

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1月15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専用ファンドとして、長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。	
主要運用対象	DC日本債券インデックスファンドL	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	日本債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	DC日本債券インデックスファンドL	外貨建資産への投資は行いません。株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限定することとし、実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	日本債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものと及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、)を行使したものに限定することとし、取得時において信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	年1回、毎決算時に原則として収益分配を行う方針です。分配対象額は、経費控除後の利子等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の合計額とします。分配金額については、委託会社が基準価額水準、市場動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益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 インデックスファンドL

運用報告書(全体版)

第21期(決算日 2023年10月24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1万円当たりで表記しています。
- ・原則として、数量、額面、金額の表記未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しています。
- ・一印は、組入、異動等の該当がないことを示します。
- ・指数に関する著作権等の知的財産権およびその他の一切の権利は指数の開発元もしくは公表元に帰属します。

最近5期の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)			ベンチマーク		債組比	券入率	債先比	券物率	純資産額 総
	円	円	%	円	%					
第17期(2019年10月24日)	12,921	0	3.4	392.564	3.6	99.7	0.0	—	—	53,443
第18期(2020年10月26日)	12,718	0	△1.6	386.827	△1.5	99.7	0.1	—	—	57,770
第19期(2021年10月25日)	12,682	0	△0.3	386.200	△0.2	99.7	—	—	—	58,459
第20期(2022年10月24日)	12,098	0	△4.6	368.854	△4.5	99.7	—	—	—	58,255
第21期(2023年10月24日)	11,847	0	△2.1	361.661	△2.0	99.7	—	—	—	57,740

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物比率
	円	%	円	%		
(当期首) 2022年10月24日	12,098	—	368.854	—	99.7	—
10月末	12,241	1.2	373.249	1.2	99.7	0.0
11月末	12,180	0.7	371.326	0.7	99.7	—
12月末	12,019	△0.7	366.595	△0.6	99.7	—
2023年1月末	11,986	△0.9	365.595	△0.9	99.8	—
2月末	12,117	0.2	369.572	0.2	99.8	0.0
3月末	12,282	1.5	374.743	1.6	99.8	—
4月末	12,313	1.8	375.608	1.8	99.8	—
5月末	12,301	1.7	375.266	1.7	99.7	—
6月末	12,330	1.9	376.290	2.0	99.8	—
7月末	12,138	0.3	370.426	0.4	99.7	—
8月末	12,050	△0.4	367.761	△0.3	99.7	—
9月末	11,962	△1.1	365.131	△1.0	99.8	—
(当期末) 2023年10月24日	11,847	△2.1	361.661	△2.0	99.7	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

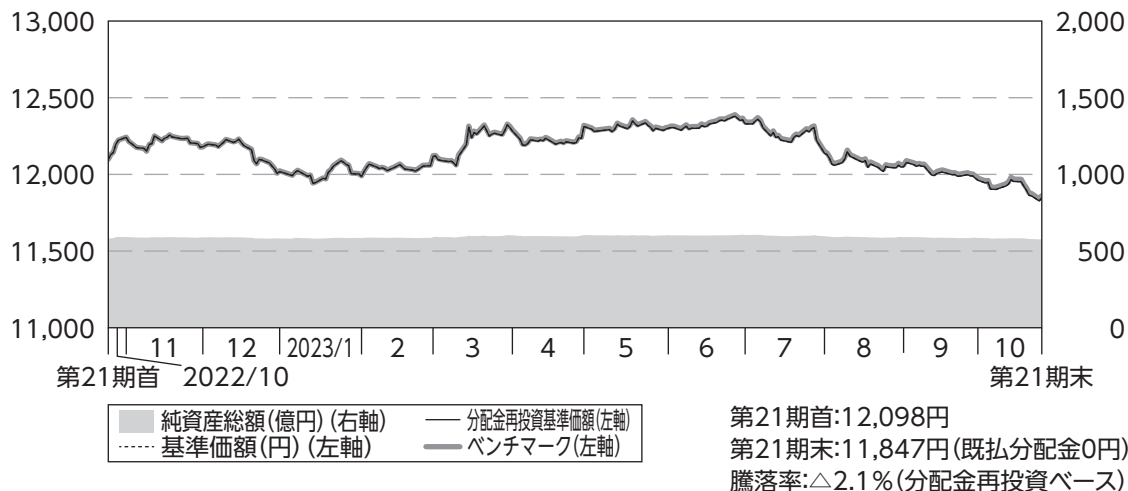
ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

【NOMURA-BPI総合】とは、野村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

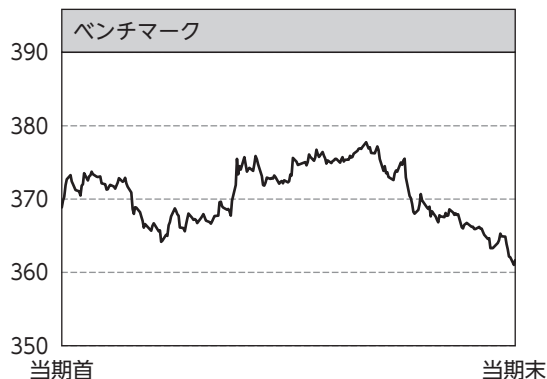


- (注1) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入金額により課税条件も異なります。従って、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額及びベンチマークは、2022年10月24日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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「日本債券マザーファンド」への投資を通じて、NOMURA－BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行いました。

【「日本債券マザーファンド」の運用経過】

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

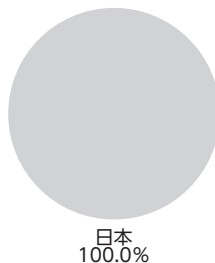
	当期末
	2023年10月24日
日本債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

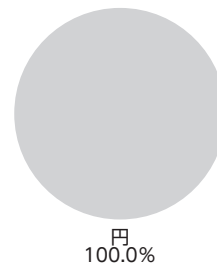
○資産別配分



○国別配分



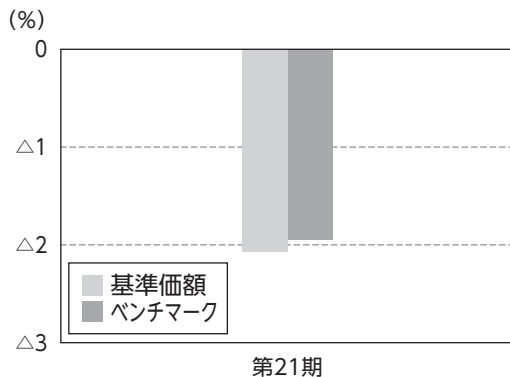
○通貨別配分



(注)資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。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25日～2023年10月24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)	3,151	

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

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

(注3)—印は該当がないことを示します。

今後の運用方針

公社債への実質投資は、わが国で発行された公社債に分散投資を行い、NOMURA-BPI総合と連動する投資成果を目標として運用を行います。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年10月25日～2023年10月24日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	16円	0.132%	(a) 信託報酬 = $\frac{\text{[期中の平均基準価額]} \times \text{信託報酬率}}{\text{期中の平均基準価額}}$ は12,159円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(7)	(0.055)	
(販売会社)	(7)	(0.055)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	0	0.000	(d) その他費用 = $\frac{\text{[期中のその他費用]} \times 10,000}{\text{[期中の平均受益権口数]}$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、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)	(-)	(-)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	16	0.132	

(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。

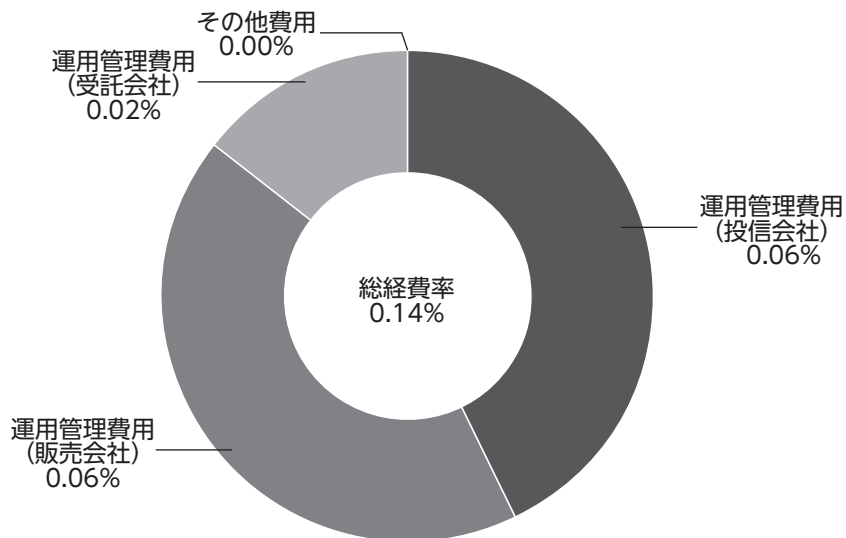
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.14%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
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 3,592,204	千円 4,743,009	千口 3,110,072	千円 4,098,857

利害関係人※との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 1	百万円 1	% 100.0	百万円 1	百万円 1	% 100.0
コール・ローン	20,691	2,285	11.0	20,678	2,296	11.1

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<日本債券マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
金 銭 信 託	百万円 3	百万円 3	% 100.0	百万円 3	百万円 3	% 100.0
コール・ローン	146,143	16,227	11.1	145,990	16,263	11.1

<平均保有割合 15.1%>

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

(注2)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

組入資産の明細

<親投資信託残高>

種 類	当期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千口 44,352,742	千口 44,834,873	千円 57,711,449

