

○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	無期限	
運用方針	・日本の公社債等を投資対象とする「日本債券インデックス・マザーファンド」受益証券に投資することにより、中長期的にNOMURA-BPI総合に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。	
主要運用対象	ベビーフンド	日本債券インデックス・マザーファンド受益証券
	マザーファンド	わが国の公社債等
組入制限	ベビーフンド	・マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 ・公社債への実質投資割合には制限を設けません。 ・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	マザーファンド	・公社債への投資割合には制限を設けません。 ・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は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設けません。
分配方針	毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。 ①分配対象額の範囲 経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等の範囲内とします。 ②分配対象収益についての分配方針 分配金額は委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 ③留保益の運用方針 特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

STATE STREET GLOBAL ADVISORS

SSGAインデックス・シリーズ・ライト
ステート・ストリート
国内債券インデックス・オープン
(隔月分配型)

第2作成期 運用報告書(全体版)

第2期 (決算日2024年5月7日)

第3期 (決算日2024年7月5日)

第4期 (決算日2024年9月5日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申しあげます。

この度、「ステート・ストリート国内債券インデックス・オープン(隔月分配型)」は、2024年9月5日に第4期の決算を行いましたので、第2期～第4期の運用状況をまとめてご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間 (営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎設定以来の運用実績

決算期		基準価額			<ベンチマーク> NOMURA-BPI総合		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率				
第1 作成 期	(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
	'24年 1月11日	10,000	-	-	10,000	-	-	-	1
	1期('24年 3月 5日)	9,908	6	△0.9	9,919	△0.8	99.3	-	1
第2 作成 期	2期('24年 5月 7日)	9,759	6	△1.4	9,785	△1.4	99.5	-	2
	3期('24年 7月 5日)	9,597	6	△1.6	9,636	△1.5	99.4	-	2
	4期('24年 9月 5日)	9,730	6	1.4	9,779	1.5	99.4	-	2

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合で、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、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よって計算、公表されている投資収益指数で、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の知的財産です。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、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

◎ 当作成期中の基準価額と市況等の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		<ベンチマーク> NOMURA-BPI総合		債 券 組入比率	債 券 先物比率
			騰 落 率		騰 落 率		
第2期	(期 首) '24年 3月 5日	円 9,908	% -	9,919	% -	% 99.3	% -
	3月末	9,885	△0.2	9,901	△0.2	99.9	-
	4月末	9,768	△1.4	9,790	△1.3	99.5	-
	(期 末) '24年 5月 7日	9,765	△1.4	9,785	△1.4	99.5	-
第3期	(期 首) '24年 5月 7日	9,759	-	9,785	-	99.5	-
	5月末	9,602	△1.6	9,632	△1.6	100.0	-
	6月末	9,627	△1.4	9,659	△1.3	100.1	-
	(期 末) '24年 7月 5日	9,603	△1.6	9,636	△1.5	99.4	-
第4期	(期 首) '24年 7月 5日	9,597	-	9,636	-	99.4	-
	7月末	9,610	0.1	9,649	0.1	99.5	-
	8月末	9,720	1.3	9,762	1.3	99.4	-
	(期 末) '24年 9月 5日	9,736	1.4	9,779	1.5	99.4	-

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合で、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

(注4) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

当作成期の運用実績

(2024年3月6日から2024年9月5日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注1) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、前作成期末の基準価額にあわせて委託会社が独自に指数化したものです。
 (注2) 基準価額は、分配金(税込み)を再投資したものと計算しています。

決算期	作成期首 基準価額 (分配落ち)	作成期末 基準価額 (分配落ち)	税込み 分配金累計	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第2作成期	9,908円	9,730円	18円	-1.6%	-1.4%

当作成期末の基準価額は9,730円となり、期間中の分配金を再投資したものと計算すると、前作成期末の9,908円に比べて160円の下落となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の動きをほぼ反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-1.6%となり、ベンチマークの騰落率(-1.4%)を0.2%下回りました。主な要因は以下の通りです。

【ベンチマークとの差異の要因】

ベンチマーク騰落率との差異は運用管理コストや売買コスト等が理由として挙げられます。

収益分配金

第2期から第4期における収益分配金は基準価額の水準、市況動向などを勘案した結果、1万口当たりそれぞれ6円(税込み)としております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行う方針です。

投資環境

(2024年3月6日から2024年9月5日まで)

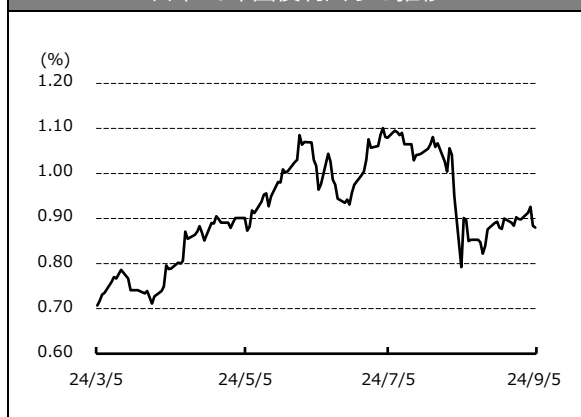
日本債券市場

日本債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

当作成期は、円安進行などを背景とした日銀の金融政策正常化観測や底堅い米景気や根強いインフレを受けた米利下げ先送り観測などから、金利は上昇基調で推移しました。期末に米景気減速懸念や日本株の大幅下落を受けて投資家のリスク回避姿勢が強まる中、金利は大幅低下しましたが、その後は米景気に対する過度な懸念が和らぎ、投資家のリスク許容度が改善する中、債券が売られました。

日本10年国債利回りは期初の0.71%から0.17%上昇の0.88%となりました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2024年3月6日から2024年9月5日まで)

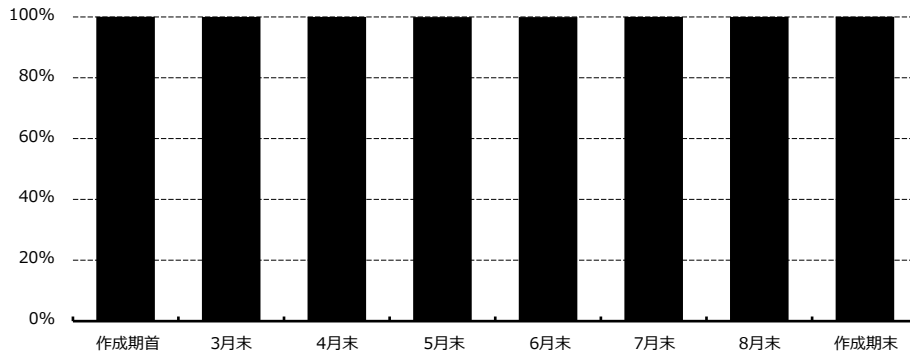
当ファンドは「日本債券インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ちます。

マザーファンドは、わが国の公社債等を主要投資対象とし、中長期的にNOMURA-BPI総合に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行うことを基本的な運用方針としています。公社債への投資は原則として高位を維持します。

マザーファンドの組入状況

当作成期も、設定・解約に伴う一時的な増減を除き、マザーファンドを高位に組み入れました。

マザーファンド組入比率の推移



今後の運用方針

今後も引き続き、マザーファンドを通じて、主としてわが国の公社債等に投資することにより、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指します。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当学期 (2024年3月6日~2024年9月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	9,702円	-	作成期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	5円	0.054%	(a)信託報酬 = 作成期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投信会社)	(2)	(0.022)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(2)	(0.022)	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
(受託会社)	(1)	(0.010)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	2	0.016	(b)その他費用 = 作成期中のその他費用÷作成期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.002)	・ 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(印刷費用等)	(1)	(0.014)	・ 印刷費用等は、法定書類等の作成、印刷、交付等に要する費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ その他は、金銭信託手数料
合 計	7円	0.070%	

