

## 当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/債券/インデックス型	
信託期間	信託期間は2010年4月6日から無期限です。	
運用方針	長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	日本債券インデックスe	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	日本債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	日本債券インデックスe	外貨建資産への投資は行いません。 株式への投資は転換社債を転換したものと 新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り ます。以下同じ。)を行使したものに限り ます。以下同じ。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 および新株予約権を行使したものに限り ます。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8期(決算日 2018年1月22日)

## 受益者のみなさまへ

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

### お問い合わせ先

フリーダイヤル: 0120-668001

(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

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	債券先比率	債券物率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	騰落率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
第4期(2014年1月22日)	10,676	0	1.6	351.482	2.0	99.2	0.2	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	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	0.5	2,639
第7期(2017年1月22日)	11,362	0	1.9	378.843	2.3	99.3	0.2	0.2	2,280
第8期(2018年1月22日)	11,343	0	△0.2	379.795	0.3	99.4	0.2	0.2	2,083

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2017年 1月23日	11,362	—	378.843	—	99.3	0.2
1月末	11,330	△0.3	377.739	△0.3	99.4	0.2
2月末	11,361	△0.0	378.896	0.0	99.4	0.2
3月末	11,342	△0.2	378.492	△0.1	99.4	0.3
4月末	11,394	0.3	380.333	0.4	99.4	0.2
5月末	11,367	0.0	379.549	0.2	99.3	0.2
6月末	11,331	△0.3	378.570	△0.1	99.2	0.4
7月末	11,330	△0.3	378.545	△0.1	99.2	0.3
8月末	11,385	0.2	380.579	0.5	99.3	0.2
9月末	11,341	△0.2	379.266	0.1	99.4	0.3
10月末	11,337	△0.2	379.268	0.1	99.4	0.2
11月末	11,363	0.0	380.257	0.4	99.2	0.3
12月末	11,366	0.0	380.513	0.4	99.3	0.4
(当期末)						
2018年 1月22日	11,343	△0.2	379.795	0.3	99.4	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。

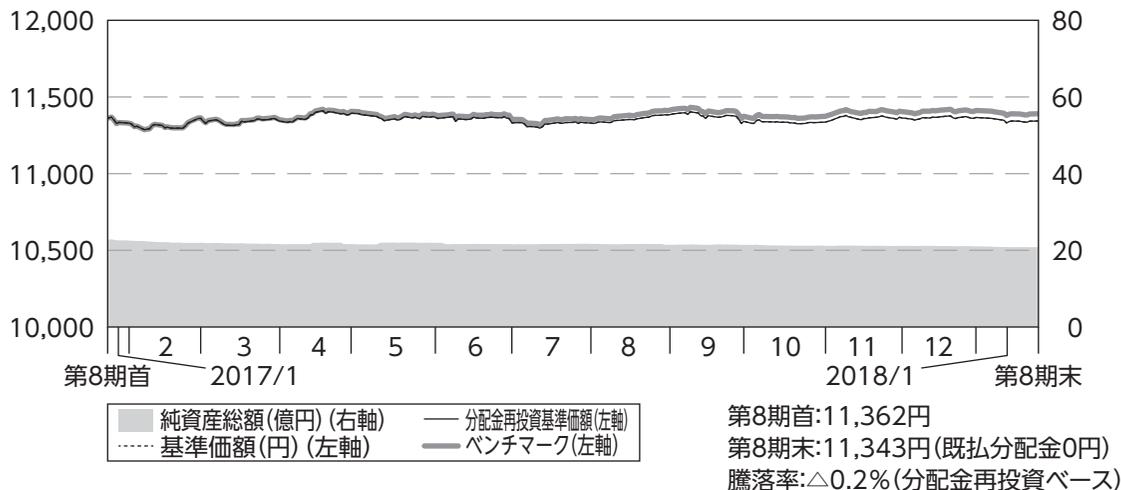
(注2) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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。

## 基準価額等の推移

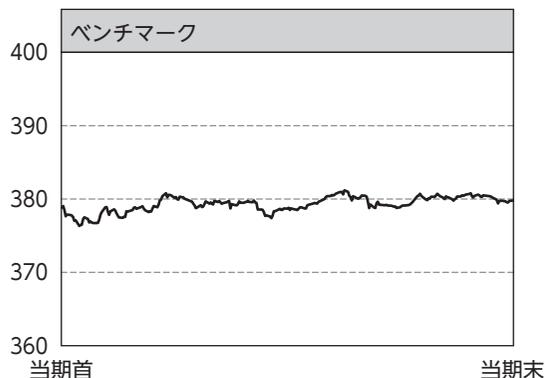


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2017年1月23日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 基準価額の主な変動要因

期初より、フランス大統領選挙に対する不透明感や北朝鮮情勢の緊迫化による地政学リスクの高まりを背景に金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移し、基準価額は上昇しましたが、2017年4月中旬以降は、フランス大統領選挙の結果を受けた欧州の政治的不透明感の後退や北朝鮮情勢の一服を受けて金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。7月上旬以降は、日銀の指し値オペ実施や北朝鮮情勢の緊迫化を受けて金利は低下し、基準価額は上昇しましたが、9月上旬以降は、衆議院解散を巡る財政悪化懸念やトランプ米政権の税制改革への期待の高まりを受けて米長期金利が上昇した影響から金利は上昇し、基準価額は下落しました。10月下旬以降期末にかけては、国債入札の結果などを受けて需給の引き締まりが意識されたことが金利低下要因となったものの、米税制改革法案の成立を背景に米長期金利が上昇基調で推移した影響や、日銀による超長期国債の買入れ減額を受けて金融緩和縮小が意識されたことが金利上昇要因となり、基準価額はもみ合い推移となりました。

## 投資環境



期初より、フランス大統領選挙に対する不透明感や北朝鮮情勢の緊迫化を背景に金利は低下基調で推移しましたが、2017年4月中旬以降は、欧州の政治的不透明感の後退や北朝鮮情勢の一服を受けて金利は上昇しました。7月上旬以降は、日銀の指し値オペ実施や北朝鮮情勢の緊迫化を受けて金利は低下しましたが、9月上旬以降は、トランプ米政権の税制改革への期待の高まりを受けて米長期金利が上昇した影響から金利は上昇しました。10月下旬以降期末にかけては、国債需給の引き締まりが意識された一方、米長期金利上昇の影響や日銀による超長期国債の買い入れ減額を受けて金融緩和縮小が意識され、金利はもみ合いで推移しました。

## 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」の運用経過】

#### (1) 債券組入比率

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

#### (2) ポートフォリオ構成

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

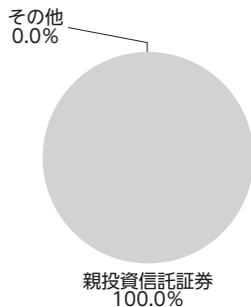
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

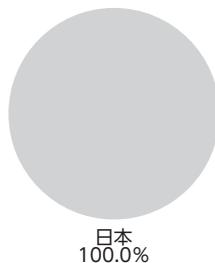
	当期末
	2018年1月22日
日本債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

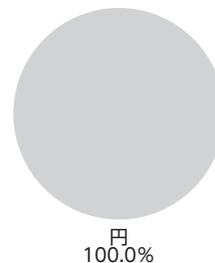
### ○資産別配分



### ○国別配分



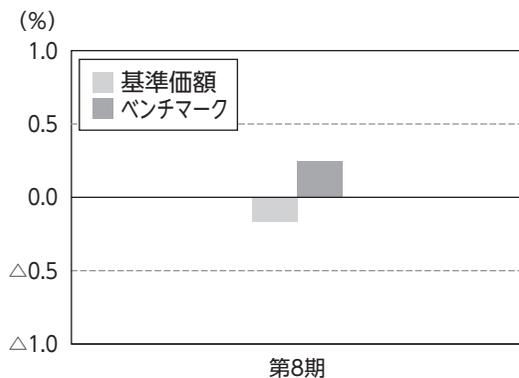
### ○通貨別配分



(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8期	
	2017年1月24日～2018年1月22日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	1,343	

