

# ファンドラップ（ウエルス・スクエア） 債券・安定型

## 運用報告書(全体版)

第7期（決算日2023年3月29日）

作成対象期間（2022年3月30日～2023年3月29日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●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／内外／債券
信託期間	2016年10月20日以降、無期限とします。
運用方針	主として、世界の債券（主として、投資適格格付が付与されているもしくは同等の信用度を有すると判断される世界の公社債など）を 実質的な投資対象とする投資信託証券に投資し、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本と します。 投資する投資信託証券については、実質的な外貨建資産については為替ヘッジを行なうことを基本とするもの、もしくはこれらに類す るものに限定することを基本とします。ただし、外貨建て投資信託証券に投資する場合は、当該投資信託証券に対して為替変動リスク を回避する目的で外国為替予約取引を用いる場合があります。 投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエアによる各投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析お よび投資環境等の定性判断等に基づく投資配分比率に関する助言をもとに各投資信託証券への配分比率を決定します。なお、組入投資 信託証券については適宜見直しを行ないます。
主な投資対象	主として有価証券に投資する投資信託証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金 融商品等に直接投資する場合があります。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
配分方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額水準等を勘 案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行ないます。

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉 営業日の午前9時～午後5時



ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 組 入 比 率	信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分 込 配 金	騰 落 率					
3期(2019年3月29日)	円 9,929	円 0	% 1.5	% 98.4	% —	% —	% —	百万円 11,215
4期(2020年3月30日)	10,030	0	1.0	97.8	—	—	—	25,323
5期(2021年3月29日)	9,934	0	△1.0	79.1	—	19.9	—	30,031
6期(2022年3月29日)	9,665	0	△2.7	86.3	—	—	—	62,717
7期(2023年3月29日)	9,359	0	△3.2	80.9	—	—	—	63,491

\*当ファンドはマザーファンド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。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

\*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 組 入 比 率	信 託 券 率
		騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2022年3月29日	円 9,665	% —	% —	% 86.3	% —	% —	% —
3月末	9,728	0.7	86.8	—	—	—	
4月末	9,700	0.4	84.2	—	—	—	
5月末	9,684	0.2	84.5	—	3.0	—	
6月末	9,593	△0.7	81.4	—	3.0	—	
7月末	9,646	△0.2	80.1	—	3.9	—	
8月末	9,585	△0.8	84.2	—	—	—	
9月末	9,492	△1.8	83.9	—	—	—	
10月末	9,480	△1.9	84.6	—	—	—	
11月末	9,434	△2.4	88.0	—	2.0	—	
12月末	9,310	△3.7	72.9	—	8.0	—	
2023年1月末	9,270	△4.1	89.0	—	—	—	
2月末	9,228	△4.5	82.1	—	—	—	
(期末) 2023年3月29日	9,359	△3.2	80.9	—	—	—	

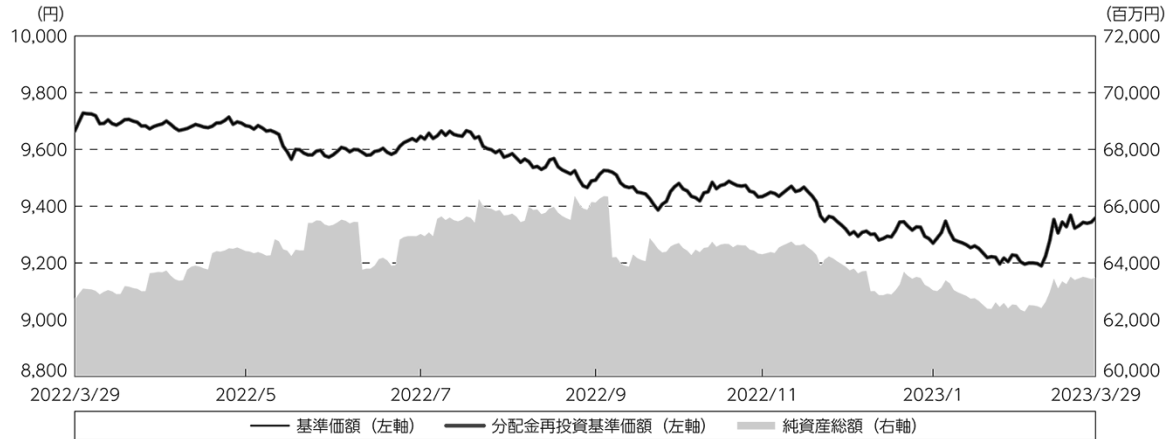
\*騰落率は期首比です。

\*当ファンドはマザーファンド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。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期首：9,665円

期末：9,359円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△ 3.2%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）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。作成期首（2022年3月29日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 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、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

### ○基準価額の変動要因

基準価額は、期首9,665円から期末9,359円となりました。

#### (変動要因)

- ・ 外国債券為替ヘッジ型マザーファンドが値下がりしたこと

## ○投資環境

### <世界債券市場>

欧米での高インフレを抑制するためにFRB（米連邦準備制度理事会）およびECB（欧州中央銀行）が積極的な利上げ姿勢を示したことで、欧米の国債利回りは上昇し、当作成期間では値下がりとなりました。

### <高利回り債券市場>

欧米の国債利回りが上昇したことや、米銀行の経営破綻を背景にリスク回避の動きが強まったことなどを背景に当作成期間では値下がりとなりました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

世界の債券（主として、投資適格格付が付与されているもしくは同等の信用度を有すると判断される世界の公社債など）を実質的な投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とし、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標に運用を行ないました。

投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエア（以下「ウエルス・スクエア」という）からの助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案して指定投資信託証券の選定および投資信託証券への投資配分比率の決定を行ないました。

※なお、投資する投資信託証券については実質的な外貨建資産について、為替ヘッジを行なうことを基本とするもの、もしくはこれらに類するものに限定することを基本とします。

### ・投資信託証券組入比率

投資方針に基づいて、当作成期を通じて高位の組入れを維持しました。

### ・指定投資信託証券の見直し

ウエルス・スクエアからの助言に基づき、当期において投資対象ファンドの見直しは行ないませんでした。

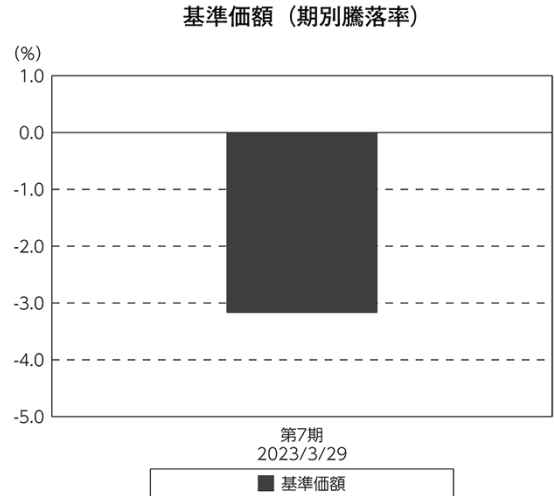
### ・指定投資信託証券の組入れ比率推移

ファンド名	期首	3月末	4月末	5月末	6月末	7月末	8月末	9月末	10月末	11月末	12月末	1月末	2月末	期末
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	64.9%	65.0%	65.1%	64.8%	65.0%	73.0%	80.2%	79.9%	80.1%	82.0%	67.9%	42.1%	50.4%	62.9%
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	3.0%	2.9%	1.0%	1.0%	1.0%	5.1%	1.0%	1.0%	1.0%	3.0%	3.0%	44.7%	28.7%	16.3%
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド	19.0%	19.0%	19.0%	18.9%	16.0%	3.0%	4.0%	4.0%	4.0%	4.0%	3.0%	3.0%	3.0%	3.0%
バンガード・米国短期国債ETF	—	—	—	3.0%	3.0%	3.9%	—	—	—	2.0%	8.0%	—	—	—

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

収益分配金については、基準価額水準等を勘案して決定しました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。

## ○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第 7 期
	2022年 3月30日～ 2023年 3月29日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	464

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）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) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## ◎今後の運用方針

投資信託証券への投資にあたっては、ウエルス・スクエアからの助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案して指定投資信託証券の選定および投資信託証券への配分比率の決定を行ないます。

ウエルス・スクエアはポートフォリオの構築にあたり、投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析および投資環境等の定性判断等に基づき、投資配分比率に関する助言を行ないます。

組入投資信託証券については適宜見直しを行ないます。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2022年3月30日～2023年3月29日)

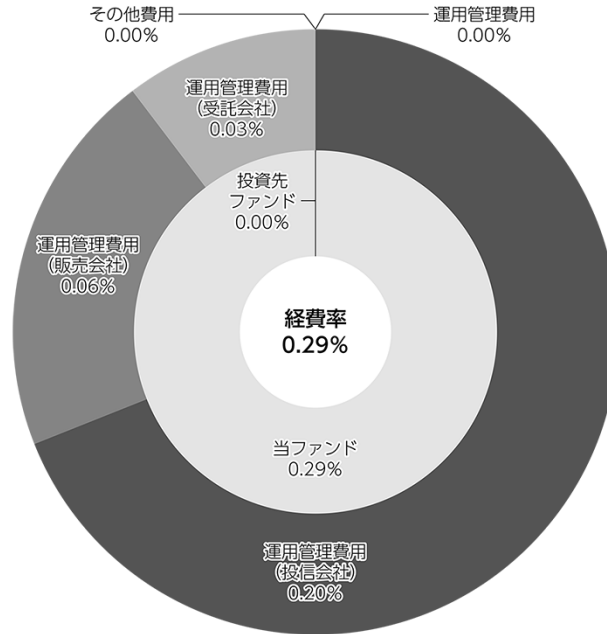
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 27	% 0.286	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(19)	(0.198)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(5)	(0.055)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.033)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.007	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(1)	(0.007)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.001	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.001)	
(d) そ の 他 費 用	0	0.003	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(0)	(0.001)	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 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	28	0.297	
期中の平均基準価額は、9,512円です。			

- \* 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により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。
- \* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。
- \* 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、この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。
- \* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
- \* 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は0.29%です。



(単位: %)

経費率(①+②)	0.29
①当ファンドの費用の比率	0.29
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00

(注) 当ファンドの費用は1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

(注) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。



## ○売買及び取引の状況

(2022年3月30日～2023年3月29日)

### 投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	バンガード・米国短期国債ETF	3,037,200	177,279	3,037,200	177,351

\*金額は受け渡し代金。

\*金額の単位未満は切り捨て。

### 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	25,111,784	32,223,494	25,536,536	32,279,534
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	37,386,190	39,292,505	28,946,857	29,798,556
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド	2,556,261	2,607,198	12,237,630	12,450,493

\*単位未満は切り捨て。

## ○利害関係人との取引状況等

(2022年3月30日～2023年3月29日)

### 利害関係人との取引状況

<ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型>  
該当事項はございません。

<国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド>

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	B/A		うち利害関係人との取引状況 D	D/C	
公社債	百万円 247,420	百万円 5,475	% 2.2	百万円 167,101	百万円 4,259	% 2.5

平均保有割合 5.0%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

<外国債券為替ヘッジ型マザーファンド>  
該当事項はございません。

<クレジット戦略型円建て債券マザーファンド>

区 分	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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 47.2%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2023年3月29日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	31,327,023	30,902,270	39,910,282
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,627,825	10,067,159	10,339,979
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド	11,568,214	1,886,844	1,921,940

\*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2023年3月29日現在)

項 目	当 期 末
	評 価 額 比 率
	千円 %
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	39,910,282 62.6
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	10,339,979 16.2
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド	1,921,940 3.0
コール・ローン等、その他	11,548,413 18.2
投資信託財産総額	63,720,614 100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*外国債券為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(89,344,371千円)の投資信託財産総額(91,972,581千円)に対する比率は97.1%です。

\*当期末における外貨建純資産(85千円)の投資信託財産総額(63,720,614千円)に対する比率は0.0%です。

\*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=131.28円、1カナダドル=96.58円、1英ポンド=161.97円、1スウェーデンクローナ=12.69円、1ノルウェークローネ=12.69円、1デンマーククローネ=19.11円、1ユーロ=142.36円、1ズロチ=30.448円、1シンガポールドル=98.91円、1人民元=19.0884円、1豪ドル=87.89円、1ニュージーランドドル=82.13円、1新シェケル=37.0196円、1メキシコペソ=7.2054円。

## ○特定資産の価格等の調査

クレジット戦略型円建て債券マザーファンドにおいて調査依頼を行なった取引は2022年2月2日から2023年2月6日までの間でスワップ取引5件でした。これらのスワップ取引について、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、取引先、通貨の種類、銘柄名、想定元本金額、取引スプレッドその他の当該スワップ取引の内容に関して、EY新日本有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2023年3月29日現在）

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	63,720,614,101	
コール・ローン等	11,397,254,137	
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	39,910,282,618	
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	10,339,979,309	
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド(評価額)	1,921,940,258	
未収入金	151,157,779	
(B) 負債	229,223,268	
未払解約金	138,006,860	
未払信託報酬	90,514,667	
未払利息	5,542	
その他未払費用	696,199	
(C) 純資産総額(A-B)	63,491,390,833	
元本	67,841,672,555	
次期繰越損益金	△ 4,350,281,722	
(D) 受益権総口数	67,841,672,555口	
1万口当たり基準価額(C/D)	9,359円	

(注) 期首元本額は64,892,615,866円、期中追加設定元本額は19,229,431,428円、期中一部解約元本額は16,280,374,739円、1口当たり純資産額は0.9359円です。

## ○損益の状況（2022年3月30日～2023年3月29日）

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	10,696,319	
受取配当金	12,228,857	
受取利息	52,684	
支払利息	△ 1,585,222	
(B) 有価証券売買損益	△1,695,912,845	
売買益	1,196,342,823	
売買損	△2,892,255,668	
(C) 信託報酬等	△ 185,182,048	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,870,398,574	
(E) 前期繰越損益金	△1,340,713,469	
(F) 追加信託差損益金	△1,139,169,679	
(配当等相当額)	( 2,373,082,922)	
(売買損益相当額)	(△3,512,252,601)	
(G) 計(D+E+F)	△4,350,281,722	
(H) 収益分配金	0	
次期繰越損益金(G+H)	△4,350,281,722	
追加信託差損益金	△1,139,169,679	
(配当等相当額)	( 2,383,376,610)	
(売買損益相当額)	(△3,522,546,289)	
分配準備積立金	769,579,647	
繰越損益金	△3,980,691,690	

\* 損益の状況の中で(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。

\* 損益の状況の中で(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。

\* 損益の状況の中で(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) 分配金の計算過程（2022年3月30日～2023年3月29日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2022年3月30日～ 2023年3月29日
a. 配当等収益(経費控除後)	269,114,177円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	2,383,376,610円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	500,465,470円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	3,152,956,257円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	464円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万円当たり)	0円

## ○分配金のお知らせ

1万円当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合、分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

## 運用報告書

第20期（決算日2022年3月31日）

作成対象期間（2021年4月1日～2022年3月31日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。
主な投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行ないません。

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	NOMURA-BPI総合	期中率			
16期(2018年4月2日)	円	%		%	%	%	百万円
	13,114	0.9	381.893	0.9	99.6	—	672,515
17期(2019年4月1日)	13,342	1.7	388.518	1.7	99.3	—	663,317
18期(2020年3月31日)	13,340	△0.0	388.450	△0.0	98.1	—	679,315
19期(2021年3月31日)	13,248	△0.7	385.724	△0.7	99.5	—	735,829
20期(2022年3月31日)	13,090	△1.2	381.037	△1.2	99.8	—	833,820

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

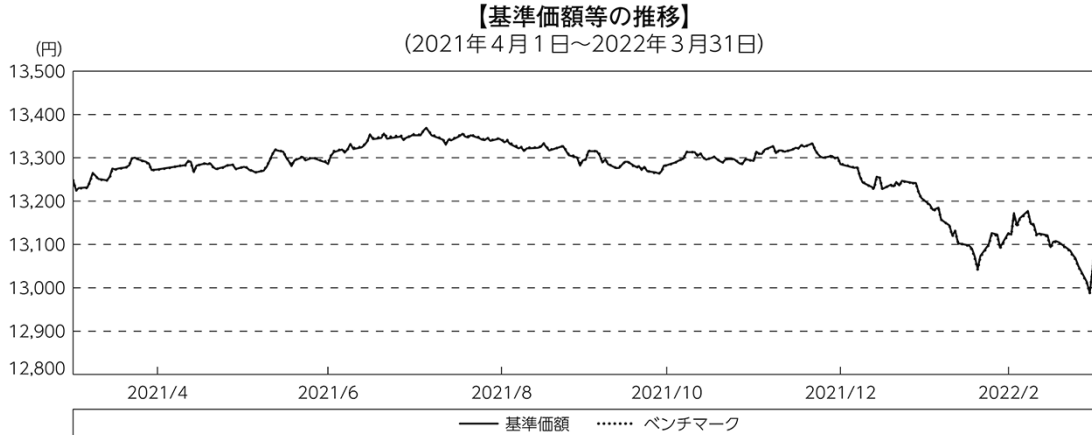
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	NOMURA-BPI総合	騰落率		
(期首) 2021年3月31日	円	%		%	%	%
	13,248	—	385.724	—	99.5	—
4月末	13,273	0.2	386.440	0.2	99.2	—
5月末	13,279	0.2	386.621	0.2	99.2	—
6月末	13,286	0.3	386.903	0.3	99.6	—
7月末	13,352	0.8	388.809	0.8	98.6	—
8月末	13,341	0.7	388.461	0.7	99.3	—
9月末	13,296	0.4	387.116	0.4	99.1	—
10月末	13,283	0.3	386.721	0.3	99.4	—
11月末	13,314	0.5	387.655	0.5	99.1	—
12月末	13,285	0.3	386.841	0.3	99.0	—
2022年1月末	13,192	△0.4	384.056	△0.4	99.0	—
2月末	13,126	△0.9	382.128	△0.9	99.0	—
(期末) 2022年3月31日	13,090	△1.2	381.037	△1.2	99.8	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

当運用期間では、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したことから基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

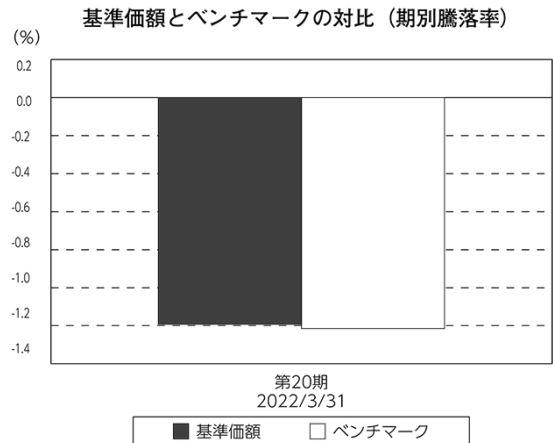
NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ない、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は-1.2%となり、ベンチマークの-1.2%と同程度となりました。

