

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6期(決算日 2016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	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	債 組 比			
	円	円	%		%	%	%	百万円
第2期(2012年1月23日)	10,328	0	2.1	336.892	2.5	97.8	1.0	529
第3期(2013年1月22日)	10,513	0	1.8	344.574	2.3	99.1	0.3	906
第4期(2014年1月22日)	10,676	0	1.6	351.482	2.0	99.2	0.2	1,279
第5期(2015年1月22日)	11,020	0	3.2	364.399	3.7	99.3	0.2	2,908
第6期(2016年1月22日)	11,155	0	1.2	370.303	1.6	99.0	0.5	2,639

(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	%		%	%	%
2015年1月22日	11,020	—	364.399	—	99.3	0.2
1月末	11,042	0.2	365.067	0.2	99.1	0.5
2月末	10,978	△0.4	363.039	△0.4	99.1	0.4
3月末	10,980	△0.4	363.279	△0.3	99.2	0.3
4月末	11,012	△0.1	364.501	0.0	99.1	0.4
5月末	10,958	△0.6	362.770	△0.4	98.8	0.7
6月末	10,948	△0.7	362.542	△0.5	99.1	0.5
7月末	10,976	△0.4	363.584	△0.2	99.1	0.5
8月末	10,991	△0.3	364.201	△0.1	98.9	0.6
9月末	11,018	△0.0	365.235	0.2	99.0	0.7
10月末	11,057	0.3	366.655	0.6	99.1	0.6
11月末	11,051	0.3	366.578	0.6	99.1	0.7
12月末	11,115	0.9	368.877	1.2	98.9	0.6
(当期末)						
2016年1月22日	11,155	1.2	370.303	1.6	99.0	0.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

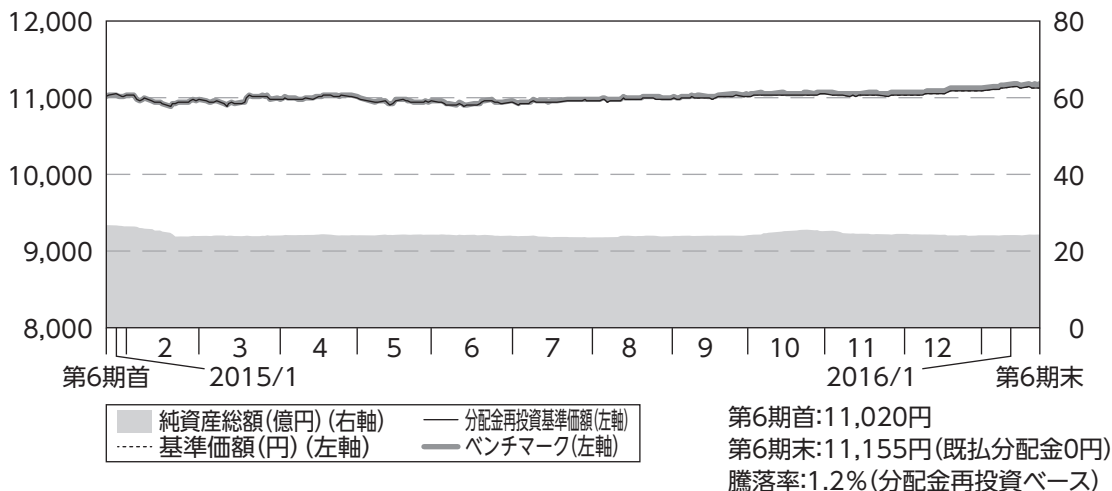
(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

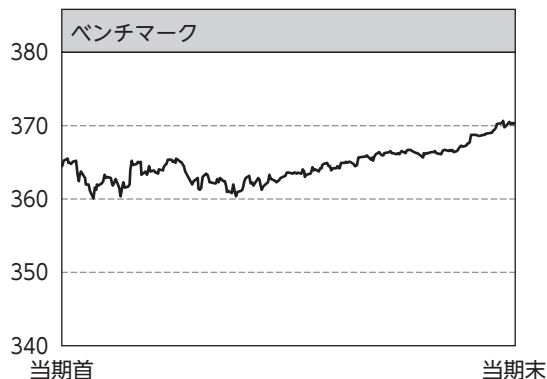


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2015年1月22日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

当期初から2015年2月中旬にかけて、高値警戒感から国内金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しましたが、その後は7月上旬にかけて、ユーロ圏のデフレ懸念後退から欧米金利が上昇したことが金利上昇要因となる一方、ギリシャ債務問題などが金利低下(債券価格は上昇)要因となり、基準価額はもみ合い推移となりました。7月中旬から2015年12月まで、原油価格の急落や中国の景気減速懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことに加え、9月に米国の利上げが見送られたことや日銀の追加金融緩和観測が高まったことを背景に金利低下基調となり、基準価額は上昇しました。12月から期末にかけては、ECB(欧州中央銀行)が実施した追加金融緩和が市場予想を下回る内容となった影響から国内金利が上昇する局面がありましたが、12月下旬に日銀が金融緩和の補完措置として国債買い入れの平均残存期間を長期化したことや、その後も中国株や原油価格の急落を背景にリスク回避姿勢が強まったことから国内金利は一段と低下し、基準価額はさらに上昇しました。

投資環境



2015年2月中旬にかけて、高値警戒感から10年国債利回りは上昇しましたが、その後はもみ合い推移となりました。7月中旬から12月にかけては、中国景気に対する警戒感に加え、9月の米国による利上げ見送りや日銀による追加金融緩和観測を背景に10年国債利回りは低下基調となりました。12月上旬にはECBが実施した追加金融緩和が市場予想を下回る内容となった影響から10年国債利回りが上昇する局面がありましたが、12月下旬に日銀が金融緩和の補完措置を導入したことや、その後も中国株や原油価格の急落を背景にリスク回避姿勢が強まったことから10年国債利回りは一段と低下し、過去最低を更新しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

【「日本債券マザーファンド」の運用状況】

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

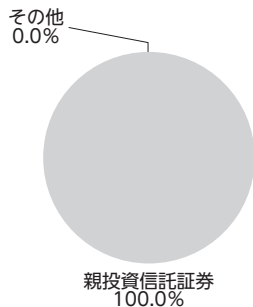
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

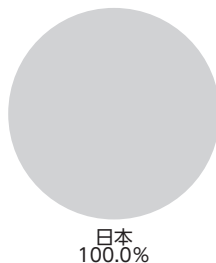
	当期末
	2016年1月22日
日本債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

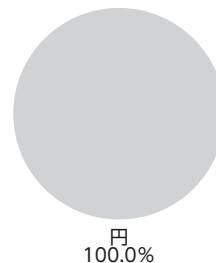
○資産別配分



○国別配分



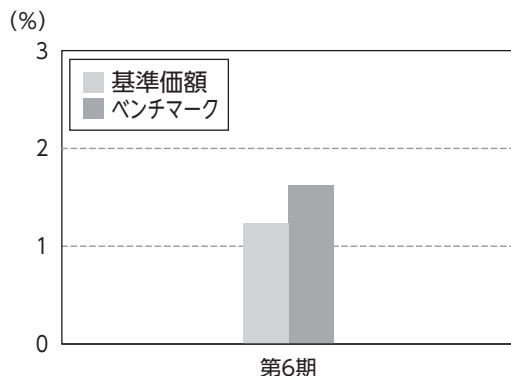
○通貨別配分



(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とベンチマークの騰落率の対比です。



(注)基準価額の騰落率は分配金込みです。

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6期	
	2015年1月23日～2016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)	1,154	

(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
	(2015年1月23日～2016年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	44円	0.400%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は11,010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 = $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用 = $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 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
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
合計	45	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 458,280	千円 594,918	千口 699,021	千円 904,009

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	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 2,829	百万円 129	% 4.6	百万円 2,862	百万円 128	% 4.5

(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	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 569,852	百万円 25,565	% 4.5	百万円 571,465	百万円 25,250	% 4.4

<平均保有割合 0.8%>

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

(注2) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 2,244,918	千口 2,004,177	千円 2,639,501

(注) 親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、239,575,703千口です。

※ 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 2,639,501	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	9,866	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	2,649,367	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 2016年1月22日現在
(A) 資 産	2,649,367,198円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	8,151,209
日本債券マザーファンド(評価額)	2,639,501,853
未 収 入 金	1,714,124
未 収 利 息	12
(B) 負 債	9,780,076
未 払 解 約 金	4,396,752
未 払 信 託 報 酬	5,311,608
そ の 他 未 払 費 用	71,716
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	2,639,587,122
元 本	2,366,307,760
次 期 繰 越 損 益 金	273,279,362
(D) 受 益 権 総 口 数	2,366,307,760口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,155円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年1月23日 至 2016年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	6,096円
受 取 利 息	6,096
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	42,995,748
売 買 益	52,192,880
売 買 損	△9,197,132
(C) 信 託 報 酬 等	△10,695,552
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	32,306,292
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	32,626,992
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	208,346,078
(配 当 等 相 当 額)	(89,031,711)
(売 買 損 益 相 当 額)	(119,314,367)
(G) 計 (D+E+F)	273,279,362
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	273,279,362
追 加 信 託 差 損 益 金	208,346,078
(配 当 等 相 当 額)	(89,537,682)
(売 買 損 益 相 当 額)	(118,808,396)
分 配 準 備 積 立 金	64,933,284

(注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は2,638,969,119円、期中追加設定元本額は1,193,621,007円、期中一部解約元本額は1,466,282,366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)	22,580,537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)	9,725,755円
(C) 収益調整金額	208,346,078円
(D) 分配準備積立金額	32,626,992円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	273,279,362円
(F) 期末残存口数	2,366,307,760口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	1,154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

