

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	日本債券インデックスファンド	下記のマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	日本債券マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	日本債券インデックスファンド	外貨建資産への投資は行いません。 株式への投資は転換社債を転換したものと 新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り ます。以下同じ。)を行使したものに限り ます。以下同じ。) 実質投資割合は取得時において信託財産の純資産総額 の10%以下とします。
	日本債券マザーファンド	株式への投資は転換社債を転換したものと 新株予約権を行使したものに限り ます。以下同じ。) 取得時において信託財産の純資産総額の10%以下 とします。 外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	年1回、毎決算時に委託会社が基準価額水準、市況動向などを勘案して分配金額を決定します。ただし、分配を行わないことがあります。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。	

日本債券 インデックスファンド

運用報告書(全体版)

第23期(決算日 2024年1月22日)

受益者のみなさまへ

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

〒105-0011 東京都港区芝公園一丁目1番1号

ホームページ <https://www.smtam.jp/>

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

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ベンチマーク		債券組入率	債券先比率	債券先物率	純資産額
	(分配落)	税 分 配 金	期 騰 落 率	期 騰 落 率	騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%		百万円
第19期(2020年1月22日)	12,537	0	0.6	389.521	1.2	99.7	—	—	1,290
第20期(2021年1月22日)	12,376	0	△1.3	386.546	△0.8	99.7	—	—	1,203
第21期(2022年1月24日)	12,276	0	△0.8	385.557	△0.3	99.7	—	—	1,118
第22期(2023年1月23日)	11,676	0	△4.9	368.724	△4.4	99.7	—	—	1,026
第23期(2024年1月22日)	11,589	0	△0.7	367.877	△0.2	99.7	—	—	1,002

(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	債券先物率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(当期首)	円	%		%	%	%
2023年1月23日	11,676	—	368.724	—	99.7	—
1月末	11,577	△0.8	365.595	△0.8	99.8	—
2月末	11,699	0.2	369.572	0.2	99.8	0.0
3月末	11,854	1.5	374.743	1.6	99.8	—
4月末	11,880	1.7	375.608	1.9	99.8	—
5月末	11,864	1.6	375.266	1.8	99.7	—
6月末	11,888	1.8	376.290	2.1	99.8	—
7月末	11,699	0.2	370.426	0.5	99.7	—
8月末	11,610	△0.6	367.761	△0.3	99.7	—
9月末	11,522	△1.3	365.131	△1.0	99.8	—
10月末	11,333	△2.9	359.310	△2.6	99.7	—
11月末	11,567	△0.9	366.877	△0.5	99.7	—
12月末	11,610	△0.6	368.384	△0.1	99.8	—
(当期末)						
2024年1月22日	11,589	△0.7	367.877	△0.2	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。

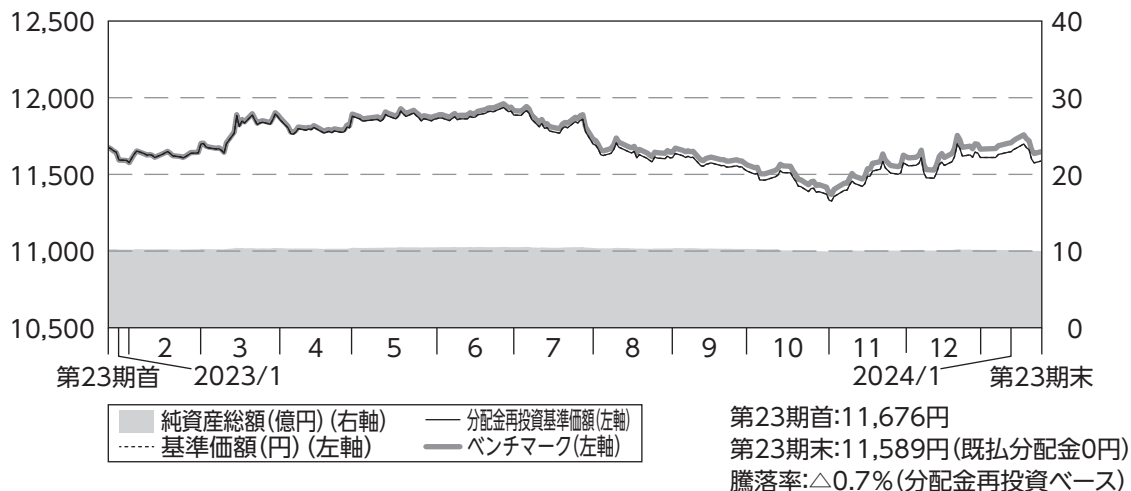
ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

【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、2023年1月23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(分配金再投資ベース)は、ベンチマークとほぼ同じ動きとなり、ほぼ同水準で引けました。

投資環境



国内金利は、2023年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(価格は上昇)しました。2023年7月下旬に日銀が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、国内金利は上昇(価格は下落)しました。その後も、米長期金利が上昇したことや、日銀が10月末の金融政策決定会合で一段の長短金利操作の柔軟化に動いたことから、金利上昇圧力が強まりやすい状況が続きました。期末にかけては米国の追加利上げ観測が後退し、米長期金利が急速に低下したことや、日銀が本格的な金融政策の修正には慎重との見方が一時強まったことから、国内金利には低下圧力が強まりました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドの運用につきましては、引き続き運用の基本方針に従い、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