(注1) 作成期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

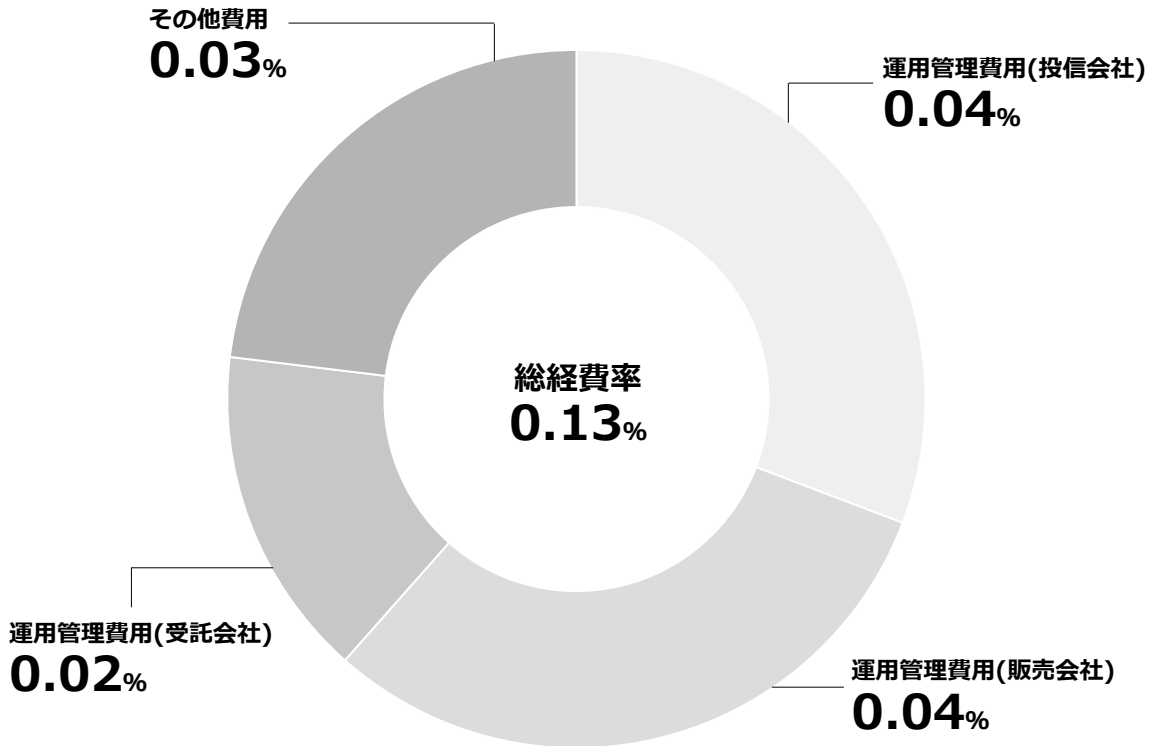
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当作成期中の運用・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。)を作成期中の平均受益権口数に作成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**0.13%**です。



(注1) 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) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

(注5) 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('24年3月6日から'24年9月5日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

決算期	当 作 成 期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本債券インデックス・マザーファンド	千口 2,517	千円 3,037	千口 1,112	千円 1,345

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('24年3月6日から'24年9月5日まで)

○公社債(日本債券インデックス・マザーファンドにおける主要な売買銘柄)

当 作 成 期			
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第168回 利付国債(5年)	599,058	第340回 利付国債(10年)	1,213,026
第461回 利付国債(2年)	500,550	第153回 利付国債(5年)	1,191,420
第169回 利付国債(5年)	378,411	第359回 利付国債(10年)	1,079,463
第374回 利付国債(10年)	342,427	第366回 利付国債(10年)	970,818
第459回 利付国債(2年)	299,724	第339回 利付国債(10年)	903,115
第188回 利付国債(20年)	287,793	第345回 利付国債(10年)	797,712
第366回 利付国債(10年)	285,540	第358回 利付国債(10年)	785,560
第171回 利付国債(5年)	268,682	第144回 利付国債(5年)	699,635
第375回 利付国債(10年)	254,407	第342回 利付国債(10年)	698,768
第166回 利付国債(5年)	200,440	第150回 利付国債(5年)	695,001

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('24年3月6日から'24年9月5日まで)

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

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

◎自社による当ファンドの設定・解約状況

当作成期設定元本	当作成期解約元本	当作成期末残高(元本)	取引の理由
千円 -	千円 -	千円 1,000	当初設定時における取得

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎組入資産の明細('24年9月5日現在)

○親投資信託残高

種 類	前作成期末(第1期末)	当作成期末(第4期末)	
	口 数	口 数	評価額
日本債券インデックス・マザーファンド	千口 946	千口 2,352	千円 2,833

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当作成期末における日本債券インデックス・マザーファンド全体の口数は58,510,974千口です。

当作成期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('24年9月5日現在)

項 目	当作成期末(第4期末)	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックス・マザーファンド	千円 2,833	% 96.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	103	3.5
投 資 信 託 財 産 総 額	2,936	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

項 目	('24年5月7日現在)	('24年7月5日現在)	('24年9月5日現在)
	第2期末	第3期末	第4期末
	円	円	円
(A) 資 産	2,046,342	2,446,398	2,936,566
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	3,164	5,964	53,263
日 本 債 券 イ ン デ ッ ク ス ・ マ ザ ー フ ァ ン ド (評 価 額)	2,043,178	2,342,905	2,833,953
未 収 入 金	-	97,529	49,350
(B) 負 債	1,718	102,948	103,378
未 払 収 益 分 配 金	1,257	1,465	1,747
未 払 解 約 金	100	100,927	100,850
未 払 信 託 報 酬	278	364	442
そ の 他 未 払 費 用	83	192	339
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	2,044,624	2,343,450	2,833,188
元 本	2,095,207	2,441,765	2,911,906
次 期 繰 越 損 益 金	△ 50,583	△ 98,315	△ 78,718
(D) 受 益 権 総 口 数	2,095,207口	2,441,765口	2,911,906口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	9,759円	9,597円	9,730円

(注) 作成期首元本額 1,167,092円
 作成期中追加設定元本額 3,449,254円
 作成期中一部解約元本額 1,704,440円

◎損益の状況

第2期(自'24年3月6日 至'24年5月7日)、第3期(自'24年5月8日 至'24年7月5日)、第4期(自'24年7月6日 至'24年9月5日)

項 目	第2期 円	第3期 円	第4期 円
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 19,486	△ 30,750	34,023
売 買 益	3,572	2,487	41,227
売 買 損	△ 23,058	△ 33,237	△ 7,204
(B) 信 託 報 酬 等	△ 361	△ 473	△ 589
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	△ 19,847	△ 31,223	33,434
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 5,204	△ 22,304	△ 45,951
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 24,275	△ 43,323	△ 64,454
(配 当 等 相 当 額)	(1,033)	(3,410)	(5,847)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 25,308)	(△ 46,733)	(△ 70,301)
(F) 計 (C+D+E)	△ 49,326	△ 96,850	△ 76,971
(G) 収 益 分 配 金	△ 1,257	△ 1,465	△ 1,747
次 期 繰 越 損 益 金 (F + G)	△ 50,583	△ 98,315	△ 78,718
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 24,275	△ 43,323	△ 64,454
(配 当 等 相 当 額)	(2,474)	(3,982)	(6,508)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 26,749)	(△ 47,305)	(△ 70,962)
分 配 準 備 積 立 金	1,633	3,080	5,191
繰 越 損 益 金	△ 27,941	△ 58,072	△ 19,455

(注1) (A)有価証券売買損益は、各期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (B)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (D)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (E)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。期首金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

項 目	第 2 期	第 3 期	第 4 期
A 費用控除後の配当等収益	2,475 円	3,159 円	4,362 円
B 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0 円	0 円	0 円
C 収益調整金	2,474 円	3,982 円	6,508 円
D 分配準備積立金	415 円	1,386 円	2,576 円
E 分配対象収益(A+B+C+D)	5,364 円	8,527 円	13,446 円
F 分配対象収益(1万口当たり)	25 円	34 円	46 円
G 分配金	1,257 円	1,465 円	1,747 円
H 分配金(1万口当たり)	6 円	6 円	6 円

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第2期 (2024年3月6日～ 2024年5月7日)	第3期 (2024年5月8日～ 2024年7月5日)	第4期 (2024年7月6日～ 2024年9月5日)
当期分配金	6円	6円	6円
(対基準価額比率)	0.061%	0.062%	0.062%
当期の収益	6円	6円	6円
当期の収益以外	-円	-円	-円
翌期繰越分配対象額	19円	28円	40円