一般社団法人投資信託協会「デリバティブ取引等に係る投資制限に関するガイドライン」の一部改正及び「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2015年4月23日)

日本債券マザーファンド

運用報告書

第15期（決算日 2016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11期(2012年1月23日)	11,981	2.6	336.892	2.5	98.3	1.0	359,863
第12期(2013年1月22日)	12,254	2.3	344.574	2.3	99.1	0.3	350,008
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

(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) 2015年 1月22日	12,954	—	364.399	—	99.4	0.2
1月末	12,981	0.2	365.067	0.2	99.1	0.5
2月末	12,911	△0.3	363.039	△0.4	99.1	0.4
3月末	12,918	△0.3	363.279	△0.3	99.2	0.3
4月末	12,961	0.1	364.501	0.0	99.1	0.4
5月末	12,901	△0.4	362.770	△0.4	98.8	0.7
6月末	12,894	△0.5	362.542	△0.5	99.1	0.5
7月末	12,932	△0.2	363.584	△0.2	99.1	0.5
8月末	12,954	0.0	364.201	△0.1	98.9	0.6
9月末	12,991	0.3	365.235	0.2	99.0	0.7
10月末	13,041	0.7	366.655	0.6	99.1	0.6
11月末	13,039	0.7	366.578	0.6	99.1	0.7
12月末	13,119	1.3	368.877	1.2	98.9	0.6
(当期末) 2016年 1月22日	13,170	1.7	370.303	1.6	99.0	0.5

(注1)騰落率は期首比です。

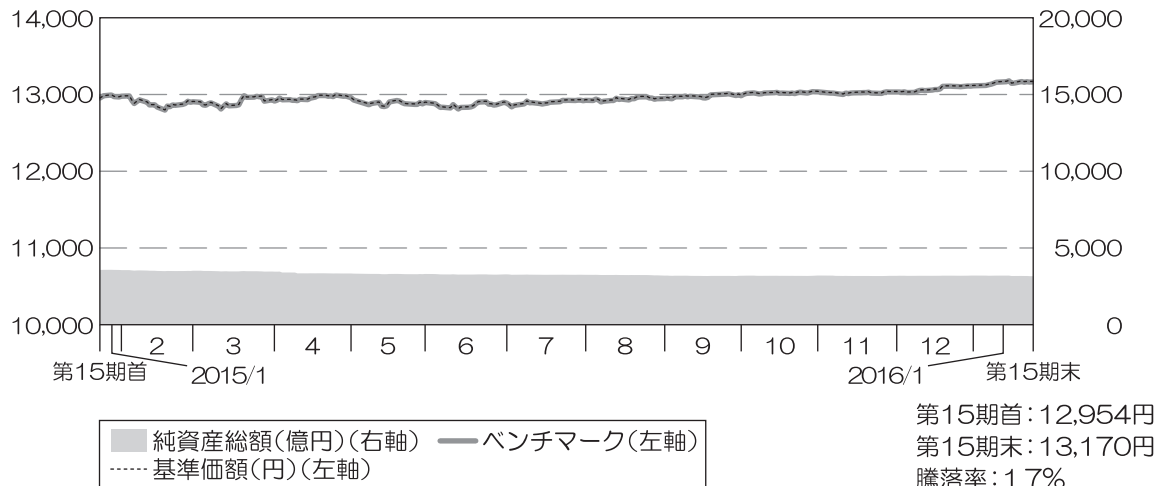
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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2015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

当期初から2015年2月中旬にかけて、高値警戒感から国内金利は上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しましたが、その後は7月上旬にかけて、ユーロ圏のデフレ懸念後退から欧米金利が上昇したことが金利上昇要因となる一方、ギリシャ債務問題などが金利低下(債券価格は上昇)要因となり、基準価額はもみ合い推移となりました。7月中旬から2015年12月まで、原油価格の急落や中国の景気減速懸念を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まったことに加え、9月に米国の利上げが見送られたことや日銀の追加金融緩和観測が高まったことを背景に金利低下基調となり、基準価額は上昇しました。12月から期末にかけては、ECB(欧州中央銀行)が実施した追加金融緩和が市場予想を下回る内容となった影響から国内金利が上昇する局面がありましたが、12月下旬に日銀が金融緩和の補完措置として国債買い入れの平均残存期間を長期化したことや、その後も中国株や原油価格の急落を背景にリスク回避姿勢が強まったことから国内金利は一段と低下し、基準価額はさらに上昇しました。

投資環境



2015年2月中旬にかけて、高値警戒感から10年国債利回りは上昇しましたが、その後はもみ合い推移となりました。7月中旬から12月にかけては、中国景気に対する警戒感に加え、9月の米国による利上げ見送りや日銀による追加金融緩和観測を背景に10年国債利回りは低下基調となりました。12月上旬にはECBが実施した追加金融緩和が市場予想を下回る内容となった影響から10年国債利回りが上昇する局面がありました。12月下旬に日銀が金融緩和の補完措置を導入したことや、その後も中国株や原油価格の急落を背景にリスク回避姿勢が強まったことから10年国債利回りは一段と低下し、過去最低を更新しました。

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

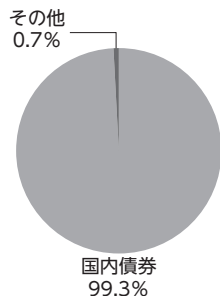
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国	組入比率
1	第106回利付国債(5年)	日本	1.3%
2	第340回利付国債(10年)	日本	1.2%
3	第339回利付国債(10年)	日本	1.1%
4	第125回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第334回利付国債(10年)	日本	1.0%
6	第338回利付国債(10年)	日本	1.0%

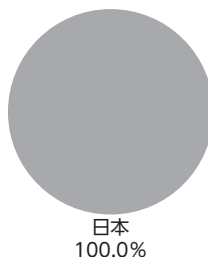
順位	銘柄名	国	組入比率
7	第105回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第333回利付国債(10年)	日本	1.0%
9	第122回利付国債(5年)	日本	1.0%
10	第332回利付国債(10年)	日本	1.0%
組入銘柄数			788

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

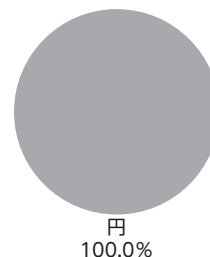
○資産別配分



○国別配分



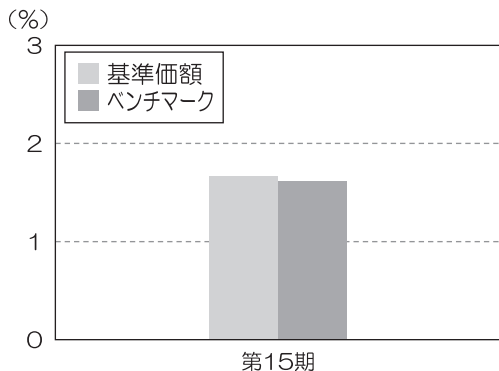
○通貨別配分



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

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2015年1月23日～2016年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	-	-	(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
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
合計	0	0.000	

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(12,970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 58,331,722	千円 89,483,110
	地 方 債 証 券	314,302	3,144,628
	特 殊 債 券	1,305,728	5,560,521 (582,515)
	社 債 券	705,160	4,416,240 (400,000)

(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)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

(注3)()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債 券 先 物 取 引	百万円 46,441	百万円 45,547	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

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	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 569,852	百万円 25,565	% 4.5	百万円 571,465	百万円 25,250	% 4.4

(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	233,534,000 (3,550,000)	253,060,790 (3,556,444)	80.2 (1.1)	— (—)	50.2 (—)	20.6 (0.0)	9.5 (1.1)	
地 方 債 証 券	17,518,830 (17,018,830)	18,704,085 (18,147,172)	5.9 (5.8)	— (—)	3.3 (3.3)	2.1 (2.0)	0.5 (0.5)	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	20,683,290 (20,483,290)	22,407,657 (22,166,232)	7.1 (7.0)	— (—)	4.5 (4.4)	1.9 (1.9)	0.8 (0.8)	
金 融 債 券	2,720,000 (2,720,000)	2,724,479 (2,724,479)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.6 (0.6)	0.2 (0.2)	
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	14,973,000 (14,873,000)	15,584,631 (15,476,465)	4.9 (4.9)	— (—)	1.7 (1.7)	2.4 (2.4)	0.8 (0.8)	
合 計	289,429,120 (58,645,120)	312,481,645 (62,070,795)	99.0 (19.7)	— (—)	59.7 (9.3)	27.6 (7.0)	11.7 (3.4)	