キャッシュ部分はヘッジ目的で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。

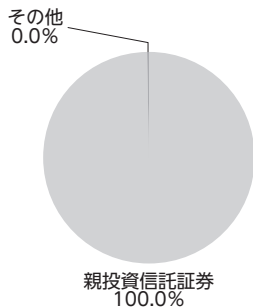
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

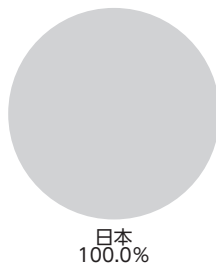
	当期末
	2024年1月22日
日本債券マザーファンド	100.0%
その他	0.0%
組入ファンド数	1

(注)組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

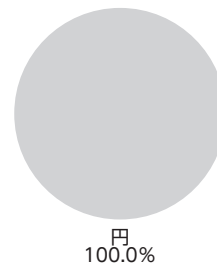
○資産別配分



○国別配分



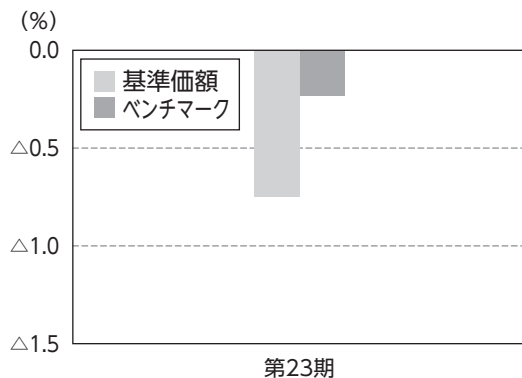
○通貨別配分



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

基準価額水準、市況動向等を考慮して、収益分配は見送りとさせていただきます。
なお、収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(1万口当たり・税引前)

項目	第23期	
	2023年1月24日～2024年1月22日	
当期分配金 (円)	—	
(対基準価額比率) (%)	(—)	
当期の収益 (円)	—	
当期の収益以外 (円)	—	
翌期繰越分配対象額 (円)	2,182	

(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
	(2023年1月24日～2024年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	64円	0.548%	(a) 信託報酬 = [期中の平均基準価額] × 信託報酬率 期中の平均基準価額は11,675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。
(投信会社)	(23)	(0.197)	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
(販売会社)	(35)	(0.296)	交付運用報告書等各種書類の送付、口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)	(6)	(0.055)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料 = $\frac{\text{[期中の売買委託手数料]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$
(株式)	(-)	(-)	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
(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 = $\frac{\text{[期中の有価証券取引税]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$
(株式)	(-)	(-)	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
(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 = $\frac{\text{[期中のその他費用]}}{\text{[期中の平均受益権口数]}} \times 10,000$
(保管費用)	(-)	(-)	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)	(-)	(-)	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)	(0)	(0.000)	その他は、信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	64	0.548	

(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。

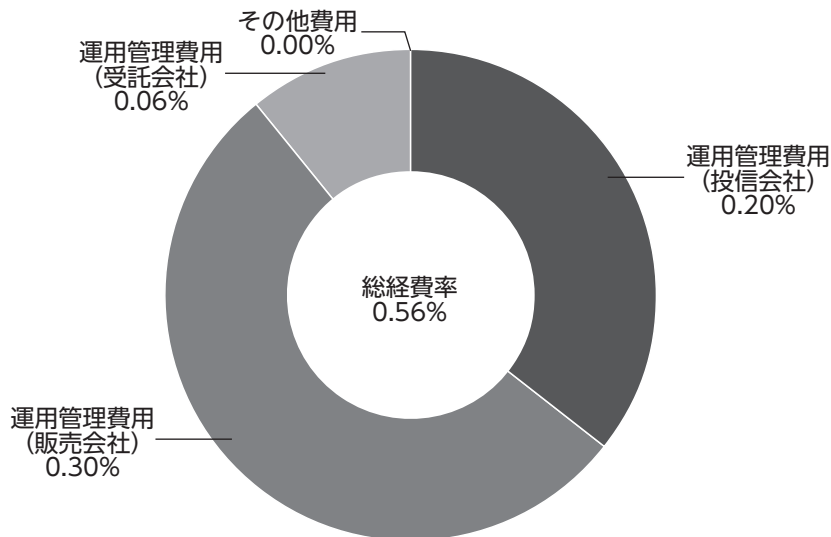
(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.56%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 60,215	千円 79,315	千口 76,473	千円 100,206

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 0.026697	百万円 0.026697	% 100.0	百万円 0.026697	百万円 0.026697	% 100.0
コール・ローン	651	63	9.7	650	64	9.8

(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	145,270	15,033	10.3	145,396	15,080	10.4

<平均保有割合 0.3%>

(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 781,730	千口 765,472	千円 1,002,309