(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
	(2017年1月24日～2018年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	45円	0.399%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{期中の平均基準価額}}{\text{期中の平均基準価額}} \times \text{信託報酬率}$ 期中の平均基準価額は11,353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。
(投信会社)	(17)	(0.151)	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
(販売会社)	(23)	(0.205)	
(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 = $\frac{\text{期中の売買委託手数料}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$
(株式)	(-)	(-)	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
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{期中の有価証券取引税}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$
(株式)	(-)	(-)	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
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用 = $\frac{\text{期中のその他費用}}{\text{期中の平均受益権口数}} \times 10,000$
(保管費用)	(-)	(-)	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
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	46	0.404	

(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 395,020	千円 533,054	千口 546,201	千円 735,905

## 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 3	百万円 3	% 100.0	百万円 3	百万円 3	% 100.0
コール・ローン	1,686	418	24.8	1,688	418	24.8

(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 1,451	百万円 1,451	% 100.0	百万円 1,451	百万円 1,451	% 100.0
コール・ローン	386,259	95,695	24.8	386,002	95,545	24.8

<平均保有割合 0.7%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 1,692,830	千口 1,541,649	千円 2,082,769

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、231,135,066千口です。

※ 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 2,082,769	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,859	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	2,096,628	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 2018年1月22日現在
(A) 資 産	2,096,628,596円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,764,829
日本債券マザーファンド(評価額)	2,082,769,131
未 収 入 金	8,094,636
(B) 負 債	12,817,732
未 払 解 約 金	8,492,045
未 払 信 託 報 酬	4,268,064
未 払 利 息	9
そ の 他 未 払 費 用	57,614
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,083,810,864
元 本	1,837,086,770
次 期 繰 越 損 益 金	246,724,094
(D) 受 益 権 総 口 数	1,837,086,770口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,343円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2017年1月24日 至 2018年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	△3,549円
受 取 利 息	7
支 払 利 息	△3,556
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	5,686,357
売 買 益	9,403,848
売 買 損	△3,717,491
(C) 信 託 報 酬 等	△8,716,225
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△3,033,417
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	36,001,794
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	213,755,717
(配 当 等 相 当 額)	(102,754,642)
(売 買 損 益 相 当 額)	(111,001,075)
(G) 計 (D+E+F)	246,724,094
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	246,724,094
追 加 信 託 差 損 益 金	213,755,717
(配 当 等 相 当 額)	(103,257,534)
(売 買 損 益 相 当 額)	(110,498,183)
分 配 準 備 積 立 金	47,417,658
繰 越 損 益 金	△14,449,281

(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2,007,458,281円、期中追加設定元本額は776,343,442円、期中一部解約元本額は946,714,953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)	11,415,864円
(B) 有価証券売買等損益額 (費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	199,306,436円
(D) 分配準備積立金額	36,001,794円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	246,724,094円
(F) 期末残存口数	1,837,086,770口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	1,343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17期（決算日 2018年1月22日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
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
第17期(2018年1月22日)	13,510	0.3	379.795	0.3	99.4	0.2	312,259

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2017年 1月23日	13,474	—	378.843	—	99.3	0.2
1月末	13,437	△0.3	377.739	△0.3	99.4	0.2
2月末	13,478	0.0	378.896	0.0	99.4	0.2
3月末	13,461	△0.1	378.492	△0.1	99.4	0.3
4月末	13,527	0.4	380.333	0.4	99.4	0.2
5月末	13,501	0.2	379.549	0.2	99.3	0.2
6月末	13,463	△0.1	378.570	△0.1	99.2	0.4
7月末	13,466	△0.1	378.545	△0.1	99.3	0.3
8月末	13,537	0.5	380.579	0.5	99.3	0.2
9月末	13,489	0.1	379.266	0.1	99.4	0.3
10月末	13,490	0.1	379.268	0.1	99.5	0.2
11月末	13,525	0.4	380.257	0.4	99.3	0.3
12月末	13,534	0.4	380.513	0.4	99.4	0.4
(当期末) 2018年 1月22日	13,510	0.3	379.795	0.3	99.4	0.2

(注1)騰落率は期首比です。

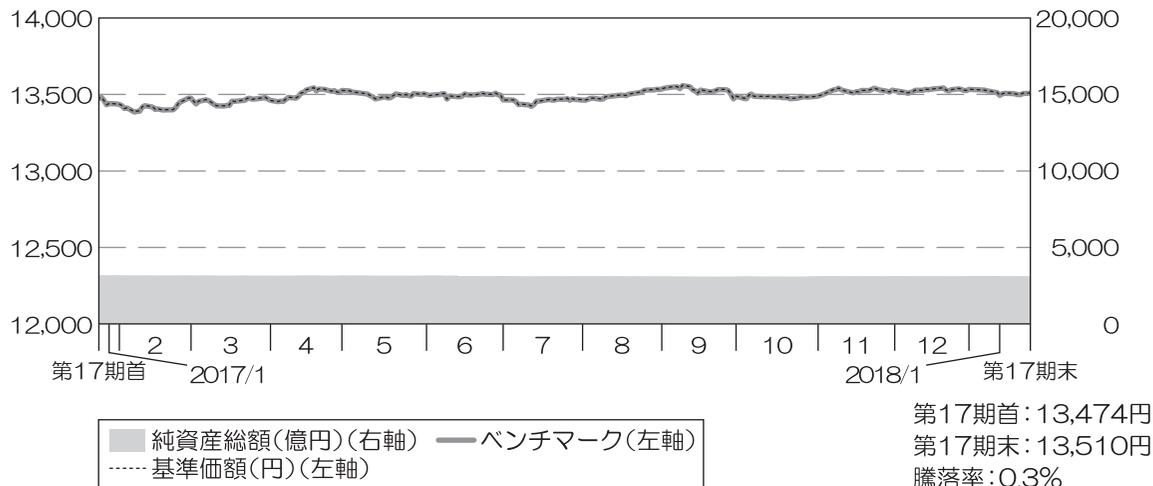
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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

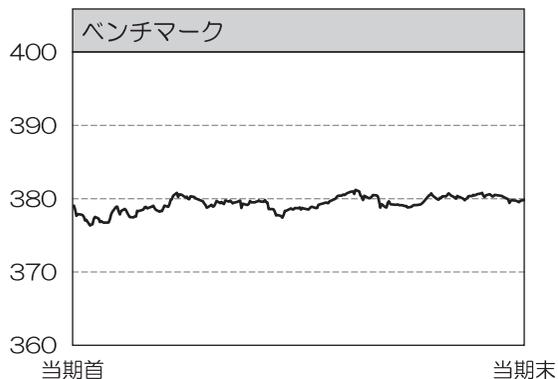


(注)ベンチマークは、2017年1月23日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

## 基準価額の主な変動要因

期初より、フランス大統領選挙に対する不透明感や北朝鮮情勢の緊迫化による地政学リスクの高まりを背景に金利は低下(債券価格は上昇)基調で推移し、基準価額は上昇しましたが、2017年4月中旬以降は、フランス大統領選挙の結果を受けた欧州の政治的不透明感の後退や北朝鮮情勢の一服を受けて金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。7月上旬以降は、日銀の指し値オペ実施や北朝鮮情勢の緊迫化を受けて金利は低下し、基準価額は上昇しましたが、9月上旬以降は、衆議院解散を巡る財政悪化懸念やトランプ米政権の税制改革への期待の高まりを受けて米長期金利が上昇した影響から金利は上昇し、基準価額は下落しました。10月下旬以降期末にかけては、国債入札の結果などを受けて需給の引き締まりが意識されたことが金利低下要因となったものの、米税制改革法案の成立を背景に米長期金利が上昇基調で推移した影響や、日銀による超長期国債の買い入れ減額を受けて金融緩和縮小が意識されたことが金利上昇要因となり、基準価額はもみ合い推移となりました。