(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1 2 1 回利付国債 (5年)	0.1	1,450,000	1,455,017	2019/9/20
第3 4 9 回利付国債 (2年)	0.1	840,000	841,100	2017/2/15	第1 2 2 回利付国債 (5年)	0.1	3,000,000	3,011,100	2019/12/20
第3 5 0 回利付国債 (2年)	0.1	620,000	620,874	2017/3/15	第1 2 3 回利付国債 (5年)	0.1	2,900,000	2,911,397	2020/3/20
第3 5 3 回利付国債 (2年)	0.1	2,180,000	2,183,771	2017/6/15	第1 2 4 回利付国債 (5年)	0.1	2,890,000	2,902,051	2020/6/20
第3 5 5 回利付国債 (2年)	0.1	1,270,000	1,272,362	2017/8/15	第1 2 5 回利付国債 (5年)	0.1	3,340,000	3,353,961	2020/9/20
第3 5 6 回利付国債 (2年)	0.1	1,660,000	1,663,253	2017/9/15	第1 2 6 回利付国債 (5年)	0.1	1,070,000	1,074,451	2020/12/20
第3 5 8 回利付国債 (2年)	0.1	1,330,000	1,332,992	2017/11/15	第1 回利付国債 (4 0年)	2.4	230,000	301,005	2048/3/20
第3 6 0 回利付国債 (2年)	0.1	210,000	210,516	2018/1/15	第2 回利付国債 (4 0年)	2.2	500,000	629,005	2049/3/20
第1 0 3 回利付国債 (5年)	0.3	2,400,000	2,408,928	2017/3/20	第3 回利付国債 (4 0年)	2.2	460,000	579,839	2050/3/20
第1 0 4 回利付国債 (5年)	0.2	200,000	200,514	2017/3/20	第4 回利付国債 (4 0年)	2.2	545,000	688,226	2051/3/20
第1 0 5 回利付国債 (5年)	0.2	3,092,000	3,101,708	2017/6/20	第5 回利付国債 (4 0年)	2.0	630,000	759,931	2052/3/20
第1 0 6 回利付国債 (5年)	0.2	4,130,000	4,144,950	2017/9/20	第6 回利付国債 (4 0年)	1.9	670,000	788,469	2053/3/20
第1 0 7 回利付国債 (5年)	0.2	1,710,000	1,716,976	2017/12/20	第7 回利付国債 (4 0年)	1.7	570,000	636,251	2054/3/20
第1 0 8 回利付国債 (5年)	0.1	880,000	881,918	2017/12/20	第8 回利付国債 (4 0年)	1.4	720,000	735,811	2055/3/20
第1 0 9 回利付国債 (5年)	0.1	880,000	882,164	2018/3/20	第2 8 5 回利付国債 (1 0年)	1.7	2,490,000	2,539,326	2017/3/20
第1 1 0 回利付国債 (5年)	0.3	370,000	372,497	2018/3/20	第2 8 6 回利付国債 (1 0年)	1.8	1,400,000	1,435,700	2017/6/20
第1 1 1 回利付国債 (5年)	0.4	1,230,000	1,240,947	2018/3/20	第2 8 7 回利付国債 (1 0年)	1.9	1,290,000	1,324,701	2017/6/20
第1 1 2 回利付国債 (5年)	0.4	660,000	666,487	2018/6/20	第2 8 8 回利付国債 (1 0年)	1.7	1,100,000	1,131,207	2017/9/20
第1 1 3 回利付国債 (5年)	0.3	2,130,000	2,145,825	2018/6/20	第2 8 9 回利付国債 (1 0年)	1.5	2,050,000	2,108,978	2017/12/20
第1 1 4 回利付国債 (5年)	0.3	1,000,000	1,008,210	2018/9/20	第2 9 0 回利付国債 (1 0年)	1.4	900,000	927,324	2018/3/20
第1 1 5 回利付国債 (5年)	0.2	1,830,000	1,840,174	2018/9/20	第2 9 1 回利付国債 (1 0年)	1.3	820,000	843,132	2018/3/20
第1 1 6 回利付国債 (5年)	0.2	2,700,000	2,716,038	2018/12/20	第2 9 2 回利付国債 (1 0年)	1.7	550,000	570,240	2018/3/20
第1 1 7 回利付国債 (5年)	0.2	2,830,000	2,848,225	2019/3/20	第2 9 3 回利付国債 (1 0年)	1.8	900,000	939,060	2018/6/20
第1 1 8 回利付国債 (5年)	0.2	1,720,000	1,731,678	2019/6/20	第2 9 4 回利付国債 (1 0年)	1.7	900,000	936,900	2018/6/20
第1 1 9 回利付国債 (5年)	0.1	660,000	662,237	2019/6/20	第2 9 5 回利付国債 (1 0年)	1.5	1,090,000	1,129,458	2018/6/20
第1 2 0 回利付国債 (5年)	0.2	1,340,000	1,349,527	2019/9/20					