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、310,651,503千口です。

※ 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 1,002,309	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,508	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	1,006,817	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 2024年1月22日現在
(A) 資 産	1,006,817,535円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	4,191,398
日本債券マザーファンド(評価額)	1,002,309,725
未 収 入 金	316,412
(B) 負 債	4,007,023
未 払 解 約 金	1,193,006
未 払 信 託 報 酬	2,814,015
未 払 利 息	2
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	1,002,810,512
元 本	865,337,040
次 期 繰 越 損 益 金	137,473,472
(D) 受 益 権 総 口 数	865,337,040口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,589円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年1月24日 至 2024年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	△901円
受 取 利 息	7
支 払 利 息	△908
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△2,086,537
売 買 益	1,249,182
売 買 損	△3,335,719
(C) 信 託 報 酬 等	△5,645,577
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△7,733,015
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△38,452,025
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	183,658,512
(配 当 等 相 当 額)	(159,064,724)
(売 買 損 益 相 当 額)	(24,593,788)
(G) 計 (D+E+F)	137,473,472
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	137,473,472
追 加 信 託 差 損 益 金	183,658,512
(配 当 等 相 当 額)	(159,135,849)
(売 買 損 益 相 当 額)	(24,522,663)
分 配 準 備 積 立 金	29,712,896
繰 越 損 益 金	△75,897,936

(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せん。

(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878,928,535円、期中追加設定元本額は125,260,699円、期中一部解約元本額は138,852,194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)	2,159,949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	159,135,849円
(D) 分配準備積立金額	27,552,947円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	188,848,745円
(F) 期末残存口数	865,337,040口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり) (E/F×10,000)	2,182円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2023年10月24日)

日本債券マザーファンド

運用報告書

第23期（決算日 2024年1月22日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第19期(2020年1月22日)	13,860	1.2	389.521	1.2	99.8	—	百万円 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
第23期(2024年1月22日)	13,094	△0.2	367.877	△0.2	99.8	—	406,775

(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 比	債券先物率 比
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2023年1月23日	13,121	—	368.724	—	99.8	—
1月末	13,011	△0.8	365.595	△0.8	99.8	—
2月末	13,154	0.3	369.572	0.2	99.9	0.0
3月末	13,335	1.6	374.743	1.6	99.8	—
4月末	13,370	1.9	375.608	1.9	99.8	—
5月末	13,358	1.8	375.266	1.8	99.7	—
6月末	13,391	2.1	376.290	2.1	99.8	—
7月末	13,184	0.5	370.426	0.5	99.8	—
8月末	13,090	△0.2	367.761	△0.3	99.7	—
9月末	12,996	△1.0	365.131	△1.0	99.8	—
10月末	12,789	△2.5	359.310	△2.6	99.8	—
11月末	13,059	△0.5	366.877	△0.5	99.7	—
12月末	13,113	△0.1	368.384	△0.1	99.8	—
(当期末) 2024年1月22日	13,094	△0.2	367.877	△0.2	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。

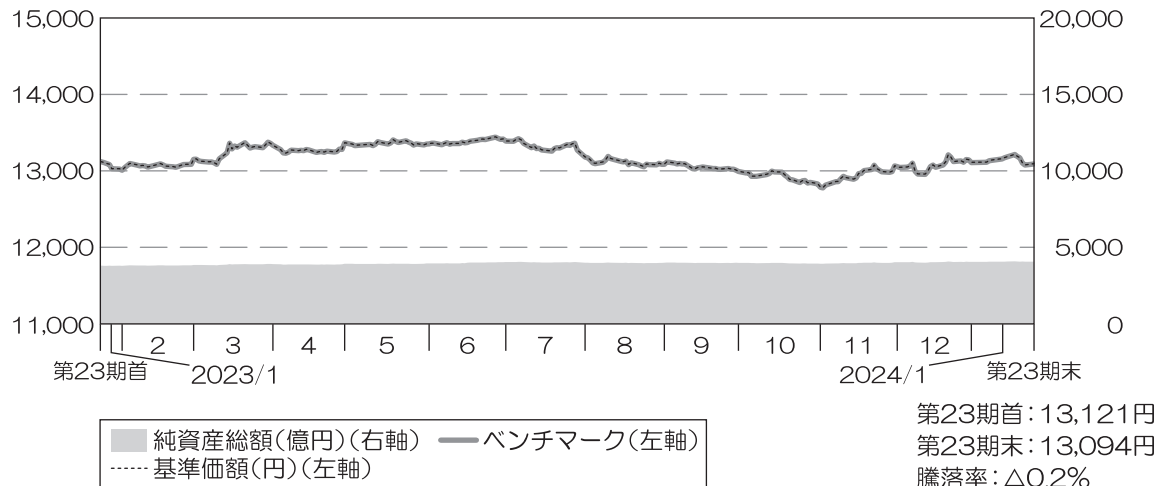
ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