### (その他要因)

ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること。



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

## ◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、債券組入比率を高位に保ち、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせることで、NOMURA-BPI総合との連動をできる限り高めるように運用を行なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。



## ○1万口当たりの費用明細

(2021年4月1日～2022年3月31日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2021年4月1日～2022年3月31日)

### 公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	212,494,042	121,317,552
	地方債証券	14,065,897	6,914,283
内	特殊債券	16,137,272	(15,360)
	社債券(投資法人債券を含む)	15,233,423	11,490,114
			(980,037)
			1,720,414

\*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

\*単位未満は切り捨て。

\* ( ) 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。

\*社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年4月1日～2022年3月31日)

### 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
		百万円	%		百万円	%
公社債	257,930	907	0.4	141,442	1,459	1.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2022年3月31日現在)

## 国内公社債

## (A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	642,295,000	667,251,907	80.0	—	53.2	18.4	8.5
	( 2,960,000)	( 3,995,904)	( 0.5)	(—)	( 0.5)	( 0.0)	( —)
地方債証券	55,428,320	57,337,944	6.9	—	3.7	2.5	0.7
	( 55,428,320)	( 57,337,944)	( 6.9)	(—)	( 3.7)	( 2.5)	( 0.7)
特殊債券 (除く金融債)	60,880,889	63,220,691	7.6	—	4.0	2.4	1.2
	( 60,880,889)	( 63,220,691)	( 7.6)	(—)	( 4.0)	( 2.4)	( 1.2)
金融債券	3,100,000	3,095,895	0.4	—	—	0.3	0.0
	( 3,100,000)	( 3,095,895)	( 0.4)	(—)	( —)	( 0.3)	( 0.0)
普通社債券 (含む投資法人債券)	40,705,000	40,993,825	4.9	—	2.6	1.8	0.5
	( 40,705,000)	( 40,993,825)	( 4.9)	(—)	( 2.6)	( 1.8)	( 0.5)
合 計	802,409,209 (163,074,209)	831,900,264 (168,644,261)	99.8 (20.2)	— (—)	63.6 (10.8)	25.4 ( 7.0)	10.8 ( 2.4)

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\*金額の単位未満は切り捨て。

\*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。

\*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (2年) 第424回	0.005	2,600,000	2,602,106	2023/5/1
国庫債券	利付 (2年) 第426回	0.005	1,500,000	1,501,395	2023/7/1
国庫債券	利付 (2年) 第427回	0.005	6,800,000	6,806,324	2023/8/1
国庫債券	利付 (2年) 第428回	0.005	2,400,000	2,402,208	2023/9/1
国庫債券	利付 (2年) 第429回	0.005	1,500,000	1,501,455	2023/10/1
国庫債券	利付 (2年) 第431回	0.005	3,000,000	3,003,000	2023/12/1
国庫債券	利付 (2年) 第433回	0.005	3,500,000	3,503,185	2024/2/1
国庫債券	利付 (5年) 第136回	0.1	4,300,000	4,308,901	2023/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第137回	0.1	6,600,000	6,615,510	2023/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第138回	0.1	7,100,000	7,118,318	2023/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第139回	0.1	6,700,000	6,718,425	2024/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第140回	0.1	5,100,000	5,115,810	2024/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第141回	0.1	9,600,000	9,631,968	2024/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第142回	0.1	1,200,000	1,204,404	2024/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第143回	0.1	6,070,000	6,094,280	2025/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第144回	0.1	4,400,000	4,418,392	2025/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第145回	0.1	3,900,000	3,916,224	2025/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第146回	0.1	2,100,000	2,108,988	2025/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第147回	0.005	5,600,000	5,602,184	2026/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第148回	0.005	7,300,000	7,300,000	2026/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第149回	0.005	7,100,000	7,096,805	2026/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第150回	0.005	4,000,000	3,996,200	2026/12/20
国庫債券	利付 (40年) 第1回	2.4	2,860,000	3,894,090	2048/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第2回	2.2	900,000	1,183,419	2049/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第3回	2.2	900,000	1,190,673	2050/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第4回	2.2	1,630,000	2,169,204	2051/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第5回	2.0	1,200,000	1,542,480	2052/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第6回	1.9	1,300,000	1,646,723	2053/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第7回	1.7	1,400,000	1,705,550	2054/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第8回	1.4	1,500,000	1,705,845	2055/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第9回	0.4	3,550,000	3,013,737	2056/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第10回	0.9	2,010,000	1,996,713	2057/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第11回	0.8	1,750,000	1,684,130	2058/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第12回	0.5	2,070,000	1,793,075	2059/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第13回	0.5	7,020,000	6,054,048	2060/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第14回	0.7	4,460,000	4,113,636	2061/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第329回	0.8	6,000,000	6,063,660	2023/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第330回	0.8	3,800,000	3,848,108	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	1,918,449	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第332回	0.6	5,900,000	5,966,021	2023/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第333回	0.6	3,600,000	3,645,324	2024/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第334回	0.6	6,600,000	6,693,786	2024/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第335回	0.5	4,600,000	4,660,858	2024/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第336回	0.5	2,750,000	2,790,040	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第337回	0.3	3,000,000	3,027,360	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第338回	0.4	9,000,000	9,116,280	2025/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (10年) 第339回	0.4	5,000,000	5,069,250	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	2,700,000	2,739,366	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	5,800,000	5,867,976	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	6,550,000	6,577,248	2026/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第343回	0.1	9,500,000	9,538,000	2026/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第344回	0.1	6,400,000	6,424,256	2026/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第345回	0.1	7,000,000	7,024,710	2026/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第346回	0.1	5,100,000	5,117,697	2027/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第347回	0.1	5,400,000	5,416,848	2027/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第348回	0.1	5,800,000	5,817,400	2027/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第349回	0.1	2,800,000	2,807,168	2027/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第350回	0.1	10,150,000	10,171,112	2028/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第351回	0.1	6,000,000	6,009,240	2028/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第352回	0.1	6,400,000	6,406,144	2028/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第353回	0.1	1,200,000	1,200,396	2028/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第354回	0.1	1,850,000	1,850,000	2029/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第355回	0.1	2,600,000	2,597,192	2029/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第356回	0.1	4,800,000	4,791,072	2029/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第357回	0.1	1,900,000	1,894,908	2029/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第358回	0.1	5,470,000	5,450,581	2030/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第359回	0.1	10,600,000	10,552,618	2030/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第360回	0.1	10,900,000	10,840,704	2030/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第361回	0.1	7,400,000	7,352,270	2030/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第362回	0.1	8,500,000	8,436,250	2031/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第363回	0.1	10,450,000	10,360,025	2031/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第364回	0.1	8,650,000	8,565,576	2031/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第365回	0.1	7,500,000	7,421,400	2031/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	500,000	599,445	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第2回	2.4	500,000	588,645	2030/2/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	187,795	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第4回	2.9	1,400,000	1,727,572	2030/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	177,307	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	600,000	725,502	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	724,794	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	116,311	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	265,000	297,125	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	272,682	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	185,216	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	265,089	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	346,799	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	996,376	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,135,386	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,156,990	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,506,924	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	2,200,000	2,740,628	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	2,050,000	2,558,297	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	1,270,000	1,622,310	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	300,000	376,092	2035/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	770,238	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,080,231	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	902,321	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	631,625	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,088,527	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	3,550,000	4,612,621	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	1,200,000	1,565,292	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	1,500,000	1,939,605	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	1,700,000	2,175,184	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	1,200,000	1,519,224	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	1,200,000	1,542,108	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	2,400,000	2,963,640	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	3,300,000	4,199,118	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	2,851,425	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	2,000,000	2,485,960	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,821,962	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	1,600,000	1,935,936	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	1,400,000	1,723,106	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	1,300,000	1,575,743	2043/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	1,500,000	1,789,545	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	1,600,000	1,910,080	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,552,954	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,673,462	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	1,700,000	1,960,831	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	1,800,000	2,076,696	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	1,700,000	1,997,602	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	1,900,000	2,150,762	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	2,900,000	3,282,887	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第50回	0.8	1,900,000	1,901,900	2046/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第51回	0.3	2,650,000	2,357,254	2046/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第52回	0.5	1,900,000	1,770,667	2046/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第53回	0.6	1,700,000	1,619,794	2046/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第54回	0.8	1,700,000	1,692,945	2047/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第55回	0.8	1,500,000	1,492,170	2047/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第56回	0.8	1,900,000	1,886,016	2047/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第57回	0.8	1,600,000	1,584,784	2047/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第58回	0.8	2,100,000	2,077,656	2048/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第59回	0.7	1,600,000	1,541,920	2048/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第60回	0.9	1,150,000	1,159,913	2048/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第61回	0.7	1,500,000	1,438,470	2048/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第62回	0.5	1,500,000	1,362,405	2049/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第63回	0.4	1,400,000	1,233,470	2049/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第64回	0.4	1,500,000	1,318,830	2049/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第65回	0.4	2,200,000	1,932,370	2049/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第66回	0.4	2,600,000	2,283,996	2050/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第67回	0.6	1,800,000	1,665,360	2050/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第68回	0.6	1,950,000	1,803,106	2050/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第69回	0.7	2,200,000	2,090,044	2050/12/20

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第70回	0.7	1,610,000	1,527,229	2051/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第71回	0.7	2,400,000	2,275,776	2051/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第72回	0.7	1,300,000	1,230,827	2051/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第73回	0.7	500,000	473,220	2051/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	444,668	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	306,843	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	411,544	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	470,274	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	309,555	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	321,838	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	302,786	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	583,587	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	569,197	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	209,926	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	1,470,000	1,547,616	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,200,000	1,266,492	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	800,000	846,504	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	638,046	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	962,297	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	742,308	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	849,752	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	916,252	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	1,400,000	1,496,082	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	385,257	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	880,384	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,477,860	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,290,012	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	433,408	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,700,000	1,855,482	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	543,745	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,206,480	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	513,517	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,646,445	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	275,522	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	650,000	713,589	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	329,310	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	220,532	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	100,000	111,770	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	442,916	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	300,000	335,283	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	333,645	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	1,100,000	1,228,623	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	820,000	924,336	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	284,782	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	1,500,000	1,716,405	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	682,848	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	450,280	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,147,076	2028/9/20

銘柄	当期末				
	利	率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券 利付 (20年) 第106回		2.2	400,000	454,592	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回		2.1	300,000	340,281	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回		1.9	1,600,000	1,793,456	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回		1.9	900,000	1,012,428	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回		2.1	1,100,000	1,252,647	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回		2.2	800,000	919,752	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回		2.1	1,800,000	2,056,536	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回		2.1	2,000,000	2,294,080	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第114回		2.1	1,700,000	1,956,734	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回		2.2	1,000,000	1,158,670	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回		2.2	1,100,000	1,279,047	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回		2.1	1,400,000	1,616,832	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回		2.0	500,000	575,335	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回		1.8	800,000	907,536	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回		1.6	800,000	894,544	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回		1.9	1,200,000	1,375,080	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回		1.8	900,000	1,023,786	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回		2.1	500,000	583,170	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回		2.0	1,000,000	1,157,750	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回		2.2	1,400,000	1,651,006	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回		2.0	1,200,000	1,393,956	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回		1.9	500,000	576,400	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回		1.9	800,000	924,784	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回		1.8	1,300,000	1,490,983	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回		1.8	1,700,000	1,954,643	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回		1.7	800,000	912,384	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回		1.7	1,300,000	1,486,641	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回		1.8	1,400,000	1,614,354	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回		1.8	1,400,000	1,618,106	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回		1.7	700,000	802,214	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第136回		1.6	700,000	795,375	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回		1.7	1,000,000	1,148,490	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第138回		1.5	800,000	902,792	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回		1.6	1,000,000	1,138,490	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第140回		1.7	2,300,000	2,647,047	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回		1.7	2,600,000	2,998,294	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回		1.8	950,000	1,105,467	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回		1.6	1,300,000	1,488,123	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回		1.5	1,300,000	1,474,239	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回		1.7	2,300,000	2,662,480	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回		1.7	2,400,000	2,783,400	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回		1.6	4,000,000	4,599,160	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回		1.5	2,100,000	2,393,874	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回		1.5	3,850,000	4,394,544	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回		1.4	3,330,000	3,763,532	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回		1.2	2,500,000	2,765,525	2034/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第152回		1.2	2,650,000	2,931,218	2035/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第153回		1.3	1,600,000	1,790,912	2035/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>国債証券</b>		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	2,120,000	2,345,780	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	5,350,000	5,778,749	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	4,650,000	4,643,815	2036/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	5,540,000	5,369,257	2036/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	3,470,000	3,500,674	2036/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第159回	0.6	4,810,000	4,912,982	2036/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	3,000,000	3,105,150	2037/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第161回	0.6	2,100,000	2,138,766	2037/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第162回	0.6	1,700,000	1,728,135	2037/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第163回	0.6	2,600,000	2,639,806	2037/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第164回	0.5	2,600,000	2,594,228	2038/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第165回	0.5	2,200,000	2,191,772	2038/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第166回	0.7	2,300,000	2,359,225	2038/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第167回	0.5	2,600,000	2,578,108	2038/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第168回	0.4	2,700,000	2,626,938	2039/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第169回	0.3	3,030,000	2,890,377	2039/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第170回	0.3	2,800,000	2,662,940	2039/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第171回	0.3	2,500,000	2,370,375	2039/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第172回	0.4	3,840,000	3,694,464	2040/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第173回	0.4	3,250,000	3,117,627	2040/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第174回	0.4	3,970,000	3,796,908	2040/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第175回	0.5	5,500,000	5,344,460	2040/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第176回	0.5	6,020,000	5,837,895	2041/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第177回	0.4	5,070,000	4,820,505	2041/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第178回	0.5	3,750,000	3,624,562	2041/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第179回	0.5	3,000,000	2,896,020	2041/12/20
メキシコ	合衆国 第19回円貨社債 (2014)	1.44	100,000	101,814	2024/7/24
小 計			642,295,000	667,251,907	
<b>地方債証券</b>					
東京都	公募第731回	0.635	100,000	101,189	2024/3/19
東京都	公募第736回	0.505	100,000	101,136	2024/9/20
東京都	公募第745回	0.533	300,000	304,758	2025/6/20
東京都	公募第760回	0.045	100,000	99,799	2026/9/18
東京都	公募第761回	0.075	100,000	99,933	2026/9/18
東京都	公募第769回	0.21	500,000	502,335	2027/6/18
東京都	公募第778回	0.165	100,000	100,029	2028/3/17
東京都	公募第784回	0.254	200,000	201,012	2028/9/20
東京都	公募第813回	0.179	200,000	198,452	2030/12/20
東京都	公募第822回	0.095	130,000	127,722	2031/9/19
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	129,764	2038/9/17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	254,348	2039/9/20
東京都	公募第1回	1.54	300,000	305,607	2023/6/20
東京都	公募 (20年) 第3回	2.26	200,000	208,768	2024/3/19
東京都	公募第7回	2.16	100,000	107,310	2025/9/19
東京都	公募 (20年) 第13回	2.15	100,000	111,376	2027/12/20
東京都	公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	224,228	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第17回	2.09	200,000	225,290	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第20回	2.09	180,000	204,798	2029/9/20



銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
東京都	公募第23回	2.12	100,000	115,857	2030/12/20
東京都	公募(20年)第26回	1.74	100,000	114,440	2032/6/18
東京都	公募(20年)第29回	1.57	200,000	227,310	2033/9/20
東京都	公募(5年)第31回	0.005	300,000	299,760	2024/6/20
東京都	公募(5年)第32回	0.02	300,000	299,757	2025/6/20
北海道	公募平成26年度第13回	0.461	100,000	101,168	2024/12/26
北海道	公募平成27年度第7回	0.529	100,000	101,647	2025/8/28
北海道	公募平成29年度第5回	0.18	200,000	200,572	2027/6/30
北海道	公募平成29年度第7回	0.21	100,000	100,322	2027/8/31
北海道	公募平成29年度第9回	0.205	100,000	100,304	2027/10/27
北海道	公募平成30年度第15回	0.291	253,920	252,970	2038/9/24
北海道	公募平成30年度第18回	0.146	200,000	199,186	2029/2/28
北海道	公募令和2年度第4回	0.165	300,000	297,705	2030/6/26
宮城県	公募第31回1号	0.515	300,000	304,815	2025/9/29
宮城県	公募第32回2号	0.105	100,000	100,067	2026/9/28
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	101,184	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	101,246	2024/3/19
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	101,360	2024/6/20
神奈川県	公募第208回	0.551	100,000	101,132	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	202,238	2024/12/20
神奈川県	公募第212回	0.42	100,000	101,140	2025/3/19
神奈川県	公募第231回	0.22	200,000	200,736	2027/12/20
神奈川県	公募第243回	0.075	200,000	197,650	2029/12/20
神奈川県	公募第247回	0.12	200,000	197,908	2030/6/20
神奈川県	公募(30年)第3回	2.62	100,000	129,973	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	331,584	2027/3/19
神奈川県	公募(20年)第14回	1.969	100,000	114,019	2030/7/19
神奈川県	公募(20年)第17回	1.975	200,000	231,072	2031/7/11
神奈川県	公募(20年)第26回	1.477	100,000	112,954	2034/6/20
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	105,182	2023/11/28
大阪府	公募第381回	0.683	100,000	101,260	2024/2/27
大阪府	公募第382回	0.674	100,000	101,281	2024/3/28
大阪府	公募第383回	0.695	100,000	101,375	2024/4/26
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	101,380	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	303,510	2024/8/28
大阪府	公募第389回	0.53	100,000	101,270	2024/10/30
大阪府	公募第396回	0.554	200,000	203,274	2025/5/28
大阪府	公募第417回	0.248	102,000	102,781	2027/2/26
大阪府	公募第423回	0.185	100,000	100,188	2027/8/30
大阪府	公募第429回	0.197	179,000	179,282	2028/2/25
大阪府	公募第452回	0.062	100,000	98,557	2030/1/30
大阪府	公募第467回	0.164	140,000	138,475	2031/4/28
大阪府	公募第469回	0.128	150,000	147,747	2031/6/27
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	115,310	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	114,676	2031/12/22
大阪府	公募(5年)第173回	0.001	200,000	199,740	2025/7/30
大阪府	公募(5年)第174回	0.001	200,000	199,700	2025/8/28
大阪府	公募(5年)第178回	0.001	400,000	399,176	2025/12/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
大阪府	公募（5年）第184回	0.001	400,000	398,744	2026/6/29
大阪府	公募（5年）第190回	0.001	200,000	199,116	2026/12/25
京都府	公募平成25年度第15回	0.66	200,000	202,476	2024/3/19
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	112,696	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	202,586	2024/9/19
京都府	公募（20年）平成27年度第5回	1.23	200,000	220,254	2035/8/17
京都府	公募（15年）平成27年度第8回	0.78	100,000	104,295	2030/10/11
京都府	公募（15年）平成28年度第2回	0.21	200,000	198,820	2031/4/22
京都府	公募（20年）平成28年度第5回	0.327	100,000	97,623	2036/8/15
京都府	公募平成29年度第4回	0.19	100,000	100,337	2027/6/21
兵庫県	公募平成26年度第17回	0.46	100,000	101,231	2025/2/26
兵庫県	公募平成29年度第22回	0.19	100,000	100,201	2028/1/21
兵庫県	公募（30年）第2回	2.36	200,000	256,522	2040/3/19
兵庫県	公募（15年）第1回	1.66	300,000	320,442	2026/7/29
兵庫県	公募（15年）第3回	1.35	200,000	212,878	2027/7/16
兵庫県	公募（12年）第3回	0.56	300,000	304,740	2025/4/16
兵庫県	公募（15年）第8回	1.09	100,000	106,172	2029/4/16
兵庫県	公募（15年）第11回	0.718	100,000	103,801	2030/5/10
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	112,092	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	115,239	2029/11/19
兵庫県	公募（20年）第11回	1.84	200,000	226,082	2030/8/16
兵庫県	公募（20年）第14回	1.72	100,000	114,135	2032/5/24
兵庫県	公募（20年）第22回	1.4	100,000	112,051	2034/9/8
静岡県	公募平成25年度第5回	0.926	101,000	102,214	2023/7/25
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	167,285	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	101,290	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	200,000	202,620	2024/10/24
静岡県	公募平成27年度第11回	0.11	115,400	115,600	2026/3/19
静岡県	公募平成28年度第2回	0.08	300,000	300,105	2026/3/19
静岡県	公募平成29年度第3回	0.17	100,000	100,370	2027/3/19
静岡県	公募（31年）第1回	0.095	174,000	172,792	2029/3/19
静岡県	公募（5年）令和3年度第2回	0.01	100,000	99,758	2026/3/19
静岡県	公募（5年）令和3年度第5回	0.005	300,000	299,052	2026/6/19
静岡県	公募（15年）第2回	1.406	200,000	213,322	2027/6/25
静岡県	公募（15年）第5回	1.087	200,000	211,830	2028/11/20
静岡県	公募（15年）第9回	0.739	100,000	103,970	2030/9/20
静岡県	公募（20年）第11回	1.841	100,000	113,265	2030/10/18
静岡県	公募（20年）第14回	1.736	200,000	228,688	2032/6/18
静岡県	公募（20年）第18回	1.473	100,000	112,894	2034/7/10
静岡県	公募（20年）第30回	0.449	200,000	191,326	2040/9/20
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	112,350	2028/12/20
愛知県	公募（20年）平成22年度第8回	1.891	200,000	227,160	2030/9/13
愛知県	公募（20年）平成24年度第4回	1.687	100,000	113,885	2032/6/11
愛知県	公募（15年）平成24年度第14回	1.314	400,000	426,444	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	115,933	2033/2/8
愛知県	公募（30年）平成25年度第8回	2.024	120,000	148,669	2043/6/19
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	120,045	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	111,640	2034/11/14

