

当ファンドの仕組みは次の通りです。

|        |   |                            |
|--------|---|----------------------------|
| 商品分類   | 追加型投信／国内／債券／インデックス型   |                            |
| 信託期間   | 信託期間は2003年2月3日から無期限です。  |                            |
| 運用方針   | 確定拠出年金法(平成13年法律第88号)に基づく確定拠出年金制度のための専用ファンドとして投資信託財産の長期的な成長をはかることをめざして運用を行います。   |                            |
| 主要運用対象 | DC日本債券インデックス・オープンS  | 下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
|        | 国内債券インデックスマザーファンド   | わが国の公社債を主要投資対象とします。        |
| 組入制限   | DC日本債券インデックス・オープンS  | 外貨建資産への投資は行いません。           |
|        | 国内債券インデックスマザーファンド   | 外貨建資産への投資は、行いません。          |
| 分配方針   | 原則として、毎年9月30日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。 |                            |

## DC日本債券インデックス・オープンS

### 運用報告書(全体版)

第21期(決算日 2023年10月2日)

#### 受益者のみなさまへ

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

#### 三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

- 口座残高など、お客さまのお取引内容についてのお問い合わせ  
お取引のある販売会社へお問い合わせください。
- 当運用報告書についてのお問い合わせ  
フリーダイヤル:0120-668001  
(受付時間は営業日の午前9時～午後5時です。)

**【本運用報告書の記載について】**

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

## 最近5期の運用実績

| 決算期               | 基準価額<br>(分配落) |           |           | ベンチマーク    |      | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産額    |
|-------------------|---------------|-----------|-----------|-----------|------|--------|--------|---------|
|                   | 円             | 税込<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | 期中<br>騰落率 | %    |        |        |         |
| 第17期(2019年 9月30日) | 12,873        | 0         | 3.8       | 394.271   | 4.1  | 99.8   | 0.0    | 124,719 |
| 第18期(2020年 9月30日) | 12,623        | 0         | △1.9      | 387.219   | △1.8 | 99.8   | —      | 129,160 |
| 第19期(2021年 9月30日) | 12,597        | 0         | △0.2      | 387.116   | △0.0 | 99.9   | —      | 131,638 |
| 第20期(2022年 9月30日) | 12,137        | 0         | △3.7      | 373.602   | △3.5 | 99.8   | —      | 125,879 |
| 第21期(2023年10月 2日) | 11,822        | 0         | △2.6      | 364.546   | △2.4 | 99.8   | —      | 120,256 |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日                  | 基準価額   |      | ベンチマーク  |      | 債券組入比率 | 債券先物比率 |
|----------------------|--------|------|---------|------|--------|--------|
|                      | 円      | 騰落率  | 騰落率     | %    |        |        |
| (当期首)<br>2022年 9月30日 | 12,137 | —    | 373.602 | —    | 99.8   | —      |
| 10月末                 | 12,122 | △0.1 | 373.249 | △0.1 | 99.7   | —      |
| 11月末                 | 12,060 | △0.6 | 371.326 | △0.6 | 99.8   | —      |
| 12月末                 | 11,901 | △1.9 | 366.595 | △1.9 | 99.8   | —      |
| 2023年 1月末            | 11,868 | △2.2 | 365.595 | △2.1 | 99.7   | —      |
| 2月末                  | 11,997 | △1.2 | 369.572 | △1.1 | 99.7   | —      |
| 3月末                  | 12,161 | 0.2  | 374.743 | 0.3  | 99.8   | —      |
| 4月末                  | 12,191 | 0.4  | 375.608 | 0.5  | 99.8   | —      |
| 5月末                  | 12,177 | 0.3  | 375.266 | 0.4  | 99.7   | —      |
| 6月末                  | 12,206 | 0.6  | 376.290 | 0.7  | 99.8   | —      |
| 7月末                  | 12,016 | △1.0 | 370.426 | △0.9 | 99.7   | —      |
| 8月末                  | 11,928 | △1.7 | 367.761 | △1.6 | 99.7   | —      |
| 9月末                  | 11,842 | △2.4 | 365.131 | △2.3 | 99.8   | —      |
| (当期末)<br>2023年10月 2日 | 11,822 | △2.6 | 364.546 | △2.4 | 99.8   | —      |

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

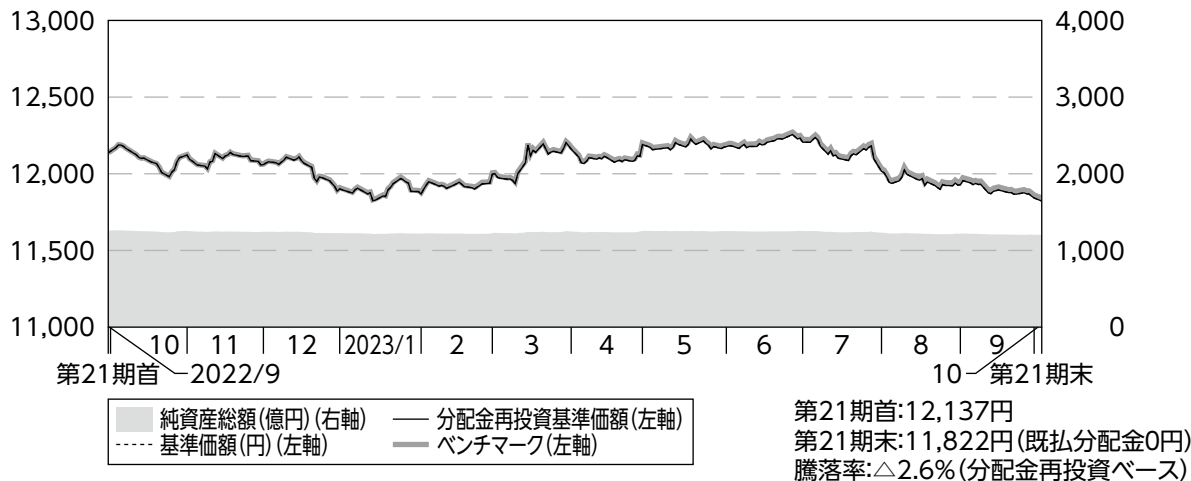
ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

【NOMURA-BPI総合】とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスを基に計算されます。

【同指数】の知的財産権は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、同指数を用いて行われる当社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移

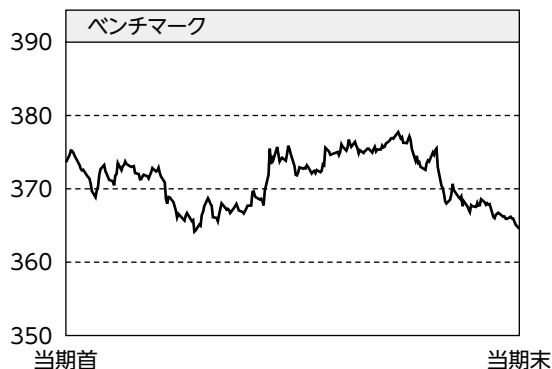


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年9月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行った結果、当期の基準価額は、ベンチマークとほぼ同じ動きとなり、下落しました。

## 投資環境



国内長期金利は、期初から2022年12月後半にかけてレンジ内で推移しましたが、12月後半に日銀が長短金利操作における長期金利の変動許容幅を0.250%程度から0.500%程度に引き上げたことを受けて急上昇しました。しかし、その後は日銀が金融政策の修正に動くとの思惑がくすぶる中、政策が現状維持とされたことで買いが優勢となり、利回りは低下に転じました。その後、3月の金融政策決定会合で日銀が一部の市場参加者の予想に反して政策修正を見送ったこと、2月下旬以降実施している事実上の国債の空売り抑制策を一段と強化したことなどから、利回りは急低下しました。その後、期末にかけては日銀が7月下旬に長短金利操作の運用柔軟化を決定し、長期金利の事実上の上限を1%に引き上げたことを受けて、国内金利は再び上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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

### 【「国内債券インデックス マザーファンド」の運用経過】

#### (1) 債券組入比率

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

#### (2) ポートフォリオ構成

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

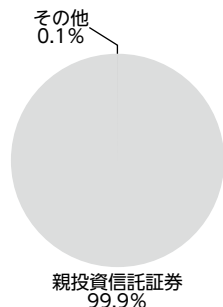
## 当ファンドの組入資産の内容

### ○組入ファンド

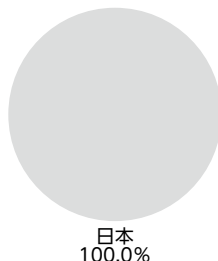
|                    | 当期末        |
|--------------------|------------|
|                    | 2023年10月2日 |
| 国内債券インデックス マザーファンド | 99.9%      |
| その他                | 0.1%       |
| 組入ファンド数            | 1          |

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

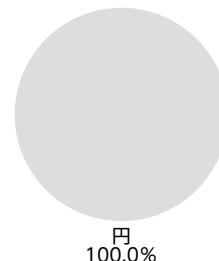
### ○資産別配分



### ○国別配分



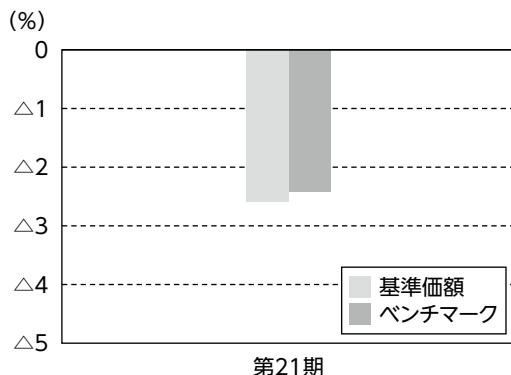
### ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

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



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

## 分配金

長期的な信託財産の成長を図るため、収益分配は見送りとさせていただきます。

なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

| 項目        | 第21期                  |       |
|-----------|-----------------------|-------|
|           | 2022年10月1日~2023年10月2日 |       |
| 当期分配金     | (円)                   | —     |
| (対基準価額比率) | (%)                   | (—)   |
| 当期の収益     | (円)                   | —     |
| 当期の収益以外   | (円)                   | —     |
| 翌期繰越分配対象額 | (円)                   | 2,604 |

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

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

(注3)—印は該当がないことを示します。

## 今後の運用方針

主として、国内債券インデックス マザーファンドの受益証券に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

# 1万口当たりの費用明細

| 項目               | 当期                      |         | 項目の概要  |
|------------------|-------------------------|---------|--|
|                  | (2022年10月1日~2023年10月2日) |         |  |
|                  | 金額                      | 比率      |  |
| (a) 信託報酬         | 21円                     | 0.177%  | (a) 信託報酬＝[期中の平均基準価額]×信託報酬率<br>期中の平均基準価額は12,046円です。<br>信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。<br>委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価<br>交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、<br>購入後の情報提供等の対価<br>運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (投信会社)           | (7)                     | (0.055) |  |
| (販売会社)           | (11)                    | (0.088) |  |
| (受託会社)           | (4)                     | (0.033) |  |
| (b) 売買委託手数料      | 0                       | 0.000   | (b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$<br>売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料   |
| (株式)             | (-)                     | (-)     |  |
| (新株予約権証券)        | (-)                     | (-)     |  |
| (オプション証券等)       | (-)                     | (-)     |  |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-)                     | (-)     |  |
| (投資信託証券)         | (-)                     | (-)     |  |
| (商品)             | (-)                     | (-)     |  |
| (先物・オプション)       | (0)                     | (0.000) |  |
| (c) 有価証券取引税      | -                       | -       | (c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$<br>有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金  |
| (株式)             | (-)                     | (-)     |  |
| (新株予約権証券)        | (-)                     | (-)     |  |
| (オプション証券等)       | (-)                     | (-)     |  |
| (新株予約権付社債(転換社債)) | (-)                     | (-)     |  |
| (公社債)            | (-)                     | (-)     |  |
| (投資信託証券)         | (-)                     | (-)     |  |
| (d) その他費用        | 0                       | 0.002   | (d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$<br>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<br>監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用<br>その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用                         |
| (保管費用)           | (-)                     | (-)     |  |
| (監査費用)           | (0)                     | (0.002) |  |
| (その他)            | (-)                     | (-)     |  |
| 合計               | 21                      | 0.179   |  |

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

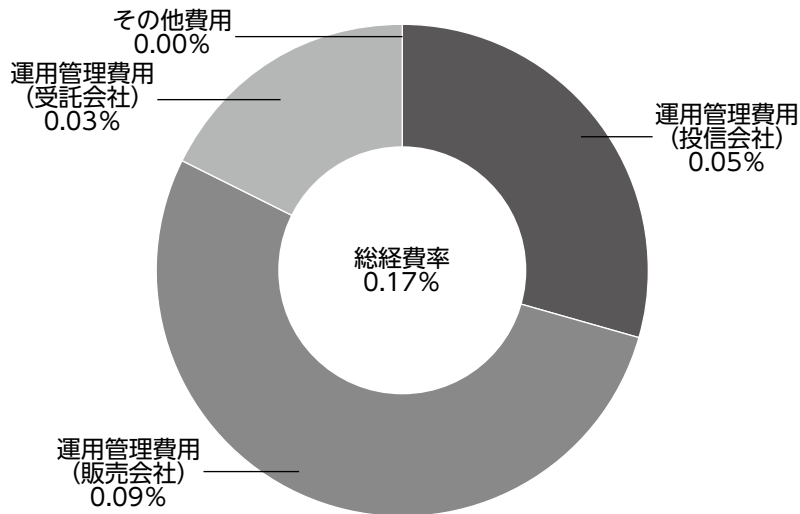
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。



## <参考情報>

### 総経費率

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総経費率(年率)は0.17%です。



(注1)各費用は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2)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3)各比率は、年率換算した値です。

(注4)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。

## 売買および取引の状況

### <親投資信託受益証券の設定、解約状況>

|                       | 当 期             |                 |                 |                  |
|-----------------------|-----------------|-----------------|-----------------|------------------|
|                       | 設 定             |                 | 解 約             |                  |
|                       | 口 数             | 金 額             | 口 数             | 金 額              |
| 国内債券インデックス<br>マザーファンド | 千口<br>5,805,403 | 千円<br>7,859,516 | 千口<br>7,740,651 | 千円<br>10,462,336 |

## 利害関係人<sup>\*</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

| 区 分           | 当               |                    |               | 期               |                    |               |
|---------------|-----------------|--------------------|---------------|-----------------|--------------------|---------------|
|               | 買付額等A           | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C           | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 金 銭 信 託       | 百万円<br>0.013724 | 百万円<br>0.013724    | %<br>100.0    | 百万円<br>0.013724 | 百万円<br>0.013724    | %<br>100.0    |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 47,860          | 5,570              | 11.6          | 47,870          | 5,606              | 11.7          |

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

### <国内債券インデックス マザーファンド>

| 区 分           | 当               |                    |               | 期               |                    |               |
|---------------|-----------------|--------------------|---------------|-----------------|--------------------|---------------|
|               | 買付額等A           | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等C           | うち利害関係人<br>との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
| 金 銭 信 託       | 百万円<br>0.054390 | 百万円<br>0.054390    | %<br>100.0    | 百万円<br>0.054390 | 百万円<br>0.054390    | %<br>100.0    |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 234,929         | 27,877             | 11.9          | 234,810         | 28,060             | 12.0          |

<平均保有割合 19.5%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

## 組入資産の明細

### <親投資信託残高>

|                    | 当 期 首(前期末)       | 当 期 末            |                   |
|--------------------|------------------|------------------|-------------------|
|                    | 口 数              | 口 数              | 評 価 額             |
| 国内債券インデックス マザーファンド | 千口<br>92,444,255 | 千口<br>90,509,007 | 千円<br>120,195,962 |

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、483,216,028千口です。

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

## 投資信託財産の構成

| 項 目                | 当 期 末       |       |
|--------------------|-------------|-------|
|                    | 評 価 額       | 比 率   |
|                    | 千円          | %     |
| 国内債券インデックス マザーファンド | 120,195,962 | 99.7  |
| コール・ローン等、その他       | 337,307     | 0.3   |
| 投資信託財産総額           | 120,533,269 | 100.0 |

## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

### ■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目                        | 当 期 末<br>2023年10月2日現在 |
|----------------------------|-----------------------|
| (A)資 産                     | 120,533,269,989円      |
| コール・ローン等                   | 293,388,842           |
| 国内債券インデックス<br>マザーファンド(評価額) | 120,195,962,048       |
| 未 収 入 金                    | 43,919,099            |
| (B)負 債                     | 277,080,802           |
| 未 払 解 約 金                  | 164,648,453           |
| 未 払 信 託 報 酬                | 110,255,625           |
| 未 払 利 息                    | 505                   |
| そ の 他 未 払 費 用              | 2,176,219             |
| (C)純 資 産 総 額(A-B)          | 120,256,189,187       |
| 元 本                        | 101,724,503,325       |
| 次 期 繰 越 損 益 金              | 18,531,685,862        |
| (D)受 益 権 総 口 数             | 101,724,503,325口      |
| 1万口当たり基準価額(C/D)            | 11,822円               |

### ■損益の状況

| 項 目                 | 当 期<br>自 2022年10月1日<br>至 2023年10月2日 |
|---------------------|-------------------------------------|
| (A)配 当 等 収 益        | △104,384円                           |
| 受 取 利 息             | 574                                 |
| 支 払 利 息             | △104,958                            |
| (B)有 価 証 券 売 買 損 益  | △2,887,661,890                      |
| 売 買 益               | 150,964,113                         |
| 売 買 損               | △3,038,626,003                      |
| (C)信 託 報 酬 等        | △220,845,068                        |
| (D)当 期 損 益 金(A+B+C) | △3,108,611,342                      |
| (E)前 期 繰 越 損 益 金    | △1,364,459,877                      |
| (F)追 加 信 託 差 損 益 金  | 23,004,757,081                      |
| (配 当 等 相 当 額)       | (22,553,209,470)                    |
| (売 買 損 益 相 当 額)     | (451,547,611)                       |
| (G) 計 (D+E+F)       | 18,531,685,862                      |
| (H)収 益 分 配 金        | 0                                   |
| 次 期 繰 越 損 益 金(G+H)  | 18,531,685,862                      |
| 追 加 信 託 差 損 益 金     | 23,004,757,081                      |
| (配 当 等 相 当 額)       | (22,553,209,470)                    |
| (売 買 損 益 相 当 額)     | (451,547,611)                       |
| 分 配 準 備 積 立 金       | 3,942,038,040                       |
| 繰 越 損 益 金           | △8,415,109,259                      |

- (注1) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
(注2) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。  
(注3) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は103,715,206,248円、期中追加設定元本額は14,382,339,845円、期中一部解約元本額は16,373,042,768円です。