## 投資環境



期初より、フランス大統領選挙に対する不透明感や北朝鮮情勢の緊迫化を背景に金利は低下基調で推移しましたが、2017年4月中旬以降は、欧州の政治的不透明感の後退や北朝鮮情勢の一服を受けて金利は上昇しました。7月上旬以降は、日銀の指し値オペ実施や北朝鮮情勢の緊迫化を受けて金利は低下しましたが、9月上旬以降は、トランプ米政権の税制改革への期待の高まりを受けて米長期金利が上昇した影響から金利は上昇しました。10月下旬以降期末にかけては、国債需給の引き締まりが意識された一方、米長期金利上昇の影響や日銀による超長期国債の買い入れ減額を受けて金融緩和縮小が意識され、金利はもみ合いで推移しました。

## 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

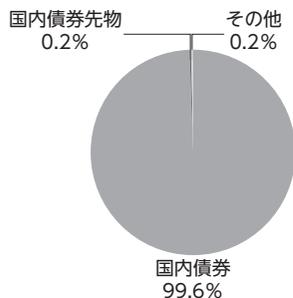
## ○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	第127回利付国債(5年)	日本	1.2%
2	第339回利付国債(10年)	日本	1.0%
3	第347回利付国債(10年)	日本	1.0%
4	第348回利付国債(10年)	日本	0.9%
5	第129回利付国債(5年)	日本	0.9%
6	第126回利付国債(5年)	日本	0.9%

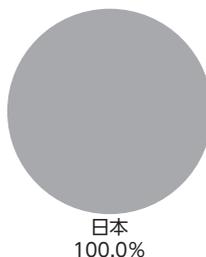
順位	銘柄名	国	組入比率
7	第117回利付国債(5年)	日本	0.9%
8	第122回利付国債(5年)	日本	0.9%
9	第333回利付国債(10年)	日本	0.9%
10	第334回利付国債(10年)	日本	0.9%
組入銘柄数			737

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

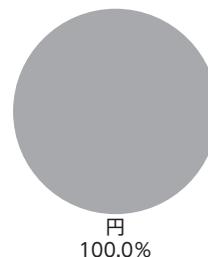
## ○資産別配分



## ○国別配分



## ○通貨別配分

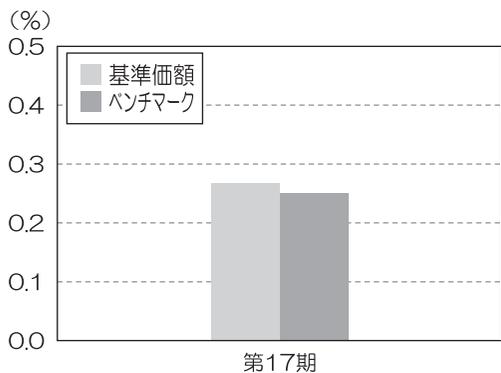


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(注2)国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.2%買建てております。

## 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
	(2017年1月24日～2018年1月22日)		
	金額	比率	
<b>(a) 売買委託手数料</b>	<b>0円</b>	<b>0.000%</b>	(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>(b) 有価証券取引税</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	(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)	(-)	(-)	
<b>(c) その他費用</b>	<b>0</b>	<b>0.000</b>	(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)	
<b>合計</b>	<b>0</b>	<b>0.000</b>	

(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(13,492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 56,744,434	千円 58,566,971
	地 方 債 証 券	911,682	1,231,489
	特 殊 債 券	1,200,753	2,021,832 (506,897)
	社 債 券	2,698,845	3,141,150

(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 20,172	百万円 20,320	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 1,451	百万円 1,451	100.0	百万円 1,451	百万円 1,451	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	386,259	95,695	24.8	386,002	95,545	24.8

(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	236,947,000 (4,340,000)	257,211,966 (4,355,457)	82.4 (1.4)	— (—)	53.4 (—)	18.6 (—)	10.3 (1.4)	
地 方 債 証 券	16,686,690 (16,286,690)	17,633,000 (17,184,051)	5.6 (5.5)	— (—)	2.8 (2.7)	2.6 (2.6)	0.2 (0.2)	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	18,543,282 (18,343,282)	20,168,517 (19,926,903)	6.5 (6.4)	— (—)	4.6 (4.5)	1.4 (1.4)	0.5 (0.5)	
金 融 債 券	2,100,000 (2,100,000)	2,103,574 (2,103,574)	0.7 (0.7)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.4 (0.4)	
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	12,900,000 (12,800,000)	13,328,240 (13,222,976)	4.3 (4.2)	— (—)	1.6 (1.6)	2.1 (2.1)	0.6 (0.6)	
合 計	287,176,972 (53,869,972)	310,445,297 (56,792,961)	99.4 (18.2)	— (—)	62.4 (8.9)	25.0 (6.3)	12.0 (3.0)	

(注1) ( )内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

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

## (B) 個別銘柄開示

銘 柄	当 期 末				償還年月日	銘 柄	当 期 末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額				利率	額面金額	評 価 額		
	%	千円	千円			%	千円	千円			
国債証券											
第373回利付国債(2年)	0.1	1,580,000	1,584,013	2019/2/15	第131回利付国債(5年)	0.1	1,910,000	1,924,707	2022/3/20		
第374回利付国債(2年)	0.1	180,000	180,491	2019/3/15	第132回利付国債(5年)	0.1	1,825,000	1,840,311	2022/6/20		
第375回利付国債(2年)	0.1	1,130,000	1,133,310	2019/4/15	第133回利付国債(5年)	0.1	2,540,000	2,562,555	2022/9/20		
第376回利付国債(2年)	0.1	590,000	591,846	2019/5/15	第134回利付国債(5年)	0.1	1,090,000	1,099,929	2022/12/20		
第377回利付国債(2年)	0.1	810,000	812,705	2019/6/15	第1回利付国債(40年)	2.4	230,000	326,935	2048/3/20		
第378回利付国債(2年)	0.1	1,660,000	1,665,859	2019/7/15	第2回利付国債(40年)	2.2	350,000	480,574	2049/3/20		
第379回利付国債(2年)	0.1	2,315,000	2,323,658	2019/8/15	第3回利付国債(40年)	2.2	410,000	564,729	2050/3/20		
第380回利付国債(2年)	0.1	760,000	762,994	2019/9/15	第4回利付国債(40年)	2.2	595,000	821,873	2051/3/20		
第381回利付国債(2年)	0.1	1,100,000	1,104,554	2019/10/15	第5回利付国債(40年)	2.0	630,000	836,142	2052/3/20		
第382回利付国債(2年)	0.1	1,290,000	1,295,611	2019/11/15	第6回利付国債(40年)	1.9	670,000	871,000	2053/3/20		
第384回利付国債(2年)	0.1	255,000	256,211	2020/1/15	第7回利付国債(40年)	1.7	570,000	706,908	2054/3/20		
第117回利付国債(5年)	0.2	2,830,000	2,840,754	2019/3/20	第8回利付国債(40年)	1.4	920,000	1,053,933	2055/3/20		
第118回利付国債(5年)	0.2	1,550,000	1,557,068	2019/6/20	第9回利付国債(40年)	0.4	830,000	683,040	2056/3/20		
第119回利付国債(5年)	0.1	660,000	662,085	2019/6/20	第10回利付国債(40年)	0.9	695,000	680,224	2057/3/20		
第120回利付国債(5年)	0.2	1,590,000	1,598,554	2019/9/20	第299回利付国債(10年)	1.3	1,140,000	1,158,775	2019/3/20		
第121回利付国債(5年)	0.1	650,000	652,424	2019/9/20	第300回利付国債(10年)	1.5	550,000	560,329	2019/3/20		
第122回利付国債(5年)	0.1	2,770,000	2,781,357	2019/12/20	第301回利付国債(10年)	1.5	1,500,000	1,534,245	2019/6/20		
第123回利付国債(5年)	0.1	2,320,000	2,330,741	2020/3/20	第302回利付国債(10年)	1.4	870,000	888,635	2019/6/20		
第124回利付国債(5年)	0.1	2,630,000	2,642,965	2020/6/20	第303回利付国債(10年)	1.4	1,640,000	1,681,328	2019/9/20		
第125回利付国債(5年)	0.1	2,200,000	2,211,704	2020/9/20	第304回利付国債(10年)	1.3	1,260,000	1,289,660	2019/9/20		
第126回利付国債(5年)	0.1	2,870,000	2,886,703	2020/12/20	第305回利付国債(10年)	1.3	2,040,000	2,095,080	2019/12/20		
第127回利付国債(5年)	0.1	3,820,000	3,843,531	2021/3/20	第306回利付国債(10年)	1.4	1,370,000	1,414,744	2020/3/20		
第128回利付国債(5年)	0.1	2,490,000	2,506,135	2021/6/20	第307回利付国債(10年)	1.3	880,000	906,840	2020/3/20		
第129回利付国債(5年)	0.1	2,870,000	2,889,458	2021/9/20	第308回利付国債(10年)	1.3	970,000	1,002,941	2020/6/20		
第130回利付国債(5年)	0.1	1,880,000	1,893,611	2021/12/20	第309回利付国債(10年)	1.1	960,000	987,984	2020/6/20		