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296回利付国債(10年)	1.5	2,150,000	2,235,720	2018/9/20	第15回利付国債(30年)	2.5	500,000	643,535	2034/6/20
第297回利付国債(10年)	1.4	1,150,000	1,196,839	2018/12/20	第16回利付国債(30年)	2.5	250,000	321,840	2034/9/20
第298回利付国債(10年)	1.3	1,360,000	1,411,448	2018/12/20	第17回利付国債(30年)	-2.4	420,000	533,383	2034/12/20
第299回利付国債(10年)	1.3	1,140,000	1,186,603	2019/3/20	第18回利付国債(30年)	2.3	540,000	676,161	2035/3/20
第300回利付国債(10年)	1.5	550,000	575,943	2019/3/20	第19回利付国債(30年)	2.3	300,000	375,246	2035/6/20
第301回利付国債(10年)	1.5	1,500,000	1,576,425	2019/6/20	第20回利付国債(30年)	-2.5	290,000	373,076	2035/9/20
第302回利付国債(10年)	1.4	870,000	911,377	2019/6/20	第21回利付国債(30年)	2.3	360,000	449,607	2035/12/20
第303回利付国債(10年)	1.4	1,640,000	1,723,459	2019/9/20	第22回利付国債(30年)	2.5	400,000	513,960	2036/3/20
第304回利付国債(10年)	1.3	740,000	774,965	2019/9/20	第23回利付国債(30年)	-2.5	370,000	475,298	2036/6/20
第305回利付国債(10年)	1.3	2,200,000	2,310,594	2019/12/20	第24回利付国債(30年)	2.5	310,000	398,449	2036/9/20
第306回利付国債(10年)	1.4	1,370,000	1,448,898	2020/3/20	第25回利付国債(30年)	2.3	355,000	443,199	2036/12/20
第307回利付国債(10年)	1.3	970,000	1,021,846	2020/3/20	第26回利付国債(30年)	-2.4	700,000	887,313	2037/3/20
第308回利付国債(10年)	1.3	970,000	1,024,989	2020/6/20	第27回利付国債(30年)	2.5	550,000	709,445	2037/9/20
第309回利付国債(10年)	1.1	1,040,000	1,089,816	2020/6/20	第28回利付国債(30年)	2.5	690,000	891,383	2038/3/20
第310回利付国債(10年)	1.0	1,400,000	1,464,064	2020/9/20	第29回利付国債(30年)	2.4	430,000	547,742	2038/9/20
第311回利付国債(10年)	0.8	670,000	694,434	2020/9/20	第30回利付国債(30年)	2.3	890,000	1,117,964	2039/3/20
第312回利付国債(10年)	1.2	2,197,000	2,324,426	2020/12/20	第31回利付国債(30年)	2.2	810,000	1,001,646	2039/9/20
第313回利付国債(10年)	1.3	1,440,000	1,535,126	2021/3/20	第32回利付国債(30年)	2.3	870,000	1,095,295	2040/3/20
第314回利付国債(10年)	1.1	620,000	654,583	2021/3/20	第33回利付国債(30年)	2.0	1,100,000	1,316,216	2040/9/20
第315回利付国債(10年)	1.2	1,130,000	1,202,207	2021/6/20	第34回利付国債(30年)	2.2	910,000	1,129,410	2041/3/20
第316回利付国債(10年)	1.1	570,000	603,350	2021/6/20	第35回利付国債(30年)	2.0	1,150,000	1,377,723	2041/9/20
第317回利付国債(10年)	1.1	740,000	785,317	2021/9/20	第36回利付国債(30年)	2.0	1,085,000	1,300,437	2042/3/20
第318回利付国債(10年)	1.0	1,270,000	1,340,599	2021/9/20	第37回利付国債(30年)	1.9	1,270,000	1,491,665	2042/9/20
第319回利付国債(10年)	1.1	740,000	787,315	2021/12/20	第38回利付国債(30年)	1.8	885,000	1,018,750	2043/3/20
第320回利付国債(10年)	1.0	1,350,000	1,428,367	2021/12/20	第39回利付国債(30年)	1.9	540,000	634,284	2043/6/20
第321回利付国債(10年)	1.0	1,420,000	1,505,867	2022/3/20	第40回利付国債(30年)	1.8	720,000	828,604	2043/9/20
第322回利付国債(10年)	0.9	680,000	716,726	2022/3/20	第41回利付国債(30年)	1.7	685,000	771,912	2043/12/20
第323回利付国債(10年)	0.9	690,000	728,791	2022/6/20	第42回利付国債(30年)	1.7	760,000	857,074	2044/3/20
第324回利付国債(10年)	0.8	1,200,000	1,259,796	2022/6/20	第43回利付国債(30年)	1.7	755,000	851,171	2044/6/20
第325回利付国債(10年)	0.8	2,455,000	2,581,285	2022/9/20	第44回利付国債(30年)	1.7	760,000	856,535	2044/9/20
第326回利付国債(10年)	0.7	560,000	585,827	2022/12/20	第45回利付国債(30年)	1.5	720,000	775,497	2044/12/20
第327回利付国債(10年)	0.8	1,380,000	1,453,140	2022/12/20	第46回利付国債(30年)	1.5	910,000	979,524	2045/3/20
第328回利付国債(10年)	0.6	2,165,000	2,251,361	2023/3/20	第47回利付国債(30年)	1.6	960,000	1,056,067	2045/6/20
第329回利付国債(10年)	0.8	2,385,000	2,515,888	2023/6/20	第48回利付国債(30年)	1.4	1,150,000	1,206,890	2045/9/20
第330回利付国債(10年)	0.8	2,080,000	2,194,691	2023/9/20	第49回利付国債(30年)	1.4	200,000	209,724	2045/12/20
第331回利付国債(10年)	0.6	1,120,000	1,165,158	2023/9/20	第34回利付国債(20年)	3.5	70,000	72,826	2017/3/20
第332回利付国債(10年)	0.6	2,890,000	3,005,571	2023/12/20	第35回利付国債(20年)	3.3	270,000	280,281	2017/3/20
第333回利付国債(10年)	0.6	2,920,000	3,036,712	2024/3/20	第37回利付国債(20年)	3.1	410,000	431,102	2017/9/20
第334回利付国債(10年)	0.6	3,060,000	3,182,094	2024/6/20	第39回利付国債(20年)	2.6	640,000	675,840	2018/3/20
第335回利付国債(10年)	0.5	2,865,000	2,954,388	2024/9/20	第40回利付国債(20年)	2.3	450,000	477,481	2018/9/20
第336回利付国債(10年)	0.5	1,330,000	1,370,870	2024/12/20	第41回利付国債(20年)	1.5	520,000	544,700	2019/3/20
第337回利付国債(10年)	0.3	2,090,000	2,117,525	2024/12/20	第42回利付国債(20年)	2.6	380,000	411,201	2019/3/20
第338回利付国債(10年)	0.4	3,070,000	3,133,579	2025/3/20	第43回利付国債(20年)	2.9	340,000	375,982	2019/9/20
第339回利付国債(10年)	0.4	3,485,000	3,552,539	2025/6/20	第44回利付国債(20年)	2.5	370,000	408,343	2020/3/20
第340回利付国債(10年)	0.4	3,690,000	3,756,272	2025/9/20	第45回利付国債(20年)	2.4	270,000	296,859	2020/3/20
第341回利付国債(10年)	0.3	670,000	674,535	2025/12/20	第46回利付国債(20年)	2.2	290,000	317,947	2020/6/22
第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	65,488	2029/9/20	第47回利付国債(20年)	-2.2	470,000	517,860	2020/9/21
第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	125,966	2030/2/20	第48回利付国債(20年)	2.5	230,000	258,055	2020/12/21
第3回利付国債(30年)	2.3	174,589	174,589	2030/5/20	第49回利付国債(20年)	2.1	280,000	310,203	2021/3/22
第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	253,777	2030/11/20	第50回利付国債(20年)	1.9	590,000	647,572	2021/3/22
第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	222,888	2031/5/20	第51回利付国債(20年)	2.0	240,000	265,776	2021/6/21
第6回利付国債(30年)	2.4	270,000	342,430	2031/11/20	第52回利付国債(20年)	2.1	430,000	480,628	2021/9/21
第7回利付国債(30年)	2.3	390,000	489,235	2032/5/20	第53回利付国債(20年)	-2.1	350,000	393,004	2021/12/20
第8回利付国債(30年)	1.8	270,000	317,563	2032/11/22	第54回利付国債(20年)	2.2	280,000	316,055	2021/12/20
第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	200,097	2032/12/20	第55回利付国債(20年)	2.0	490,000	549,740	2022/3/21
第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	180,546	2033/3/20	第56回利付国債(20年)	2.0	410,000	461,865	2022/6/20
第11回利付国債(30年)	1.7	280,000	324,175	2033/6/20	第57回利付国債(20年)	1.9	360,000	403,239	2022/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	370,000	452,436	2033/9/20	第58回利付国債(20年)	1.9	250,000	281,115	2022/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	350,000	421,697	2033/12/20	第59回利付国債(20年)	1.7	440,000	490,582	2022/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	444,720	2034/3/20	第60回利付国債(20年)	1.4	570,000	623,756	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6 1 回利付国債 (20年)	1.0	390,000	416,672	2023/3/20	第1 2 1 回利付国債 (20年)	1.9	770,000	918,394	2030/9/20
第6 2 回利付国債 (20年)	0.8	250,000	263,622	2023/6/20	第1 2 2 回利付国債 (20年)	1.8	540,000	636,687	2030/9/20
第6 3 回利付国債 (20年)	1.8	570,000	643,273	2023/6/20	第1 2 3 回利付国債 (20年)	-2.1	710,000	866,910	2030/12/20
第6 4 回利付国債 (20年)	1.9	410,000	467,084	2023/9/20	第1 2 4 回利付国債 (20年)	2.0	400,000	482,856	2030/12/20
第6 5 回利付国債 (20年)	1.9	370,000	422,688	2023/12/20	第1 2 5 回利付国債 (20年)	2.2	300,000	371,019	2031/3/20
第6 6 回利付国債 (20年)	1.8	330,000	374,401	2023/12/20	第1 2 6 回利付国債 (20年)	-2.0	520,000	628,045	2031/3/20
第6 7 回利付国債 (20年)	1.9	310,000	355,080	2024/3/20	第1 2 7 回利付国債 (20年)	1.9	550,000	656,095	2031/3/20
第6 8 回利付国債 (20年)	2.2	230,000	269,021	2024/3/20	第1 2 8 回利付国債 (20年)	1.9	640,000	763,724	2031/6/20
第6 9 回利付国債 (20年)	2.1	530,000	615,637	2024/3/20	第1 2 9 回利付国債 (20年)	1.8	250,000	294,777	2031/6/20
第7 0 回利付国債 (20年)	2.4	490,000	583,359	2024/6/20	第1 3 0 回利付国債 (20年)	1.8	840,000	990,578	2031/9/20
第7 1 回利付国債 (20年)	2.2	400,000	469,556	2024/6/20	第1 3 1 回利付国債 (20年)	1.7	360,000	419,047	2031/9/20
第7 2 回利付国債 (20年)	2.1	710,000	829,982	2024/9/20	第1 3 2 回利付国債 (20年)	1.7	200,000	232,606	2031/12/20
第7 3 回利付国債 (20年)	2.0	540,000	628,273	2024/12/20	第1 3 3 回利付国債 (20年)	1.8	890,000	1,048,811	2031/12/20
第7 4 回利付国債 (20年)	2.1	310,000	363,400	2024/12/20	第1 3 4 回利付国債 (20年)	1.8	350,000	412,426	2032/3/20
第7 5 回利付国債 (20年)	2.1	360,000	422,755	2025/3/20	第1 3 5 回利付国債 (20年)	1.7	640,000	744,166	2032/3/20
第7 6 回利付国債 (20年)	1.9	340,000	393,145	2025/3/20	第1 3 6 回利付国債 (20年)	1.6	290,000	332,685	2032/3/20
第7 7 回利付国債 (20年)	2.0	290,000	337,939	2025/3/20	第1 3 7 回利付国債 (20年)	1.7	370,000	429,795	2032/6/20
第7 8 回利付国債 (20年)	1.9	20,000	23,157	2025/6/20	第1 3 8 回利付国債 (20年)	1.5	540,000	610,729	2032/6/20
第7 9 回利付国債 (20年)	2.0	570,000	665,247	2025/6/20	第1 3 9 回利付国債 (20年)	1.6	350,000	401,051	2032/6/20
第8 0 回利付国債 (20年)	2.1	250,000	294,082	2025/6/20	第1 4 0 回利付国債 (20年)	1.7	965,000	1,119,747	2032/9/20
第8 1 回利付国債 (20年)	2.0	180,000	210,571	2025/9/20	第1 4 1 回利付国債 (20年)	1.7	800,000	927,896	2032/12/20
第8 2 回利付国債 (20年)	2.1	485,000	572,232	2025/9/20	第1 4 2 回利付国債 (20年)	1.8	480,000	564,475	2032/12/20
第8 3 回利付国債 (20年)	2.1	270,000	319,172	2025/12/20	第1 4 3 回利付国債 (20年)	1.6	1,070,000	1,223,031	2033/3/20
第8 4 回利付国債 (20年)	2.0	590,000	691,739	2025/12/20	第1 4 4 回利付国債 (20年)	1.5	440,000	496,161	2033/3/20
第8 5 回利付国債 (20年)	2.1	360,000	426,949	2026/3/20	第1 4 5 回利付国債 (20年)	1.7	1,140,000	1,320,883	2033/6/20
第8 6 回利付国債 (20年)	2.3	240,000	289,394	2026/3/20	第1 4 6 回利付国債 (20年)	1.7	1,220,000	1,410,527	2033/9/20
第8 7 回利付国債 (20年)	2.2	170,000	203,301	2026/3/20	第1 4 7 回利付国債 (20年)	1.6	1,460,000	1,662,385	2033/12/20
第8 8 回利付国債 (20年)	2.3	530,000	641,077	2026/6/20	第1 4 8 回利付国債 (20年)	1.5	1,350,000	1,511,703	2034/3/20
第8 9 回利付国債 (20年)	2.2	320,000	383,817	2026/6/20	第1 4 9 回利付国債 (20年)	1.5	1,350,000	1,508,800	2034/6/20
第9 0 回利付国債 (20年)	2.2	620,000	745,407	2026/9/20	第1 5 0 回利付国債 (20年)	1.4	1,670,000	1,834,094	2034/9/20
第9 1 回利付国債 (20年)	2.3	510,000	618,446	2026/9/20	第1 5 1 回利付国債 (20年)	1.2	1,420,000	1,507,060	2034/12/20
第9 2 回利付国債 (20年)	2.1	790,000	943,552	2026/12/20	第1 5 2 回利付国債 (20年)	1.2	1,360,000	1,439,560	2035/3/20
第9 3 回利付国債 (20年)	2.0	410,000	486,214	2027/3/20	第1 5 3 回利付国債 (20年)	1.3	1,560,000	1,674,098	2035/6/20
第9 4 回利付国債 (20年)	2.1	545,000	652,201	2027/3/20	第1 5 4 回利付国債 (20年)	1.2	1,660,000	1,747,515	2035/9/20
第9 5 回利付国債 (20年)	2.3	510,000	623,092	2027/6/20	第1 5 5 回利付国債 (20年)	1.0	300,000	304,035	2035/12/20
第9 6 回利付国債 (20年)	2.1	200,000	239,938	2027/6/20	第1 8 回メキシコ合衆国円貨債券	0.8	100,000	100,311	2019/7/24
第9 7 回利付国債 (20年)	2.2	510,000	618,721	2027/9/20	小 計		233,534,000	253,060,790	
第9 8 回利付国債 (20年)	2.1	450,000	540,868	2027/9/20	地方債証券				
第9 9 回利付国債 (20年)	2.1	660,000	794,197	2027/12/20	第3 回東京都公募債 (20年)	2.26	100,000	116,427	2024/3/19
第1 0 0 回利付国債 (20年)	2.2	730,000	888,884	2028/3/20	第7 回東京都公募債 (30年)	2.51	200,000	249,558	2038/9/17
第1 0 1 回利付国債 (20年)	2.4	360,000	447,015	2028/3/20	第1 1 回東京都公募債 (20年)	2.22	200,000	238,868	2027/3/19
第1 0 2 回利付国債 (20年)	2.4	500,000	622,155	2028/6/20	第1 7 回東京都公募債 (20年)	2.09	100,000	119,278	2028/12/20
第1 0 3 回利付国債 (20年)	2.3	300,000	369,726	2028/6/20	第1 8 回東京都公募債 (20年)	2.22	200,000	242,002	2029/3/19
第1 0 4 回利付国債 (20年)	2.1	360,000	434,851	2028/6/20	第2 0 回東京都公募債 (20年)	2.09	100,000	119,646	2029/9/20
第1 0 5 回利付国債 (20年)	2.1	580,000	701,672	2028/9/20	第2 1 回東京都公募債 (20年)	2.19	100,000	121,109	2029/12/20
第1 0 6 回利付国債 (20年)	2.2	310,000	378,779	2028/9/20	第6 4 5 回東京都公募債	1.77	100,000	101,963	2017/3/17
第1 0 7 回利付国債 (20年)	2.1	430,000	520,940	2028/12/20	第6 4 6 回東京都公募債	1.99	100,000	102,710	2017/6/20
第1 0 8 回利付国債 (20年)	1.9	690,000	818,450	2028/12/20	第6 4 7 回東京都公募債	1.97	100,000	102,682	2017/6/20
第1 0 9 回利付国債 (20年)	1.9	370,000	439,308	2029/3/20	第6 5 7 回東京都公募債	1.81	100,000	103,760	2018/3/20
第1 1 0 回利付国債 (20年)	2.1	565,000	685,378	2029/3/20	第6 9 6 回東京都公募債	1.19	100,000	105,970	2021/6/18
第1 1 1 回利付国債 (20年)	2.2	320,000	392,742	2029/6/20	第7 0 3 回東京都公募債	0.99	100,000	105,321	2021/12/20
第1 1 2 回利付国債 (20年)	2.1	970,000	1,178,181	2029/6/20	第7 1 4 回東京都公募債	0.74	200,000	208,496	2022/12/20
第1 1 3 回利付国債 (20年)	2.1	910,000	1,106,641	2029/9/20	第7 2 2 回東京都公募債	0.8	200,000	209,526	2023/6/20
第1 1 4 回利付国債 (20年)	2.1	700,000	852,194	2029/12/20	平成19年度第14回北海道公募債 (10年)	1.68	100,000	103,207	2018/2/28
第1 1 5 回利付国債 (20年)	2.2	350,000	430,678	2029/12/20	平成20年度第14回北海道公募債	1.74	100,000	104,916	2019/2/27
第1 1 6 回利付国債 (20年)	2.2	450,000	554,355	2030/3/20	平成21年度第6回北海道公募債	1.6	100,000	105,183	2019/8/28
第1 1 7 回利付国債 (20年)	2.1	770,000	938,329	2030/3/20	平成22年度第1回北海道公募債	1.47	100,000	105,598	2020/4/30
第1 1 8 回利付国債 (20年)	2.0	500,000	602,750	2030/6/20	平成22年度第8回北海道公募債	0.96	100,000	103,710	2020/10/29
第1 1 9 回利付国債 (20年)	1.8	390,000	459,322	2030/6/20	平成23年度第4回北海道公募債	1.21	100,000	105,569	2021/6/30
第1 2 0 回利付国債 (20年)	1.6	500,000	575,025	2030/6/20	第1 6 回神奈川県公募債 (20年)	2.09	100,000	120,097	2031/1/24