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、306,510,882千口です。

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

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日 本 債 券 マ ザ ー フ ァ ン ド	千円 57,711,449	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	170,770	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	57,882,219	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 2023年10月24日現在
(A) 資 産	57,882,219,529円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	99,893,859
日本債券マザーファンド(評価額)	57,711,449,615
未 収 入 金	70,876,055
(B) 負 債	141,949,138
未 払 解 約 金	102,568,490
未 払 信 託 報 酬	39,380,595
未 払 利 息	49
そ の 他 未 払 費 用	4
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	57,740,270,391
元 本	48,737,134,896
次 期 繰 越 損 益 金	9,003,135,495
(D) 受 益 権 総 口 数	48,737,134,896口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,847円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年10月25日 至 2023年10月24日
(A) 配 当 等 収 益	△42,211円
受 取 利 息	486
支 払 利 息	△42,697
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,188,494,448
売 買 益	42,141,451
売 買 損	△1,230,635,899
(C) 信 託 報 酬 等	△78,194,934
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,266,731,593
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△435,630,391
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,705,497,479
(配 当 等 相 当 額)	(11,409,663,006)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△704,165,527)
(G) 計 (D+E+F)	9,003,135,495
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	9,003,135,495
追 加 信 託 差 損 益 金	10,705,497,479
(配 当 等 相 当 額)	(11,412,901,947)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△707,404,468)
分 配 準 備 積 立 金	3,948,903,194
繰 越 損 益 金	△5,651,265,178

(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48,152,212,384円、期中追加設定元本額は6,293,008,908円、期中一部解約元本額は5,708,086,396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)	379,675,603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	11,412,901,947円
(D) 分配準備積立金額	3,569,227,591円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	15,361,805,141円
(F) 期末残存口数	48,737,134,896口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	3,151円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

該当事項はありません。

日本債券マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2023年1月23日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第18期(2019年1月22日)	13,698	1.4	384.988	1.4	99.4	0.3	302,423
第19期(2020年1月22日)	13,860	1.2	389.521	1.2	99.8	—	365,754
第20期(2021年1月22日)	13,756	△0.8	386.546	△0.8	99.8	—	376,037
第21期(2022年1月24日)	13,721	△0.3	385.557	△0.3	99.8	—	387,055
第22期(2023年1月23日)	13,121	△4.4	368.724	△4.4	99.8	—	379,941

(注)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2022年 1月24日	13,721	—	385.557	—	99.8	—
1月末	13,667	△0.4	384.056	△0.4	99.7	—
2月末	13,599	△0.9	382.128	△0.9	99.7	0.2
3月末	13,562	△1.2	381.037	△1.2	99.8	—
4月末	13,528	△1.4	380.119	△1.4	99.8	—
5月末	13,508	△1.6	379.538	△1.6	99.7	—
6月末	13,384	△2.5	376.081	△2.5	99.8	—
7月末	13,471	△1.8	378.553	△1.8	99.7	—
8月末	13,440	△2.0	377.670	△2.0	99.7	—
9月末	13,297	△3.1	373.602	△3.1	99.8	—
10月末	13,283	△3.2	373.249	△3.2	99.8	0.0
11月末	13,218	△3.7	371.326	△3.7	99.7	—
12月末	13,045	△4.9	366.595	△4.9	99.8	—
(当期末) 2023年 1月23日	13,121	△4.4	368.724	△4.4	99.8	—

(注1)騰落率は期首比です。

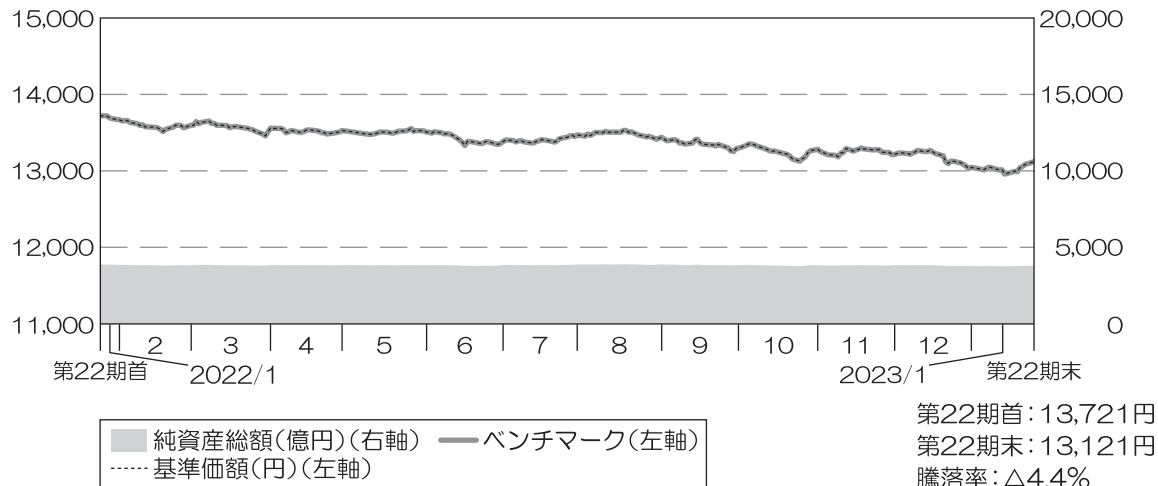
(注2)債券先物比率は買建比率－売建比率です。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移



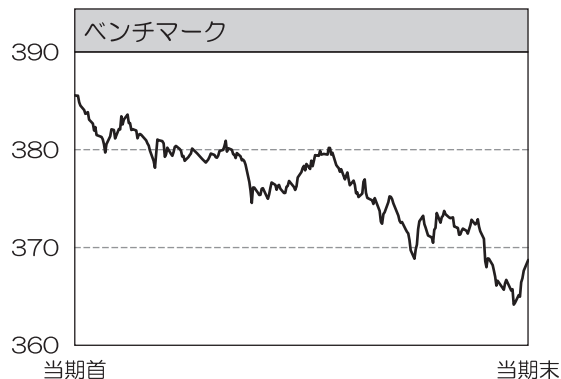
(注)ベンチマークは、2022年1月24日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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。

期初より2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響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。2月下旬から3月上旬にかけて、ウクライナ情勢の深刻化により国内金利が低下(債券価格は上昇)したことから基準価額は一時的に上昇しましたが、その後は3月下旬から6月中旬にかけては欧米の長期金利が上昇した影響を受けて国内金利が上昇し、下落しました。その後8月中旬にかけては、先行きの世界的な景気減速が意識されて国内金利が低下したことから基準価額は上昇しましたが、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し、再び下落しました。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が、2023年1月の金融政策決定会合は緩和スタンスの維持であったことなどから期末にかけては下げ幅を一部戻しました。

投資環境



国内金利は、期初より2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響から上昇しましたが、2月下旬から3月上旬にかけて、ウクライナ情勢の深刻化により低下しました。3月下旬から6月中旬には、欧米の長期金利が上昇した影響を受けて国内金利は上昇した後、8月中旬にかけては、先行きの世界的な景気減速が意識されて低下しました。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は再度上昇し、12月の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国内金利の上昇が加速しましたが、2023年1月の金融政策決定会合は緩和スタンスの維持であったことなどから国内金利は低下しました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

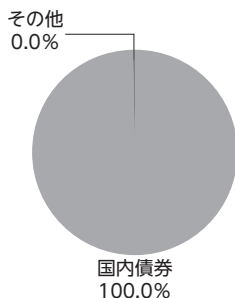
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第367回利付国債(10年)	日本	1.1%
2	第153回利付国債(5年)	日本	0.9%
3	第350回利付国債(10年)	日本	0.9%
4	第346回利付国債(10年)	日本	0.9%
5	第340回利付国債(10年)	日本	0.9%
6	第344回利付国債(10年)	日本	0.9%

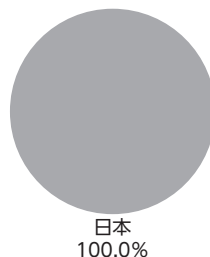
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第149回利付国債(5年)	日本	0.9%
8	第363回利付国債(10年)	日本	0.8%
9	第347回利付国債(10年)	日本	0.8%
10	第345回利付国債(10年)	日本	0.8%
組入銘柄数		744	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

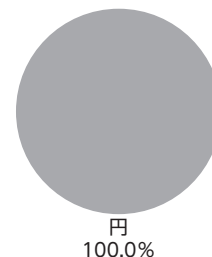
○資産別配分



○国別配分



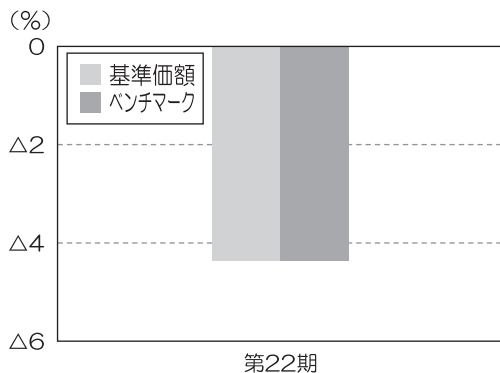
○通貨別配分



(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

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2022年1月25日～2023年1月23日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	-	-	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(-)	(-)	
(その他)	(-)	(-)	
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(13,416円)で除して100を乗じたものです。