※分配金の計算過程

| 項   | 目                           | 当 | 期                |
|-----|-----------------------------|---|------------------|
| (A) | 配当等収益額(費用控除後)               |   | －円               |
| (B) | 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)  |   | －円               |
| (C) | 収益調整金額                      |   | 22,553,209,470円  |
| (D) | 分配準備積立金額                    |   | 3,942,038,040円   |
| (E) | 分配対象収益額(A+B+C+D)            |   | 26,495,247,510円  |
| (F) | 期末残存口数                      |   | 101,724,503,325口 |
| (G) | 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000) |   | 2,604円           |
| (H) | 分配金額(1万口当たり)                |   | －円               |
| (I) | 収益分配金金額(F×H/10,000)         |   | －円               |

## お知らせ

---

該当事項はありません。

# 国内債券インデックス マザーファンド

## 運用報告書

第23期（決算日 2023年5月29日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

|        |  |
|--------|--|
| 信託期間   | 信託期間は2000年5月30日から無期限です。                              |
| 運用方針   | わが国の公社債を中心に投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。 |
| 主要運用対象 | わが国の公社債を主要投資対象とします。                                  |
| 組入制限   | 外貨建資産への投資は、行いません。                                    |

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

### 【本運用報告書の記載について】

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

## 最近5期の運用実績

| 決算期              | 基準価額   |      | ベンチマーク  |      | 債券先物率<br>組入比率 | 債券先物率<br>比 | 純資産額           |
|------------------|--------|------|---------|------|---------------|------------|----------------|
|                  | 円      | 騰落率  | 円       | 騰落率  |               |            |                |
| 第19期(2019年5月29日) | 14,211 | 2.0  | 390.052 | 2.0  | 99.7          | 0.0        | 百万円<br>462,300 |
| 第20期(2020年5月29日) | 14,136 | △0.5 | 388.127 | △0.5 | 100.5         | —          | 540,159        |
| 第21期(2021年5月31日) | 14,082 | △0.4 | 386.621 | △0.4 | 99.8          | —          | 628,366        |
| 第22期(2022年5月30日) | 13,840 | △1.7 | 379.991 | △1.7 | 99.8          | 0.1        | 624,929        |
| 第23期(2023年5月29日) | 13,656 | △1.3 | 374.891 | △1.3 | 100.1         | —          | 633,923        |

(注)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## 当期中の基準価額と市況の推移

| 年月日                  | 基準価額   |      | ベンチマーク  |      | 債券先物率<br>組入比率 | 債券先物率<br>比 |
|----------------------|--------|------|---------|------|---------------|------------|
|                      | 円      | 騰落率  | 円       | 騰落率  |               |            |
| (当期首)<br>2022年 5月30日 | 13,840 | —    | 379.991 | —    | 99.8          | 0.1        |
| 5月末                  | 13,825 | △0.1 | 379.538 | △0.1 | 99.8          | —          |
| 6月末                  | 13,698 | △1.0 | 376.081 | △1.0 | 99.8          | —          |
| 7月末                  | 13,787 | △0.4 | 378.553 | △0.4 | 99.8          | —          |
| 8月末                  | 13,756 | △0.6 | 377.670 | △0.6 | 99.7          | —          |
| 9月末                  | 13,610 | △1.7 | 373.602 | △1.7 | 99.9          | —          |
| 10月末                 | 13,595 | △1.8 | 373.249 | △1.8 | 99.8          | —          |
| 11月末                 | 13,528 | △2.3 | 371.326 | △2.3 | 99.8          | —          |
| 12月末                 | 13,351 | △3.5 | 366.595 | △3.5 | 99.8          | —          |
| 2023年 1月末            | 13,316 | △3.8 | 365.595 | △3.8 | 99.8          | —          |
| 2月末                  | 13,463 | △2.7 | 369.572 | △2.7 | 99.8          | —          |
| 3月末                  | 13,649 | △1.4 | 374.743 | △1.4 | 99.9          | —          |
| 4月末                  | 13,684 | △1.1 | 375.608 | △1.2 | 99.9          | —          |
| (当期末)<br>2023年 5月29日 | 13,656 | △1.3 | 374.891 | △1.3 | 100.1         | —          |

(注1)騰落率は期首比です。

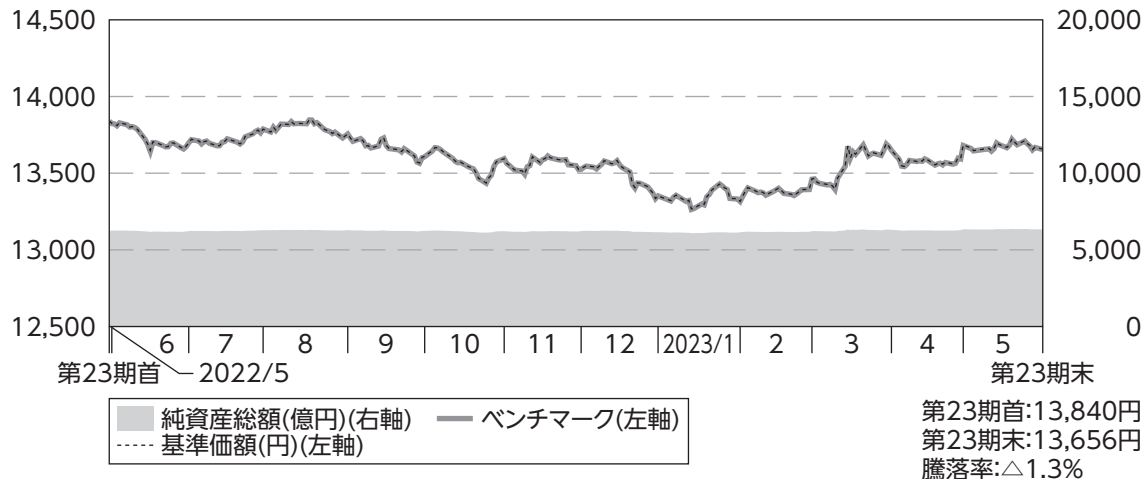
(注2)債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

## ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

## 当期中の運用経過と今後の運用方針

### 基準価額等の推移



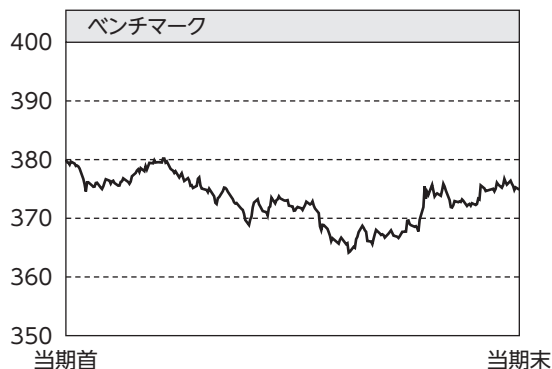
(注)ベンチマークは、2022年5月30日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

### 基準価額の主な変動要因

当期の基準価額は、下落しました。

2022年8月下旬から11月中旬にかけて、米長期金利が上昇した影響等から国内金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。12月には金融政策決定会合で、日銀が長期金利の変動許容幅を0.250%程度から0.500%程度に引き上げたことで幅広い年限で利回りの上昇が加速し、基準価額は一段と下落しました。しかし、その後は金融政策決定会合において緩和スタンスが維持されたことや海外の金融機関に対する信用不安の高まりから金利低下(債券価格は上昇)圧力が高まったことなどから期末にかけては下げ幅を戻しました。

## 投資環境



国内金利は、2022年8月下旬から11月中旬にかけて、米長期金利が上昇した影響等から上昇しました。12月には金融政策決定会合で、日銀が長期金利の変動許容幅を0.250%程度から0.500%程度に引き上げたことで幅広い年限で利回りの上昇が加速しました。しかし、その後は金融政策決定会合において緩和スタンスが維持されたことや海外の金融機関に対する信用不安の高まりから金利低下圧力が高まりました。

## 当ファンドのポートフォリオ

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

### (1) 債券組入比率

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

### (2) ポートフォリオ構成

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



## 当ファンドの組入資産の内容

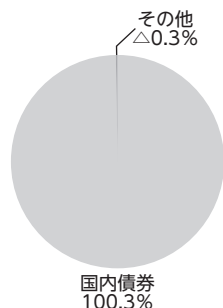
### ○上位10銘柄

| 順位 | 銘柄名            | 国・地域 | 組入比率 |
|----|----------------|------|------|
| 1  | 第141回利付国債(5年)  | 日本   | 1.4% |
| 2  | 第350回利付国債(10年) | 日本   | 1.1% |
| 3  | 第150回利付国債(5年)  | 日本   | 1.1% |
| 4  | 第365回利付国債(10年) | 日本   | 1.0% |
| 5  | 第148回利付国債(5年)  | 日本   | 1.0% |
| 6  | 第344回利付国債(10年) | 日本   | 0.9% |

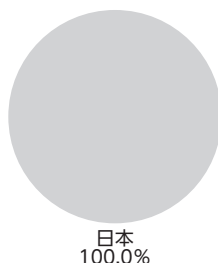
| 順位    | 銘柄名            | 国・地域 | 組入比率 |
|-------|----------------|------|------|
| 7     | 第140回利付国債(5年)  | 日本   | 0.9% |
| 8     | 第346回利付国債(10年) | 日本   | 0.9% |
| 9     | 第144回利付国債(5年)  | 日本   | 0.9% |
| 10    | 第363回利付国債(10年) | 日本   | 0.9% |
| 組入銘柄数 |                | 990  |      |

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

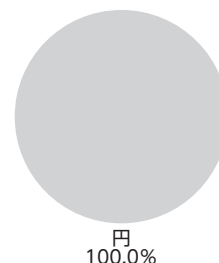
### ○資産別配分



### ○国別配分



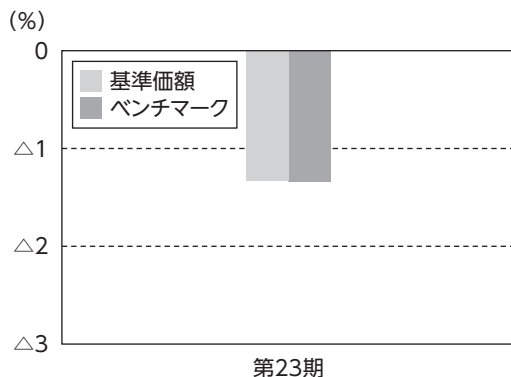
### ○通貨別配分



(注) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

## 今後の運用方針

NOMURA-BPI総合をベンチマークとし、その動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

## 1万口当たりの費用明細

| 項目   | 当期   |  | 項目の概要   |
|--|--|--|---|
|  | (2022年5月31日~2023年5月29日)                      |  |   |
|  | 金額   | 比率   |   |
| (a) 売買委託手数料<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(投資信託証券)<br>(商品)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0) | 0.000%<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(0.000) | (a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$<br>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) 有価証券取引税<br>(株式)<br>(新株予約権証券)<br>(オプション証券等)<br>(新株予約権付社債(転換社債))<br>(公社債)<br>(投資信託証券)              | -<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)         | -<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)<br>(-)                 | (b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$<br>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  |
| (c) その他費用<br><br>(保管費用)<br><br>(監査費用)<br>(その他)   | -<br><br>(-)<br><br>(-)<br>(-)               | -<br><br>(-)<br><br>(-)<br>(-)                       | (c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$<br>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<br>監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用<br>その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用 |
| 合計   | 0  | 0.000  |   |

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

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額(13,605円)で除して100を乗じたものです。

## 売買および取引の状況

### <公社債>

|        |                | 当 期         |                        |
|--------|----------------|-------------|------------------------|
|        |                | 買 付 額       | 売 付 額                  |
| 国<br>内 | 国 債 証 券        | 129,724,698 | 105,419,481            |
|        | 地 方 債 証 券      | 3,722,803   | 4,442,249              |
|        | 特 殊 債 券        | 9,763,330   | 8,238,202<br>(727,263) |
|        | 社債券(投資法人債券を含む) | 6,498,745   | 7,665,654              |

(注1)金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3)社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

### <先物取引の種類別取引状況>

| 種 類 別  |             | 当 期           |               |           |          |
|--------|-------------|---------------|---------------|-----------|----------|
|        |             | 買 建           |               | 売 建       |          |
|        |             | 新 規 買 付 額     | 決 済 額         | 新 規 売 付 額 | 決 済 額    |
| 国<br>内 | 債 券 先 物 取 引 | 百万円<br>17,977 | 百万円<br>18,572 | 百万円<br>-  | 百万円<br>- |

(注)金額は受渡代金です。

## 利害関係人<sup>※</sup>との取引状況等

### ■利害関係人との取引状況

| 区 分           | 当               |                    |            | 期               |                    |            |
|---------------|-----------------|--------------------|------------|-----------------|--------------------|------------|
|               | 買付額等A           | うち利害関係人<br>との取引状況B | B<br>A     | 売付額等C           | うち利害関係人<br>との取引状況D | D<br>C     |
| 金 銭 信 託       | 百万円<br>0.054390 | 百万円<br>0.054390    | %<br>100.0 | 百万円<br>0.054390 | 百万円<br>0.054390    | %<br>100.0 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン | 210,820         | 21,306             | 10.1       | 212,120         | 21,280             | 10.0       |

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

## 組入資産の明細

## &lt;国内(邦貨建)公社債&gt;

## (A) 債券種類別開示

| 区 分                                | 当 期                         |                             |                 | 末                       |                   |               |               |
|------------------------------------|-----------------------------|-----------------------------|-----------------|-------------------------|-------------------|---------------|---------------|
|                                    | 額 面 金 額                     | 評 価 額                       | 組 入 比 率         | う ち B<br>格 以<br>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                            | 528,412,000                 | 536,742,855                 | 84.7            | —                       | 55.1              | 20.6          | 8.9           |
| 地 方 債 証 券                          | 31,680,430<br>(31,680,430)  | 32,186,855<br>(32,186,855)  | 5.1<br>(5.1)    | —<br>(—)                | 3.1<br>(3.1)      | 1.5<br>(1.5)  | 0.5<br>(0.5)  |
| 特 殊 債 証 券<br>(除 く 金 融 債)           | 34,350,238<br>(34,350,238)  | 34,845,524<br>(34,845,524)  | 5.5<br>(5.5)    | —<br>(—)                | 3.2<br>(3.2)      | 1.4<br>(1.4)  | 0.9<br>(0.9)  |
| 金 融 債 証 券                          | 2,200,000<br>(2,200,000)    | 2,197,728<br>(2,197,728)    | 0.3<br>(0.3)    | —<br>(—)                | —<br>(—)          | 0.2<br>(0.2)  | 0.1<br>(0.1)  |
| 普 通 社 債 証 券<br>(含 む 投 資 法 人 債 証 券) | 28,900,000<br>(28,900,000)  | 28,322,084<br>(28,322,084)  | 4.5<br>(4.5)    | —<br>(—)                | 1.9<br>(1.9)      | 2.1<br>(2.1)  | 0.5<br>(0.5)  |
| 合 計                                | 625,542,668<br>(97,130,668) | 634,295,047<br>(97,552,192) | 100.1<br>(15.4) | —<br>(—)                | 63.2<br>(8.1)     | 25.9<br>(5.3) | 11.0<br>(2.0) |

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ( )内は非上場債で内書きです。

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

## (B) 個別銘柄開示

| 銘 柄 名         | 当 期    |           |            | 末          |
|---------------|--------|-----------|------------|------------|
|               | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| <b>国債証券</b>   |        |           |            |            |
| 第437回利付国債(2年) | 0.005  | 2,920,000 | 2,923,942  | 2024/6/1   |
| 第438回利付国債(2年) | 0.005  | 900,000   | 901,269    | 2024/7/1   |
| 第439回利付国債(2年) | 0.005  | 470,000   | 470,714    | 2024/8/1   |
| 第440回利付国債(2年) | 0.005  | 1,930,000 | 1,932,914  | 2024/9/1   |
| 第441回利付国債(2年) | 0.005  | 440,000   | 440,646    | 2024/10/1  |
| 第442回利付国債(2年) | 0.005  | 400,000   | 400,624    | 2024/11/1  |
| 第443回利付国債(2年) | 0.005  | 3,300,000 | 3,305,214  | 2024/12/1  |
| 第444回利付国債(2年) | 0.005  | 1,025,000 | 1,026,547  | 2025/1/1   |
| 第445回利付国債(2年) | 0.005  | 700,000   | 700,994    | 2025/2/1   |
| 第446回利付国債(2年) | 0.005  | 1,160,000 | 1,161,624  | 2025/3/1   |
| 第448回利付国債(2年) | 0.005  | 50,000    | 50,067     | 2025/5/1   |
| 第140回利付国債(5年) | 0.1    | 5,870,000 | 5,883,324  | 2024/6/20  |
| 第141回利付国債(5年) | 0.1    | 8,820,000 | 8,843,637  | 2024/9/20  |
| 第142回利付国債(5年) | 0.1    | 3,910,000 | 3,921,573  | 2024/12/20 |
| 第143回利付国債(5年) | 0.1    | 4,480,000 | 4,494,156  | 2025/3/20  |
| 第144回利付国債(5年) | 0.1    | 5,650,000 | 5,669,153  | 2025/6/20  |
| 第145回利付国債(5年) | 0.1    | 5,120,000 | 5,138,944  | 2025/9/20  |
| 第146回利付国債(5年) | 0.1    | 4,910,000 | 4,929,492  | 2025/12/20 |
| 第147回利付国債(5年) | 0.005  | 4,090,000 | 4,096,298  | 2026/3/20  |

| 銘 柄 名         | 当 期    |           |            | 末          |
|---------------|--------|-----------|------------|------------|
|               | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第148回利付国債(5年) | 0.005  | 6,170,000 | 6,179,440  | 2026/6/20  |
| 第149回利付国債(5年) | 0.005  | 4,820,000 | 4,826,362  | 2026/9/20  |
| 第150回利付国債(5年) | 0.005  | 6,660,000 | 6,665,927  | 2026/12/20 |
| 第151回利付国債(5年) | 0.005  | 4,510,000 | 4,511,713  | 2027/3/20  |
| 第152回利付国債(5年) | 0.1    | 210,000   | 210,837    | 2027/3/20  |
| 第153回利付国債(5年) | 0.005  | 5,160,000 | 5,158,916  | 2027/6/20  |
| 第154回利付国債(5年) | 0.1    | 4,650,000 | 4,663,996  | 2027/9/20  |
| 第155回利付国債(5年) | 0.3    | 980,000   | 990,691    | 2027/12/20 |
| 第156回利付国債(5年) | 0.2    | 3,790,000 | 3,813,232  | 2027/12/20 |
| 第157回利付国債(5年) | 0.2    | 1,460,000 | 1,467,329  | 2028/3/20  |
| 第1回利付国債(40年)  | 2.4    | 400,000   | 504,780    | 2048/3/20  |
| 第2回利付国債(40年)  | 2.2    | 1,130,000 | 1,374,306  | 2049/3/20  |
| 第3回利付国債(40年)  | 2.2    | 650,000   | 789,834    | 2050/3/20  |
| 第4回利付国債(40年)  | 2.2    | 950,000   | 1,155,285  | 2051/3/20  |
| 第5回利付国債(40年)  | 2.0    | 1,070,000 | 1,255,923  | 2052/3/20  |
| 第6回利付国債(40年)  | 1.9    | 1,260,000 | 1,453,624  | 2053/3/20  |
| 第7回利付国債(40年)  | 1.7    | 1,240,000 | 1,370,200  | 2054/3/20  |
| 第8回利付国債(40年)  | 1.4    | 1,490,000 | 1,530,408  | 2055/3/20  |
| 第9回利付国債(40年)  | 0.4    | 2,210,000 | 1,679,202  | 2056/3/20  |
| 第10回利付国債(40年) | 0.9    | 2,040,000 | 1,814,274  | 2057/3/20  |

