

## 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9期(決算日 2019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/>

スマートフォンサイト <http://s.smtam.jp/>

## 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

**【本運用報告書の記載について】**

- ・基準価額および税込分配金は1万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	債券先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	債券組入率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
第8期(2018年1月22日)	11,343	0	△0.2	379.795	0.3	99.4	0.2	2,083
第9期(2019年1月22日)	11,451	0	1.0	384.988	1.4	99.3	0.3	1,970

(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				
(当期首)	円	%		%	%	%
2018年1月22日	11,343	—	379.795	—	99.4	0.2
1月末	11,343	0.0	379.850	0.0	99.3	0.3
2月末	11,382	0.3	381.295	0.4	99.1	0.5
3月末	11,397	0.5	381.911	0.6	99.4	0.3
4月末	11,385	0.4	381.638	0.5	99.5	0.3
5月末	11,406	0.6	382.498	0.7	99.2	0.4
6月末	11,408	0.6	382.669	0.8	99.3	0.3
7月末	11,383	0.4	381.979	0.6	99.2	0.3
8月末	11,318	△0.2	379.893	0.0	99.2	0.2
9月末	11,287	△0.5	378.986	△0.2	99.4	0.3
10月末	11,302	△0.4	379.645	△0.0	99.3	0.3
11月末	11,346	0.0	381.238	0.4	99.1	0.4
12月末	11,425	0.7	384.131	1.1	99.6	0.4
(当期末)						
2019年1月22日	11,451	1.0	384.988	1.4	99.3	0.3

(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。

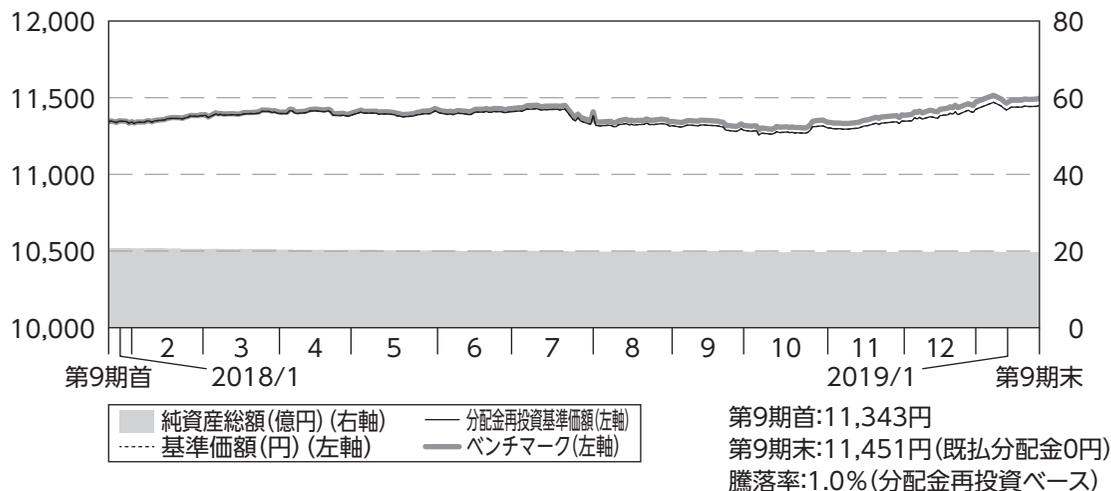
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

### 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

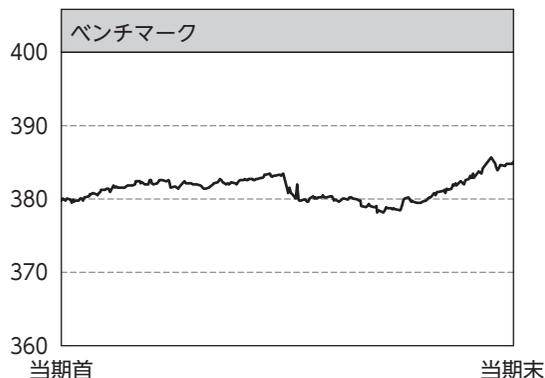


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2018年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

期初より2018年7月下旬にかけて、米中貿易摩擦の激化懸念の高まりやイタリア政局の混迷などから投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に、金利が低下(債券価格は上昇)基調推移となったことから、基準価額は上昇しました。8月から10月上旬にかけては、7月末の日銀金融政策決定会合で長期金利変動幅の拡大容認が決定されたほか、買い入れオペ減額に対する警戒感や米国金利上昇の影響を受けて金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。10月中旬以降期末にかけては、世界的な株安と原油安の動きに加え、米中貿易摩擦を背景に世界景気の減速懸念が高まったことなどから金利が低下し、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



期初より2018年7月下旬にかけて、米中貿易摩擦の激化懸念の高まりやイタリア政局の混迷などから投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に、金利は低下しました。8月から10月上旬にかけては、7月末の日銀金融政策決定会合で長期金利変動幅の拡大容認が決定されたほか、買い入れオペ減額に対する警戒感や米国金利上昇の影響を受けて、金利は上昇しました。10月中旬以降期末にかけては、世界的な株安と原油安の動きに加え、米中貿易摩擦を背景に世界景気の減速懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。

## 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。

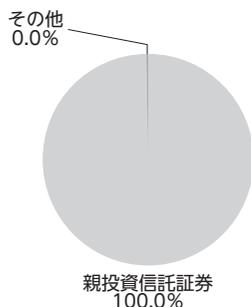
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

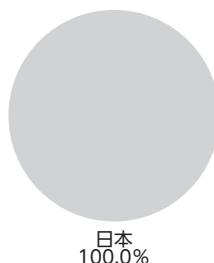
	当期末
	2019年1月22日
日本債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

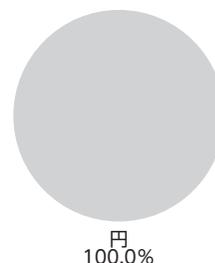
### ○資産別配分



### ○国別配分



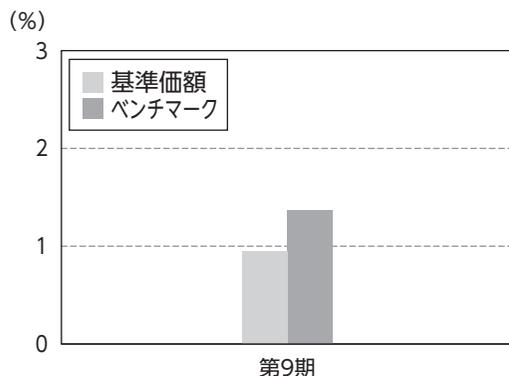
### ○通貨別配分



(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9期	
	2018年1月23日～2019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)	1,450	

(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
	(2018年1月23日～2019年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	45円	0.400%	(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11,365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)	(17)	(0.151)	
(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 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}$ 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	46	0.405	

(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 351,882	千円 476,967	千口 455,360	千円 616,819

## 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 74	百万円 74	% 100.0	百万円 74	百万円 74	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	1,362	198	14.5	1,362	200	14.7

(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 20,248	百万円 20,248	% 100.0	百万円 20,210	百万円 20,210	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	377,080	59,677	15.8	377,363	60,031	15.9

<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 1,541,649	千口 1,438,171	千円 1,970,007

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、220,780,734千口です。

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

## 投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 1,970,007	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	16,674	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	1,986,681	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 2019年1月22日現在
(A) 資 産	1,986,681,948円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,556,969
日本債券マザーファンド(評価額)	1,970,007,031
未 収 入 金	10,117,948
(B) 負 債	15,690,011
未 払 解 約 金	11,642,003
未 払 信 託 報 酬	3,993,991
未 払 利 息	17
そ の 他 未 払 費 用	54,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,970,991,937
元 本	1,721,260,903
次 期 繰 越 損 益 金	249,731,034
(D) 受 益 権 総 口 数	1,721,260,903口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	11,451円

### ■損益の状況

項 目	当 期 自 2018年1月23日 至 2019年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	△3,866円
支 払 利 息	△3,866
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	25,985,868
売 買 益	30,061,252
売 買 損	△4,075,384
(C) 信 託 報 酬 等	△8,134,776
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	17,847,226
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	21,584,358
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	210,299,450
(配 当 等 相 当 額)	(110,130,121)
(売 買 損 益 相 当 額)	(100,169,329)
(G) 計 (D+E+F)	249,731,034
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	249,731,034
追 加 信 託 差 損 益 金	210,299,450
(配 当 等 相 当 額)	(110,532,320)
(売 買 損 益 相 当 額)	(99,767,130)
分 配 準 備 積 立 金	43,357,221
繰 越 損 益 金	△3,925,637

