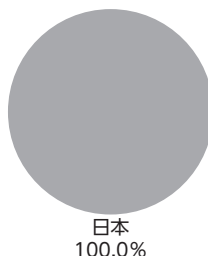
順位	銘柄名	国	組入比率
7	第126回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第340回利付国債(10年)	日本	0.9%
9	第334回利付国債(10年)	日本	0.9%
10	第117回利付国債(5年)	日本	0.9%
組入銘柄数			749

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

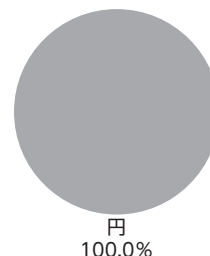
○資産別配分



○国別配分



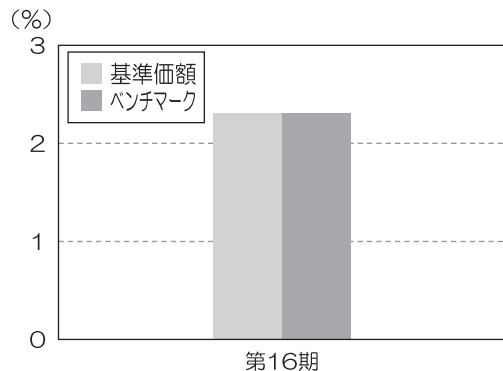
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2016年1月23日～2017年1月23日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	0	0.000	(c) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(13,657円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 69,646,071	千円 65,704,075
	地 方 債 証 券	3,161,794	3,716,294
	特 殊 債 券	4,017,374	4,605,286 (755,111)
	社 債 券	2,426,712	3,932,551 (200,000)

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債 券 先 物 取 引	百万円 37,583	百万円 38,360	百万円 -	百万円 -

(注)金額は受渡代金です。

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 167,686	百万円 167,686	% 100.0	百万円 167,686	百万円 167,686	% 100.0
コール・ローン	413,979	66,309	16.0	415,074	66,420	16.0

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

〈国内(邦貨建)公社債〉

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBBB格以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国 債 証 券	238,077,000 (3,980,000)	260,831,357 (4,006,011)	81.8 (1.3)	— (—)	51.4 (—)	19.6 (—)	10.8 (1.3)	
地 方 債 証 券	16,986,690 (16,586,690)	18,114,993 (17,661,049)	5.7 (5.5)	— (—)	3.4 (3.3)	2.1 (2.0)	0.2 (0.2)	
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	19,650,179 (19,450,179)	21,497,701 (21,253,047)	6.7 (6.7)	— (—)	4.9 (4.8)	1.5 (1.5)	0.4 (0.4)	
金 融 債 証 券	2,300,000 (2,300,000)	2,310,395 (2,310,395)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.5 (0.5)	0.3 (0.3)	
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	13,300,000 (13,200,000)	13,847,541 (13,740,578)	4.3 (4.3)	— (—)	1.6 (1.6)	1.8 (1.8)	0.9 (0.9)	
合 計	290,313,869 (55,516,869)	316,601,987 (58,971,081)	99.3 (18.5)	— (—)	61.3 (9.8)	25.5 (5.8)	12.5 (2.9)	

(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			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日			利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円		
国債証券										
第362回利付国債(2年)	0.1	2,470,000	2,481,510	2018/3/15	第125回利付国債(5年)	0.1	2,740,000	2,766,660	2020/9/20	
第364回利付国債(2年)	0.1	2,030,000	2,040,332	2018/5/15	第126回利付国債(5年)	0.1	3,020,000	3,050,804	2020/12/20	
第365回利付国債(2年)	0.1	610,000	613,178	2018/6/15	第127回利付国債(5年)	0.1	3,520,000	3,557,452	2021/3/20	
第366回利付国債(2年)	0.1	80,000	80,430	2018/7/15	第128回利付国債(5年)	0.1	2,490,000	2,516,991	2021/6/20	
第367回利付国債(2年)	0.1	2,090,000	2,101,892	2018/8/15	第129回利付国債(5年)	0.1	3,140,000	3,175,262	2021/9/20	
第368回利付国債(2年)	0.1	1,640,000	1,649,577	2018/9/15	第130回利付国債(5年)	0.1	900,000	910,431	2021/12/20	
第370回利付国債(2年)	0.1	2,630,000	2,646,910	2018/11/15	第1回利付国債(40年)	2.4	230,000	332,110	2048/3/20	
第371回利付国債(2年)	0.1	600,000	603,978	2018/12/15	第2回利付国債(40年)	2.2	350,000	488,411	2049/3/20	
第372回利付国債(2年)	0.1	750,000	755,122	2019/1/15	第3回利付国債(40年)	2.2	410,000	575,463	2050/3/20	
第109回利付国債(5年)	0.1	880,000	884,153	2018/3/20	第4回利付国債(40年)	2.2	645,000	910,385	2051/3/20	
第110回利付国債(5年)	0.3	370,000	372,597	2018/3/20	第5回利付国債(40年)	2.0	630,000	854,991	2052/3/20	
第111回利付国債(5年)	0.4	1,230,000	1,240,049	2018/3/20	第6回利付国債(40年)	1.9	670,000	892,922	2053/3/20	
第112回利付国債(5年)	0.4	660,000	666,303	2018/6/20	第7回利付国債(40年)	1.7	570,000	726,265	2054/3/20	
第113回利付国債(5年)	0.3	1,930,000	1,945,729	2018/6/20	第8回利付国債(40年)	1.4	720,000	848,743	2055/3/20	
第114回利付国債(5年)	0.3	790,000	797,268	2018/9/20	第9回利付国債(40年)	0.4	600,000	508,002	2056/3/20	
第115回利付国債(5年)	0.2	1,830,000	1,843,651	2018/9/20	第290回利付国債(10年)	1.4	900,000	917,721	2018/3/20	
第116回利付国債(5年)	0.2	3,210,000	3,237,285	2018/12/20	第291回利付国債(10年)	1.3	820,000	835,202	2018/3/20	
第117回利付国債(5年)	0.2	2,830,000	2,855,951	2019/3/20	第292回利付国債(10年)	1.7	550,000	562,732	2018/3/20	
第118回利付国債(5年)	0.2	1,550,000	1,565,515	2019/6/20	第293回利付国債(10年)	1.8	900,000	926,307	2018/6/20	
第119回利付国債(5年)	0.1	660,000	665,009	2019/6/20	第294回利付国債(10年)	1.7	900,000	925,038	2018/6/20	
第120回利付国債(5年)	0.2	1,590,000	1,607,156	2019/9/20	第295回利付国債(10年)	1.5	890,000	912,258	2018/6/20	
第121回利付国債(5年)	0.1	650,000	655,284	2019/9/20	第296回利付国債(10年)	1.5	2,150,000	2,212,414	2018/9/20	
第122回利付国債(5年)	0.1	2,770,000	2,793,822	2019/12/20	第297回利付国債(10年)	1.4	880,000	907,561	2018/12/20	
第123回利付国債(5年)	0.1	2,620,000	2,643,632	2020/3/20	第298回利付国債(10年)	1.3	1,360,000	1,399,997	2018/12/20	
第124回利付国債(5年)	0.1	2,710,000	2,735,474	2020/6/20	第299回利付国債(10年)	1.3	1,140,000	1,177,517	2019/3/20	