売買および取引の状況

<公社債>

		当 期	
		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 81,532,465	千円 66,256,709
	地 方 債 証 券	1,497,154	1,762,923
	特 殊 債 券	5,945,461	6,796,863 (425,774)
	社 債 券	4,792,628	5,617,697

(注1) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

<先物取引の種類別取引状況>

種 類 別		当 期			
		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	債 券 先 物 取 引	百万円 9,253	百万円 9,255	百万円 -	百万円 -

(注) 金額は受渡代金です。

利害関係人*との取引状況等

■利害関係人との取引状況

区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$ %
金 銭 信 託	百万円 0.039391	百万円 0.039391	100.0	百万円 0.039391	百万円 0.039391	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	143,224	10,774	7.5	143,153	10,727	7.5

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

〈国内(邦貨建)公社債〉

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBBB格以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%
国 債 証 券	320,469,000 (-)	320,703,799 (-)	84.4 (-)	- (-)	54.8 (-)	20.4 (-)	9.3 (-)	
地 方 債 証 券	19,327,300 (19,127,300)	19,767,066 (19,543,205)	5.2 (5.1)	- (-)	3.1 (3.1)	1.3 (1.3)	0.8 (0.8)	
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	20,282,234 (20,082,234)	20,726,695 (20,506,691)	5.5 (5.4)	- (-)	3.1 (3.1)	1.4 (1.4)	1.0 (1.0)	
金 融 債 証 券	1,300,000 (1,300,000)	1,295,996 (1,295,996)	0.3 (0.3)	- (-)	- (-)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)	
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	17,000,000 (17,000,000)	16,585,969 (16,585,969)	4.4 (4.4)	- (-)	1.9 (1.9)	2.1 (2.1)	0.3 (0.3)	
合 計	378,378,534 (57,509,534)	379,079,526 (57,931,861)	99.8 (15.2)	- (-)	62.9 (8.1)	25.3 (5.0)	11.5 (2.2)	

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

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

(B) 個別銘柄開示

当 期 末					当 期 末				
銘 柄	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日	銘 柄	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
国債証券					第151回利付国債(5年)	0.005	2,120,000	2,112,537	2027/3/20
第433回利付国債(2年)	0.005	1,510,000	1,510,845	2024/2/1	第152回利付国債(5年)	0.1	695,000	695,284	2027/3/20
第434回利付国債(2年)	0.005	935,000	935,504	2024/3/1	第153回利付国債(5年)	0.005	3,485,000	3,468,934	2027/6/20
第435回利付国債(2年)	0.005	1,000,000	1,000,530	2024/4/1	第154回利付国債(5年)	0.1	2,650,000	2,646,316	2027/9/20
第436回利付国債(2年)	0.005	900,000	900,450	2024/5/1	第1回利付国債(40年)	2.4	230,000	275,342	2048/3/20
第437回利付国債(2年)	0.005	945,000	945,444	2024/6/1	第2回利付国債(40年)	2.2	450,000	519,408	2049/3/20
第438回利付国債(2年)	0.005	865,000	865,371	2024/7/1	第3回利付国債(40年)	2.2	380,000	439,371	2050/3/20
第439回利付国債(2年)	0.005	1,065,000	1,065,479	2024/8/1	第4回利付国債(40年)	2.2	665,000	767,769	2051/3/20
第440回利付国債(2年)	0.005	1,400,000	1,400,672	2024/9/1	第5回利付国債(40年)	2.0	495,000	549,093	2052/3/20
第442回利付国債(2年)	0.005	1,175,000	1,175,622	2024/11/1	第6回利付国債(40年)	1.9	670,000	722,635	2053/3/20
第443回利付国債(2年)	0.005	860,000	860,473	2024/12/1	第7回利付国債(40年)	1.7	1,210,000	1,244,206	2054/3/20
第444回利付国債(2年)	0.005	265,000	265,127	2025/1/1	第8回利付国債(40年)	1.4	940,000	895,331	2055/3/20
第139回利付国債(5年)	0.1	2,220,000	2,223,574	2024/3/20	第9回利付国債(40年)	0.4	940,000	652,548	2056/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	2,465,000	2,469,141	2024/6/20	第10回利付国債(40年)	0.9	1,270,000	1,039,241	2057/3/20
第141回利付国債(5年)	0.1	2,868,000	2,873,678	2024/9/20	第11回利付国債(40年)	0.8	1,080,000	850,230	2058/3/20
第142回利付国債(5年)	0.1	2,010,000	2,014,582	2024/12/20	第12回利付国債(40年)	0.5	810,000	566,967	2059/3/20
第143回利付国債(5年)	0.1	2,090,000	2,095,162	2025/3/20	第13回利付国債(40年)	0.5	1,220,000	847,094	2060/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	2,790,000	2,797,365	2025/6/20	第14回利付国債(40年)	0.7	1,425,000	1,057,293	2061/3/20
第145回利付国債(5年)	0.1	2,875,000	2,883,395	2025/9/20	第15回利付国債(40年)	1.0	1,050,000	849,282	2062/3/20
第146回利付国債(5年)	0.1	2,280,000	2,286,931	2025/12/20	第333回利付国債(10年)	0.6	2,680,000	2,699,724	2024/3/20
第147回利付国債(5年)	0.005	2,560,000	2,560,000	2026/3/20	第334回利付国債(10年)	0.6	3,010,000	3,036,156	2024/6/20
第148回利付国債(5年)	0.005	2,310,000	2,308,798	2026/6/20	第335回利付国債(10年)	0.5	2,430,000	2,450,898	2024/9/20
第149回利付国債(5年)	0.005	3,245,000	3,240,846	2026/9/20	第336回利付国債(10年)	0.5	1,040,000	1,050,296	2024/12/20
第150回利付国債(5年)	0.005	2,740,000	2,733,588	2026/12/20					

当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第337回利付国債(10年)	0.3	1,710,000	1,720,413	2024/12/20
第338回利付国債(10年)	0.4	2,930,000	2,956,135	2025/3/20
第339回利付国債(10年)	0.4	3,035,000	3,064,894	2025/6/20
第340回利付国債(10年)	0.4	3,210,000	3,244,924	2025/9/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,050,000	2,068,142	2025/12/20
第342回利付国債(10年)	0.1	2,940,000	2,948,790	2026/3/20
第343回利付国債(10年)	0.1	2,895,000	2,902,874	2026/6/20
第344回利付国債(10年)	0.1	3,240,000	3,247,063	2026/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	3,180,000	3,184,324	2026/12/20
第346回利付国債(10年)	0.1	3,425,000	3,426,404	2027/3/20
第347回利付国債(10年)	0.1	3,205,000	3,203,589	2027/6/20
第348回利付国債(10年)	0.1	3,020,000	3,015,802	2027/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	2,750,000	2,742,630	2027/12/20
第350回利付国債(10年)	0.1	3,450,000	3,436,786	2028/3/20
第351回利付国債(10年)	0.1	1,840,000	1,831,131	2028/6/20
第352回利付国債(10年)	0.1	2,420,000	2,405,794	2028/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	2,750,000	2,729,952	2028/12/20
第354回利付国債(10年)	0.1	3,110,000	3,082,663	2029/3/20
第355回利付国債(10年)	0.1	2,760,000	2,731,323	2029/6/20
第356回利付国債(10年)	0.1	2,530,000	2,500,247	2029/9/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,560,000	2,527,052	2029/12/20
第358回利付国債(10年)	0.1	2,730,000	2,697,431	2030/3/20
第359回利付国債(10年)	0.1	3,130,000	3,079,074	2030/6/20
第360回利付国債(10年)	0.1	2,885,000	2,832,262	2030/9/20
第361回利付国債(10年)	0.1	2,930,000	2,870,345	2030/12/20
第362回利付国債(10年)	0.1	2,870,000	2,806,458	2031/3/20
第363回利付国債(10年)	0.1	3,295,000	3,217,238	2031/6/20
第364回利付国債(10年)	0.1	3,075,000	2,999,078	2031/9/20
第365回利付国債(10年)	0.1	2,845,000	2,776,378	2031/12/20
第366回利付国債(10年)	0.2	1,558,000	1,539,319	2032/3/20
第367回利付国債(10年)	0.2	4,215,000	4,222,755	2032/6/20
第368回利付国債(10年)	0.2	2,155,000	2,165,236	2032/9/20
第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	58,307	2029/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	114,745	2030/2/20
第3回利付国債(30年)	2.3	140,000	160,106	2030/5/20
第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	227,232	2030/11/20
第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	206,830	2031/5/20
第6回利付国債(30年)	2.4	20,000	23,488	2031/11/20
第7回利付国債(30年)	2.3	790,000	926,496	2032/5/20
第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	196,306	2032/12/20
第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	180,201	2033/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	430,000	481,260	2033/6/20
第12回利付国債(30年)	2.1	430,000	498,838	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	130,000	149,467	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	417,368	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	370,000	445,739	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	165,000	198,932	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	405,000	484,112	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	400,000	474,056	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	345,000	409,159	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	400,000	484,260	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	890,000	1,056,652	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	380,000	460,427	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	170,000	206,104	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	145,000	175,885	2036/9/20