| 銘柄名            | 期         |              | 末           |            |
|----------------|-----------|--------------|-------------|------------|
|                | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評価額<br>(千円) | 償還年月日      |
| 第11回利付国債(40年)  | 0.8       | 1,525,000    | 1,307,809   | 2058/3/20  |
| 第12回利付国債(40年)  | 0.5       | 1,290,000    | 990,642     | 2059/3/20  |
| 第13回利付国債(40年)  | 0.5       | 2,330,000    | 1,773,246   | 2060/3/20  |
| 第14回利付国債(40年)  | 0.7       | 2,130,000    | 1,729,325   | 2061/3/20  |
| 第15回利付国債(40年)  | 1.0       | 2,850,000    | 2,534,647   | 2062/3/20  |
| 第334回利付国債(10年) | 0.6       | 5,260,000    | 5,299,818   | 2024/6/20  |
| 第335回利付国債(10年) | 0.5       | 3,630,000    | 3,658,785   | 2024/9/20  |
| 第336回利付国債(10年) | 0.5       | 1,210,000    | 1,221,144   | 2024/12/20 |
| 第337回利付国債(10年) | 0.3       | 2,800,000    | 2,817,024   | 2024/12/20 |
| 第338回利付国債(10年) | 0.4       | 4,560,000    | 4,599,124   | 2025/3/20  |
| 第339回利付国債(10年) | 0.4       | 3,970,000    | 4,008,032   | 2025/6/20  |
| 第340回利付国債(10年) | 0.4       | 4,430,000    | 4,477,090   | 2025/9/20  |
| 第341回利付国債(10年) | 0.3       | 5,020,000    | 5,065,631   | 2025/12/20 |
| 第342回利付国債(10年) | 0.1       | 4,760,000    | 4,780,039   | 2026/3/20  |
| 第343回利付国債(10年) | 0.1       | 2,670,000    | 2,681,828   | 2026/6/20  |
| 第344回利付国債(10年) | 0.1       | 5,900,000    | 5,926,373   | 2026/9/20  |
| 第345回利付国債(10年) | 0.1       | 3,380,000    | 3,796,140   | 2026/12/20 |
| 第346回利付国債(10年) | 0.1       | 5,750,000    | 5,772,942   | 2027/3/20  |
| 第347回利付国債(10年) | 0.1       | 3,550,000    | 3,562,957   | 2027/6/20  |
| 第348回利付国債(10年) | 0.1       | 4,260,000    | 4,272,822   | 2027/9/20  |
| 第349回利付国債(10年) | 0.1       | 5,120,000    | 5,129,267   | 2027/12/20 |
| 第350回利付国債(10年) | 0.1       | 6,670,000    | 6,673,134   | 2028/3/20  |
| 第351回利付国債(10年) | 0.1       | 4,835,000    | 4,832,534   | 2028/6/20  |
| 第352回利付国債(10年) | 0.1       | 4,330,000    | 4,324,284   | 2028/9/20  |
| 第353回利付国債(10年) | 0.1       | 4,385,000    | 4,376,493   | 2028/12/20 |
| 第354回利付国債(10年) | 0.1       | 4,720,000    | 4,706,406   | 2029/3/20  |
| 第355回利付国債(10年) | 0.1       | 4,660,000    | 4,643,224   | 2029/6/20  |
| 第356回利付国債(10年) | 0.1       | 4,280,000    | 4,259,926   | 2029/9/20  |
| 第357回利付国債(10年) | 0.1       | 3,330,000    | 3,310,552   | 2029/12/20 |
| 第358回利付国債(10年) | 0.1       | 4,000,000    | 3,970,440   | 2030/3/20  |
| 第359回利付国債(10年) | 0.1       | 3,920,000    | 3,881,897   | 2030/6/20  |
| 第360回利付国債(10年) | 0.1       | 4,840,000    | 4,782,694   | 2030/9/20  |
| 第361回利付国債(10年) | 0.1       | 4,710,000    | 4,643,777   | 2030/12/20 |
| 第362回利付国債(10年) | 0.1       | 4,050,000    | 3,985,159   | 2031/3/20  |
| 第363回利付国債(10年) | 0.1       | 5,650,000    | 5,547,961   | 2031/6/20  |
| 第364回利付国債(10年) | 0.1       | 5,110,000    | 5,008,822   | 2031/9/20  |
| 第365回利付国債(10年) | 0.1       | 6,417,000    | 6,281,023   | 2031/12/20 |
| 第366回利付国債(10年) | 0.2       | 5,370,000    | 5,294,390   | 2032/3/20  |
| 第367回利付国債(10年) | 0.2       | 4,900,000    | 4,822,727   | 2032/6/20  |
| 第368回利付国債(10年) | 0.2       | 4,280,000    | 4,206,940   | 2032/9/20  |
| 第369回利付国債(10年) | 0.5       | 4,660,000    | 4,698,538   | 2032/12/20 |
| 第370回利付国債(10年) | 0.5       | 1,610,000    | 1,619,837   | 2033/3/20  |
| 第1回利付国債(30年)   | 2.8       | 110,000      | 128,099     | 2029/9/20  |
| 第2回利付国債(30年)   | 2.4       | 160,000      | 183,491     | 2030/2/20  |
| 第3回利付国債(30年)   | 2.3       | 120,000      | 137,139     | 2030/5/20  |
| 第4回利付国債(30年)   | 2.9       | 110,000      | 131,298     | 2030/11/20 |
| 第5回利付国債(30年)   | 2.2       | 50,000       | 57,374      | 2031/5/20  |

| 銘柄名           | 期         |              | 末           |            |
|---------------|-----------|--------------|-------------|------------|
|               | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評価額<br>(千円) | 償還年月日      |
| 第6回利付国債(30年)  | 2.4       | 350,000      | 409,909     | 2031/11/20 |
| 第7回利付国債(30年)  | 2.3       | 380,000      | 444,653     | 2032/5/20  |
| 第8回利付国債(30年)  | 1.8       | 850,000      | 959,148     | 2032/11/22 |
| 第9回利付国債(30年)  | 1.4       | 240,000      | 261,974     | 2032/12/20 |
| 第10回利付国債(30年) | 1.1       | 160,000      | 170,084     | 2033/3/20  |
| 第11回利付国債(30年) | 1.7       | 260,000      | 291,551     | 2033/6/20  |
| 第12回利付国債(30年) | 2.1       | 190,000      | 220,886     | 2033/9/20  |
| 第13回利付国債(30年) | 2.0       | 400,000      | 461,564     | 2033/12/20 |
| 第14回利付国債(30年) | 2.4       | 750,000      | 897,922     | 2034/3/20  |
| 第15回利付国債(30年) | 2.5       | 340,000      | 411,464     | 2034/6/20  |
| 第16回利付国債(30年) | 2.5       | 200,000      | 242,556     | 2034/9/20  |
| 第17回利付国債(30年) | 2.4       | 1,130,000    | 1,360,881   | 2034/12/20 |
| 第18回利付国債(30年) | 2.3       | 315,000      | 376,317     | 2035/3/20  |
| 第19回利付国債(30年) | 2.3       | 530,000      | 634,160     | 2035/6/20  |
| 第20回利付国債(30年) | 2.5       | 480,000      | 586,555     | 2035/9/20  |
| 第21回利付国債(30年) | 2.3       | 500,000      | 599,970     | 2035/12/20 |
| 第22回利付国債(30年) | 2.5       | 540,000      | 662,007     | 2036/3/20  |
| 第23回利付国債(30年) | 2.5       | 430,000      | 528,289     | 2036/6/20  |
| 第24回利付国債(30年) | 2.5       | 780,000      | 959,696     | 2036/9/20  |
| 第25回利付国債(30年) | 2.3       | 600,000      | 723,360     | 2036/12/20 |
| 第26回利付国債(30年) | 2.4       | 1,550,000    | 1,891,232   | 2037/3/20  |
| 第27回利付国債(30年) | 2.5       | 1,870,000    | 2,312,311   | 2037/9/20  |
| 第28回利付国債(30年) | 2.5       | 2,040,000    | 2,527,498   | 2038/3/20  |
| 第29回利付国債(30年) | 2.4       | 1,670,000    | 2,049,808   | 2038/9/20  |
| 第30回利付国債(30年) | 2.3       | 2,070,000    | 2,514,491   | 2039/3/20  |
| 第31回利付国債(30年) | 2.2       | 1,100,000    | 1,320,264   | 2039/9/20  |
| 第32回利付国債(30年) | 2.3       | 1,460,000    | 1,775,214   | 2040/3/20  |
| 第33回利付国債(30年) | 2.0       | 2,120,000    | 2,480,378   | 2040/9/20  |
| 第34回利付国債(30年) | 2.2       | 1,665,000    | 2,001,762   | 2041/3/20  |
| 第35回利付国債(30年) | 2.0       | 2,300,000    | 2,693,461   | 2041/9/20  |
| 第36回利付国債(30年) | 2.0       | 2,130,000    | 2,496,786   | 2042/3/20  |
| 第37回利付国債(30年) | 1.9       | 2,255,000    | 2,604,525   | 2042/9/20  |
| 第38回利付国債(30年) | 1.8       | 1,410,000    | 1,601,766   | 2043/3/20  |
| 第39回利付国債(30年) | 1.9       | 1,470,000    | 1,696,688   | 2043/6/20  |
| 第40回利付国債(30年) | 1.8       | 1,280,000    | 1,454,080   | 2043/9/20  |
| 第41回利付国債(30年) | 1.7       | 1,270,000    | 1,419,174   | 2043/12/20 |
| 第42回利付国債(30年) | 1.7       | 1,360,000    | 1,520,017   | 2044/3/20  |
| 第43回利付国債(30年) | 1.7       | 1,240,000    | 1,386,158   | 2044/6/20  |
| 第44回利付国債(30年) | 1.7       | 1,350,000    | 1,508,044   | 2044/9/20  |
| 第45回利付国債(30年) | 1.5       | 1,440,000    | 1,553,904   | 2044/12/20 |
| 第46回利付国債(30年) | 1.5       | 1,750,000    | 1,888,040   | 2045/3/20  |
| 第47回利付国債(30年) | 1.6       | 1,660,000    | 1,821,866   | 2045/6/20  |
| 第48回利付国債(30年) | 1.4       | 1,750,000    | 1,850,660   | 2045/9/20  |
| 第49回利付国債(30年) | 1.4       | 1,740,000    | 1,839,319   | 2045/12/20 |
| 第50回利付国債(30年) | 0.8       | 1,610,000    | 1,506,815   | 2046/3/20  |
| 第51回利付国債(30年) | 0.3       | 1,670,000    | 1,391,009   | 2046/6/20  |
| 第52回利付国債(30年) | 0.5       | 1,580,000    | 1,376,037   | 2046/9/20  |

| 銘柄名           | 期     |           |           | 償還年月日      |
|---------------|-------|-----------|-----------|------------|
|               | 利率(%) | 額面金額(千円)  | 評価額(千円)   |            |
| 第53回利付国債(30年) | 0.6   | 1,460,000 | 1,297,910 | 2046/12/20 |
| 第54回利付国債(30年) | 0.8   | 1,720,000 | 1,597,037 | 2047/3/20  |
| 第55回利付国債(30年) | 0.8   | 1,470,000 | 1,361,499 | 2047/6/20  |
| 第56回利付国債(30年) | 0.8   | 1,500,000 | 1,385,775 | 2047/9/20  |
| 第57回利付国債(30年) | 0.8   | 1,410,000 | 1,299,315 | 2047/12/20 |
| 第58回利付国債(30年) | 0.8   | 2,280,000 | 2,095,639 | 2048/3/20  |
| 第59回利付国債(30年) | 0.7   | 1,370,000 | 1,226,218 | 2048/6/20  |
| 第60回利付国債(30年) | 0.9   | 1,440,000 | 1,346,976 | 2048/9/20  |
| 第61回利付国債(30年) | 0.7   | 1,280,000 | 1,137,024 | 2048/12/20 |
| 第62回利付国債(30年) | 0.5   | 775,000   | 652,046   | 2049/3/20  |
| 第63回利付国債(30年) | 0.4   | 1,500,000 | 1,222,950 | 2049/6/20  |
| 第64回利付国債(30年) | 0.4   | 1,720,000 | 1,397,345 | 2049/9/20  |
| 第65回利付国債(30年) | 0.4   | 1,405,000 | 1,139,595 | 2049/12/20 |
| 第66回利付国債(30年) | 0.4   | 1,290,000 | 1,040,591 | 2050/3/20  |
| 第67回利付国債(30年) | 0.6   | 1,695,000 | 1,438,766 | 2050/6/20  |
| 第68回利付国債(30年) | 0.6   | 1,490,000 | 1,260,718 | 2050/9/20  |
| 第69回利付国債(30年) | 0.7   | 1,420,000 | 1,232,119 | 2050/12/20 |
| 第70回利付国債(30年) | 0.7   | 1,960,000 | 1,697,281 | 2051/3/20  |
| 第71回利付国債(30年) | 0.7   | 1,400,000 | 1,211,112 | 2051/6/20  |
| 第72回利付国債(30年) | 0.7   | 1,130,000 | 976,557   | 2051/9/20  |
| 第73回利付国債(30年) | 0.7   | 1,870,000 | 1,614,464 | 2051/12/20 |
| 第74回利付国債(30年) | 1.0   | 2,040,000 | 1,903,748 | 2052/3/20  |
| 第75回利付国債(30年) | 1.3   | 1,400,000 | 1,407,420 | 2052/6/20  |
| 第76回利付国債(30年) | 1.4   | 1,960,000 | 2,018,721 | 2052/9/20  |
| 第77回利付国債(30年) | 1.6   | 1,510,000 | 1,629,335 | 2052/12/20 |
| 第78回利付国債(30年) | 1.4   | 650,000   | 669,714   | 2053/3/20  |
| 第70回利付国債(20年) | 2.4   | 400,000   | 410,648   | 2024/6/20  |
| 第71回利付国債(20年) | 2.2   | 200,000   | 204,902   | 2024/6/20  |
| 第72回利付国債(20年) | 2.1   | 630,000   | 648,213   | 2024/9/20  |
| 第73回利付国債(20年) | 2.0   | 360,000   | 371,743   | 2024/12/20 |
| 第74回利付国債(20年) | 2.1   | 200,000   | 206,836   | 2024/12/20 |
| 第75回利付国債(20年) | 2.1   | 130,000   | 135,111   | 2025/3/20  |
| 第76回利付国債(20年) | 1.9   | 270,000   | 279,639   | 2025/3/20  |
| 第77回利付国債(20年) | 2.0   | 290,000   | 300,877   | 2025/3/20  |
| 第78回利付国債(20年) | 1.9   | 170,000   | 176,881   | 2025/6/20  |
| 第79回利付国債(20年) | 2.0   | 270,000   | 281,485   | 2025/6/20  |
| 第80回利付国債(20年) | 2.1   | 220,000   | 229,812   | 2025/6/20  |
| 第81回利付国債(20年) | 2.0   | 390,000   | 408,579   | 2025/9/20  |
| 第82回利付国債(20年) | 2.1   | 600,000   | 629,970   | 2025/9/20  |
| 第83回利付国債(20年) | 2.1   | 290,000   | 306,013   | 2025/12/20 |
| 第84回利付国債(20年) | 2.0   | 470,000   | 494,745   | 2025/12/20 |
| 第85回利付国債(20年) | 2.1   | 290,000   | 307,516   | 2026/3/20  |
| 第86回利付国債(20年) | 2.3   | 510,000   | 543,670   | 2026/3/20  |
| 第87回利付国債(20年) | 2.2   | 1,830,000 | 1,945,674 | 2026/3/20  |
| 第88回利付国債(20年) | 2.3   | 420,000   | 450,151   | 2026/6/20  |
| 第89回利付国債(20年) | 2.2   | 350,000   | 374,055   | 2026/6/20  |
| 第90回利付国債(20年) | 2.2   | 630,000   | 676,651   | 2026/9/20  |