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300回利付国債(10年)	1.5	550,000	570,476	2019/3/20	第16回利付国債(30年)	2.5	250,000	334,902	2034/9/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,500,000	1,561,680	2019/6/20	第17回利付国債(30年)	2.4	420,000	556,138	2034/12/20
第302回利付国債(10年)	1.4	870,000	903,677	2019/6/20	第18回利付国債(30年)	-2.3	540,000	706,422	2035/3/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,640,000	1,710,175	2019/9/20	第19回利付国債(30年)	2.3	300,000	392,643	2035/6/20
第304回利付国債(10年)	1.3	1,260,000	1,310,563	2019/9/20	第20回利付国債(30年)	2.5	290,000	389,951	2035/9/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,200,000	2,295,964	2019/12/20	第21回利付国債(30年)	-2.3	360,000	471,902	2035/12/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,370,000	1,438,527	2020/3/20	第22回利付国債(30年)	2.5	380,000	511,913	2036/3/20
第307回利付国債(10年)	1.3	970,000	1,015,444	2020/3/20	第23回利付国債(30年)	2.5	370,000	499,100	2036/6/20
第308回利付国債(10年)	1.3	970,000	1,018,761	2020/6/20	第24回利付国債(30年)	2.5	335,000	452,055	2036/9/20
第309回利付国債(10年)	1.1	1,040,000	1,085,167	2020/6/20	第25回利付国債(30年)	2.3	335,000	440,159	2036/12/20
第310回利付国債(10年)	1.0	1,400,000	1,459,654	2020/9/20	第26回利付国債(30年)	2.4	610,000	813,209	2037/3/20
第311回利付国債(10年)	0.8	670,000	693,624	2020/9/20	第27回利付国債(30年)	2.5	470,000	638,194	2037/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	2,037,000	2,144,899	2020/12/20	第28回利付国債(30年)	2.5	930,000	1,267,552	2038/3/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,070,000	1,134,521	2021/3/20	第29回利付国債(30年)	2.4	420,000	566,496	2038/9/20
第314回利付国債(10年)	1.1	620,000	652,209	2021/3/20	第30回利付国債(30年)	2.3	890,000	1,186,948	2039/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	1,130,000	1,197,031	2021/6/20	第31回利付国債(30年)	2.2	800,000	1,054,200	2039/9/20
第316回利付国債(10年)	1.1	570,000	601,287	2021/6/20	第32回利付国債(30年)	2.3	900,000	1,208,511	2040/3/20
第317回利付国債(10年)	1.1	470,000	497,170	2021/9/20	第33回利付国債(30年)	2.0	1,020,000	1,308,996	2040/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,050,000	1,105,786	2021/9/20	第34回利付国債(30年)	-2.2	980,000	1,305,213	2041/3/20
第319回利付国債(10年)	1.1	560,000	593,829	2021/12/20	第35回利付国債(30年)	-2.0	1,050,000	1,355,497	2041/9/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,270,000	1,340,459	2021/12/20	第36回利付国債(30年)	2.0	1,145,000	1,482,305	2042/3/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,420,000	1,501,990	2022/3/20	第37回利付国債(30年)	1.9	1,150,000	1,466,043	2042/9/20
第322回利付国債(10年)	0.9	680,000	715,740	2022/3/20	第38回利付国債(30年)	1.8	885,000	1,109,975	2043/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	690,000	728,053	2022/6/20	第39回利付国債(30年)	1.9	540,000	691,318	2043/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,000,000	1,049,710	2022/6/20	第40回利付国債(30年)	1.8	670,000	842,156	2043/9/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,285,000	2,402,563	2022/9/20	第41回利付国債(30年)	1.7	655,000	808,767	2043/12/20
第326回利付国債(10年)	0.7	560,000	586,420	2022/12/20	第42回利付国債(30年)	1.7	730,000	901,674	2044/3/20
第327回利付国債(10年)	0.8	1,180,000	1,242,669	2022/12/20	第43回利付国債(30年)	1.7	695,000	858,728	2044/6/20
第328回利付国債(10年)	0.6	1,680,000	1,751,652	2023/3/20	第44回利付国債(30年)	1.7	760,000	939,337	2044/9/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,045,000	2,160,747	2023/6/20	第45回利付国債(30年)	1.5	600,000	712,038	2044/12/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,880,000	1,989,303	2023/9/20	第46回利付国債(30年)	1.5	910,000	1,081,180	2045/3/20
第331回利付国債(10年)	0.6	970,000	1,013,426	2023/9/20	第47回利付国債(30年)	1.6	930,000	1,129,624	2045/6/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,530,000	2,645,696	2023/12/20	第48回利付国債(30年)	1.4	960,000	1,117,699	2045/9/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,620,000	2,740,179	2024/3/20	第49回利付国債(30年)	1.4	840,000	978,986	2045/12/20
第334回利付国債(10年)	0.6	2,760,000	2,887,870	2024/6/20	第50回利付国債(30年)	0.8	865,000	873,252	2046/3/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,325,000	2,416,721	2024/9/20	第51回利付国債(30年)	0.3	965,000	847,125	2046/6/20
第336回利付国債(10年)	0.5	970,000	1,009,110	2024/12/20	第52回利付国債(30年)	0.5	1,190,000	1,107,080	2046/9/20
第337回利付国債(10年)	0.3	1,720,000	1,762,157	2024/12/20	第53回利付国債(30年)	0.6	320,000	305,660	2046/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	2,970,000	3,068,039	2025/3/20	第39回利付国債(20年)	2.6	440,000	454,748	2018/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	3,325,000	3,436,720	2025/6/20	第40回利付国債(20年)	2.3	450,000	468,994	2018/9/20
第340回利付国債(10年)	0.4	2,910,000	3,008,096	2025/9/20	第41回利付国債(20年)	1.5	520,000	539,302	2019/3/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,010,000	2,060,913	2025/12/20	第42回利付国債(20年)	2.6	380,000	403,123	2019/9/20
第342回利付国債(10年)	0.1	2,410,000	2,427,593	2026/3/20	第43回利付国債(20年)	2.9	340,000	368,101	2019/9/20
第343回利付国債(10年)	0.1	2,790,000	2,808,302	2026/6/20	第44回利付国債(20年)	-2.5	370,000	401,327	2020/3/20
第344回利付国債(10年)	0.1	3,060,000	3,077,625	2026/9/20	第45回利付国債(20年)	2.4	270,000	292,005	2020/3/20
第345回利付国債(10年)	0.1	1,250,000	1,256,150	2026/12/20	第46回利付国債(20年)	2.2	290,000	313,539	2020/6/22
第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	66,328	2029/9/20	第47回利付国債(20年)	-2.2	470,000	510,777	2020/9/21
第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	128,269	2030/2/20	第48回利付国債(20年)	2.5	230,000	253,885	2020/12/21
第3回利付国債(30年)	2.3	140,000	178,245	2030/5/20	第49回利付国債(20年)	2.1	280,000	306,202	2021/3/22
第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	258,462	2030/11/20	第50回利付国債(20年)	1.9	590,000	640,279	2021/3/22
第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	228,351	2031/5/20	第51回利付国債(20年)	2.0	240,000	262,634	2021/6/21
第6回利付国債(30年)	2.4	270,000	351,445	2031/11/20	第52回利付国債(20年)	2.1	430,000	474,904	2021/9/21
第7回利付国債(30年)	2.3	190,000	245,461	2032/5/20	第53回利付国債(20年)	2.1	350,000	388,402	2021/12/20
第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	208,312	2032/12/20	第54回利付国債(20年)	2.2	280,000	312,102	2021/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	188,764	2033/3/20	第55回利付国債(20年)	2.0	490,000	543,694	2022/3/21
第11回利付国債(30年)	1.7	280,000	337,058	2033/6/20	第56回利付国債(20年)	2.0	410,000	457,117	2022/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	370,000	469,296	2033/9/20	第57回利付国債(20年)	1.9	360,000	399,412	2022/6/20
第13回利付国債(30年)	2.0	350,000	438,651	2033/12/20	第58回利付国債(20年)	1.9	250,000	278,500	2022/9/20
第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	461,587	2034/3/20	第59回利付国債(20年)	1.7	440,000	487,014	2022/12/20
第15回利付国債(30年)	2.5	500,000	668,635	2034/6/20	第60回利付国債(20年)	1.4	570,000	620,752	2022/12/20