当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第25回利付国債(30年)	2.3	185,000	219,720	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	1,240,000	1,488,409	2037/3/20
第27回利付国債(30年)	2.5	890,000	1,080,655	2037/9/20
第28回利付国債(30年)	2.5	1,050,000	1,274,836	2038/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	880,000	1,055,331	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	765,000	905,170	2039/3/20
第31回利付国債(30年)	2.2	660,000	769,223	2039/9/20
第32回利付国債(30年)	2.3	955,000	1,125,219	2040/3/20
第33回利付国債(30年)	2.0	1,260,000	1,423,434	2040/9/20
第34回利付国債(30年)	2.2	1,360,000	1,579,164	2041/3/20
第35回利付国債(30年)	2.0	1,350,000	1,522,732	2041/9/20
第36回利付国債(30年)	2.0	1,300,000	1,466,517	2042/3/20
第37回利付国債(30年)	1.9	1,415,000	1,572,517	2042/9/20
第38回利付国債(30年)	1.8	885,000	966,455	2043/3/20
第39回利付国債(30年)	1.9	835,000	926,240	2043/6/20
第40回利付国債(30年)	1.8	725,000	790,453	2043/9/20
第41回利付国債(30年)	1.7	650,000	696,169	2043/12/20
第42回利付国債(30年)	1.7	739,000	790,656	2044/3/20
第43回利付国債(30年)	1.7	835,000	892,414	2044/6/20
第44回利付国債(30年)	1.7	880,000	939,479	2044/9/20
第45回利付国債(30年)	1.5	835,000	859,073	2044/12/20
第46回利付国債(30年)	1.5	1,055,000	1,083,822	2045/3/20
第47回利付国債(30年)	1.6	1,030,000	1,076,133	2045/6/20
第48回利付国債(30年)	1.4	1,010,000	1,015,231	2045/9/20
第49回利付国債(30年)	1.4	1,020,000	1,023,549	2045/12/20
第50回利付国債(30年)	0.8	990,000	873,912	2046/3/20
第51回利付国債(30年)	0.3	1,045,000	815,768	2046/6/20
第52回利付国債(30年)	0.5	1,045,000	854,339	2046/9/20
第53回利付国債(30年)	0.6	1,070,000	892,701	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	935,000	815,348	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	855,000	743,431	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	680,000	589,546	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	910,000	785,948	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	1,350,000	1,162,566	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	645,000	540,148	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	1,190,000	1,044,177	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	900,000	748,908	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	780,000	613,329	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	1,000,000	761,700	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	1,060,000	804,275	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	760,000	576,543	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	750,000	566,767	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	1,090,000	867,476	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	1,130,000	896,169	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	985,000	801,602	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	1,235,000	1,002,721	2051/3/20
第71回利付国債(30年)	0.7	765,000	619,650	2051/6/20
第72回利付国債(30年)	0.7	1,010,000	816,958	2051/9/20
第73回利付国債(30年)	0.7	1,225,000	988,538	2051/12/20
第74回利付国債(30年)	1.0	1,255,000	1,098,752	2052/3/20
第75回利付国債(30年)	1.3	753,000	712,097	2052/6/20
第76回利付国債(30年)	1.4	1,146,000	1,108,812	2052/9/20
第67回利付国債(20年)	1.9	310,000	316,922	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	230,000	235,929	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	530,000	543,053	2024/3/20

当期末					当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
第7 0 回利付国債 (20年)	2.4	690,000	713,425	2024/6/20	第1 2 4 回利付国債 (20年)	2.0	700,000	789,439	2030/12/20
第7 1 回利付国債 (20年)	2.2	400,000	412,456	2024/6/20	第1 2 5 回利付国債 (20年)	2.2	680,000	779,688	2031/3/20
第7 2 回利付国債 (20年)	2.1	710,000	734,913	2024/9/20	第1 2 6 回利付国債 (20年)	2.0	450,000	508,635	2031/3/20
第7 3 回利付国債 (20年)	2.0	540,000	560,773	2024/12/20	第1 2 7 回利付国債 (20年)	1.9	400,000	448,952	2031/3/20
第7 4 回利付国債 (20年)	2.1	310,000	322,517	2024/12/20	第1 2 8 回利付国債 (20年)	1.9	750,000	843,855	2031/6/20
第7 5 回利付国債 (20年)	2.1	360,000	376,380	2025/3/20	第1 2 9 回利付国債 (20年)	1.8	260,000	290,417	2031/6/20
第7 6 回利付国債 (20年)	1.9	350,000	364,416	2025/3/20	第1 3 0 回利付国債 (20年)	1.8	890,000	996,728	2031/9/20
第7 7 回利付国債 (20年)	2.0	290,000	302,571	2025/3/20	第1 3 1 回利付国債 (20年)	1.7	760,000	844,762	2031/9/20
第7 8 回利付国債 (20年)	1.9	120,000	125,508	2025/6/20	第1 3 2 回利付国債 (20年)	1.7	600,000	668,784	2031/12/20
第7 9 回利付国債 (20年)	2.0	100,000	104,830	2025/6/20	第1 3 3 回利付国債 (20年)	1.8	620,000	696,421	2031/12/20
第8 0 回利付国債 (20年)	2.1	250,000	262,675	2025/6/20	第1 3 4 回利付国債 (20年)	1.8	925,000	1,041,152	2032/3/20
第8 1 回利付国債 (20年)	2.0	180,000	189,606	2025/9/20	第1 3 5 回利付国債 (20年)	1.7	580,000	647,413	2032/3/20
第8 2 回利付国債 (20年)	2.1	485,000	512,174	2025/9/20	第1 3 6 回利付国債 (20年)	1.6	450,000	498,325	2032/3/20
第8 3 回利付国債 (20年)	2.1	1,355,000	1,437,844	2025/12/20	第1 3 7 回利付国債 (20年)	1.7	580,000	648,619	2032/6/20
第8 4 回利付国債 (20年)	2.0	190,000	201,063	2025/12/20	第1 3 8 回利付国債 (20年)	1.5	460,000	505,852	2032/6/20
第8 5 回利付国債 (20年)	2.1	360,000	383,756	2026/3/20	第1 3 9 回利付国債 (20年)	1.6	735,000	815,291	2032/6/20
第8 6 回利付国債 (20年)	2.3	240,000	257,349	2026/3/20	第1 4 0 回利付国債 (20年)	1.7	1,285,000	1,438,943	2032/9/20
第8 7 回利付国債 (20年)	2.2	170,000	181,753	2026/3/20	第1 4 1 回利付国債 (20年)	1.7	950,000	1,064,104	2032/12/20
第8 8 回利付国債 (20年)	2.3	290,000	312,480	2026/6/20	第1 4 2 回利付国債 (20年)	1.8	890,000	1,005,344	2032/12/20
第8 9 回利付国債 (20年)	2.2	320,000	343,718	2026/6/20	第1 4 3 回利付国債 (20年)	1.6	900,000	998,523	2033/3/20
第9 0 回利付国債 (20年)	2.2	610,000	658,080	2026/9/20	第1 4 4 回利付国債 (20年)	1.5	960,000	1,055,798	2033/3/20
第9 1 回利付国債 (20年)	2.3	310,000	335,565	2026/9/20	第1 4 5 回利付国債 (20年)	1.7	1,210,000	1,354,244	2033/6/20
第9 2 回利付国債 (20年)	2.1	1,490,000	1,608,380	2026/12/20	第1 4 6 回利付国債 (20年)	1.7	1,340,000	1,498,870	2033/9/20
第9 3 回利付国債 (20年)	2.0	400,000	431,680	2027/3/20	第1 4 7 回利付国債 (20年)	1.6	1,720,000	1,904,796	2033/12/20
第9 4 回利付国債 (20年)	2.1	445,000	482,086	2027/3/20	第1 4 8 回利付国債 (20年)	1.5	1,240,000	1,358,767	2034/3/20
第9 5 回利付国債 (20年)	2.3	950,000	1,041,380	2027/6/20	第1 4 9 回利付国債 (20年)	1.5	1,890,000	2,069,323	2034/6/20
第9 6 回利付国債 (20年)	2.1	200,000	217,486	2027/6/20	第1 5 0 回利付国債 (20年)	1.4	1,910,000	2,067,422	2034/9/20
第9 7 回利付国債 (20年)	2.2	210,000	230,164	2027/9/20	第1 5 1 回利付国債 (20年)	1.2	1,675,000	1,772,870	2034/12/20
第9 8 回利付国債 (20年)	2.1	370,000	403,818	2027/9/20	第1 5 2 回利付国債 (20年)	1.2	1,775,000	1,876,476	2035/3/20
第9 9 回利付国債 (20年)	2.1	660,000	722,475	2027/12/20	第1 5 3 回利付国債 (20年)	1.3	1,425,000	1,520,831	2035/6/20
第1 0 0 回利付国債 (20年)	2.2	660,000	728,593	2028/3/20	第1 5 4 回利付国債 (20年)	1.2	1,575,000	1,659,782	2035/9/20
第1 0 1 回利付国債 (20年)	2.4	360,000	401,090	2028/3/20	第1 5 5 回利付国債 (20年)	1.0	1,290,000	1,325,604	2035/12/20
第1 0 2 回利付国債 (20年)	2.4	1,070,000	1,197,094	2028/6/20	第1 5 6 回利付国債 (20年)	0.4	1,375,000	1,306,442	2036/3/20
第1 0 3 回利付国債 (20年)	2.3	1,305,000	1,453,026	2028/6/20	第1 5 7 回利付国債 (20年)	0.2	1,840,000	1,695,063	2036/6/20
第1 0 4 回利付国債 (20年)	2.1	260,000	286,709	2028/6/20	第1 5 8 回利付国債 (20年)	0.5	2,060,000	1,968,165	2036/9/20
第1 0 5 回利付国債 (20年)	2.1	730,000	807,774	2028/9/20	第1 5 9 回利付国債 (20年)	0.6	1,700,000	1,641,027	2036/12/20
第1 0 6 回利付国債 (20年)	2.2	270,000	300,277	2028/9/20	第1 6 0 回利付国債 (20年)	0.7	640,000	623,929	2037/3/20
第1 0 7 回利付国債 (20年)	2.1	500,000	554,945	2028/12/20	第1 6 1 回利付国債 (20年)	0.6	1,530,000	1,465,862	2037/6/20
第1 0 8 回利付国債 (20年)	1.9	925,000	1,015,862	2028/12/20	第1 6 2 回利付国債 (20年)	0.6	1,290,000	1,231,124	2037/9/20
第1 0 9 回利付国債 (20年)	1.9	290,000	319,272	2029/3/20	第1 6 3 回利付国債 (20年)	0.6	1,315,000	1,250,012	2037/12/20
第1 1 0 回利付国債 (20年)	2.1	515,000	573,231	2029/3/20	第1 6 4 回利付国債 (20年)	0.5	1,490,000	1,390,140	2038/3/20
第1 1 1 回利付国債 (20年)	2.2	450,000	505,296	2029/6/20	第1 6 5 回利付国債 (20年)	0.5	1,200,000	1,114,704	2038/6/20
第1 1 2 回利付国債 (20年)	2.1	950,000	1,060,751	2029/6/20	第1 6 6 回利付国債 (20年)	0.7	1,230,000	1,172,903	2038/9/20
第1 1 3 回利付国債 (20年)	2.1	1,525,000	1,707,984	2029/9/20	第1 6 7 回利付国債 (20年)	0.5	1,250,000	1,150,812	2038/12/20
第1 1 4 回利付国債 (20年)	2.1	920,000	1,033,758	2029/12/20	第1 6 8 回利付国債 (20年)	0.4	1,840,000	1,658,796	2039/3/20
第1 1 5 回利付国債 (20年)	2.2	370,000	418,255	2029/12/20	第1 6 9 回利付国債 (20年)	0.3	1,190,000	1,049,687	2039/6/20
第1 1 6 回利付国債 (20年)	2.2	330,000	374,810	2030/3/20	第1 7 0 回利付国債 (20年)	0.3	1,310,000	1,148,739	2039/9/20
第1 1 7 回利付国債 (20年)	2.1	240,000	270,904	2030/3/20	第1 7 1 回利付国債 (20年)	0.3	1,150,000	1,003,133	2039/12/20
第1 1 8 回利付国債 (20年)	2.0	450,000	505,215	2030/6/20	第1 7 2 回利付国債 (20年)	0.4	1,320,000	1,174,483	2040/3/20
第1 1 9 回利付国債 (20年)	1.8	320,000	354,502	2030/6/20	第1 7 3 回利付国債 (20年)	0.4	1,330,000	1,160,451	2040/6/20
第1 2 0 回利付国債 (20年)	1.6	1,330,000	1,454,155	2030/6/20	第1 7 4 回利付国債 (20年)	0.4	1,495,000	1,308,364	2040/9/20
第1 2 1 回利付国債 (20年)	1.9	970,000	1,084,101	2030/9/20	第1 7 5 回利付国債 (20年)	0.5	1,320,000	1,171,724	2040/12/20
第1 2 2 回利付国債 (20年)	1.8	490,000	543,978	2030/9/20	第1 7 6 回利付国債 (20年)	0.5	1,380,000	1,220,554	2041/3/20
第1 2 3 回利付国債 (20年)	2.1	900,000	1,021,923	2030/12/20	第1 7 7 回利付国債 (20年)	0.4	1,225,000	1,059,698	2041/6/20