(注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎当作成期の分配金のお知らせ

決 算 期	第 2 期	第 3 期	第 4 期
1万口当たり分配金	6円	6円	6円

日本債券インデックス・マザーファンド

第21期 運用報告書 (決算日2024年3月5日)

日本債券インデックス・マザーファンドの第21期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ 中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合に連動した投資成果をめざして運用を行います。 ・ 公社債の組入比率は原則として高位を維持します。
主要運用対象	わが国の公社債等
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 公社債への投資割合には制限を設けません。 ・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は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。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

〒105-6325 東京都港区虎ノ門一丁目23番1号 虎ノ門ヒルズ森タワー25階

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		＜ベンチマーク＞ NOMURA-BPI総合		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
17期('20年 3月 5日)	13,065	1.9	13,072	1.9	99.2	-	165,138
18期('21年 3月 5日)	12,831	△1.8	12,839	△1.8	99.4	-	160,991
19期('22年 3月 7日)	12,762	△0.5	12,766	△0.6	99.6	-	181,773
20期('23年 3月 6日)	12,260	△3.9	12,265	△3.9	99.6	-	171,874
21期('24年 3月 5日)	12,224	△0.3	12,219	△0.4	99.3	-	95,601

(注1) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合で、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。
NOMURA-BPI総合とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、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よって計算、公表されている投資収益指数で、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の知的財産です。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、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		＜ベンチマーク＞ NOMURA-BPI総合		債券 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) '23年 3月 6日	12,260	-	12,265	-	99.6	-
3月末	12,464	1.7	12,471	1.7	99.8	-
4月末	12,496	1.9	12,500	1.9	99.8	-
5月末	12,488	1.9	12,489	1.8	99.9	-
6月末	12,520	2.1	12,523	2.1	100.5	-
7月末	12,326	0.5	12,328	0.5	99.6	-
8月末	12,238	△0.2	12,239	△0.2	99.7	-
9月末	12,151	△0.9	12,151	△0.9	99.8	-
10月末	11,959	△2.5	11,958	△2.5	99.6	-
11月末	12,211	△0.4	12,209	△0.5	99.7	-
12月末	12,262	0.0	12,260	△0.0	99.7	-
'24年 1月末	12,174	△0.7	12,172	△0.8	100.1	-
2月末	12,215	△0.4	12,210	△0.4	100.0	-
(期末) '24年 3月 5日	12,224	△0.3	12,219	△0.4	99.3	-

(注1) 騰落率は期首比です。

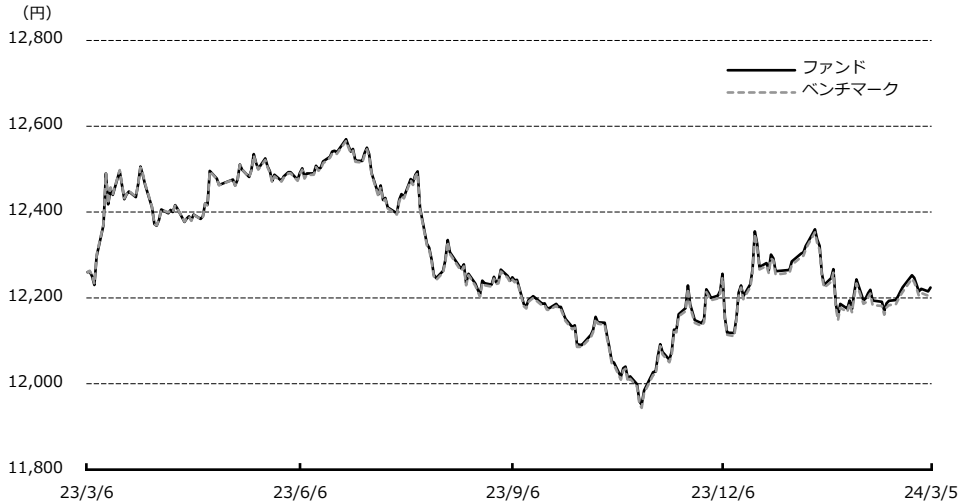
(注2) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合で、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

当期の運用実績

(2023年3月7日から2024年3月5日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、前期末の基準価額にあわせて指数化しています。

当期末の基準価額は12,224円となり、前期末の12,260円に比べて36円の下落となりました。

基準価額の変動要因

ベンチマーク(NOMURA-BPI総合)の動きをほぼ反映して、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境」をご参照ください。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-0.3%となり、ベンチマークの騰落率(-0.4%)と同水準となりました。

投資環境

(2023年3月7日から2024年3月5日まで)

日本債券市場

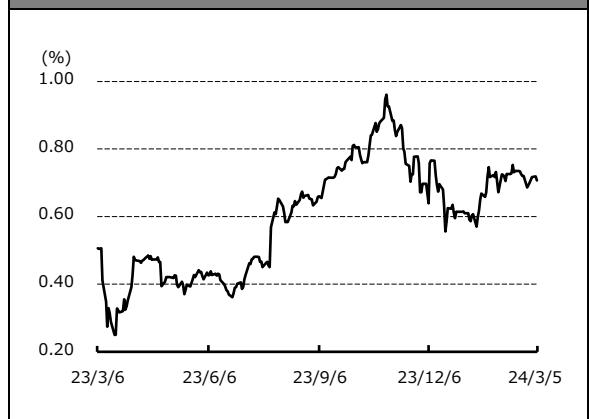
日本債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

期前半は、序盤に米地方銀行の経営破綻に伴う金融不安から債券が買われる場面がありましたが、米欧の金融当局の対応を受けて投資家のリスク回避姿勢が後退すると債券利回りに上昇圧力がかかりました。その後は小動きの展開となりましたが、7月末に日銀が長短金利操作(イールドカーブ・コントロール、YCC)の運用を柔軟化すると債券が大きく売られました。

期後半は、序盤は米国の金融引き締め長期化観測や日銀によるYCCの再修正を受けて債券が売られる展開となりました。その後は米国の利上げ終了や2024年の利下げ観測が高まる中、債券利回りが低下しましたが、期末にかけて早期の米利下げ観測が後退する中、債券が売られる展開となりました。

日本10年国債利回りは前期末から0.20%上昇の0.71%となりました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2023年3月7日から2024年3月5日まで)

当マザーファンドは、主としてわが国の公社債などを主要投資対象としNOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指した運用を行うことを基本的な運用方針としています。公社債への投資は原則として高位を維持し、外貨建資産に対する投資は行いません。

当期も、NOMURA-BPI総合の収益率を捉える目的で、層化抽出法の発想に従って、ファンドのセクター配分や、デュレーション(金利感応度)、債券の満期構成などをベンチマークに合致させるように努めつつ、非国債の個別発行体リスクを厳格にコントロールしながら、インデックス構成銘柄のわが国の公社債券に分散投資しました。

インデックスの構成銘柄変更のタイミングに合わせて、各月末にファンドのリスク特性をベンチマークに合わせるべくリバランス(銘柄の入れ替え)を行うとともに、月中における資金流入出に対応した取引や、ファンドで受け取った利金の再投資も行いました。

組入銘柄数は、当期を通じて銘柄分散を保ち、約450から500銘柄での運用を継続しました。ファンドにおける個別発行体の分散度に関しても、安定的な運用が十分可能な水準を引き続き維持しております。債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

今後の運用方針

今後も引き続き、主としてわが国の公社債などに投資することにより、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指します。

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2023年3月7日~2024年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	12,292円	-	期中の平均基準価額です。
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	(a) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 ・その他は、金銭信託手数料
合 計	0円	0.000%	

(注1) 期中の費用(消費税等のかかるものは消費税等を含みます)は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注2) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含みます)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、各項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しています。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('23年3月7日から'24年3月5日まで)

○公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 23,144,122	千円 84,065,181
	地 方 債 証 券	214,679	4,585,346 (139,000)
	特 殊 債 券	299,440	6,448,347 (512,813)
	社 債 券	398,137	2,960,094 (300,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれていません。

(注4) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('23年3月7日から'24年3月5日まで)