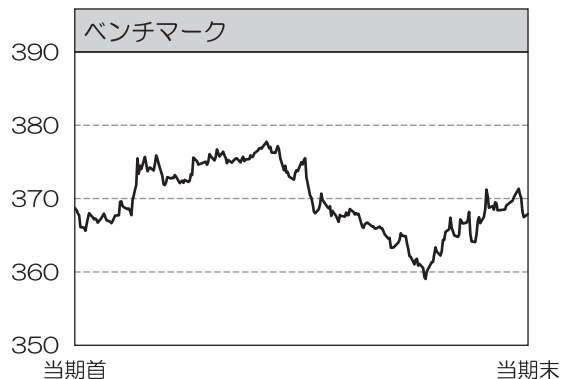


(注)ベンチマークは、2023年1月23日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

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、ほぼ同水準で引けました。

投資環境



国内金利は、2023年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（価格は上昇）しました。2023年7月下旬に日銀が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、国内金利は上昇（価格は下落）しました。その後も、米長期金利が上昇したことや、日銀が10月末の金融政策決定会合で一段の長短金利操作の柔軟化に動いたことから、金利上昇圧力が強まりやすい状況が続きました。期末にかけては米国の追加利上げ観測が後退し、米長期金利が急速に低下したことや、日銀が本格的な金融政策の修正には慎重との見方が一時強まったことから、国内金利には低下圧力が強まりました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

キャッシュ部分はヘッジ目的で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

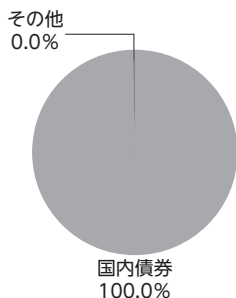
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第368回利付国債(10年)	日本	1.0%
2	第350回利付国債(10年)	日本	0.9%
3	第452回利付国債(2年)	日本	0.9%
4	第365回利付国債(10年)	日本	0.9%
5	第344回利付国債(10年)	日本	0.9%
6	第364回利付国債(10年)	日本	0.9%

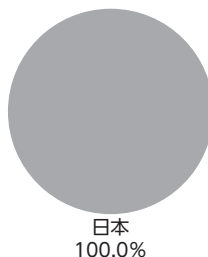
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第346回利付国債(10年)	日本	0.9%
8	第371回利付国債(10年)	日本	0.8%
9	第363回利付国債(10年)	日本	0.8%
10	第345回利付国債(10年)	日本	0.8%
組入銘柄数		784	

(注)組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

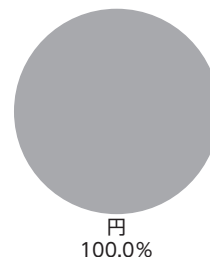
○資産別配分



○国別配分



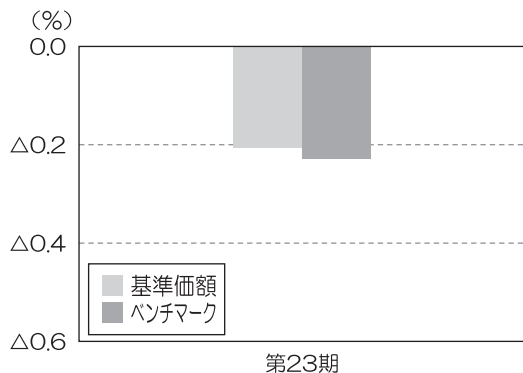
○通貨別配分



(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
	(2023年1月24日～2024年1月22日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.000%	(a) 売買委託手数料 = $\frac{[\text{期中の売買委託手数料}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(b) 有価証券取引税	-	-	(b) 有価証券取引税 = $\frac{[\text{期中の有価証券取引税}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(c) その他費用	0	0.000	(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、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	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(13,154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 94,427,929	千円 67,587,971
	地 方 債 証 券	4,495,586	3,069,535
	特 殊 債 券	6,637,412	5,530,824 (375,885)
	社 債 券	5,202,088	3,247,289

(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 6,332	百万円 6,331	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 3	百万円 3	100.0	百万円 3	百万円 3	100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン	145,270	15,033	10.3	145,396	15,080	10.4

(注) 当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

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

組入資産の明細

〈国内(邦貨建)公社債〉

(A) 債券種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額	組入比率	うちBBB格以下 組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率			
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満	
千円	千円	%	%	%	%	%	%	
国 債 証 券	347,663,000	343,705,699	84.5	—	54.5	20.5	9.4	
地 方 債 証 券	20,712,300 (20,512,300)	21,100,683 (20,878,896)	5.2 (5.1)	— (—)	2.8 (2.8)	1.8 (1.8)	0.5 (0.5)	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	21,143,055 (20,943,055)	21,275,138 (21,058,289)	5.2 (5.2)	— (—)	3.1 (3.1)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)	
金 融 債 券	1,300,000 (1,300,000)	1,296,540 (1,296,540)	0.3 (0.3)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.0 (0.0)	
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	18,900,000 (18,900,000)	18,514,609 (18,514,609)	4.6 (4.6)	— (—)	2.0 (2.0)	1.9 (1.9)	0.7 (0.7)	
合 計	409,718,355 (61,655,355)	405,892,670 (61,748,334)	99.8 (15.2)	— (—)	62.4 (7.8)	26.0 (5.4)	11.4 (2.0)	