当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第178回利付国債(20年)	0.5	1,380,000	1,212,426	2041/9/20
第179回利付国債(20年)	0.5	1,710,000	1,497,857	2041/12/20
第180回利付国債(20年)	0.8	1,410,000	1,302,896	2042/3/20
第181回利付国債(20年)	0.9	1,350,000	1,268,284	2042/6/20
第182回利付国債(20年)	1.1	1,495,000	1,453,872	2042/9/20
小計		320,469,000	320,703,799	
地方債証券				
第1回東京都公募債(東京グリーンボンド(30年))	0.982	100,000	87,751	2047/9/20
第3回東京都公募債(20年)	2.26	100,000	102,506	2024/3/19
第7回東京都公募債(30年)	2.51	200,000	238,466	2038/9/17
第1回東京都公募債(20年)	2.22	200,000	216,532	2027/3/19
第16回東京都公募債(20年)	2.01	150,000	164,245	2028/12/20
第17回東京都公募債(20年)	2.09	100,000	109,959	2028/12/20
第18回東京都公募債(20年)	2.22	200,000	221,948	2029/3/19
第20回東京都公募債(20年)	2.09	100,000	110,653	2029/9/20
第21回東京都公募債(20年)	2.19	100,000	111,708	2029/12/20
第729回東京都公募債	0.69	150,000	151,051	2024/3/19
第740回東京都公募債	0.463	100,000	100,681	2024/12/20
第786回東京都公募債	0.16	200,000	197,898	2028/9/20
第800回東京都公募債	0.08	300,000	292,575	2029/12/20
第830回東京都公募債	0.275	100,000	97,517	2032/6/18
平成27年度第15回北海道公募債	0.22	100,000	100,291	2026/2/26
令和4年度第1回北海道公募債	0.294	100,000	97,498	2032/4/28
第3回神奈川県公募債(30年)	2.62	100,000	120,752	2037/3/19
第11回神奈川県公募債(20年)	2.08	100,000	110,412	2029/7/20
第15回神奈川県公募債(20年)	1.94	300,000	331,695	2030/11/12
第16回神奈川県公募債(20年)	2.09	600,000	671,436	2031/1/24
第21回神奈川県公募債(20年)	1.732	100,000	111,202	2032/9/19
第243回神奈川県公募債	0.075	100,000	97,492	2029/12/20
第2回大阪府公募債(20年)	2.23	300,000	335,196	2029/11/16
第386回大阪府公募債(10年)	0.585	100,000	100,710	2024/7/30
第403回大阪府公募債(10年)	0.462	300,000	302,976	2025/12/25
第417回大阪府公募債(10年)	0.248	108,000	108,139	2027/2/26
第423回大阪府公募債(10年)	0.185	300,000	298,980	2027/8/30
平成25年度第2回京都府公募債(15年)	1.05	100,000	103,786	2028/4/28
平成27年度第4回京都府公募債	0.553	100,000	101,071	2025/6/19
平成27年度第13回京都府公募債	0.11	105,860	105,843	2026/3/17
令和元年度第3回京都府公募債	0.01	100,000	99,866	2024/6/21
令和2年度第1回京都府公募債(10年)	0.135	100,000	97,733	2030/4/12
第3回兵庫県公募債(20年)	2.31	100,000	109,459	2027/9/21
第4回兵庫県公募債(15年)	1.31	100,000	104,994	2027/12/24
第8回兵庫県公募債(15年)	1.09	100,000	104,186	2029/4/16
第11回兵庫県公募債(15年)	0.718	200,000	203,490	2030/5/10
平成26年度第2回兵庫県公募債	0.63	100,000	100,703	2024/5/20
平成28年度第30回兵庫県公募債	0.215	100,000	100,020	2027/3/19
令和3年度第9回兵庫県公募債(5年)	0.001	100,000	99,313	2026/11/24
第12回静岡県公募債(30年)	0.822	100,000	83,871	2048/3/19
第15回静岡県公募債(20年)	1.701	100,000	110,478	2032/10/15
平成26年度第10回静岡県公募債	0.515	100,000	100,752	2024/11/25
平成27年度第1回静岡県公募債	0.425	100,000	100,714	2025/4/21
平成28年度第6回静岡県公募債	0.494	100,000	100,930	2025/6/20
令和4年度第5回静岡県公募債	0.29	100,000	97,651	2032/6/18
平成22年度第14回愛知県公募債(20年)	2.087	100,000	111,761	2030/12/13
平成25年度第8回愛知県公募債(30年)	2.024	110,000	121,764	2043/6/19
平成25年度第21回愛知県公募債(10年)	0.703	400,000	402,904	2024/3/28