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
愛知県	公募平成26年度第17回	0.463	300,000	303,720	2025/2/26
愛知県	公募(15年)平成27年度第2回	0.74	300,000	311,994	2030/4/26
愛知県	公募平成27年度第15回	0.471	100,000	101,516	2025/11/27
愛知県	公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,322	2027/8/31
愛知県	公募平成29年度第9回	0.15	100,000	100,054	2027/9/15
愛知県	公募平成30年度第7回	0.18	200,000	200,126	2028/7/31
愛知県	公募令和3年度第10回	0.001	200,000	199,194	2026/10/15
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	202,318	2023/9/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	110,539	2025/1/27
広島県	公募平成26年度第7回	0.46	200,000	202,502	2025/3/25
広島県	公募平成29年度第3回	0.15	100,000	100,027	2027/9/27
広島県	公募平成29年度第4回	0.22	211,300	212,128	2027/11/24
広島県	公募平成30年度第6回	0.02	300,000	299,952	2024/2/20
広島県	公募令和2年度第2回	0.165	100,000	99,309	2030/7/22
広島県	公募令和2年度第7回	0.214	300,000	298,272	2031/3/19
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	101,193	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	149,734	2023/9/27
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	101,224	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	101,230	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第3回	0.67	100,000	101,354	2024/5/20
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	202,534	2024/9/26
埼玉県	公募平成26年度第7回	0.476	400,000	404,772	2024/12/25
埼玉県	公募平成26年度第9回	0.429	100,000	101,140	2025/2/25
埼玉県	公募平成27年度第9回	0.235	100,000	100,658	2026/2/25
埼玉県	公募平成28年度第5回	0.05	100,000	99,870	2026/7/28
埼玉県	公募平成30年度第4回	0.205	200,000	200,432	2028/6/26
埼玉県	公募平成30年度第7回	0.02	200,000	200,004	2023/10/26
埼玉県	公募令和元年度第4回	0.055	100,000	98,891	2029/6/20
埼玉県	公募令和2年度第4回	0.145	300,000	297,468	2030/6/17
埼玉県	公募(15年)第1回	0.941	100,000	105,310	2029/10/19
埼玉県	公募(15年)第2回	0.869	200,000	210,042	2030/5/22
埼玉県	公募(15年)第3回	0.43	100,000	101,415	2032/1/30
埼玉県	公募(25年)第2回	0.781	200,000	200,442	2042/9/19
埼玉県	公募(30年)第9回	0.845	200,000	196,056	2048/3/19
埼玉県	公募(20年)第6回	2.26	100,000	113,347	2028/9/21
埼玉県	公募(20年)第16回	1.216	100,000	109,944	2035/8/14
埼玉県	公募(20年)第20回	0.626	100,000	101,414	2037/5/15
福岡県	公募平成26年度第1回	0.654	100,000	101,371	2024/6/26
福岡県	公募平成27年度第1回	0.578	300,000	305,169	2025/6/26
福岡県	公募平成29年度第1回	0.2	100,000	100,389	2027/6/23
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	106,475	2026/11/27
福岡県	公募(15年)平成27年度第1回	0.784	200,000	208,690	2030/11/25
福岡県	公募(15年)令和元年度第1回	0.254	100,000	98,393	2034/6/14
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	130,347	2037/9/18
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	1.827	100,000	120,291	2044/6/20
福岡県	公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	0.937	100,000	100,344	2047/12/20
福岡県	公募(20年)平成20年度第1回	2.26	300,000	339,471	2028/8/18
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	2.05	100,000	112,417	2028/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
福岡県	公募（20年）平成22年度第1回	1.77	300,000	337,437	2030/8/19
福岡県	公募（20年）平成22年度第2回	2.116	300,000	348,285	2031/2/21
福岡県	公募（20年）平成24年度第2回	1.635	100,000	113,474	2032/8/16
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	101,082	2023/6/23
千葉県	公募平成25年度第4回	0.92	100,000	101,194	2023/7/25
千葉県	公募平成26年度第1回	0.679	100,000	101,330	2024/4/25
千葉県	公募平成26年度第3回	0.611	200,000	202,640	2024/7/25
千葉県	公募平成27年度第6回	0.469	200,000	203,040	2025/12/25
千葉県	公募平成28年度第4回	0.085	200,000	199,954	2026/9/25
千葉県	公募平成29年度第4回	0.15	100,000	100,027	2027/9/24
千葉県	公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,237	2028/3/24
千葉県	公募令和元年度第6回	0.135	300,000	297,813	2030/1/25
千葉県	公募（20年）第1回	2.06	400,000	429,756	2025/12/19
千葉県	公募（20年）第8回	2.18	100,000	115,363	2030/4/19
千葉県	公募（20年）第13回	1.701	200,000	228,558	2032/10/15
千葉県	公募（20年）第16回	1.555	200,000	227,574	2034/4/14
千葉県	公募（20年）第17回	1.403	100,000	112,107	2034/10/13
新潟県	公募平成30年度第2回	0.264	200,000	201,106	2028/11/30
新潟県	公募令和2年度第2回	0.135	120,000	118,680	2030/11/29
長野県	公募令和3年度第1回	0.19	300,000	297,714	2031/4/16
茨城県	公募令和3年度第3回	0.005	200,000	199,298	2026/8/25
群馬県	公募第12回	0.519	100,000	101,580	2025/8/15
群馬県	公募（5年）第13回	0.005	300,000	298,950	2026/8/18
群馬県	公募（20年）第3回	1.687	100,000	113,887	2032/6/25
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	189,046	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	400,000	402,808	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	300,000	303,564	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	101,174	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	700,000	707,385	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第129回	0.71	100,000	101,190	2023/12/25
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	101,335	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	101,238	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	202,640	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	500,000	506,295	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	156,993	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	546,453	2025/2/25
共同発行市場地方債	公募第145回	0.406	1,000,000	1,011,210	2025/4/25
共同発行市場地方債	公募第152回	0.496	400,000	406,420	2025/11/25
共同発行市場地方債	公募第154回	0.405	300,000	303,927	2026/1/23
共同発行市場地方債	公募第156回	0.1	200,000	200,230	2026/3/25
共同発行市場地方債	公募第157回	0.08	300,000	300,114	2026/4/24
共同発行市場地方債	公募第161回	0.06	300,000	299,670	2026/8/25
共同発行市場地方債	公募第172回	0.225	600,000	603,162	2027/7/23
共同発行市場地方債	公募第184回	0.175	100,000	100,031	2028/7/25
共同発行市場地方債	公募第186回	0.25	400,000	401,796	2028/9/25
共同発行市場地方債	公募第188回	0.264	300,000	301,656	2028/11/24
共同発行市場地方債	公募第190回	0.16	610,000	608,956	2029/1/25
共同発行市場地方債	公募第191回	0.14	100,000	99,655	2029/2/22

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>地方債証券</b>		%	千円	千円	
共同発行市場地方債	公募第194回	0.11	200,000	198,648	2029/5/25
共同発行市場地方債	公募第196回	0.06	400,000	395,508	2029/7/25
共同発行市場地方債	公募第197回	0.06	300,000	296,595	2029/8/24
共同発行市場地方債	公募第200回	0.07	100,000	98,834	2029/11/22
共同発行市場地方債	公募第206回	0.131	300,000	297,270	2030/5/24
共同発行市場地方債	公募第213回	0.125	300,000	296,286	2030/12/25
共同発行市場地方債	公募第215回	0.145	400,000	395,528	2031/2/25
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	114,439	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	116,930	2044/9/20
長崎県	公募令和元年度第3回	0.05	100,000	98,855	2029/6/20
島根県	公募(30年)平成29年度第1回	0.919	100,000	100,195	2047/6/20
佐賀県	公募平成28年度第1回	0.08	100,000	99,930	2026/11/30
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	202,416	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,048	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	143,715	2024/11/28
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,048	2023/11/29
熊本県	公募平成28年度第2回	0.06	132,000	131,819	2026/10/28
熊本市	公募平成29年度第1回	0.19	100,000	100,225	2027/11/30
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	236,019	2023/12/26
新潟市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,312	2027/12/24
浜松市	公募平成26年度第1回	0.335	100,000	100,821	2025/1/23
大阪市	公募平成25年度第6回	0.694	100,000	101,107	2023/11/22
大阪市	公募平成26年度第5回	0.593	100,000	101,365	2024/9/27
大阪市	公募平成27年度第6回	0.471	100,000	101,514	2025/11/25
大阪市	公募令和2年度第2回	0.131	300,000	297,273	2030/5/22
大阪市	公募令和3年度第2回	0.16	300,000	296,835	2031/5/21
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	107,183	2026/7/17
大阪市	公募(20年)第1回	2.3	300,000	336,072	2027/11/15
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	114,691	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	113,479	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	100,000	114,651	2032/12/21
大阪市	公募(20年)第26回	0.635	100,000	101,179	2037/10/23
名古屋市	公募第488回	0.598	300,000	304,137	2024/9/20
名古屋市	公募第489回	0.461	100,000	101,146	2024/12/20
名古屋市	公募第501回	0.175	200,000	200,326	2027/9/29
名古屋市	公募第503回	0.205	100,000	100,266	2028/3/24
名古屋市	公募第504回	0.205	200,000	200,430	2028/6/20
名古屋市	公募第511回	0.075	200,000	197,416	2030/3/27
名古屋市	公募第512回	0.15	300,000	297,585	2030/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	206,388	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	105,056	2029/11/16
京都市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,402	2027/8/25
京都市	公募平成29年度第4回	0.235	101,280	101,748	2028/1/31
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	107,153	2025/9/19
京都市	公募(20年)第5回	2.36	200,000	221,270	2026/12/18
京都市	公募(20年)第6回	2.38	100,000	112,146	2027/9/17
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	111,616	2034/11/24
京都市	公募(20年)第15回	0.487	200,000	199,256	2036/11/28

銘	柄	当 期 末		
		利 率	額 面 金 額	評 価 額
		%	千円	千円
地方債証券				
神戸市	公募平成26年度第17回	0.28	300,000	302,010
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	200,074
神戸市	公募平成30年度第2回	0.845	200,000	196,056
横浜市	公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	201,482
横浜市	公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	202,068
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	202,328
横浜市	公募平成28年度第5回	0.23	300,000	301,947
横浜市	公募平成29年度第3回	0.22	100,000	100,453
横浜市	公募2019年度第3回	0.05	200,000	197,468
横浜市	公募(30年)第2回	2.49	200,000	251,640
横浜市	公募(20年)第11回	2.2	100,000	109,883
横浜市	公募(20年)第18回	2.21	100,000	114,156
横浜市	公募(20年)第26回	1.776	100,000	115,328
横浜市	公募(20年)第30回	1.376	100,000	111,802
札幌市	公募(15年)平成23年度第9回	1.493	200,000	213,530
札幌市	公募(20年)平成24年度第1回	1.79	100,000	114,800
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	1.794	100,000	115,593
札幌市	公募平成26年度第4回	0.54	100,000	101,107
札幌市	公募平成26年度第9回	0.43	200,000	202,096
川崎市	公募(20年)第14回	1.79	100,000	114,645
川崎市	公募(20年)第17回	1.527	100,000	112,925
川崎市	公募(20年)第19回	1.362	100,000	111,628
川崎市	公募(30年)第11回	0.817	100,000	97,348
北九州市	公募(10年)令和2年度第2回	0.125	200,000	197,356
北九州市	公募(20年)第3回	2.33	200,000	223,736
北九州市	公募(20年)第14回	1.732	100,000	114,598
福岡市	公募(20年)平成21年度第3回	2.14	200,000	228,270
福岡市	公募(20年)平成23年度第4回	1.89	100,000	114,827
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	113,106
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	101,278
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	162,025
福岡市	公募(5年)2020年度第9回	0.01	300,000	299,427
広島市	公募平成26年度第2回	0.456	100,000	101,125
広島市	公募平成27年度第2回	0.464	500,000	507,510
広島市	公募(10年)平成30年度第6回	0.146	241,000	240,267
千葉市	公募平成26年度第2回	0.505	200,000	202,466
三重県	公募平成28年度第1回	0.165	155,000	155,475
福井県	公募平成27年度第4回	0.085	200,000	200,116
福井県	公募令和元年度第3回	0.05	200,000	197,384
徳島県	公募平成29年度第2回	0.19	200,000	200,450
徳島県	公募平成30年度第2回	0.264	300,000	301,659
山梨県	公募令和元年度第1回	0.05	100,000	98,692
岡山県	公募平成28年度第2回	0.205	168,900	169,776
岡山県	公募令和2年度第3回	0.224	300,000	298,512
愛知県・名古屋	折半保証名古屋高速道路債券 第96回	2.34	100,000	112,992
愛知県・名古屋	折半保証名古屋高速道路債券 第102回	2.298	300,000	343,410
福岡北九州	高速道路債券 第117回	2.26	100,000	112,504

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
福岡北九州高速道路債券 第136回		0.833	100,000	103,502	2030/3/19
小	計		55,428,320	57,337,944	
特殊債券(除く金融債)					
政保 地方公共団体金融機構債券 第48回		0.605	500,000	503,515	2023/5/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第49回		0.882	13,000	13,141	2023/6/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回		0.911	100,000	101,200	2023/7/14
政保 地方公共団体金融機構債券 第56回		0.747	591,000	599,002	2024/1/19
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回		0.669	116,000	117,566	2024/4/12
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回		0.544	100,000	101,297	2024/9/13
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回		0.539	400,000	405,348	2024/10/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回		0.414	420,000	424,935	2025/2/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回		0.509	189,000	191,963	2025/5/23
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回		0.381	509,000	515,566	2025/11/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第80回		0.32	300,000	303,294	2026/1/19
政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回		0.173	500,000	501,610	2024/1/29
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回		0.02	116,000	115,856	2026/4/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第91回		0.085	300,000	300,138	2026/12/14
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回		0.145	157,000	157,095	2028/5/19
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回		0.13	100,000	99,937	2028/7/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回		0.219	110,000	110,491	2028/10/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第119回		0.04	116,000	114,983	2029/4/13
政保 地方公共団体金融機構債券 11回		0.001	500,000	499,885	2024/8/28
日本政策金融公庫債券 政府保証第63回		0.11	110,000	108,718	2031/2/25
新関西国際空港債券 政府保証第2回		0.882	191,000	193,137	2023/6/27
新関西国際空港債券 政府保証第5回		0.145	117,000	117,374	2027/3/30
原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券 政府保証第16回		0.001	700,000	700,175	2023/11/27
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回		2.2	100,000	102,706	2023/6/19
日本政策投資銀行社債 政府保証第37回		0.085	400,000	400,184	2026/12/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回		0.155	300,000	300,594	2027/12/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第52回		0.001	300,000	299,898	2025/1/24
日本政策投資銀行社債 政府保証第55回		0.105	300,000	298,740	2029/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第90回		2.1	100,000	114,186	2029/9/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第92回		2.1	200,000	228,630	2029/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第97回		2.1	200,000	229,142	2029/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第99回		2.2	200,000	230,942	2030/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第106回		2.1	200,000	230,116	2030/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回		1.9	200,000	227,578	2030/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第123回		2.1	100,000	124,308	2040/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回		1.83	100,000	119,931	2042/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回		1.634	100,000	113,621	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第171回		1.56	100,000	112,893	2032/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第172回		1.919	300,000	364,989	2042/8/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回		1.726	100,000	114,998	2033/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第185回		1.757	200,000	230,770	2033/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第190回		0.605	400,000	402,916	2023/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第193回		0.882	1,000,000	1,011,270	2023/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第197回		0.835	272,000	275,291	2023/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第207回		0.693	300,000	303,654	2023/12/28