(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156回利付国債(5年)	0.2	2,060,000	2,067,210	2027/12/20
第445回利付国債(2年)	0.005	1,355,000	1,356,029	2025/2/1	第157回利付国債(5年)	0.2	760,000	761,725	2028/3/20
第446回利付国債(2年)	0.005	905,000	905,696	2025/3/1	第158回利付国債(5年)	0.1	2,210,000	2,205,889	2028/3/20
第447回利付国債(2年)	0.005	1,044,000	1,044,803	2025/4/1	第159回利付国債(5年)	0.1	560,000	558,163	2028/6/20
第448回利付国債(2年)	0.005	1,050,000	1,050,724	2025/5/1	第160回利付国債(5年)	0.2	1,720,000	1,721,874	2028/6/20
第449回利付国債(2年)	0.005	2,205,000	2,206,323	2025/6/1	第161回利付国債(5年)	0.3	970,000	975,296	2028/6/20
第450回利付国債(2年)	0.005	1,150,000	1,150,655	2025/7/1	第162回利付国債(5年)	0.3	750,000	753,112	2028/9/20
第452回利付国債(2年)	0.005	3,740,000	3,741,496	2025/9/1	第163回利付国債(5年)	0.4	1,740,000	1,755,242	2028/9/20
第453回利付国債(2年)	0.005	450,000	450,112	2025/10/1	第164回利付国債(5年)	0.2	300,000	299,418	2028/12/20
第454回利付国債(2年)	0.1	1,020,000	1,022,070	2025/11/1	第1回利付国債(40年)	2.4	270,000	313,081	2048/3/20
第455回利付国債(2年)	0.005	340,000	340,030	2025/9/20	第2回利付国債(40年)	2.2	560,000	625,872	2049/3/20
第456回利付国債(2年)	0.1	800,000	801,240	2026/1/1	第3回利付国債(40年)	2.2	585,000	652,117	2050/3/20
第143回利付国債(5年)	0.1	2,150,000	2,154,085	2025/3/20	第4回利付国債(40年)	2.2	665,000	739,127	2051/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	2,790,000	2,795,468	2025/6/20	第5回利付国債(40年)	2.0	495,000	527,288	2052/3/20
第145回利付国債(5年)	0.1	2,605,000	2,610,392	2025/9/20	第6回利付国債(40年)	1.9	830,000	864,038	2053/3/20
第146回利付国債(5年)	0.1	2,230,000	2,234,460	2025/12/20	第7回利付国債(40年)	1.7	990,000	980,228	2054/3/20
第147回利付国債(5年)	0.005	2,750,000	2,750,000	2026/3/20	第8回利付国債(40年)	1.4	890,000	814,866	2055/3/20
第148回利付国債(5年)	0.005	2,750,000	2,749,642	2026/6/20	第9回利付国債(40年)	0.4	1,070,000	713,336	2056/3/20
第149回利付国債(5年)	0.005	3,145,000	3,144,150	2026/9/20	第10回利付国債(40年)	0.9	1,270,000	993,482	2057/3/20
第150回利付国債(5年)	0.005	2,610,000	2,608,460	2026/12/20	第11回利付国債(40年)	0.8	1,080,000	810,432	2058/3/20
第151回利付国債(5年)	0.005	1,840,000	1,838,252	2027/3/20	第12回利付国債(40年)	0.5	970,000	645,030	2059/3/20
第152回利付国債(5年)	0.1	1,375,000	1,377,805	2027/3/20	第13回利付国債(40年)	0.5	1,320,000	866,368	2060/3/20
第153回利付国債(5年)	0.005	2,945,000	2,939,993	2027/6/20	第14回利付国債(40年)	0.7	1,545,000	1,080,047	2061/3/20
第154回利付国債(5年)	0.1	2,650,000	2,651,908	2027/9/20	第15回利付国債(40年)	1.0	1,861,000	1,431,927	2062/3/20
第155回利付国債(5年)	0.3	910,000	916,724	2027/12/20					