当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
平成27年度第17回愛知県公募債(10年)	0.38	200,000	201,586	2026/1/27
平成29年度第6回愛知県公募債(10年)	0.22	100,000	99,889	2027/7/28
平成29年度第16回愛知県公募債(10年)	0.26	100,000	99,801	2028/2/14
平成30年度第1回愛知県公募債(10年)	0.185	200,000	198,680	2028/4/27
令和元年度第16回愛知県公募債(10年)	0.09	100,000	97,518	2030/2/15
令和2年度第7回愛知県公募債(10年)	0.145	100,000	97,324	2030/7/31
令和3年度第6回愛知県公募債(30年)	0.718	200,000	157,268	2051/6/20
平成20年度第1回広島県公募債(20年)	2.34	100,000	111,098	2028/9/21
平成27年度第2回広島県公募債	0.602	162,000	163,987	2025/7/24
平成29年度第7回広島県公募債	0.2	131,440	130,707	2028/3/23
令和2年度第7回広島県公募債	0.214	100,000	97,228	2031/3/19
第5回埼玉県公募債(20年)	2.35	100,000	110,381	2028/3/17
第7回埼玉県公募債(15年)	0.34	400,000	374,028	2035/8/17
第8回埼玉県公募債(15年)	0.367	100,000	92,825	2036/4/18
第9回埼玉県公募債(30年)	0.845	100,000	84,346	2048/3/19
第18回埼玉県公募債(20年)	0.323	200,000	184,318	2036/5/10
平成29年度第5回埼玉県公募債	0.22	100,000	99,889	2027/7/26
平成19年度第1回福岡県公募債(30年)	2.62	100,000	120,778	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募債(30年)	2.28	200,000	231,854	2038/9/17
平成23年度第1回福岡県公募債(15年)	1.491	100,000	104,997	2026/11/27
平成26年度第8回福岡県公募債	0.441	100,000	100,643	2024/12/25
平成29年度第8回福岡県公募債	0.23	200,000	199,250	2031/2/25
令和3年度第2回福岡県公募債	0.155	100,000	96,618	2031/5/30
令和3年度第5回福岡県公募債	0.001	100,000	99,312	2026/11/25
令和3年度第1回福岡県公募債(15年)	0.299	200,000	183,268	2036/7/14
第6回千葉県公募債(20年)	2.26	200,000	222,600	2029/4/20
第8回千葉県公募債(20年)	2.18	100,000	112,100	2030/4/19
第9回千葉県公募債(20年)	1.84	100,000	109,735	2030/10/11
平成26年度第9回千葉県公募債	0.465	100,000	100,778	2025/3/25
平成28年度第1回千葉県公募債	0.08	100,000	99,817	2026/5/25
平成29年度第5回千葉県公募債	0.215	120,000	119,622	2027/12/24
令和元年度第7回千葉県公募債	0.08	100,000	97,470	2030/2/25
平成27年度第3回新潟県公募債	0.12	200,000	200,000	2026/3/25
令和3年度第1回長野県公募債(10年)	0.19	200,000	193,954	2031/4/16
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	100,751	2024/4/25
第134回共同発行市場公募地方債	0.674	100,000	100,767	2024/5/24
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	600,000	604,590	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	100,735	2024/8/23
第139回共同発行市場公募地方債	0.544	200,000	201,536	2024/10/25
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	100,733	2024/11/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	100,675	2025/4/25
第153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	101,027	2025/12/25
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	300,000	298,968	2026/8/25
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	100,157	2027/2/25
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	150,000	149,649	2027/10/25
第181回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	99,314	2028/4/25
第194回共同発行市場公募地方債	0.11	160,000	156,995	2029/5/25
第209回共同発行市場公募地方債	0.125	100,000	97,084	2030/8/23
第228回共同発行市場公募地方債	0.199	200,000	193,246	2032/3/25
第231回共同発行市場公募地方債	0.309	200,000	195,736	2032/6/25
第233回共同発行市場公募地方債	0.305	200,000	196,102	2032/8/25
令和元年度第2回奈良県公募債(5年)	0.011	100,000	99,808	2024/11/29
第7回大阪市公募債(30年)	0.973	100,000	87,518	2047/9/20
第10回大阪市公募債(20年)	2.22	100,000	112,096	2030/1/25
令和3年度第2回大阪市公募債	0.16	100,000	96,667	2031/5/21

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	評価額	
	%	千円	千円		
第3回名古屋市公募公債(30年)	2.5	100,000	119,172	2037/9/18	
第13回名古屋市公募公債(30年)	0.977	100,000	87,588	2047/9/20	
第488回名古屋市公募公債(10年)	0.598	100,000	100,815	2024/9/20	
第495回名古屋市公募公債(10年)	0.11	100,000	99,984	2026/3/19	
第522回名古屋市公募公債(10年)	0.554	200,000	197,566	2032/12/20	
第2回京都市公募公債(20年)	2.12	100,000	105,317	2025/9/19	
第6回京都市公募公債(20年)	2.38	100,000	109,784	2027/9/17	
平成27年度第5回京都市公募公債令和4年度第3回京都市公募公債	0.205	200,000	200,552	2026/2/25	
令和4年度第4回京都市公募公債	0.8	100,000	100,929	2033/1/24	
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	2.38	100,000	110,852	2028/5/26	
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	1.711	100,000	109,727	2032/12/17	
平成26年度第3回神戸市公募公債(20年)	1.482	100,000	107,384	2034/7/14	
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	0.674	100,000	78,482	2050/6/20	
第5回横浜市公募公債(20年)	2.17	100,000	104,952	2025/6/20	
第5回横浜市公募公債(30年)	2.64	100,000	121,075	2037/3/19	
第7回横浜市公募公債(30年)	2.54	100,000	119,715	2038/3/19	
第25回横浜市公募公債(20年)	1.72	100,000	110,721	2032/7/16	
第26回横浜市公募公債(20年)	1.776	100,000	110,115	2033/1/28	
第55回横浜市公募公債(5年)	0.01	100,000	99,584	2026/5/28	
令和3年度第2回横浜市公募公債	0.16	100,000	96,665	2031/5/23	
第8回川崎市公募公債(20年)	2.2	100,000	111,399	2029/9/20	
第11回川崎市公募公債(20年)	1.84	150,000	164,643	2030/10/18	
第88回川崎市公募公債	0.464	100,000	101,021	2025/12/19	
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	1.511	400,000	431,352	2034/2/17	
平成29年度第12回福岡市公募公債	0.2	130,000	129,275	2028/3/28	
平成30年度第9回福岡市公募公債(10年)	0.289	100,000	99,639	2028/10/30	
平成27年度第2回広島市公募公債	0.464	100,000	101,027	2025/12/25	
平成26年度第1回千葉市公募公債	0.679	200,000	201,464	2024/4/25	
平成27年度第1回三重県公募公債	0.464	100,000	101,027	2025/12/25	
令和3年度第2回三重県公募公債	0.269	100,000	97,222	2032/3/4	
平成27年度第1回山梨県公募公債(10年)	0.495	100,000	101,059	2025/10/30	
小計		19,327,300	19,767,066		
特殊債券(除金融債)					
第3回政府保証新関西国際空港債券	0.644	200,000	201,658	2024/6/26	
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	99,871	2025/1/24	
第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	109,801	2027/10/29	
第86回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	110,409	2029/7/31	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	111,259	2029/9/28	
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	112,520	2030/1/31	
第101回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	116,219	2040/2/29	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	114,550	2040/5/31	
第111回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	111,477	2030/6/28	
第123回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	112,916	2040/11/30	
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.68	100,000	110,981	2032/11/30	
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	100,000	111,121	2033/1/31	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	評価額	
	%	千円	千円		
第235回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.224	100,000	104,970	2034/12/28	
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	200,000	201,028	2025/1/31	
第238回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.414	200,000	201,462	2025/2/28	
第247回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.509	300,000	303,117	2025/5/30	
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	100,000	100,736	2026/1/30	
第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	99,772	2026/4/30	
第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.01	100,000	99,580	2026/9/30	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	300,000	299,487	2027/1/29	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	243,000	242,147	2028/2/29	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.219	100,000	99,525	2028/10/31	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	0.001	500,000	499,490	2024/8/28	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	300,000	301,980	2024/2/16	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	100,689	2024/3/15	
第59回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	100,000	100,754	2024/4/12	
第60回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	100,000	100,797	2024/5/21	
第62回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.601	100,000	100,790	2024/7/16	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.484	100,000	100,983	2025/6/13	
第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.386	200,000	201,712	2025/10/15	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	421,000	424,730	2025/12/12	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	200,000	199,654	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	99,766	2026/12/14	
第107回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.12	100,000	99,210	2028/4/14	
第110回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	150,000	148,720	2028/7/18	
第113回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	99,524	2028/10/16	
第129回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	66,314	2028/10/16	
第1回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.99	100,000	124,845	2045/9/20	
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	150,000	160,716	2026/3/19	
第21回道路債券	2.75	100,000	119,171	2033/6/20	
第22回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	237,184	2047/3/20	
第27回道路債券	2.42	100,000	102,655	2024/3/20	
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	109,298	2027/10/20	
第28回道路債券	2.83	300,000	360,501	2033/12/20	
第33回道路債券	2.91	100,000	121,451	2034/6/20	
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	110,681	2028/6/20	
第38回道路債券	2.26	100,000	103,514	2024/9/20	
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	100,000	110,706	2028/9/20	
第42回道路債券	2.22	100,000	104,448	2025/3/21	
第49回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	111,692	2029/5/18	
第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	100,000	100,666	2024/3/19	
第128回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.62	300,000	302,082	2024/6/20	
第155回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	104,249	2035/6/20	
第2回地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	111,048	2029/4/27	
第4回地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.12	100,000	110,862	2029/12/28	
第5回地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.22	200,000	223,536	2030/1/28	
第7回地方公営企業等金融機構債券(20年)	2.202	100,000	111,972	2030/4/26	
第9回公営企業債券(20年)	2.33	100,000	103,688	2024/9/24	
第11回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	104,250	2025/3/24	