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第310回利付国債(10年)	1.0	1,400,000	1,441,174	2020/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	670,000	686,140	2020/9/20
第312回利付国債(10年)	1.2	2,037,000	2,114,426	2020/12/20
第313回利付国債(10年)	1.3	910,000	950,258	2021/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	250,000	259,480	2021/3/20
第315回利付国債(10年)	1.2	1,020,000	1,065,267	2021/6/20
第316回利付国債(10年)	1.1	360,000	374,749	2021/6/20
第317回利付国債(10年)	1.1	280,000	292,269	2021/9/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,050,000	1,092,157	2021/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	560,000	586,107	2021/12/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,270,000	1,324,229	2021/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,340,000	1,400,849	2022/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	990,000	1,030,827	2022/3/20
第323回利付国債(10年)	0.9	690,000	720,028	2022/6/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,000,000	1,039,110	2022/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,205,000	2,295,118	2022/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	560,000	581,504	2022/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	1,180,000	1,231,117	2022/12/20
第328回利付国債(10年)	0.6	1,680,000	1,738,632	2023/3/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,245,000	2,350,919	2023/6/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,820,000	1,908,797	2023/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	970,000	1,006,316	2023/9/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,530,000	2,628,138	2023/12/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,660,000	2,766,666	2024/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	2,660,000	2,769,272	2024/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,625,000	2,718,660	2024/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	370,000	383,431	2024/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	2,390,000	2,443,703	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	2,170,000	2,234,449	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	3,095,000	3,187,819	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	2,570,000	2,647,665	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,440,000	2,496,852	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	1,930,000	1,943,336	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	2,605,000	2,621,359	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	2,160,000	2,172,096	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	2,680,000	2,693,051	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	2,685,000	2,695,981	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	3,125,000	3,138,125	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	2,930,000	2,941,221	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	720,000	721,764	2027/12/20
第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	65,252	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	126,533	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	140,000	175,977	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	254,607	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	226,405	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	270,000	348,019	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	190,000	243,504	2032/5/20
第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	208,098	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	189,160	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	280,000	336,473	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	370,000	467,483	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	350,000	437,332	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	459,679	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	500,000	665,720	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	250,000	333,537	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	420,000	554,757	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	540,000	704,667	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	300,000	392,100	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	290,000	389,461	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	360,000	471,520	2035/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第22回利付国債(30年)	2.5	380,000	511,575	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	370,000	498,908	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	-2.5	335,000	452,410	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	335,000	441,050	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	610,000	814,691	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	-2.5	490,000	664,783	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	900,000	1,223,910	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	620,000	835,065	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	645,000	858,856	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	600,000	789,270	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	695,000	931,466	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,050,000	1,344,514	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	940,000	1,246,985	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	1,050,000	1,350,310	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,100,000	1,417,372	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	1,825,000	1,756,609	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	385,000	1,028,973	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	620,000	660,992	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	530,000	786,706	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	655,000	803,030	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	705,000	864,654	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	705,000	864,992	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	760,000	932,816	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	600,000	707,868	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	910,000	1,073,636	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	920,000	1,109,096	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	760,000	878,172	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	840,000	970,460	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	895,000	898,087	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	895,000	783,268	2046/6/20
第52回利付国債(30年)	0.5	950,000	878,436	2046/9/20
第53回利付国債(30年)	0.6	450,000	426,865	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	775,000	774,077	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,015,000	1,012,584	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	690,000	687,522	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	335,000	333,388	2047/12/20
第58回利付国債(20年)	1.5	520,000	529,796	2019/3/20
第42回利付国債(20年)	2.6	380,000	391,977	2019/3/20
第43回利付国債(20年)	2.9	340,000	357,054	2019/9/20
第44回利付国債(20年)	2.5	370,000	390,856	2020/3/20
第45回利付国債(20年)	2.4	270,000	284,639	2020/3/20
第46回利付国債(20年)	2.2	290,000	306,211	2020/6/22
第47回利付国債(20年)	2.2	470,000	499,003	2020/9/21
第48回利付国債(20年)	-2.5	230,000	247,539	2020/12/21
第49回利付国債(20年)	2.1	280,000	299,597	2021/3/22
第50回利付国債(20年)	1.9	590,000	627,553	2021/3/22
第51回利付国債(20年)	-2.0	240,000	257,220	2021/6/21
第52回利付国債(20年)	2.1	430,000	464,640	2021/9/21
第53回利付国債(20年)	2.1	350,000	380,030	2021/12/20
第54回利付国債(20年)	-2.2	280,000	305,118	2021/12/20
第55回利付国債(20年)	2.0	490,000	532,693	2022/3/21
第56回利付国債(20年)	2.0	410,000	447,777	2022/6/20
第57回利付国債(20年)	1.9	360,000	391,579	2022/6/20
第58回利付国債(20年)	1.9	250,000	273,190	2022/9/20
第59回利付国債(20年)	1.7	440,000	478,676	2022/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	570,000	611,684	2022/12/20
第61回利付国債(20年)	1.0	390,000	411,781	2023/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	250,000	261,865	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	570,000	627,974	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	410,000	455,723	2023/9/20

銘柄	当期		期末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
第65回利付国債(20年)	1.9	370,000	412,846	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	366,257	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	310,000	347,293	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	230,000	261,926	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	530,000	600,299	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	490,000	566,743	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	400,000	457,512	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	710,000	810,841	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	540,000	615,621	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	310,000	355,557	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	360,000	414,352	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	340,000	386,467	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	331,710	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	20,000	22,821	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	100,000	114,847	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	250,000	288,970	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	180,000	207,477	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	485,000	562,745	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	270,000	314,566	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	190,000	219,860	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	360,000	421,102	2026/3/20
第86回利付国債(20年)	2.3	240,000	284,642	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	170,000	200,237	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	340,000	404,858	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	320,000	378,358	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	620,000	735,822	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	510,000	609,669	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	790,000	933,969	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	260,000	306,181	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	545,000	646,767	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	400,000	484,000	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	300,000	357,387	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	510,000	614,764	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	370,000	442,453	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	660,000	791,775	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	860,000	1,043,575	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	360,000	444,092	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	370,000	458,085	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	335,000	411,299	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	260,000	313,859	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	500,000	605,420	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	270,000	329,775	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	270,000	327,890	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	725,000	864,830	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	290,000	346,799	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	465,000	566,304	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	470,000	579,312	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	810,000	989,293	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	805,000	985,931	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	730,000	896,476	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	270,000	334,732	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	400,000	496,960	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	580,000	713,684	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	500,000	610,770	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	390,000	466,931	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	420,000	492,651	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	750,000	909,045	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	450,000	539,860	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	720,000	892,641	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	370,000	454,064	2030/12/20