銘柄	当 期 利率	期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第6 1 回利付国債 (2 0 年)	1.0	390,000	416,406	2023/3/20
第6 2 回利付国債 (2 0 年)	0.8	250,000	264,150	2023/6/20
第6 3 回利付国債 (2 0 年)	1.8	570,000	638,930	2023/6/20
第6 4 回利付国債 (2 0 年)	1.9	410,000	463,976	2023/9/20
第6 5 回利付国債 (2 0 年)	1.9	370,000	420,401	2023/12/20
第6 6 回利付国債 (2 0 年)	1.8	330,000	372,665	2023/12/20
第6 7 回利付国債 (2 0 年)	1.9	310,000	353,235	2024/3/20
第6 8 回利付国債 (2 0 年)	2.2	230,000	267,025	2024/3/20
第6 9 回利付国債 (2 0 年)	2.1	530,000	611,519	2024/3/20
第7 0 回利付国債 (2 0 年)	2.4	490,000	578,092	2024/6/20
第7 1 回利付国債 (2 0 年)	2.2	400,000	465,980	2024/6/20
第7 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	710,000	824,721	2024/9/20
第7 3 回利付国債 (2 0 年)	2.0	540,000	625,827	2024/12/20
第7 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	310,000	361,723	2024/12/20
第7 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	360,000	421,768	2025/3/20
第7 6 回利付国債 (2 0 年)	1.9	340,000	392,795	2025/3/20
第7 7 回利付国債 (2 0 年)	2.0	290,000	337,394	2025/3/20
第7 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	20,000	23,182	2025/6/20
第7 9 回利付国債 (2 0 年)	2.0	100,000	116,750	2025/6/20
第8 0 回利付国債 (2 0 年)	2.1	250,000	293,975	2025/6/20
第8 1 回利付国債 (2 0 年)	2.0	180,000	210,963	2025/9/20
第8 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	485,000	572,624	2025/9/20
第8 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	270,000	320,041	2025/12/20
第8 4 回利付国債 (2 0 年)	2.0	190,000	223,525	2025/12/20
第8 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	360,000	428,569	2026/3/20
第8 6 回利付国債 (2 0 年)	2.3	240,000	290,097	2026/3/20
第8 7 回利付国債 (2 0 年)	2.2	170,000	203,932	2026/3/20
第8 8 回利付国債 (2 0 年)	2.3	340,000	412,341	2026/6/20
第8 9 回利付国債 (2 0 年)	2.2	320,000	385,088	2026/6/20
第9 0 回利付国債 (2 0 年)	2.2	620,000	749,121	2026/9/20
第9 1 回利付国債 (2 0 年)	2.3	510,000	621,118	2026/9/20
第9 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	790,000	950,030	2026/12/20
第9 3 回利付国債 (2 0 年)	2.0	260,000	310,874	2027/3/20
第9 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	545,000	657,139	2027/3/20
第9 5 回利付国債 (2 0 年)	2.3	400,000	491,840	2027/6/20
第9 6 回利付国債 (2 0 年)	2.1	300,000	362,691	2027/6/20
第9 7 回利付国債 (2 0 年)	2.2	510,000	623,862	2027/9/20
第9 8 回利付国債 (2 0 年)	2.1	370,000	448,702	2027/9/20
第9 9 回利付国債 (2 0 年)	2.1	660,000	802,777	2027/12/20
第1 0 0 回利付国債 (2 0 年)	2.2	890,000	1,095,447	2028/3/20
第1 0 1 回利付国債 (2 0 年)	2.4	360,000	451,036	2028/3/20
第1 0 2 回利付国債 (2 0 年)	2.4	370,000	465,130	2028/6/20
第1 0 3 回利付国債 (2 0 年)	2.3	400,000	498,344	2028/6/20
第1 0 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	260,000	318,073	2028/6/20
第1 0 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	490,000	601,141	2028/9/20
第1 0 6 回利付国債 (2 0 年)	2.2	310,000	383,873	2028/9/20
第1 0 7 回利付国債 (2 0 年)	2.1	430,000	528,659	2028/12/20
第1 0 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	620,000	747,738	2028/12/20
第1 0 9 回利付国債 (2 0 年)	1.9	370,000	447,248	2029/3/20
第1 1 0 回利付国債 (2 0 年)	2.1	565,000	696,441	2029/3/20
第1 1 1 回利付国債 (2 0 年)	2.2	640,000	798,739	2029/6/20
第1 1 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	970,000	1,198,803	2029/6/20
第1 1 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	755,000	935,475	2029/9/20
第1 1 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	600,000	745,248	2029/12/20
第1 1 5 回利付国債 (2 0 年)	2.2	350,000	439,141	2029/12/20
第1 1 6 回利付国債 (2 0 年)	2.2	400,000	502,808	2030/3/20
第1 1 7 回利付国債 (2 0 年)	2.1	620,000	771,404	2030/3/20
第1 1 8 回利付国債 (2 0 年)	2.0	500,000	616,645	2030/6/20
第1 1 9 回利付国債 (2 0 年)	1.8	390,000	470,815	2030/6/20
第1 2 0 回利付国債 (2 0 年)	1.6	420,000	495,763	2030/6/20