(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1,837,086,770円、期中追加設定元本額は633,233,665円、期中一部解約元本額は749,059,532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)	12,312,936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	206,373,813円
(D) 分配準備積立金額	31,044,285円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	249,731,034円
(F) 期末残存口数	1,721,260,903口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	1,450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

---

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2018年10月1日付で、三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継いたしました。

なお、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が本件承継前に三井住友信託銀行より受けていた投資助言(関連して三井住友信託銀行株式会社がその他の運用会社等から受けていた投資助言がある場合には同助言を含みます。)については、承継後の運用体制においても実質的に引き継がれております。

このため、本件承継に伴いファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。

# 日本債券マザーファンド

## 運用報告書

第18期（決算日 2019年1月22日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

**【本運用報告書の記載について】**

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

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率		騰落率			
第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
第18期(2019年1月22日)	13,698	1.4	384.988	1.4	99.4	0.3	302,423

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

## 当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率
	円	騰落率		騰落率		
(当期首) 2018年 1月22日	13,510	—	379.795	—	99.4	0.2
1月末	13,512	0.0	379.850	0.0	99.4	0.3
2月末	13,563	0.4	381.295	0.4	99.1	0.5
3月末	13,585	0.6	381.911	0.6	99.5	0.3
4月末	13,575	0.5	381.638	0.5	99.5	0.3
5月末	13,606	0.7	382.498	0.7	99.2	0.4
6月末	13,613	0.8	382.669	0.8	99.4	0.3
7月末	13,589	0.6	381.979	0.6	99.3	0.3
8月末	13,516	0.0	379.893	0.0	99.3	0.2
9月末	13,483	△0.2	378.986	△0.2	99.5	0.3
10月末	13,507	△0.0	379.645	△0.0	99.3	0.3
11月末	13,564	0.4	381.238	0.4	99.2	0.4
12月末	13,663	1.1	384.131	1.1	99.6	0.4
(当期末) 2019年 1月22日	13,698	1.4	384.988	1.4	99.4	0.3

(注1)騰落率は期首比です。

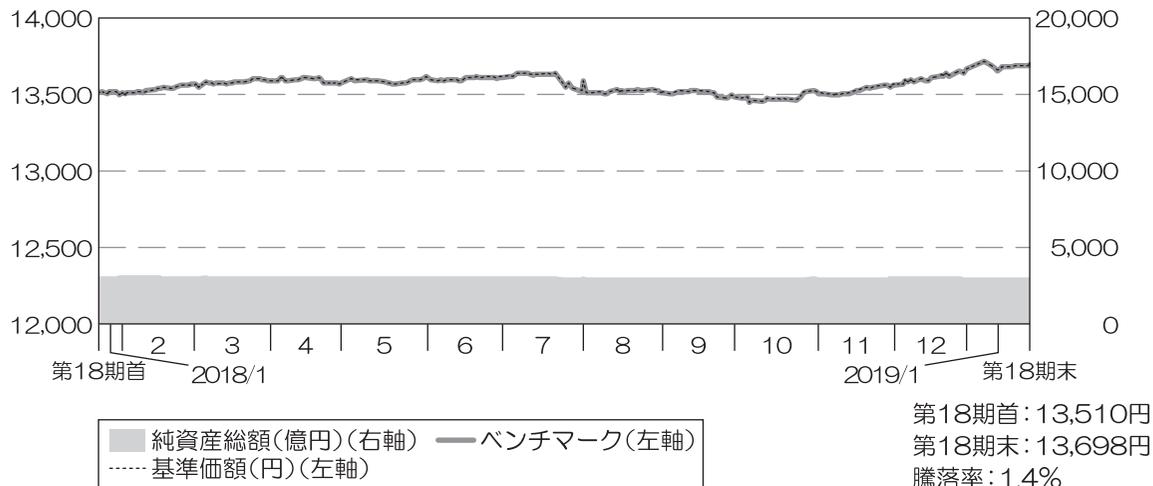
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

NOMURA-BPI総合とは、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

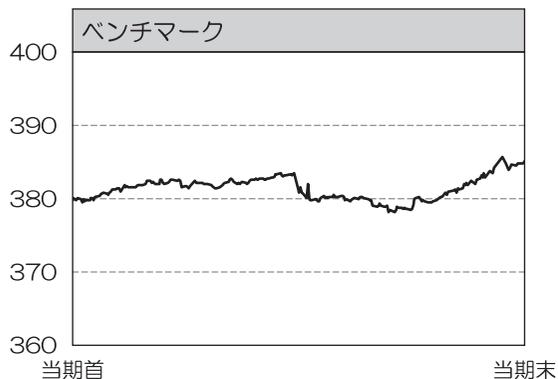


(注)ベンチマークは、2018年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

期初より2018年7月下旬にかけて、米中貿易摩擦の激化懸念の高まりやイタリア政局の混迷などから投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に、金利が低下(債券価格は上昇)基調推移となったことから、基準価額は上昇しました。8月から10月上旬にかけては、7月末の日銀金融政策決定会合で長期金利変動幅の拡大容認が決定されたほか、買い入れオペ減額に対する警戒感や米国金利上昇の影響を受けて金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。10月中旬以降期末にかけては、世界的な株安と原油安の動きに加え、米中貿易摩擦を背景に世界景気の減速懸念が高まったことなどから金利が低下し、基準価額は上昇しました。

## 投資環境



期初より2018年7月下旬にかけて、米中貿易摩擦の激化懸念の高まりやイタリア政局の混迷などから投資家のリスク回避姿勢が強まったことを背景に、金利は低下しました。8月から10月上旬にかけては、7月末の日銀金融政策決定会合で長期金利変動幅の拡大容認が決定されたほか、買い入れオペ減額に対する警戒感や米国金利上昇の影響を受けて、金利は上昇しました。10月中旬以降期末にかけては、世界的な株安と原油安の動きに加え、米中貿易摩擦を背景に世界景気の減速懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。

## 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

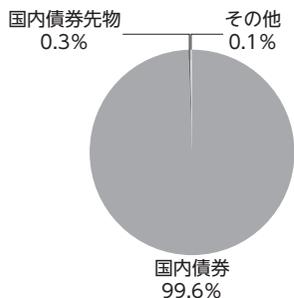
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第127回利付国債(5年)	日本	1.3%
2	第339回利付国債(10年)	日本	1.0%
3	第126回利付国債(5年)	日本	1.0%
4	第338回利付国債(10年)	日本	0.9%
5	第334回利付国債(10年)	日本	0.9%
6	第333回利付国債(10年)	日本	0.9%

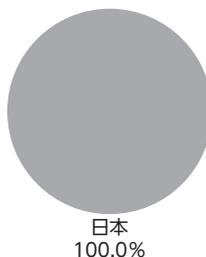
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第340回利付国債(10年)	日本	0.9%
8	第349回利付国債(10年)	日本	0.9%
9	第348回利付国債(10年)	日本	0.9%
10	第124回利付国債(5年)	日本	0.9%
組入銘柄数		702	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

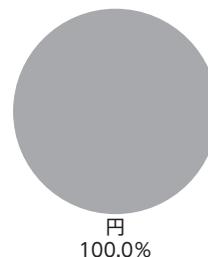
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

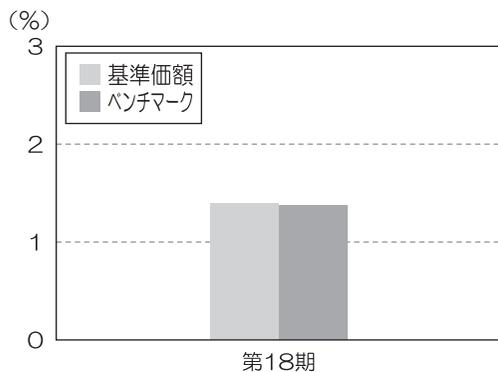


(注1)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。

(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0.3%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
	(2018年1月23日～2019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(13,564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 51,563,826	千円 60,524,179
	地 方 債 証 券	2,075,046	2,999,206
	特 殊 債 券	3,699,469	4,330,718 (385,789)
	社 債 券	1,907,201	2,032,400 (300,000)

(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 27,957	百万円 27,653	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 20,248	百万円 20,248	% 100.0	百万円 20,210	百万円 20,210	% 100.0
コール・ローン	377,080	59,677	15.8	377,363	60,031	15.9