| 銘柄名            | 期     |           |           | 償還年月日      |
|----------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                | 利率(%) | 額面金額(千円)  | 評価額(千円)   |            |
| 第91回利付国債(20年)  | 2.3   | 450,000   | 484,812   | 2026/9/20  |
| 第92回利付国債(20年)  | 2.1   | 880,000   | 946,440   | 2026/12/20 |
| 第93回利付国債(20年)  | 2.0   | 410,000   | 441,287   | 2027/3/20  |
| 第94回利付国債(20年)  | 2.1   | 610,000   | 658,873   | 2027/3/20  |
| 第95回利付国債(20年)  | 2.3   | 830,000   | 907,082   | 2027/6/20  |
| 第96回利付国債(20年)  | 2.1   | 1,590,000 | 1,724,768 | 2027/6/20  |
| 第97回利付国債(20年)  | 2.2   | 900,000   | 984,051   | 2027/9/20  |
| 第98回利付国債(20年)  | 2.1   | 440,000   | 479,199   | 2027/9/20  |
| 第99回利付国債(20年)  | 2.1   | 1,510,000 | 1,650,414 | 2027/12/20 |
| 第100回利付国債(20年) | 2.2   | 480,000   | 528,585   | 2028/3/20  |
| 第101回利付国債(20年) | 2.4   | 715,000   | 794,214   | 2028/3/20  |
| 第102回利付国債(20年) | 2.4   | 1,180,000 | 1,316,231 | 2028/6/20  |
| 第103回利付国債(20年) | 2.3   | 400,000   | 444,168   | 2028/6/20  |
| 第104回利付国債(20年) | 2.1   | 160,000   | 176,057   | 2028/6/20  |
| 第105回利付国債(20年) | 2.1   | 1,180,000 | 1,303,262 | 2028/9/20  |
| 第106回利付国債(20年) | 2.2   | 380,000   | 421,701   | 2028/9/20  |
| 第107回利付国債(20年) | 2.1   | 700,000   | 776,104   | 2028/12/20 |
| 第108回利付国債(20年) | 1.9   | 840,000   | 922,051   | 2028/12/20 |
| 第109回利付国債(20年) | 1.9   | 520,000   | 572,535   | 2029/3/20  |
| 第110回利付国債(20年) | 2.1   | 1,100,000 | 1,223,794 | 2029/3/20  |
| 第111回利付国債(20年) | 2.2   | 970,000   | 1,089,368 | 2029/6/20  |
| 第112回利付国債(20年) | 2.1   | 790,000   | 882,469   | 2029/6/20  |
| 第113回利付国債(20年) | 2.1   | 2,020,000 | 2,264,076 | 2029/9/20  |
| 第114回利付国債(20年) | 2.1   | 2,330,000 | 2,619,991 | 2029/12/20 |
| 第115回利付国債(20年) | 2.2   | 700,000   | 791,658   | 2029/12/20 |
| 第116回利付国債(20年) | 2.2   | 1,660,000 | 1,882,904 | 2030/3/20  |
| 第117回利付国債(20年) | 2.1   | 1,080,000 | 1,217,764 | 2030/3/20  |
| 第118回利付国債(20年) | 2.0   | 660,000   | 741,127   | 2030/6/20  |
| 第119回利付国債(20年) | 1.8   | 530,000   | 587,785   | 2030/6/20  |
| 第120回利付国債(20年) | 1.6   | 1,270,000 | 1,390,827 | 2030/6/20  |
| 第121回利付国債(20年) | 1.9   | 1,470,000 | 1,644,106 | 2030/9/20  |
| 第122回利付国債(20年) | 1.8   | 900,000   | 1,000,134 | 2030/9/20  |
| 第123回利付国債(20年) | 2.1   | 1,820,000 | 2,065,954 | 2030/12/20 |
| 第124回利付国債(20年) | 2.0   | 610,000   | 687,915   | 2030/12/20 |
| 第125回利付国債(20年) | 2.2   | 1,230,000 | 1,409,309 | 2031/3/20  |
| 第126回利付国債(20年) | 2.0   | 730,000   | 825,272   | 2031/3/20  |
| 第127回利付国債(20年) | 1.9   | 1,020,000 | 1,145,337 | 2031/3/20  |
| 第128回利付国債(20年) | 1.9   | 970,000   | 1,091,240 | 2031/6/20  |
| 第129回利付国債(20年) | 1.8   | 740,000   | 826,676   | 2031/6/20  |
| 第130回利付国債(20年) | 1.8   | 1,685,000 | 1,886,087 | 2031/9/20  |
| 第131回利付国債(20年) | 1.7   | 700,000   | 777,875   | 2031/9/20  |
| 第132回利付国債(20年) | 1.7   | 660,000   | 734,956   | 2031/12/20 |
| 第133回利付国債(20年) | 1.8   | 850,000   | 953,606   | 2031/12/20 |
| 第134回利付国債(20年) | 1.8   | 840,000   | 944,445   | 2032/3/20  |
| 第135回利付国債(20年) | 1.7   | 630,000   | 702,947   | 2032/3/20  |
| 第136回利付国債(20年) | 1.6   | 1,050,000 | 1,162,612 | 2032/3/20  |
| 第137回利付国債(20年) | 1.7   | 1,000,000 | 1,117,530 | 2032/6/20  |



| 銘柄名            | 期         |              |             | 末          |
|----------------|-----------|--------------|-------------|------------|
|                | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評価額<br>(千円) | 償還年月日      |
| 第138回利付国債(20年) | 1.5       | 680,000      | 747,993     | 2032/6/20  |
| 第139回利付国債(20年) | 1.6       | 830,000      | 920,270     | 2032/6/20  |
| 第140回利付国債(20年) | 1.7       | 2,670,000    | 2,985,540   | 2032/9/20  |
| 第141回利付国債(20年) | 1.7       | 1,600,000    | 1,791,488   | 2032/12/20 |
| 第142回利付国債(20年) | 1.8       | 895,000      | 1,010,356   | 2032/12/20 |
| 第143回利付国債(20年) | 1.6       | 1,880,000    | 2,087,928   | 2033/3/20  |
| 第144回利付国債(20年) | 1.5       | 980,000      | 1,079,166   | 2033/3/20  |
| 第145回利付国債(20年) | 1.7       | 2,675,000    | 2,999,611   | 2033/6/20  |
| 第146回利付国債(20年) | 1.7       | 2,760,000    | 3,098,376   | 2033/9/20  |
| 第147回利付国債(20年) | 1.6       | 2,260,000    | 2,515,628   | 2033/12/20 |
| 第148回利付国債(20年) | 1.5       | 2,130,000    | 2,349,560   | 2034/3/20  |
| 第149回利付国債(20年) | 1.5       | 2,600,000    | 2,867,904   | 2034/6/20  |
| 第150回利付国債(20年) | 1.4       | 2,680,000    | 2,927,203   | 2034/9/20  |
| 第151回利付国債(20年) | 1.2       | 2,375,000    | 2,541,392   | 2034/12/20 |
| 第152回利付国債(20年) | 1.2       | 2,780,000    | 2,973,710   | 2035/3/20  |
| 第153回利付国債(20年) | 1.3       | 2,420,000    | 2,614,882   | 2035/6/20  |
| 第154回利付国債(20年) | 1.2       | 2,775,000    | 2,964,144   | 2035/9/20  |
| 第155回利付国債(20年) | 1.0       | 3,000,000    | 3,130,980   | 2035/12/20 |
| 第156回利付国債(20年) | 0.4       | 2,420,000    | 2,344,302   | 2036/3/20  |
| 第157回利付国債(20年) | 0.2       | 2,930,000    | 2,758,009   | 2036/6/20  |
| 第158回利付国債(20年) | 0.5       | 2,640,000    | 2,577,273   | 2036/9/20  |
| 第159回利付国債(20年) | 0.6       | 2,390,000    | 2,357,472   | 2036/12/20 |
| 第160回利付国債(20年) | 0.7       | 2,010,000    | 2,004,934   | 2037/3/20  |
| 第161回利付国債(20年) | 0.6       | 2,070,000    | 2,033,091   | 2037/6/20  |
| 第162回利付国債(20年) | 0.6       | 1,230,000    | 1,204,600   | 2037/9/20  |
| 第163回利付国債(20年) | 0.6       | 2,190,000    | 2,138,447   | 2037/12/20 |
| 第164回利付国債(20年) | 0.5       | 2,000,000    | 1,920,560   | 2038/3/20  |
| 第165回利付国債(20年) | 0.5       | 2,120,000    | 2,030,430   | 2038/6/20  |
| 第166回利付国債(20年) | 0.7       | 1,750,000    | 1,721,422   | 2038/9/20  |
| 第167回利付国債(20年) | 0.5       | 2,210,000    | 2,103,699   | 2038/12/20 |
| 第168回利付国債(20年) | 0.4       | 1,510,000    | 1,410,400   | 2039/3/20  |
| 第169回利付国債(20年) | 0.3       | 1,990,000    | 1,822,481   | 2039/6/20  |
| 第170回利付国債(20年) | 0.3       | 2,710,000    | 2,471,709   | 2039/9/20  |
| 第171回利付国債(20年) | 0.3       | 1,830,000    | 1,663,360   | 2039/12/20 |
| 第172回利付国債(20年) | 0.4       | 2,280,000    | 2,099,788   | 2040/3/20  |
| 第173回利付国債(20年) | 0.4       | 2,350,000    | 2,157,088   | 2040/6/20  |
| 第174回利付国債(20年) | 0.4       | 2,640,000    | 2,415,177   | 2040/9/20  |
| 第175回利付国債(20年) | 0.5       | 2,030,000    | 1,884,022   | 2040/12/20 |
| 第176回利付国債(20年) | 0.5       | 2,720,000    | 2,516,326   | 2041/3/20  |
| 第177回利付国債(20年) | 0.4       | 2,330,000    | 2,111,306   | 2041/6/20  |
| 第178回利付国債(20年) | 0.5       | 2,120,000    | 1,951,417   | 2041/9/20  |
| 第179回利付国債(20年) | 0.5       | 2,495,000    | 2,290,734   | 2041/12/20 |
| 第180回利付国債(20年) | 0.8       | 2,390,000    | 2,310,675   | 2042/3/20  |
| 第181回利付国債(20年) | 0.9       | 1,690,000    | 1,660,289   | 2042/6/20  |
| 第182回利付国債(20年) | 1.1       | 2,400,000    | 2,436,864   | 2042/9/20  |
| 第183回利付国債(20年) | 1.4       | 2,450,000    | 2,612,435   | 2042/12/20 |

| 銘柄名                        | 期         |              |             | 末          |
|----------------------------|-----------|--------------|-------------|------------|
|                            | 利率<br>(%) | 額面金額<br>(千円) | 評価額<br>(千円) | 償還年月日      |
| 第184回利付国債(20年)             | 1.1       | 970,000      | 981,164     | 2043/3/20  |
| 小計                         |           | 528,412,000  | 536,742,855 |            |
| <b>地方債証券</b>               |           |              |             |            |
| 第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年)) | 0.1       | 100,000      | 99,911      | 2026/12/18 |
| 第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年)) | 0.74      | 100,000      | 84,641      | 2051/9/20  |
| 第6回東京都公募公債(20年)            | 2.0       | 100,000      | 103,506     | 2025/3/19  |
| 第9回東京都公募公債(30年)            | 2.37      | 100,000      | 120,130     | 2039/3/18  |
| 第11回東京都公募公債(30年)           | 2.19      | 100,000      | 117,528     | 2040/9/20  |
| 第13回東京都公募公債(30年)           | 1.93      | 100,000      | 113,760     | 2042/3/19  |
| 第15回東京都公募公債(30年)           | 1.827     | 100,000      | 111,747     | 2044/6/20  |
| 第16回東京都公募公債(20年)           | 2.01      | 200,000      | 218,938     | 2028/12/20 |
| 第17回東京都公募公債(20年)           | 2.09      | 100,000      | 109,907     | 2028/12/20 |
| 第19回東京都公募公債(20年)           | 2.13      | 100,000      | 110,762     | 2029/6/20  |
| 第19回東京都公募公債(30年)           | 0.725     | 100,000      | 84,736      | 2050/9/20  |
| 第26回東京都公募公債(20年)           | 1.74      | 200,000      | 219,492     | 2032/6/18  |
| 第27回東京都公募公債(20年)           | 1.68      | 200,000      | 218,744     | 2032/12/20 |
| 第33回東京都公募公債(5年)            | 0.01      | 200,000      | 199,590     | 2025/12/19 |
| 第751回東京都公募公債               | 0.37      | 100,000      | 100,714     | 2025/12/19 |
| 第765回東京都公募公債               | 0.21      | 100,000      | 100,283     | 2027/3/19  |
| 第770回東京都公募公債               | 0.18      | 100,000      | 100,100     | 2027/6/18  |
| 第781回東京都公募公債               | 0.16      | 300,000      | 298,500     | 2028/6/20  |
| 第800回東京都公募公債               | 0.08      | 200,000      | 196,280     | 2029/12/20 |
| 第830回東京都公募公債               | 0.275     | 300,000      | 290,859     | 2032/6/18  |
| 平成27年度第15回北海道公募公債          | 0.22      | 100,000      | 100,328     | 2026/2/26  |
| 平成28年度第1回北海道公募公債           | 0.085     | 100,000      | 99,947      | 2026/4/28  |
| 平成28年度第14回北海道公募公債          | 0.24      | 100,000      | 100,353     | 2027/2/24  |
| 平成30年度第14回北海道公募公債          | 0.195     | 200,000      | 198,884     | 2028/12/28 |
| 令和4年度第10回北海道公募公債           | 0.554     | 200,000      | 197,716     | 2032/12/27 |
| 第31回1号宮城県公募公債(10年)         | 0.515     | 200,000      | 202,028     | 2025/9/29  |
| 第4回神奈川県公募公債(30年)           | 2.62      | 200,000      | 246,280     | 2038/3/19  |
| 第11回神奈川県公募公債(20年)          | 2.08      | 100,000      | 110,538     | 2029/7/20  |
| 第15回神奈川県公募公債(20年)          | 1.94      | 200,000      | 221,508     | 2030/11/12 |
| 第17回神奈川県公募公債(20年)          | 1.975     | 100,000      | 111,382     | 2031/7/11  |
| 第20回神奈川県公募公債(20年)          | 1.706     | 100,000      | 109,454     | 2032/6/18  |
| 第27回神奈川県公募公債(20年)          | 1.398     | 100,000      | 106,867     | 2034/9/20  |
| 第78回神奈川県公募公債(5年)           | 0.005     | 200,000      | 199,980     | 2024/6/20  |
| 第210回神奈川県公募公債              | 0.451     | 200,000      | 201,268     | 2024/12/20 |
| 第215回神奈川県公募公債              | 0.494     | 100,000      | 100,853     | 2025/6/20  |
| 第218回神奈川県公募公債              | 0.195     | 100,000      | 100,268     | 2025/12/19 |
| 第226回神奈川県公募公債              | 0.195     | 100,000      | 100,227     | 2027/3/19  |
| 第227回神奈川県公募公債              | 0.18      | 100,000      | 100,100     | 2027/6/18  |
| 第243回神奈川県公募公債              | 0.075     | 200,000      | 196,216     | 2029/12/20 |
| 第6回大阪府公募公債(20年)            | 1.98      | 200,000      | 221,694     | 2030/9/13  |
| 第7回大阪府公募公債(20年)            | 1.84      | 200,000      | 220,744     | 2031/9/26  |
| 第10回大阪府公募公債(20年)           | 1.72      | 100,000      | 109,655     | 2032/9/24  |

| 銘柄名                  | 期 末    |           |            | 償還年月日      |
|----------------------|--------|-----------|------------|------------|
|                      | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) |            |
| 第389回大阪府公債(10年)      | 0.53   | 100,000   | 100,691    | 2024/10/30 |
| 第395回大阪府公債(10年)      | 0.435  | 151,000   | 152,038    | 2025/4/28  |
| 第399回大阪府公債(10年)      | 0.529  | 100,000   | 100,997    | 2025/8/28  |
| 第402回大阪府公債(10年)      | 0.493  | 100,000   | 100,992    | 2025/11/27 |
| 第407回大阪府公債(10年)      | 0.09   | 156,000   | 155,940    | 2026/4/27  |
| 第410回大阪府公債(10年)      | 0.001  | 200,000   | 199,312    | 2026/7/28  |
| 第439回大阪府公債(10年)      | 0.193  | 200,000   | 198,864    | 2028/12/27 |
| 第440回大阪府公債(10年)      | 0.2    | 100,000   | 99,425     | 2029/1/30  |
| 第458回大阪府公債(10年)      | 0.1    | 100,000   | 97,604     | 2030/7/30  |
| 第465回大阪府公債(10年)      | 0.12   | 160,000   | 155,353    | 2031/2/25  |
| 第468回大阪府公債(10年)      | 0.129  | 182,000   | 176,328    | 2031/5/28  |
| 第469回大阪府公債(10年)      | 0.128  | 200,000   | 193,464    | 2031/6/27  |
| 平成21年度第3回京都府公債(20年)  | 2.19   | 100,000   | 111,469    | 2029/9/20  |
| 平成23年度第5回京都府公債(20年)  | 1.79   | 100,000   | 110,082    | 2031/10/17 |
| 平成27年度第4回京都府公債       | 0.553  | 100,000   | 100,984    | 2025/6/19  |
| 平成28年度第5回京都府公債(20年)  | 0.327  | 100,000   | 93,444     | 2036/8/15  |
| 平成29年度第5回京都府公債(20年)  | 0.63   | 100,000   | 96,475     | 2037/8/14  |
| 令和2年度第12回京都府公債       | 0.12   | 140,500   | 136,759    | 2030/12/16 |
| 第2回兵庫県公債(20年)        | 2.37   | 100,000   | 109,328    | 2027/9/17  |
| 第3回兵庫県公債(12年)        | 0.56   | 100,000   | 100,920    | 2025/4/16  |
| 第8回兵庫県公債(15年)        | 1.35   | 100,000   | 105,435    | 2028/7/14  |
| 第7回兵庫県公債(15年)        | 1.12   | 100,000   | 104,490    | 2028/12/25 |
| 第8回兵庫県公債(15年)        | 1.09   | 100,000   | 104,446    | 2029/4/16  |
| 第9回兵庫県公債(20年)        | 2.25   | 400,000   | 448,000    | 2029/11/19 |
| 平成26年度第17回兵庫県公債      | 0.46   | 100,000   | 100,688    | 2025/2/26  |
| 第35回兵庫県公債(20年)       | 0.578  | 100,000   | 94,988     | 2038/5/28  |
| 令和元年度第17回兵庫県公債       | 0.15   | 300,000   | 295,314    | 2030/1/28  |
| 第1回静岡県公債(20年)        | 2.18   | 100,000   | 104,841    | 2025/9/19  |
| 第9回静岡県公債(30年)        | 1.539  | 100,000   | 106,004    | 2045/6/20  |
| 第12回静岡県公債(30年)       | 0.822  | 100,000   | 89,615     | 2048/3/19  |
| 第15回静岡県公債(20年)       | 1.701  | 100,000   | 109,578    | 2032/10/15 |
| 第18回静岡県公債(20年)       | 1.473  | 100,000   | 107,638    | 2034/7/10  |
| 平成27年度第3回静岡県公債       | 0.544  | 100,000   | 100,937    | 2025/5/21  |
| 平成29年度第5回静岡県公債       | 0.19   | 100,000   | 100,140    | 2027/6/18  |
| 平成29年度第8回静岡県公債       | 0.21   | 100,000   | 100,221    | 2027/6/18  |
| 平成29年度第11回静岡県公債      | 0.215  | 100,000   | 100,170    | 2027/9/17  |
| 令和2年度第11回静岡県公債       | 0.204  | 310,000   | 303,635    | 2030/12/20 |
| 平成21年度第5回愛知県公債(20年)  | 2.28   | 100,000   | 111,654    | 2029/6/20  |
| 平成27年度第17回愛知県公債(10年) | 0.38   | 100,000   | 100,771    | 2026/1/27  |
| 平成28年度第5回愛知県公債(10年)  | 0.07   | 100,000   | 99,907     | 2026/6/29  |
| 平成29年度第6回愛知県公債(10年)  | 0.22   | 200,000   | 200,430    | 2027/7/28  |
| 平成29年度第12回愛知県公債(20年) | 0.606  | 300,000   | 287,589    | 2037/11/20 |
| 平成30年度第1回愛知県公債(10年)  | 0.185  | 100,000   | 99,747     | 2028/4/27  |
| 平成30年度第6回愛知県公債(30年)  | 0.777  | 100,000   | 88,349     | 2048/6/19  |
| 令和元年度第16回愛知県公債(10年)  | 0.09   | 200,000   | 196,132    | 2030/2/15  |