○公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第370回 利付国債(10年)	2,048,111	第146回 利付国債(5年)	2,157,804
第371回 利付国債(10年)	1,270,553	第145回 利付国債(5年)	1,801,860
第 1 回 クライメート・トランジション利付国債(10年)	1,195,440	第370回 利付国債(10年)	1,737,047
第372回 利付国債(10年)	1,060,601	第369回 利付国債(10年)	1,618,786
第157回 利付国債(5年)	1,005,963	第141回 利付国債(5年)	1,604,512
第160回 利付国債(5年)	999,040	第154回 利付国債(5年)	1,603,552
第158回 利付国債(5年)	951,045	第147回 利付国債(5年)	1,600,576
第451回 利付国債(2年)	799,942	第439回 利付国債(2年)	1,552,176
第361回 利付国債(10年)	781,834	第148回 利付国債(5年)	1,502,220
第184回 利付国債(20年)	763,057	第364回 利付国債(10年)	1,441,055

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('23年3月7日から'24年3月5日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

◎組入資産の明細('24年3月5日現在)

○国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額面金額	評 価 額	組入比率	組入比率 (うちBB格以下)	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	80,000,000 (200,000)	79,123,059 (198,977)	82.8 (0.2)	- (-)	55.1 (-)	20.9 (0.1)	6.7 (0.1)
地 方 債 証 券	5,271,340 (5,271,340)	5,340,130 (5,340,130)	5.6 (5.6)	- (-)	3.1 (3.1)	1.9 (1.9)	0.6 (0.6)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	5,312,691 (5,212,691)	5,347,579 (5,239,356)	5.6 (5.5)	- (-)	3.1 (3.1)	1.9 (1.8)	0.6 (0.6)
金 融 債 証 券	300,000 (300,000)	297,461 (297,461)	0.3 (0.3)	- (-)	- (-)	0.3 (0.3)	- (-)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	5,010,000 (4,910,000)	4,815,204 (4,714,709)	5.0 (4.9)	- (-)	2.6 (2.6)	2.0 (2.0)	0.4 (0.3)
合 計	95,894,031 (15,894,031)	94,923,434 (15,790,634)	99.3 (16.5)	- (-)	64.0 (8.9)	27.0 (6.0)	8.3 (1.6)

(注1) 評価については、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注4) 格付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。