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>		%	千円	千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第211回	0.66	137,000	138,731	2024/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第213回	0.645	745,000	754,506	2024/3/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第216回	1.483	100,000	113,195	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第217回	1.72	100,000	118,118	2044/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第219回	1.478	100,000	113,104	2034/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第220回	0.644	300,000	304,260	2024/6/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第224回	1.72	100,000	118,182	2044/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第225回	0.556	190,000	192,504	2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第229回	0.539	630,000	638,574	2024/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第234回	0.466	100,000	101,238	2024/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第239回	1.16	500,000	546,690	2035/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第241回	0.45	200,000	202,638	2025/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第245回	1.079	300,000	325,128	2035/4/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第258回	0.386	400,000	405,164	2025/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第261回	0.381	401,000	406,208	2025/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第271回	0.02	151,000	150,873	2026/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第296回	0.522	200,000	200,614	2036/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第297回	0.085	100,000	100,025	2026/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第306回	0.145	403,000	404,289	2027/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第315回	0.13	100,000	100,130	2027/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第321回	0.155	600,000	601,452	2027/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第324回	0.09	100,000	99,863	2027/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第335回	0.84	100,000	98,340	2047/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第339回	0.195	500,000	502,055	2028/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第342回	0.145	131,000	131,116	2028/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第351回	0.145	100,000	100,031	2028/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第354回	0.13	200,000	199,874	2028/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第357回	0.209	100,000	100,407	2028/8/31
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	360,000	364,006	2023/10/20
民間都市開発推進機構	政府保証第17回	0.145	400,000	401,700	2026/2/26
関西国際空港債券	政府保証第54回	2.4	300,000	341,961	2028/6/23
中部国際空港債券	政府保証第22回	0.001	300,000	300,012	2024/3/1
預金保険機構債券	政府保証第230回	0.1	600,000	601,260	2024/8/6
預金保険機構債券	政府保証第231回	0.1	300,000	300,645	2024/10/4
新関西国際空港社債	財投機関債第6回	1.445	300,000	323,811	2028/9/15
新関西国際空港社債	財投機関債第9回	1.231	100,000	106,766	2028/12/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	105,945	2029/9/20
新関西国際空港社債	財投機関債第22回	0.05	200,000	200,054	2023/12/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	105,691	2029/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第66回	0.09	400,000	400,308	2026/4/17
日本政策投資銀行社債	財投機関債第78回	0.225	200,000	201,138	2027/4/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第82回	0.27	100,000	100,761	2027/7/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第86回	0.235	300,000	301,482	2027/10/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第96回	0.195	200,000	200,000	2028/7/12
日本政策投資銀行社債	財投機関債第101回	0.309	300,000	302,010	2028/10/12
日本政策投資銀行社債	財投機関債第137回	0.03	400,000	399,348	2026/3/19
日本政策投資銀行社債	財投機関債第138回	0.145	400,000	394,984	2031/1/15
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第1回	2.99	200,000	285,690	2045/9/20



銘柄	柄	当 期 末		
		利 率	額 面 金 額	評 価 額
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第4回	2.59	100,000	127,526
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第8回	2.45	200,000	218,860
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第17回	2.35	100,000	110,080
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第23回	2.39	300,000	335,703
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第33回	2.91	200,000	287,268
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第39回	2.37	300,000	341,697
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第47回	2.41	100,000	115,199
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第89回	1.711	100,000	113,701
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第103回	1.69	350,000	399,311
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第105回	1.853	100,000	115,808
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第107回	0.935	100,000	101,131
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第116回	0.722	400,000	404,132
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第122回	0.704	100,000	101,315
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第123回	0.69	100,000	101,287
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第130回	0.56	200,000	202,326
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第134回	0.529	200,000	202,188
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第136回	0.583	200,000	202,682
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第145回	1.523	300,000	338,166
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第149回	1.604	100,000	114,185
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第157回	0.857	100,000	104,678
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第164回	1.149	100,000	108,476
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第173回	0.652	100,000	87,957
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第188回	0.614	100,000	100,426
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第260回	0.651	200,000	182,546
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第28回	2.83	400,000	510,520
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第33回	2.91	100,000	129,379
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第38回	2.26	1,000,000	1,054,860
公営企業債券	30年第4回財投機関債	2.95	100,000	129,714
地方公営企業等金融機構債券	(20年) 第1回	2.07	100,000	112,400
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第1回	2.266	300,000	343,353
地方公共団体金融機構債券	20年第4回	2.12	100,000	114,202
地方公共団体金融機構債券	F16回	2.042	100,000	109,252
地方公共団体金融機構債券	20年第6回	2.242	300,000	346,530
地方公共団体金融機構債券	20年第7回	2.202	300,000	346,170
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第10回	1.752	300,000	336,546
地方公共団体金融機構債券	F104回	1.314	100,000	103,746
地方公共団体金融機構債券	F106回	1.259	100,000	102,416
地方公共団体金融機構債券	F122回	1.412	100,000	106,696
地方公共団体金融機構債券	F124回	1.418	100,000	106,682
地方公共団体金融機構債券	F132回	1.09	500,000	517,375
地方公共団体金融機構債券	F142回	1.016	100,000	102,593
地方公共団体金融機構債券	F145回	1.059	200,000	206,068
地方公共団体金融機構債券	F147回	1.291	100,000	105,910
地方公共団体金融機構債券	F160回	1.052	100,000	105,241
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第29回	1.725	100,000	114,890
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	600,000	606,972
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	303,567
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	212,714

銘柄	利	当 期		末	償還年月日
		率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第38回	1.487	100,000	112,708	2034/7/28	
地方公共団体金融機構債券 F240回	1.069	300,000	318,813	2030/2/28	
地方公共団体金融機構債券 第64回	0.574	100,000	101,318	2024/9/27	
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第39回	1.425	100,000	111,998	2034/9/28	
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第43回	1.171	100,000	108,910	2035/4/27	
地方公共団体金融機構債券 第74回	0.519	300,000	304,719	2025/7/28	
地方公共団体金融機構債券 第77回	0.491	100,000	101,555	2025/10/28	
地方公共団体金融機構債券 第79回	0.484	400,000	406,312	2025/12/26	
地方公共団体金融機構債券 第95回	0.2	200,000	200,886	2027/4/28	
地方公共団体金融機構債券 第101回	0.235	400,000	401,992	2027/10/28	
公営企業債券 (20年) 第5回財投機関債	2.11	200,000	206,156	2023/9/20	
公営企業債券 (20年) 第19回財投機関債	2.37	100,000	110,681	2026/12/18	
公営企業債券 (20年) 第20回財投機関債	2.25	100,000	110,677	2027/3/24	
公営企業債券 (20年) 第23回財投機関債	2.29	200,000	223,458	2027/9/24	
公営企業債券 (20年) 第24回財投機関債	2.29	100,000	112,661	2028/4/25	
公営企業債券 (20年) 第25回財投機関債	2.5	100,000	114,234	2028/6/20	
首都高速道路 第28回	0.04	200,000	199,288	2026/9/18	
阪神高速道路 第25回	0.03	100,000	99,719	2026/3/19	
都市再生債券 財投機関債第96回	0.599	200,000	202,762	2024/9/20	
都市再生債券 財投機関債第97回	1.017	100,000	105,617	2029/9/20	
都市再生債券 財投機関債第101回	0.935	100,000	105,092	2029/11/20	
都市再生債券 財投機関債第109回	0.918	100,000	105,168	2030/6/20	
都市再生債券 財投機関債第113回	0.851	300,000	314,043	2030/9/20	
都市再生債券 財投機関債第121回	0.482	200,000	203,268	2031/2/20	
都市再生債券 財投機関債第127回	0.075	100,000	99,933	2026/9/18	
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	2.26	100,000	107,073	2025/6/20	
東京交通債券 第347回	2.05	157,000	162,889	2024/3/8	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	2.26	400,000	442,684	2027/3/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回	2.46	200,000	224,196	2027/6/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	2.15	100,000	103,137	2023/9/20	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	1.94	100,000	105,645	2025/3/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	2.11	100,000	114,783	2030/6/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	1.95	100,000	114,051	2030/10/22	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	2.066	100,000	115,920	2031/6/13	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	1.751	300,000	321,141	2026/6/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	2.056	100,000	115,902	2031/7/11	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第81回	1.926	100,000	114,942	2031/9/12	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回	1.841	200,000	228,496	2031/10/17	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	1.595	200,000	214,086	2026/12/18	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第115回	1.811	100,000	114,914	2032/9/14	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	1.836	100,000	115,312	2032/11/12	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	1.801	200,000	229,652	2032/9/17	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	2.273	100,000	126,792	2042/9/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	1.092	200,000	210,692	2028/3/17	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	1.31	100,000	106,884	2028/6/20	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回	1.192	100,000	106,382	2028/10/20	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回	0.484	450,000	457,146	2025/12/19	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第188回	0.09	300,000	300,180	2026/5/20	

銘柄	利	当期末		
		率	額面金額	評価額
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回	0.155	300,000	300,843	2026/12/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第208回	0.215	200,000	200,986	2027/5/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	0.403	100,000	100,435	2032/11/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回	0.274	130,000	130,605	2028/8/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第301回	0.04	300,000	299,766	2025/12/19
成田国際空港 第17回	0.489	400,000	404,996	2025/2/20
成田国際空港 第19回	0.275	100,000	100,732	2026/2/18
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第6回	2.04	200,000	212,868	2025/6/20
国際協力機構債券 第6回財投機関債	2.098	200,000	230,976	2030/12/13
国際協力機構債券 第23回財投機関債	0.684	100,000	101,242	2024/2/21
東日本高速道路 第61回	0.14	200,000	198,332	2029/7/31
東日本高速道路 第83回	0.05	200,000	199,496	2026/6/19
東日本高速道路 第86回	0.04	400,000	398,312	2026/12/18
中日本高速道路 第63回	0.576	100,000	101,807	2025/11/13
中日本高速道路 第79回	0.04	300,000	299,853	2024/8/19
中日本高速道路 第86回	0.06	100,000	99,920	2026/1/22
中日本高速道路 第89回	0.05	100,000	99,770	2026/6/1
中日本高速道路 第90回	0.05	300,000	299,223	2026/7/27
中日本高速道路 第91回	0.04	200,000	199,288	2026/9/17
西日本高速道路 第20回	0.759	200,000	202,174	2023/9/20
西日本高速道路 第22回	0.744	400,000	405,572	2024/3/19
西日本高速道路 第23回	0.602	100,000	101,211	2024/6/20
西日本高速道路 第30回	0.17	300,000	300,798	2026/5/22
西日本高速道路 第50回	0.04	200,000	199,906	2024/6/20
西日本高速道路 第64回	0.04	200,000	199,288	2026/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第57回	0.835	300,000	303,024	2023/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第62回	0.714	100,000	101,188	2023/12/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第68回	0.586	200,000	202,558	2024/8/5
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	1.441	100,000	111,989	2034/8/4
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第71回	0.525	500,000	506,430	2024/11/27
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第90回	0.2	300,000	297,222	2031/5/30
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第135回	0.11	300,000	296,286	2030/2/27
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	1.8	47,955	47,964	2039/6/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	2.34	31,527	31,840	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	2.25	9,812	9,814	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	1.84	21,762	22,037	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	1.93	24,848	25,499	2041/3/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	1.69	44,552	45,068	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	2.12	48,220	48,231	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	2.3	42,676	43,433	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	1.99	68,136	69,297	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	2.14	11,942	12,209	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	2.28	18,253	19,340	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	1.98	60,456	63,777	2044/9/10
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	1.64	8,461	8,462	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	1.43	55,408	57,873	2045/11/10
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	1.71	16,994	16,997	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	1.79	65,904	69,261	2046/2/10

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	1.51	49,404	51,584	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	2.34	32,882	34,639	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	1.89	61,290	64,340	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	1.36	70,320	73,032	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	1.21	110,910	115,269	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	1.34	104,337	108,795	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	1.26	68,310	71,058	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	1.64	22,919	23,961	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	1.6	54,536	57,348	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	1.07	36,254	37,496	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	1.07	79,276	82,037	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	1.08	35,126	36,332	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	1.87	19,636	19,640	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	1.25	107,292	111,774	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	1.88	22,695	23,962	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	1.86	23,817	25,165	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	1.87	22,160	23,409	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	1.85	21,588	22,722	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	1.41	61,322	64,063	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	1.42	88,764	92,673	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	1.44	30,209	31,557	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	1.21	69,196	71,954	2048/9/10
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	2.25	64,692	67,966	2044/4/10
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	1.82	65,358	68,801	2045/1/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	1.52	116,340	121,429	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	68,702	71,803	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	1.16	119,025	123,574	2047/9/10
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	1.07	102,831	106,303	2048/4/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	81,394	85,162	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	67,616	70,459	2048/8/10
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	1.04	167,964	173,627	2049/4/10
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	1.01	289,590	298,929	2049/5/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	44,519	45,782	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	45,806	47,153	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	47,221	48,424	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	98,986	100,819	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	104,948	106,055	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	55,060	56,248	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	58,938	60,032	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	175,536	179,647	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	181,524	186,452	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	122,374	125,528	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	0.84	59,037	60,442	2050/9/10
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	0.89	60,253	61,856	2050/10/10
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	0.41	227,583	226,986	2051/12/10
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	0.48	152,614	152,861	2052/1/10
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	0.46	153,860	153,830	2052/2/10
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	0.47	76,630	76,706	2052/3/10

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>特殊債券(除く金融債)</b>	%	千円	千円	
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	0.46	153,474	153,512	2052/4/10
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	0.4	77,284	77,038	2052/5/10
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	0.43	77,966	77,846	2052/6/10
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	0.46	79,113	79,112	2052/8/10
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	0.42	316,640	315,731	2052/10/10
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	0.43	239,586	238,996	2052/11/10
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	0.42	159,776	159,259	2053/1/10
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	0.46	163,342	163,155	2053/2/10
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	0.39	165,444	164,532	2053/7/10
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	0.39	83,201	82,723	2053/8/10
貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	0.44	83,926	83,718	2053/9/10
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	0.38	84,144	83,543	2054/1/10
貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	0.32	259,845	256,877	2054/3/10
貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	0.33	258,975	256,102	2054/5/10
貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	0.21	449,695	440,566	2054/11/10
貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	0.33	181,820	179,687	2055/1/10
貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	0.3	183,262	180,650	2055/3/10
貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	0.33	287,067	283,182	2056/1/10
貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券	0.36	191,340	189,237	2056/2/10
貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券	0.41	287,844	285,820	2056/3/10
貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券	0.41	193,174	191,746	2056/4/10
貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券	0.4	193,346	191,733	2056/5/10
貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券	0.39	291,225	288,472	2056/6/10
貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券	0.36	487,895	482,054	2056/7/10
貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券	0.38	296,436	293,261	2056/11/10
貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券	0.36	297,600	293,841	2056/12/10
貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券	0.32	298,263	293,800	2057/1/10
貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券	0.4	199,656	198,014	2057/2/10
貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券	0.48	300,000	299,928	2057/3/10
貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券	0.46	300,000	299,727	2057/4/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	0.725	100,000	101,115	2024/7/30
小 計		60,880,889	63,220,691	
<b>金融債券</b>				
商工債券 利付第818回い号	0.17	100,000	100,121	2023/7/27
商工債券 利付第819回い号	0.18	300,000	300,411	2023/8/25
商工債券 利付第829回い号	0.13	200,000	200,084	2024/6/27
商工債券 利付第831回い号	0.08	200,000	199,854	2024/8/27
商工債券 利付第833回い号	0.05	100,000	99,813	2024/10/25
商工債券 利付第845回い号	0.12	300,000	299,727	2025/10/27
商工債券 利付第852回い号	0.09	100,000	99,648	2026/5/27
商工債券 利付第854回い号	0.08	400,000	398,284	2026/7/27
商工債券 利付第856回い号	0.09	200,000	199,110	2026/9/25
しんきん中金債券 利付第374回	0.05	300,000	299,187	2026/1/27
しんきん中金債券 利付第377回	0.04	100,000	99,633	2026/4/27
しんきん中金債券 利付第379回	0.04	400,000	398,312	2026/6/26
しんきん中金債券 利付第380回	0.03	100,000	99,527	2026/7/27
商工債券 利付(3年)第258回	0.04	100,000	99,836	2024/7/26

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>	%	千円	千円	
商工債券 利付 (10年) 第15回	0.48	200,000	202,348	2025/9/19
小 計		3,100,000	3,095,895	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>				
東京電力 第548回	2.347	100,000	110,509	2028/9/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	109,961	2029/12/10
中部電力 第500回	0.875	200,000	203,036	2024/5/24
中部電力 第524回	0.39	100,000	100,362	2027/5/25
中部電力 第530回	0.274	200,000	197,660	2029/6/25
関西電力 第509回	0.47	100,000	100,614	2027/5/25
関西電力 第511回	0.41	300,000	300,804	2027/9/17
関西電力 第527回	0.28	200,000	200,388	2024/4/25
関西電力 第535回	0.18	200,000	199,586	2025/12/19
中国電力 第377回	1.121	100,000	101,363	2023/8/25
中国電力 第400回	0.34	100,000	99,973	2027/9/24
中国電力 第402回	0.25	100,000	100,184	2024/10/25
中国電力 第416回	0.355	100,000	99,577	2029/5/25
中国電力 第422回	0.35	600,000	595,110	2030/4/25
中国電力 第425回	0.37	100,000	99,327	2030/6/25
北陸電力 第307回	1.055	100,000	103,308	2026/6/25
北陸電力 第308回	0.769	100,000	101,459	2024/9/25
北陸電力 第326回	0.719	100,000	99,241	2038/4/23
東北電力 第475回	0.809	100,000	101,558	2024/9/25
東北電力 第481回	0.803	200,000	203,806	2025/7/25
東北電力 第484回	0.758	100,000	100,620	2036/5/23
東北電力 第491回	0.42	100,000	100,696	2027/2/25
東北電力 第508回	0.465	100,000	100,303	2029/4/25
東北電力 第521回	0.45	300,000	299,886	2030/5/24
東北電力 第529回	0.07	200,000	198,546	2026/4/24
四国電力 第281回	1.111	100,000	101,410	2023/9/25
九州電力 第424回	1.233	100,000	101,757	2023/11/24
九州電力 第428回	0.936	105,000	106,793	2024/7/25
九州電力 第449回	0.43	200,000	200,928	2027/4/23
九州電力 第451回	0.45	100,000	100,412	2027/5/25
九州電力 第476回	0.43	100,000	99,752	2029/5/25
九州電力 第481回	0.324	300,000	296,781	2029/7/25
九州電力 第484回	0.375	200,000	198,376	2029/11/22
九州電力 第493回	0.1	300,000	298,026	2026/5/25
北海道電力 第321回	0.886	100,000	101,827	2024/12/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	106,547	2030/3/25
北海道電力 第338回	0.84	100,000	101,268	2036/11/25
北海道電力 第345回	0.27	300,000	300,447	2024/9/25
東京電力パワーグリッド 第6回	0.85	100,000	101,468	2027/8/31
東京電力パワーグリッド 第11回	0.79	300,000	303,477	2028/1/25
東京電力パワーグリッド 第14回	0.43	100,000	100,221	2023/7/24
東京電力パワーグリッド 第15回	0.89	300,000	302,211	2030/7/24
東京電力パワーグリッド 第28回	1.01	100,000	101,764	2029/7/10
東京電力パワーグリッド 第35回	1.2	100,000	103,211	2030/4/23
東京電力パワーグリッド 第38回	0.58	400,000	402,360	2025/7/16