日本債券マザーファンド 一第15期一

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第2回神奈川県公債(20年)	1.732	100,000	114,454	2032/9/17	
第16回神奈川県公債	1.62	100,000	105,270	2019/6/20	
第168回神奈川県公債	1.36	100,000	105,008	2019/12/20	
第173回神奈川県公債	1.3	100,000	105,378	2020/6/19	
第174回神奈川県公債	1.17	100,000	104,807	2020/6/19	
第175回神奈川県公債	1.09	100,000	104,456	2020/6/19	
第184回神奈川県公債	1.02	100,000	104,943	2021/6/18	
第190回神奈川県公債	0.88	100,000	104,933	2022/6/20	
第196回神奈川県公債	0.678	100,000	103,812	2023/3/20	
第305回大阪府公債(10年)	1.93	100,000	102,829	2017/8/30	
第324回大阪府公債(10年)	1.64	100,000	104,700	2019/3/29	
第331回大阪府公債(10年)	1.41	100,000	104,680	2019/10/29	
第334回大阪府公債(10年)	1.47	100,000	105,227	2020/1/28	
第335回大阪府公債(10年)	1.48	100,000	105,367	2020/2/25	
第339回大阪府公債(10年)	1.37	100,000	105,325	2020/6/29	
第356回大阪府公債(10年)	1.06	130,000	136,552	2021/12/27	
第363回大阪府公債(10年)	0.77	114,000	118,233	2022/8/30	
第371回大阪府公債(10年)	0.58	200,000	204,924	2023/4/26	
第376回大阪府公債(10年)	0.82	100,000	104,216	2023/9/27	
平成20年度第6回京都府公債	1.48	100,000	104,459	2019/3/25	
平成21年度第5回京都府公債	1.35	100,000	104,983	2019/12/24	
第4回兵庫県公債(1.5年)	1.31	100,000	109,174	2027/12/24	
平成21年度第1回兵庫県公債	1.62	100,000	104,787	2019/4/23	
平成21年度第3回兵庫県公債	1.46	100,000	105,229	2020/1/22	
平成22年度第1回兵庫県公債	1.26	100,000	105,348	2021/1/21	
平成25年度第1回兵庫県公債	0.73	100,000	103,558	2024/1/22	
平成19年度第4回静岡県公債	1.94	100,000	102,975	2017/8/28	
平成19年度第7回静岡県公債	1.81	100,000	103,194	2017/11/28	
平成22年度第3回静岡県公債	1.379	100,000	105,636	2020/5/25	
平成23年度第1回静岡県公債	1.385	100,000	106,702	2021/4/21	
平成23年度第5回静岡県公債	1.158	100,000	105,711	2021/6/28	
平成24年度第1回静岡県公債	0.678	100,000	103,815	2023/3/22	
平成25年度第1回静岡県公債	0.581	100,000	103,123	2023/4/19	
平成20年度第6回愛知県公債(10年)	1.71	100,000	104,648	2018/11/28	
平成20年度第10回愛知県公債(10年)	1.48	100,000	104,467	2019/3/27	
平成21年度第1回愛知県公債(10年)	1.61	100,000	105,022	2019/4/30	
平成22年度第1回愛知県公債(10年)	1.417	100,000	105,709	2020/4/30	
平成22年度第5回愛知県公債(10年)	1.258	100,000	105,229	2020/6/30	
平成22年度第14回愛知県公債(20年)	2.087	100,000	119,831	2030/12/13	
平成23年度第4回愛知県公債(10年)	1.182	100,000	105,840	2021/6/28	
平成23年度第8回愛知県公債(10年)	1.087	100,000	105,466	2021/8/26	
平成24年度第2回愛知県公債(10年)	0.982	100,000	105,463	2022/4/27	
平成25年度第16回愛知県公債(10年)	0.665	100,000	103,754	2023/11/28	
平成20年度第6回広島県公債	1.48	100,000	104,443	2019/3/25	
平成20年度第1回広島県公債(20年)	2.34	100,000	121,990	2028/9/21	
平成23年度第1回広島県公債	1.19	272,000	287,675	2021/5/27	
平成24年度第2回広島県公債	0.84	100,000	104,714	2022/7/25	
平成19年度第5回埼玉県公債	1.81	100,000	103,199	2017/11/29	
平成19年度第7回埼玉県公債	1.65	100,000	103,291	2018/2/27	
平成20年度第5回埼玉県公債	1.73	100,000	104,701	2018/11/27	
平成21年度第2回埼玉県公債	1.57	100,000	105,002	2019/5/27	
平成22年度第4回埼玉県公債	1.17	100,000	104,900	2020/7/28	
平成23年度第9回埼玉県公債	0.99	100,000	105,295	2022/1/27	
平成24年度第2回埼玉県公債	0.91	100,000	105,058	2022/5/18	
平成24年度第6回埼玉県公債	0.801	100,000	104,565	2022/10/26	
平成19年度第1回福岡県公債(30年)	2.62	100,000	126,475	2037/9/18	
平成20年度第5回福岡県公債	1.67	100,000	104,409	2018/10/30	
平成20年度第1回福岡県公債(30年)	2.28	200,000	240,398	2038/9/17	
平成21年度第5回福岡県公債	1.37	100,000	104,860	2019/10/28	
平成22年度第2回福岡県公債(15年)	1.765	100,000	113,813	2026/1/26	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
	%	千円	千円		
第6回千葉県公債(20年)	2.26	100,000	121,630	2029/4/20	
第8回千葉県公債(20年)	2.18	100,000	121,122	2030/4/19	
平成28年度第7回千葉県公債	1.8	100,000	101,878	2017/2/24	
平成21年度第3回千葉県公債	1.64	100,000	105,360	2019/6/25	
平成22年度第4回千葉県公債	1.17	100,000	104,888	2020/7/24	
平成22年度第8回千葉県公債	1.0	100,000	104,335	2020/11/25	
平成22年度第9回千葉県公債	1.22	100,000	105,486	2020/12/25	
平成22年度第2回新潟県公債	1.52	100,000	104,431	2019/2/27	
平成21年度第2回新潟県公債	1.55	133,900	141,393	2019/11/27	
平成24年度第1回岐阜県公債(10年)	0.82	139,630	146,059	2022/9/28	
第4回共同発行市場公募地方債	1.7	100,000	101,890	2017/3/24	
第5回共同発行市場公募地方債	1.7	100,000	102,693	2017/9/25	
第5回共同発行市場公募地方債	1.72	100,000	102,991	2017/11/24	
第6回共同発行市場公募地方債	1.5	100,000	103,891	2018/10/25	
第7回共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	103,966	2019/1/25	
第7回共同発行市場公募地方債	1.46	100,000	104,363	2019/3/25	
第7回共同発行市場公募地方債	1.57	100,000	104,954	2019/5/24	
第7回共同発行市場公募地方債	1.4	100,000	104,601	2019/7/25	
第7回共同発行市場公募地方債	1.54	100,000	105,211	2019/8/23	
第7回共同発行市場公募地方債	1.39	100,000	104,779	2019/9/25	
第7回共同発行市場公募地方債	1.34	100,000	104,698	2019/10/25	
第8回共同発行市場公募地方債	1.42	100,000	105,328	2020/1/24	
第8回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	105,526	2020/2/25	
第8回共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	105,380	2020/3/25	
第8回共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	105,740	2020/4/24	
第8回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	105,307	2020/6/25	
第8回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	104,865	2020/7/24	
第9回共同発行市場公募地方債	1.25	100,000	105,581	2020/12/25	
第9回共同発行市場公募地方債	1.28	100,000	105,925	2021/2/25	
第9回共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	106,065	2021/3/25	
第9回共同発行市場公募地方債	1.18	100,000	105,676	2021/5/25	
第9回共同発行市場公募地方債	1.17	100,000	105,711	2021/6/25	
第10回共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	106,001	2021/7/23	
第10回共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	105,200	2021/8/25	
第10回共同発行市場公募地方債	1.03	100,000	105,155	2021/9/24	
第10回共同発行市場公募地方債	1.0	177,440	186,376	2021/10/25	
第10回共同発行市場公募地方債	1.07	100,000	105,616	2021/12/24	
第11回共同発行市場公募地方債	0.89	300,000	314,640	2022/5/25	
第11回共同発行市場公募地方債	0.89	200,000	209,876	2022/6/24	
第11回共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	104,578	2022/11/25	
第11回共同発行市場公募地方債	0.72	500,000	520,390	2022/12/22	
第11回共同発行市場公募地方債	0.84	200,000	209,832	2023/1/25	
第11回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	103,832	2023/3/24	
第12回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	209,820	2023/8/25	
平成24年度第2回熊本県公債(10年)	0.8	100,000	104,524	2022/10/26	
平成23年度第1回静岡市公債	1.045	100,000	105,457	2021/11/25	
平成21年度第3回大阪市公債	1.48	200,000	209,518	2019/7/22	
平成21年度第7回大阪市公債	1.47	100,000	105,413	2019/10/27	
第1回名古屋市長市公債(20年)	1.99	100,000	113,984	2023/12/20	
第464回名古屋市長市公債(10年)	1.61	100,000	104,089	2018/9/20	
第482回名古屋市長市公債(10年)	0.639	100,000	103,572	2023/3/20	
第2回京都市公債公債(20年)	1.22	100,000	116,595	2025/9/19	
平成19年度第2回京都市公債	1.74	100,000	103,129	2017/12/27	
平成21年度第5回京都市公債	1.45	100,000	105,459	2020/2/25	
第5回横浜市公債公債(20年)	2.17	100,000	116,902	2025/6/20	
平成20年度第6回横浜市公債	1.51	100,000	104,399	2019/2/15	
平成22年度第1回横浜市公債	1.36	100,000	105,554	2020/5/25	
平成22年度第4回横浜市公債	0.947	100,000	104,114	2020/10/28	
平成23年度第1回横浜市公債	1.189	100,000	105,777	2021/5/24	
第2回横浜市公債(20年)	1.72	100,000	114,331	2032/7/16	