銘柄	当 期 利率	期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第1 2 1 回利付国債 (2 0 年)	1.9	660,000	806,421	2030/9/20
第1 2 2 回利付国債 (2 0 年)	1.8	450,000	543,874	2030/9/20
第1 2 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	720,000	900,756	2030/12/20
第1 2 4 回利付国債 (2 0 年)	2.0	400,000	495,036	2030/12/20
第1 2 5 回利付国債 (2 0 年)	2.2	300,000	380,196	2031/3/20
第1 2 6 回利付国債 (2 0 年)	2.0	660,000	817,825	2031/3/20
第1 2 7 回利付国債 (2 0 年)	1.9	450,000	551,457	2031/3/20
第1 2 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	730,000	895,549	2031/6/20
第1 2 9 回利付国債 (2 0 年)	1.8	350,000	424,518	2031/6/20
第1 3 0 回利付国債 (2 0 年)	1.8	820,000	995,422	2031/9/20
第1 3 1 回利付国債 (2 0 年)	1.7	360,000	431,946	2031/9/20
第1 3 2 回利付国債 (2 0 年)	1.7	600,000	720,324	2031/12/20
第1 3 3 回利付国債 (2 0 年)	1.8	610,000	741,040	2031/12/20
第1 3 4 回利付国債 (2 0 年)	1.8	490,000	595,634	2032/3/20
第1 3 5 回利付国債 (2 0 年)	1.7	380,000	456,421	2032/3/20
第1 3 6 回利付国債 (2 0 年)	1.6	450,000	533,988	2032/3/20
第1 3 7 回利付国債 (2 0 年)	1.7	370,000	444,936	2032/6/20
第1 3 8 回利付国債 (2 0 年)	1.5	540,000	633,052	2032/6/20
第1 3 9 回利付国債 (2 0 年)	1.6	350,000	415,466	2032/6/20
第1 4 0 回利付国債 (2 0 年)	1.7	1,225,000	1,472,584	2032/9/20
第1 4 1 回利付国債 (2 0 年)	1.7	970,000	1,167,249	2032/12/20
第1 4 2 回利付国債 (2 0 年)	1.8	430,000	523,916	2032/12/20
第1 4 3 回利付国債 (2 0 年)	1.6	920,000	1,093,254	2033/3/20
第1 4 4 回利付国債 (2 0 年)	1.5	440,000	515,759	2033/3/20
第1 4 5 回利付国債 (2 0 年)	1.7	1,160,000	1,396,384	2033/6/20
第1 4 6 回利付国債 (2 0 年)	1.7	1,220,000	1,468,745	2033/9/20
第1 4 7 回利付国債 (2 0 年)	1.6	1,360,000	1,615,802	2033/12/20
第1 4 8 回利付国債 (2 0 年)	1.5	1,600,000	1,873,408	2034/3/20
第1 4 9 回利付国債 (2 0 年)	1.5	1,140,000	1,334,221	2034/6/20
第1 5 0 回利付国債 (2 0 年)	1.4	1,460,000	1,684,051	2034/9/20
第1 5 1 回利付国債 (2 0 年)	1.2	1,240,000	1,387,175	2034/12/20
第1 5 2 回利付国債 (2 0 年)	1.2	1,220,000	1,363,215	2035/3/20
第1 5 3 回利付国債 (2 0 年)	1.3	1,440,000	1,632,729	2035/6/20
第1 5 4 回利付国債 (2 0 年)	1.2	1,430,000	1,593,978	2035/9/20
第1 5 5 回利付国債 (2 0 年)	1.0	1,270,000	1,367,840	2035/12/20
第1 5 6 回利付国債 (2 0 年)	0.4	1,410,000	1,363,907	2036/3/20
第1 5 7 回利付国債 (2 0 年)	0.2	1,440,000	1,336,420	2036/6/20
第1 5 8 回利付国債 (2 0 年)	0.5	1,270,000	1,244,384	2036/9/20
第1 5 9 回利付国債 (2 0 年)	0.6	520,000	518,154	2036/12/20
小 計		238,077,000	260,831,357	
地方債証券				
第3 回東京都公募債 (2 0 年)	2.26	100,000	115,662	2024/3/19
第7 回東京都公募債 (3 0 年)	2.51	200,000	265,330	2038/9/17
第1 1 回東京都公募債 (2 0 年)	2.22	200,000	239,710	2027/3/19
第1 7 回東京都公募債 (2 0 年)	2.09	100,000	120,582	2028/12/20
第1 8 回東京都公募債 (2 0 年)	2.22	200,000	244,880	2029/3/19
第2 0 回東京都公募債 (2 0 年)	2.09	100,000	121,388	2029/9/20
第2 1 回東京都公募債 (2 0 年)	2.19	100,000	122,877	2029/12/20
第6 9 6 回東京都公募債	1.19	100,000	105,216	2021/6/18
第7 0 3 回東京都公募債	0.99	100,000	104,834	2021/12/20
第7 1 4 回東京都公募債	0.74	200,000	208,622	2022/12/20
第7 2 2 回東京都公募債	0.8	200,000	209,978	2023/6/20
第7 4 0 回東京都公募債	0.463	100,000	102,891	2024/12/20
第7 5 1 回東京都公募債	0.37	100,000	102,202	2025/12/19
平成2 2 年度第1 回北海道公募債	1.47	100,000	104,784	2020/4/30
平成2 2 年度第8 回北海道公募債	0.96	100,000	103,594	2020/10/29
平成2 3 年度第4 回北海道公募債	1.21	100,000	105,343	2021/6/30
平成2 7 年度第1 5 回北海道公募債	0.22	300,000	301,851	2026/2/26
第1 6 回神奈川県公募債 (2 0 年)	2.09	100,000	122,247	2031/1/24
第2 1 回神奈川県公募債 (2 0 年)	1.732	100,000	117,634	2032/9/17

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
	%	千円	千円	
第168回神奈川県公募債	1.36	100,000	103,923	2019/12/20
第173回神奈川県公募債	1.3	100,000	104,408	2020/6/19
第174回神奈川県公募債	1.17	100,000	103,964	2020/6/19
第175回神奈川県公募債	1.09	100,000	103,694	2020/6/19
第184回神奈川県公募債	1.02	100,000	104,467	2021/6/18
第190回神奈川県公募債	0.88	100,000	104,671	2022/6/20
第196回神奈川県公募債	0.678	100,000	103,947	2023/3/20
第334回大阪府公募債(10年)	1.47	100,000	104,405	2020/11/28
第335回大阪府公募債(10年)	1.48	100,000	104,553	2020/2/25
第339回大阪府公募債(10年)	1.37	100,000	104,684	2020/6/29
第356回大阪府公募債(10年)	1.06	130,000	136,758	2021/12/27
第363回大阪府公募債(10年)	0.77	114,000	118,715	2022/8/30
第371回大阪府公募債(10年)	0.58	200,000	206,672	2023/4/26
第376回大阪府公募債(10年)	0.82	100,000	105,053	2023/9/27
第403回大阪府公募債(10年)	0.462	200,000	205,496	2025/12/25
平成21年度第5回京都府公募債	1.35	100,000	103,909	2019/12/24
平成27年度第4回京都府公募債	0.553	100,000	103,557	2025/6/19
平成27年度第13回京都府公募債	0.11	105,860	105,524	2026/3/17
第4回兵庫県公募債(15年)	1.31	100,000	110,626	2027/12/24
平成21年度第1回兵庫県公募債	1.62	100,000	103,631	2019/4/23
平成21年度第35回兵庫県公募債	1.46	100,000	104,351	2020/11/22
平成22年度第19回兵庫県公募債	1.26	100,000	105,012	2021/1/21
平成25年度第14回兵庫県公募債	0.73	100,000	104,522	2024/1/22
平成26年度第2回兵庫県公募債	0.63	100,000	103,813	2024/5/20
平成22年度第3回静岡県公募債	1.379	100,000	104,582	2020/5/25
平成23年度第1回静岡県公募債	1.385	100,000	105,855	2021/4/21
平成23年度第5回静岡県公募債	1.158	100,000	105,106	2021/6/28
平成24年度第10回静岡県公募債	0.678	100,000	103,951	2023/3/22
平成25年度第1回静岡県公募債	0.581	100,000	103,396	2023/4/19
平成27年度第6回静岡県公募債	0.494	100,000	103,068	2025/6/30
平成22年度第1回愛知県公募債(10年)	1.417	100,000	104,611	2020/4/30
平成22年度第5回愛知県公募債(10年)	1.258	100,000	104,301	2020/6/30
平成22年度第14回愛知県公募債(20年)	2.087	100,000	122,113	2030/12/13
平成23年度第4回愛知県公募債(10年)	1.182	100,000	105,213	2021/6/28
平成23年度第8回愛知県公募債(10年)	1.087	100,000	104,967	2021/8/26
平成24年度第2回愛知県公募債(10年)	0.982	100,000	105,107	2022/4/27
平成25年度第16回愛知県公募債(10年)	0.665	100,000	104,124	2023/11/28
平成27年度第17回愛知県公募債(10年)	0.38	200,000	204,218	2026/11/27
平成20年度第1回広島県公募債(20年)	2.34	100,000	123,054	2028/9/21
平成23年度第1回広島県公募債	1.19	272,000	285,991	2021/5/27
平成24年度第2回広島県公募債	0.84	100,000	104,505	2022/7/25
平成27年度第2回広島県公募債	0.602	162,000	168,470	2025/7/27
平成19年度第7回埼玉県公募債	1.65	100,000	101,802	2018/2/24
平成20年度第5回埼玉県公募債	1.73	100,000	103,181	2018/11/27
平成21年度第2回埼玉県公募債	1.57	100,000	103,662	2019/5/27
平成22年度第4回埼玉県公募債	1.17	100,000	104,089	2020/7/28
平成23年度第9回埼玉県公募債	0.99	100,000	104,936	2022/1/27
平成24年度第2回埼玉県公募債	0.91	100,000	104,780	2022/5/18
平成20年度第6回埼玉県公募債	0.801	100,000	104,461	2022/10/26
平成27年度第8回埼玉県公募債	0.41	100,000	102,377	2026/11/28
平成19年度第1回福岡県公募債(30年)	2.62	100,000	133,805	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募債(30年)	2.28	200,000	256,302	2038/9/17
平成21年度第5回福岡県公募債	1.37	100,000	103,763	2019/10/28
平成22年度第2回福岡県公募債(15年)	1.765	100,000	114,524	2026/1/26
第6回千葉県公募債(20年)	2.26	100,000	122,848	2029/4/20
第8回千葉県公募債(20年)	2.18	100,000	122,919	2030/4/19
平成22年度第4回千葉県公募債	1.17	100,000	104,078	2020/7/24
平成22年度第8回千葉県公募債	1.0	100,000	103,819	2021/11/25
平成22年度第9回千葉県公募債	1.22	100,000	104,762	2020/12/25
平成26年度第9回千葉県公募債	0.465	100,000	102,792	2025/3/25