銘柄	当期		期末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
第125回利付国債(20年)	2.2	350,000	439,411	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	430,000	528,835	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	400,000	486,820	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	690,000	840,909	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	350,000	421,991	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	780,000	941,499	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	360,000	429,775	2031/9/20
第132回利付国債(20年)	1.7	600,000	717,384	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	640,000	773,811	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	260,000	314,862	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	495,000	592,282	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	450,000	532,300	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	530,000	635,067	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	510,000	596,552	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	330,000	399,845	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	1,225,000	1,469,865	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	990,000	1,188,574	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	350,000	425,201	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,220,000	1,447,737	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.7	1,160,000	1,393,960	2033/6/20
第145回利付国債(20年)	1.7	1,220,000	1,467,696	2033/9/20
第146回利付国債(20年)	1.6	1,010,000	1,200,193	2033/12/20
第147回利付国債(20年)	1.5	1,410,000	1,654,071	2034/3/20
第148回利付国債(20年)	1.5	1,140,000	1,338,166	2034/6/20
第149回利付国債(20年)	1.6	1,420,000	1,644,289	2034/9/20
第150回利付国債(20年)	1.2	1,240,000	1,394,851	2034/12/20
第151回利付国債(20年)	1.2	1,180,000	1,326,178	2035/3/20
第152回利付国債(20年)	1.3	1,330,000	1,516,106	2035/6/20
第153回利付国債(20年)	1.2	1,420,000	1,594,177	2035/9/20
第154回利付国債(20年)	1.0	1,410,000	1,534,672	2035/12/20
第155回利付国債(20年)	0.4	1,410,000	1,386,523	2036/3/20
第156回利付国債(20年)	0.2	1,560,000	1,474,917	2036/6/20
第157回利付国債(20年)	0.5	910,000	906,132	2036/9/20
第158回利付国債(20年)	0.6	1,410,000	1,425,721	2036/12/20
第159回利付国債(20年)	0.7	1,510,000	1,550,573	2037/3/20
第160回利付国債(20年)	0.6	915,000	920,599	2037/6/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,330,000	1,335,865	2037/9/20
第162回利付国債(20年)	0.6	455,000	455,809	2037/12/20
小計		236,947,000	257,211,966	
<b>地方債証券</b>				
第1回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	0.982	100,000	101,456	2047/9/20
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	113,349	2024/3/19
第7回東京都公募公債(30年)	2.51	200,000	264,840	2038/9/17
第11回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000	236,420	2027/3/19
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	119,224	2028/12/20
第18回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000	241,834	2029/3/19
第20回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	120,998	2029/9/20
第21回東京都公募公債(20年)	2.19	100,000	121,523	2029/12/20
第696回東京都公募公債	1.19	100,000	103,943	2021/6/18
第703回東京都公募公債	0.99	100,000	103,728	2021/12/20
第714回東京都公募公債	0.74	100,000	103,404	2022/12/20
第722回東京都公募公債	0.8	200,000	208,032	2023/6/20
第740回東京都公募公債	0.463	100,000	102,455	2024/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,838	2025/12/19
平成22年度第1回北海道公募公債	1.47	100,000	103,263	2020/4/30
平成22年度第8回北海道公募公債	0.96	100,000	102,557	2020/10/29
平成23年度第4回北海道公募公債	1.21	100,000	103,996	2021/6/30
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	300,000	301,077	2026/2/26
第16回神奈川県公募公債(20年)	2.09	100,000	121,271	2031/1/24

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
第21回神奈川県公債(20年)	1.732	100,000	117,622	2032/9/17	
第168回神奈川県公債	1.36	100,000	102,538	2019/12/20	
第173回神奈川県公債	1.3	100,000	103,052	2020/6/19	
第174回神奈川県公債	1.17	100,000	102,740	2020/6/19	
第175回神奈川県公債	1.09	100,000	102,547	2020/6/19	
第184回神奈川県公債	1.02	100,000	103,347	2021/6/18	
第190回神奈川県公債	0.88	100,000	103,650	2022/6/20	
第196回神奈川県公債	0.678	100,000	103,150	2023/3/20	
第334回大阪府公債(10年)	1.47	100,000	102,901	2020/1/28	
第335回大阪府公債(10年)	1.48	100,000	103,032	2020/2/25	
第339回大阪府公債(10年)	1.37	100,000	103,258	2020/6/29	
第356回大阪府公債(10年)	1.06	130,000	135,122	2021/12/27	
第363回大阪府公債(10年)	0.77	114,000	117,714	2022/8/30	
第371回大阪府公債(10年)	0.58	200,000	205,310	2023/4/26	
第376回大阪府公債(10年)	0.82	100,000	104,153	2023/9/27	
第403回大阪府公債(10年)	0.462	300,000	306,966	2025/12/25	
平成21年度第5回京都府公債	1.35	100,000	102,533	2019/12/24	
平成27年度第4回京都府公債	0.553	100,000	103,064	2025/6/19	
平成27年度第13回京都府公債	0.11	105,860	105,391	2026/3/17	
第4回兵庫県公債(15年)	1.31	100,000	109,995	2027/12/24	
平成21年度第35回兵庫県公債	1.46	100,000	102,858	2020/1/22	
平成22年度第19回兵庫県公債	1.26	100,000	103,667	2021/1/21	
平成25年度第14回兵庫県公債	0.73	100,000	103,776	2024/1/22	
平成26年度第2回兵庫県公債	0.63	100,000	103,265	2024/5/20	
平成22年度第3回静岡県公債	1.379	100,000	103,150	2020/5/25	
平成23年度第1回静岡県公債	1.385	100,000	104,391	2021/4/21	
平成23年度第5回静岡県公債	1.158	100,000	103,847	2021/6/28	
平成24年度第10回静岡県公債	0.678	100,000	103,154	2023/3/22	
平成25年度第1回静岡県公債	0.581	100,000	102,702	2023/4/19	
平成27年度第6回静岡県公債	0.494	100,000	102,633	2025/6/30	
平成22年度第1回愛知県公債(10年)	1.417	100,000	103,143	2020/4/4/20	
平成22年度第5回愛知県公債(10年)	1.258	100,000	102,988	2020/6/30	
平成22年度第14回愛知県公債(20年)	2.087	100,000	121,131	2030/12/13	
平成23年度第4回愛知県公債(10年)	1.182	100,000	103,929	2021/6/28	
平成23年度第8回愛知県公債(10年)	1.087	100,000	103,755	2021/8/26	
平成24年度第2回愛知県公債(10年)	0.982	100,000	103,962	2022/4/27	
平成25年度第16回愛知県公債(10年)	0.665	100,000	103,405	2023/11/28	
平成27年度第17回愛知県公債(10年)	0.38	200,000	203,480	2026/1/27	
平成20年度第1回広島県公債(20年)	2.34	100,000	121,391	2028/9/21	
平成23年度第1回広島県公債	1.19	272,000	282,488	2021/5/27	
平成24年度第2回広島県公債	0.84	100,000	103,550	2022/7/25	
平成27年度第2回広島県公債	0.602	162,000	167,430	2025/7/24	
平成22年度第4回埼玉県公債	1.17	100,000	102,862	2020/7/28	
平成23年度第9回埼玉県公債	0.99	100,000	103,786	2022/1/27	
平成24年度第2回埼玉県公債	0.91	100,000	103,705	2022/5/18	
平成24年度第6回埼玉県公債	0.801	100,000	103,565	2022/10/26	
平成27年度第8回埼玉県公債	0.41	200,000	203,956	2026/1/28	
平成19年度第1回福岡県公債(30年)	2.62	100,000	134,100	2037/9/18	
平成20年度第1回福岡県公債(30年)	2.28	200,000	256,094	2038/9/17	
平成21年度第5回福岡県公債	1.37	100,000	102,363	2019/10/28	
平成22年度第2回福岡県公債(15年)	1.765	100,000	112,739	2026/1/26	
第6回千葉県公債(20年)	2.26	100,000	121,379	2029/4/20	
第8回千葉県公債(20年)	2.18	100,000	121,687	2030/4/19	
平成22年度第4回千葉県公債	1.17	100,000	102,849	2020/7/24	
平成22年度第8回千葉県公債	1.0	100,000	102,753	2020/11/25	
平成22年度第9回千葉県公債	1.22	100,000	103,475	2020/12/25	
平成26年度第9回千葉県公債	0.465	100,000	102,416	2025/3/25	
平成28年度第1回千葉県公債	0.08	100,000	99,219	2026/5/25	
平成21年度第2回新潟県公債	1.55	133,900	137,655	2019/11/27	
平成27年度第3回新潟県公債	0.12	200,000	199,194	2026/3/25	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
平成24年度第1回岐阜県公債(10年)	0.82	139,630	144,651	2022/9/28	
第82回共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	102,785	2020/1/24	
第83回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	102,949	2020/2/25	
第84回共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	102,926	2020/3/25	
第85回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	103,172	2020/4/24	
第87回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	103,049	2020/6/25	
第88回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	102,849	2020/7/24	
第93回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	103,563	2020/12/25	
第95回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	103,863	2021/2/25	
第96回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	103,990	2021/3/25	
第98回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	103,816	2021/5/25	
第99回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	103,879	2021/6/25	
第100回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	104,106	2021/7/23	
第101回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	103,619	2021/8/25	
第102回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	103,629	2021/9/24	
第103回共同発行市場公募地方債	1.0	177,400	183,786	2021/10/24	
第105回共同発行市場公募地方債	1.07	100,000	104,011	2021/12/25	
第110回共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	310,905	2022/5/25	
第111回共同発行市場公募地方債	0.89	200,000	207,406	2022/6/24	
第116回共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	103,597	2022/11/25	
第117回共同発行市場公募地方債	0.72	500,000	516,295	2022/12/27	
第118回共同発行市場公募地方債	0.84	200,000	207,788	2023/1/25	
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,168	2023/3/24	
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	208,350	2023/8/25	
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	103,693	2024/4/25	
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	102,647	2024/11/25	
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	101,983	2025/4/25	
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	300,000	307,371	2025/12/25	
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	100,000	103,560	2022/10/26	
平成23年度第1回静岡市公債	1.045	100,000	103,834	2021/11/25	
第7回大阪市公債(30年)	0.973	100,000	101,012	2047/9/20	
平成21年度第3回大阪市公債	1.48	100,000	102,168	2019/7/22	
平成21年度第7回大阪市公債	1.47	100,000	102,897	2020/1/27	
第1回名古屋市公債(20年)	1.99	100,000	111,232	2023/12/20	
第3回名古屋市公債(30年)	0.977	100,000	99,487	2047/9/20	
平成21年度第2回名古屋市公債(10年)	0.639	100,000	102,949	2023/3/20	
第488回名古屋市公債(10年)	0.598	100,000	103,226	2024/9/20	
第495回名古屋市公債(10年)	0.11	100,000	99,517	2026/3/19	
第2回京都市公債(20年)	1.12	100,000	114,914	2025/9/19	
平成21年度第5回京都市公債	1.45	100,000	102,969	2020/2/25	
平成27年度第5回京都市公債	2.205	200,000	200,638	2026/2/25	
第5回横浜市公債(20年)	1.17	100,000	114,968	2025/6/20	
平成22年度第4回横浜市公債	0.947	100,000	102,532	2020/10/28	
平成23年度第1回横浜市公債	1.189	100,000	103,843	2021/5/24	
平成23年度第6回横浜市公債	0.718	100,000	103,754	2023/12/22	
第25回横浜市公債(20年)	1.72	100,000	117,343	2032/7/16	
第26回横浜市公債(20年)	1.776	100,000	118,235	2033/1/28	
平成23年度第4回札幌市公債(10年)	1.02	100,000	103,347	2021/6/18	
平成24年度第7回札幌市公債(10年)	0.75	100,000	103,254	2022/9/20	
第88回川崎市公債	0.464	100,000	102,413	2025/12/19	
平成23年度第5回広島市公債	1.01	151,900	157,855	2022/2/25	
平成27年度第2回広島市公債	0.464	100,000	102,418	2025/12/25	
平成23年度第1回千葉市公債	1.37	100,000	104,342	2021/4/21	
平成23年度第1回三重県公債	0.464	100,000	102,418	2025/12/25	
平成24年度第1回福井県公債	0.8	100,000	103,560	2022/10/26	
平成24年度第1回山梨県公債(10年)	0.8	100,000	103,564	2022/10/28	
平成27年度第1回山梨県公債(10年)	0.495	100,000	102,610	2025/10/30	
平成23年度第2回岡山県公債(10年)	1.01	100,000	104,007	2022/3/30	
小計		16,686,690	17,633,000		