(注5) 金額の単位未満は切り捨てています。

○国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

種 類	銘 柄 名		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
国 債 証 券	第447回	利付国債(2年)	0.005	200,000	199,934	2025/ 4 / 1
	第448回	利付国債(2年)	0.005	100,000	99,948	2025/ 5 / 1
	第449回	利付国債(2年)	0.005	150,000	149,896	2025/ 6 / 1
	第450回	利付国債(2年)	0.005	200,000	199,814	2025/ 7 / 1
	第451回	利付国債(2年)	0.005	800,000	799,096	2025/ 8 / 1
	第452回	利付国債(2年)	0.005	400,000	399,372	2025/ 9 / 1
	第456回	利付国債(2年)	0.1	100,000	99,899	2026/ 1 / 1
	第457回	利付国債(2年)	0.1	500,000	499,425	2026/ 2 / 1
	第144回	利付国債(5年)	0.1	700,000	700,224	2025/ 6 / 20
	第149回	利付国債(5年)	0.005	1,000,000	995,690	2026/ 9 / 20
	第150回	利付国債(5年)	0.005	1,100,000	1,094,643	2026/12/20
	第151回	利付国債(5年)	0.005	900,000	895,104	2027/ 3 / 20
	第152回	利付国債(5年)	0.1	300,000	299,229	2027/ 3 / 20
	第153回	利付国債(5年)	0.005	1,500,000	1,490,190	2027/ 6 / 20
	第155回	利付国債(5年)	0.3	100,000	100,168	2027/12/20
	第156回	利付国債(5年)	0.2	250,000	249,482	2027/12/20
	第157回	利付国債(5年)	0.2	500,000	498,300	2028/ 3 / 20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第158回 利付国債(5年)	0.1	250,000	248,152	2028/ 3 /20
	第160回 利付国債(5年)	0.2	400,000	398,220	2028/ 6 /20
	第161回 利付国債(5年)	0.3	200,000	199,956	2028/ 6 /20
	第162回 利付国債(5年)	0.3	150,000	149,797	2028/ 9 /20
	第163回 利付国債(5年)	0.4	150,000	150,469	2028/ 9 /20
	第164回 利付国債(5年)	0.2	150,000	148,903	2028/12/20
	第165回 利付国債(5年)	0.3	500,000	498,700	2028/12/20
	第 1 回 クライメート・トランジション利付国債(5年)	0.3	600,000	598,440	2028/12/20
	第 32 回 利付国債(30年)	2.3	500,000	579,425	2040/ 3 /20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	200,000	221,944	2030/ 3 /20
	第 1 回 利付国債(40年)	2.4	160,000	186,099	2048/ 3 /20
	第 2 回 利付国債(40年)	2.2	300,000	336,081	2049/ 3 /20
	第 3 回 利付国債(40年)	2.2	250,000	279,625	2050/ 3 /20
	第 4 回 利付国債(40年)	2.2	250,000	278,572	2051/ 3 /20
	第 5 回 利付国債(40年)	2.0	130,000	138,854	2052/ 3 /20
	第 6 回 利付国債(40年)	1.9	150,000	156,288	2053/ 3 /20
	第 7 回 利付国債(40年)	1.7	160,000	158,736	2054/ 3 /20
	第 8 回 利付国債(40年)	1.4	100,000	91,851	2055/ 3 /20
	第 9 回 利付国債(40年)	0.4	190,000	127,282	2056/ 3 /20
	第 10 回 利付国債(40年)	0.9	150,000	117,760	2057/ 3 /20
	第 11 回 利付国債(40年)	0.8	90,000	67,784	2058/ 3 /20
	第 12 回 利付国債(40年)	0.5	200,000	133,652	2059/ 3 /20
	第 13 回 利付国債(40年)	0.5	460,000	303,416	2060/ 3 /20
	第 14 回 利付国債(40年)	0.7	510,000	358,626	2061/ 3 /20
	第 15 回 利付国債(40年)	1.0	400,000	309,904	2062/ 3 /20
	第 16 回 利付国債(40年)	1.3	260,000	220,584	2063/ 3 /20
	第 1 回 クライメート・トランジション利付国債(10年)	0.7	1,200,000	1,200,540	2033/12/20
	第339回 利付国債(10年)	0.4	900,000	903,762	2025/ 6 /20
	第340回 利付国債(10年)	0.4	1,210,000	1,215,299	2025/ 9 /20
	第341回 利付国債(10年)	0.3	200,000	200,554	2025/12/20
	第342回 利付国債(10年)	0.1	800,000	798,936	2026/ 3 /20
	第343回 利付国債(10年)	0.1	400,000	399,360	2026/ 6 /20
	第344回 利付国債(10年)	0.1	700,000	698,670	2026/ 9 /20
	第345回 利付国債(10年)	0.1	1,000,000	997,770	2026/12/20
	第346回 利付国債(10年)	0.1	800,000	797,944	2027/ 3 /20
	第347回 利付国債(10年)	0.1	750,000	747,420	2027/ 6 /20
	第348回 利付国債(10年)	0.1	900,000	895,887	2027/ 9 /20
	第349回 利付国債(10年)	0.1	500,000	497,085	2027/12/20
	第350回 利付国債(10年)	0.1	600,000	595,566	2028/ 3 /20
	第351回 利付国債(10年)	0.1	500,000	495,655	2028/ 6 /20
	第353回 利付国債(10年)	0.1	100,000	98,868	2028/12/20
	第354回 利付国債(10年)	0.1	650,000	641,790	2029/ 3 /20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第355回 利付国債(10年)	0.1	100,000	98,675	2029/ 6 /20
	第356回 利付国債(10年)	0.1	650,000	640,815	2029/ 9 /20
	第358回 利付国債(10年)	0.1	900,000	885,906	2030/ 3 /20
	第359回 利付国債(10年)	0.1	1,250,000	1,228,875	2030/ 6 /20
	第360回 利付国債(10年)	0.1	1,000,000	981,490	2030/ 9 /20
	第361回 利付国債(10年)	0.1	1,400,000	1,371,314	2030/12/20
	第362回 利付国債(10年)	0.1	300,000	293,136	2031/ 3 /20
	第363回 利付国債(10年)	0.1	830,000	808,635	2031/ 6 /20
	第364回 利付国債(10年)	0.1	200,000	194,254	2031/ 9 /20
	第365回 利付国債(10年)	0.1	900,000	872,019	2031/12/20
	第366回 利付国債(10年)	0.2	1,000,000	974,180	2032/ 3 /20
	第367回 利付国債(10年)	0.2	200,000	194,294	2032/ 6 /20
	第368回 利付国債(10年)	0.2	280,000	271,227	2032/ 9 /20
	第370回 利付国債(10年)	0.5	260,000	257,218	2033/ 3 /20
	第371回 利付国債(10年)	0.4	100,000	97,809	2033/ 6 /20
	第372回 利付国債(10年)	0.8	150,000	151,816	2033/ 9 /20
	第373回 利付国債(10年)	0.6	300,000	297,249	2033/12/20
	第 1 回 利付国債(30年)	2.8	300,000	340,146	2029/ 9 /20
	第 2 回 利付国債(30年)	2.4	380,000	425,615	2030/ 2 /20
	第 3 回 利付国債(30年)	2.3	100,000	111,809	2030/ 5 /20
	第 5 回 利付国債(30年)	2.2	100,000	112,409	2031/ 5 /20
	第 6 回 利付国債(30年)	2.4	180,000	205,846	2031/11/20
	第 7 回 利付国債(30年)	2.3	300,000	342,156	2032/ 5 /20
	第 8 回 利付国債(30年)	1.8	100,000	110,258	2032/11/22
	第 9 回 利付国債(30年)	1.4	100,000	106,859	2032/12/20
	第12回 利付国債(30年)	2.1	300,000	339,693	2033/ 9 /20
	第13回 利付国債(30年)	2.0	100,000	112,324	2033/12/20
	第14回 利付国債(30年)	2.4	100,000	116,271	2034/ 3 /20
第15回 利付国債(30年)	2.5	200,000	234,780	2034/ 6 /20	
第16回 利付国債(30年)	2.5	200,000	235,112	2034/ 9 /20	
第17回 利付国債(30年)	2.4	200,000	233,412	2034/12/20	
第18回 利付国債(30年)	2.3	200,000	231,602	2035/ 3 /20	
第19回 利付国債(30年)	2.3	200,000	231,904	2035/ 6 /20	
第20回 利付国債(30年)	2.5	100,000	118,213	2035/ 9 /20	
第21回 利付国債(30年)	2.3	200,000	232,200	2035/12/20	
第22回 利付国債(30年)	2.5	200,000	236,944	2036/ 3 /20	
第23回 利付国債(30年)	2.5	100,000	118,558	2036/ 6 /20	
第24回 利付国債(30年)	2.5	120,000	142,360	2036/ 9 /20	
第25回 利付国債(30年)	2.3	100,000	116,326	2036/12/20	
第26回 利付国債(30年)	2.4	150,000	176,358	2037/ 3 /20	
第27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	380,425	2037/ 9 /20	
第28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	356,712	2038/ 3 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第 29 回 利付国債(30年)	2.4	200,000	235,250	2038/ 9 /20
	第 30 回 利付国債(30年)	2.3	350,000	406,556	2039/ 3 /20
	第 31 回 利付国債(30年)	2.2	100,000	114,524	2039/ 9 /20
	第 33 回 利付国債(30年)	2.0	400,000	444,780	2040/ 9 /20
	第 34 回 利付国債(30年)	2.2	350,000	398,944	2041/ 3 /20
	第 35 回 利付国債(30年)	2.0	220,000	243,388	2041/ 9 /20
	第 36 回 利付国債(30年)	2.0	180,000	198,991	2042/ 3 /20
	第 37 回 利付国債(30年)	1.9	330,000	358,776	2042/ 9 /20
	第 38 回 利付国債(30年)	1.8	200,000	213,630	2043/ 3 /20
	第 39 回 利付国債(30年)	1.9	180,000	195,001	2043/ 6 /20
	第 40 回 利付国債(30年)	1.8	150,000	159,573	2043/ 9 /20
	第 41 回 利付国債(30年)	1.7	100,000	104,487	2043/12/20
	第 42 回 利付国債(30年)	1.7	130,000	135,677	2044/ 3 /20
	第 43 回 利付国債(30年)	1.7	140,000	145,944	2044/ 6 /20
	第 44 回 利付国債(30年)	1.7	150,000	156,181	2044/ 9 /20
	第 45 回 利付国債(30年)	1.5	120,000	120,476	2044/12/20
	第 46 回 利付国債(30年)	1.5	350,000	350,840	2045/ 3 /20
	第 47 回 利付国債(30年)	1.6	150,000	152,790	2045/ 6 /20
	第 48 回 利付国債(30年)	1.4	300,000	294,156	2045/ 9 /20
	第 49 回 利付国債(30年)	1.4	120,000	117,450	2045/12/20
	第 50 回 利付国債(30年)	0.8	350,000	302,652	2046/ 3 /20
	第 51 回 利付国債(30年)	0.3	250,000	192,025	2046/ 6 /20
	第 52 回 利付国債(30年)	0.5	100,000	80,247	2046/ 9 /20
	第 53 回 利付国債(30年)	0.6	400,000	327,452	2046/12/20
	第 54 回 利付国債(30年)	0.8	410,000	350,361	2047/ 3 /20
	第 55 回 利付国債(30年)	0.8	390,000	332,268	2047/ 6 /20
	第 56 回 利付国債(30年)	0.8	150,000	127,408	2047/ 9 /20
	第 57 回 利付国債(30年)	0.8	340,000	287,918	2047/12/20
	第 58 回 利付国債(30年)	0.8	480,000	405,240	2048/ 3 /20
	第 59 回 利付国債(30年)	0.7	300,000	246,516	2048/ 6 /20
	第 60 回 利付国債(30年)	0.9	340,000	292,134	2048/ 9 /20
	第 61 回 利付国債(30年)	0.7	120,000	97,875	2048/12/20
	第 62 回 利付国債(30年)	0.5	250,000	192,905	2049/ 3 /20
	第 63 回 利付国債(30年)	0.4	250,000	186,897	2049/ 6 /20
	第 64 回 利付国債(30年)	0.4	310,000	230,826	2049/ 9 /20
	第 65 回 利付国債(30年)	0.4	310,000	229,908	2049/12/20
	第 66 回 利付国債(30年)	0.4	290,000	214,034	2050/ 3 /20
	第 67 回 利付国債(30年)	0.6	400,000	310,736	2050/ 6 /20
	第 68 回 利付国債(30年)	0.6	400,000	309,340	2050/ 9 /20
	第 69 回 利付国債(30年)	0.7	200,000	158,374	2050/12/20
	第 70 回 利付国債(30年)	0.7	360,000	284,101	2051/ 3 /20
	第 71 回 利付国債(30年)	0.7	330,000	259,528	2051/ 6 /20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第 72 回 利付国債(30年)	0.7	280,000	219,447	2051/ 9 /20
	第 73 回 利付国債(30年)	0.7	220,000	171,982	2051/12/20
	第 74 回 利付国債(30年)	1.0	220,000	185,990	2052/ 3 /20
	第 75 回 利付国債(30年)	1.3	100,000	91,054	2052/ 6 /20
	第 76 回 利付国債(30年)	1.4	210,000	195,451	2052/ 9 /20
	第 77 回 利付国債(30年)	1.6	160,000	155,851	2052/12/20
	第 78 回 利付国債(30年)	1.4	160,000	148,502	2053/ 3 /20
	第 79 回 利付国債(30年)	1.2	150,000	132,231	2053/ 6 /20
	第 80 回 利付国債(30年)	1.8	190,000	193,165	2053/ 9 /20
	第 81 回 利付国債(30年)	1.6	150,000	145,308	2053/12/20
	第 78 回 利付国債(20年)	1.9	250,000	255,880	2025/ 6 /20
	第 80 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	102,610	2025/ 6 /20
	第 81 回 利付国債(20年)	2.0	200,000	205,804	2025/ 9 /20
	第 83 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	310,479	2025/12/20
	第 85 回 利付国債(20年)	2.1	200,000	207,860	2026/ 3 /20
	第 88 回 利付国債(20年)	2.3	400,000	419,484	2026/ 6 /20
	第 89 回 利付国債(20年)	2.2	400,000	418,572	2026/ 6 /20
	第 90 回 利付国債(20年)	2.2	300,000	315,414	2026/ 9 /20
	第 91 回 利付国債(20年)	2.3	300,000	316,176	2026/ 9 /20
	第 92 回 利付国債(20年)	2.1	340,000	358,183	2026/12/20
	第 93 回 利付国債(20年)	2.0	300,000	316,497	2027/ 3 /20
	第 94 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	317,403	2027/ 3 /20
	第 95 回 利付国債(20年)	2.3	150,000	160,296	2027/ 6 /20
	第 96 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	106,210	2027/ 6 /20
	第 97 回 利付国債(20年)	2.2	150,000	160,411	2027/ 9 /20
	第 98 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	106,589	2027/ 9 /20
	第 99 回 利付国債(20年)	2.1	200,000	213,896	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	200,000	215,376	2028/ 3 /20
	第101回 利付国債(20年)	2.4	100,000	108,487	2028/ 3 /20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	200,000	217,836	2028/ 6 /20
	第103回 利付国債(20年)	2.3	200,000	216,988	2028/ 6 /20
	第104回 利付国債(20年)	2.1	150,000	161,470	2028/ 6 /20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	100,000	107,969	2028/ 9 /20
	第106回 利付国債(20年)	2.2	200,000	216,834	2028/ 9 /20
第107回 利付国債(20年)	2.1	100,000	108,323	2028/12/20	
第108回 利付国債(20年)	1.9	100,000	107,380	2028/12/20	
第109回 利付国債(20年)	1.9	200,000	215,454	2029/ 3 /20	
第110回 利付国債(20年)	2.1	200,000	217,436	2029/ 3 /20	
第111回 利付国債(20年)	2.2	200,000	219,332	2029/ 6 /20	
第112回 利付国債(20年)	2.1	200,000	218,292	2029/ 6 /20	
第113回 利付国債(20年)	2.1	200,000	219,088	2029/ 9 /20	
第114回 利付国債(20年)	2.1	300,000	329,988	2029/12/20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第115回 利付国債(20年)	2.2	500,000	552,820	2029/12/20
	第118回 利付国債(20年)	2.0	600,000	660,522	2030/ 6 /20
	第122回 利付国債(20年)	1.8	500,000	545,670	2030/ 9 /20
	第123回 利付国債(20年)	2.1	300,000	333,942	2030/12/20
	第126回 利付国債(20年)	2.0	300,000	332,631	2031/ 3 /20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	200,000	220,386	2031/ 3 /20
	第128回 利付国債(20年)	1.9	300,000	330,939	2031/ 6 /20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	400,000	438,752	2031/ 9 /20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	400,000	436,488	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	300,000	329,619	2031/12/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	300,000	327,564	2032/ 3 /20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	250,000	271,040	2032/ 3 /20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	200,000	218,582	2032/ 6 /20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	200,000	216,994	2032/ 6 /20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	300,000	328,014	2032/ 9 /20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	100,000	109,414	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	300,000	330,891	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	100,000	108,619	2033/ 3 /20
	第144回 利付国債(20年)	1.5	100,000	107,716	2033/ 3 /20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	250,000	273,837	2033/ 6 /20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	220,000	240,970	2033/ 9 /20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	100,000	108,545	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	300,000	322,659	2034/ 3 /20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	130,000	139,781	2034/ 6 /20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	100,000	104,336	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	450,000	468,967	2035/ 3 /20
	第153回 利付国債(20年)	1.3	150,000	157,765	2035/ 6 /20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	340,000	353,436	2035/ 9 /20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	100,000	101,553	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	420,000	396,971	2036/ 3 /20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	400,000	367,388	2036/ 6 /20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	370,000	351,537	2036/ 9 /20
	第159回 利付国債(20年)	0.6	500,000	479,490	2036/12/20
	第160回 利付国債(20年)	0.7	550,000	532,191	2037/ 3 /20
第161回 利付国債(20年)	0.6	550,000	523,572	2037/ 6 /20	
第162回 利付国債(20年)	0.6	600,000	569,334	2037/ 9 /20	
第163回 利付国債(20年)	0.6	700,000	661,647	2037/12/20	
第164回 利付国債(20年)	0.5	400,000	371,492	2038/ 3 /20	
第165回 利付国債(20年)	0.5	450,000	416,142	2038/ 6 /20	
第166回 利付国債(20年)	0.7	410,000	388,704	2038/ 9 /20	
第167回 利付国債(20年)	0.5	500,000	458,625	2038/12/20	
第168回 利付国債(20年)	0.4	400,000	359,692	2039/ 3 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第169回 利付国債(20年)	0.3	370,000	325,921	2039/ 6 /20
	第170回 利付国債(20年)	0.3	420,000	368,071	2039/ 9 /20
	第171回 利付国債(20年)	0.3	400,000	348,732	2039/12/20
	第172回 利付国債(20年)	0.4	500,000	441,155	2040/ 3 /20
	第173回 利付国債(20年)	0.4	400,000	351,128	2040/ 6 /20
	第174回 利付国債(20年)	0.4	500,000	436,650	2040/ 9 /20
	第175回 利付国債(20年)	0.5	480,000	424,440	2040/12/20
	第176回 利付国債(20年)	0.5	400,000	352,168	2041/ 3 /20
	第177回 利付国債(20年)	0.4	120,000	103,294	2041/ 6 /20
	第178回 利付国債(20年)	0.5	250,000	218,002	2041/ 9 /20
	第179回 利付国債(20年)	0.5	120,000	104,245	2041/12/20
	第181回 利付国債(20年)	0.9	120,000	111,262	2042/ 6 /20
	第182回 利付国債(20年)	1.1	100,000	95,654	2042/ 9 /20
	第183回 利付国債(20年)	1.4	50,000	50,186	2042/12/20
	第186回 利付国債(20年)	1.5	560,000	567,285	2043/ 9 /20
	第187回 利付国債(20年)	1.3	100,000	97,618	2043/12/20
	第 2 回 メキシコ合衆国	1.25	100,000	99,168	2027/ 9 / 8
第 26 回 メキシコ合衆国	0.85	100,000	99,809	2025/ 4 /18	
小 計			80,000,000	79,123,059	
地 方 債 証 券	第800回 東京都公募公債	0.08	100,000	97,828	2029/12/20
	第 12 回 東京都公募公債(20年)	2.31	100,000	106,922	2027/ 9 /17
	第 26 回 東京都公募公債(20年)	1.74	100,000	108,647	2032/ 6 /18
	平成27年度第 13 回 北海道公募公債	0.469	100,000	100,376	2025/12/25
	平成30年度第 18 回 北海道公募公債	0.146	20,000	19,683	2029/ 2 /28
	第 3 回 神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	118,599	2037/ 3 /19
	第 18 回 神奈川県公募公債(20年)	1.825	50,000	54,554	2031/11/14
	第 27 回 神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	105,152	2034/ 9 /20
	第 36 回 神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	93,474	2037/12/18
	第387回 大阪府公募公債(10年)	0.521	44,040	44,139	2024/ 8 /28
	第392回 大阪府公募公債(10年)	0.36	100,000	100,202	2025/ 1 /29
	第469回 大阪府公募公債(10年)	0.128	100,000	96,797	2031/ 6 /27
	第479回 大阪府公募公債(10年)	0.29	4,000	3,881	2032/ 5 /28
	平成25年度第 10 回 京都府公募公債(15年)	1.14	100,000	103,167	2028/10/13
	第 2 回 兵庫県公募公債(30年)	2.36	100,000	114,663	2040/ 3 /19
	第 3 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	103,411	2027/ 7 /16
	第 6 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	103,977	2028/ 7 /14
	平成26年度第 9 回 静岡県公募公債	0.554	20,000	20,059	2024/10/24
	令和2年度第 9 回 静岡県公募公債	0.12	100,000	97,624	2030/ 9 /20
	第 10 回 静岡県公募公債(20年)	2.072	100,000	109,791	2030/ 6 /14
	第 11 回 静岡県公募公債(20年)	1.841	50,000	54,347	2030/10/18
	平成24年度第 12 回 愛知県公募公債(30年)	2.12	10,000	11,041	2042/ 9 /19