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
	%	千円	千円	
平成21年度第2回新潟県公募債	1.55	133,900	139,767	2019/11/27
平成27年度第3回新潟県公募債	0.12	200,000	199,544	2026/3/25
平成24年度第1回岐阜県公募債(10年)	0.82	139,630	145,924	2022/9/28
第7回共同発行市場公募債地方債	1.54	100,000	103,961	2019/8/23
第78回共同発行市場公募債地方債	1.39	100,000	103,698	2019/9/25
第79回共同発行市場公募債地方債	1.34	100,000	103,670	2019/10/25
第82回共同発行市場公募債地方債	1.42	100,000	104,238	2020/1/24
第83回共同発行市場公募債地方債	1.44	100,000	104,430	2020/2/25
第84回共同発行市場公募債地方債	1.38	100,000	104,356	2020/3/25
第85回共同発行市場公募債地方債	1.44	100,000	104,663	2020/4/24
第87回共同発行市場公募債地方債	1.29	100,000	104,396	2020/6/25
第88回共同発行市場公募債地方債	1.17	100,000	104,078	2020/7/24
第93回共同発行市場公募債地方債	1.25	100,000	104,881	2020/12/25
第95回共同発行市場公募債地方債	1.28	100,000	105,216	2021/2/25
第96回共同発行市場公募債地方債	1.29	100,000	105,357	2021/3/25
第98回共同発行市場公募債地方債	1.18	100,000	105,093	2021/5/25
第99回共同発行市場公募債地方債	1.17	100,000	105,149	2021/6/25
第100回共同発行市場公募債地方債	1.21	100,000	105,419	2021/7/23
第101回共同発行市場公募債地方債	1.05	100,000	104,794	2021/8/25
第102回共同発行市場公募債地方債	1.03	100,000	104,786	2021/9/24
第103回共同発行市場公募債地方債	1.0	177,400	185,792	2021/10/25
第105回共同発行市場公募債地方債	1.07	100,000	105,239	2021/12/24
第110回共同発行市場公募債地方債	0.89	300,000	314,073	2022/5/25
第111回共同発行市場公募債地方債	0.89	200,000	209,470	2022/6/24
第116回共同発行市場公募債地方債	0.8	100,000	104,489	2022/11/25
第117回共同発行市場公募債地方債	0.72	500,000	520,370	2022/12/22
第118回共同発行市場公募債地方債	0.84	200,000	209,714	2023/1/25
第120回共同発行市場公募債地方債	0.68	100,000	103,967	2023/3/24
第125回共同発行市場公募債地方債	0.82	200,000	210,176	2023/8/25
第133回共同発行市場公募債地方債	0.689	100,000	104,315	2024/4/25
第140回共同発行市場公募債地方債	0.505	100,000	103,032	2024/11/25
第153回共同発行市場公募債地方債	0.469	300,000	308,700	2025/12/25
平成24年度第2回熊本県公募債(10年)	0.8	100,000	104,455	2022/10/26
平成23年度第1回静岡市公募債	1.045	100,000	105,033	2021/11/25
平成21年度第3回大阪市公募債	1.48	200,000	207,358	2019/7/22
平成21年度第7回大阪市公募債	1.47	100,000	104,401	2021/1/27
第1回名古屋市長市公募債(20年)	1.99	100,000	113,234	2023/10/20
第464回名古屋市長市公募債(10年)	1.61	100,000	102,660	2018/9/20
第482回名古屋市長市公募債(10年)	0.639	100,000	103,708	2023/3/20
第495回名古屋市長市公募債(10年)	1.11	100,000	99,684	2026/3/19
第2回京都市公募債(20年)	2.12	100,000	117,028	2025/9/19
平成21年度第5回京都市公募債	1.45	100,000	104,460	2020/2/25
平成27年度第5回京都市公募債	0.205	200,000	201,144	2026/2/25
第5回横浜市公募債(20年)	2.17	100,000	117,053	2025/6/20
平成22年度第4回横浜市公募債	0.947	100,000	103,543	2020/10/28
平成23年度第1回横浜市公募債	1.189	100,000	105,129	2021/5/24
平成25年度第6回横浜市公募債	0.718	100,000	104,493	2023/12/22
第25回横浜市公募債(20年)	1.72	100,000	117,531	2032/7/16
第26回横浜市公募債(20年)	1.776	100,000	118,394	2033/1/28
平成23年度第4回札幌市公募債(10年)	1.02	100,000	104,467	2021/6/18
平成24年度第7回札幌市公募債(10年)	0.75	100,000	104,095	2022/9/20
平成19年度第5回福岡市公募債	1.49	100,000	101,746	2018/3/28
平成20年度第5回福岡市公募債	1.57	100,000	102,741	2018/10/24
平成23年度第5回広島市公募債	1.01	151,900	159,668	2022/2/25
平成27年度第2回広島市公募債	0.464	100,000	102,856	2025/12/25
平成23年度第1回千葉市公募債	1.37	100,000	105,791	2021/4/21
平成27年度第1回三重県公募債	0.464	100,000	102,856	2025/12/25
平成24年度第1回福井県公募債	0.8	100,000	104,455	2022/10/26
平成24年度第1回山梨県公募債(10年)	0.8	100,000	104,459	2022/10/28
平成27年度第1回山梨県公募債(10年)	0.495	100,000	103,074	2025/10/30
平成23年度第2回山梨県公募債(10年)	1.01	100,000	105,204	2022/3/30
小計		16,986,690	18,114,993	