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
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	102,167		2019/7/29
第2 回政府保証公営企業債券(1 5年)	2.1	100,000	106,852		2021/4/16
第2 回政府保証新関西国際空港債券	0.882	200,000	209,402		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	226,527		2021/12/22
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	120,290		2027/10/29
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	101,462		2019/2/27
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	102,071		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	119,396		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	102,245		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	241,448		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	102,181		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	102,649		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	102,373		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	205,386		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	244,380		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	103,005		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	130,607		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	102,864		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	103,245		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	103,124		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	128,614		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	103,241		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	120,303		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	174,516		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	126,829		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	104,334		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	103,942		2021/7/30
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	103,805		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	129,866		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	103,711		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	104,186		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	103,943		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	103,811		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	207,500		2022/10/31

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
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	117,453		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	208,276		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	118,207		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	216,020		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	205,500		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	103,149		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	104,913		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	104,404		2023/9/29
第3 回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	102,394		2019/8/16
第5 回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	102,137		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	102,606		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	102,842		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	103,194		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	103,175		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	102,806		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	102,725		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	103,686		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	104,155		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	103,880		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	103,611		2021/8/13
第3 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	200,000	207,490		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	225,593		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	103,359		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	104,673		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	105,919		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	201,194		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	430,358		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	198,628		2026/3/13
第1 8回政府保証国際空港債券	0.668	100,000	103,363		2023/3/22
第2 1回政府保証西日本高速道路債券	1.3	100,000	102,893		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	296,247		2026/7/17
第7 5回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	99,735		2027/1/18
第1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.99	100,000	148,744		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	177,289		2026/3/19
第1 7 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	500,000	591,455		2026/9/18
第2 0 0回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.28	100,000	118,711		2027/4/20
第2 1 回道路債券	2.75	100,000	132,663		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	284,036		2047/3/20
第2 7 回道路債券	2.42	100,000	113,985		2024/3/20
第2 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	120,106		2027/10/20
第3 3 回道路債券	2.91	100,000	136,339		2034/6/20
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	121,642		2028/6/20
第3 8 回道路債券	2.26	100,000	113,951		2024/9/20
第3 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	100,000	121,508		2028/9/20
第4 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	122,676		2029/5/18
第5 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.43	100,000	102,721		2019/12/20
第6 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	100,000	102,959		2020/6/19
第1 0 4 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	103,128		2023/3/20
第2 回地方公営企業等金融機構債券(2 0年)	2.29	100,000	121,477		2029/4/27
第4 回地方公共団体金融機構債券(2 0年)	2.12	100,000	120,340		2029/12/28
第5 回公営企業債券(2 0年)	2.11	100,000	111,249		2023/9/20
第5 回地方公共団体金融機構債券(2 0年)	2.22	200,000	243,262		2030/1/28
第7 回地方公共団体金融機構債券(2 0年)	2.202	100,000	121,693		2030/4/26