(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。

※ 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	228,932,000 (4,170,000)	249,701,588 (4,201,844)	82.6 (1.4)	— (—)	54.1 (—)	17.9 (0.8)	10.5 (0.6)	
地 方 債 証 券	15,792,230 (15,592,230)	16,691,593 (16,448,543)	5.5 (5.4)	— (—)	3.0 (3.0)	2.4 (2.4)	0.1 (0.1)	
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	17,880,493 (17,680,493)	19,528,651 (19,288,493)	6.5 (6.4)	— (—)	4.8 (4.7)	1.5 (1.5)	0.1 (0.1)	
金 融 債 証 券	1,700,000 (1,700,000)	1,701,414 (1,701,414)	0.6 (0.6)	— (—)	— (—)	0.4 (0.4)	0.1 (0.1)	
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	12,500,000 (12,500,000)	12,895,604 (12,895,604)	4.3 (4.3)	— (—)	1.6 (1.6)	2.1 (2.1)	0.6 (0.6)	
合 計	276,804,723 (51,642,723)	300,518,850 (54,535,899)	99.4 (18.0)	— (—)	63.6 (9.3)	24.4 (7.2)	11.4 (1.5)	

(注1) ( )内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

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

## (B) 個別銘柄開示

当 期 末					当 期 末				
銘 柄	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	銘 柄	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
国債証券					第135回利付国債(5年)	0.1	2,340,000	2,365,927	2023/3/20
第385回利付国債(2年)	0.1	640,000	641,907	2020/2/15	第136回利付国債(5年)	0.1	1,620,000	1,639,051	2023/6/20
第386回利付国債(2年)	0.1	1,520,000	1,524,848	2020/3/15	第137回利付国債(5年)	0.1	2,020,000	2,044,644	2023/9/20
第387回利付国債(2年)	0.1	1,190,000	1,194,010	2020/4/15	第1回利付国債(40年)	2.4	230,000	335,220	2048/3/20
第388回利付国債(2年)	0.1	1,530,000	1,535,508	2020/5/15	第2回利付国債(40年)	2.2	350,000	494,249	2049/3/20
第389回利付国債(2年)	0.1	380,000	381,417	2020/6/1	第3回利付国債(40年)	2.2	410,000	582,179	2050/3/20
第390回利付国債(2年)	0.1	1,310,000	1,315,174	2020/7/1	第4回利付国債(40年)	2.2	595,000	849,303	2051/3/20
第391回利付国債(2年)	0.1	1,670,000	1,676,997	2020/8/1	第5回利付国債(40年)	2.0	415,000	571,708	2052/3/20
第392回利付国債(2年)	0.1	310,000	311,370	2020/9/1	第6回利付国債(40年)	1.9	610,000	825,415	2053/3/20
第394回利付国債(2年)	0.1	1,200,000	1,205,856	2020/11/1	第7回利付国債(40年)	1.7	570,000	739,141	2054/3/20
第395回利付国債(2年)	0.1	1,440,000	1,447,228	2020/12/1	第8回利付国債(40年)	1.4	920,000	1,109,004	2055/3/20
第396回利付国債(2年)	0.1	370,000	371,942	2021/1/1	第9回利付国債(40年)	0.4	830,000	732,807	2056/3/20
第123回利付国債(5年)	0.1	2,320,000	2,327,354	2020/3/20	第10回利付国債(40年)	0.9	890,000	928,225	2057/3/20
第124回利付国債(5年)	0.1	2,630,000	2,640,178	2020/6/20	第11回利付国債(40年)	0.8	510,000	513,825	2058/3/20
第125回利付国債(5年)	0.1	2,200,000	2,210,054	2020/9/20	第306回利付国債(10年)	1.4	1,370,000	1,394,934	2020/3/20
第126回利付国債(5年)	0.1	2,870,000	2,885,096	2020/12/20	第307回利付国債(10年)	1.3	880,000	894,995	2020/3/20
第127回利付国債(5年)	0.1	3,820,000	3,842,270	2021/3/20	第308回利付国債(10年)	1.3	970,000	990,156	2020/6/20
第128回利付国債(5年)	0.1	2,330,000	2,344,888	2021/6/20	第309回利付国債(10年)	1.1	960,000	977,241	2020/6/20
第129回利付国債(5年)	0.1	1,980,000	1,993,998	2021/9/20	第310回利付国債(10年)	1.0	1,400,000	1,427,342	2020/9/20
第130回利付国債(5年)	0.1	1,880,000	1,894,551	2021/12/20	第311回利付国債(10年)	0.8	670,000	680,854	2020/9/20
第131回利付国債(5年)	0.1	1,910,000	1,926,044	2022/3/20	第312回利付国債(10年)	1.2	2,037,000	2,090,369	2020/12/20
第132回利付国債(5年)	0.1	1,325,000	1,337,017	2022/6/20	第313回利付国債(10年)	1.3	910,000	938,810	2021/3/20
第133回利付国債(5年)	0.1	1,670,000	1,686,282	2022/9/20	第314回利付国債(10年)	1.1	250,000	256,832	2021/3/20
第134回利付国債(5年)	0.1	2,320,000	2,344,174	2022/12/20					