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第2 0回政府保証日本高速道路債券	1.4	100,000	101,610	2018/3/16
第2 0回政府保証西日本高速道路債券	1.4	100,000	103,543	2019/7/29
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	108,923	2021/4/16
第8 8 5回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	102,266	2018/5/22
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	200,000	211,382	2023/6/27
第1 5回政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	210,000	230,745	2021/12/22
第1 7回政府保証株式会社日本政策投資銀行債	0.257	200,000	200,958	2018/11/9
第4 3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	122,002	2027/10/29
第5 6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	101,745	2018/4/20
第5 8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	102,303	2018/5/30
第6 6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	102,536	2018/9/28
第6 9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	102,972	2018/11/28
第7 5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	102,746	2019/2/27
第7 8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	103,195	2019/4/30
第8 0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	103,550	2019/5/31
第8 6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	120,655	2029/7/31
第8 9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	103,516	2019/9/30
第9 0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	244,128	2029/9/28
第9 1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	103,345	2019/10/31
第9 3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	104,004	2019/11/29
第9 5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	103,526	2019/12/27
第9 8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	207,902	2020/1/31
第9 9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	247,008	2030/1/31
第1 0 0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	104,365	2020/2/28
第1 0 1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	130,788	2040/2/29
第1 0 3回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,127	2020/3/19
第1 0 4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	104,605	2020/4/30
第1 0 7回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,383	2020/5/29
第1 0 9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	128,944	2040/5/31
第1 1 0回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,499	2020/6/30
第1 1 1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	121,243	2030/6/28
第1 2 2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	170,000	175,958	2020/11/30
第1 2 3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	127,186	2040/11/30
第1 3 3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	105,591	2021/4/30
第1 3 9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	105,014	2021/7/30

銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
第1 4 7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	104,816	2021/10/29
第1 4 9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	125,000	131,130	2021/11/30
第1 5 7回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	104,641	2022/2/28
第1 6 1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	105,193	2022/4/28
第1 6 3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	104,875	2022/5/31
第1 6 8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	104,681	2022/7/29
第1 7 5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	200,000	209,248	2022/10/31
第1 7 8回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.68	100,000	117,600	2032/11/30
第1 8 2回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	210,094	2023/1/31
第1 8 3回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	100,000	118,363	2033/1/31
第1 8 6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	209,000	217,627	2023/3/17
第1 8 9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	200,000	206,822	2023/4/28
第1 9 0回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	100,000	103,866	2023/5/31
第1 9 5回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	100,000	105,964	2023/7/31
第2 0 0回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	105,379	2023/9/29
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.6	100,000	102,918	2018/11/16
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	103,868	2019/8/16
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	100,000	102,616	2019/1/22
第5回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	103,303	2019/10/18
第6回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	103,965	2019/11/18
第1 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	104,105	2020/3/13
第1 1回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.4	100,000	104,554	2020/4/17
第1 3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	104,434	2020/6/12
第1 4回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	103,863	2020/7/17
第1 6回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	103,678	2020/9/14
第2 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	104,831	2021/1/20
第2 2回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	105,414	2021/3/12
第2 6回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	104,972	2021/7/16
第2 7回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	104,602	2021/8/13
第3 4回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	200,000	209,352	2022/3/14
第3 7回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	217,000	227,600	2022/6/17
第4 6回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	104,128	2023/3/17
第4 9回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.882	100,000	105,664	2023/6/16
第5 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.911	101,000	106,979	2023/7/14
第5 6回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.747	193,000	202,862	2024/1/19
第7 9回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	421,000	432,101	2025/12/12
第8 2回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	200,000	198,904	2026/3/13
第1 8回政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	104,138	2023/3/22
第2 1回政府保証西日本高速道路債券	1.3	100,000	104,156	2020/3/27
第6 9回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.06	300,000	296,547	2026/7/17
第1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.99	100,000	148,264	2045/9/20
第8 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	150,000	181,047	2026/3/19
第1 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	500,000	603,460	2026/9/18
第2 0 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.28	100,000	120,264	2027/4/20
第2 1 回道路債券	2.75	100,000	133,206	2033/6/20
第2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	278,846	2047/3/20
第2 7 回道路債券	2.42	100,000	116,599	2024/3/20

銘柄	当 期	末		
		利率	額面金額	評 価 額
		千円	千円	償還年月日
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	121,544	2027/10/20
第33回道路債券	2.91	100,000	137,032	2034/6/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	123,382	2028/6/20
第38回道路債券	2.26	100,000	116,147	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	123,110	2028/9/20
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	124,229	2029/5/18
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.43	100,000	104,142	2019/12/20
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	100,000	104,205	2020/6/19
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	104,047	2023/3/20
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	122,946	2029/4/27
第4回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.12	100,000	121,596	2029/12/28
第5回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	113,629	2023/9/20
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.22	200,000	245,946	2030/1/28
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	100,000	122,918	2030/4/26
第9回公営企業債券(20年)	2.33	100,000	116,701	2024/9/24
第11回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	115,901	2025/3/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	121,915	2030/12/27
第15回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	117,111	2025/9/24
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.03	300,000	363,975	2031/6/27
第17回公営企業債券(20年)	2.39	200,000	240,370	2026/3/24
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	119,225	2031/9/26
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	300,000	349,716	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	121,729	2028/4/25
第43回地方公共団体金融機構債券	0.72	100,000	104,055	2022/12/28
第16回国際協力銀行債券	2.07	100,000	105,649	2019/9/20
第19回国際協力銀行債券	1.67	100,000	105,246	2020/3/19
第34回都市再生債券	1.39	100,000	103,693	2019/9/20
第43回都市再生債券	1.29	100,000	104,692	2020/9/18
第38回関西国際空港株式会社債	1.112	100,000	105,226	2021/12/20
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	17,172	17,835	2036/5/10
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	110,485	117,348	2042/5/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	40,802	43,565	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	20,909	22,508	2037/11/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	52,731	55,352	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	17,854	18,719	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	18,695	19,963	2037/5/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	122,279	2027/6/18
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	12,349	12,632	2037/8/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	74,852	79,876	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	19,759	21,094	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	47,800	50,758	2042/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	19,507	20,838	2037/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	28,568	29,293	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	20,121	21,496	2037/5/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	15,818	16,075	2038/6/10
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	15,635	16,170	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	25,067	26,780	2040/11/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	90,525	94,425	2032/11/10
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	16,554	17,260	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	30,243	31,404	2032/11/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	35,980	37,917	2039/7/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	2.6	100,000	125,766	2028/9/20
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	32,178	34,988	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.72	18,395	19,160	2039/12/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	34,273	37,284	2044/6/10
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	1.67	100,000	103,184	2018/12/20
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	64,440	69,616	2044/7/10
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	20,682	21,667	2040/3/10
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	58,950	61,596	2040/4/10
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	1.64	100,000	103,525	2019/3/20