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第9回公営企業債券(20年)	2.33	100,000	114,437	2024/9/24
第11回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	113,817	2025/3/24
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	120,955	2030/12/27
第15回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	114,950	2025/9/24
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.03	300,000	361,620	2031/6/27
第17回公営企業債券(20年)	2.39	200,000	235,480	2026/3/24
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	118,600	2031/9/26
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	300,000	350,268	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	120,096	2028/4/25
第43回地方公共団体金融機構債券	0.72	100,000	103,245	2022/12/28
第16回国際協力銀行債券	2.07	100,000	103,430	2019/9/20
第19回国際協力銀行債券	1.67	100,000	103,573	2020/3/19
第34回都市再生債券	1.39	100,000	102,300	2019/9/20
第43回都市再生債券	1.29	100,000	103,397	2020/9/18
第38回関西国際空港株式会社債	1.112	100,000	104,143	2021/12/20
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	15,078	15,568	2036/5/10
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	90,240	95,035	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	35,480	37,589	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	18,118	19,316	2037/11/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	45,525	47,425	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	15,609	16,234	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	16,330	17,306	2037/5/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	120,579	2027/6/18
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	10,848	10,956	2037/8/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	65,508	69,390	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	17,233	18,250	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	39,864	42,035	2042/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	17,202	18,224	2037/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	25,232	25,749	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	17,584	18,652	2037/5/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	13,685	13,857	2038/6/10
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	13,721	14,127	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	21,638	23,062	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	74,052	76,768	2032/11/10
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	14,256	14,743	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	24,769	25,579	2032/11/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	31,640	33,199	2039/7/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	2.6	100,000	123,886	2028/9/20
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	27,674	29,998	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.72	15,558	16,090	2039/12/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	29,953	32,515	2044/6/10
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	55,820	60,127	2044/7/10
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	18,098	18,883	2040/3/10
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	50,661	52,658	2040/4/10
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	1.64	100,000	101,892	2019/3/20
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	17,914	18,596	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	57,501	59,775	2040/7/10
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	20,731	21,705	2040/9/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	38,613	41,203	2045/3/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	39,339	41,832	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	17,920	18,730	2040/11/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	40,067	42,484	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	18,652	19,517	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	54,111	56,523	2041/2/10
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	85,630	89,909	2045/8/10
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	41,286	43,628	2041/3/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	19,503	20,605	2041/4/10
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	102,855	2019/12/20
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	17,684	18,757	2041/5/10
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	52,794	55,482	2045/11/10

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	51,342	54,358	2045/12/10
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	122,540	2030/2/18
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	152,832	163,067	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	174,512	185,726	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	17,797	18,893	2041/10/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	40,560	43,077	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	40,865	43,251	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	52,044	55,070	2042/2/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	44,449	47,074	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	18,686	19,772	2042/4/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	49,180	51,817	2046/10/10
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	52,052	54,865	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	55,399	58,850	2046/12/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	53,419	56,249	2047/2/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	61,738	64,147	2047/12/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	63,385	66,523	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	56,800	59,433	2048/3/10
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	55,493	57,565	2048/4/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	58,020	60,231	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	63,093	66,367	2048/6/10
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	1.841	100,000	118,298	2031/10/17
第87回一般担保住宅金融支援機構債券	1.53	100,000	111,173	2026/9/18
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,618	2031/11/18
第102回一般担保住宅金融支援機構債券	1.441	100,000	110,856	2027/3/19
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	88,623	91,190	2051/1/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	186,352	185,641	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	94,376	92,980	2051/8/10
第112回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	95,010	94,781	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	95,250	94,770	2051/11/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	95,596	95,558	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	96,065	96,569	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	96,497	96,824	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	96,966	97,449	2052/3/10
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	97,910	98,011	2052/6/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	99,483	99,478	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	99,827	99,642	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	100,000	99,894	2053/1/10
第45回中日本高速道路株式会社債	0.904	100,000	103,729	2022/9/20
第18回西日本高速道路株式会社債	0.893	200,000	207,656	2023/3/20
第29回西日本高速道路株式会社債	0.81	100,000	100,593	2026/2/12
第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	99,487	2026/10/19
小計		18,543,282	20,168,517	
<b>金融債券</b>				
第770号商工債	0.2	100,000	100,150	2019/7/26
第771号商工債	0.2	100,000	100,159	2019/8/27
第773号商工債	0.2	200,000	200,350	2019/10/25
第786号商工債	0.22	100,000	100,283	2020/11/27
第787号商工債	0.22	100,000	100,291	2020/12/25
第765号農林債	0.3	100,000	100,280	2019/2/27
第766号農林債	0.3	300,000	300,900	2019/3/27
第769号農林債	0.3	100,000	100,363	2019/6/27
第779号農林債	0.26	100,000	100,439	2020/4/27
第295回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,292	2019/6/27
第299回信金中金債(5年)	0.2	200,000	200,542	2019/10/25
第308回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,463	2020/7/27
第322回信金中金債(5年)	0.03	100,000	99,761	2021/9/27
第327回信金中金債(5年)	0.06	200,000	199,592	2022/2/25
第331回信金中金債(5年)	0.08	100,000	99,867	2022/6/27
第201号商工債(3年)	0.01	100,000	99,842	2019/10/25
小計		2,100,000	2,103,574	

銘柄	当 期	末		
		利率	額面金額	評 価 額
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	償還年月日
第457回東京電力株式会社社債	2.05	100,000	101,569	2018/11/16
第542回東京電力株式会社社債	1.602	100,000	100,383	2018/4/25
第544回東京電力株式会社社債	1.976	100,000	100,790	2018/6/25
第482回中部電力株式会社社債	2.17	100,000	103,020	2019/6/25
第500回中部電力株式会社社債	0.875	100,000	103,735	2024/5/24
第518回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	99,900	2023/1/25
第495回関西電力株式会社社債	0.746	100,000	102,164	2021/9/17
第505回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	99,807	2023/8/25
第509回関西電力株式会社社債	0.47	100,000	100,044	2027/5/25
第510回関西電力株式会社社債	0.49	100,000	100,181	2027/7/23
第370回中国電力株式会社社債	1.285	100,000	103,620	2020/12/25
第377回中国電力株式会社社債	1.121	100,000	104,800	2023/8/25
第393回中国電力株式会社社債	0.26	100,000	98,846	2026/11/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	105,594	2026/6/25
第479回東北電力株式会社社債	0.372	200,000	201,620	2022/4/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	104,174	2023/6/23
第371回九州電力株式会社社債	1.43	100,000	105,909	2022/12/22
第431回九州電力株式会社社債	0.811	100,000	103,081	2024/12/25
第436回九州電力株式会社社債	0.39	100,000	100,815	2022/1/25
第316回北海道電力株式会社社債	1.164	100,000	102,508	2020/6/25
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	100,000	103,072	2023/5/9
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,528	2027/11/30
第9回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.08	100,000	99,984	2020/6/12
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	100,000	100,070	2024/2/23
第1回株式会社ニコレイ無担保社債	0.659	100,000	101,244	2020/9/4
第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	100,000	99,829	2027/2/26
第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.671	100,000	101,998	2023/3/20
第43回住友化学株式会社無担保社債	1.58	100,000	103,178	2020/4/23
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	100,000	99,690	2024/7/24
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	100,000	99,542	2024/5/31
第1回ヤフー株式会社無担保社債	0.04	100,000	99,891	2020/2/28
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	100,778	2019/12/4
第5回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	100,000	99,665	2022/3/3
第1回XTGホールディングス株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,034	2022/8/3
第9回住友理工株式会社無担保社債	0.455	100,000	99,587	2027/9/21
第14回旭硝子株式会社無担保社債	1.005	100,000	104,207	2023/6/2
第67回日本製鐵株式会社無担保社債	1.293	100,000	103,567	2021/3/19
第23回日新製鋼株式会社無担保社債	0.64	100,000	100,474	2019/3/13
第21回FEホールディングス株式会社無担保社債	0.804	100,000	102,707	2024/3/13
第9回株式会社LIXILグループ無担保社債	0.08	100,000	99,565	2021/8/31
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.821	100,000	103,057	2022/9/20
第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	100,000	103,178	2023/12/13
第2回日本電産株式会社無担保社債	0.595	100,000	100,825	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	101,423	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	99,958	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	100,038	2023/9/20
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	0.609	100,000	101,012	2020/10/30
第12回株式会社デンソー無担保社債	0.01	100,000	99,527	2021/9/17
第24回三菱重工株式会社無担保社債	1.482	100,000	102,582	2019/12/9
第32回三菱重工株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,641	2021/8/31
第5回J.A三井リース株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,923	2019/9/9
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	100,212	2022/8/4
第57回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,227	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	102,401	2019/6/20
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.135	100,000	102,272	2020/7/29