| 銘柄名                        | 期 末    |           |            | 償還年月日      |
|----------------------------|--------|-----------|------------|------------|
|                            | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) |            |
| 令和2年度第7回愛知県公債(10年)         | 0.145  | 100,000   | 97,984     | 2030/7/31  |
| 令和3年度第6回愛知県公債(30年)         | 0.718  | 200,000   | 168,440    | 2051/6/20  |
| 平成20年度第1回広島県公債(20年)        | 2.34   | 100,000   | 110,853    | 2028/9/21  |
| 平成21年度第1回広島県公債(20年)        | 2.21   | 200,000   | 222,378    | 2029/5/28  |
| 平成27年度第4回広島県公債             | 0.476  | 125,230   | 126,447    | 2025/11/25 |
| 平成29年度第1回広島県公債             | 0.175  | 100,000   | 100,099    | 2027/5/25  |
| 令和2年度第7回広島県公債              | 0.214  | 390,000   | 381,494    | 2031/3/19  |
| 令和4年度第2回広島県公債              | 0.369  | 100,000   | 97,756     | 2032/7/22  |
| 第2回埼玉県公債(10年)              | 0.706  | 100,000   | 100,043    | 2033/5/20  |
| 第3回埼玉県公債(20年)              | 2.42   | 100,000   | 109,126    | 2027/6/18  |
| 第6回埼玉県公債(20年)              | 2.26   | 100,000   | 110,433    | 2028/9/21  |
| 第6回埼玉県公債(30年)              | 0.957  | 100,000   | 93,642     | 2046/12/20 |
| 第7回埼玉県公債(20年)              | 2.29   | 200,000   | 223,448    | 2029/6/22  |
| 第8回埼玉県公債(15年)              | 0.367  | 200,000   | 188,650    | 2036/4/18  |
| 第10回埼玉県公債(20年)             | 1.94   | 200,000   | 221,508    | 2030/11/12 |
| 第18回埼玉県公債(20年)             | 0.323  | 200,000   | 187,342    | 2036/5/20  |
| 平成27年度第7回埼玉県公債             | 0.469  | 100,000   | 100,973    | 2025/12/25 |
| 平成28年度第6回埼玉県公債             | 0.085  | 100,000   | 99,916     | 2026/9/29  |
| 平成28年度第9回埼玉県公債             | 0.249  | 100,000   | 100,424    | 2027/2/24  |
| 平成29年度第4回埼玉県公債             | 0.19   | 100,000   | 100,121    | 2027/6/22  |
| 令和2年度第7回埼玉県公債              | 0.125  | 100,000   | 97,604     | 2030/10/16 |
| 令和2年度第8回埼玉県公債              | 0.12   | 100,000   | 97,337     | 2030/12/17 |
| 令和3年度第8回埼玉県公債              | 0.125  | 150,000   | 144,814    | 2031/10/27 |
| 平成19年度第1回福岡県公債(20年)        | 2.38   | 100,000   | 109,267    | 2027/8/20  |
| 平成20年度第2回福岡県公債(20年)        | 2.05   | 100,000   | 109,688    | 2028/12/20 |
| 平成22年度第1回福岡県公債(15年)        | 1.67   | 100,000   | 103,926    | 2025/11/21 |
| 平成23年度第1回福岡県公債(20年)        | 2.008  | 100,000   | 111,583    | 2031/5/23  |
| 平成23年度第1回福岡県公債(15年)        | 1.491  | 100,000   | 104,758    | 2026/11/27 |
| 平成24年度第1回福岡県公債(30年)        | 2.12   | 100,000   | 116,913    | 2042/9/19  |
| 平成26年度第8回福岡県公債             | 0.441  | 100,000   | 100,624    | 2024/12/25 |
| 平成26年度第4回福岡県公債(20年)        | 1.249  | 100,000   | 105,154    | 2035/2/23  |
| 平成27年度第7回福岡県公債             | 0.464  | 100,000   | 100,960    | 2025/12/25 |
| 平成30年度第1回福岡県公債(30年)        | 0.777  | 100,000   | 88,349     | 2048/6/19  |
| 平成30年度第1回福岡県公債(20年)        | 0.639  | 100,000   | 95,605     | 2038/8/20  |
| 令和2年度第1回福岡県公債              | 0.155  | 300,000   | 294,450    | 2030/6/24  |
| 令和3年度第2回福岡県公債              | 0.155  | 100,000   | 97,193     | 2031/5/30  |
| 令和3年度第1回福岡県公債(15年)         | 0.299  | 100,000   | 93,212     | 2036/7/14  |
| 令和5年度第1回福岡県公債(グリーンボンド・10年) | 0.681  | 100,000   | 99,762     | 2033/5/30  |
| 第5回千葉県公債(20年)              | 2.26   | 200,000   | 220,866    | 2028/9/21  |
| 第6回千葉県公債(20年)              | 2.26   | 100,000   | 111,320    | 2029/4/20  |
| 第13回千葉県公債(20年)             | 1.701  | 100,000   | 109,578    | 2032/10/15 |
| 平成26年度第7回千葉県公債             | 0.429  | 100,000   | 100,651    | 2025/2/25  |
| 平成27年度第1回千葉県公債             | 0.549  | 100,000   | 100,959    | 2025/5/23  |
| 平成28年度第4回千葉県公債             | 0.085  | 100,000   | 99,917     | 2026/9/25  |
| 平成28年度第6回千葉県公債             | 0.18   | 120,000   | 120,218    | 2027/1/25  |
| 令和元年度第7回千葉県公債              | 0.08   | 300,000   | 293,979    | 2030/2/25  |



| 銘柄名                  | 期     |          |         | 末          |
|----------------------|-------|----------|---------|------------|
|                      | 利率(%) | 額面金額(千円) | 評価額(千円) | 償還年月日      |
| 令和2年度第7回千葉県公募債       | 0.15  | 100,000  | 97,869  | 2030/9/25  |
| 令和4年度第6回千葉県公募債       | 0.554 | 130,000  | 128,750 | 2032/12/24 |
| 平成27年度第1回新潟県公募債      | 0.476 | 100,000  | 100,974 | 2025/11/27 |
| 令和3年度第1回長野県公募債(10年)  | 0.19  | 300,000  | 292,731 | 2031/4/16  |
| 令和4年度第1回長野県公募債(10年)  | 0.299 | 300,000  | 292,107 | 2032/4/23  |
| 第1回群馬県公募債(20年)       | 1.841 | 200,000  | 219,980 | 2030/10/18 |
| 平成29年度第1回岐阜県公募債(10年) | 0.205 | 100,000  | 100,065 | 2027/10/29 |
| 第135回共同発行市場公募債地方債    | 0.659 | 100,000  | 100,692 | 2024/6/25  |
| 第136回共同発行市場公募債地方債    | 0.611 | 100,000  | 100,687 | 2024/7/25  |
| 第137回共同発行市場公募債地方債    | 0.566 | 100,000  | 100,676 | 2024/8/23  |
| 第139回共同発行市場公募債地方債    | 0.544 | 100,000  | 100,718 | 2024/10/25 |
| 第140回共同発行市場公募債地方債    | 0.505 | 200,000  | 201,398 | 2024/11/25 |
| 第145回共同発行市場公募債地方債    | 0.406 | 200,000  | 201,296 | 2025/4/25  |
| 第146回共同発行市場公募債地方債    | 0.553 | 200,000  | 201,934 | 2025/5/23  |
| 第148回共同発行市場公募債地方債    | 0.553 | 125,400  | 126,691 | 2025/7/25  |
| 第149回共同発行市場公募債地方債    | 0.5   | 100,000  | 100,951 | 2025/8/25  |
| 第152回共同発行市場公募債地方債    | 0.496 | 100,000  | 101,022 | 2025/11/25 |
| 第156回共同発行市場公募債地方債    | 0.1   | 100,000  | 100,014 | 2026/3/25  |
| 第157回共同発行市場公募債地方債    | 0.08  | 100,000  | 99,961  | 2026/4/24  |
| 第159回共同発行市場公募債地方債    | 0.07  | 200,000  | 199,816 | 2026/6/25  |
| 第160回共同発行市場公募債地方債    | 0.05  | 200,000  | 199,684 | 2026/7/24  |
| 第164回共同発行市場公募債地方債    | 0.06  | 400,000  | 399,416 | 2026/8/25  |
| 第164回共同発行市場公募債地方債    | 0.05  | 100,000  | 99,756  | 2026/11/25 |
| 第166回共同発行市場公募債地方債    | 0.18  | 100,000  | 100,182 | 2027/1/25  |
| 第167回共同発行市場公募債地方債    | 0.245 | 100,000  | 100,409 | 2027/2/25  |
| 第171回共同発行市場公募債地方債    | 0.185 | 200,000  | 200,204 | 2027/6/25  |
| 第174回共同発行市場公募債地方債    | 0.145 | 194,300  | 194,006 | 2027/9/24  |
| 第175回共同発行市場公募債地方債    | 0.215 | 100,000  | 100,131 | 2027/10/25 |
| 第181回共同発行市場公募債地方債    | 0.18  | 300,000  | 299,169 | 2028/4/25  |
| 第219回共同発行市場公募債地方債    | 0.145 | 100,000  | 96,940  | 2031/6/25  |
| 第228回共同発行市場公募債地方債    | 0.199 | 200,000  | 193,350 | 2032/3/25  |
| 第233回共同発行市場公募債地方債    | 0.315 | 200,000  | 194,394 | 2032/8/25  |
| 令和4年度第3回長崎県公募債(10年)  | 0.364 | 100,000  | 97,758  | 2032/6/18  |
| 令和4年度第1回熊本市公募債       | 0.449 | 101,000  | 99,144  | 2032/11/30 |
| 平成29年度第1回静岡市公募債      | 0.22  | 100,000  | 100,111 | 2027/11/24 |
| 平成30年度第1回浜松市公募債      | 0.145 | 100,000  | 99,177  | 2029/1/25  |
| 第13回回大阪市公募債(20年)     | 2.08  | 200,000  | 222,892 | 2030/6/14  |
| 第15回回大阪市公募債(30年)     | 0.704 | 100,000  | 83,861  | 2051/6/20  |
| 第22回回大阪市公募債(20年)     | 0.347 | 300,000  | 281,823 | 2036/5/30  |
| 第24回回大阪市公募債(20年)     | 0.655 | 100,000  | 97,085  | 2037/4/21  |
| 令和3年度第2回大阪市公募債       | 0.16  | 200,000  | 194,482 | 2031/5/21  |
| 第1回名古屋市公募債(12年)      | 1.033 | 100,000  | 101,972 | 2025/6/20  |
| 第1回名古屋市公募債(30年)      | 2.53  | 100,000  | 119,576 | 2035/3/20  |
| 第5回名古屋市公募債(30年)      | 2.49  | 100,000  | 121,958 | 2039/3/18  |
| 第9回名古屋市公募債(20年)      | 2.07  | 100,000  | 109,797 | 2028/12/20 |
| 第11回名古屋市公募債(30年)     | 1.774 | 100,000  | 110,568 | 2044/9/20  |
| 第499回名古屋市公募債(10年)    | 0.225 | 100,000  | 100,323 | 2027/3/26  |

| 銘柄名                   | 期     |            |            | 末          |
|-----------------------|-------|------------|------------|------------|
|                       | 利率(%) | 額面金額(千円)   | 評価額(千円)    | 償還年月日      |
| 第512回名古屋市公募債(10年)     | 0.15  | 300,000    | 294,357    | 2030/6/20  |
| 平成28年度第6回京都市公募債       | 0.18  | 200,000    | 200,364    | 2027/1/27  |
| 平成18年度第3回神戸市公募債(20年)  | 2.54  | 120,000    | 128,924    | 2026/6/19  |
| 平成20年度第1回神戸市公募債(20年)  | 2.38  | 200,000    | 221,072    | 2028/5/26  |
| 平成21年度第11回神戸市公募債(20年) | 2.233 | 100,000    | 112,168    | 2030/1/29  |
| 平成24年度第12回神戸市公募債(20年) | 1.711 | 100,000    | 109,695    | 2032/12/17 |
| 令和2年度第9回神戸市公募債(30年)   | 0.674 | 100,000    | 83,855     | 2050/6/20  |
| 令和3年度第6回神戸市公募債(30年)   | 0.713 | 100,000    | 84,121     | 2051/6/20  |
| 第5回横浜市公募債(20年)        | 2.17  | 100,000    | 104,312    | 2025/6/20  |
| 第20回横浜市公募債(20年)       | 2.1   | 300,000    | 333,036    | 2029/10/19 |
| 平成27年度第3回横浜市公募債       | 0.524 | 100,000    | 100,996    | 2025/8/18  |
| 平成28年度第4回横浜市公募債       | 0.175 | 100,000    | 100,163    | 2027/1/22  |
| 平成29年度第2回横浜市公募債       | 0.24  | 100,000    | 100,313    | 2027/7/16  |
| 平成30年度第1回横浜市公募債       | 0.195 | 100,000    | 99,799     | 2028/4/17  |
| 平成30年度第4回横浜市公募債       | 0.289 | 100,000    | 100,076    | 2028/10/17 |
| 第30回横浜市公募債(20年)       | 1.376 | 200,000    | 213,364    | 2034/10/20 |
| 令和2年度第1回横浜市公募債        | 0.15  | 300,000    | 294,381    | 2030/6/12  |
| 令和3年度第2回横浜市公募債        | 0.16  | 100,000    | 97,239     | 2031/5/23  |
| 平成23年度第9回札幌市公募債(15年)  | 1.493 | 100,000    | 105,012    | 2027/2/12  |
| 平成26年度第9回札幌市公募債(10年)  | 0.43  | 100,000    | 100,601    | 2024/12/20 |
| 第11回川崎市公募債(20年)       | 1.84  | 100,000    | 109,982    | 2030/10/18 |
| 第89回川崎市公募債            | 0.16  | 100,000    | 100,141    | 2026/12/18 |
| 第93回川崎市公募債            | 0.105 | 100,000    | 97,554     | 2030/9/20  |
| 平成26年度第2回北九州市公募債      | 0.451 | 100,000    | 100,622    | 2034/12/24 |
| 平成27年度第2回北九州市公募債      | 0.484 | 100,000    | 100,991    | 2025/12/18 |
| 平成28年度第1回北九州市公募債      | 0.08  | 100,000    | 99,932     | 2026/4/15  |
| 平成21年度第3回福岡市公募債(20年)  | 2.14  | 100,000    | 111,150    | 2029/9/18  |
| 平成25年度第6回福岡市公募債(20年)  | 1.511 | 100,000    | 107,874    | 2034/2/17  |
| 平成26年度第5回福岡市公募債       | 0.539 | 200,000    | 201,430    | 2024/10/28 |
| 平成26年度第2回広島市公募債       | 0.456 | 100,000    | 100,647    | 2024/12/25 |
| 平成28年度第4回広島市公募債       | 0.165 | 105,000    | 105,149    | 2026/12/25 |
| 平成29年度第6回広島市公募債       | 0.23  | 170,000    | 170,049    | 2028/2/25  |
| 令和元年度第6回広島市公募債        | 0.115 | 550,000    | 540,226    | 2030/2/25  |
| 令和2年度第3回広島市公募債(5年)    | 0.02  | 300,000    | 299,565    | 2025/10/24 |
| 令和元年度第5回千葉市公募債        | 0.08  | 200,000    | 195,986    | 2030/2/25  |
| 令和3年度第8回千葉市公募債        | 0.209 | 300,000    | 290,277    | 2032/3/25  |
| 令和4年度第1回千葉市公募債        | 0.274 | 100,000    | 97,159     | 2032/4/22  |
| 平成27年度第1回山梨県公募債(10年)  | 0.495 | 100,000    | 101,003    | 2025/10/30 |
| 平成26年度第1回岡山県公募債(10年)  | 0.33  | 200,000    | 200,934    | 2025/1/30  |
| 平成30年度第3回岡山県公募債(10年)  | 0.15  | 100,000    | 99,111     | 2029/3/29  |
| 第113回福岡北九州高速道路債券      | 2.41  | 100,000    | 109,346    | 2027/12/20 |
| 小計                    |       | 31,680,430 | 32,186,855 |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>    |       |            |            |            |
| 第40回政府保証日本政策金融公庫債券    | 0.02  | 126,000    | 125,841    | 2026/3/13  |
| 第46回政府保証日本政策金融公庫債券    | 0.16  | 100,000    | 100,109    | 2027/7/20  |

| 当                          |        | 期 末       |            |            |
|----------------------------|--------|-----------|------------|------------|
| 銘 柄 名                      | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第47回政府保証日本政策金融公庫債券         | 0.09   | 210,000   | 209,458    | 2027/9/24  |
| 第53回政府保証日本政策金融公庫債券         | 0.209  | 187,000   | 186,801    | 2028/9/15  |
| 第54回政府保証日本政策金融公庫債券         | 0.001  | 220,000   | 219,975    | 2024/10/24 |
| 第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債     | 0.085  | 100,000   | 99,982     | 2026/12/14 |
| 第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債     | 0.001  | 100,000   | 99,968     | 2025/1/24  |
| 第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.4    | 100,000   | 123,788    | 2049/6/30  |
| 第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.1    | 200,000   | 222,382    | 2029/9/28  |
| 第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.2    | 200,000   | 223,972    | 2029/11/30 |
| 第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.2    | 100,000   | 118,165    | 2040/5/31  |
| 第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 2.1    | 100,000   | 112,348    | 2030/12/27 |
| 第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.8    | 100,000   | 110,742    | 2031/12/26 |
| 第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.56   | 100,000   | 108,752    | 2032/8/31  |
| 第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.641  | 100,000   | 109,502    | 2032/9/30  |
| 第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.66   | 100,000   | 109,704    | 2032/12/28 |
| 第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.779  | 100,000   | 110,999    | 2033/7/29  |
| 第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.475  | 200,000   | 216,708    | 2034/3/31  |
| 第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.644  | 100,000   | 100,692    | 2024/6/28  |
| 第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.601  | 100,000   | 100,696    | 2024/7/31  |
| 第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.427  | 100,000   | 107,869    | 2034/7/31  |
| 第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.396  | 200,000   | 214,958    | 2034/9/29  |
| 第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.539  | 100,000   | 100,756    | 2024/10/31 |
| 第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.466  | 259,000   | 260,846    | 2024/12/27 |
| 第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.32   | 300,000   | 301,506    | 2025/1/31  |
| 第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.16   | 100,000   | 104,879    | 2035/2/28  |
| 第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 1.216  | 200,000   | 210,930    | 2035/3/30  |
| 第243回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.391  | 100,000   | 100,683    | 2025/4/30  |
| 第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.484  | 112,000   | 113,003    | 2025/6/30  |
| 第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.32   | 200,000   | 201,360    | 2026/1/30  |