当期末				当期末					
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
第16回利付国債(40年)	1.3	1,090,000	916,417	2063/3/20	第20回利付国債(30年)	2.5	250,000	296,900	2035/9/20
第338回利付国債(10年)	0.4	2,950,000	2,965,812	2025/3/20	第21回利付国債(30年)	2.3	685,000	798,867	2035/12/20
第339回利付国債(10年)	0.4	2,970,000	2,988,354	2025/6/20	第22回利付国債(30年)	2.5	475,000	565,064	2036/3/20
第340回利付国債(10年)	0.4	2,930,000	2,950,627	2025/9/20	第23回利付国債(30年)	2.5	180,000	214,290	2036/6/20
第341回利付国債(10年)	0.3	2,600,000	2,615,106	2025/12/20	第24回利付国債(30年)	2.5	150,000	178,794	2036/9/20
第342回利付国債(10年)	0.1	3,020,000	3,026,160	2026/3/20	第25回利付国債(30年)	2.3	185,000	216,072	2036/12/20
第343回利付国債(10年)	0.1	2,995,000	3,001,469	2026/6/20	第26回利付国債(30年)	2.4	1,210,000	1,428,501	2037/3/20
第344回利付国債(10年)	0.1	3,520,000	3,527,920	2026/9/20	第27回利付国債(30年)	2.5	890,000	1,062,544	2037/9/20
第345回利付国債(10年)	0.1	3,280,000	3,287,117	2026/12/20	第28回利付国債(30年)	2.5	1,035,000	1,235,914	2038/3/20
第346回利付国債(10年)	0.1	3,455,000	3,462,048	2027/3/20	第29回利付国債(30年)	2.4	880,000	1,038,822	2038/9/20
第347回利付国債(10年)	0.1	2,805,000	2,809,263	2027/6/20	第30回利付国債(30年)	2.3	810,000	944,217	2039/3/20
第348回利付国債(10年)	0.1	3,210,000	3,212,311	2027/9/20	第31回利付国債(30年)	2.2	900,000	1,034,298	2039/9/20
第349回利付国債(10年)	0.1	3,190,000	3,188,755	2027/12/20	第32回利付国債(30年)	2.3	1,075,000	1,249,365	2040/3/20
第350回利付国債(10年)	0.1	3,750,000	3,743,025	2028/3/20	第33回利付国債(30年)	2.0	1,420,000	1,583,186	2040/9/20
第351回利付国債(10年)	0.1	1,840,000	1,833,964	2028/6/20	第34回利付国債(30年)	2.2	1,350,000	1,542,037	2041/3/20
第352回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,657,050	2028/9/20	第35回利付国債(30年)	2.0	1,370,000	1,519,713	2041/9/20
第353回利付国債(10年)	0.1	2,860,000	2,841,953	2028/12/20	第36回利付国債(30年)	2.0	1,365,000	1,510,877	2042/3/20
第354回利付国債(10年)	0.1	2,835,000	2,814,786	2029/3/20	第37回利付国債(30年)	1.9	1,420,000	1,545,599	2042/9/20
第355回利付国債(10年)	0.1	3,060,000	3,036,315	2029/6/20	第38回利付国債(30年)	1.8	935,000	999,028	2043/3/20
第356回利付国債(10年)	0.1	2,760,000	2,737,644	2029/9/20	第39回利付国債(30年)	1.9	825,000	894,085	2043/6/20
第357回利付国債(10年)	0.1	2,640,000	2,616,187	2029/12/20	第40回利付国債(30年)	1.8	705,000	750,782	2043/9/20
第358回利付国債(10年)	0.1	2,980,000	2,948,441	2030/3/20	第41回利付国債(30年)	1.7	655,000	685,057	2043/12/20
第359回利付国債(10年)	0.1	3,040,000	3,002,729	2030/6/20	第42回利付国債(30年)	1.7	918,000	958,272	2044/3/20
第360回利付国債(10年)	0.1	2,885,000	2,842,677	2030/9/20	第43回利付国債(30年)	1.7	825,000	860,178	2044/6/20
第361回利付国債(10年)	0.1	2,870,000	2,820,636	2030/12/20	第44回利付国債(30年)	1.7	820,000	853,939	2044/9/20
第362回利付国債(10年)	0.1	3,150,000	3,087,472	2031/3/20	第45回利付国債(30年)	1.5	932,000	935,718	2044/12/20