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315回利付国債(10年)	1.2	1,020,000	1,053,619	2021/6/20	第20回利付国債(30年)	2.5	290,000	391,836	2035/9/20
第316回利付国債(10年)	1.1	360,000	370,998	2021/6/20	第21回利付国債(30年)	2.3	360,000	475,851	2035/12/20
第317回利付国債(10年)	1.1	280,000	289,452	2021/9/20	第22回利付国債(30年)	2.5	380,000	515,542	2036/3/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,050,000	1,082,644	2021/9/20	第23回利付国債(30年)	2.5	370,000	502,985	2036/6/20
第319回利付国債(10年)	1.1	560,000	580,686	2021/12/20	第24回利付国債(30年)	2.5	335,000	456,293	2036/9/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,270,000	1,313,205	2021/12/20	第25回利付国債(30年)	2.3	335,000	445,449	2036/12/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,540,000	1,596,610	2022/3/20	第26回利付国債(30年)	2.4	610,000	823,445	2037/3/20
第322回利付国債(10年)	0.9	860,000	888,887	2022/3/20	第27回利付国債(30年)	2.5	490,000	672,152	2037/9/20
第323回利付国債(10年)	0.9	690,000	715,040	2022/6/20	第28回利付国債(30年)	2.5	900,000	1,239,543	2038/3/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,005,000	1,032,870	2022/6/20	第29回利付国債(30年)	2.4	620,000	845,208	2038/9/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,205,000	2,282,858	2022/9/20	第30回利付国債(30年)	2.3	945,000	1,275,997	2039/3/20
第326回利付国債(10年)	0.7	560,000	578,933	2022/12/20	第31回利付国債(30年)	2.2	600,000	800,724	2039/9/20
第327回利付国債(10年)	0.8	1,010,000	1,048,117	2022/12/20	第32回利付国債(30年)	2.3	695,000	944,247	2040/3/20
第328回利付国債(10年)	0.6	1,530,000	1,578,608	2023/3/20	第33回利付国債(30年)	2.0	1,160,000	1,511,828	2040/9/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,035,000	2,121,670	2023/6/20	第34回利付国債(30年)	2.2	890,000	1,200,129	2041/3/20
第330回利付国債(10年)	0.8	1,820,000	1,901,972	2023/9/20	第35回利付国債(30年)	2.0	1,050,000	1,376,140	2041/9/20
第331回利付国債(10年)	0.6	970,000	1,004,590	2023/9/20	第36回利付国債(30年)	2.0	1,000,000	1,313,990	2042/3/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,530,000	2,625,077	2023/12/20	第37回利付国債(30年)	1.9	1,255,000	1,624,974	2042/9/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,660,000	2,764,325	2024/3/20	第38回利付国債(30年)	1.8	865,000	1,103,765	2043/3/20
第334回利付国債(10年)	0.6	2,660,000	2,769,459	2024/6/20	第39回利付国債(30年)	1.9	700,000	910,189	2043/6/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,465,000	2,557,141	2024/9/20	第40回利付国債(30年)	1.8	335,000	428,712	2043/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	270,000	280,540	2024/12/20	第41回利付国債(30年)	1.7	635,000	798,461	2043/12/20
第337回利付国債(10年)	0.3	2,350,000	2,413,732	2024/12/20	第42回利付国債(30年)	1.7	600,000	754,968	2044/3/20
第338回利付国債(10年)	0.4	2,680,000	2,772,406	2025/3/20	第43回利付国債(30年)	1.7	625,000	786,968	2044/6/20
第339回利付国債(10年)	0.4	2,945,000	3,050,725	2025/6/20	第44回利付国債(30年)	1.7	730,000	919,785	2044/9/20
第340回利付国債(10年)	0.4	2,570,000	2,665,938	2025/9/20	第45回利付国債(30年)	1.5	600,000	727,602	2044/12/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,230,000	2,300,824	2025/12/20	第46回利付国債(30年)	1.5	740,000	897,657	2045/3/20
第342回利付国債(10年)	0.1	1,590,000	1,618,731	2026/3/20	第47回利付国債(30年)	1.6	795,000	984,058	2045/6/20
第343回利付国債(10年)	0.1	2,255,000	2,295,477	2026/6/20	第48回利付国債(30年)	1.4	760,000	903,883	2045/9/20
第344回利付国債(10年)	0.1	1,770,000	1,801,470	2026/9/20	第49回利付国債(30年)	1.4	840,000	999,146	2045/12/20
第345回利付国債(10年)	0.1	2,100,000	2,136,876	2026/12/20	第50回利付国債(30年)	0.8	830,000	863,714	2046/3/20
第346回利付国債(10年)	0.1	2,255,000	2,293,943	2027/3/20	第51回利付国債(30年)	0.3	895,000	818,325	2046/6/20
第347回利付国債(10年)	0.1	2,515,000	2,556,547	2027/6/20	第52回利付国債(30年)	0.5	950,000	915,515	2046/9/20
第348回利付国債(10年)	0.1	2,600,000	2,640,794	2027/9/20	第53回利付国債(30年)	0.6	450,000	444,681	2046/12/20
第349回利付国債(10年)	0.1	2,605,000	2,643,501	2027/12/20	第54回利付国債(30年)	0.8	635,000	659,231	2047/3/20
第350回利付国債(10年)	0.1	2,420,000	2,452,234	2028/3/20	第55回利付国債(30年)	0.8	840,000	871,256	2047/6/20
第351回利付国債(10年)	0.1	2,130,000	2,156,113	2028/6/20	第56回利付国債(30年)	0.8	500,000	518,115	2047/9/20
第352回利付国債(10年)	0.1	2,310,000	2,336,819	2028/9/20	第57回利付国債(30年)	0.8	840,000	869,601	2047/12/20
第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	64,576	2029/9/20	第58回利付国債(30年)	0.9	1,060,000	1,096,273	2048/3/20
第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	125,886	2030/2/20	第59回利付国債(30年)	0.7	730,000	735,372	2048/6/20
第3回利付国債(30年)	2.3	140,000	175,260	2030/5/20	第60回利付国債(30年)	0.9	910,000	964,163	2048/9/20
第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	252,614	2030/11/20	第44回利付国債(20年)	2.5	370,000	381,458	2020/3/20
第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	225,729	2031/5/20	第45回利付国債(20年)	2.4	270,000	278,051	2020/3/20
第6回利付国債(30年)	2.4	270,000	347,311	2031/11/20	第46回利付国債(20年)	2.2	290,000	299,761	2020/6/22
第7回利付国債(30年)	2.3	190,000	243,348	2032/5/20	第47回利付国債(20年)	2.2	470,000	488,626	2020/9/21
第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	209,651	2032/12/20	第48回利付国債(20年)	2.5	230,000	241,787	2020/12/21
第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	191,057	2033/3/20	第49回利付国債(20年)	2.1	280,000	293,804	2021/3/22
第11回利付国債(30年)	1.7	280,000	338,570	2033/6/20	第50回利付国債(20年)	1.9	590,000	616,526	2021/3/22
第12回利付国債(30年)	2.1	370,000	469,437	2033/9/20	第51回利付国債(20年)	2.0	240,000	252,624	2021/6/21
第13回利付国債(30年)	2.0	350,000	439,918	2033/12/20	第52回利付国債(20年)	2.1	430,000	456,144	2021/9/21
第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	461,212	2034/3/20	第53回利付国債(20年)	2.1	350,000	373,261	2021/12/20
第15回利付国債(30年)	2.5	500,000	668,370	2034/6/20	第54回利付国債(20年)	2.2	280,000	299,429	2021/12/20
第16回利付国債(30年)	2.5	250,000	335,007	2034/9/20	第55回利付国債(20年)	2.0	490,000	523,736	2022/3/21
第17回利付国債(30年)	2.4	420,000	557,289	2034/12/20	第56回利付国債(20年)	2.0	410,000	440,323	2022/6/20
第18回利付国債(30年)	2.3	340,000	446,831	2035/3/20	第57回利付国債(20年)	1.9	360,000	385,390	2022/6/20
第19回利付国債(30年)	2.3	300,000	394,740	2035/6/20	第58回利付国債(20年)	1.9	250,000	268,945	2022/9/20

当期末					当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
第59回利付国債(20年)	1.7	440,000	472,172	2022/12/20	第115回利付国債(20年)	2.2	270,000	333,331	2029/12/20
第60回利付国債(20年)	1.4	570,000	604,958	2022/12/20	第116回利付国債(20年)	2.2	260,000	321,822	2030/3/20
第61回利付国債(20年)	1.0	390,000	408,915	2023/3/20	第117回利付国債(20年)	2.1	580,000	711,480	2030/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	250,000	260,647	2023/6/20	第118回利付国債(20年)	2.0	500,000	609,535	2030/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	570,000	619,567	2023/6/20	第119回利付国債(20年)	1.8	320,000	382,854	2030/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	410,000	449,524	2023/9/20	第120回利付国債(20年)	1.6	380,000	446,036	2030/6/20
第65回利付国債(20年)	1.9	370,000	407,592	2023/12/20	第121回利付国債(20年)	1.9	750,000	907,650	2030/9/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	361,897	2023/12/20	第122回利付国債(20年)	1.8	400,000	479,460	2030/9/20
第67回利付国債(20年)	1.9	310,000	343,002	2024/3/20	第123回利付国債(20年)	2.1	650,000	803,913	2030/12/20
第68回利付国債(20年)	2.2	230,000	258,069	2024/3/20	第124回利付国債(20年)	2.0	320,000	392,000	2030/12/20
第69回利付国債(20年)	2.1	530,000	591,930	2024/3/20	第125回利付国債(20年)	2.2	260,000	325,559	2031/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	490,000	558,090	2024/6/20	第126回利付国債(20年)	2.0	320,000	393,004	2031/3/20
第71回利付国債(20年)	2.2	400,000	451,224	2024/6/20	第127回利付国債(20年)	1.9	400,000	486,452	2031/3/20
第72回利付国債(20年)	2.1	710,000	801,149	2024/9/20	第128回利付国債(20年)	1.9	560,000	682,259	2031/6/20
第73回利付国債(20年)	2.0	540,000	609,190	2024/12/20	第129回利付国債(20年)	1.8	290,000	349,766	2031/6/20
第74回利付国債(20年)	2.1	310,000	351,567	2024/12/20	第130回利付国債(20年)	1.8	780,000	942,201	2031/9/20
第75回利付国債(20年)	2.1	360,000	410,306	2025/3/20	第131回利付国債(20年)	1.7	360,000	430,380	2031/9/20
第76回利付国債(20年)	1.9	340,000	383,288	2025/3/20	第132回利付国債(20年)	1.7	600,000	718,662	2031/12/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	328,723	2025/3/20	第133回利付国債(20年)	1.8	690,000	835,210	2031/12/20
第78回利付国債(20年)	1.9	20,000	22,651	2025/6/20	第134回利付国債(20年)	1.8	260,000	315,335	2032/3/20
第79回利付国債(20年)	2.0	100,000	113,905	2025/6/20	第135回利付国債(20年)	1.7	495,000	593,965	2032/3/20
第80回利付国債(20年)	2.1	250,000	286,380	2025/6/20	第136回利付国債(20年)	1.6	450,000	534,163	2032/3/20
第81回利付国債(20年)	2.0	180,000	206,024	2025/9/20	第137回利付国債(20年)	1.7	460,000	552,966	2032/6/20
第82回利付国債(20年)	2.1	485,000	558,380	2025/9/20	第138回利付国債(20年)	1.5	510,000	599,688	2032/6/20
第83回利付国債(20年)	2.1	70,000	80,963	2025/12/20	第139回利付国債(20年)	1.6	330,000	392,363	2032/6/20
第84回利付国債(20年)	2.0	190,000	218,433	2025/12/20	第140回利付国債(20年)	1.7	1,155,000	1,390,862	2032/9/20
第85回利付国債(20年)	2.1	360,000	418,266	2026/3/20	第141回利付国債(20年)	1.7	730,000	880,540	2032/12/20
第86回利付国債(20年)	2.3	240,000	282,312	2026/3/20	第142回利付国債(20年)	1.8	450,000	548,901	2032/12/20
第87回利付国債(20年)	2.2	170,000	198,743	2026/3/20	第143回利付国債(20年)	1.6	1,110,000	1,324,796	2033/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	340,000	401,778	2026/6/20	第144回利付国債(20年)	1.5	340,000	401,111	2033/3/20
第89回利付国債(20年)	2.2	320,000	375,750	2026/6/20	第145回利付国債(20年)	1.7	1,090,000	1,318,006	2033/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	420,000	495,306	2026/9/20	第146回利付国債(20年)	1.7	1,150,000	1,392,661	2033/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	310,000	367,979	2026/9/20	第147回利付国債(20年)	1.6	1,140,000	1,366,073	2033/12/20
第92回利付国債(20年)	2.1	790,000	929,253	2026/12/20	第148回利付国債(20年)	1.5	1,090,000	1,290,810	2034/3/20
第93回利付国債(20年)	2.0	260,000	304,881	2027/3/20	第149回利付国債(20年)	1.5	1,120,000	1,327,670	2034/6/20
第94回利付国債(20年)	2.1	445,000	525,473	2027/3/20	第150回利付国債(20年)	1.4	1,420,000	1,663,544	2034/9/20
第95回利付国債(20年)	2.3	400,000	480,968	2027/6/20	第151回利付国債(20年)	1.2	1,100,000	1,255,067	2034/12/20
第96回利付国債(20年)	2.1	200,000	237,096	2027/6/20	第152回利付国債(20年)	1.2	1,180,000	1,345,683	2035/3/20
第97回利付国債(20年)	2.2	210,000	251,630	2027/9/20	第153回利付国債(20年)	1.3	1,260,000	1,457,001	2035/6/20
第98回利付国債(20年)	2.1	370,000	440,126	2027/9/20	第154回利付国債(20年)	1.2	1,420,000	1,620,177	2035/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	460,000	548,973	2027/12/20	第155回利付国債(20年)	1.0	1,360,000	1,507,111	2035/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	760,000	916,818	2028/3/20	第156回利付国債(20年)	0.4	1,130,000	1,138,215	2036/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	360,000	440,899	2028/3/20	第157回利付国債(20年)	0.2	1,330,000	1,293,026	2036/6/20
第102回利付国債(20年)	2.4	370,000	454,800	2028/6/20	第158回利付国債(20年)	0.5	1,060,000	1,081,942	2036/9/20
第103回利付国債(20年)	2.3	335,000	408,619	2028/6/20	第159回利付国債(20年)	0.6	1,340,000	1,388,253	2036/12/20
第104回利付国債(20年)	2.1	260,000	312,234	2028/6/20	第160回利付国債(20年)	0.7	1,160,000	1,220,958	2037/3/20
第105回利付国債(20年)	2.1	500,000	602,565	2028/9/20	第161回利付国債(20年)	0.6	985,000	1,017,899	2037/6/20
第106回利付国債(20年)	2.2	270,000	327,998	2028/9/20	第162回利付国債(20年)	0.6	1,250,000	1,288,925	2037/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	270,000	326,332	2028/12/20	第163回利付国債(20年)	0.6	955,000	983,382	2037/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	725,000	861,887	2028/12/20	第164回利付国債(20年)	0.5	860,000	868,342	2038/3/20
第109回利付国債(20年)	1.9	290,000	345,767	2029/3/20	第165回利付国債(20年)	0.5	770,000	776,175	2038/6/20
第110回利付国債(20年)	2.1	515,000	624,489	2029/3/20	第166回利付国債(20年)	0.7	1,600,000	1,670,720	2038/9/20
第111回利付国債(20年)	2.2	550,000	674,498	2029/6/20	小計		228,932,000	249,701,588	
第112回利付国債(20年)	2.1	550,000	668,789	2029/6/20	地方債証券				
第113回利付国債(20年)	2.1	1,055,000	1,286,994	2029/9/20	第1回東京都公募債(東京グリーンボンド(30年))	0.982	100,000	104,600	2047/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	610,000	746,457	2029/12/20					