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
	%	千円	千円	
第26回横浜市公募債(20年)	1.776	100,000	114,982	2033/1/28
平成23年度第4回札幌市公募債(10年)	1.02	100,000	104,915	2021/6/18
平成24年度第7回札幌市公募債(10年)	0.75	100,000	104,128	2022/9/20
第79回川崎市公募債	1.86	100,000	102,962	2017/9/20
平成19年度第3回福岡市公募債	1.87	100,000	103,130	2017/10/24
平成19年度第5回福岡市公募債	1.49	100,000	103,069	2018/3/28
平成20年度第5回福岡市公募債	1.57	100,000	104,093	2018/2/24
平成23年度第5回広島市公募債	1.01	151,900	160,143	2022/10/25
平成23年度第1回千葉市公募債	1.37	100,000	106,596	2021/4/21
平成24年度第1回福岡県公募債	0.8	100,000	104,524	2022/10/26
平成24年度第1回山梨県公募債(10年)	0.8	100,000	104,492	2022/10/28
平成23年度第2回岡山県公募債(10年)	1.01	100,000	105,541	2022/3/30
小計		17,518,830	18,704,085	
特殊債券(除く金融債)				
第20回政府保証日本高速道路債	1.4	100,000	102,774	2018/3/16
第20回政府保証西日本高速道路債	1.4	100,000	104,542	2019/7/29
第2回政府保証公営企業債券(15年)	2.1	100,000	110,347	2021/4/16
第874回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	101,976	2017/4/19
第877回政府保証公営企業債券	1.9	200,000	205,314	2017/7/18
第879回政府保証公営企業債券	1.7	200,000	205,264	2017/9/19
第885回政府保証公営企業債券	1.7	100,000	103,716	2018/5/22
第191回政府保証中小企業債券	1.7	200,000	205,228	2017/9/15
第2回政府保証新関西国際空港債	0.882	200,000	210,754	2023/6/27
第15回政府保証日本政策投資銀行債券	2.0	210,000	233,255	2021/12/22
第16回政府保証日本政策投資銀行債券	1.8	100,000	101,868	2017/2/28
第17回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.257	200,000	200,846	2018/11/9
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	193,000	196,636	2017/3/28
第33回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	102,002	2017/4/25
第34回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	102,140	2017/5/26
第40回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	200,000	205,754	2017/8/31
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	121,443	2027/10/29
第44回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	200,000	205,886	2017/11/30
第56回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	102,901	2018/4/20
第58回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	100,000	103,752	2018/5/30
第66回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	103,745	2018/9/28
第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	100,000	104,247	2018/11/28
第75回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	103,703	2019/2/27
第77回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	103,772	2019/3/19
第78回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	200,000	208,470	2019/4/30
第80回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	104,679	2019/5/31
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	118,925	2029/7/31
第89回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,389	2019/9/30
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	240,524	2029/9/28
第91回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	104,114	2019/10/31

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
	%	千円	千円	
第93回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	104,967	2019/11/29
第95回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	100,000	104,284	2019/12/27
第98回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	200,000	209,576	2020/1/31
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	243,602	2030/1/31
第100回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	105,288	2020/2/28
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	123,451	2040/2/29
第103回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,941	2020/3/19
第104回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	105,502	2020/4/30
第107回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	105,171	2020/5/29
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	121,361	2040/5/31
第110回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	105,275	2020/6/30
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	119,215	2030/6/28
第122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	176,483	2020/11/30
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	119,330	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	106,232	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	105,416	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	105,070	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	131,432	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	104,768	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	105,369	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	104,961	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	104,681	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	209,014	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	114,173	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	209,840	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	114,842	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	216,889	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	205,692	2023/4/28
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	103,309	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	105,620	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	104,827	2023/9/29
第2回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.6	100,000	104,198	2018/11/16
第3回政府保証地方公共団体金融機構債券	1.5	100,000	104,946	2019/8/16