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
東京電力パワーグリッド 第40回		1.37	400,000	416,096	2035/7/13
東京電力パワーグリッド 第45回		0.8	300,000	299,562	2031/4/22
I N P E X 第1回社債間限定同順位特約付		0.08	500,000	498,310	2026/3/16
長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付		0.47	200,000	198,958	2030/7/12
五洋建設 第7回社債間限定同順位特約付		0.14	100,000	99,494	2026/9/25
大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付		0.69	100,000	99,178	2036/11/28
大和ハウス工業 第25回特定社債間限定同順位特約付		0.28	300,000	297,015	2031/6/3
日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付		0.03	200,000	199,700	2023/7/14
明治ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付		0.05	200,000	198,546	2026/4/23
アサヒグループホールディングス 第16回特定社債間限定同順位		0.08	300,000	298,341	2026/3/13
コカ・コーラボトラーズジャパン 第3回社債間限定同順位特約付		0.27	100,000	98,603	2029/9/19
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付		0.19	100,000	100,136	2024/3/8
日本たばこ産業 第13回		0.355	100,000	99,749	2028/9/8
三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付		0.41	100,000	99,338	2027/8/31
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付		0.714	100,000	100,747	2023/9/20
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特		0.34	200,000	199,356	2026/8/28
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付		0.97	100,000	98,391	2038/5/17
セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約		0.06	100,000	99,864	2023/12/20
セブン&アイ・ホールディングス 第14回社債間限定同順位特約		0.19	600,000	599,514	2025/12/19
セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約		0.28	200,000	199,220	2027/12/20
東レ 第30回社債間限定同順位特約付		0.375	100,000	100,000	2027/7/16
東レ 第33回社債間限定同順位特約付		0.38	100,000	99,633	2028/7/18
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付		0.734	200,000	197,864	2028/10/25
王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付		0.425	100,000	100,204	2028/1/26
王子ホールディングス 第42回社債間限定同順位特約付		0.08	600,000	596,898	2026/3/24
日本製紙 第15回社債間限定同順位特約付		0.35	100,000	98,591	2031/9/10
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付		0.38	100,000	99,917	2027/9/13
イビデン 第11回社債間限定同順位特約付		0.001	100,000	99,695	2024/9/9
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付		0.39	100,000	100,044	2028/6/19
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付		0.33	100,000	99,619	2029/5/30
三菱ケミカルホールディングス 第33回社債間限定同順位特約付		0.28	200,000	197,898	2030/2/28
三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付		0.83	100,000	97,884	2040/6/11
ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付		0.5	100,000	100,258	2030/12/13
電通 第3回社債間限定同順位特約付		0.424	100,000	100,015	2028/10/25
電通 第6回社債間限定同順位特約付		0.49	300,000	300,336	2030/7/8
武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付		0.4	200,000	196,554	2031/10/14
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付		0.23	100,000	99,866	2024/5/31
オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付		0.15	100,000	99,801	2025/9/17
オリエンタルランド 第18回社債間限定同順位特約付		0.29	200,000	197,956	2030/9/17
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付		0.35	100,000	99,905	2024/12/6
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付		0.37	200,000	198,522	2026/7/31
楽天 第13回社債間限定同順位特約付		0.45	100,000	96,169	2029/6/25
楽天 第15回社債間限定同順位特約付		0.5	100,000	99,617	2024/12/2
出光興産 第14回社債間限定同順位特約付		0.34	100,000	98,739	2031/7/15
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付		0.295	100,000	99,865	2027/4/21
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付		0.385	300,000	298,953	2028/6/20
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順		0.26	100,000	99,691	2026/5/27
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順		0.25	100,000	99,972	2025/7/14

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
三菱マテリアル	第36回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	99,199	2028/6/7
住友金属鉱山	第33回社債間限定同順位特約付	0.09	200,000	198,682	2026/9/15
住友電気工業	第26回社債間限定同順位特約付	0.3	200,000	198,914	2027/3/1
LIXILグループ	第11回社債間限定同順位特約付	0.01	300,000	299,508	2023/7/18
日立建機	第20回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	98,819	2031/3/18
荏原製作所	第10回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,586	2025/10/22
日立製作所	第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	213,232	2028/12/13
パナソニック	第17回社債間限定同順位特約付	0.47	200,000	201,638	2026/9/18
パナソニック	第20回社債間限定同順位特約付	0.08	100,000	99,829	2023/12/22
パナソニック	第21回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,808	2025/12/24
パナソニック	第22回社債間限定同順位特約付	0.29	200,000	198,662	2027/12/24
パナソニック	第23回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	98,718	2030/12/24
ソニー	第32回	0.28	100,000	100,189	2023/9/20
東海理化電機製作所	第1回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	99,034	2027/6/7
三菱重工業	第35回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,735	2027/8/27
三菱重工業	第38回社債間限定同順位特約付(第2回グリーンボ)	0.09	300,000	298,227	2026/9/1
J A 三井リース	第8回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	100,204	2024/9/13
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	第9回社債間限定	0.22	100,000	99,729	2025/10/10
トヨタ自動車	第26回社債間限定同順位特約付	0.05	700,000	697,487	2026/3/18
トヨタ自動車	第27回社債間限定同順位特約付	0.219	300,000	297,366	2031/3/18
楽天カード	第3回社債間限定同順位特約付	0.42	100,000	98,265	2026/12/11
ドンキホーテホールディングス	第12回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	100,358	2024/3/21
ニコン	第22回特定社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	99,538	2025/12/2
丸紅	第113回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	98,809	2031/4/18
豊田通商	第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	102,779	2025/12/5
豊田通商	第19回社債間限定同順位特約付	0.954	200,000	205,652	2026/7/10
三井物産	第64回社債間限定同順位特約付	2.36	100,000	110,488	2027/5/21
三井物産	第71回社債間限定同順位特約付	1.187	100,000	105,524	2029/7/13
住友商事	第49回社債間限定同順位特約付	1.286	100,000	105,742	2029/1/29
住友商事	第53回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,916	2027/7/26
クレディセゾン	第50回社債間限定同順位特約付	0.904	100,000	101,495	2024/4/24
クレディセゾン	第65回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,994	2027/7/30
クレディセゾン	第76回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	98,523	2029/7/31
イオン	第20回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	101,313	2024/6/28
三菱UFJフィナンシャル・グループ	第1回劣後特約付	0.94	100,000	101,261	2024/6/26
りそなホールディングス	第20回社債間限定同順位特約付	0.27	100,000	100,070	2025/7/23
三井住友トラスト・ホールディングス	第2回劣後特約付	0.915	200,000	202,446	2025/6/5
みずほコーポレート銀行	第8回特定社債間限定同順位特約付	2.54	100,000	111,666	2027/7/27
三菱東京UFJ銀行	第23回劣後特約付	2.91	100,000	116,536	2029/10/16
三菱東京UFJ銀行	第24回劣後特約付	2.27	100,000	112,582	2030/9/27
三井住友フィナンシャルグループ	第1回劣後特約付	0.849	300,000	303,225	2024/9/12
三井住友フィナンシャルグループ	第3回劣後特約付	0.884	100,000	101,277	2025/5/29
三井住友フィナンシャルグループ	第4回劣後特約付	1.328	100,000	104,794	2030/5/29
三井住友信託銀行	第18回社債間限定同順位特約付	0.16	200,000	199,608	2026/1/27
セブン銀行	第11回社債間限定同順位特約付	0.536	100,000	101,018	2024/12/20
セブン銀行	第12回社債間限定同順位特約付	0.39	300,000	302,010	2027/9/17
みずほフィナンシャルグループ	第1回劣後特約付	0.95	200,000	202,124	2024/7/16
みずほ銀行	第7回劣後特約付	2.87	100,000	109,949	2026/11/6



銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
芙蓉総合リース	第26回社債間限定同順位特約付	0.03	200,000	199,566	2023/10/20
みずほリース	第3回社債間限定同順位特約付	0.24	300,000	299,769	2025/7/15
みずほリース	第7回社債間限定同順位特約付	0.33	200,000	198,708	2028/1/20
NTTファイナンス	第2回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,054	2026/12/18
NTTファイナンス	第16回日本電信電話保証付	0.18	100,000	99,956	2025/12/19
NTTファイナンス	第17回日本電信電話保証付	0.28	200,000	199,612	2027/12/20
NTTファイナンス	第18回日本電信電話保証付	0.38	300,000	299,874	2030/9/20
東京センチュリー	第33回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	98,947	2028/4/27
ホンダファイナンス	第69回社債間限定同順位特約付	0.09	200,000	198,912	2026/6/19
トヨタファイナンス	第81回社債間限定同順位特約付	0.265	100,000	99,781	2027/10/22
トヨタファイナンス	第96回社債間限定同順位特約付	0.06	800,000	797,080	2026/4/15
リコーリース	第28回社債間限定同順位特約付	0.345	100,000	99,786	2027/7/20
イオンフィナンシャルサービス	第6回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	100,006	2024/5/28
アコム	第77回特定社債間限定同順位特約付	0.274	100,000	100,082	2023/8/30
アコム	第78回特定社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	100,024	2026/8/28
ジャックス	第19回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,058	2023/6/15
オリエントコーポレーション	第32回社債間限定同順位特約付	0.55	100,000	98,670	2032/1/20
日立キャピタル	第61回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	100,083	2026/6/19
日立キャピタル	第80回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	98,412	2029/10/19
オリックス	第202回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	98,466	2031/4/21
三井住友ファイナンス&リース	第27回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	99,601	2026/10/16
三菱UFJリース	第52回社債間限定同順位特約付	0.375	300,000	300,291	2027/7/13
三菱UFJリース	第56回社債間限定同順位特約付	0.455	100,000	100,316	2028/1/18
三菱UFJリース	第76回社債間限定同順位特約付	0.37	300,000	296,901	2030/1/23
大和証券グループ本社	第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	101,798	2025/8/12
大和証券グループ本社	第36回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	99,567	2026/6/2
三井住友海上火災保険	第7回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,641	2026/11/13
三井不動産	第71回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	198,802	2030/4/16
三菱地所	第93回担保提供制限等財務上特約無	2.555	200,000	227,946	2028/7/28
三菱地所	第120回担保提供制限等財務上特約無	0.24	100,000	99,786	2027/6/18
東京建物	第25回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	100,109	2027/3/19
ダイビル	第19回特定社債間限定同順位特約付	0.96	100,000	94,834	2039/7/19
エス・ティ・ティ都市開発	第15回社債間限定同順位特約付	1.25	100,000	105,714	2028/9/20
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	101,163	2023/6/26
野村不動産オフィスファンド投資法人	第7回特定投資法人債間限	2.9	100,000	113,371	2028/3/17
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	101,281	2024/8/30
東武鉄道	第124回社債間限定同順位特約付	0.001	100,000	99,680	2023/11/27
相鉄ホールディングス	第32回相模鉄道株式会社保証付	0.58	200,000	201,626	2025/1/28
東京急行電鉄	第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	108,394	2033/6/3
東京急行電鉄	第83回社債間限定同順位特約付	0.459	200,000	200,456	2031/4/22
小田急電鉄	第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	210,634	2030/6/12
小田急電鉄	第74回社債間限定同順位特約付	0.756	100,000	99,861	2037/5/29
京成電鉄	第58回社債間限定同順位特約付	0.001	200,000	199,156	2024/8/30
東日本旅客鉄道	第57回社債間限定同順位特約付	2.376	200,000	227,488	2028/12/12
東日本旅客鉄道	第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	113,006	2030/9/27
東日本旅客鉄道	第106回社債間限定同順位特約付	0.981	100,000	105,624	2035/1/29
東日本旅客鉄道	第107回社債間限定同順位特約付	1.415	100,000	109,692	2045/1/27
東日本旅客鉄道	第119回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	99,867	2027/1/27

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
東日本旅客鉄道	第133回社債間限定同順位特約付	1.246	100,000	101,700	2058/9/27
東日本旅客鉄道	第145回社債間限定同順位特約付	0.771	200,000	173,784	2059/12/23
東日本旅客鉄道	第147回社債間限定同順位特約付	0.265	100,000	99,413	2030/4/22
東日本旅客鉄道	第153回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	99,074	2030/7/19
東日本旅客鉄道	第164回社債間限定同順位特約付	0.245	100,000	98,982	2031/4/15
東日本旅客鉄道	第165回社債間限定同順位特約付	0.596	100,000	96,081	2041/4/15
東日本旅客鉄道	第167回社債間限定同順位特約付	0.978	100,000	92,153	2061/4/15
西日本旅客鉄道	第13回社債間限定同順位特約付	2.34	100,000	110,271	2027/2/19
西日本旅客鉄道	第15回社債間限定同順位特約付	2.26	300,000	334,011	2027/12/20
西日本旅客鉄道	第60回社債間限定同順位特約付	0.255	200,000	198,578	2030/5/21
西日本旅客鉄道	第65回社債間限定同順位特約付	0.24	200,000	198,206	2030/8/27
西日本旅客鉄道	第66回社債間限定同順位特約付	0.629	200,000	194,052	2040/8/27
西日本旅客鉄道	第77回社債間限定同順位特約付	0.961	100,000	91,712	2061/4/22
東海旅客鉄道	第17回社債間限定同順位特約付	2.21	200,000	210,050	2024/9/20
東海旅客鉄道	第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	229,368	2030/4/23
東海旅客鉄道	第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	108,846	2032/9/30
東海旅客鉄道	第73回社債間限定同順位特約付	1.014	300,000	317,100	2035/1/26
東海旅客鉄道	第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	114,516	2045/3/6
東京地下鉄	第22回	0.215	100,000	99,845	2027/6/21
東京地下鉄	第23回	0.661	100,000	100,294	2037/6/19
東京地下鉄	第24回	1.035	100,000	100,923	2047/6/21
西武ホールディングス	第1回社債間限定同順位特約付	0.758	200,000	198,870	2032/3/17
西日本鉄道	第45回社債間限定同順位特約付	0.717	100,000	102,085	2031/3/4
阪急阪神ホールディングス	第47回	1.202	400,000	422,452	2029/7/18
阪急阪神ホールディングス	第49回	0.817	100,000	100,920	2036/12/15
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	102,597	2027/4/30
日本通運	第11回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	99,577	2026/7/14
日本通運	第12回社債間限定同順位特約付	0.7	100,000	97,994	2036/7/14
日本郵船	第32回社債間限定同順位特約付	2.13	100,000	109,447	2031/9/9
横浜高速鉄道	第2回社債間限定同順位特約付	0.455	100,000	100,299	2027/2/23
九州旅客鉄道	第2回社債間限定同順位特約付	0.929	200,000	189,370	2049/3/5
九州旅客鉄道	第4回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	94,444	2039/12/9
ANAホールディングス	第32回社債間限定同順位特約付	0.99	100,000	93,594	2036/6/9
澁澤倉庫	第8回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	99,692	2023/6/14
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	101,150	2023/12/20
KDDI	第25回社債間限定同順位特約付	0.395	100,000	100,120	2028/11/22
ソフトバンク	第11回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	99,385	2026/6/3
ソフトバンク	第12回社債間限定同順位特約付	0.42	200,000	197,650	2028/6/2
ソフトバンク	第14回社債間限定同順位特約付	0.24	100,000	98,963	2026/10/9
ソフトバンク	第16回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	97,950	2031/10/10
電源開発	第40回社債間限定同順位特約付	0.889	100,000	101,621	2024/6/20
電源開発	第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	101,477	2024/8/20
電源開発	第50回社債間限定同順位特約付	0.415	100,000	100,489	2027/7/20
電源開発	第59回社債間限定同順位特約付	0.414	100,000	100,076	2028/9/20
電源開発	第73回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	197,158	2031/5/20
東京瓦斯	第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	121,129	2043/12/17
東京瓦斯	第55回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	92,195	2039/9/13
大阪瓦斯	第36回社債間限定同順位特約付	0.642	100,000	89,955	2049/6/4

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円
大阪瓦斯 第43回社債間限定同順位特約付	0.851	200,000	189,250
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,024
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	97,201
広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	0.405	100,000	99,643
東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	0.18	100,000	99,916
ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	0.405	100,000	100,285
ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	1.569	100,000	100,121
フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第29回円貨社債	0.25	200,000	199,214
フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第31回円貨社債	0.423	100,000	97,713
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	0.45	100,000	99,322
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第6回非上位円貨社債	1.258	200,000	202,802
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第4回非上位円貨社債	1.258	200,000	202,822
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第25回非上位円貨社債	0.302	200,000	196,942
クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)	0.865	100,000	100,657
クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債(2018)	0.204	100,000	99,690
クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債(2018)	0.509	100,000	98,004
スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)	1.043	100,000	100,338
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円	0.842	100,000	100,542
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円	1.207	100,000	101,495
ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第6回円貨社債	0.65	100,000	100,278
ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債	0.968	100,000	98,970
サンタンデール銀行 第1回円貨社債	0.463	100,000	99,718
フランス電力 第4回円貨社債(2017)	1.088	100,000	98,298
現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債	0.65	200,000	198,894
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債(2017)	0.967	100,000	100,514
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	0.32	200,000	200,052
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	0.293	200,000	200,026
小 計		40,705,000	40,993,825
合 計		802,409,209	831,900,264

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
コール・ローン等、その他	831,900,264	98.4
投資信託財産総額	13,335,246	1.6
	845,235,510	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年3月31日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	845,235,510,832
コール・ローン等	6,304,434,651
公社債(評価額)	831,900,264,861
未収入金	6,203,887,080
未収利息	813,644,338
前払費用	13,279,902
(B) 負債	11,415,470,748
未払金	11,194,815,000
未払解約金	220,652,886
未払利息	2,862
(C) 純資産総額(A-B)	833,820,040,084
元本	637,009,354,599
次期繰越損益金	196,810,685,485
(D) 受益権総口数	637,009,354,599口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,090円

(注) 期首元本額は555,429,500,070円、期中追加設定元本額は140,183,169,551円、期中一部解約元本額は58,603,315,022円、1口当たり純資産額は1.3090円です。