銘柄	当期		期末		償還年月日	銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	評価額			利率	額面金額	評価額	評価額	
	%	千円	千円	千円			%	千円	千円	千円	
第3回東京都公募債(20年)	2.26	100,000	111,531	2024/3/19	平成24年度第2回埼玉県公募債	0.91	100,000	102,952	2022/5/18		
第7回東京都公募債(30年)	2.51	200,000	269,024	2038/9/17	平成24年度第6回埼玉県公募債	0.801	100,000	102,933	2022/10/26		
第11回東京都公募債(20年)	2.22	200,000	235,618	2027/3/19	平成27年度第8回埼玉県公募債	0.41	200,000	205,536	2026/1/28		
第17回東京都公募債(20年)	2.09	100,000	119,102	2028/12/20	平成29年度第5回埼玉県公募債	0.22	100,000	101,353	2027/7/26		
第18回東京都公募債(20年)	2.22	200,000	241,516	2029/3/19	平成19年度第1回福岡県公募債(30年)	0.62	100,000	136,047	2037/9/18		
第20回東京都公募債(20年)	2.09	100,000	120,110	2029/9/20	平成20年度第1回福岡県公募債(30年)	2.28	200,000	260,654	2038/9/17		
第21回東京都公募債(20年)	2.19	100,000	121,507	2029/12/20	平成22年度第2回福岡県公募債(15年)	1.765	100,000	112,254	2026/1/26		
第69回東京都公募債	1.19	100,000	102,810	2021/6/18	平成23年度第1回福岡県公募債(15年)	1.491	100,000	111,435	2026/11/27		
第703回東京都公募債	0.99	100,000	102,837	2021/12/20	第6回千葉県公募債(20年)	2.26	100,000	121,158	2029/4/20		
第714回東京都公募債	0.74	100,000	102,812	2022/12/20	第8回千葉県公募債(20年)	2.18	100,000	121,697	2030/4/19		
第722回東京都公募債	0.8	200,000	206,870	2023/6/20	平成26年度第9回千葉県公募債	0.465	100,000	102,773	2025/3/25		
第740回東京都公募債	0.463	100,000	102,614	2024/12/20	平成28年度第1回千葉県公募債	0.068	100,000	100,476	2026/5/25		
第751回東京都公募債	0.37	100,000	102,449	2025/12/19	平成29年度第5回千葉県公募債	0.215	120,000	121,327	2027/12/24		
平成22年度第8回北海道公募債	0.96	100,000	101,643	2020/10/29	平成27年度第3回新潟県公募債	0.12	200,000	201,502	2026/3/25		
平成23年度第4回北海道公募債	1.21	100,000	102,873	2021/6/30	平成24年度第1回岐阜県公募債(10年)	0.82	139,630	143,739	2022/9/28		
平成27年度第15回北海道公募債	0.22	300,000	304,248	2026/8/26	第95回共同発行市場公募債地方債	1.28	100,000	102,636	2021/2/25		
第16回神奈川県公募債(20年)	2.09	100,000	121,519	2031/1/24	第96回共同発行市場公募債地方債	1.29	100,000	102,754	2021/3/25		
第21回神奈川県公募債(20年)	1.732	100,000	118,465	2032/9/17	第98回共同発行市場公募債地方債	1.18	100,000	102,710	2021/5/25		
第175回神奈川県公募債	1.09	100,000	101,503	2020/6/19	第99回共同発行市場公募債地方債	1.17	100,000	102,784	2021/6/25		
第184回神奈川県公募債	1.02	100,000	102,402	2021/6/18	第100回共同発行市場公募債地方債	1.21	100,000	102,976	2021/7/23		
第190回神奈川県公募債	0.88	100,000	102,930	2022/6/20	第101回共同発行市場公募債地方債	1.05	100,000	102,675	2021/8/25		
第196回神奈川県公募債	0.678	100,000	102,732	2023/3/20	第102回共同発行市場公募債地方債	1.03	100,000	102,710	2021/9/24		
第356回大阪府公募債(10年)	1.06	130,000	133,937	2021/12/27	第103回共同発行市場公募債地方債	1.0	177,400	182,214	2021/10/25		
第363回大阪府公募債(10年)	0.77	114,000	117,035	2022/8/30	第105回共同発行市場公募債地方債	1.07	100,000	103,080	2021/12/24		
第371回大阪府公募債(10年)	0.58	200,000	204,676	2023/4/26	第110回共同発行市場公募債地方債	0.89	300,000	308,706	2022/5/25		
第376回大阪府公募債(10年)	0.82	100,000	103,689	2023/9/27	第111回共同発行市場公募債地方債	0.89	200,000	205,948	2022/6/24		
第403回大阪府公募債(10年)	0.462	300,000	309,057	2025/12/25	第116回共同発行市場公募債地方債	0.8	100,000	102,993	2022/11/25		
第417回大阪府公募債(10年)	0.248	108,000	109,635	2027/2/26	第117回共同発行市場公募債地方債	0.72	500,000	513,690	2022/12/22		
平成27年度第4回京都府公募債	0.553	100,000	103,442	2025/6/19	第118回共同発行市場公募債地方債	0.84	200,000	206,568	2023/1/25		
平成27年度第13回京都府公募債	0.11	105,860	106,577	2026/3/17	第120回共同発行市場公募債地方債	0.68	100,000	102,748	2023/3/24		
第4回兵庫県公募債(15年)	1.31	100,000	110,501	2027/12/24	第125回共同発行市場公募債地方債	0.82	200,000	207,332	2023/8/25		
平成22年度第19回兵庫県公募債	1.26	100,000	102,455	2021/1/21	第133回共同発行市場公募債地方債	0.689	100,000	103,511	2024/4/25		
平成25年度第14回兵庫県公募債	0.73	100,000	103,494	2024/1/22	第140回共同発行市場公募債地方債	0.505	100,000	102,829	2024/11/25		
平成26年度第2回兵庫県公募債	0.63	100,000	103,189	2024/5/20	第145回共同発行市場公募債地方債	0.406	100,000	102,443	2025/4/25		
平成28年度第30回兵庫県公募債	0.215	100,000	101,257	2027/3/19	第153回共同発行市場公募債地方債	0.469	300,000	309,417	2025/12/25		
第12回静岡県公募債(30年)	0.822	100,000	100,993	2048/3/19	第161回共同発行市場公募債地方債	0.06	300,000	300,909	2026/8/25		
平成23年度第1回静岡県公募債	1.385	100,000	103,061	2021/4/21	第167回共同発行市場公募債地方債	0.245	100,000	101,653	2027/2/25		
平成23年度第5回静岡県公募債	1.158	100,000	102,765	2021/6/28	第175回共同発行市場公募債地方債	0.215	150,000	151,825	2027/10/25		
平成24年度第10回静岡県公募債	0.678	100,000	102,736	2023/3/22	第181回共同発行市場公募債地方債	0.18	100,000	100,577	2028/4/25		
平成25年度第1回静岡県公募債	0.581	100,000	102,375	2023/4/19	平成24年度第2回熊本県公募債(10年)	0.8	100,000	102,929	2022/10/26		
平成27年度第6回静岡県公募債	0.494	100,000	103,066	2025/6/20	平成23年度第1回静岡県公募債	1.045	100,000	102,926	2021/11/25		
平成22年度第14回愛知県公募債(20年)	2.087	100,000	121,353	2030/12/13	第7回大阪市公募債(30年)	0.973	100,000	104,879	2047/9/20		
平成23年度第4回愛知県公募債(10年)	1.182	100,000	102,823	2021/6/28	第1回名古屋市公募債(20年)	1.99	100,000	109,663	2023/12/20		
平成23年度第8回愛知県公募債(10年)	1.087	100,000	102,774	2021/8/26	第13回名古屋市公募債(30年)	0.977	100,000	103,877	2047/9/20		
平成24年度第2回愛知県公募債(10年)	0.982	100,000	103,134	2022/4/27	第48回名古屋市公募債(10年)	0.539	100,000	102,570	2023/3/20		
平成25年度第16回愛知県公募債(10年)	0.665	100,000	103,124	2023/11/28	第48回名古屋市公募債(10年)	0.698	100,000	103,267	2024/9/20		
平成27年度第17回愛知県公募債(10年)	0.38	200,000	205,112	2026/1/27	第49回名古屋市公募債(10年)	0.11	100,000	100,678	2026/3/19		
平成29年度第6回愛知県公募債(10年)	0.22	100,000	101,311	2027/7/28	第2回京都市公募債(20年)	2.12	100,000	113,998	2025/9/19		
平成25年度第16回愛知県公募債(10年)	0.26	100,000	101,436	2028/2/14	平成27年度第5回京都市公募債	0.205	200,000	202,692	2026/2/25		
平成20年度第1回広島県公募債(20年)	2.34	100,000	121,028	2028/9/21	平成20年度第1回神戸市公募債(20年)	2.38	100,000	120,832	2028/5/26		
平成23年度第1回広島県公募債	1.19	272,000	279,450	2021/5/27	第5回横浜市公募債(20年)	2.17	100,000	113,795	2025/6/20		
平成24年度第2回広島県公募債	0.84	100,000	102,872	2022/7/25	平成23年度第1回横浜市公募債	1.189	100,000	102,727	2021/5/24		
平成27年度第2回広島県公募債	0.602	162,000	168,175	2025/7/24	平成25年度第6回横浜市公募債	0.718	100,000	103,427	2023/12/22		
平成29年度第7回広島県公募債	0.2	131,440	132,570	2028/3/23	第25回横浜市公募債(20年)	1.72	100,000	118,163	2032/7/16		
第9回埼玉県公募債(30年)	0.845	100,000	101,901	2048/3/19	第26回横浜市公募債(20年)	1.776	100,000	119,287	2033/1/28		
平成23年度第9回埼玉県公募債	0.99	100,000	102,931	2022/1/27	平成23年度第4回札幌市公募債(10年)	1.02	100,000	102,402	2021/6/18		