銘柄	当 期 利 率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第4回政府保証地方公営企業等金融機構債券	1.3	100,000	103,579	2019/1/22
第5回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.2	100,000	104,075	2019/10/18
第6回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.4	100,000	104,929	2019/11/18
第10回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.3	100,000	104,921	2020/3/13
第11回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.4	100,000	105,456	2020/4/17
第13回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.3	100,000	105,217	2020/6/12
第14回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.1	100,000	104,415	2020/7/17
第16回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.0	100,000	104,111	2020/9/14
第20回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.2	100,000	105,413	2021/1/20
第22回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.3	100,000	106,074	2021/3/12
第26回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.1	100,000	105,383	2021/7/16
第27回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	1.0	100,000	104,897	2021/8/13
第34回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	0.9	200,000	209,600	2022/3/14
第37回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	0.895	217,000	227,754	2022/6/17
第46回政府保証地方公共団体会社金融機構債券	0.668	100,000	103,775	2023/3/17
第18回政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	103,781	2023/3/22
第21回政府保証西日本高速道路債券	1.3	100,000	104,967	2020/3/27
第41回日本政策投資銀行債券	1.73	100,000	102,686	2017/9/20
第41回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.177	100,000	100,084	2017/3/17
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.99	100,000	135,597	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	179,449	2026/3/19
第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.28	100,000	119,018	2027/4/20
第21回道路債券	2.75	100,000	128,813	2033/6/20
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	254,286	2047/3/20
第27回道路債券	2.42	100,000	117,011	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	120,166	2027/10/20
第31回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	100,000	102,745	2017/12/20
第32回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.61	100,000	103,229	2018/3/20
第33回道路債券	2.91	100,000	131,742	2034/6/20
第35回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.65	100,000	103,315	2018/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	121,646	2023/6/20
第38回道路債券	2.26	100,000	116,390	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	121,259	2028/9/20
第44回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.62	100,000	104,288	2018/12/20
第45回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.67	100,000	104,824	2019/3/20
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	121,926	2029/5/18
第53回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.38	100,000	104,515	2019/9/20
第56回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.43	100,000	105,015	2019/12/20
第61回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	100,000	104,815	2020/6/19
第104回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.715	100,000	103,414	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	120,832	2029/4/27
第4回地方公共団体会社金融機構債券(20年)	2.12	100,000	119,156	2029/12/28
第5回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	113,982	2023/9/20
第5回地方公共団体会社金融機構債券(20年)	2.22	200,000	240,954	2030/1/28
第7回地方公共団体会社金融機構債券(20年)	2.202	100,000	120,327	2030/4/26
第9回公営企業債券(20年)	2.33	100,000	117,051	2024/9/24
第11回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	115,736	2025/3/24
第12回地方公共団体会社金融機構債券(20年)	2.092	100,000	118,971	2030/12/27
第15回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	116,517	2025/9/24
第15回地方公共団体会社金融機構債券(20年)	2.03	300,000	354,285	2031/6/27
第17回公営企業債券(20年)	2.39	200,000	238,494	2026/3/24
第17回地方公共団体会社金融機構債券(20年)	1.87	100,000	115,956	2031/9/26
第23回地方公共団体会社金融機構債券(20年)	1.68	300,000	338,307	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	120,180	2028/4/25
第39回地方公共団体会社金融機構債券	0.815	100,000	104,136	2022/8/26
第43回地方公共団体会社金融機構債券	0.72	100,000	103,658	2022/12/28
第16回国際協力銀行債券	2.07	100,000	107,027	2019/9/20
第19回国際協力銀行債券	1.67	100,000	106,317	2020/3/19
第16回都市再生債券	1.76	100,000	102,736	2017/9/20
第34回都市再生債券	1.39	100,000	104,551	2019/9/20

銘柄	当 期 利 率	末		償還年月日
		額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円	
第43回都市再生債券	1.29	100,000	105,293	2020/9/18
第324回東京交通債券	3.4	100,000	103,436	2017/2/7
第1回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	20,014	20,944	2036/5/10
第1回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.13	142,980	153,494	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	47,826	51,460	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	24,501	26,593	2037/11/10
第2回一般担保住宅金融支援機構債券	1.28	100,000	101,951	2037/3/17
第3回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.82	61,572	65,241	2036/5/10
第5回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.76	21,028	22,245	2036/11/10
第6回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	22,004	23,760	2037/5/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	121,176	2027/6/18
第7回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	14,419	14,891	2037/8/10
第7回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.25	88,332	95,325	2037/5/10
第8回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	23,009	24,799	2037/5/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	61,488	65,836	2042/12/10
第9回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	22,752	24,454	2037/5/10
第10回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.43	33,420	34,458	2038/2/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.15	23,490	25,331	2037/5/10
第11回貸付債権担保住宅金融公庫債券	0.92	18,481	18,827	2038/6/10
第11回一般担保住宅金融支援機構債券	1.66	100,000	102,946	2017/12/20
第12回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	18,569	19,330	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	30,932	33,223	2040/11/10
第14回一般担保住宅金融支援機構債券	1.86	100,000	103,766	2018/3/20
第17回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	110,733	116,163	2032/11/10
第17回一般担保住宅金融支援機構債券	1.69	100,000	104,138	2018/9/5
第18回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.89	20,156	21,197	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	36,971	38,594	2032/11/10
第20回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.12	42,722	45,378	2039/7/10
第23回一般担保住宅金融支援機構債券	2.6	100,000	124,049	2028/9/20
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	40,545	44,272	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.72	23,210	24,394	2039/12/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	41,155	44,819	2044/6/10
第25回一般担保住宅金融支援機構債券	1.67	100,000	104,433	2018/12/20
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	78,880	85,388	2044/7/10
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	25,953	27,424	2040/3/10
第29回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	78,153	82,701	2040/4/10
第29回一般担保住宅金融支援機構債券	1.64	100,000	104,729	2019/3/20
第31回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.7	28,896	30,552	2040/6/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	92,577	97,858	2040/7/10
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	32,118	34,158	2040/9/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	53,859	57,527	2045/3/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	57,690	61,603	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	28,106	29,928	2040/11/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	59,588	63,458	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	29,677	31,629	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	84,252	89,585	2041/2/10
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	130,210	136,940	2045/8/10
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	61,190	65,532	2041/3/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	30,473	32,796	2041/4/10
第41回一般担保住宅金融支援機構債券	1.5	100,000	105,287	2019/12/20
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	28,310	30,776	2041/5/10
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	73,227	76,908	2045/11/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	73,752	78,163	2045/12/10
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	120,992	2030/2/18
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	222,585	238,145	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	278,820	298,103	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	27,155	29,417	2041/10/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	67,925	72,441	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	67,693	71,865	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.21	83,997	91,072	2042/2/10

銘柄	当 期 利率	末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
		千円	千円	
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	72,383	76,804	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	28,950	31,227	2042/4/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	75,992	80,013	2046/10/10
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	77,322	81,549	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	79,813	83,922	2046/12/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	79,175	83,380	2047/12/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	85,132	87,811	2047/12/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	86,011	89,793	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	84,184	87,818	2048/3/10
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	83,574	86,224	2048/4/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	84,444	87,160	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	86,915	91,000	2048/6/10
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	1.841	100,000	115,031	2031/10/17
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	115,335	2031/11/18
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	100,000	100,793	2051/1/10
第110回農林漁業金融公庫債券	1.78	100,000	101,928	2017/3/17
第21回東日本高速道路株式会社債	0.58	100,000	101,046	2018/6/20
第5回中国日本高速道路株式会社債	1.86	100,000	104,517	2018/9/20
第6回中国日本高速道路株式会社債	1.73	100,000	104,547	2018/12/20
小 計		20,683,290	22,407,657	
金融債券				
い第741号商工債	0.45	200,000	200,620	2017/2/27
い第758号商工債	0.4	100,000	100,531	2018/7/27
い第770号商工債	0.2	100,000	100,041	2019/7/26
い第771号商工債	0.2	100,000	100,030	2019/8/27
い第773号商工債	0.2	200,000	200,036	2019/10/25
い第786号商工債	0.22	100,000	100,096	2020/11/27
い第745号農林債	0.35	120,000	120,249	2017/6/27
い第749号農林債	0.3	100,000	100,171	2017/10/27
い第751号農林債	0.3	100,000	100,184	2017/12/27
い第765号農林債	0.3	100,000	100,258	2019/2/27
い第766号農林債	0.3	300,000	300,804	2019/3/27
い第769号農林債	0.3	100,000	100,273	2019/6/27
第267回信金中金債(5年)	0.45	100,000	100,310	2017/2/27
第275回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,224	2017/10/27
第278回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,232	2018/1/26
第280回信金中金債(5年)	0.2	100,000	100,046	2018/3/27
第288回信金中金債(5年)	0.3	100,000	100,339	2018/11/27
第295回信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,205	2019/6/27
第299回信金中金債(5年)	0.2	200,000	200,036	2019/10/25
第182号商工債(3年)	0.14	100,000	99,916	2018/3/27
第183号商工債(3年)	0.15	200,000	199,878	2018/4/27
小 計		2,720,000	2,724,479	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第457回東京電力株式会社債	2.05	100,000	103,872	2018/11/16
第521回東京電力株式会社債	1.97	100,000	100,644	2016/6/27
第522回東京電力株式会社債	2.06	100,000	100,943	2016/8/31
第539回東京電力株式会社債	1.591	100,000	102,002	2018/3/28
第542回東京電力株式会社債	1.602	100,000	102,111	2018/4/25
第544回東京電力株式会社債	1.976	100,000	103,164	2018/6/25
第426回中部電力株式会社債	2.17	100,000	107,487	2019/1/25
第482回中部電力株式会社債	2.75	100,000	106,479	2019/6/25
第490回中部電力株式会社債	1.444	100,000	104,100	2019/7/25
第500回中部電力株式会社債	0.875	100,000	103,080	2024/5/24
第448回関西電力株式会社債	2.16	100,000	104,400	2018/6/20
第463回関西電力株式会社債	1.64	100,000	102,985	2018/4/25
第495回関西電力株式会社債	0.746	100,000	101,688	2021/9/17
第370回中国電力株式会社債	1.285	100,000	104,829	2020/12/25
第377回中国電力株式会社債	1.121	100,000	105,078	2023/8/25
第303回北陸電力株式会社債	0.756	100,000	101,665	2019/6/25