銘柄	当 期	末		
		利率	額面金額	評 価 額
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	%	千円	千円	償還年月日
第1回ユニバー・ファミリーマー	1.221	100,000	103,444	2021/9/14
トホールディングス無担保社債	0.14	100,000	99,992	2022/2/22
第69回三井物産株式会社無担保社債	2.139	100,000	118,991	2031/7/22
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	105,864	2022/3/16
第9回株式会社みずほコーポレー	2.2	100,000	113,955	2026/10/30
ト銀行無担保社債(劣後特約付)				
第25回株式会社三菱東京UFJ	1.31	100,000	103,082	2020/11/12
銀行無担保社債(劣後特約付)				
第28回株式会社三菱東京UFJ	1.56	100,000	104,032	2021/1/20
銀行無担保社債(劣後特約付)				
第32回株式会社三菱東京UFJ	1.62	100,000	104,466	2021/6/9
銀行無担保社債(劣後特約付)				
第35回株式会社三菱東京UFJ	1.52	100,000	104,876	2022/1/26
銀行無担保社債(劣後特約付)				
第57回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.22	100,000	109,994	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	102,266	2019/7/17
第1回三井住友FC無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	102,054	2024/9/12
第11回株式会社社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.78	100,000	105,960	2022/3/15
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	103,264	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	104,049	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	104,367	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	113,725	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	104,632	2020/8/7
第1回N.T.Tファイナンス株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,895	2021/12/20
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	0.03	100,000	99,198	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	99,817	2019/12/20
第74回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,832	2020/4/24
第25回リコーリース株式会社無担保社債	0.13	100,000	99,992	2022/2/23
第9回株式会社ジャックス無担保社債	0.79	100,000	101,409	2021/1/22
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.888	100,000	103,282	2024/3/19
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.12	100,000	99,744	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	99,754	2022/1/26
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	1.252	100,000	102,461	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	104,005	2020/6/24
第47回三井不動産株式会社無担保社債	1.954	100,000	117,254	2032/12/20
第38回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	118,786	2027/9/17
第104回三菱地所株式会社無担保社債	1.095	100,000	103,449	2021/12/22
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,024	2024/4/26
第31回日本ビルファンド投資法人無担保社債	1.168	100,000	103,923	2023/6/26
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	103,424	2022/6/7
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	1.199	100,000	103,751	2021/7/28
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.02	100,000	108,931	2022/9/20
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.86	100,000	105,264	2020/12/18
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	100,000	118,080	2027/4/16
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.249	100,000	122,003	2030/3/22
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.874	100,000	103,464	2022/7/22
第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.302	100,000	100,574	2058/1/25
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.21	100,000	112,497	2024/3/20
第64回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	92,037	2056/12/13
第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.033	100,000	100,177	2047/11/29
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保社債	2.212	100,000	121,653	2030/4/23
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	119,631	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	100,000	121,767	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	116,548	2032/5/25

銘柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第46回阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.819	100,000	103,093	2023/10/25
第4回株式会社日立物流無担保社債	0.33	100,000	99,209	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	102,850	2020/9/10
第18回KDDI株式会社無担保社債	1.573	100,000	102,559	2019/12/20
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	112,254	2025/6/20
第33回電源開発株式会社無担保社債	1.422	100,000	104,020	2021/2/19
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	104,038	2023/12/20
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	1.238	100,000	103,867	2021/9/3
第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,123	2022/7/21
第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.16	100,000	99,855	2021/10/14
第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.384	100,000	100,458	2024/10/11
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.55	100,000	100,670	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	100,856	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	100,529	2024/1/26
第17回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.217	100,000	99,976	2023/1/25
第9回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.15	100,000	99,887	2021/7/9

銘柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.202	200,000	200,060	2022/6/9
第4回スヴェンスカ・ハンデルスバンクエンAB円貨社債	0.325	100,000	100,304	2019/9/4
第1回HSBC・ホールディングス・ビーエルシー円貨社債	0.45	100,000	100,925	2021/9/24
第1回バンコ・サンタンデール・エセ・アー非上位円貨社債	0.568	100,000	100,012	2023/1/11
第6回ビー・エヌ・ビー・バリバ円貨社債	0.439	100,000	100,381	2019/9/17
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	100,261	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	99,968	2020/10/29
小 計		12,900,000	13,328,240	
合 計		287,176,972	310,445,297	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期		末	
	買 建 額	売 建 額	買 建 額	売 建 額
国内	100万円	100万円	601	—
10年国債標準物	601	—		

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比 率	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%	千円	%
コーポレートローン等、その他	310,445,297	99.3	310,445,297	99.3
投資信託財産総額	2,166,023	0.7	2,166,023	0.7
	312,611,320	100.0	312,611,320	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 2018年1月22日現在
(A) 資 産	312,716,265,164円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,378,128,322
公 社 債(評価額)	310,445,297,773
未 収 入 金	100,876,000
未 収 利 息	679,534,368
前 払 費 用	6,724,701
差 入 委 託 証 拠 金	105,704,000
(B) 負 債	456,915,079
未 払 金	200,761,296
未 払 解 約 金	151,167,500
未 払 利 息	2,283
差入委託証拠金代用有価証券	104,984,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	312,259,350,085
元 本	231,135,066,038
次 期 繰 越 損 益 金	81,124,284,047
(D) 受 益 権 総 口 数	231,135,066,038口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,510円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2017年1月24日 至 2018年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	3,034,997,818円
受 取 利 息	3,036,097,354
支 払 利 息	△1,099,536
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,244,064,459
売 買 益	240,504,600
売 買 損	△2,484,569,059
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△1,297,156
取 引 益	17,897,880
取 引 損	△19,195,036
(D) そ の 他 費 用	△11,411
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	789,624,792
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	82,186,795,478
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,864,836,426
(H) 解 約 差 損 益 金	△8,716,972,649
(I) 計 (E+F+G+H)	81,124,284,047
次 期 繰 越 損 益 金(I)	81,124,284,047

(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236,558,846,378円、期中追加設定元本額は19,640,315,189円、期中一部解約元本額は25,064,095,529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 103,801,000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)	45,162,708,375円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	36,136,756,497円
DC日本債券インデックスファンドL	34,422,150,415円
インデックスコレクション (バランス株式30)	18,729,555,869円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	16,105,397,614円
インデックスコレクション (国内債券)	15,187,681,236円
DCバランスファンド30	7,204,604,931円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	5,511,251,684円
DCバランスファンド50	4,936,633,053円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	4,847,490,055円
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	4,041,635,374円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	3,923,809,935円

VAファンド25 (適格機関投資家専用)	3,499,827,188円
VAバランスファンド(株40/100) (適格機関投資家専用)	3,336,370,860円
日本債券バシップファンド私募A (適格機関投資家専用)	3,017,905,277円
DC日本債券インデックスファンド	2,892,835,712円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	2,857,097,717円
インデックスコレクション (バランス株式50)	2,268,846,800円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	2,137,978,629円
VAバランスファンド(株60/100) (適格機関投資家専用)	1,921,681,634円
日本債券インデックスe	1,541,649,986円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	1,435,799,966円
DCバランスファンド70	1,222,423,759円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	1,087,787,076円
日本債券インデックスファンド	963,525,190円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	959,314,713円
インデックスコレクション (バランス株式70)	865,259,104円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	806,411,759円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	735,643,739円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	647,501,734円
VAバランスファンド2(株40/100) (適格機関投資家専用)	495,218,539円
VAバランスファンド(株50/100) (適格機関投資家専用)	421,476,814円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	291,378,759円
バランスVA20L (適格機関投資家専用)	288,853,577円
VAバランスファンド(株25/100) (適格機関投資家専用)	243,032,268円
日本債券インデックスファンド(SMA専用)	230,972,074円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	225,822,242円
バランスVA20 (適格機関投資家専用)	222,515,537円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	164,057,905円
VAバランス株式40 (適格機関投資家専用)	86,439,935円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	46,620,939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)	9,417,772円
世界バランスVA20 (適格機関投資家専用)	1,723,796円

## お知らせ

該当事項はありません。