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	平成24年度第 14 回 愛知県公募公債(15年)	1.314	100,000	103,553	2027/12/13
	平成27年度第 12 回 愛知県公募公債(15年)	0.759	100,000	101,660	2030/10/21
	平成30年度第 6 回 愛知県公募公債(30年)	0.777	100,000	81,680	2048/ 6 /19
	平成28年度第 1 回 広島県公募公債	0.08	100,000	99,578	2026/ 5 /25
	平成29年度第 4 回 埼玉県公募公債	0.19	100,000	99,608	2027/ 6 /22
	第 12 回 埼玉県公募公債(30年)	0.474	100,000	73,709	2049/12/20
	第 29 回 埼玉県公募公債(20年)	0.476	100,000	85,089	2041/12/13
	平成28年度第 6 回 福岡県公募公債	0.175	100,000	99,694	2026/12/22
	平成29年度第 1 回 福岡県公募公債	0.2	100,000	99,640	2027/ 6 /23
	令和3年度第 6 回 福岡県公募公債	0.189	100,000	96,726	2032/ 1 /19
	平成26年度第 4 回 福岡県公募公債(20年)	1.249	100,000	103,436	2035/ 2 /23
	第 15 回 千葉県公募公債(20年・定時償還)	0.235	90,000	84,752	2041/10/15
	第 10 回 千葉県公募公債(20年)	1.8	100,000	108,794	2031/ 8 /18
	第 13 回 千葉県公募公債(20年)	1.701	100,000	108,432	2032/10/15
	第 24 回 千葉県公募公債	0.559	100,000	92,098	2038/ 4 /15
	第 24 回 群馬県公募公債(10年)	0.08	100,000	96,360	2031/ 8 /18
	第147回 共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	100,479	2025/ 6 /25
	第157回 共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	99,595	2026/ 4 /24
	第181回 共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	99,122	2028/ 4 /25
	第184回 共同発行市場公募地方債	0.175	100,000	98,984	2028/ 7 /25
	第188回 共同発行市場公募地方債	0.264	30,000	29,760	2028/11/24
	第209回 共同発行市場公募地方債	0.125	100,000	97,711	2030/ 8 /23
	第211回 共同発行市場公募地方債	0.125	100,000	97,558	2030/10/25
	令和2年度第 3 回 長崎県公募公債(10年)	0.13	12,400	12,134	2030/ 6 /20
	平成30年度第 1 回 熊本市公募公債	0.264	100,000	99,201	2028/11/30
	第 5 回 大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	109,123	2028/ 9 /21
	第 13 回 大阪市公募公債(20年)	2.08	50,000	54,886	2030/ 6 /14
	第 2 回 名古屋市公募公債(15年)	0.905	100,000	102,443	2029/11/16
	第 6 回 京都市公募公債(20年)	2.38	100,000	107,110	2027/ 9 /17
	第 2 回 横浜市公募公債(30年)	2.49	100,000	116,433	2035/ 3 /20
	第 4 回 横浜市公募公債(30年)	2.54	100,000	117,581	2036/12/19
	平成27年度第 4 回 札幌市公募公債(10年)	0.51	100,000	100,425	2025/ 6 /20
	第 6 回 札幌市公募公債(20年)	2.24	100,000	109,247	2029/ 6 /20
	第 14 回 川崎市公募公債(20年)	1.79	100,000	108,997	2032/ 3 /19
	平成28年度第 5 回 広島市公募公債	0.24	100,000	99,869	2027/ 2 /26
	平成30年度第 6 回 広島市公募公債	0.146	45,000	44,311	2029/ 2 /22
	平成27年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.395	100,000	100,265	2026/ 1 /29
	平成29年度第 1 回 秋田県公募公債	0.2	45,900	45,552	2028/ 3 /24
	第160回 福岡北九州高速道路債券	0.573	100,000	86,196	2041/ 3 /22
		小 計		5,271,340	5,340,130
特 殊 債 券 (除く金融債)	F149回 地方公共団体金融機構債券	1.145	100,000	101,524	2025/12/19
	F181回 地方公共団体金融機構債券	1.109	100,000	101,852	2026/ 7 /28