第363回利付国債(10年)	0.1	3,415,000	3,337,684	2031/6/20	第46回利付国債(30年)	1.5	1,145,000	1,147,759	2045/3/20
第364回利付国債(10年)	0.1	3,555,000	3,464,169	2031/9/20	第47回利付国債(30年)	1.6	1,115,000	1,135,817	2045/6/20
第365回利付国債(10年)	0.1	3,785,000	3,678,225	2031/12/20	第48回利付国債(30年)	1.4	1,050,000	1,029,462	2045/9/20
第366回利付国債(10年)	0.2	2,868,000	2,802,781	2032/3/20	第49回利付国債(30年)	1.4	1,060,000	1,037,390	2045/12/20
第367回利付国債(10年)	0.2	3,145,000	3,065,179	2032/6/20	第50回利付国債(30年)	0.8	1,150,000	993,830	2046/3/20
第368回利付国債(10年)	0.2	3,975,000	3,863,183	2032/9/20	第51回利付国債(30年)	0.3	1,169,000	896,178	2046/6/20
第369回利付国債(10年)	0.5	2,920,000	2,906,363	2032/12/20	第52回利付国債(30年)	0.5	1,140,000	913,242	2046/9/20
第370回利付国債(10年)	0.5	3,196,000	3,173,755	2033/3/20	第53回利付国債(30年)	0.6	1,015,000	828,869	2046/12/20
第371回利付国債(10年)	0.4	3,400,000	3,337,950	2033/6/20	第54回利付国債(30年)	0.8	925,000	787,989	2047/3/20
第372回利付国債(10年)	0.8	3,190,000	3,242,316	2033/9/20	第55回利付国債(30年)	0.8	1,005,000	852,832	2047/6/20
第1回利付国債(30年)	2.8	50,000	57,176	2029/9/20	第56回利付国債(30年)	0.8	700,000	592,207	2047/9/20
第2回利付国債(30年)	2.4	100,000	112,869	2030/2/20	第57回利付国債(30年)	0.8	990,000	834,282	2047/12/20
第3回利付国債(30年)	2.3	140,000	157,661	2030/5/20	第58回利付国債(30年)	0.8	1,390,000	1,167,794	2048/3/20
第4回利付国債(30年)	2.9	190,000	222,813	2030/11/20	第59回利付国債(30年)	0.7	910,000	744,043	2048/6/20
第5回利付国債(30年)	2.2	180,000	203,331	2031/5/20	第60回利付国債(30年)	0.9	940,000	803,756	2048/9/20
第6回利付国債(30年)	2.4	205,000	235,659	2031/11/20	第61回利付国債(30年)	0.7	885,000	718,204	2048/12/20
第7回利付国債(30年)	2.3	130,000	148,989	2032/5/20	第62回利付国債(30年)	0.5	1,160,000	890,416	2049/3/20
第9回利付国債(30年)	1.4	180,000	193,235	2032/12/20	第63回利付国債(30年)	0.4	980,000	728,737	2049/6/20
第10回利付国債(30年)	1.1	170,000	177,915	2033/3/20	第64回利付国債(30年)	0.4	980,000	725,190	2049/9/20
第11回利付国債(30年)	1.7	375,000	412,642	2033/6/20	第65回利付国債(30年)	0.4	560,000	412,731	2049/12/20
第12回利付国債(30年)	2.1	430,000	489,322	2033/9/20	第66回利付国債(30年)	0.4	970,000	711,436	2050/3/20
第13回利付国債(30年)	2.0	130,000	146,812	2033/12/20	第67回利付国債(30年)	0.6	670,000	517,755	2050/6/20
第14回利付国債(30年)	2.4	350,000	409,118	2034/3/20	第68回利付国債(30年)	0.6	830,000	639,066	2050/9/20
第15回利付国債(30年)	2.5	370,000	436,711	2034/6/20	第69回利付国債(30年)	0.7	1,165,000	918,544	2050/12/20
第16回利付国債(30年)	2.5	335,000	395,980	2034/9/20	第70回利付国債(30年)	0.7	1,190,000	935,042	2051/3/20
第17回利付国債(30年)	2.4	405,000	475,004	2034/12/20	第71回利付国債(30年)	0.7	800,000	626,424	2051/6/20
第18回利付国債(30年)	2.3	380,000	442,213	2035/3/20	第72回利付国債(30年)	0.7	1,220,000	952,844	2051/9/20
第19回利付国債(30年)	2.3	345,000	401,814	2035/6/20	第73回利付国債(30年)	0.7	1,135,000	884,187	2051/12/20