| 当                          |        | 期 末       |            |            |
|----------------------------|--------|-----------|------------|------------|
| 銘 柄 名                      | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.145  | 100,000   | 100,219    | 2026/2/27  |
| 第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.394  | 100,000   | 83,732     | 2046/5/31  |
| 第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.005  | 107,000   | 106,681    | 2026/11/30 |
| 第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.115  | 205,000   | 205,110    | 2027/1/29  |
| 第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.145  | 100,000   | 100,133    | 2027/3/31  |
| 第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.14   | 200,000   | 200,194    | 2027/4/30  |
| 第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.155  | 100,000   | 100,058    | 2027/8/31  |
| 第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.195  | 120,000   | 120,006    | 2028/2/29  |
| 第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.145  | 200,000   | 199,316    | 2028/5/31  |
| 第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.625  | 300,000   | 287,901    | 2038/9/30  |
| 第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.219  | 214,000   | 213,815    | 2028/10/31 |
| 第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.005  | 100,000   | 98,353     | 2029/6/29  |
| 第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.001  | 100,000   | 98,052     | 2029/10/31 |
| 第403回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 0.001  | 120,000   | 117,278    | 2030/3/29  |
| 第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)   | 0.001  | 600,000   | 599,934    | 2024/8/28  |
| 第72回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.509  | 419,000   | 422,896    | 2025/5/23  |
| 第79回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.379  | 100,000   | 100,808    | 2025/12/12 |
| 第81回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.145  | 100,000   | 100,217    | 2026/2/16  |
| 第82回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.02   | 100,000   | 99,874     | 2026/3/13  |
| 第91回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.085  | 100,000   | 99,982     | 2026/12/14 |
| 第95回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.14   | 251,000   | 251,240    | 2027/4/16  |
| 第98回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.16   | 100,000   | 100,108    | 2027/7/16  |
| 第99回政府保証地方公共団体金融機構債券       | 0.155  | 100,000   | 100,054    | 2027/8/13  |
| 第105回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.195  | 110,000   | 110,034    | 2028/2/15  |
| 第111回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.209  | 156,000   | 155,875    | 2028/8/15  |
| 第113回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.219  | 100,000   | 99,917     | 2028/10/16 |
| 第120回政府保証地方公共団体金融機構債券      | 0.001  | 100,000   | 98,289     | 2029/7/13  |
| 第78回株式会社日本政策投資銀行無担保社債      | 0.225  | 100,000   | 100,115    | 2027/4/13  |
| 第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債     | 0.892  | 100,000   | 70,689     | 2070/7/16  |
| 第148回株式会社日本政策投資銀行無担保社債     | 0.001  | 500,000   | 499,500    | 2024/12/20 |
| 第20回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 2.28   | 100,000   | 108,056    | 2027/4/20  |
| 第21回道路債券                   | 2.75   | 100,000   | 119,492    | 2033/6/20  |
| 第28回道路債券                   | 2.83   | 200,000   | 241,556    | 2033/12/20 |
| 第33回道路債券                   | 2.91   | 200,000   | 244,016    | 2034/6/20  |
| 第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券      | 2.39   | 100,000   | 109,942    | 2028/3/17  |

| 銘柄名                   | 期      |           | 末        |            |
|-----------------------|--------|-----------|----------|------------|
|                       | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評価額 (千円) | 償還年月日      |
| 第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.84   | 100,000   | 128,477  | 2048/3/20  |
| 第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.42   | 100,000   | 110,485  | 2028/6/20  |
| 第3回道路債券               | 2.26   | 100,000   | 102,897  | 2024/9/20  |
| 第4回道路債券               | 2.22   | 200,000   | 207,698  | 2025/3/21  |
| 第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 2.41   | 100,000   | 111,735  | 2029/4/20  |
| 第9回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.773  | 100,000   | 110,249  | 2032/9/17  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.445  | 100,000   | 106,988  | 2034/6/20  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 0.529  | 100,000   | 100,530  | 2024/6/20  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 0.476  | 100,000   | 100,641  | 2024/12/20 |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.974  | 100,000   | 110,311  | 2055/3/19  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.243  | 200,000   | 209,276  | 2035/6/20  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 0.614  | 600,000   | 573,870  | 2037/9/18  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 1.183  | 100,000   | 89,522   | 2058/3/19  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 0.3    | 100,000   | 100,465  | 2027/2/26  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 0.201  | 200,000   | 200,006  | 2027/5/26  |
| 第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 0.934  | 100,000   | 99,139   | 2038/5/26  |
| 第2回回営企業債券(30年)        | 2.39   | 300,000   | 349,020  | 2033/12/20 |
| 第3回地方公共団体金融機構債券(15年)  | 1.176  | 100,000   | 104,600  | 2029/1/26  |
| 第5回回営企業債券(30年)        | 2.72   | 300,000   | 361,116  | 2034/9/22  |
| 第7回回営企業債券(30年)        | 2.67   | 200,000   | 241,020  | 2035/6/20  |
| 第8回回営企業債券(30年)        | 2.5    | 100,000   | 118,732  | 2035/9/21  |
| 第8回地方公共団体金融機構債券(20年)  | 2.043  | 200,000   | 221,810  | 2030/6/28  |
| 第10回地方公共団体金融機構債券(20年) | 1.752  | 200,000   | 217,906  | 2030/8/28  |
| 第11回地方公共団体金融機構債券(30年) | 0.633  | 200,000   | 162,514  | 2050/8/26  |
| 第18回回営企業債券(20年)       | 2.58   | 100,000   | 107,493  | 2026/6/19  |
| 第19回地方公共団体金融機構債券(20年) | 1.84   | 200,000   | 220,778  | 2031/12/26 |
| 第24回地方公共団体金融機構債券(20年) | 1.702  | 100,000   | 109,747  | 2032/9/28  |
| 第34回地方公共団体金融機構債券(20年) | 1.624  | 500,000   | 544,775  | 2034/1/27  |
| 第65回地方公共団体金融機構債券      | 0.535  | 300,000   | 302,064  | 2024/10/28 |
| 第67回地方公共団体金融機構債券      | 0.501  | 100,000   | 100,697  | 2024/12/27 |
| 第69回地方公共団体金融機構債券      | 0.478  | 100,000   | 100,713  | 2025/2/28  |
| 第76回地方公共団体金融機構債券      | 0.505  | 200,000   | 201,928  | 2025/9/26  |
| F77回地方公共団体金融機構債券      | 1.519  | 200,000   | 209,352  | 2026/10/20 |
| 第83回地方公共団体金融機構債券      | 0.09   | 200,000   | 199,866  | 2026/4/28  |
| 第88回地方公共団体金融機構債券      | 0.075  | 100,000   | 99,800   | 2026/9/28  |
| F95回地方公共団体金融機構債券      | 1.336  | 100,000   | 102,149  | 2025/2/6   |
| F107回地方公共団体金融機構債券     | 1.388  | 100,000   | 102,374  | 2025/3/19  |
| 第116回地方公共団体金融機構債券     | 0.155  | 100,000   | 98,902   | 2029/1/26  |
| 第119回地方公共団体金融機構債券     | 0.125  | 100,000   | 98,581   | 2029/4/27  |

| 銘柄名                    | 期      |           | 末        |            |
|------------------------|--------|-----------|----------|------------|
|                        | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評価額 (千円) | 償還年月日      |
| F129回地方公共団体金融機構債券      | 1.07   | 700,000   | 714,847  | 2025/7/29  |
| F132回地方公共団体金融機構債券      | 1.09   | 100,000   | 102,167  | 2025/7/30  |
| F146回地方公共団体金融機構債券      | 1.134  | 200,000   | 205,034  | 2025/10/28 |
| F202回地方公共団体金融機構債券      | 0.929  | 200,000   | 204,990  | 2026/6/26  |
| F206回地方公共団体金融機構債券      | 1.065  | 100,000   | 103,702  | 2028/1/28  |
| F208回地方公共団体金融機構債券      | 0.857  | 100,000   | 102,029  | 2026/2/4   |
| F214回地方公共団体金融機構債券      | 0.94   | 100,000   | 102,894  | 2027/4/28  |
| F226回地方公共団体金融機構債券      | 1.096  | 100,000   | 104,183  | 2029/2/28  |
| F441回地方公共団体金融機構債券      | 0.227  | 100,000   | 99,921   | 2027/10/25 |
| 第29回首都高速道路株式会社債        | 0.125  | 100,000   | 99,717   | 2026/12/18 |
| 第7回阪神高速道路債券            | 2.18   | 100,000   | 103,758  | 2025/3/21  |
| 第27回阪神高速道路株式会社債        | 0.27   | 100,000   | 100,207  | 2027/3/19  |
| 第28回阪神高速道路株式会社債        | 0.305  | 100,000   | 100,395  | 2026/6/19  |
| 第19回水資源債券(サステナビリティボンド) | 0.001  | 200,000   | 199,800  | 2024/12/20 |
| 第4回株式会社日本政策金融公庫社債      | 2.2    | 100,000   | 110,982  | 2029/9/20  |
| 第18回株式会社日本政策金融公庫社債     | 2.157  | 100,000   | 112,241  | 2031/5/9   |
| 第89回株式会社日本政策金融公庫社債     | 0.03   | 100,000   | 99,918   | 2025/3/12  |
| 第117回都市再生債券            | 0.804  | 200,000   | 204,014  | 2030/11/20 |
| 第159回都市再生債券            | 0.43   | 200,000   | 137,610  | 2059/3/19  |
| 第161回都市再生債券            | 0.687  | 100,000   | 75,853   | 2059/3/19  |
| 第171回都市再生債券            | 0.886  | 200,000   | 160,532  | 2061/3/18  |
| 第5回本州四国連絡橋債券           | 2.23   | 100,000   | 103,338  | 2024/12/20 |
| 第62回独立行政法人福祉医療機構債券     | 0.18   | 100,000   | 97,989   | 2030/6/20  |
| 第2回貸付債担保T種住宅金融支援機構債券   | 0.18   | 109,170   | 108,624  | 2032/5/10  |
| 第3回一般担保住宅金融支援機構債券      | 2.26   | 100,000   | 107,820  | 2027/3/19  |
| 第3回貸付債担保T種住宅金融支援機構債券   | 0.16   | 75,022    | 74,948   | 2033/1/10  |
| 第4回一般担保住宅金融公庫債券        | 2.41   | 100,000   | 107,860  | 2026/12/18 |
| 第4回貸付債担保S種住宅金融支援機構債券   | 2.03   | 10,254    | 10,313   | 2038/5/10  |
| 第4回貸付債担保T種住宅金融支援機構債券   | 0.08   | 129,975   | 128,959  | 2033/4/10  |
| 第6回貸付債担保S種住宅金融支援機構債券   | 1.94   | 10,068    | 10,123   | 2038/11/10 |
| 第6回貸付債担保T種住宅金融支援機構債券   | 0.06   | 149,760   | 148,311  | 2034/2/10  |
| 第7回貸付債担保T種住宅金融支援機構債券   | 0.14   | 53,648    | 53,226   | 2034/2/10  |
| 第8回貸付債担保S種住宅金融支援機構債券   | 2.09   | 10,632    | 10,747   | 2039/5/10  |
| 第8回貸付債担保T種住宅金融支援機構債券   | 0.13   | 187,212   | 186,206  | 2034/6/10  |
| 第9回貸付債担保T種住宅金融支援機構債券   | 0.13   | 128,642   | 127,672  | 2034/8/10  |
| 第10回貸付債担保S種住宅金融支援機構債券  | 2.09   | 10,722    | 10,863   | 2039/11/10 |
| 第12回一般担保住宅金融支援機構債券     | 2.29   | 100,000   | 109,150  | 2027/12/20 |
| 第23回貸付債担保住宅金融支援機構債券    | 2.25   | 14,289    | 14,922   | 2044/4/10  |
| 第24回貸付債担保住宅金融支援機構債券    | 2.34   | 14,091    | 14,693   | 2044/5/10  |
| 第25回貸付債担保住宅金融支援機構債券    | 2.28   | 16,075    | 16,901   | 2044/6/10  |
| 第28回貸付債担保住宅金融支援機構債券    | 1.98   | 18,166    | 19,103   | 2044/9/10  |
| 第30回貸付債担保住宅金融支援機構債券    | 1.97   | 19,307    | 20,360   | 2044/11/10 |
| 第31回貸付債担保住宅金融支援機構債券    | 1.89   | 19,876    | 20,924   | 2044/12/10 |
| 第34回貸付債担保住宅金融支援機構債券    | 1.86   | 40,878    | 42,969   | 2045/3/10  |

| 当                    |        | 期 末       |            |            |
|----------------------|--------|-----------|------------|------------|
| 銘 柄 名                | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第3回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.81   | 18,640    | 19,493     | 2045/5/10  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.79   | 18,982    | 19,802     | 2046/2/10  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.85   | 18,639    | 19,455     | 2046/3/10  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.89   | 17,596    | 18,348     | 2046/5/10  |
| 第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券    | 2.27   | 10,434    | 10,579     | 2041/12/10 |
| 第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.67   | 37,262    | 38,706     | 2046/7/10  |
| 第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.64   | 19,560    | 20,329     | 2046/8/10  |
| 第5回貸付債権担保住宅金融公庫債券    | 2.09   | 10,077    | 10,133     | 2042/4/10  |
| 第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.41   | 26,221    | 27,222     | 2046/12/10 |
| 第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.42   | 24,886    | 25,834     | 2047/1/10  |
| 第5回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.44   | 25,068    | 26,040     | 2047/2/10  |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.34   | 54,138    | 56,091     | 2047/5/10  |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.12   | 66,848    | 68,743     | 2047/11/10 |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.09   | 34,688    | 35,621     | 2047/12/10 |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.26   | 35,524    | 36,770     | 2048/1/10  |
| 第6回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.28   | 36,193    | 37,501     | 2048/2/10  |
| 第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.25   | 31,475    | 32,548     | 2048/3/10  |
| 第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.08   | 30,543    | 31,356     | 2048/5/10  |
| 第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.3    | 35,997    | 37,334     | 2048/6/10  |
| 第7回一般担保住宅金融支援機構債券    | 2.066  | 150,000   | 167,517    | 2031/6/13  |
| 第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.08   | 94,254    | 96,763     | 2048/11/10 |
| 第7回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.07   | 126,676   | 130,002    | 2048/12/10 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.01   | 37,001    | 37,849     | 2049/5/10  |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 1.02   | 38,441    | 39,331     | 2049/6/10  |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.96   | 39,110    | 39,890     | 2049/8/10  |
| 第8回一般担保住宅金融支援機構債券    | 1.863  | 100,000   | 110,458    | 2031/11/18 |
| 第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.95   | 123,444   | 125,794    | 2049/10/10 |
| 第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.87   | 42,212    | 42,843     | 2049/11/10 |
| 第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.74   | 89,614    | 90,248     | 2050/1/10  |
| 第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.8    | 50,138    | 50,612     | 2050/3/10  |
| 第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.74   | 53,860    | 54,156     | 2050/5/10  |
| 第9回一般担保住宅金融支援機構債券    | 1.583  | 300,000   | 315,906    | 2027/3/19  |
| 第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.83   | 53,051    | 53,608     | 2050/6/10  |
| 第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.9    | 165,153   | 167,430    | 2050/7/10  |
| 第9回貸付債権担保住宅金融支援機構債券  | 0.88   | 111,452   | 112,805    | 2050/8/10  |
| 第10回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.84   | 54,194    | 54,763     | 2050/9/10  |
| 第10回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.85   | 58,477    | 59,054     | 2051/1/10  |
| 第10回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.34   | 64,820    | 63,449     | 2051/5/10  |
| 第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.37   | 70,480    | 69,103     | 2051/10/10 |
| 第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.34   | 70,000    | 68,450     | 2051/11/10 |
| 第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.41   | 70,322    | 69,027     | 2051/12/10 |
| 第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.48   | 70,872    | 69,856     | 2052/1/10  |
| 第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46   | 71,211    | 70,056     | 2052/2/10  |
| 第11回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.44   | 73,144    | 71,764     | 2052/7/10  |
| 第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46   | 73,405    | 72,083     | 2052/8/10  |

| 当                    |        | 期 末       |            |            |
|----------------------|--------|-----------|------------|------------|
| 銘 柄 名                | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42   | 73,239    | 71,715     | 2052/9/10  |
| 第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42   | 73,252    | 71,726     | 2052/10/10 |
| 第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.43   | 73,979    | 72,449     | 2052/11/10 |
| 第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4    | 150,590   | 147,108    | 2052/12/10 |
| 第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42   | 74,080    | 72,506     | 2053/1/10  |
| 第12回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.46   | 151,610   | 148,664    | 2053/2/10  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42   | 75,463    | 73,805     | 2053/3/10  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4    | 151,146   | 147,627    | 2053/4/10  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.42   | 76,277    | 74,595     | 2053/6/10  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.39   | 154,058   | 150,263    | 2053/7/10  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.39   | 155,208   | 151,329    | 2053/8/10  |
| 第13回一般担保住宅金融支援機構債券   | 2.105  | 100,000   | 114,880    | 2043/3/20  |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.47   | 78,202    | 76,652     | 2053/10/10 |
| 第13回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.5    | 77,642    | 76,272     | 2053/11/10 |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.38   | 77,975    | 75,922     | 2054/1/10  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.32   | 160,970   | 155,918    | 2054/3/10  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.31   | 80,769    | 78,130     | 2054/4/10  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.33   | 79,802    | 77,314     | 2054/5/10  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.31   | 161,956   | 156,554    | 2054/6/10  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.21   | 82,534    | 79,165     | 2054/7/10  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.15   | 249,069   | 237,611    | 2054/9/10  |
| 第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.15   | 167,512   | 159,724    | 2054/10/10 |
| 第15回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.34   | 85,327    | 82,449     | 2055/2/10  |
| 第15回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3    | 86,188    | 83,018     | 2055/3/10  |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.37   | 177,182   | 171,356    | 2055/9/10  |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.35   | 89,397    | 86,299     | 2055/11/10 |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.35   | 179,332   | 173,046    | 2055/12/10 |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.33   | 181,208   | 174,481    | 2056/1/10  |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.36   | 89,924    | 86,816     | 2056/2/10  |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.41   | 180,842   | 175,275    | 2056/3/10  |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.4    | 181,658   | 175,814    | 2056/5/10  |
| 第16回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.39   | 91,903    | 88,835     | 2056/6/10  |
| 第17回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.31   | 93,201    | 89,431     | 2056/8/10  |
| 第17回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.31   | 279,090   | 267,758    | 2056/9/10  |
| 第17回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.33   | 93,432    | 89,727     | 2056/10/10 |
| 第17回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.48   | 94,681    | 92,055     | 2057/3/10  |
| 第18回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.5    | 96,266    | 93,658     | 2057/6/10  |
| 第18回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.53   | 97,030    | 94,539     | 2057/8/10  |
| 第18回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.5    | 194,906   | 189,417    | 2057/9/10  |
| 第18回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.76   | 98,459    | 97,767     | 2057/12/10 |
| 第18回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.02   | 197,134   | 200,077    | 2058/1/10  |
| 第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.95   | 99,856    | 100,694    | 2058/4/10  |
| 第19回一般担保住宅金融支援機構債券   | 0.18   | 100,000   | 91,425     | 2036/7/18  |
| 第19回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.96   | 100,000   | 100,898    | 2058/6/10  |
| 第32回一般担保住宅金融支援機構債券   | 0.753  | 100,000   | 82,499     | 2051/3/20  |