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第 68 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.32	14,000	14,028	2025/ 1 /20
	第 76 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	100,372	2025/ 9 /12
	F308回 地方公共団体金融機構債券	1.192	100,000	100,418	2037/ 3 /19
	第 89 回 地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,318	2026/10/28
	第 98 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	99,583	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	99,523	2027/ 8 /13
	第 68 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	0.53	100,000	90,554	2038/ 7 /28
	F438回 地方公共団体金融機構債券	0.123	100,000	99,586	2026/ 3 /27
	第114回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	100,000	99,088	2028/11/14
	第 8 回 公営企業債券(30年)	2.5	10,000	11,575	2035/ 9 /21
	第 13 回 公営企業債券(20年)	2.16	10,000	10,248	2025/ 6 /20
	第 22 回 公営企業債券(20年)	2.32	100,000	106,315	2027/ 6 /18
	第 53 回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	62,000	61,499	2028/ 9 /15
	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	114,299	2049/ 6 /30
	第 12 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.52	100,000	104,940	2026/ 6 /19
	第 23 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	20,000	21,336	2027/ 7 /20
	第 26 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	10,000	11,772	2037/ 9 /18
	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	107,398	2032/ 8 /31
	第215回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	2,000	2,002	2024/ 4 /30
	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	13,000	13,039	2024/12/27
	第237回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.97	100,000	100,899	2035/ 1 /31
	第252回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	100,000	103,510	2035/ 7 /31
	第312回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.11	100,000	99,467	2027/ 5 /31
	第331回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.566	100,000	93,304	2037/11/30
	第342回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	13,000	12,887	2028/ 3 /31
	第404回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.306	100,000	70,302	2050/ 3 /31
	第 3 回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	100,000	105,729	2027/ 3 /19
	第 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	19,114	19,145	2042/ 6 /10
	第 36 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	17,194	17,838	2045/ 5 /10
	第 38 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	19,385	20,058	2045/ 7 /10
	第 39 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	18,839	19,415	2045/ 8 /10
	第 43 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	22,384	23,253	2045/12/10
	第 45 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	17,557	18,218	2046/ 2 /10
	第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	24,404	25,173	2046/12/10
	第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	25,093	25,825	2047/ 5 /10
	第108回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.434	100,000	103,455	2027/ 6 /18
	第 96 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	50,831	50,251	2050/ 5 /10
	第101回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.89	382	380	2050/10/10
	第106回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	57,962	56,250	2051/ 3 /10
	第110回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.23	64,545	61,484	2051/ 7 /10
	第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	67,015	64,360	2051/12/10
第119回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	338	325	2052/ 4 /10	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第215回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.23	100,000	99,436	2027/ 8 /20
	第125回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	69,725	66,681	2052/10/10
	第132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	71,359	67,972	2053/ 5 /10
	第133回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	72,675	69,296	2053/ 6 /10
	第135回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	73,498	69,838	2053/ 8 /10
	第138回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	73,914	70,784	2053/11/10
	第139回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	74,406	71,021	2053/12/10
	第 3 回 貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	32,016	31,781	2033/ 1 /10
	第168回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	86,788	81,640	2056/ 5 /10
	第173回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	89,445	83,536	2056/10/10
	第176回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	456	425	2057/ 1 /10
	第192回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.04	96,360	96,258	2058/ 5 /10
	第 34 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	10,163	10,240	2040/ 9 /10
	第 64 回 西日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	99,172	2026/ 9 /18
	第118回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.663	100,000	92,015	2038/ 8 /27
	第 9 回 新関西国際空港	1.231	100,000	103,108	2028/12/20
	第 78 回 株式会社日本政策投資銀行	0.225	100,000	99,576	2027/ 4 /13
	第 96 回 株式会社日本政策投資銀行	0.195	100,000	98,781	2028/ 7 /12
	第 37 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	108,223	2028/ 6 /20
	第 49 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	109,438	2029/ 5 /18
	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	109,048	2029/ 9 /28
	第172回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.919	100,000	107,523	2042/ 8 /29
	第 4 回 公営企業債券(30年)	2.95	100,000	119,387	2034/ 3 /24
	第 23 回 国際協力銀行債券	2.09	100,000	103,190	2025/12/19
	第191回 都市再生債券	1.907	100,000	98,202	2063/ 3 /19
	第 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1	9,516	9,532	2043/ 1 /10
	第 25 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	14,649	15,255	2044/ 6 /10
	第 28 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	16,907	17,618	2044/ 9 /10
	第 29 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	18,297	19,135	2044/10/10
	第 31 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	18,355	19,147	2044/12/10
	第 32 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	17,767	18,441	2045/ 1 /10
	第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	22,511	23,221	2045/11/10
	第 66 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	31,299	31,859	2047/11/10
	第 69 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	33,977	34,817	2048/ 2 /10
	第 70 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	29,375	30,090	2048/ 3 /10
第 71 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	27,802	28,264	2048/ 4 /10	
第 79 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	29,576	30,049	2048/12/10	
第 81 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	32,812	33,308	2049/ 2 /10	
第157回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	100,240	2025/ 5 /20	
第 5 回 国際協力機構債券	1.918	100,000	108,581	2030/ 9 /13	
第 85 回 中日本高速道路株式会社債	0.07	100,000	99,634	2025/10/21	
小 計			5,312,691	5,347,579	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
金 融 債 券	い第855号商工債	0.08	100,000	99,093	2026/ 8 /27
	い第856号商工債	0.09	100,000	99,066	2026/ 9 /25
	第378回 信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,302	2026/ 5 /27
	小 計		300,000	297,461	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第506回 中部電力	0.695	100,000	100,495	2025/ 9 /25
	第545回 中部電力	0.3	100,000	96,045	2031/ 7 /25
	第510回 関西電力	0.49	100,000	99,651	2027/ 7 /23
	第524回 関西電力	0.514	100,000	98,972	2028/10/25
	第426回 中国電力	0.33	100,000	97,142	2030/ 7 /25
	第432回 中国電力	0.04	100,000	99,798	2025/ 1 /24
	第534回 東北電力	0.51	100,000	86,213	2038/ 6 /25
	第540回 東北電力	0.19	100,000	99,102	2027/ 1 /25
	第298回 四国電力	0.962	100,000	87,461	2043/ 4 /24
	第465回 九州電力	0.38	100,000	98,614	2028/ 7 /25
	第489回 九州電力	1.43	100,000	94,689	2043/ 7 /24
	第350回 北海道電力	0.754	100,000	89,475	2038/ 3 /25
	第 6 回 東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	100,167	2027/ 8 /31
	第 26 回 東京電力パワーグリッド	1.31	100,000	97,943	2034/ 4 /24
	第 3 回 韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空	0.76	100,000	99,551	2026/ 6 /29
	第 30 回 大和ハウス工業	0.53	100,000	99,856	2027/10/27
	第 21 回 キリンホールディングス	0.29	100,000	99,227	2027/ 6 / 7
	第 15 回 東急不動産ホールディングス	0.78	100,000	97,018	2032/10/20
	第 22 回 三菱瓦斯化学	0.17	100,000	99,570	2025/ 9 / 3
	第 8 回 楽天	0.32	100,000	99,145	2024/ 6 /25
	第 4 回 ENEOSホールディングス	0.834	100,000	97,462	2032/ 6 /15
	第 59 回 日本電気	0.46	100,000	99,458	2027/ 7 /12
	第 26 回 トヨタ自動車	0.05	100,000	99,253	2026/ 3 /18
	第 21 回 三井住友信託銀行	0.15	100,000	98,976	2026/11/ 6
	第 3 回 NTTファイナンス	0.529	100,000	97,225	2031/12/19
	第 73 回 ホンダファイナンス	0.1	100,000	98,960	2026/12/18
	第 67 回 三菱UFJリース	0.39	100,000	97,809	2029/ 4 /11
	第 83 回 三井不動産株式会社	0.81	100,000	97,644	2033/ 6 / 6
	第 65 回 三菱地所	2.04	100,000	108,573	2032/12/20
	第 18 回 イオンモール	1.05	100,000	88,369	2038/ 7 / 2
	第 44 回 相鉄ホールディングス	0.36	100,000	99,240	2027/ 6 /15
	第 11 回 東急	0.479	100,000	96,435	2032/ 6 / 1
	第122回 東日本旅客鉄道	1.119	100,000	75,924	2057/ 1 /26
	第 52 回 西日本旅客鉄道	1.157	100,000	75,994	2058/ 4 /25
	第 45 回 東海旅客鉄道	2.321	100,000	108,762	2029/ 6 /19
	第 4 回 東京地下鉄	2.38	10,000	10,452	2026/ 6 /19
	第 13 回 東京地下鉄	1.702	100,000	106,828	2032/ 5 /25
	第 47 回 阪急阪神ホールディングス	1.202	100,000	102,822	2029/ 7 /18