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7回札幌市公債(10年)	0.75	100,000	102,670	千円	2022/9/20
第88回川崎市公債	0.464	100,000	103,097	千円	2025/12/19
平成29年度第12回福岡市公債	0.2	130,000	131,056	千円	2028/3/28
平成30年度第9回福岡市公債(10年)	0.289	100,000	101,431	千円	2028/10/30
平成23年度第5回広島市公債	1.01	151,900	156,555	千円	2022/2/25
平成27年度第2回広島市公債	0.464	100,000	103,104	千円	2025/12/25
平成23年度第1回千葉市公債	1.37	100,000	103,027	千円	2021/4/21
平成27年度第1回三重県公債	0.464	100,000	103,104	千円	2025/12/25
平成24年度第1回福井県公債	0.8	100,000	102,929	千円	2022/10/26
平成24年度第1回山梨県公債(10年)	0.8	100,000	102,934	千円	2022/10/28
平成27年度第1回山梨県公債(10年)	0.495	100,000	103,245	千円	2025/10/30
平成23年度第2回岡山県公債(10年)	1.01	100,000	103,150	千円	2022/3/30
小計		15,792,230	16,691,593		
<b>特殊債券(除く金融債)</b>					
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	104,788	千円	2021/4/16
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	200,000	208,224	千円	2023/6/27
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	210,000	222,568	千円	2021/12/22
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	119,898	千円	2027/10/29
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	119,415	千円	2029/7/31
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	241,396	千円	2029/9/28
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	200,000	244,202	千円	2030/1/31
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	132,952	千円	2040/2/29
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	131,200	千円	2040/5/31
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	120,386	千円	2030/6/28
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	129,616	千円	2040/11/30
第133回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	103,054	千円	2021/4/30
第139回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.1	100,000	102,891	千円	2021/7/30
第147回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	102,909	千円	2021/10/29
第149回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	125,000	128,752	千円	2021/11/30
第157回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	100,000	102,938	千円	2022/2/28
第161回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.977	100,000	103,340	千円	2022/4/28
第163回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.901	100,000	103,178	千円	2022/5/31
第168回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.839	100,000	103,113	千円	2022/7/29
第175回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.791	200,000	206,318	千円	2022/10/31
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.68	100,000	118,430	千円	2032/11/30
第182回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.834	200,000	207,086	千円	2023/1/31
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	100,000	119,187	千円	2033/1/31
第186回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	209,000	215,190	千円	2023/3/17
第189回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	200,000	205,004	千円	2023/4/28