銘柄	当 期 利率	末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
		千円	千円	
第307回北陸電力株式会社債	1.055	100,000	103,185	2026/6/25
第459回東北電力株式会社債	0.869	173,000	174,255	2017/2/24
第253回四国電力株式会社債	1.0	100,000	104,171	2023/6/23
第371回九州電力株式会社債	1.43	100,000	106,393	2022/12/22
第384回九州電力株式会社債	1.47	100,000	101,709	2017/6/23
第396回九州電力株式会社債	1.79	100,000	102,732	2017/11/24
第405回九州電力株式会社債	1.792	100,000	104,074	2018/11/22
第315回北海道電力株式会社債	0.82	100,000	101,148	2018/4/25
第316回北海道電力株式会社債	1.164	100,000	103,544	2020/6/25
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	100,000	103,725	2023/5/9
第20回清水建設株式会社無担保社債	0.599	100,000	101,150	2020/3/6
第5回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.325	100,000	100,367	2017/12/20
第3回リソールホールディングス株式会社無担保社債	1.69	100,000	103,312	2018/3/19
第21回株式会社ニチレイ無担保社債	0.659	100,000	102,045	2020/9/4
第5回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.852	100,000	101,034	2017/6/20
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	102,903	2023/3/20
第29回王子製紙株式会社無担保社債	0.386	100,000	100,352	2017/7/26
第43回友化学株式会社無担保社債	1.58	100,000	105,277	2020/4/23
第9回宇部興産株式会社無担保社債	0.604	100,000	100,770	2018/6/6
第3回大日本住友製薬株式会社無担保社債	1.106	100,000	102,008	2018/3/8
第1回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,349	2017/12/4
第2回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.515	100,000	101,224	2019/12/4
第5回東海ゴム工業無担保社債	0.288	100,000	100,180	2018/2/28
第14回旭硝子株式会社無担保社債	1.005	100,000	104,849	2023/6/2
第67回新日本製鐵株式会社無担保社債	1.293	100,000	104,949	2021/3/19
第23回新製鋼株式会社無担保社債	0.64	100,000	100,721	2019/3/8
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	101,523	2024/3/13
第28回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.777	100,000	101,500	2018/8/31
第22回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.821	100,000	103,808	2022/9/20
第12回株式会社クボタ無担保社債	0.299	100,000	100,316	2018/1/31
第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	100,000	103,238	2023/12/13
第1回日本電産株式会社無担保社債	0.386	100,000	100,387	2017/9/20
第2回日本電産株式会社無担保社債	0.595	100,000	101,192	2019/9/20
第13回トヨタテクノ株式会社無担保社債	0.568	100,000	100,510	2022/3/18
第26回ソニー株式会社無担保社債	2.068	100,000	105,272	2019/6/20
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	0.609	100,000	101,492	2020/10/30
第22回三菱重工業株式会社無担保社債	2.03	100,000	103,090	2017/9/12
第24回三菱重工業株式会社無担保社債	1.482	100,000	104,894	2019/12/9
第1回明治安田生命2013基金特定目的会社特定社債	0.82	200,000	202,692	2018/8/8
第52回日産自動車株式会社無担保社債	1.17	100,000	101,322	2017/4/28
第57回日産自動車株式会社無担保社債	0.314	100,000	100,338	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	105,410	2019/6/20
第18回株式会社ニコン無担保社債	0.996	100,000	101,610	2018/1/26
第60回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.135	100,000	103,736	2020/7/29
第62回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.221	100,000	104,836	2021/9/14
第92回丸紅株式会社無担保社債	0.756	100,000	101,640	2019/7/19
第69回三井物産株式会社無担保社債	2.139	100,000	117,159	2021/7/22
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	107,829	2023/7/16
第70回三菱商事株式会社無担保社債	1.9	100,000	104,375	2018/7/25
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	2.2	100,000	114,892	2026/10/30
第25回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.31	100,000	104,734	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	106,147	2021/2/20

銘柄	利率	当 期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.62	100,000	106,872	2021/6/9
第35回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.52	100,000	106,831	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	113,174	2022/10/27
第87回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	1.87	100,000	102,108	2017/4/20
第107回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	1.575	100,000	104,814	2019/7/17
第140回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.24	100,000	100,111	2018/1/23
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	100,539	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	108,193	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	105,088	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	106,190	2020/12/17
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.6	200,000	213,288	2021/6/1
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	115,680	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	107,401	2020/8/7
第8回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.99	100,000	102,132	2017/4/27
第6回興銀リース株式会社無担保社債	0.151	100,000	99,963	2018/6/5
第21回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.35	100,000	100,415	2017/12/20
第25回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.554	100,000	101,026	2018/6/20
第63回アコム株式会社無担保社債	0.99	100,000	100,982	2017/6/7
第9回株式会社ジャックス無担保社債	0.79	100,000	101,405	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	103,262	2024/3/19
第163回オリックス株式会社無担保社債	0.746	100,000	100,696	2017/8/7
第167回オリックス株式会社無担保社債	0.508	100,000	100,370	2018/3/7
第6回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.323	100,000	100,307	2018/2/8
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	103,897	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	106,431	2020/6/24
第39回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.853	100,000	101,295	2018/2/26
第41回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.783	100,000	101,308	2018/6/20
第40回三井不動産株式会社無担保社債	1.061	100,000	103,280	2020/6/19
第47回三井不動産株式会社無担保社債	1.954	100,000	113,169	2032/12/20
第79回三菱地所株式会社無担保社債	1.79	100,000	101,959	2017/3/27
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	119,365	2027/9/17
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	100,903	2024/4/26
第10回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.03	100,000	103,677	2020/9/18
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	105,025	2023/6/26
第9回ジャパンリアルエステイト投資法人無担保投資法人債	0.497	100,000	100,765	2018/8/30
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	104,706	2022/6/7
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	1.199	100,000	105,434	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	111,815	2022/9/20
第43回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.86	100,000	108,166	2020/12/18
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.26	100,000	118,408	2027/4/16
第52回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.62	100,000	103,324	2018/4/20
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.249	100,000	120,038	2030/3/22
第85回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.874	100,000	104,121	2022/7/22
第7回西日本旅客鉄道株式会社社債	2.41	100,000	106,641	2018/12/25
第11回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.21	100,000	115,062	2024/3/20
第10回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.42	100,000	102,164	2017/9/20
第20回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.77	100,000	102,744	2017/9/20
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	100,000	119,588	2030/4/23

銘柄	利率	当 期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	119,542	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	100,000	119,783	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	112,086	2032/5/25
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	103,365	2023/10/25
第9回株式会社商船三井無担保社債	0.97	100,000	98,639	2024/6/19
第5回関西高速鉄道株式会社無担保社債	1.238	100,000	104,661	2020/9/10
第52回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.77	100,000	101,916	2017/3/17
第53回日本電信電話株式会社電信電話債券	1.54	100,000	102,717	2017/12/20
第18回KDDI株式会社無担保社債	1.573	100,000	105,383	2018/12/20
第15回株式会社エヌ・ティ・ティ・ドコモ無担保社債	1.96	100,000	104,376	2018/6/20
第9回沖縄電力株式会社社債	0.88	100,000	101,571	2018/3/20
第33回電源開発株式会社無担保社債	1.422	100,000	105,416	2021/2/19
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	100,000	103,498	2023/12/20
第9回大阪瓦斯株式会社無担保社債	2.9	100,000	105,578	2018/1/30
第11回北海道瓦斯株式会社無担保社債	1.238	100,000	105,253	2021/9/3
第21回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	1.6	100,000	103,163	2018/3/20
第2回ディー・エヌ・ビー・バンク エイ・エス・エイ円貨社債	0.593	100,000	100,979	2019/1/24
第5回ノルデアバンク・アクトイ エポラーク・アプリクト円貨社債	0.73	100,000	101,193	2018/6/5
第7回ビー・ピー・シー・イー・エス・イー円貨社債	0.55	100,000	100,672	2019/7/10
第11回ビー・ピー・シー・イー・エス・イー円貨社債	0.437	100,000	99,962	2020/12/11
第4回スウェンスカ・ハンデルスバンクエンA B円貨社債	0.325	100,000	100,134	2019/9/4
第9回クレディ・スイス・エ・ジ円貨社債	0.285	100,000	100,023	2018/12/18
第13回JPモルガン・チェース・アンド・カンパニー円貨社債	0.373	100,000	100,157	2017/2/13
第6回ビー・エヌ・ビー・パリ円貨社債	0.439	100,000	100,290	2019/9/17
第9回ナショナル・オーストラリア銀行円貨社債	0.457	200,000	201,618	2019/1/17
第9回ウエストバンク・バンキング・コーポレーション円貨社債	1.2	100,000	101,185	2017/3/9
第11回ウエストバンク・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.3	100,000	100,018	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	100,218	2020/10/29
第21回アボバンク・ネーランド円貨社債	0.708	200,000	202,208	2018/5/24
小 計		14,973,000	15,584,631	
合 計		289,429,120	312,481,645	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
	百万円	百万円
国内 10年国債標準物	1,494	-

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 312,481,645	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,539,746	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	317,021,391	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 2016年1月22日現在
(A) 資 産	317,126,375,533円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,215,786,698
公 社 債(評価額)	312,481,645,484
未 収 入 金	1,500,358,400
未 収 利 息	812,094,862
前 払 費 用	11,546,089
差 入 委 託 証 拠 金	104,944,000
(B) 負 債	1,611,026,474
未 払 金	564,536
未 払 解 約 金	1,505,477,938
差入委託証拠金代用有価証券	104,984,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	315,515,349,059
元 本	239,575,703,877
次 期 繰 越 損 益 金	75,939,645,182
(D) 受 益 権 総 口 数	239,575,703,877口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,170円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2015年1月23日 至 2016年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	3,784,387,523円
受 取 利 息	3,784,387,523
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,305,641,559
売 買 益	2,903,060,298
売 買 損	△1,597,418,739
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	10,098,472
取 引 益	51,785,304
取 引 損	△41,686,832
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	5,100,127,554
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	81,278,000,057
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	6,496,432,150
(G) 解 約 差 損 益 金	△16,934,914,579
(H) 計 (D+E+F+G)	75,939,645,182
次 期 繰 越 損 益 金(H)	75,939,645,182

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

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

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

お知らせ

一般社団法人投資信託協会「信用リスク集中回避のための投資制限に係るガイドライン」の制定に伴い、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2015年3月11日)