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)	第 25 回 日本郵船	2.65	100,000	104,719	2026/ 6 /22
	第 10 回 九州旅客鉄道	0.616	100,000	83,723	2041/12/ 9
	第 32 回 ANAホールディングス	0.99	100,000	88,941	2036/ 6 / 9
	第 14 回 ソフトバンク	0.24	100,000	98,553	2026/10/ 9
	第 31 回 光通信	1.38	100,000	85,887	2036/ 2 / 1
	第 58 回 電源開発	0.705	100,000	88,636	2038/ 7 /20
	第 31 回 東京電力パワーグリッド	0.98	100,000	99,802	2029/10/ 9
	第 67 回 東京瓦斯	0.822	100,000	75,064	2051/ 7 /13
	第 45 回 東邦瓦斯	0.394	100,000	95,468	2032/ 5 /26
	第 30 回 フランス相互信用連合銀行	0.317	100,000	98,987	2026/10/ 9
	第 36 回 フランス相互信用連合銀行	0.315	100,000	96,789	2028/10/20
	第 14 回 クレディ・アグリコル・エス・エー	0.459	100,000	98,525	2027/ 6 / 9
	第 8 回 ビー・エヌ・ピー・パリバ	1.01	100,000	99,790	2028/ 9 / 7
	小 計		5,010,000	4,815,204	
	合 計		95,894,031	94,923,434	

(注1) 評価については、原則として金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('24年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 94,923,434	% 89.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	11,638,693	10.9
投 資 信 託 財 産 総 額	106,562,127	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('24年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	106,562,127,865
コーポレート債(評価額)	125,367,177
未収入金	94,923,434,965
未収利息	11,207,649,205
前払費用	296,276,452
(B) 負 債	9,400,066
未払解約金	10,960,903,992
未払利息	10,960,901,977
その他未払費用	332
(C) 純資産総額(A-B)	1,683
元本	95,601,223,873
次期繰越損益金	78,209,434,735
(D) 受益権総口数	17,391,789,138
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	78,209,434,735口
	12,224円

(注1) 期首元本額 140,194,933,687円

期中追加設定元本額 11,000,839,444円

期中一部解約元本額 72,986,338,396円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別

内訳は、次の通りです。

日本債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	18,671,200,462円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	12,344,312,965円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	8,228,188,816円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	6,399,506,052円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	4,664,299,688円
日本債券インデックス・ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	3,922,819,518円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	3,752,423,134円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	3,307,739,649円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	3,145,445,790円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	2,324,859,558円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,949,843,019円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,663,790,388円
日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>	1,531,101,841円
AMC/ステート・ストリートリスク/ベクトル型(リス・オフ)(スタイル)	1,256,992,275円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	1,194,013,604円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	1,104,776,885円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	997,275,984円
日本債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	369,753,985円
Tadrisクビエント型マルチ分散戦略ファンド(スタイル)年金<適格機関投資家限定>	359,211,553円
Tadrisクビエント型マルチ分散戦略ファンド(スタイル)<適格機関投資家限定>	346,789,222円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	140,143,045円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	117,189,359円
日本債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	75,617,033円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	56,600,225円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	51,465,436円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	42,800,001円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	42,464,669円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	35,653,508円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	17,699,944円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	17,009,042円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	13,727,068円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	13,218,840円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	11,592,305円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	9,117,963円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	8,388,001円
バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	8,212,181円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	7,096,936円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	4,554,956円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	1,029,409円
ステート・ストリート国内債券インデックス・オープン(隔月分配型)	946,552円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	563,874円

◎損益の状況

当期(自'23年3月7日 至'24年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	1,081,276,720
受 取 利 息	1,081,812,547
支 払 利 息	△ 535,827
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 1,327,458,232
売 買 損 益	784,138,948
売 買 損	△ 2,111,597,180
(C) そ の 他 費 用	△ 21,443
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 246,202,955
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	31,679,490,489
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,591,133,663
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 16,632,632,059
(H) 計 算 (D+E+F+G)	17,391,789,138
次 期 繰 越 損 益 金(H)	17,391,789,138

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

(注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。