銘柄	当 期	末		
		利率	額面金額	評 価 額
		千円	千円	償還年月日
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	21,494	22,466	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	70,452	73,745	2040/7/10
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	24,367	25,656	2040/9/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	44,455	47,542	2045/3/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	45,961	49,068	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	21,361	22,473	2040/11/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	47,321	50,390	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	22,462	23,671	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	64,470	67,781	2041/2/10
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	102,008	107,480	2045/8/10
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	47,768	50,710	2041/3/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	23,094	24,559	2041/4/10
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	104,346	2019/12/20
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	21,255	22,756	2041/5/10
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	61,601	64,847	2045/11/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	60,639	64,354	2045/12/10
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	123,865	2030/2/18
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	180,834	193,546	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	212,204	226,722	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	21,062	22,532	2041/10/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	50,232	53,592	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	49,960	53,094	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	61,899	66,097	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	54,719	58,169	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	22,178	23,641	2042/4/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	58,877	62,203	2046/10/10
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	62,199	65,726	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	66,217	69,807	2046/12/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	64,470	68,044	2047/2/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	72,486	75,268	2047/12/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	73,899	77,582	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	67,496	70,799	2048/3/10
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	66,634	69,232	2048/4/10
第75回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	69,165	71,908	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	73,449	77,357	2048/6/10
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	1.84	100,000	118,815	2031/10/17
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	1.53	100,000	112,801	2026/9/18
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	119,141	2031/11/18
第102回一般担保住宅金融支援機構債券	1.441	100,000	112,179	2027/3/19
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	95,438	98,167	2051/1/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	194,958	193,503	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	98,455	96,688	2051/8/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	99,047	98,607	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	99,388	98,645	2051/11/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	99,861	99,604	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	100,000	100,348	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	100,000	100,123	2052/2/10
第45回中国日本高速道路株式会社債	0.904	100,000	104,728	2022/9/20
第18回西日本高速道路株式会社債	0.893	200,000	209,634	2023/3/20
第29回西日本高速道路株式会社債	0.31	100,000	100,826	2026/2/12
第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	99,573	2026/10/19
小 計		19,650,179	21,497,701	
金融債券				
い第758号商工債	0.4	100,000	100,595	2018/7/27
い第770号商工債	0.2	100,000	100,463	2019/7/26
い第771号商工債	0.2	100,000	100,479	2019/8/27
い第773号商工債	0.2	200,000	201,006	2019/10/25
い第786号商工債	0.22	100,000	100,690	2020/11/27
い第765号農林債	0.3	100,000	100,598	2019/2/27
い第766号農林債	0.3	300,000	301,860	2019/3/27

銘柄	当 期 利率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
い第769号農林債	0.3	100,000	100,691	2019/6/27
い第779号農林債	0.26	100,000	100,732	2020/4/27
第280回信中金債(5年)	0.2	100,000	100,228	2018/3/27
第288回信中金債(5年)	0.3	100,000	100,543	2018/11/27
第295回信中金債(5年)	0.25	100,000	100,582	2019/6/27
第299回信中金債(5年)	0.2	200,000	201,006	2019/10/25
第322回信中金債(5年)	0.03	100,000	99,909	2021/9/27
第182号商工債(3年)	0.14	100,000	100,157	2018/3/27
第183号商工債(3年)	0.15	200,000	200,364	2018/4/27
第187号商工債(3年)	0.16	200,000	200,492	2018/8/27
小 計		2,300,000	2,310,395	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第457回東京電力株式会社社債	2.05	100,000	103,296	2018/11/16
第539回東京電力株式会社社債	1.591	100,000	101,678	2018/3/28
第542回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	101,788	2018/4/25
第544回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	102,520	2018/6/25
第482回中部電力株式会社社債	2.17	100,000	105,021	2019/6/25
第500回中部電力株式会社社債	0.875	100,000	104,161	2024/5/24
第448回関西電力株式会社社債	2.16	100,000	102,941	2018/6/20
第463回関西電力株式会社社債	1.64	100,000	102,002	2018/4/25
第495回関西電力株式会社社債	0.746	100,000	102,399	2021/9/17
第505回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	99,580	2023/8/25
第370回中国電力株式会社社債	1.285	100,000	104,403	2020/12/25
第377回中国電力株式会社社債	1.121	100,000	105,677	2023/8/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	106,285	2026/6/25
第479回東北電力株式会社社債	0.372	200,000	201,420	2022/4/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	104,932	2023/6/23
第371回九州電力株式会社社債	1.43	100,000	106,659	2022/12/22
第431回九州電力株式会社社債	0.811	100,000	103,119	2024/12/25
第436回九州電力株式会社社債	0.39	100,000	100,619	2022/1/25
第315回北海道電力株式会社社債	0.82	100,000	101,001	2018/4/25
第316回北海道電力株式会社社債	1.164	100,000	103,398	2020/6/25
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	100,000	103,280	2023/5/9
第20回清水建設株式会社無担保社債	0.599	100,000	101,273	2020/3/6
第3回キッホホールディングス株式会社無担保社債	1.69	100,000	102,009	2018/3/19
第21回株式会社ニチレイ無担保社債	0.659	100,000	101,878	2020/9/4
第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.671	100,000	102,246	2023/3/20
第43回住友化学株式会社無担保社債	1.58	100,000	104,645	2020/4/23
第3回大日本住友製菓株式会社無担保社債	1.106	100,000	101,256	2018/3/8
第2回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.515	100,000	101,161	2019/12/4
第5回東海ゴム工業無担保社債	0.288	100,000	100,321	2018/2/28
第14回旭硝子株式会社無担保社債	1.005	100,000	104,723	2023/6/2
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	1.293	100,000	104,582	2021/3/19
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	0.64	100,000	101,048	2019/3/8
第21回FFホールディングス株式会社無担保社債	0.804	100,000	102,776	2024/3/13
第28回住友金属山株式会社無担保社債	0.77	100,000	101,154	2018/8/31
第9回株式会社LIXILグループ無担保社債	0.08	100,000	99,633	2018/8/31
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.821	100,000	103,444	2022/9/20
第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	100,000	103,706	2023/12/13
第2回日本電産株式会社無担保社債	0.595	100,000	101,437	2019/9/20
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	100,000	101,902	2022/3/18
第15回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	100,000	100,091	2021/9/17
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,170	2023/9/20
第26回ソニー株式会社無担保社債	2.068	100,000	104,635	2019/6/20
第4回株式会社旭硝子無担保社債	0.609	100,000	101,505	2020/10/30
第12回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,585	2019/11/17
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	104,010	2019/12/9
第32回三菱重工株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,727	2021/8/31