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
第190回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	100,000	102,835	千円	2023/5/31
第195回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	100,000	104,329	千円	2023/7/31
第200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	103,969	千円	2023/9/29
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	102,606	千円	2026/1/30
第271回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	200,000	201,008	千円	2026/3/31
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	100,510	千円	2026/4/30
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	300,000	303,495	千円	2027/1/29
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	243,000	246,525	千円	2028/2/29
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.219	100,000	101,441	千円	2028/10/31
第16回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	101,719	千円	2020/9/14
第20回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	102,485	千円	2021/1/20
第22回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.3	100,000	102,873	千円	2021/3/12
第26回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	102,845	千円	2021/7/16
第27回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	102,681	千円	2021/8/13
第34回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.9	200,000	205,944	千円	2022/3/14
第37回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	217,000	223,948	千円	2022/6/17
第46回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	100,000	102,962	千円	2023/3/17
第49回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.882	100,000	104,084	千円	2023/6/16
第50回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.911	101,000	105,327	千円	2023/7/14
第56回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.747	193,000	200,646	千円	2024/1/19
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	421,000	433,478	千円	2025/12/12
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	200,000	201,002	千円	2026/3/13
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,949	千円	2026/12/14
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	200,000	202,982	千円	2028/2/15
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.12	100,000	100,676	千円	2028/4/14
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	150,000	151,011	千円	2028/7/18
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	100,000	101,397	千円	2028/8/15
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	101,437	千円	2028/10/16
第18回政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	102,972	千円	2023/3/22
第69回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.06	300,000	300,222	千円	2026/7/17
第75回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.2	100,000	101,032	千円	2027/1/18
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.9	100,000	151,586	千円	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	175,719	千円	2026/3/19
第17回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.35	500,000	587,230	千円	2026/9/18
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.28	100,000	117,960	千円	2027/4/20
第21回道路債券	2.75	100,000	132,819	千円	2033/6/10
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	290,842	千円	2047/3/20
第27回道路債券	2.42	100,000	112,275	千円	2024/3/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	119,254	千円	2027/10/20
第28回道路債券	2.83	300,000	404,250	千円	2033/12/20
第33回道路債券	2.91	100,000	136,617	千円	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	120,947	千円	2028/6/20
第38回道路債券	2.26	100,000	112,537	千円	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	120,904	千円	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	122,265	千円	2029/5/18
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	102,758	千円	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	121,134	千円	2029/4/27
第4回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.12	100,000	120,283	千円	2029/12/28
第5回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	109,575	千円	2023/9/20

当 期		末		償還年月日	当 期		末		償還年月日
銘	利率	額面金額	評 価 額		銘	利率	額面金額	評 価 額	
		千円	千円			千円	千円		
第5回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.22	200,000	242,894	2030/1/28	第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	15,398	16,196	2041/5/10
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	100,000	121,641	2030/4/26	第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	46,854	49,506	2045/11/10
第9回公営企業債券(20年)	2.33	100,000	112,958	2024/9/24	第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	45,416	48,309	2045/12/10
第11回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	112,802	2025/3/24	第43回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	122,312	2030/1/10
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	121,127	2030/12/27	第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	134,211	143,770	2046/2/18
第15回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	114,112	2025/9/24	第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	151,488	161,674	2046/2/10
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.03	300,000	362,619	2031/6/27	第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	15,734	16,590	2041/10/10
第17回公営企業債券(20年)	2.39	200,000	233,666	2026/3/24	第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	34,877	37,116	2046/6/10
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	119,103	2031/9/26	第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	35,414	37,568	2046/7/10
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	300,000	351,921	2032/7/28	第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	45,636	47,974	2042/2/10
第24回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	119,674	2028/2/25	第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.64	38,313	40,704	2046/8/10
第43回地方公共団体金融機構債券	0.72	100,000	102,628	2022/12/28	第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.09	16,139	16,969	2042/4/10
第19回国際協力銀行債券	1.67	100,000	101,903	2020/3/19	第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	43,134	45,655	2046/10/10
第343回都市再生債券	1.29	100,000	102,119	2020/9/18	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	45,777	48,487	2046/11/10
第38回関西国際空港株式会社債	1.112	100,000	103,071	2021/12/20	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	49,716	52,615	2046/12/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	13,297	13,654	2036/5/10	第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	47,520	50,326	2047/2/10
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	77,070	80,633	2042/5/10	第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	54,762	57,178	2047/12/10
第1回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.08	31,468	33,104	2037/11/10	第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	55,863	58,887	2048/2/10
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	16,145	17,148	2037/11/10	第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	49,905	52,429	2048/3/10
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	40,302	41,668	2036/5/10	第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	47,898	49,905	2048/4/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	13,942	14,396	2036/11/10	第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	49,749	51,873	2048/5/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	14,395	15,118	2037/5/10	第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	55,433	58,475	2048/6/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	119,661	2027/6/18	第85回一般担保住宅金融支援機構債券	1.841	100,000	118,685	2031/10/17
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	9,694	9,725	2037/8/10	第87回一般担保住宅金融支援機構債券	1.53	100,000	111,072	2026/9/18
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	57,924	60,817	2037/5/10	第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	119,007	2031/11/18
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	15,204	16,008	2037/5/10	第102回一般担保住宅金融支援機構債券	1.441	100,000	110,933	2027/3/19
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	34,166	35,819	2042/12/10	第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	82,475	85,481	2051/1/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	15,090	15,837	2037/5/10	第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	176,850	177,905	2051/6/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	22,630	22,916	2038/2/10	第110回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	90,091	89,593	2051/8/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	15,640	16,469	2037/5/10	第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	90,767	91,366	2051/10/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	12,228	12,343	2038/6/10	第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	91,031	91,416	2051/11/10
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	12,027	12,280	2038/9/10	第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	91,169	91,964	2051/12/10
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.15	19,251	20,510	2040/11/10	第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	91,617	92,815	2052/1/10
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	60,228	62,145	2032/11/10	第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	92,192	93,308	2052/2/10
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	12,182	12,475	2039/5/10	第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	92,606	93,801	2052/3/10
第18回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.57	20,303	20,882	2032/11/10	第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	93,691	94,583	2052/6/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	27,388	28,504	2039/7/10	第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	95,294	96,211	2052/11/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	2.6	100,000	123,149	2028/9/20	第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	95,788	96,483	2052/12/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	24,149	26,146	2044/5/10	第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	95,699	96,543	2053/1/10
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.72	13,652	14,050	2039/12/10	第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	97,648	98,442	2053/6/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	26,273	28,556	2044/6/10	第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	98,534	99,097	2053/8/10
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	50,054	53,917	2044/7/10	第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	98,875	99,816	2053/9/10
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	15,575	16,162	2040/3/10	第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	99,860	100,946	2053/12/10
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	44,115	45,567	2040/4/10	第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	100,000	100,433	2054/1/10
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	15,526	16,058	2040/6/10	第45回中国日本高速道路株式会社債	0.904	100,000	103,082	2022/9/20
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	50,223	52,049	2040/7/10	第18回西日本高速道路株式会社債	0.893	200,000	206,820	2023/3/20
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	18,316	19,140	2040/9/10	第29回西日本高速道路株式会社債	0.31	100,000	101,649	2026/2/12
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	34,503	37,007	2045/3/10	第32回西日本高速道路株式会社債	0.2	100,000	100,768	2026/10/19
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	34,634	36,954	2045/4/10	第34回西日本高速道路株式会社債	0.335	100,000	101,799	2027/2/16
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	15,575	16,190	2040/11/10					
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	35,039	37,258	2045/5/10					
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	16,218	16,908	2040/12/10					
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	46,773	48,583	2041/2/10					
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	74,054	78,054	2045/8/10					
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	35,750	37,658	2041/3/10					
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	17,056	17,937	2041/4/10					
					小 計		17,880,493	19,528,651	
					金融債券				
					貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.22	100,000	100,295	2020/11/27
					貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.22	100,000	100,307	2020/12/25
					貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	100,000	100,298	2020/4/27
					回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,347	2020/7/27
					回信金中金債(5年)	0.03	100,000	99,959	2021/9/27