銘柄	当 期	末		
		利率	額面金額	評 価 額
	%	千円	千円	償還年月日
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	111,561	2030/12/27
第15回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	105,340	2025/9/24
第15回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.03	300,000	334,308	2031/6/27
第17回公営企業債券(20年)	2.39	100,000	107,019	2026/3/24
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	110,396	2031/9/26
第19回公営企業債券(20年)	2.37	100,000	108,187	2026/12/18
第22回公営企業債券(20年)	2.32	200,000	217,488	2027/6/18
第23回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	300,000	330,762	2032/7/28
第24回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	109,784	2028/4/25
第30回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.812	100,000	110,279	2033/7/28
第34回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	400,000	434,480	2034/1/27
第70回地方公共団体金融機構債券	0.514	100,000	100,832	2025/3/28
第75回地方公共団体金融機構債券	0.529	100,000	101,025	2025/8/28
F76回地方公共団体金融機構債券	1.448	100,000	103,623	2025/10/28
第83回地方公共団体金融機構債券	0.09	200,000	199,512	2026/4/28
第96回地方公共団体金融機構債券	0.205	100,000	99,593	2027/5/28
F190回地方公共団体金融機構債券	0.792	100,000	101,182	2024/10/24
F202回地方公共団体金融機構債券	0.929	200,000	205,096	2026/6/26
第29回首都高速道路株式会社社債	0.125	100,000	99,172	2026/12/18
第27回阪神高速道路株式会社社債	0.27	100,000	99,571	2027/3/19
第87回株式会社日本政策金融公庫社債	0.001	100,000	99,882	2024/3/11
第89回株式会社日本政策金融公庫社債	0.03	100,000	99,766	2025/3/12
第159回都市再生債券	0.43	100,000	62,901	2059/3/19
第161回都市再生債券	0.687	100,000	69,673	2059/3/19
第169回都市再生債券	0.862	100,000	73,778	2060/3/19
第2回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.27	9,904	9,942	2037/11/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	158,133	156,300	2033/7/10
第6回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	109,304	2027/6/18
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.14	58,512	57,834	2034/2/10
第8回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	20,214	20,288	2042/12/10
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	69,312	68,282	2034/8/10
第12回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.15	11,983	12,288	2040/11/10
第24回一般担保住宅金融支援機構債券	2.6	100,000	111,975	2028/9/20
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	14,536	15,205	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	16,603	17,475	2044/6/10
第26回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	31,020	32,412	2044/7/10
第28回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.79	10,209	10,240	2040/7/10
第32回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.69	30,492	30,577	2040/7/10
第34回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	11,410	11,587	2040/9/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	21,232	22,268	2045/3/10
第35回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	20,154	21,117	2045/4/10
第36回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	19,386	20,236	2045/5/10
第37回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	10,225	10,326	2040/12/10
第39回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	41,654	43,099	2045/8/10
第40回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	22,566	22,921	2041/3/10
第41回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	10,562	10,679	2041/4/10
第42回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	25,049	25,922	2045/11/10
第43回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	24,701	25,741	2045/12/10
第43回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	112,215	2030/2/18
第44回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	71,172	74,551	2046/1/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	78,888	82,318	2046/2/10
第47回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.18	9,968	10,005	2041/10/10
第49回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	18,633	19,387	2046/6/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	19,337	20,078	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	20,244	21,029	2046/8/10

銘柄	当 期	末		
		利率	額面金額	評 価 額
	%	千円	千円	償還年月日
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	10,458	10,568	2042/4/10
第53回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	22,949	23,776	2046/10/10
第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	24,247	25,135	2046/11/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	27,069	28,040	2046/12/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	26,001	26,973	2047/2/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	36,018	36,903	2047/12/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	37,387	38,655	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	32,787	33,846	2048/3/10
第71回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	31,252	32,008	2048/4/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	32,048	32,837	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	37,382	38,707	2048/6/10
第85回一般担保住宅金融支援機構債券	1.841	100,000	110,131	2031/10/17
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	110,411	2031/11/18
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	59,958	60,281	2051/1/10
第109回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	137,028	133,628	2051/6/10
第111回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	70,248	67,733	2051/8/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	71,994	70,166	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	71,500	69,485	2051/11/10
第115回一般担保住宅金融支援機構債券	0.41	71,995	70,215	2051/12/10
第115回一般担保住宅金融支援機構債券	1.811	100,000	111,609	2032/9/14
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	72,407	70,903	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	72,846	71,180	2052/2/10
第118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	72,496	70,922	2052/3/10
第121回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	73,602	71,683	2052/6/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	75,730	73,610	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	76,792	74,454	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	75,754	73,584	2053/1/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	77,978	75,597	2053/6/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	79,300	76,619	2053/8/10
第136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	79,345	76,917	2053/9/10
第139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	79,826	77,445	2053/12/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	79,602	76,775	2054/1/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	81,552	78,237	2054/5/10
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	82,879	79,321	2054/6/10
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	84,283	80,025	2054/7/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	260,517	247,699	2054/12/10
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	261,108	249,637	2055/1/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	86,853	83,041	2055/2/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	175,438	167,174	2055/3/10
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	100,613	2025/5/20
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	90,091	86,217	2055/9/10
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	90,426	86,397	2055/10/10
第162回一般担保住宅金融支援機構債券	1.299	100,000	104,181	2035/6/20
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	91,277	87,137	2055/12/10
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	92,103	87,729	2056/1/10
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	92,058	88,340	2056/3/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	92,480	88,592	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	186,616	178,529	2056/6/10
第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	95,106	90,424	2056/10/10
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	96,027	91,623	2056/12/10
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	192,502	185,489	2057/3/10
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	97,518	93,988	2057/6/10
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	98,942	95,224	2057/9/10
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.58	198,360	192,196	2057/10/10
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	100,000	100,356	2058/1/10

銘柄	利率	期末		償還年月日
		額面金額	評価額	
	%	千円	千円	
第24回沖繩振興開発金融公庫債券	0.09	500,000	499,715	2024/6/20
第67回東日本高速道路株式会社社債	0.22	200,000	195,450	2030/1/31
第74回東日本高速道路株式会社社債	0.06	100,000	99,506	2025/12/19
第87回東日本高速道路株式会社社債	0.1	100,000	97,705	2028/12/20
第89回中日本高速道路株式会社社債	0.05	100,000	99,251	2026/5/8
第28回西日本高速道路株式会社社債	0.31	100,000	100,135	2026/2/12
第54回西日本高速道路株式会社社債	0.07	200,000	199,372	2025/6/20
第66回西日本高速道路株式会社社債	0.08	600,000	599,472	2024/5/20
第70回西日本高速道路株式会社社債	0.08	200,000	199,672	2024/10/15
第66回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.086	100,000	103,665	2029/5/29
小計		20,282,234	20,726,695	
金融債券				
い第829号商工債	0.13	100,000	99,964	2024/6/27
い第832号商工債	0.06	300,000	299,523	2024/9/27
い第835号商工債	0.05	200,000	199,558	2024/12/27
い第845号商工債	0.12	200,000	199,664	2025/10/27
い第853号商工債	0.09	100,000	99,492	2026/6/26
第376回信中金債(5年)	0.05	200,000	199,180	2026/3/27
第379回信中金債(5年)	0.04	100,000	99,440	2026/6/26
第386回信中金債(5年)	0.05	100,000	99,175	2027/1/27
小計		1,300,000	1,295,996	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第500回中部電力株式会社社債	0.875	100,000	100,820	2024/5/24
第535回中部電力株式会社社債	0.26	200,000	191,582	2029/11/22
第509回関西電力株式会社社債	0.47	100,000	99,264	2027/5/25
第510回関西電力株式会社社債	0.49	100,000	99,281	2027/7/23
第536回関西電力株式会社社債	0.44	100,000	95,322	2030/12/20
第541回関西電力株式会社社債	0.37	100,000	94,026	2031/9/19
第554回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	99,888	2025/10/24
第393回中国電力株式会社社債	0.26	100,000	98,943	2026/11/25
第425回中国電力株式会社社債	0.37	100,000	95,959	2030/6/25
第426回中国電力株式会社社債	0.33	100,000	95,535	2030/7/25
第445回中国電力株式会社社債	0.45	100,000	99,731	2026/9/25
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	102,038	2026/6/25
第321回北陸電力株式会社社債	0.365	100,000	99,213	2027/4/23
第508回東北電力株式会社社債	0.465	100,000	97,461	2029/4/25
第521回東北電力株式会社社債	0.45	100,000	96,485	2030/5/24
第535回東北電力株式会社社債	0.2	200,000	193,912	2028/7/25
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	97,942	2028/8/25
第507回九州電力株式会社社債	0.644	200,000	193,252	2032/5/25
第323回北海道電力株式会社社債	1.337	100,000	102,803	2030/3/25
第357回北海道電力株式会社社債	0.475	100,000	97,491	2029/5/25
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,163	2027/11/30
第21回西松建設株式会社無担保社債	0.6	100,000	98,634	2029/3/1
第5回五洋建設株式会社無担保社債	0.25	100,000	99,773	2025/10/14
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.08	200,000	198,516	2026/6/3
第3回高砂熱工業株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,373	2026/7/16
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	100,003	2025/12/5
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	100,000	99,060	2026/6/3
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	100,000	99,855	2024/2/23
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	99,872	2025/8/29
第10回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	100,000	99,809	2027/2/26
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	98,754	2030/4/22