銘柄	当 期 利率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	0.82	100,000	100,759	2018/8/8
第5回J.A.三井リース株式会社無担保社債	0.05	100,000	100,043	2019/9/9
第57回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,505	2019/3/20
第10回トヨタ自動車株式会社無担保社債	1.772	100,000	104,188	2019/6/20
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.135	100,000	103,074	2020/7/29
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.221	100,000	104,286	2021/9/14
第69回三井物産株式会社無担保社債	2.139	100,000	119,258	2031/7/22
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	106,457	2022/3/16
第70回三菱商事株式会社無担保社債	1.9	100,000	102,791	2018/7/25
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	115,173	2026/10/30
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	104,228	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	105,407	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	106,091	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	106,203	2022/1/26
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.22	100,000	112,235	2022/10/27
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	1.575	100,000	103,867	2019/7/17
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	102,056	2024/9/12
第11回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.78	100,000	107,546	2022/3/15
第5回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債	0.285	100,000	100,509	2018/11/28
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	104,543	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	100,000	105,470	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	100,000	105,971	2021/6/1
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	115,416	2026/6/1
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	106,418	2020/8/7
第41回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.003	100,000	99,537	2021/9/17
第39回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	100,000	100,110	2019/12/20
第9回株式会社ジャックス無担保社債	0.79	100,000	101,411	2021/1/22
第50回日興キャピタル株式会社無担保社債	0.888	100,000	103,438	2024/3/19
第67回オリックス株式会社無担保社債	0.508	100,000	100,478	2018/3/7
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.12	100,000	99,478	2021/6/9
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,976	2022/1/26
第14回株式会社たけふ証券グループ本社無担保社債	1.252	100,000	103,533	2020/5/27
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	105,717	2020/6/24
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.853	100,000	100,877	2018/2/26
第41回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.783	100,000	101,016	2018/6/20
第40回三井不動産株式会社無担保社債	1.061	100,000	102,920	2020/6/19
第47回三井不動産株式会社無担保社債	1.954	100,000	115,860	2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	118,871	2027/9/17
第104回三菱地所株式会社無担保社債	1.095	100,000	103,974	2021/12/22
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	102,767	2024/4/26
第10回エス・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.03	100,000	102,928	2020/9/18
第13回日本ビルファンド投資法人無担保社債	1.168	100,000	104,324	2023/6/26
第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	0.497	100,000	100,764	2018/8/30
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	104,239	2022/6/7
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	1.199	100,000	104,673	2021/7/28
第21回日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.02	100,000	110,706	2022/9/20
第43回日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.86	100,000	106,963	2020/12/18

銘柄	当 期		末		償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	評 価 額	
	%	千円	千円		
第4回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.26	100,000	120,223		2027/4/16
第5回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.62	100,000	102,016		2018/4/20
第6回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.249	100,000	123,736		2030/3/22
第8回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.874	100,000	104,171		2022/7/22
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	2.41	100,000	104,657		2018/12/25
第1回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.21	100,000	114,496		2024/3/20
第4回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	94,859		2056/12/13
第5回東南海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	100,000	123,341		2030/4/23
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	121,231		2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	100,000	122,867		2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	116,624		2032/5/25
第4回大阪阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.819	100,000	103,751		2023/10/25
第4回株式会社日立物流無担保社債	0.33	100,000	99,155		2026/9/28
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	1.238	100,000	103,865		2020/9/10
第18回KDD I株式会社無担保社債	1.573	100,000	104,079		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	102,759		2018/6/20
第9回沖縄電力株式会社社債	0.88	100,000	101,024		2018/3/20
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	113,960		2025/6/20
第33回電源開発株式会社無担保社債	1.422	100,000	105,104		2021/2/19
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	104,772		2023/12/20
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	1.238	100,000	104,669		2021/9/3
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	101,927		2018/3/20
第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.16	100,000	99,326		2021/10/14
第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ円貨社債	0.593	100,000	100,566		2019/1/24
第5回ノルデアバンク・アクツイエボラーク・プブリクト円貨社債	0.73	100,000	100,635		2018/6/5

銘柄	当 期		末		償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	評 価 額	
	%	千円	千円		
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.55	100,000	100,510		2019/7/10
第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.437	100,000	99,909		2020/12/11
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	100,093		2024/1/26
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.15	100,000	99,026		2021/7/9
第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンクエンA B円貨社債	0.325	100,000	100,081		2019/9/4
第9回クレディ・スイス・エイ・ジー円貨社債	0.285	100,000	99,511		2018/12/18
第1回H S B C・ホールディングス・ビーエルシー円貨社債	0.45	100,000	99,649		2021/9/24
第6回ビー・エヌ・ビー・パリ円貨社債	0.439	100,000	100,303		2019/9/17
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	0.457	200,000	201,106		2019/1/17
第11回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,326		2021/1/22
第3回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社債	0.289	100,000	99,934		2020/10/29
第21回ラボバンク・ネーデルランド円貨社債	0.708	200,000	201,130		2018/5/24
小 計		13,300,000	13,847,541		
合 計		290,313,869	316,601,987		

<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	751	—	

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
	千円	%	
公 社 債	316,601,987	99.1	
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,967,074	0.9	
投 資 信 託 財 産 総 額	319,569,061	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 2017年1月23日現在
(A) 資 産	319,673,954,828円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,121,119,634
公 社 債(評価額)	316,601,987,732
未 収 入 金	1,097,812,680
未 収 利 息	736,795,141
前 払 費 用	10,955,641
差 入 委 託 証 拠 金	105,284,000
(B) 負 債	928,312,972
未 払 金	601,987,000
未 払 解 約 金	221,339,302
未 払 利 息	2,616
差入委託証拠金代用有価証券	104,984,000
そ の 他 未 払 費 用	54
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	318,745,641,856
元 本	236,558,846,378
次 期 繰 越 損 益 金	82,186,795,478
(D) 受 益 権 総 口 数	236,558,846,378口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,474円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2016年1月23日 至 2017年1月23日
(A) 配 当 等 収 益	3,322,509,983円
受 取 利 息	3,323,688,504
支 払 利 息	△1,178,521
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,781,709,529
売 買 益	5,449,250,013
売 買 損	△1,667,540,484
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	32,987,676
取 引 益	70,534,376
取 引 損	△37,546,700
(D) そ の 他 費 用	△148,287
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	7,137,058,901
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	75,939,645,182
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	12,628,007,055
(H) 解 約 差 損 益 金	△13,517,915,660
(I) 計 (E+F+G+H)	82,186,795,478
次 期 繰 越 損 益 金(I)	82,186,795,478

(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まず。

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は239,575,703,877円、期中追加設定元本額は34,450,057,502円、期中一部解約元本額は37,466,915,001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 105,297,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

私募日本債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	45,200,378,031円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	37,321,627,106円
DC日本債券インデックスファンドL	33,604,535,593円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	16,804,604,882円
インデックスコレクション (バランス株式30)	13,636,926,020円
インデックスコレクション (国内債券)	13,265,335,978円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	10,251,201,641円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	6,309,358,426円
DCバランスファンド30	6,180,517,204円
日本債券パッシブファンド私募A (適格機関投資家専用)	5,305,450,762円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	5,069,513,973円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	4,498,217,489円

DCバランスファンド50	4,154,576,334円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	4,071,989,152円
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	4,063,816,521円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	3,529,357,003円
DC日本債券インデックスファンド	2,907,663,141円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	2,278,277,566円
VAバランスファンド(株60/100) (適格機関投資家専用)	2,175,886,270円
インデックスコレクション(バランス株式50)	1,788,921,875円
日本債券インデックスe	1,692,830,260円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	1,530,449,879円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	1,273,543,962円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	1,135,508,408円
日本債券インデックスファンド	1,115,877,566円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	1,079,294,111円
DCバランスファンド70	964,160,118円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	863,646,472円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	721,381,801円
インデックスコレクション(バランス株式70)	688,249,631円
VAバランスファンド2(株40/100) (適格機関投資家専用)	529,156,439円
VAバランスファンド(株50/100) (適格機関投資家専用)	452,029,968円
バランスVA20L (適格機関投資家専用)	337,947,535円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	324,424,204円
VAバランスファンド(株25/100) (適格機関投資家専用)	319,307,207円
日本債券インデックスファンド(SMA専用)	251,279,060円
バランスVA20 (適格機関投資家専用)	241,388,848円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	225,232,806円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	180,949,879円
VAバランス株式40 (適格機関投資家専用)	151,219,528円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	53,816,254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)	5,671,552円
世界バランスVA20 (適格機関投資家専用)	3,325,923円

お知らせ

該当事項はありません。