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	評価額	
	%	千円	千円		
第327回信金中金債(5年)	0.06	200,000	199,884		2022/2/25
第328回信金中金債(5年)	0.06	100,000	99,936		2022/3/25
第331回信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,001		2022/6/27
第339回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,081		2023/2/27
第342回信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,086		2023/5/26
第218号商工債(3年)	0.12	400,000	400,172		2021/3/26
第221号商工債(3年)	0.11	200,000	200,048		2021/6/25
<b>小計</b>		<b>1,700,000</b>	<b>1,701,414</b>		
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
第500回中部電力株式会社社債	0.875	100,000	103,507		2024/5/24
第518回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,139		2023/1/25
第495回関西電力株式会社社債	0.746	100,000	101,627		2021/9/17
第505回関西電力株式会社社債	0.24	100,000	100,180		2023/8/25
第509回関西電力株式会社社債	0.47	100,000	100,403		2027/5/25
第510回関西電力株式会社社債	0.49	100,000	100,492		2027/7/23
第377回中国電力株式会社社債	1.121	100,000	104,257		2023/8/25
第393回中国電力株式会社社債	0.26	100,000	99,465		2026/11/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	105,749		2026/6/25
第321回北陸電力株式会社社債	0.365	100,000	100,321		2027/4/23
第479回東北電力株式会社社債	0.372	200,000	201,732		2022/4/25
第253回四国電力株式会社社債	1.0	100,000	103,660		2023/6/23
第371回九州電力株式会社社債	1.43	100,000	105,043		2022/12/22
第431回九州電力株式会社社債	0.811	100,000	103,095		2024/12/25
第436回九州電力株式会社社債	0.39	100,000	100,804		2022/1/25
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	99,803		2028/8/25
第316回北海道電力株式会社社債	1.164	100,000	101,561		2020/6/25
第323回北海道電力株式会社社債	1.337	100,000	108,344		2030/3/25
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	100,000	103,707		2023/5/9
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	100,427		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	100,054		2020/6/12
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	100,000	100,623		2024/2/23
第21回株式会社ニチレイ無担保社債	0.659	100,000	100,933		2020/9/4
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	100,859		2025/8/29
第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,341		2027/2/26
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,580		2023/8/30
第9回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.671	100,000	102,436		2023/3/20
第43回住友化学株式会社無担保社債	1.58	100,000	101,871		2020/4/23
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	100,000	100,348		2024/7/24
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	100,000	100,231		2024/5/31
第1回ヤフー株式会社無担保社債	0.04	100,000	99,895		2020/2/23
第5回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	100,000	100,003		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	100,181		2022/8/3
第9回住友理工株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,708		2027/9/21
第14回旭硝子株式会社無担保社債	1.005	100,000	104,108		2023/6/19
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	1.293	100,000	102,606		2021/3/12
第21回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.804	100,000	103,010		2024/3/13
第9回株式会社LIXILグループ無担保社債	0.08	100,000	99,818		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	102,648		2022/9/20
第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	100,000	103,218		2023/12/13
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	100,000	101,346		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	100,265		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	100,404		2023/9/20

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	評価額	
	%	千円	千円		
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	0.609	100,000	100,844		2020/10/30
第12回株式会社アソシエート無担保社債	0.001	100,000	99,814		2021/9/17
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	0.34	100,000	100,605		2027/6/7
第32回三菱重工業株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,919		2021/8/31
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	100,000	100,232		2022/8/4
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.135	100,000	101,580		2020/7/29
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.221	100,000	102,902		2021/9/14
第1回ユニバーファミリーマートホールディングス無担保社債	0.14	100,000	100,218		2022/2/22
第69回三井物産株式会社無担保社債	2.139	100,000	119,631		2031/7/22
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	104,897		2022/3/16
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	113,419		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	102,181		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	102,844		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	103,532		2021/6/9
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.52	100,000	104,038		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	107,904		2022/10/27
第1回三井住友FG無担保社債(実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	102,387		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	104,839		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	102,223		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	102,854		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	103,428		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	112,954		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	102,997		2020/8/7
第1回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,973		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	99,473		2021/9/17
第42回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.05	100,000	99,868		2022/6/20
第25回リコーリース株式会社無担保社債	0.13	100,000	99,941		2022/2/23
第50回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.888	100,000	103,448		2024/3/19
第21回三井住友フィナンサーズ株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,074		2023/11/27
第39回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.12	100,000	100,058		2021/6/9
第48回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,093		2022/1/26
第14回株式会社和証券グループ本社無担保社債	1.252	100,000	101,475		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	102,477		2020/6/24
第47回三井不動産株式会社無担保社債	1.954	100,000	118,571		2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	118,021		2027/9/17
第104回三菱地所株式会社無担保社債	1.095	100,000	102,984		2021/12/22
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	103,332		2024/4/26
第13回日本ビルファンド投資法人無担保社債	1.168	100,000	104,211		2023/6/26
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	102,969		2022/6/7
第21回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.02	100,000	107,276		2022/9/20
第9回東日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	100,000	117,150		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	121,247		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	102,966		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	105,518		2058/1/25

銘 柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第13回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	103,897	2058/9/27
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.21	100,000	110,909	2024/3/20
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	97,074	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	103,298	2047/11/29
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	100,000	120,940	2030/4/23
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	118,726	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	100,000	121,026	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	116,557	2032/5/25
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	103,586	2058/5/24
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.819	100,000	103,075	2023/10/25
第4回株式会社日立物流無担保社債	0.33	100,000	100,663	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	101,845	2020/9/10
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	200,000	201,928	2028/11/22
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	111,050	2025/6/20
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	103,646	2023/12/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,230	2028/7/20
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	1.238	100,000	102,940	2021/9/3
第6回S C S K株式会社無担保社債	0.14	100,000	100,214	2022/7/21
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	100,593	2028/6/6
第20回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.16	100,000	99,835	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	99,942	2024/10/11
第1回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.214	200,000	199,114	2022/6/30
第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.437	100,000	100,422	2020/12/11

銘 柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,855	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	99,403	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	99,800	2021/7/9
第12回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.202	200,000	199,256	2022/6/9
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	100,344	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	98,670	2023/1/11
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	100,215	2021/1/22
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	200,000	200,178	2023/7/6
第3回ロイヤルバンク・オブ・カナダ円貨社債	0.289	100,000	100,204	2020/10/29
小 計		12,500,000	12,895,604	
合 計		276,804,723	300,518,850	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
10年国債標準物	915	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 300,518,850	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,359,139	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	302,877,989	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 2019年1月22日現在
(A) 資 産	302,978,036,022円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,132,350,784
公 社 債(評価額)	300,518,850,836
未 収 入 金	598,721,256
未 収 利 息	620,450,552
前 払 費 用	7,665,594
差 入 委 託 証 拠 金	99,997,000
(B) 負 債	554,347,904
未 払 解 約 金	454,267,134
未 払 利 息	3,048
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
そ の 他 未 払 費 用	30,722
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	302,423,688,118
元 本	220,780,734,427
次 期 繰 越 損 益 金	81,642,953,691
(D) 受 益 権 総 口 数	220,780,734,427口
1万口当たり基準価額(C/D)	13.698円

## ■損益の状況

項 目	当 期 自 2018年1月23日 至 2019年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	2,814,245,294円
受 取 利 息	2,815,551,481
支 払 利 息	△1,306,187
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,400,303,264
売 買 益	2,357,545,492
売 買 損	△957,242,228
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	9,640,768
取 引 益	21,265,524
取 引 損	△11,624,756
(D) そ の 他 費 用	△125,747
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	4,224,063,579
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	81,124,284,047
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,251,075,082
(H) 解 約 差 損 益 金	△9,956,469,017
(I) 計 (E+F+G+H)	81,642,953,691
次 期 繰 越 損 益 金(I)	81,642,953,691

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

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

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

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は231,135,066,038円、期中追加設定元本額は17,557,940,424円、期中一部解約元本額は27,912,272,035円です。

※担保に供している資産

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

国債証券 101,332,000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)	45,375,088,552円
DC日本債券インデックスファンドL	36,388,123,456円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	31,422,785,888円
インデックスコレクション (バランス株式30)	21,686,899,130円
インデックスコレクション (国内債券)	16,904,326,452円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	13,023,577,087円
DCバランスファンド30	7,649,360,391円
DCバランスファンド50	4,942,669,806円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	4,511,660,082円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	4,182,615,112円
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	3,489,199,399円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	3,297,378,102円

VAファンド25 (適格機関投資家専用)	3,127,909,664円
日本債券パッシブファンド私募A (適格機関投資家専用)	2,991,733,542円
DC日本債券インデックスファンド	2,858,422,111円
インデックスコレクション (バランス株式50)	2,470,447,219円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	1,837,467,720円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	1,735,320,922円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	1,578,356,969円
日本債券インデックスe	1,438,171,289円
DCバランスファンド70	1,185,719,473円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	1,172,751,016円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	946,117,551円
日本債券インデックスファンド	915,924,593円
インデックスコレクション (バランス株式70)	913,108,278円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	723,827,446円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	574,572,485円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	538,012,893円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	442,740,246円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	424,867,197円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	399,787,403円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	354,787,353円
バランスVA20L (適格機関投資家専用)	251,749,511円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	238,126,917円
バランスVA20 (適格機関投資家専用)	202,510,743円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	195,320,313円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	189,705,037円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	151,742,794円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	43,307,721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)	4,542,564円

## お知らせ

投資助言に係る記載を削除することに伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2018年4月11日)

当ファンドの委託会社であります三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社は、2018年10月1日付で、三井住友信託銀行株式会社の運用事業に係る権利義務を承継いたしました。

なお、三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社が本件承継前に三井住友信託銀行より受けていた投資助言(関連して三井住友信託銀行株式会社がその他の運用会社等から受けていた投資助言がある場合には同助言を含みます。)については、承継後の運用体制においても実質的に引き継がれております。

このため、本件承継に伴いファンドの運用方針、運用プロセス等に変更はありません。