| 当 期                    |        | 末          |            |            |
|------------------------|--------|------------|------------|------------|
| 銘 柄 名                  | 利率 (%) | 額面金額 (千円)  | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第6回沖縄振興開発金融公庫債券        | 2.04   | 100,000    | 103,980    | 2025/6/20  |
| 第24回沖縄振興開発金融公庫債券       | 0.09   | 600,000    | 600,354    | 2024/6/20  |
| 第21回国際協力機構債券           | 1.734  | 100,000    | 109,947    | 2033/9/20  |
| 第64回東日本高速道路株式会社債       | 0.14   | 100,000    | 98,039     | 2029/11/29 |
| 第67回東日本高速道路株式会社債       | 0.22   | 200,000    | 196,886    | 2030/1/31  |
| 第73回東日本高速道路株式会社債       | 0.21   | 500,000    | 489,850    | 2030/7/17  |
| 第86回東日本高速道路株式会社債       | 0.04   | 100,000    | 99,417     | 2026/12/18 |
| 第102回東日本高速道路株式会社債      | 0.121  | 500,000    | 500,055    | 2025/4/28  |
| 第85回中日本高速道路株式会社債       | 0.07   | 200,000    | 199,688    | 2025/10/21 |
| 第98回中日本高速道路株式会社債       | 0.514  | 200,000    | 201,822    | 2028/2/21  |
| 第100回中日本高速道路株式会社債      | 0.385  | 100,000    | 100,277    | 2028/5/18  |
| 第27回西日本高速道路株式会社債       | 0.58   | 200,000    | 202,030    | 2025/9/2   |
| 第54回西日本高速道路株式会社債       | 0.07   | 600,000    | 599,208    | 2025/6/20  |
| 第70回西日本高速道路株式会社債       | 0.08   | 300,000    | 300,042    | 2024/10/15 |
| 第71回西日本高速道路株式会社債       | 0.315  | 100,000    | 100,169    | 2027/9/17  |
| 第74回西日本高速道路株式会社債       | 0.499  | 200,000    | 201,790    | 2027/12/20 |
| 第77回西日本高速道路株式会社債       | 0.39   | 200,000    | 200,062    | 2028/5/25  |
| 第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券  | 0.06   | 100,000    | 99,727     | 2026/8/19  |
| 第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 | 0.292  | 200,000    | 190,284    | 2034/5/30  |
| 小 計                    |        | 34,350,238 | 34,845,524 |            |
| <b>金融債券</b>            |        |            |            |            |
| い第829号商工債              | 0.13   | 200,000    | 200,054    | 2024/6/27  |
| い第832号商工債              | 0.06   | 200,000    | 199,824    | 2024/9/27  |
| い第833号商工債              | 0.05   | 100,000    | 99,889     | 2024/10/25 |
| い第843号商工債              | 0.12   | 200,000    | 199,754    | 2025/8/27  |
| い第847号商工債              | 0.1    | 100,000    | 99,756     | 2025/12/26 |
| い第850号商工債              | 0.1    | 200,000    | 199,326    | 2026/3/27  |
| い第876号商工債              | 0.45   | 200,000    | 200,256    | 2028/5/26  |
| 第360回信金中金債(5年)         | 0.01   | 200,000    | 199,800    | 2024/11/27 |
| 第376回信金中金債(5年)         | 0.05   | 100,000    | 99,747     | 2026/3/27  |
| 第379回信金中金債(5年)         | 0.04   | 100,000    | 99,663     | 2026/6/26  |
| 第385回信金中金債(5年)         | 0.04   | 400,000    | 398,080    | 2026/12/25 |
| 第16号商工債(10年)           | 0.45   | 100,000    | 100,662    | 2025/12/19 |
| 第2回信金中金債(10年)          | 0.52   | 100,000    | 100,917    | 2025/9/26  |
| 小 計                    |        | 2,200,000  | 2,197,728  |            |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b> |        |            |            |            |
| 第511回中部電力株式会社社債        | 0.21   | 100,000    | 99,625     | 2026/7/24  |
| 第519回中部電力株式会社社債        | 0.84   | 100,000    | 94,327     | 2037/1/23  |
| 第540回中部電力株式会社社債        | 0.53   | 100,000    | 86,137     | 2040/2/24  |
| 第508回関西電力株式会社社債        | 0.455  | 100,000    | 100,076    | 2027/4/23  |
| 第510回関西電力株式会社社債        | 0.49   | 200,000    | 200,298    | 2027/7/23  |
| 第511回関西電力株式会社社債        | 0.41   | 100,000    | 99,746     | 2027/9/17  |
| 第524回関西電力株式会社社債        | 0.514  | 100,000    | 99,498     | 2028/10/25 |
| 第536回関西電力株式会社社債        | 0.44   | 100,000    | 97,082     | 2030/12/20 |
| 第538回関西電力株式会社社債        | 0.39   | 100,000    | 96,551     | 2031/1/24  |

| 当 期                          |        | 末         |            |            |
|------------------------------|--------|-----------|------------|------------|
| 銘 柄 名                        | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第550回関西電力株式会社社債              | 0.39   | 100,000   | 99,803     | 2027/5/25  |
| 第554回関西電力株式会社社債              | 0.41   | 100,000   | 100,178    | 2025/10/24 |
| 第398回中国電力株式会社社債              | 0.425  | 100,000   | 100,007    | 2027/7/23  |
| 第400回中国電力株式会社社債              | 0.34   | 100,000   | 99,575     | 2027/9/24  |
| 第416回中国電力株式会社社債              | 0.355  | 200,000   | 196,594    | 2029/5/25  |
| 第425回中国電力株式会社社債              | 0.37   | 100,000   | 97,221     | 2030/6/25  |
| 第448回中国電力株式会社社債              | 0.92   | 300,000   | 299,409    | 2033/5/25  |
| 第307回北陸電力株式会社社債              | 1.055  | 100,000   | 102,221    | 2026/6/25  |
| 第322回北陸電力株式会社社債              | 0.38   | 100,000   | 99,920     | 2027/6/25  |
| 第330回北陸電力株式会社社債              | 0.34   | 200,000   | 196,932    | 2029/5/25  |
| 第496回東北電力株式会社社債              | 0.355  | 100,000   | 99,597     | 2027/9/24  |
| 第508回東北電力株式会社社債              | 0.465  | 100,000   | 99,002     | 2029/4/25  |
| 第521回東北電力株式会社社債              | 0.45   | 200,000   | 195,584    | 2030/5/24  |
| 第527回東北電力株式会社社債              | 0.32   | 100,000   | 96,009     | 2031/2/25  |
| 第535回東北電力株式会社社債              | 0.2    | 100,000   | 98,148     | 2028/7/25  |
| 第309回四国電力株式会社社債              | 0.4    | 100,000   | 97,655     | 2030/5/24  |
| 第314回四国電力株式会社社債              | 0.29   | 100,000   | 95,738     | 2031/5/23  |
| 第449回九州電力株式会社社債              | 0.43   | 200,000   | 200,114    | 2027/4/23  |
| 第465回九州電力株式会社社債              | 0.38   | 100,000   | 98,975     | 2028/7/25  |
| 第468回九州電力株式会社社債              | 0.435  | 100,000   | 99,215     | 2028/8/25  |
| 第484回九州電力株式会社社債              | 0.375  | 200,000   | 195,598    | 2029/11/22 |
| 第489回九州電力株式会社社債              | 0.44   | 100,000   | 97,661     | 2030/5/24  |
| 第494回九州電力株式会社社債              | 0.31   | 100,000   | 95,601     | 2031/5/23  |
| 第516回九州電力株式会社社債              | 0.92   | 200,000   | 199,606    | 2033/5/25  |
| 第340回北海道電力株式会社社債             | 0.48   | 100,000   | 100,172    | 2027/4/23  |
| 第350回北海道電力株式会社社債             | 0.754  | 100,000   | 91,442     | 2038/3/25  |
| 第385回北海道電力株式会社社債             | 1.03   | 100,000   | 99,668     | 2033/5/25  |
| 第52回成田国際空港株式会社社債             | 0.281  | 100,000   | 100,285    | 2025/1/31  |
| 第39回大成建設株式会社無担保社債            | 0.37   | 100,000   | 98,181     | 2030/6/14  |
| 第24回清水建設株式会社無担保社債            | 0.365  | 100,000   | 99,669     | 2027/11/30 |
| 第32回清水建設株式会社無担保社債            | 0.55   | 100,000   | 100,394    | 2028/2/24  |
| 第11回西松建設株式会社無担保社債            | 0.42   | 100,000   | 99,933     | 2027/3/1   |
| 第8回戸田建設株式会社無担保社債             | 0.14   | 100,000   | 99,437     | 2026/6/3   |
| 第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債         | 0.08   | 300,000   | 298,620    | 2026/6/3   |
| 第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債         | 0.28   | 100,000   | 96,646     | 2031/6/3   |
| 第29回大和ハウス工業株式会社無担保社債         | 0.21   | 100,000   | 100,019    | 2025/10/27 |
| 第2回DM三井製糖ホールディングス株式会社無担保社債   | 0.33   | 100,000   | 100,044    | 2025/12/5  |
| 第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債       | 0.22   | 100,000   | 100,160    | 2024/9/13  |
| 第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債 | 0.23   | 100,000   | 100,139    | 2024/6/13  |
| 第19回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債 | 0.28   | 100,000   | 100,129    | 2026/3/6   |
| 第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債     | 0.603  | 100,000   | 100,747    | 2025/2/28  |
| 第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債     | 0.09   | 200,000   | 198,694    | 2026/6/3   |

| 銘柄名                          | 当 期    |           | 末          |            |
|------------------------------|--------|-----------|------------|------------|
|                              | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第8回サントリーホールディングス株式会社無担保社債    | 0.18   | 300,000   | 299,814    | 2025/6/6   |
| 第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債   | 0.8    | 100,000   | 99,708     | 2033/5/25  |
| 第24回株式会社ニチレイ無担保社債            | 0.25   | 100,000   | 100,008    | 2025/8/29  |
| 第6回ヒューリック株式会社無担保社債           | 0.494  | 100,000   | 99,337     | 2028/10/20 |
| 第11回ヒューリック株式会社無担保社債          | 0.32   | 100,000   | 100,047    | 2026/4/13  |
| 第10回J. フロント リテリング株式会社無担保社債   | 0.47   | 100,000   | 99,200     | 2028/5/26  |
| 第25回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債   | 0.6    | 100,000   | 98,825     | 2030/4/22  |
| 第27回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債   | 0.32   | 100,000   | 100,210    | 2026/2/27  |
| 第28回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債   | 0.694  | 100,000   | 100,784    | 2028/3/1   |
| 第14回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債 | 0.19   | 200,000   | 199,682    | 2025/12/19 |
| 第13回旭化成株式会社無担保社債             | 0.12   | 100,000   | 99,786     | 2025/6/19  |
| 第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債      | 0.45   | 100,000   | 99,726     | 2028/11/29 |
| 第25回トクヤマ株式会社無担保社債            | 0.37   | 100,000   | 99,748     | 2027/3/1   |
| 第13回イビデン株式会社無担保社債            | 0.29   | 200,000   | 199,924    | 2025/9/12  |
| 第4回エー・ウォーター株式会社無担保社債         | 0.405  | 100,000   | 98,952     | 2028/8/31  |
| 第56回三井化学株式会社無担保社債            | 0.3    | 100,000   | 100,033    | 2026/2/27  |
| 第13回J S R株式会社無担保社債           | 0.619  | 100,000   | 97,402     | 2032/9/1   |
| 第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債  | 0.37   | 100,000   | 99,167     | 2028/2/25  |
| 第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債  | 0.23   | 200,000   | 198,612    | 2027/2/26  |
| 第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債  | 0.19   | 200,000   | 199,754    | 2025/6/11  |
| 第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債  | 0.09   | 100,000   | 99,317     | 2026/6/3   |
| 第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債  | 0.74   | 100,000   | 86,290     | 2041/6/3   |
| 第4回株式会社野村総合研究所無担保社債          | 0.34   | 100,000   | 99,223     | 2028/3/23  |
| 第4回株式会社電通グループ無担保社債           | 0.22   | 100,000   | 100,008    | 2025/7/8   |
| 第6回株式会社電通無担保社債               | 0.49   | 200,000   | 197,490    | 2030/7/8   |
| 第16回武田薬品工業株式会社無担保社債          | 0.4    | 300,000   | 285,858    | 2031/10/14 |
| 第1回アステラス製薬株式会社無担保社債          | 0.26   | 100,000   | 100,094    | 2025/12/5  |
| 第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債       | 0.26   | 100,000   | 99,978     | 2026/3/6   |
| 第13回ヤフー株式会社無担保社債             | 0.46   | 100,000   | 96,285     | 2029/7/31  |
| 第10回株式会社資生堂無担保社債             | 0.08   | 100,000   | 99,833     | 2025/2/26  |
| 第7回東燃ゼネラル石油株式会社無担保社債         | 0.925  | 100,000   | 101,048    | 2024/10/23 |
| 第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債    | 0.834  | 100,000   | 97,178     | 2032/6/15  |
| 第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債      | 0.82   | 100,000   | 100,679    | 2024/6/4   |
| 第11回株式会社ブリヂストン無担保社債          | 0.295  | 100,000   | 99,792     | 2027/4/21  |
| 第13回株式会社ブリヂストン無担保社債          | 0.23   | 100,000   | 99,933     | 2026/4/17  |

| 銘柄名                                | 当 期    |           | 末          |            |
|------------------------------------|--------|-----------|------------|------------|
|                                    | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評 価 額 (千円) | 償還年月日      |
| 第14回株式会社ブリヂストン無担保社債                | 0.375  | 100,000   | 99,132     | 2029/4/19  |
| 第11回住友理工株式会社無担保社債                  | 0.78   | 100,000   | 97,158     | 2032/9/1   |
| 第2回日本製鉄株式会社無担保社債                   | 0.24   | 100,000   | 99,882     | 2026/6/19  |
| 第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債         | 0.25   | 300,000   | 300,150    | 2025/7/14  |
| 第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債                 | 0.425  | 100,000   | 99,897     | 2027/9/1   |
| 第34回住友金属山形株式会社無担保社債                | 0.315  | 100,000   | 99,699     | 2027/10/14 |
| 第14回株式会社L I X I L無担保社債             | 0.475  | 100,000   | 99,897     | 2027/8/27  |
| 第17回株式会社クボタ無担保社債                   | 0.95   | 100,000   | 100,300    | 2033/4/20  |
| 第8回株式会社タダノ無担保社債                    | 0.28   | 100,000   | 99,649     | 2025/7/17  |
| 第17回株式会社日立製作所無担保社債                 | 1.371  | 100,000   | 104,862    | 2028/12/13 |
| 第20回株式会社日立製作所無担保社債                 | 0.29   | 100,000   | 97,849     | 2030/3/12  |
| 第1回株式会社安川電機無担保社債                   | 0.13   | 100,000   | 99,576     | 2026/5/20  |
| 第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債              | 0.23   | 100,000   | 99,881     | 2025/7/16  |
| 第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債              | 0.45   | 100,000   | 97,769     | 2030/7/16  |
| 第17回パナソニック株式会社無担保社債                | 0.47   | 200,000   | 200,716    | 2026/9/18  |
| 第21回パナソニック株式会社無担保社債                | 0.19   | 100,000   | 99,726     | 2025/12/24 |
| 第23回パナソニック株式会社無担保社債                | 0.39   | 100,000   | 95,932     | 2030/12/24 |
| 第37回ソニーグループ株式会社無担保社債               | 0.28   | 200,000   | 200,200    | 2025/12/8  |
| 第18回株式会社デンソー無担保社債                  | 0.315  | 100,000   | 99,694     | 2028/3/17  |
| 第29回三菱重工業株式会社無担保社債                 | 0.662  | 100,000   | 100,634    | 2024/9/3   |
| 第35回三菱重工業株式会社無担保社債                 | 0.33   | 100,000   | 99,702     | 2027/8/27  |
| 第22回J A 三井株式会社無担保社債                | 0.45   | 100,000   | 99,605     | 2027/9/1   |
| 第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債                | 0.14   | 100,000   | 99,686     | 2026/2/4   |
| 第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債                | 0.219  | 200,000   | 194,836    | 2031/3/18  |
| 第4回豊田合成株式会社無担保社債                   | 0.24   | 100,000   | 99,954     | 2025/3/13  |
| 第1回オリックス銀行株式会社無担保社債                | 0.16   | 100,000   | 99,495     | 2026/3/11  |
| 第6回日本印刷株式会社無担保社債                   | 0.58   | 100,000   | 99,407     | 2040/3/9   |
| 第108回丸紅株式会社無担保社債                   | 0.38   | 100,000   | 99,759     | 2027/7/12  |
| 第70回三井物産株式会社無担保社債                  | 2.021  | 100,000   | 110,121    | 2033/3/4   |
| 第73回三井物産株式会社無担保社債                  | 0.29   | 200,000   | 196,628    | 2029/7/11  |
| 第53回住友商事株式会社無担保社債                  | 0.33   | 100,000   | 99,572     | 2027/7/26  |
| 第56回住友商事株式会社無担保社債                  | 0.435  | 100,000   | 99,327     | 2028/9/14  |
| 第60回住友商事株式会社無担保社債                  | 0.574  | 100,000   | 96,614     | 2032/5/24  |
| 第3回岩谷産業株式会社無担保社債                   | 0.714  | 100,000   | 100,037    | 2029/9/7   |
| 第22回三菱UF J フィナンシャル・グループ無担保社債 (劣後特) | 0.61   | 100,000   | 97,375     | 2029/12/12 |
| 第24回株式会社りそなホールディングス無担保社債           | 0.4    | 100,000   | 99,688     | 2027/9/2   |
| 第23回株式会社三菱東京UF J 銀行無担保社債 (劣後特約付)   | 2.91   | 100,000   | 111,798    | 2029/10/16 |
| 第88回株式会社三菱東京UF J 銀行無担保社債           | 2.34   | 100,000   | 107,705    | 2027/4/20  |
| 第1回三井住友FG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)    | 0.849  | 100,000   | 100,221    | 2024/9/12  |
| 第11回株式会社セブン銀行無担保社債                 | 0.536  | 100,000   | 100,569    | 2024/12/20 |
| 第1回みずほFG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)     | 0.95   | 300,000   | 300,822    | 2024/7/16  |