## ○損益の状況 (2021年4月1日～2022年3月31日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	5,723,401,519
受取利息	5,724,911,537
支払利息	△ 1,510,018
(B) 有価証券売買損益	△ 16,033,601,285
売買益	164,384,768
売買損	△ 16,197,986,053
(C) 当期損益金(A+B)	△ 10,310,199,766
(D) 前期繰越損益金	180,400,353,686
(E) 追加信託差損益金	45,850,802,345
(F) 解約差損益金	△ 19,130,270,780
(G) 計(C+D+E+F)	196,810,685,485
次期繰越損益金(G)	196,810,685,485

\*損益の状況の中で(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。

\*損益の状況の中で(E)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。

\*損益の状況の中で(F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	159,230,144,819
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け)	51,968,969,660
マイバランス50(確定拠出年金向け)	51,621,522,264
野村世界6資産分散投信(安定コース)	41,349,667,432
マイバランス30(確定拠出年金向け)	38,128,200,110
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	35,212,095,763
マイ・ロード	35,186,303,460
ファンドラップ(ウェルス・スクエア)債券・安定型	31,327,023,046
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	21,802,374,834
のむらっぴ・ファンド(普通型)	20,112,939,733
マイバランス70(確定拠出年金向け)	19,847,888,365
野村世界6資産分散投信(分配コース)	17,664,745,205
のむらっぴ・ファンド(保守型)	16,059,759,182
マイバランスDC30	14,414,168,995
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,487,903,593
マイバランスDC50	12,027,813,857
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,171,692,307
マイバランスDC70	4,427,526,951
野村6資産均等バランス	4,230,386,616
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	3,714,615,690
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,532,046,682
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,471,983,513

ファンド名	当期末 元本額
	円
のむらっぴ・ファンド(積極型)	2,709,532,435
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	2,372,693,668
野村インデックスファンド・国内債券	1,940,508,577
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,697,668,987
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,632,524,914
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,515,267,300
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	1,510,069,117
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	1,448,753,728
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	1,385,913,012
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	1,175,772,283
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	912,844,711
野村日本債券インデックスファンド	778,502,291
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	726,321,232
野村円債投資インデックスファンド	722,131,079
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	596,018,419
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	562,413,683
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	544,036,495
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	516,733,620
野村国内債券インデックスファンド	399,203,288
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	370,173,357
野村資産設計ファンド2025	355,854,308
野村資産設計ファンド2020	348,643,122

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村資産設計ファンド2015	342,212,517
ノムラPOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用)	336,480,292
野村資産設計ファンド2030	298,175,797
マイターゲット2060(確定拠出年金向け)	295,767,409
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	287,067,599
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	226,607,660
マイターゲット2055(確定拠出年金向け)	223,811,681
みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け)	217,452,141
野村資産設計ファンド2040	210,631,470
野村資産設計ファンド2035	158,887,693
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	153,637,290
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	140,635,123
世界6資産分散ファンド	124,733,821
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030	85,490,300
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	85,429,618
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	78,140,127
マイターゲット2065(確定拠出年金向け)	71,066,278
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	55,105,479
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	40,561,278
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	39,689,442

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2040	33,641,062
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	33,564,866
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	32,762,632
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	30,892,430
野村資産設計ファンド2045	26,156,783
野村資産設計ファンド2050	24,622,798
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	23,352,125
インデックス・ブレンド(タイプⅤ)	21,294,624
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	19,853,584
野村POFs用・ターゲット・リターン・資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	15,379,521
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2050	12,824,664
野村資産設計ファンド2060	12,744,346
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	10,200,316
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	8,769,023
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	6,804,242
野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2060	5,788,384
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	4,442,377
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	2,909,847
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	416,257

## 〇お知らせ

該当事項はございません。

# 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

## 運用報告書

第9期（決算日2022年9月6日）

作成対象期間（2021年9月7日～2022年9月6日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行いません。外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。外貨建資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

**野村アセットマネジメント**

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	騰落	中率	騰落	中率			
	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%	百万円
5期(2018年9月6日)	11,174	△ 2.1	112.61	△ 1.9	98.8	—	50,125
6期(2019年9月6日)	12,118	8.4	122.22	8.5	99.7	—	59,275
7期(2020年9月7日)	12,502	3.2	126.25	3.3	99.2	—	69,653
8期(2021年9月6日)	12,332	△ 1.4	124.58	△ 1.3	99.3	—	85,718
9期(2022年9月6日)	10,625	△13.8	107.48	△13.7	99.7	—	80,566

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

\*FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行なう円ベースの指数)です。なお、設定時を100として再指数化しています。

\*FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。  
(出所) FTSE Fixed Income LLC

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	中率	騰落	中率		
(期首)	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%
2021年9月6日	12,332	—	124.58	—	99.3	—
9月末	12,186	△ 1.2	123.09	△ 1.2	99.5	—
10月末	12,183	△ 1.2	123.02	△ 1.3	100.8	—
11月末	12,258	△ 0.6	123.80	△ 0.6	97.2	—
12月末	12,145	△ 1.5	122.69	△ 1.5	100.1	—
2022年1月末	11,994	△ 2.7	121.17	△ 2.7	98.4	—
2月末	11,741	△ 4.8	118.62	△ 4.8	99.0	—
3月末	11,420	△ 7.4	115.47	△ 7.3	105.1	—
4月末	11,168	△ 9.4	112.95	△ 9.3	101.1	—
5月末	11,055	△10.4	111.76	△10.3	98.7	—
6月末	10,749	△12.8	108.74	△12.7	101.4	—
7月末	11,063	△10.3	111.99	△10.1	96.3	—
8月末	10,683	△13.4	108.05	△13.3	101.2	—
(期末)						
2022年9月6日	10,625	△13.8	107.48	△13.7	99.7	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

### ○基準価額の主な変動要因

外国債券利回りが上昇（価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

### ○当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行ないました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行ないました。



## ○当ファンドのベンチマークとの差異

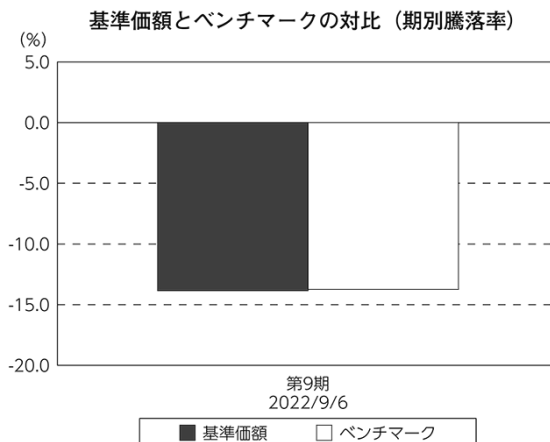
今期の基準価額の騰落率は-13.8%となり、ベンチマークの-13.7%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

### (マイナス要因)

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

### (その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること



(注) ベンチマークは、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

## ◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行なってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年9月7日～2022年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷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
(b) そ の 他 費 用 ( 保 管 費 用 ) ( そ の 他 )	1 (1) (0)	0.009 (0.009) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷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 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	1	0.009	
期中の平均基準価額は、11,553円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
外 国	債券先物取引	百万円 1,057	百万円 1,056	百万円 -	百万円 -

\*単位未満は切り捨て。

\*外国の取引金額は、各月末（決算日の属する月については決算日）の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年9月7日～2022年9月6日)

該当事項はございません。

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

(2022年9月6日現在)

## 外国公社債

## (A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	321,300	298,106	41,815,432	51.9	—	22.8	19.3	9.8
カナダ	千カナダドル	千カナダドル						
	16,550	15,808	1,692,928	2.1	—	1.1	0.5	0.5
イギリス	千英ポンド	千英ポンド						
	24,080	22,662	3,683,633	4.6	—	3.4	0.9	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ						
	16,050	15,330	199,757	0.2	—	0.2	0.0	0.0
ノルウェー	千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ						
	14,700	13,552	191,768	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ	千デンマーククローネ						
	14,650	15,144	284,558	0.4	—	0.3	0.0	0.0
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	33,000	33,604	4,695,267	5.8	—	3.5	1.6	0.8
イタリア	47,410	45,297	6,328,948	7.9	—	4.4	2.4	1.0
フランス	48,960	48,034	6,711,412	8.3	—	5.3	2.3	0.7
オランダ	9,810	9,493	1,326,463	1.6	—	0.9	0.5	0.2
スペイン	31,320	30,768	4,298,962	5.3	—	3.0	1.9	0.5
ベルギー	10,640	10,284	1,436,887	1.8	—	1.3	0.3	0.1
オーストリア	7,420	6,915	966,186	1.2	—	0.8	0.4	0.1
フィンランド	3,310	3,099	433,021	0.5	—	0.4	0.1	0.0
アイルランド	4,250	3,886	542,961	0.7	—	0.4	0.1	0.1
ポーランド	千ズロチ	千ズロチ						
	13,900	12,005	355,971	0.4	—	0.2	0.2	—
シンガポール	千シンガポールドル	千シンガポールドル						
	7,040	6,575	658,562	0.8	—	0.5	0.2	0.0
中国	千人民元	千人民元						
	113,000	114,652	2,319,482	2.9	—	1.2	1.2	0.5
オーストラリア	千豪ドル	千豪ドル						
	14,060	13,125	1,257,257	1.6	—	1.2	0.4	0.0
イスラエル	千新シェケル	千新シェケル						
	8,300	8,460	348,838	0.4	—	0.2	0.1	0.2
メキシコ	千メキシコペソ	千メキシコペソ						
	115,600	108,684	764,791	0.9	—	0.4	0.5	0.1
合 計	—	—	80,313,097	99.7	—	51.5	33.1	15.1

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円	
	国債証券					
	US TREASURY BOND	2.375	1,500	1,471	206,381	2024/8/15
	US TREASURY BOND	6.0	610	660	92,643	2026/2/15
	US TREASURY BOND	6.125	1,800	2,034	285,427	2027/11/15
	US TREASURY BOND	5.25	20	22	3,102	2028/11/15
	US TREASURY BOND	2.875	510	450	63,148	2043/5/15
	US TREASURY BOND	3.75	250	253	35,563	2043/11/15
	US TREASURY N/B	1.375	3,000	2,940	412,533	2023/8/31
	US TREASURY N/B	2.75	3,500	3,476	487,646	2023/8/31
	US TREASURY N/B	0.125	2,500	2,417	339,052	2023/9/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,000	978	137,256	2023/9/30
	US TREASURY N/B	0.125	500	482	67,643	2023/10/15
	US TREASURY N/B	1.625	1,700	1,666	233,736	2023/10/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,481	348,086	2023/11/15
	US TREASURY N/B	2.125	500	492	69,074	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.875	1,500	1,490	209,098	2023/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,970	276,408	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.625	700	693	97,239	2023/12/31
	US TREASURY N/B	0.125	1,000	956	134,209	2024/1/15
	US TREASURY N/B	2.25	500	492	69,030	2024/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	400	396	55,585	2024/2/15
	US TREASURY N/B	2.125	1,500	1,472	206,529	2024/2/29
	US TREASURY N/B	2.375	300	295	41,458	2024/2/29
	US TREASURY N/B	1.5	1,000	972	136,431	2024/2/29
	US TREASURY N/B	0.25	2,500	2,383	334,285	2024/3/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	1,961	275,126	2024/3/31
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,964	275,553	2024/3/31
	US TREASURY N/B	0.375	1,000	952	133,637	2024/4/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,955	274,337	2024/4/30
	US TREASURY N/B	2.5	2,500	2,463	345,599	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,953	274,041	2024/5/31
	US TREASURY N/B	2.0	800	780	109,493	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,942	272,490	2024/6/30
	US TREASURY N/B	3.0	1,500	1,489	208,884	2024/6/30
	US TREASURY N/B	0.375	3,000	2,838	398,175	2024/7/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	2,930	411,111	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.75	3,000	2,910	408,226	2024/7/31
	US TREASURY N/B	0.375	2,000	1,887	264,732	2024/8/15
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	1,942	272,458	2024/8/31
	US TREASURY N/B	1.25	1,000	959	134,563	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	1,950	273,581	2024/9/30
	US TREASURY N/B	1.5	1,500	1,443	202,531	2024/9/30
	US TREASURY N/B	0.625	1,500	1,416	198,660	2024/10/15
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	1,953	273,997	2024/10/31
	US TREASURY N/B	1.5	1,000	961	134,840	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,464	205,416	2024/11/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.125	2,400	2,334	327,455	2024/11/30
	US TREASURY N/B	1.5	3,000	2,878	403,829	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	800	779	109,358	2024/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,927	270,337	2024/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	1,934	271,334	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,476	207,092	2025/2/28
	US TREASURY N/B	1.125	1,000	945	132,692	2025/2/28
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	1,920	269,329	2025/3/15
	US TREASURY N/B	2.625	2,500	2,451	343,935	2025/3/31
	US TREASURY N/B	0.375	500	461	64,748	2025/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	2,300	2,223	311,883	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,964	275,597	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,054	428,501	2025/5/31
	US TREASURY N/B	0.25	2,000	1,834	257,373	2025/5/31
	US TREASURY N/B	2.875	1,500	1,477	207,281	2025/6/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,473	206,624	2025/6/30
	US TREASURY N/B	0.25	700	640	89,892	2025/6/30
	US TREASURY N/B	3.0	2,000	1,976	277,219	2025/7/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	1,969	276,299	2025/7/31
	US TREASURY N/B	0.25	2,000	1,825	256,014	2025/7/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	2,669	374,413	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	588	82,541	2025/8/31
	US TREASURY N/B	3.0	3,000	2,962	415,566	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	1,500	1,362	191,082	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	1,000	905	127,010	2025/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,580	221,766	2025/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	2,500	2,436	341,798	2026/1/31
	US TREASURY N/B	0.375	500	451	63,269	2026/1/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,200	2,071	290,500	2026/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,500	2,424	340,099	2026/2/28
	US TREASURY N/B	2.25	500	480	67,444	2026/3/31
	US TREASURY N/B	1.625	700	657	92,171	2026/5/15
	US TREASURY N/B	2.125	2,500	2,388	335,100	2026/5/31
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	946	132,818	2026/6/30
	US TREASURY N/B	1.875	2,500	2,363	331,579	2026/7/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,700	2,512	352,365	2026/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	500	462	64,932	2026/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,000	3,738	524,368	2026/9/30
	US TREASURY N/B	0.875	3,500	3,168	444,458	2026/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,459	345,042	2026/11/15
	US TREASURY N/B	1.625	3,000	2,797	392,405	2026/11/30
	US TREASURY N/B	1.75	1,200	1,123	157,652	2026/12/31
	US TREASURY N/B	1.25	2,500	2,288	321,073	2026/12/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	1,848	259,357	2027/1/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,000	954	133,831	2027/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	2,000	1,817	254,962	2027/2/28
	US TREASURY N/B	1.875	1,100	1,033	144,966	2027/2/28

銘柄	当	期 末			償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額		邦貨換算金額
	%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ						
国債証券	US TREASURY N/B	2.5	2,000	1,929	270,611	2027/3/31
	US TREASURY N/B	0.5	2,000	1,757	246,535	2027/4/30
	US TREASURY N/B	2.75	2,000	1,949	273,482	2027/4/30
	US TREASURY N/B	2.375	3,800	3,638	510,414	2027/5/15
	US TREASURY N/B	0.5	2,000	1,753	246,009	2027/5/31
	US TREASURY N/B	2.625	1,500	1,454	204,084	2027/5/31
	US TREASURY N/B	0.5	1,500	1,312	184,120	2027/6/30
	US TREASURY N/B	3.25	200	199	27,957	2027/6/30
	US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,044	426,981	2027/8/15
	US TREASURY N/B	0.5	1,500	1,300	182,452	2027/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,600	1,517	212,921	2027/11/15
	US TREASURY N/B	0.75	1,500	1,309	183,709	2028/1/31
	US TREASURY N/B	2.75	2,700	2,620	367,544	2028/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	2,000	1,781	249,844	2028/2/29
	US TREASURY N/B	1.25	4,000	3,571	501,004	2028/4/30
	US TREASURY N/B	2.875	3,500	3,414	478,997	2028/5/15
	US TREASURY N/B	1.0	1,000	875	122,834	2028/7/31
	US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,021	423,779	2028/8/15
	US TREASURY N/B	1.25	2,000	1,771	248,540	2028/9/30
	US TREASURY N/B	1.375	1,500	1,337	187,605	2028/10/31
	US TREASURY N/B	3.125	5,000	4,942	693,240	2028/11/15
	US TREASURY N/B	1.5	1,000	897	125,848	2028/11/30
	US TREASURY N/B	1.375	2,500	2,226	312,251	2028/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	1,000	909	127,640	2029/1/31
	US TREASURY N/B	2.625	3,400	3,262	457,692	2029/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,500	2,432	341,223	2029/4/30
	US TREASURY N/B	2.375	2,500	2,359	330,976	2029/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,500	1,448	203,188	2029/5/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,700	2,429	340,826	2029/8/15
	US TREASURY N/B	1.75	200	181	25,469	2029/11/15
	US TREASURY N/B	1.5	2,000	1,774	248,847	2030/2/15
	US TREASURY N/B	6.25	500	601	84,408	2030/5/15
	US TREASURY N/B	0.625	1,700	1,401	196,598	2030/5/15
	US TREASURY N/B	0.625	4,300	3,526	494,639	2030/8/15
	US TREASURY N/B	0.875	3,500	2,922	409,977	2030/11/15
	US TREASURY N/B	5.375	500	578	81,197	2031/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	3,100	2,633	369,373	2031/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	2,600	2,293	321,764	2031/5/15
	US TREASURY N/B	1.25	3,700	3,144	441,068	2031/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	2,400	2,052	287,965	2031/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	3,200	2,857	400,751	2032/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,900	2,821	395,787	2032/5/15
	US TREASURY N/B	5.0	340	410	57,558	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	1,760	2,023	283,829	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	400	407	57,155	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	800	892	125,190	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	400	459	64,418	2039/8/15