銘柄	利率	期末		償還年月日
		額面金額	評価額	
	%	千円	千円	
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	100,000	99,673	2025/12/19
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,672	2027/7/16
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	100,000	99,782	2024/9/6
第19回旭化成株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,011	2025/12/5
第13回イビデン株式会社無担保社債	0.29	100,000	99,805	2025/9/12
第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	0.17	100,000	99,690	2025/9/3
第12回J S R株式会社無担保社債	0.544	100,000	98,821	2029/8/31
第22回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.32	100,000	99,690	2026/6/9
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	100,000	98,927	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	100,000	99,786	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	99,159	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	85,229	2041/6/3
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	100,000	98,536	2030/7/8
第16回田舎薬品工業株式会社無担保社債	0.4	200,000	189,194	2031/10/14
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	0.26	200,000	200,006	2025/12/5
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	100,000	99,893	2024/5/31
第3回株式会社ツムラ無担保社債	0.824	100,000	98,962	2029/9/7
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	95,697	2029/7/31
第18回楽天グループ株式会社無担保社債	1.05	100,000	82,673	2031/12/2
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	98,968	2032/6/15
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	98,467	2029/4/19
第9回住友理工株式会社無担保社債	0.455	100,000	99,559	2027/9/21
第11回日本電気碍子株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,807	2026/5/29
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.385	100,000	98,947	2028/6/20
第34回JFEホールディングス株式会社無担保社債	0.25	100,000	99,951	2025/7/14
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	0.425	100,000	99,429	2027/9/1
第34回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.315	100,000	99,297	2027/10/14
第14回株式会社LIXIL無担保社債	0.475	100,000	99,410	2027/8/27
第10回株式会社荏原製作所無担保社債	0.19	100,000	99,527	2025/10/22
第11回株式会社荏原製作所無担保社債	0.24	100,000	99,719	2025/10/14
第53回日本精工株式会社無担保社債	0.445	100,000	99,406	2027/9/3
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	97,687	2030/3/12
第23回パナソニック株式会社無担保社債	0.39	100,000	96,367	2030/12/24
第37回ユニグループ株式会社無担保社債	0.28	300,000	300,033	2025/12/8
第8回TDK株式会社無担保社債	0.15	100,000	98,946	2026/12/2
第1回株式会社東海理化電機製作所無担保社債	0.34	100,000	98,925	2027/6/7
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,583	2026/2/4
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,786	2025/3/13
第7回楽天カード株式会社無担保社債	0.83	100,000	95,907	2028/12/15
第1回オリエント銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,401	2026/3/11
第6回日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	86,097	2040/3/9
第69回三井物産株式会社無担保社債	2.139	100,000	110,843	2031/7/22
第60回住友商事株式会社無担保社債	0.574	100,000	98,006	2032/5/24
第8回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.29	100,000	98,002	2028/4/14
第22回三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債(劣後特)	0.61	100,000	97,541	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	99,072	2027/9/2
第9回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債(劣後特約付)	2.2	100,000	105,242	2026/10/30

銘柄	当期		期末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
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	100,484	2024/9/12
第2回5回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	105,194	2026/6/1
第2回3回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	100,000	98,926	2026/12/11
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,716	2025/12/19
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.38	100,000	97,807	2030/9/20
第3回4回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.22	100,000	97,381	2028/7/21
第5回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,501	2026/6/19
第6回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.16	100,000	99,620	2025/9/19
第7回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.25	200,000	199,714	2025/9/19
第9回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.11	100,000	99,751	2025/10/21
第9回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,942	2025/10/21
第1回6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	99,320	2025/6/24
第1回7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	98,957	2026/7/31
第3回0回株式会社ジャックス無担保社債	0.28	100,000	99,249	2026/1/27
第3回5回株式会社ジャックス無担保社債	0.25	100,000	98,570	2026/12/9
第5回0日立キャピタル株式会社無担保社債	0.888	100,000	100,732	2024/3/19
第5回5日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	101,704	2026/9/18
第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.37	100,000	95,278	2031/12/1
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,223	2026/7/10
第8回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,191	2026/1/21
第3回4回トヨタホールディングス株式会社無担保社債	0.28	100,000	98,405	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	299,463	2025/9/5
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	100,000	99,146	2026/11/13
第1回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	0.425	100,000	99,575	2027/10/14
第4回7回三井不動産株式会社無担保社債	1.954	100,000	110,245	2032/12/20
第7回8回三井不動産株式会社無担保社債	0.81	100,000	88,220	2040/4/27
第8回3回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	108,750	2027/9/17
第11回8回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,528	2026/12/18
第1回3回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	86,893	2039/8/5
第9回7回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	100,831	2024/4/26
第3回4回東京急行株式会社無担保社債	0.34	100,000	97,123	2030/6/10
第4回5回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	87,551	2049/12/3
第8回4回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	87,378	2039/6/20
第8回6回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	78,215	2049/12/3
第4回2回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	87,932	2040/5/25
第4回9回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.26	100,000	107,617	2027/4/16
第6回7回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.249	100,000	111,147	2030/3/22
第1回2回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.302	100,000	82,896	2058/1/25
第1回3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	81,255	2058/9/27
第1回6回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.596	100,000	84,661	2041/4/15

銘柄	当期		期末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
第1回7回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.993	100,000	71,623	2061/12/16
第1回10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.21	100,000	102,295	2024/3/20
第4回6回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	76,500	2056/12/13
第5回10回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.033	100,000	84,304	2047/11/29
第5回1回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	100,000	110,830	2030/4/23
第7回1回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	103,532	2044/10/28
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	108,820	2027/12/20
第1回0回東京地下鉄株式会社社債	2.23	100,000	111,157	2030/3/19
第1回3回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	109,909	2032/5/25
第3回1回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	81,819	2058/5/24
第5回6回東京地下鉄株式会社社債	1.066	100,000	82,743	2052/2/28
第4回5回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	200,000	197,438	2031/3/4
第5回8回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.09	100,000	99,331	2026/2/26
第4回株式会社日立物流無担保社債	0.33	100,000	99,107	2026/9/28
第2回5回KDDI株式会社無担保社債	0.395	200,000	197,686	2028/11/22
第1回1回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.3	200,000	198,134	2026/6/3
第1回7回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.51	100,000	97,168	2029/1/26
第3回1回株式会社光通信無担保社債	1.38	100,000	84,109	2036/2/1
第3回7回株式会社光通信無担保社債	1.33	100,000	81,145	2036/1/4
第5回6回電源開発株式会社無担保社債	0.54	100,000	93,480	2033/5/20
第5回7回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	97,683	2028/7/20
第3回1回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	100,000	97,808	2029/10/9
第3回8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	200,000	199,174	2025/7/16
第3回9回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	100,000	97,760	2030/7/16
第4回1回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.64	100,000	98,915	2026/10/8
第4回2回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	97,747	2032/10/8
第4回8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	200,000	174,996	2036/8/29
第3回8回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.984	100,000	106,277	2043/12/17
第4回1回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	100,000	95,464	2031/6/3
第4回2回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	84,473	2041/6/3
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	100,000	99,394	2028/6/6
第2回4回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.384	100,000	99,369	2024/10/11
第2回9回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.25	100,000	99,313	2024/10/10
第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・ユー非上位円貨社債	0.499	100,000	98,736	2024/12/12
第1回バンコ・ナンタンデル・エセ・ア円貨社債	0.463	200,000	197,748	2024/12/5
小計		17,000,000	16,585,969	
合計		378,378,534	379,079,526	

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 379,079,526	99.6%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,391,878	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	380,471,404	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 2023年1月23日現在
(A) 資 産	380,571,451,606円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	385,864,811
公 社 債(評価額)	379,079,526,393
未 収 入 金	298,378,000
未 収 利 息	691,571,857
前 払 費 用	16,063,545
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B) 負 債	629,864,297
未 払 金	306,754,000
未 払 解 約 金	223,063,154
未 払 利 息	143
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	379,941,587,309
元 本	289,563,258,941
次 期 繰 越 損 益 金	90,378,328,368
(D) 受 益 権 総 口 数	289,563,258,941口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,121円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2022年1月25日 至 2023年1月23日
(A) 配 当 等 収 益	2,917,648,794円
受 取 利 息	2,917,924,077
支 払 利 息	△275,283
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△20,046,071,238
売 買 益	69,757,283
売 買 損	△20,115,828,521
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,999,080
取 引 益	7,054,260
取 引 損	△5,055,180
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△17,126,423,364
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	104,965,797,065
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,042,243,534
(G) 解 約 差 損 益 金	△5,503,288,867
(H) 計 (D+E+F+G)	90,378,328,368
次 期 繰 越 損 益 金(H)	90,378,328,368

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は282,089,625,994円、期中追加設定元本額は23,748,427,399円、期中一部解約元本額は16,274,794,452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 99,617,000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。

インデックスコレクション (バランス株式30)	63,043,976,740円
私募日本債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	51,565,971,502円
DC日本債券インデックスファンドL	44,711,842,375円
インデックスコレクション (国内債券)	37,602,711,804円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	22,158,467,002円
DCバランスファンド30	12,234,780,573円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	10,928,483,175円
DCバランスファンド50	8,610,494,319円
インデックスコレクション (バランス株式50)	6,994,391,691円
日本債券パッシブファンド私募A (適格機関投資家専用)	4,457,356,559円
インデックスコレクション (バランス株式70)	3,044,226,931円
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	2,929,264,806円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	2,892,784,948円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	2,767,480,846円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	2,669,911,096円
DCバランスファンド70	2,503,755,793円
DC日本債券インデックスファンド	1,927,801,871円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	1,346,405,225円
日本債券インデックスe	1,064,765,773円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	954,009,055円
日本債券インデックスファンド	781,730,850円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	776,965,469円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	748,838,819円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	544,129,320円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	431,179,809円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	338,373,432円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	323,219,718円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	249,379,781円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	152,143,142円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	148,956,243円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	129,048,645円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	123,783,577円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	122,970,347円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	110,339,178円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	79,115,043円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	53,022,542円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	38,179,872円
私募日本債券インデックスファンドAL (適格機関投資家専用)	3,001,070円

お知らせ

該当事項はありません。