| 当                           |        | 期         |          | 末          |  |
|-----------------------------|--------|-----------|----------|------------|--|
| 銘柄名                         | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評価額 (千円) | 償還年月日      |  |
| 第9回みずほリース株式会社無担保社債          | 0.23   | 100,000   | 97,984   | 2028/9/1   |  |
| 第16回N T Tファイナンス株式会社無担保社債    | 0.18   | 200,000   | 199,758  | 2025/12/19 |  |
| 第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債    | 0.38   | 200,000   | 196,566  | 2030/9/20  |  |
| 第34回東京センチュリー株式会社無担保社債       | 0.22   | 100,000   | 97,613   | 2028/7/21  |  |
| 第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債      | 0.19   | 100,000   | 99,760   | 2026/6/19  |  |
| 第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債      | 0.25   | 200,000   | 200,016  | 2025/9/19  |  |
| 第78回株式会社ホンダファイナンス無担保社債      | 0.3    | 100,000   | 100,108  | 2025/12/19 |  |
| 第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債      | 0.11   | 100,000   | 99,892   | 2025/10/21 |  |
| 第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債      | 0.21   | 100,000   | 100,035  | 2025/10/21 |  |
| 第41回リコーリース株式会社無担保社債         | 0.14   | 100,000   | 99,306   | 2026/4/17  |  |
| 第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債 | 0.27   | 100,000   | 99,526   | 2025/6/24  |  |
| 第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債 | 0.34   | 100,000   | 99,269   | 2026/7/31  |  |
| 第32回株式会社ジャックス無担保社債          | 0.23   | 100,000   | 99,198   | 2026/6/8   |  |
| 第35回株式会社ジャックス無担保社債          | 0.25   | 100,000   | 99,023   | 2026/12/9  |  |
| 第38回株式会社ジャックス無担保社債          | 0.824  | 100,000   | 100,732  | 2028/3/1   |  |
| 第56回日立キャピタル株式会社無担保社債        | 0.963  | 100,000   | 101,753  | 2026/9/18  |  |
| 第80回日立キャピタル株式会社無担保社債        | 0.28   | 100,000   | 96,848   | 2029/10/19 |  |
| 第212回オリックス株式会社無担保社債         | 0.654  | 100,000   | 100,390  | 2028/3/8   |  |
| 第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債       | 0.375  | 200,000   | 198,512  | 2027/7/13  |  |
| 第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債       | 0.455  | 100,000   | 99,210   | 2028/1/18  |  |
| 第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債       | 0.474  | 100,000   | 98,770   | 2028/10/18 |  |
| 第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債     | 0.41   | 100,000   | 99,112   | 2027/8/27  |  |
| 第39回株式会社大和証券グループ本社無担保社債     | 0.794  | 100,000   | 100,431  | 2028/2/24  |  |
| 第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債      | 0.28   | 100,000   | 98,752   | 2026/9/4   |  |
| 第4回野村ホールディングス株式会社無担保社債      | 0.6    | 300,000   | 299,889  | 2025/9/5   |  |
| 第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債      | 0.75   | 200,000   | 199,466  | 2027/9/3   |  |
| 第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債      | 0.19   | 200,000   | 199,032  | 2026/11/13 |  |
| 第66回三井不動産株式会社無担保社債          | 0.28   | 200,000   | 199,956  | 2026/3/13  |  |
| 第120回三菱地所株式会社無担保社債          | 0.24   | 200,000   | 199,164  | 2027/6/18  |  |
| 第131回三菱地所株式会社無担保社債          | 0.59   | 100,000   | 89,013   | 2039/8/5   |  |
| 第135回三菱地所株式会社無担保社債          | 0.26   | 100,000   | 95,743   | 2031/6/20  |  |
| 第100回住友不動産株式会社無担保社債         | 0.809  | 100,000   | 100,823  | 2024/9/9   |  |
| 第109回住友不動産株式会社無担保社債         | 0.31   | 100,000   | 96,393   | 2031/5/9   |  |
| 第105回東武鉄道株式会社無担保社債          | 1.081  | 100,000   | 101,979  | 2026/6/17  |  |
| 第132回東武鉄道株式会社無担保社債          | 0.624  | 100,000   | 95,671   | 2032/6/2   |  |

| 当                         |        | 期         |          | 末          |  |
|---------------------------|--------|-----------|----------|------------|--|
| 銘柄名                       | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評価額 (千円) | 償還年月日      |  |
| 第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債       | 0.951  | 100,000   | 86,817   | 2046/9/26  |  |
| 第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債       | 0.73   | 100,000   | 89,615   | 2040/6/11  |  |
| 第63回小田急電鉄株式会社無担保社債        | 0.905  | 100,000   | 101,673  | 2025/12/12 |  |
| 第84回小田急電鉄株式会社無担保社債        | 0.608  | 100,000   | 89,434   | 2039/6/20  |  |
| 第86回小田急電鉄株式会社無担保社債        | 0.858  | 100,000   | 81,762   | 2049/12/3  |  |
| 第42回京王電鉄株式会社無担保社債         | 0.73   | 100,000   | 90,435   | 2040/5/25  |  |
| 第51回京成電鉄株式会社無担保社債         | 0.395  | 100,000   | 99,074   | 2028/9/7   |  |
| 第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債    | 2.46   | 100,000   | 107,160  | 2026/9/18  |  |
| 第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債    | 2.376  | 200,000   | 220,692  | 2028/12/12 |  |
| 第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 0.06   | 100,000   | 99,294   | 2026/7/28  |  |
| 第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 1.133  | 100,000   | 91,058   | 2047/7/26  |  |
| 第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 1.246  | 100,000   | 85,748   | 2058/9/27  |  |
| 第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 0.265  | 100,000   | 97,639   | 2030/4/22  |  |
| 第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 0.836  | 100,000   | 81,185   | 2050/12/16 |  |
| 第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 0.596  | 100,000   | 88,429   | 2041/4/15  |  |
| 第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 1.002  | 100,000   | 77,573   | 2061/7/15  |  |
| 第184回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債   | 0.21   | 300,000   | 299,820  | 2025/10/14 |  |
| 第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債      | 2.427  | 100,000   | 109,547  | 2028/3/17  |  |
| 第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債      | 1.024  | 100,000   | 80,909   | 2056/12/13 |  |
| 第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債      | 1.042  | 100,000   | 89,145   | 2047/8/30  |  |
| 第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債      | 0.13   | 500,000   | 499,115  | 2025/5/21  |  |
| 第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債      | 0.582  | 100,000   | 88,219   | 2041/4/22  |  |
| 第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債     | 2.375  | 100,000   | 116,496  | 2039/12/16 |  |
| 第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債     | 1.917  | 100,000   | 107,474  | 2044/10/28 |  |
| 第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債     | 1.362  | 100,000   | 104,159  | 2034/11/28 |  |
| 第31回東京地下鉄株式会社社債           | 1.22   | 100,000   | 85,466   | 2058/5/24  |  |
| 第37回東京地下鉄株式会社社債           | 0.772  | 100,000   | 73,183   | 2059/6/27  |  |
| 第40回東京地下鉄株式会社社債           | 0.937  | 100,000   | 66,364   | 2070/1/31  |  |
| 第54回東京地下鉄株式会社社債           | 1.055  | 100,000   | 78,973   | 2061/10/14 |  |
| 第56回東京地下鉄株式会社社債           | 1.066  | 100,000   | 86,497   | 2052/2/28  |  |
| 第53回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債 | 0.878  | 200,000   | 163,686  | 2049/11/19 |  |
| 第25回KDDI株式会社無担保社債         | 0.395  | 100,000   | 99,116   | 2028/11/22 |  |
| 第30回KDDI株式会社無担保社債         | 0.21   | 100,000   | 100,007  | 2025/10/27 |  |
| 第11回ソフトバンク株式会社無担保社債       | 0.3    | 400,000   | 397,404  | 2026/6/3   |  |
| 第31回株式会社光通信無担保社債          | 1.38   | 200,000   | 174,740  | 2036/2/1   |  |
| 第33回株式会社光通信無担保社債          | 0.85   | 100,000   | 91,652   | 2031/6/16  |  |
| 第36回株式会社光通信無担保社債          | 0.8    | 100,000   | 90,738   | 2031/11/4  |  |
| 第44回電源開発株式会社無担保社債         | 0.688  | 100,000   | 92,519   | 2036/10/20 |  |

| 銘柄名                   | 期      |           | 末        |           |
|-----------------------|--------|-----------|----------|-----------|
|                       | 利率 (%) | 額面金額 (千円) | 評価額 (千円) | 償還年月日     |
| 第50回電源開発株式会社無担保社債     | 0.415  | 100,000   | 99,940   | 2027/7/20 |
| 第57回電源開発株式会社無担保社債     | 0.355  | 100,000   | 98,898   | 2028/7/20 |
| 第77回電源開発株式会社無担保社債     | 0.4    | 100,000   | 99,943   | 2027/5/20 |
| 第84回電源開発株式会社無担保社債     | 0.754  | 100,000   | 101,149  | 2028/2/18 |
| 第86回電源開発株式会社無担保社債     | 0.93   | 100,000   | 99,756   | 2033/5/20 |
| 第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 0.98   | 200,000   | 199,964  | 2029/10/9 |
| 第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 1.08   | 100,000   | 99,768   | 2030/7/16 |
| 第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 0.64   | 300,000   | 299,694  | 2026/10/8 |
| 第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 1.13   | 100,000   | 98,429   | 2032/10/8 |
| 第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 0.4    | 100,000   | 99,307   | 2026/4/22 |
| 第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 0.8    | 100,000   | 97,026   | 2031/4/22 |
| 第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 0.88   | 300,000   | 274,053  | 2036/8/29 |
| 第9回株式会社JERA無担保社債      | 0.664  | 100,000   | 95,773   | 2032/5/25 |
| 第64回東京瓦斯株式会社無担保社債     | 0.805  | 100,000   | 81,114   | 2050/9/9  |
| 第65回東京瓦斯株式会社無担保社債     | 0.225  | 200,000   | 193,744  | 2030/9/10 |
| 第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債     | 0.22   | 200,000   | 191,688  | 2031/6/3  |
| 第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債     | 0.576  | 100,000   | 87,700   | 2041/6/3  |

| 銘柄名                           | 期      |             | 末           |            |
|-------------------------------|--------|-------------|-------------|------------|
|                               | 利率 (%) | 額面金額 (千円)   | 評価額 (千円)    | 償還年月日      |
| 第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債       | 0.405  | 200,000     | 199,898     | 2028/6/6   |
| 第24回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債 | 0.384  | 100,000     | 99,715      | 2024/10/11 |
| 第29回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債 | 0.25   | 300,000     | 299,013     | 2024/10/10 |
| 第2回B・P・C・E・S・A円貨社債 (ソーシャルボンド) | 0.367  | 100,000     | 99,777      | 2024/6/28  |
| 第8回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債   | 0.499  | 100,000     | 99,760      | 2024/12/12 |
| 第14回ビー・ビー・シー・イー・エス・エー円貨社債     | 0.45   | 100,000     | 99,066      | 2026/6/17  |
| 第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債      | 0.343  | 100,000     | 99,768      | 2024/6/7   |
| 第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債       | 0.463  | 400,000     | 397,300     | 2024/12/5  |
| 小計                            |        | 28,900,000  | 28,322,084  |            |
| 合計                            |        | 625,542,668 | 634,295,047 |            |

## 投資信託財産の構成

| 項目                      | 当 期 末             |           |
|-------------------------|-------------------|-----------|
|                         | 評価額               | 比率        |
| 公 社 債                   | 千円<br>634,295,047 | %<br>99.5 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 3,106,508         | 0.5       |
| 投 資 信 託 財 産 総 額         | 637,401,555       | 100.0     |



## 資産、負債、元本および基準価額の状況ならびに損益の状況

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

| 項 目                | 当 期 末<br>2023年5月29日現在 |
|--------------------|-----------------------|
| (A) 資 産            | 637,501,602,404円      |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等    | 1,126,725,634         |
| 公 社 債(評価額)         | 634,295,047,386       |
| 未 収 入 金            | 695,528,600           |
| 未 収 利 息            | 1,250,407,829         |
| 前 払 費 用            | 33,845,955            |
| 差 入 委 託 証 拠 金      | 100,047,000           |
| (B) 負 債            | 3,578,154,776         |
| 未 払 金              | 3,294,223,440         |
| 未 払 解 約 金          | 183,882,056           |
| 未 払 利 息            | 2,280                 |
| 差入委託証拠金代用有価証券      | 100,047,000           |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 633,923,447,628       |
| 元 本                | 464,214,231,123       |
| 次 期 繰 越 損 益 金      | 169,709,216,505       |
| (D) 受 益 権 総 口 数    | 464,214,231,123口      |
| 1万口当たり基準価額(C/D)    | 13,656円               |

## ■損益の状況

| 項 目                   | 当 期<br>自 2022年5月31日<br>至 2023年5月29日 |
|-----------------------|-------------------------------------|
| (A) 配 当 等 収 益         | 4,483,465,045円                      |
| 受 取 利 息               | 4,483,886,484                       |
| 支 払 利 息               | △421,439                            |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益   | △12,703,394,939                     |
| 売 買 益                 | 560,863,563                         |
| 売 買 損                 | △13,264,258,502                     |
| (C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益 | △4,851,180                          |
| 取 引 益                 | 9,422,940                           |
| 取 引 損                 | △14,274,120                         |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C)  | △8,224,781,074                      |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金     | 173,377,533,182                     |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金   | 14,329,655,100                      |
| (G) 解 約 差 損 益 金       | △9,773,190,703                      |
| (H) 計 (D+E+F+G)       | 169,709,216,505                     |
| 次 期 繰 越 損 益 金(H)      | 169,709,216,505                     |

(注1) (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。

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

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

## 〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は451,551,932,225円、期中追加設定元本額は40,001,268,645円、期中一部解約元本額は27,338,969,747円です。

※担保に供している資産

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

国債証券 100,047,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

|                                   |                 |
|-----------------------------------|-----------------|
| DC日本債券インデックス・オープンS                | 91,618,304,544円 |
| FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用) | 86,680,340,620円 |
| DC日本債券インデックス・オープンP                | 65,041,475,347円 |
| DCマイセクション50                       | 31,245,100,628円 |
| DCマイセクション25                       | 26,813,604,729円 |
| 分散投資コア戦略ファンドS                     | 25,039,704,682円 |
| SMT 国内債券インデックス・オープン               | 20,172,273,724円 |
| 分散投資コア戦略ファンドA                     | 19,006,137,381円 |
| 日本債券ファンド・シリーズ1                    | 17,026,998,996円 |
| DCマイセクションS50                      | 16,141,285,246円 |
| DCマイセクションS25                      | 14,442,060,155円 |
| DCマイセクション75                       | 9,375,423,679円  |
| グローバル・バランスファンド・シリーズ1              | 5,557,283,556円  |
| 世界経済インデックスファンド                    | 5,455,300,580円  |

|                                |                |
|--------------------------------|----------------|
| DC世界経済インデックスファンド               | 4,317,324,991円 |
| SBI資産設計オープン(資産成長型)             | 4,283,893,634円 |
| DCマイセレクションS75                  | 3,832,750,226円 |
| バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)        | 2,962,832,993円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2035           | 2,485,040,072円 |
| バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)        | 2,369,074,030円 |
| DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)       | 1,715,034,237円 |
| バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)        | 1,325,451,136円 |
| バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)        | 1,017,697,602円 |
| DCターゲット・イヤー ファンド2045           | 961,541,681円   |
| バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)        | 895,224,574円   |
| バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)      | 698,564,072円   |
| DCターゲット・イヤー ファンド2025           | 584,133,383円   |
| ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)   | 432,344,335円   |
| DC日本債券インデックス・オープン              | 428,590,555円   |
| My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)       | 298,525,845円   |
| 10資産分散投資ファンド                   | 289,286,501円   |
| DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)       | 252,536,572円   |
| グローバル経済コア                      | 229,604,054円   |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)    | 145,034,138円   |
| 国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)         | 116,715,081円   |
| バランス50VA1(適格機関投資家専用)           | 102,948,955円   |
| 世界経済インデックスファンド(株式シフト型)         | 98,406,174円    |
| SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)    | 91,081,627円    |
| SMT インデックスバランス・オープン            | 74,131,089円    |
| バランス30VA1(適格機関投資家専用)           | 65,519,349円    |
| 世界バランスVA1(適格機関投資家専用)           | 63,615,683円    |
| 世界バランスVA2(適格機関投資家専用)           | 51,466,375円    |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2030 | 47,581,344円    |
| SMT 世界経済インデックス・オープン            | 42,447,603円    |
| 世界経済インデックスファンド(債券シフト型)         | 42,240,553円    |
| FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)    | 40,114,168円    |
| SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)       | 38,308,628円    |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2040 | 28,880,498円    |
| バランス25VA2(適格機関投資家専用)           | 26,835,372円    |
| DCターゲット・イヤー ファンド2055           | 25,241,690円    |
| バランス50VA2(適格機関投資家専用)           | 22,160,040円    |
| マイセレクション50VA1(適格機関投資家専用)       | 18,217,001円    |
| SBI資産設計オープン(分配型)               | 15,553,705円    |
| 私営世界経済バシンプファンド(適格機関投資家専用)      | 15,369,963円    |
| SMT 8資産インデックスバランス・オープン         | 14,457,341円    |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2050 | 10,358,741円    |
| DCターゲット・イヤーファンド(6資産・運用継続型)2060 | 9,288,617円     |
| マイセレクション75VA1(適格機関投資家専用)       | 7,961,710円     |
| エマージング株式オープン                   | 2,227,240円     |
| 国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)         | 2,220,294円     |
| 国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)         | 1,103,784円     |

## お知らせ

該当事項はありません。