銘柄	銘柄	当期末				償還年月日
		利率	額面金額	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	4.375	500	565	79,252	2039/11/15
	US TREASURY N/B	4.625	1,150	1,337	187,649	2040/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,000	675	94,715	2040/5/15
	US TREASURY N/B	3.875	340	357	50,117	2040/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,200	802	112,592	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	1,600	1,764	247,471	2040/11/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,200	836	117,392	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	300	352	49,471	2041/2/15
	US TREASURY N/B	3.75	400	409	57,427	2041/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	500	466	65,428	2041/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,200	1,117	156,778	2042/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	400	364	51,093	2042/5/15
	US TREASURY N/B	3.25	500	473	66,420	2042/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	435	61,039	2042/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	434	60,918	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	800	736	103,317	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	300	298	41,890	2043/8/15
	US TREASURY N/B	3.625	700	695	97,536	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,700	1,556	218,301	2044/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,600	1,432	200,936	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	300	245	34,434	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,540	2,271	318,597	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	2,414	338,661	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	920	823	115,488	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,530	2,061	289,229	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,400	2,770	388,613	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	4,030	3,120	437,656	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,300	2,015	282,671	2046/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	500	448	62,891	2047/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,000	898	125,969	2047/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,520	1,305	183,061	2047/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	1,300	1,117	156,807	2047/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,266	177,645	2048/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,400	1,301	182,539	2048/5/15
	US TREASURY N/B	3.0	900	818	114,841	2048/8/15
	US TREASURY N/B	3.375	300	293	41,170	2048/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,500	2,296	322,073	2049/2/15
	US TREASURY N/B	2.875	500	449	62,989	2049/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,027	144,157	2049/8/15
	US TREASURY N/B	2.375	1,000	813	114,057	2049/11/15
	US TREASURY N/B	2.0	600	447	62,805	2050/2/15
	US TREASURY N/B	1.25	2,500	1,522	213,582	2050/5/15
	US TREASURY N/B	1.375	1,600	1,008	141,392	2050/8/15
	US TREASURY N/B	1.625	1,600	1,078	151,333	2050/11/15
	US TREASURY N/B	1.875	1,000	719	100,884	2051/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	2,200	1,786	250,563	2051/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	300	222	31,172	2051/8/15

銘	柄	当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	国債証券	US TREASURY N/B	1.875	1,600	1,148	161,100	2051/11/15
		US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,181	165,792	2052/2/15
		US TREASURY N/B	2.875	1,700	1,545	216,755	2052/5/15
小 計						41,815,432	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	150	147	15,798	2023/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	600	588	63,016	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	260	255	27,353	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,000	2,883	308,827	2024/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	1,000	946	101,351	2025/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	200	190	20,361	2025/4/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.25	600	539	57,755	2026/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	937	100,437	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,000	906	97,061	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	376	40,331	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,020	1,184	126,894	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	700	665	71,223	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	800	698	74,843	2030/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	600	526	56,419	2031/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	500	436	46,719	2031/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	900	818	87,622	2032/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	600	742	79,482	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	487	52,169	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	180	202	21,676	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,040	984	105,440	2048/12/1
	CANADIAN GOVERNMENT	2.0	800	639	68,499	2051/12/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	500	371	39,733	2053/12/1	
	CANADIAN GOVERNMENT	2.75	300	279	29,908	2064/12/1	
小 計						1,692,928	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	2.25	950	941	152,982	2023/9/7
		UK TREASURY	1.0	500	482	78,484	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	400	396	64,494	2024/9/7
		UK TREASURY	0.25	600	559	90,887	2025/1/31
		UK TREASURY	0.625	300	281	45,780	2025/6/7
		UK TREASURY	2.0	1,000	972	158,062	2025/9/7
		UK TREASURY	1.5	670	635	103,246	2026/7/22
		UK TREASURY	0.375	800	719	116,997	2026/10/22
		UK TREASURY	1.25	1,000	925	150,430	2027/7/22
		UK TREASURY	4.25	300	318	51,811	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	400	373	60,653	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	90	105	17,220	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	800	699	113,702	2029/10/22
		UK TREASURY	0.375	700	575	93,566	2030/10/22
		UK TREASURY	4.75	600	684	111,253	2030/12/7
		UK TREASURY	0.25	600	475	77,217	2031/7/31
		UK TREASURY	1.0	100	83	13,618	2032/1/31

銘柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
イギリス		%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
国債証券	UK TREASURY	4.25	600	667	108,414	2032/6/7
	UK TREASURY	0.875	300	239	38,874	2033/7/31
	UK TREASURY	4.5	500	567	92,320	2034/9/7
	UK TREASURY	0.625	800	578	94,006	2035/7/31
	UK TREASURY	4.25	460	511	83,217	2036/3/7
	UK TREASURY	1.75	770	631	102,591	2037/9/7
	UK TREASURY	4.75	500	594	96,691	2038/12/7
	UK TREASURY	1.125	300	217	35,417	2039/1/31
	UK TREASURY	4.25	100	112	18,293	2039/9/7
	UK TREASURY	1.25	200	142	23,164	2041/10/22
	UK TREASURY	4.5	350	412	66,992	2042/12/7
	UK TREASURY	3.5	600	616	100,283	2045/1/22
	UK TREASURY	4.25	1,580	1,827	297,009	2046/12/7
	UK TREASURY	1.5	700	490	79,791	2047/7/22
	UK TREASURY	1.75	350	258	42,042	2049/1/22
	UK TREASURY	4.25	1,240	1,463	237,920	2049/12/7
	UK TREASURY	1.25	500	317	51,609	2051/7/31
	UK TREASURY	3.75	110	121	19,804	2052/7/22
	UK TREASURY	1.5	300	201	32,775	2053/7/31
	UK TREASURY	1.625	300	208	33,838	2054/10/22
	UK TREASURY	1.75	500	357	58,181	2057/7/22
	UK TREASURY	4.0	200	241	39,261	2060/1/22
	UK TREASURY	2.5	200	177	28,790	2065/7/22
	UK TREASURY	3.5	530	598	97,305	2068/7/22
	UK TSY 0 1/2% 2061	0.5	400	172	27,986	2061/10/22
	UK TSY 0 5/8% 2050	0.625	500	263	42,890	2050/10/22
	UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	300	296	48,255	2044/1/22
	UNITED KINGDOM GILT	0.875	300	182	29,739	2046/1/31
	UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	780	958	155,753	2055/12/7
小 計					3,683,633	
スウェーデン			千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	2,976	38,783	2023/11/13
	SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	250	3,266	2025/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,572	33,514	2026/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	1,000	929	12,110	2028/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,500	3,203	41,743	2029/11/12
	SWEDISH GOVERNMENT	0.125	4,000	3,422	44,594	2031/5/12
	SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,600	1,975	25,743	2039/3/30
小 計					199,757	
ノルウェー			千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	2,750	2,738	38,748	2024/3/14
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	2,000	1,923	27,220	2025/3/13
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,596	22,596	2026/2/19
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,750	1,636	23,157	2027/2/17
	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,399	19,805	2028/4/26
	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,000	1,734	24,536	2030/8/19

銘柄	当期末					償還年月日	
	利率	額面金額	評価額				
			外貨建金額	邦貨換算金額			
ノルウェー		%	千ノルウェークロネ	千ノルウェークロネ	千円		
国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.25	3,000	2,523	35,704	2031/9/17	
小計					191,768		
デンマーク			千デンマーククロネ	千デンマーククロネ			
国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,661	31,220	2023/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	1.75	1,400	1,412	26,534	2025/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,167	40,719	2027/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,100	1,918	36,041	2029/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	—	2,000	1,681	31,591	2031/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	4.5	4,200	5,695	107,017	2039/11/15	
	KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,000	608	11,432	2052/11/15	
小計					284,558		
ユーロ			千ユーロ	千ユーロ			
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	100	99	13,887	2023/10/13
		BUNDESobligation	—	1,000	987	137,997	2024/4/5
		BUNDESobligation	—	1,500	1,459	203,955	2025/4/11
		BUNDESobligation	—	1,000	959	134,093	2026/4/10
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	400	428	59,937	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	618	86,482	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	707	98,837	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	440	61,540	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	200	197	27,569	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	500	498	69,671	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	880	123,041	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	300	286	40,016	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,270	2,175	303,922	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	1,400	1,734	242,332	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	850	818	114,353	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	956	133,572	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,000	1,186	165,781	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	1,000	931	130,193	2029/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	400	363	50,842	2029/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	500	668	93,397	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	200	180	25,225	2030/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	894	124,919	2030/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	894	124,939	2030/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,100	1,449	202,492	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	877	122,635	2031/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,000	878	122,720	2031/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	500	434	60,646	2032/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,400	1,881	262,827	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	100	81	11,323	2035/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	900	714	99,884	2036/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,000	1,292	180,538	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	500	449	62,807	2038/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	710	971	135,791	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	87	12,264	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	650	821	114,765	2042/7/4

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	800	916	128,071	2044/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	910	1,055	147,473	2046/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	1,200	1,091	152,435	2048/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,100	687	95,989	2050/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	600	361	50,444	2052/8/15
		BUNDESSCHATZANWEISUNGEN	—	1,200	1,185	165,643	2024/3/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,000	988	138,120	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	194	27,174	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,280	318,578	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	—	1,000	959	134,068	2024/8/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,545	215,988	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	1,200	1,181	165,014	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	500	503	70,279	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	—	1,500	1,423	198,828	2024/12/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	500	476	66,611	2025/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,350	1,436	200,693	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	500	485	67,792	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	779	108,963	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	981	137,135	2025/7/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	200	199	27,835	2025/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	330	323	45,222	2025/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5	1,200	1,115	155,819	2026/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,000	1,062	148,382	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	—	1,500	1,359	189,879	2026/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	528	73,779	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,100	1,032	144,255	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.1	600	551	77,049	2027/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	500	482	67,456	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	1,500	1,355	189,355	2027/9/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	467	65,372	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,800	1,702	237,890	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.25	1,000	852	119,153	2028/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5	600	513	71,693	2028/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	240	259	36,248	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	500	487	68,113	2028/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	1,000	962	134,452	2029/6/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.0	1,000	977	136,576	2029/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,122	156,835	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	800	804	112,413	2030/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	700	600	83,935	2030/4/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	200	164	22,950	2030/8/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	200	172	24,061	2030/12/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	824	115,144	2031/5/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	600	469	65,560	2031/12/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	417	58,368	2032/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	600	529	73,981	2032/12/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,500	1,740	243,238	2033/2/1		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,070	928	129,736	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,610	1,770	247,421	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	800	749	104,711	2035/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	300	222	31,139	2036/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	100	82	11,457	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	780	785	109,755	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	400	361	50,561	2038/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	700	611	85,422	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	350	393	54,970	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.1	500	442	61,819	2040/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	335	46,933	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8	800	569	79,528	2041/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	580	638	89,181	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	500	312	43,641	2045/4/30
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	460	408	57,034	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	500	398	55,608	2047/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	400	363	50,740	2048/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	300	287	40,201	2049/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	500	368	51,493	2050/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7	400	248	34,650	2051/9/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.15	700	471	65,861	2052/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	310	234	32,801	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	2,500	2,467	344,820	2024/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	500	492	68,784	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	510	519	72,646	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,000	966	135,097	2025/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,400	1,352	189,000	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	600	586	81,899	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,100	1,061	148,294	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	1,050	994	139,003	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,200	2,050	286,481	2027/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	1,000	972	135,863	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,300	1,233	172,373	2028/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,300	1,232	172,238	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,000	1,884	263,343	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,500	1,380	192,910	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,800	1,581	221,024	2029/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	1,220	1,281	179,105	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,500	1,283	179,292	2030/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	500	415	58,070	2031/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	800	653	91,253	2032/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,000	983	137,371	2032/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	800	710	99,263	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,550	1,334	186,506	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	500	416	58,137	2038/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	560	506	70,832	2039/6/25
FRANCE (GOVT OF)	0.5	300	213	29,786	2040/5/25		

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	0.5	600	397	55,547	2044/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	610	542	75,836	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	1,100	875	122,354	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	500	310	43,313	2052/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	900	545	76,248	2053/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	300	235	32,837	2066/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	300	311	43,544	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	1,100	1,111	155,340	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	1,100	1,264	176,715	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	600	592	82,717	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	1,000	951	132,984	2026/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	1,410	1,509	210,903	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	900	949	132,626	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	1,200	1,478	206,608	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	2,340	2,265	316,570	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	300	398	55,645	2032/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	2,290	2,879	402,369	2035/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	400	479	67,001	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	720	927	129,588	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,200	1,335	186,654	2045/5/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	700	905	126,458	2055/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	900	1,189	166,141	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,000	1,018	142,249	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	700	680	95,053	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,000	955	133,523	2026/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	400	386	53,982	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,100	1,047	146,406	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,000	953	133,160	2028/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,100	964	134,712	2030/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	200	174	24,423	2032/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	550	580	81,065	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	400	495	69,171	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	300	218	30,579	2038/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	300	232	32,494	2040/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	772	107,912	2042/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	650	738	103,233	2047/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	—	500	275	38,495	2052/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,920	1,998	279,202	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	400	391	54,671	2024/5/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	600	587	82,070	2024/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,400	1,440	201,275	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	964	134,711	2025/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	800	801	111,921	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	700	668	93,454	2025/5/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,000	1,088	152,016	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	700	711	99,466	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,000	940	131,462	2026/1/31

銘柄			当期末				償還年月日
			利率	額面金額	評価額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	20	20	2,811	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	400	462	64,642	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	980	136,989	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,500	1,376	192,383	2027/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	500	490	68,501	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	800	755	105,555	2027/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	500	485	67,879	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	1,400	1,254	175,313	2028/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,000	964	134,697	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	900	865	120,963	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	330	385	53,911	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,000	953	133,264	2029/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	800	712	99,535	2029/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	500	436	60,924	2030/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	300	290	40,605	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	600	549	76,781	2030/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.7	800	668	93,377	2032/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.55	200	196	27,426	2032/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	1,300	1,244	173,825	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	1,100	976	136,469	2035/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	400	500	69,994	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	500	365	51,061	2040/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	700	861	120,344	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	100	68	9,618	2042/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	500	660	92,353	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	950	909	127,052	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	700	639	89,394	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	600	356	49,796	2050/10/31
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.9	300	218	30,573	2052/10/31		
BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.45	200	198	27,690	2066/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	110	15,461	2029/1/31		
SPANISH GOVERNMENT	5.75	1,100	1,401	195,818	2032/7/30		
SPANISH GOVERNMENT	4.2	710	813	113,690	2037/1/31		
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	0.2	600	595	83,165	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	236	32,974	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	300	295	41,291	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	1,200	1,182	165,284	2025/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	100	98	13,733	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	150	144	20,185	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	—	1,000	918	128,268	2027/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	300	285	39,864	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	400	376	52,662	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.1	300	261	36,508	2030/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	700	644	90,000	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	—	1,000	827	115,618	2031/10/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	639	89,378	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	500	431	60,279	2037/6/22



銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	1.9	120	109	15,278	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	366	51,186	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	650	762	106,558	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	500	400	55,993	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	400	320	44,804	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.4	300	215	30,109	2053/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	370	319	44,627	2066/6/22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	670	852	119,112	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	120	121	16,922	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	200	195	27,356	2024/7/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	500	504	70,491	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.2	1,100	1,096	153,149	2025/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	291	40,680	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	380	53,194	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	662	92,600	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	1,000	915	127,920	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	500	420	58,788	2031/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	534	74,691	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.25	100	74	10,405	2036/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	279	39,039	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	—	300	190	26,679	2040/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	200	225	31,510	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	200	165	23,179	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	200	131	18,303	2051/3/20
REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	432	60,443	2062/1/26		
REPUBLIC OF AUSTRIA	0.7	300	150	21,044	2071/4/20		
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	210	141	19,784	2086/11/2		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	203	28,408	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	810	783	109,486	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	782	109,383	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	257	35,955	2030/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	500	443	61,952	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	400	299	41,789	2036/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	164	22,971	2042/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	1.375	200	165	23,074	2047/4/15
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	200	190	26,662	2028/5/15
		IRISH GOVERNMENT	0.35	400	333	46,598	2032/10/18
		IRISH TSY 0.2%	0.2	200	187	26,141	2027/5/15
		IRISH TSY 0.2% 2030	0.2	1,100	956	133,606	2030/10/18
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	650	639	89,332	2026/5/15
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	200	155	21,725	2050/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	550	500	69,934	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	450	405	56,629	2045/2/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	517	72,330	2024/3/18
小 計						26,740,112	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	6,200	5,676	168,316	2024/10/25

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
ポーランド		%	千ズロチ	千ズロチ	千円		
国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	3,800	3,170	93,997	2028/4/25	
	POLAND GOVERNMENT BOND	2.75	3,900	3,158	93,656	2029/10/25	
小 計					355,971		
シンガポール			千シンガポールドル	千シンガポールドル			
国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	400	401	40,215	2024/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	395	39,611	2025/6/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	681	68,289	2026/6/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	746	74,776	2027/3/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	294	29,507	2028/5/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	400	397	39,763	2029/7/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	310	306	30,739	2030/9/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.625	900	800	80,165	2031/7/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	900	819	82,069	2036/8/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	700	635	63,675	2039/7/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	472	47,275	2046/3/1	
	SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	400	312	31,310	2050/3/1	
SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	400	311	31,164	2051/10/1		
小 計					658,562		
中国			千人民元	千人民元			
国債証券	CHINA GOVERNMENT BOND	2.47	20,000	20,171	408,085	2024/9/2	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.26	18,000	18,059	365,361	2025/2/24	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.24	9,000	9,024	182,576	2025/5/25	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.69	6,000	6,081	123,038	2026/8/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.37	13,000	12,994	262,885	2027/1/20	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.91	9,000	9,174	185,602	2028/10/14	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	14,000	14,131	285,896	2029/6/15	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.02	4,000	4,104	83,039	2031/5/27	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.89	4,000	4,063	82,204	2031/11/18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	2.75	4,000	4,022	81,382	2032/2/17	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.72	3,000	3,339	67,555	2051/4/12	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.53	2,000	2,162	43,752	2051/10/18	
	CHINA GOVERNMENT BOND	3.32	7,000	7,320	148,101	2052/4/15	
	小 計					2,319,482	
オーストラリア			千豪ドル	千豪ドル			
国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	400	397	38,122	2024/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	300	281	26,976	2024/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,340	1,340	128,384	2025/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	536	51,377	2026/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	868	83,183	2027/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	290	27,844	2027/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	820	768	73,662	2028/5/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	864	82,814	2028/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	500	492	47,211	2029/4/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	758	72,693	2029/11/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	800	743	71,180	2030/5/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	200	162	15,608	2030/12/21	
	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	500	420	40,298	2031/6/21	

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
オーストラリア		%	千豪ドル	千豪ドル	千円		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	150	119	11,402	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	500	402	38,582	2032/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	800	670	64,257	2032/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,255	120,258	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	500	468	44,855	2033/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	715	68,568	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	148	14,182	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	320	291	27,936	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	700	587	56,275	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	227	21,813	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	500	310	29,766	2051/6/21
小	計					1,257,257	
イスラエル				千新シエケル	千新シエケル		
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,500	1,481	61,104	2023/11/30
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,500	1,525	62,902	2024/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	0.5	400	377	15,549	2025/4/30
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	2,000	1,922	79,270	2027/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,000	869	35,840	2030/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,100	1,445	59,580	2042/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	800	838	34,590	2047/3/31
小	計					348,838	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	13,100	12,699	89,363	2024/9/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	11,000	11,086	78,014	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.0	3,200	2,882	20,284	2025/3/6
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	12,532	88,187	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.5	15,000	13,033	91,716	2027/3/4
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	4,700	4,426	31,150	2027/6/3
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	16,700	15,469	108,852	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	2,820	19,849	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	6,530	45,956	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	10,200	9,780	68,824	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,000	4,429	31,171	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	3,914	27,542	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	9,077	63,879	2023/12/7
小	計					764,791	
合	計					80,313,097	

\* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## ○投資信託財産の構成

(2022年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円	%
	80,313,097	96.0
コール・ローン等、その他	3,302,958	4.0
投資信託財産総額	83,616,055	100.0

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 当期末における外貨建純資産（82,377,094千円）の投資信託財産総額（83,616,055千円）に対する比率は98.5%です。

\* 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=140.27円、1カナダドル=107.09円、1英ポンド=162.54円、1スウェーデンクローナ=13.03円、1ノルウェークローネ=14.15円、1デンマーククローネ=18.79円、1ユーロ=139.72円、1ズロチ=29.6513円、1シンガポールドル=100.16円、1人民元=20.2305円、1豪ドル=95.79円、1新シエケル=41.2315円、1メキシコペソ=7.0368円。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年9月6日現在)

項目	当期末	円
(A) 資産	165,759,520,120	
コール・ローン等	1,171,587,374	
公社債(評価額)	80,313,097,403	
未収入金	83,804,726,447	
未収利息	422,400,674	
前払費用	47,448,816	
差入委託証拠金	259,406	
(B) 負債	85,193,479,056	
未払金	85,178,402,522	
未払解約金	14,255,625	
未払利息	1,009	
その他未払費用	819,900	
(C) 純資産総額(A-B)	80,566,041,064	
元本	75,825,824,813	
次期繰越損益金	4,740,216,251	
(D) 受益権総口数	75,825,824,813口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,625円	

(注) 期首元本額は69,507,998,280円、期中追加設定元本額は29,919,073,643円、期中一部解約元本額は23,601,247,110円、1口当たり純資産額は1.0625円です。

## ○損益の状況 (2021年9月7日～2022年9月6日)

項目	当期	円
(A) 配当等収益	1,860,926,034	
受取利息	1,861,197,920	
その他収益金	995	
支払利息	△ 272,881	
(B) 有価証券売買損益	△14,409,354,485	
売買益	19,825,324,282	
売買損	△34,234,678,767	
(C) 先物取引等取引損益	△ 615,708	
取引益	160,957	
取引損	△ 776,665	
(D) 保管費用等	△ 7,700,551	
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△12,556,744,710	
(F) 前期繰越損益金	16,210,603,242	
(G) 追加信託差損益金	4,459,054,029	
(H) 解約差損益金	△ 3,372,696,310	
(I) 計(E+F+G+H)	4,740,216,251	
次期繰越損益金(I)	4,740,216,251	

\* 損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(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。

\* 損益の状況の中で(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。

\* 損益の状況の中で(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。

## ○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額	円
野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	45,565,102,638	
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	10,432,731,724	
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	9,123,988,347	
オールウェザー・ファクターアロケーションオープン投信(適格機関投資家専用)	6,047,758,615	
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	1,950,369,029	
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	889,032,550	
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	727,714,628	
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	599,858,365	
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	168,747,669	
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	164,404,240	

ファンド名	当期末 元本額	円
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	87,617,457	
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	39,905,389	
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	12,091,048	
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	5,867,127	
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	3,945,914	
インデックス・ブレンド(タイプIII)	2,677,783	
インデックス・ブレンド(タイプV)	2,173,236	
インデックス・ブレンド(タイプI)	729,960	
インデックス・ブレンド(タイプIV)	657,286	
インデックス・ブレンド(タイプII)	451,808	

## ○お知らせ

該当事項はございません。

# クレジット戦略型円建て債券 マザーファンド

## 運用報告書

第6期（決算日2022年8月29日）

作成対象期間（2021年8月28日～2022年8月29日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

#### ●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	内外の金融機関、事業会社等が発行する円建ての社債（シニア債、劣後債等を含みます。）、資産担保証券、モーゲージ担保証券およびわが国の国債等を主要投資対象とし、わが国の国債を対象とした先物取引（以下「国債先物取引」といいます。）および、わが国の企業の信用リスクに係る円建てのデリバティブ取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行なうことを基本とします。
主な投資対象	内外の金融機関、事業会社等が発行する円建ての社債（シニア債、劣後債等を含みます。）、資産担保証券、モーゲージ担保証券およびわが国の国債等を主要投資対象とし、国債先物取引および、わが国の企業の信用リスクに係る円建てのデリバティブ取引を主要取引対象とします。また、選択権付債券売買取引（債券店頭オプション取引）および金利スワップ取引等を活用する場合があります。
主な投資制限	外貨建資産への投資は行いません。 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の20%以内とします。

## 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

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

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	中率	NOMURA-BPI 総合	期騰落			
	円	%			%	%	百万円
2期(2018年8月27日)	10,105	0.6	380.372	△0.0	92.8	—	2,003
3期(2019年8月27日)	10,581	4.7	397.960	4.6	99.0	△7.4	2,089
4期(2020年8月27日)	10,366	△2.0	386.308	△2.9	96.6	—	4,702
5期(2021年8月27日)	10,534	1.6	388.404	0.5	98.8	—	10,825
6期(2022年8月29日)	10,217	△3.0	376.960	△2.9	89.5	—	7,676

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	NOMURA-BPI 総合	騰落		
(期首) 2021年8月27日	円	%			%	%
8月末	10,534	—	388.404	—	98.8	—
9月末	10,536	0.0	388.461	0.0	99.5	—
10月末	10,510	△0.2	387.116	△0.3	99.4	—
11月末	10,500	△0.3	386.721	△0.4	99.4	—
12月末	10,527	△0.1	387.655	△0.2	99.5	—
2022年1月末	10,508	△0.2	386.841	△0.4	99.6	—
2月末	10,440	△0.9	384.056	△1.1	99.2	—
3月末	10,388	△1.4	382.128	△1.6	99.2	—
4月末	10,361	△1.6	381.037	△1.9	99.4	—
5月末	10,333	△1.9	380.119	△2.1	98.4	—
6月末	10,317	△2.1	379.538	△2.3	99.3	—
7月末	10,205	△3.1	376.081	△3.2	98.5	—
8月末	10,241	△2.8	378.553	△2.5	86.8	—
(期末) 2022年8月29日	円	%			%	%
	10,217	△3.0	376.960	△2.9	89.5	—

\*騰落率は期首比です。

\*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,534円から期末10,217円に317円の値下がりとなりました。

上昇要因：・主に保有する社債からインカム収益を得たこと

下落要因：・保有銘柄のクレジットスプレッド（国債利回りに対する、社債利回りの上乗せ部分）拡大により、社債価格が下落したこと  
・国債利回りが上昇（価格は下落）したこと

### ○投資環境

国内社債市場におけるクレジットスプレッド（国債利回りに対する社債利回りの上乗せ部分）は、相対的にスプレッド水準の厚い事業債A・BBB格セクターや円建外債セクターを中心に拡大基調で推移しました。期の前半にかけては、各国政府・中央銀行による積極的な財政・金融緩和政策を背景に、グローバル金融市場とともに国内社債市場も堅調に推移しました。しかしながら、世界的なインフレ圧力の高まりを背景として、各国中央銀行による金融政策が引き締めスタンスに転じたことに加えて、ロシア・ウクライナ情勢の不安定化がグローバル金融市場のリスクセンチメントを悪化させた結果、国内クレジットスプレッドも拡大基調に転じました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

### ・デュレーション

基本運用方針に従いポートフォリオのデュレーション（金利感応度）は、ベンチマークのデュレーション程度に維持しました。

### ・現物債券ポートフォリオの推移

#### <種別構成>

本邦企業の強固な財務基盤に加えて、日銀の金融緩和政策の継続により国内社債市場の安定推移を見込んだ結果、事業債のオーバーウェイト（ベンチマーク対比で多めの組み入れ）を維持しました。

#### <格付別構成>

主に短中期年限の事業債保有により、期を通じてA~BBB格セクターのオーバーウェイトポジションを維持しました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-3.01%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の騰落率-2.95%を0.06%下回りました。

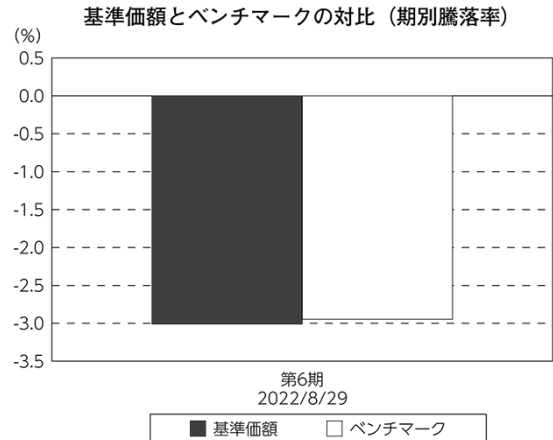
### 【主な差異要因】

#### (プラス要因)

- ・主にA~BBB格社債の保有を通じたインカム収益の獲得
- ・保有銘柄の売却等によるトレーディング収益の獲得

#### (マイナス要因)

- ・オーバーウェイトとした事業債セクター等のクレジットスプレッド拡大による種別効果のマイナス
- ・保有銘柄のクレジットスプレッド拡大による個別銘柄効果のマイナス



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。



## ◎今後の運用方針

本邦社債発行企業の財務・資金調達基盤は総じて強固であり、企業信用力は底堅く推移するものと見込んでおります。また、日銀による金融・信用緩和政策が下支えとなることで、クレジットスプレッドも安定的に推移するものと予想します。尤も、ロシア・ウクライナ情勢の不安定化に伴いエネルギー価格の高止まりが続いている事に加えて、各国中央銀行による金融政策の正常化（利上げ）が本格化しつつある等、グローバル経済にも下押し圧力が強まっていることから、その影響について動向を注視してまいります。

引き続き、A～BBB格セクターのオーバーウェイトを基本ポジションとして維持しつつ、インカム収益の安定的な獲得を図ります。また、外部環境の変化に応じてポートフォリオのポジション調整や銘柄の入れ替えを行なうことで、超過収益の積み上げを図ってまいります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年8月28日～2022年8月29日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,405円です。			

\*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2021年8月28日～2022年8月29日)

## 公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 10,133,486	千円 12,718,255
	社債券（投資法人債券を含む）	8,807,872	8,952,558 ( 500,000)

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）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。

\*社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

## スワップ及び先渡取引状況

種 類	当 期
	取引契約金額
その他のスワップ	百万円 300

\*単位未満は切り捨て。

\*当期末の想定元本額です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年8月28日～2022年8月29日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 18,941	百万円 101	% 0.5	百万円 21,670	百万円 1,591	% 7.3

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

## ○組入資産の明細

(2022年8月29日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	3,050,000	2,912,942	37.9	—	35.5	2.5	—	
普通社債券 (含む投資法人債券)	4,000,000 (4,000,000)	3,959,120 (3,959,120)	51.6 (51.6)	— (—)	50.3 (50.3)	1.3 (1.3)	— (—)	
合 計	7,050,000 (4,000,000)	6,872,062 (3,959,120)	89.5 (51.6)	— (—)	85.8 (50.3)	3.8 (1.3)	— (—)	

\* ( ) 内は非上場債で内書きです。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 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。

\* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
		千円	千円	償還年月日	
<b>国債証券</b>					
国庫債券	利付(5年)第153回	0.005	190,000	189,817	2027/6/20
国庫債券	利付(40年)第13回	0.5	40,000	31,448	2060/3/20
国庫債券	利付(10年)第356回	0.1	100,000	99,511	2029/9/20
国庫債券	利付(10年)第364回	0.1	50,000	49,423	2031/9/20
国庫債券	利付(10年)第367回	0.2	340,000	338,694	2032/6/20
国庫債券	利付(30年)第65回	0.4	220,000	181,559	2049/12/20
国庫債券	利付(30年)第69回	0.7	160,000	142,193	2050/12/20
国庫債券	利付(30年)第71回	0.7	50,000	44,175	2051/6/20
国庫債券	利付(30年)第72回	0.7	100,000	88,182	2051/9/20
国庫債券	利付(30年)第73回	0.7	80,000	70,561	2051/12/20
国庫債券	利付(20年)第151回	1.2	190,000	207,584	2034/12/20
国庫債券	利付(20年)第156回	0.4	50,000	49,271	2036/3/20
国庫債券	利付(20年)第157回	0.2	220,000	210,388	2036/6/20
国庫債券	利付(20年)第158回	0.5	100,000	99,347	2036/9/20
国庫債券	利付(20年)第159回	0.6	180,000	180,833	2036/12/20
国庫債券	利付(20年)第171回	0.3	280,000	258,913	2039/12/20
国庫債券	利付(20年)第174回	0.4	100,000	93,174	2040/9/20
国庫債券	利付(20年)第176回	0.5	50,000	47,119	2041/3/20
国庫債券	利付(20年)第177回	0.4	100,000	92,329	2041/6/20
国庫債券	利付(20年)第178回	0.5	150,000	140,811	2041/9/20
国庫債券	利付(20年)第180回	0.8	230,000	227,309	2042/3/20
国庫債券	利付(20年)第181回	0.9	70,000	70,295	2042/6/20
小計			3,050,000	2,912,942	
<b>普通社債券(含む投資法人債券)</b>					
関西電力	第1回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付	0.896	100,000	99,150	2082/3/20
九州電力	第2回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	1.09	100,000	99,229	2080/10/15
東京電力パワーグリッド	第20回	1.16	100,000	98,464	2033/12/13
東京電力パワーグリッド	第39回	1.08	100,000	99,447	2030/7/16
東京電力パワーグリッド	第45回	0.8	100,000	96,954	2031/4/22
アサヒグループホールディングス	第1回利払繰延期限前償還条項劣	0.97	200,000	200,860	2080/10/15
日鉄興和不動産	第5回社債間限定同順位特約付	0.65	300,000	293,871	2031/7/18
帝人	第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	0.75	200,000	196,126	2051/7/21
住友化学	第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	1.3	100,000	99,393	2079/12/13
武田薬品工業	第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	1.72	100,000	102,800	2079/6/6
楽天	第15回社債間限定同順位特約付	0.5	100,000	99,477	2024/12/2
ENEOS	第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	0.7	200,000	199,044	2081/6/15
DMG森精機	第2回利払繰延条項任意償還条項付無担保永久債劣後	1.0	100,000	99,730	2169/4/29
パナソニック	第1回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付	0.74	200,000	196,616	2081/10/14
パナソニック	第2回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付	0.885	100,000	96,620	2081/10/14
日本生命	第4回A号利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	0.91	100,000	100,153	2046/11/22
アイシン精機	第1回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付	0.4	200,000	198,500	2080/2/28
大樹生命	第1回利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	0.74	100,000	98,820	2051/7/2
兼松	第6回無担保社債間限定同順位特約付	0.65	100,000	98,835	2029/3/2
クレディセゾン	第73回社債間限定同順位特約付	0.48	100,000	99,004	2029/3/15
イオン	第8回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	1.185	100,000	94,855	2051/9/8
三菱東京UFJ銀行	第30回劣後特約付	2.46	100,000	112,719	2031/1/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
三菱HCキャピタル	第1回利払繰延条項期限前償還劣後特約付	0.63	200,000	197,120	2081/9/27
第一生命HD	第4回利払繰延条項任意償還条項付無担保永久債券後	0.9	100,000	97,079	2170/6/23
T&Dホールディングス	第1回利払繰延・期限前償還条項劣後特約	1.12	100,000	100,340	2048/9/23
イオンモール	第22回社債間限定同順位特約付	0.4	200,000	196,086	2029/7/3
東日本旅客鉄道	第122回社債間限定同順位特約付	1.119	100,000	89,798	2057/1/26
商船三井	第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	1.6	100,000	101,470	2056/4/27
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	第9回期限前償還劣後特約	1.1	100,000	97,000	2031/12/16
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	第1回期限前償還条項付	1.422	100,000	99,820	2029/7/6
ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー	第10回円貨社債	1.247	100,000	99,740	2028/5/26
小	計		4,000,000	3,959,120	
合	計		7,050,000	6,872,062	

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

### スワップ及び先渡取引残高

種 類	取 引 契 約 残 高	
	当期末想定元本額	
その他のスワップ	百万円 300	

\*単位未満は切り捨て。

### ○投資信託財産の構成

(2022年8月29日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 6,872,062	% 89.5
コール・ローン等、その他	804,405	10.5
投資信託財産総額	7,676,467	100.0

\*金額の単位未満は切り捨て。

### ○特定資産の価格等の調査

調査依頼を行なった取引は2021年8月3日から2022年8月1日までの間でスワップ取引3件でした。これらのスワップ取引について、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、取引先、通貨の種類、銘柄名、想定元本金額、取引スプレッドその他の当該スワップ取引の内容に関して、EY新日本有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月29日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,676,467,976
コール・ローン等	689,138,495
公社債(評価額)	6,872,062,600
未収入金	100,758,439
未収利息	12,255,030
前払費用	2,253,412
(B) 負債	660
未払利息	660
(C) 純資産総額(A-B)	7,676,467,316
元本	7,513,264,409
次期繰越損益金	163,202,907
(D) 受益権総口数	7,513,264,409口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,217円

(注) 期首元本額は10,276,291,559円、期中追加設定元本額は8,483,217,135円、期中一部解約元本額は11,246,244,285円、1口当たり純資産額は1,0217円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

・ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	2,575,076,014円
・オルウェザー・ファクターアロケーションMオープン投信(道徳機関投資家専用)	2,569,253,599円
・野村ターゲットインカムファンド(年3%目標分配型)	2,127,535,722円
・野村ターゲットインカムファンド(資産成長型)	190,816,454円
・野村ターゲットインカムファンド(年6%目標払出型)	50,582,620円

## ○損益の状況 (2021年8月28日～2022年8月29日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	78,132,328
受取利息	79,765,843
支払利息	△ 1,633,515
(B) 有価証券売買損益	△596,949,389
売買益	13,339,400
売買損	△610,288,789
(C) 先物取引等取引損益	3,347,260
取引益	4,497,463
取引損	△ 1,150,203
(D) 保管費用等	△ 5,940
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△515,475,741
(F) 前期繰越損益金	548,763,818
(G) 追加信託差損益金	350,802,538
(H) 解約差損益金	△220,887,708
(I) 計(E+F+G+H)	163,202,907
次期繰越損益金(I)	163,202,907

\*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(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。

\*損益の状況の中で(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。

\*損益の状況の中で(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。

## ○お知らせ

該当事項はございません。