当期末					当期末				
銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日	銘柄	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円			%	千円	千円	
第7 4 回利付国債 (3 0 年)	1.0	1,295,000	1,091,218	2052/3/20	第1 2 2 回利付国債 (2 0 年)	1.8	700,000	768,033	2030/9/20
第7 5 回利付国債 (3 0 年)	1.3	1,083,000	983,060	2052/6/20	第1 2 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	1,180,000	1,320,585	2030/12/20
第7 6 回利付国債 (3 0 年)	1.4	1,126,000	1,045,783	2052/9/20	第1 2 4 回利付国債 (2 0 年)	2.0	650,000	723,053	2030/12/20
第7 7 回利付国債 (3 0 年)	1.6	1,062,000	1,033,400	2052/12/20	第1 2 5 回利付国債 (2 0 年)	2.2	670,000	755,967	2031/3/20
第7 8 回利付国債 (3 0 年)	1.4	1,249,000	1,157,897	2053/3/20	第1 2 6 回利付国債 (2 0 年)	2.0	590,000	657,248	2031/3/20
第7 9 回利付国債 (3 0 年)	1.2	930,000	817,981	2053/6/20	第1 2 7 回利付国債 (2 0 年)	1.9	670,000	741,696	2031/3/20
第8 0 回利付国債 (3 0 年)	1.8	850,000	863,353	2053/9/20	第1 2 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	960,000	1,064,332	2031/6/20
第7 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	360,000	368,996	2025/3/20	第1 2 9 回利付国債 (2 0 年)	1.8	560,000	616,828	2031/6/20
第7 6 回利付国債 (2 0 年)	1.9	350,000	357,938	2025/3/20	第1 3 0 回利付国債 (2 0 年)	1.8	890,000	981,118	2031/9/20
第7 7 回利付国債 (2 0 年)	2.0	290,000	296,910	2025/3/20	第1 3 1 回利付国債 (2 0 年)	1.7	575,000	629,602	2031/9/20
第7 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	120,000	123,273	2025/6/20	第1 3 2 回利付国債 (2 0 年)	1.7	600,000	657,510	2031/12/20
第7 9 回利付国債 (2 0 年)	2.0	100,000	102,868	2025/6/20	第1 3 3 回利付国債 (2 0 年)	1.8	790,000	871,757	2031/12/20
第8 0 回利付国債 (2 0 年)	2.1	250,000	257,522	2025/6/20	第1 3 4 回利付国債 (2 0 年)	1.8	725,000	801,030	2032/3/20
第8 1 回利付国債 (2 0 年)	2.0	180,000	186,042	2025/9/20	第1 3 5 回利付国債 (2 0 年)	1.7	580,000	636,265	2032/3/20
第8 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	485,000	502,086	2025/9/20	第1 3 6 回利付国債 (2 0 年)	1.6	530,000	577,254	2032/3/20
第8 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	470,000	488,865	2025/12/20	第1 3 7 回利付国債 (2 0 年)	1.7	680,000	746,721	2032/6/20
第8 4 回利付国債 (2 0 年)	2.0	190,000	197,263	2025/12/20	第1 3 8 回利付国債 (2 0 年)	1.5	460,000	497,503	2032/6/20
第8 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	360,000	376,236	2026/3/20	第1 3 9 回利付国債 (2 0 年)	1.6	645,000	702,798	2032/6/20
第8 6 回利付国債 (2 0 年)	2.3	240,000	251,858	2026/3/20	第1 4 0 回利付国債 (2 0 年)	1.7	1,295,000	1,422,764	2032/9/20
第8 7 回利付国債 (2 0 年)	2.2	170,000	178,034	2026/3/20	第1 4 1 回利付国債 (2 0 年)	1.7	660,000	725,676	2032/12/20
第8 8 回利付国債 (2 0 年)	2.3	290,000	305,970	2026/6/20	第1 4 2 回利付国債 (2 0 年)	1.8	780,000	864,247	2032/12/20
第8 9 回利付国債 (2 0 年)	2.2	320,000	336,851	2026/6/20	第1 4 3 回利付国債 (2 0 年)	1.6	1,320,000	1,440,146	2033/3/20
第9 0 回利付国債 (2 0 年)	2.2	610,000	645,404	2026/9/20	第1 4 4 回利付国債 (2 0 年)	1.5	550,000	595,270	2033/3/20
第9 1 回利付国債 (2 0 年)	2.3	310,000	328,817	2026/9/20	第1 4 5 回利付国債 (2 0 年)	1.7	1,030,000	1,133,391	2033/6/20
第9 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	1,190,000	1,261,721	2026/12/20	第1 4 6 回利付国債 (2 0 年)	1.7	1,280,000	1,408,524	2033/9/20
第9 3 回利付国債 (2 0 年)	2.0	400,000	424,756	2027/3/20	第1 4 7 回利付国債 (2 0 年)	1.6	1,605,000	1,750,974	2033/12/20
第9 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	445,000	473,942	2027/3/20	第1 4 8 回利付国債 (2 0 年)	1.5	1,435,000	1,551,177	2034/3/20
第9 5 回利付国債 (2 0 年)	2.3	950,000	1,022,494	2027/6/20	第1 4 9 回利付国債 (2 0 年)	1.5	1,920,000	2,074,003	2034/6/20
第9 6 回利付国債 (2 0 年)	2.1	530,000	566,840	2027/6/20	第1 5 0 回利付国債 (2 0 年)	1.4	1,960,000	2,096,063	2034/9/20
第9 7 回利付国債 (2 0 年)	2.2	570,000	614,066	2027/9/20	第1 5 1 回利付国債 (2 0 年)	1.2	1,775,000	1,859,277	2034/12/20
第9 8 回利付国債 (2 0 年)	2.1	370,000	397,254	2027/9/20	第1 5 2 回利付国債 (2 0 年)	1.2	1,795,000	1,878,126	2035/3/20
第9 9 回利付国債 (2 0 年)	2.1	1,290,000	1,390,129	2027/12/20	第1 5 3 回利付国債 (2 0 年)	1.3	1,585,000	1,673,062	2035/6/20
第1 0 0 回利付国債 (2 0 年)	2.2	660,000	716,139	2028/3/20	第1 5 4 回利付国債 (2 0 年)	1.2	1,945,000	2,029,024	2035/9/20
第1 0 1 回利付国債 (2 0 年)	2.4	360,000	393,595	2028/3/20	第1 5 5 回利付国債 (2 0 年)	1.0	1,475,000	1,502,980	2035/12/20
第1 0 2 回利付国債 (2 0 年)	2.4	1,070,000	1,174,335	2028/6/20	第1 5 6 回利付国債 (2 0 年)	0.4	1,425,000	1,350,643	2036/3/20
第1 0 3 回利付国債 (2 0 年)	2.3	920,000	1,005,679	2028/6/20	第1 5 7 回利付国債 (2 0 年)	0.2	1,960,000	1,804,866	2036/6/20
第1 0 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	260,000	281,941	2028/6/20	第1 5 8 回利付国債 (2 0 年)	0.5	1,945,000	1,853,429	2036/9/20
第1 0 5 回利付国債 (2 0 年)	2.1	730,000	793,816	2028/9/20	第1 5 9 回利付国債 (2 0 年)	0.6	1,730,000	1,663,239	2036/12/20
第1 0 6 回利付国債 (2 0 年)	2.2	400,000	436,812	2028/9/20	第1 6 0 回利付国債 (2 0 年)	0.7	850,000	825,146	2037/3/20
第1 0 7 回利付国債 (2 0 年)	2.1	500,000	545,495	2028/12/20	第1 6 1 回利付国債 (2 0 年)	0.6	1,650,000	1,575,700	2037/6/20
第1 0 8 回利付国債 (2 0 年)	1.9	925,000	1,000,193	2028/12/20	第1 6 2 回利付国債 (2 0 年)	0.6	1,200,000	1,141,632	2037/9/20
第1 0 9 回利付国債 (2 0 年)	1.9	642,000	696,602	2029/3/20	第1 6 3 回利付国債 (2 0 年)	0.6	1,675,000	1,587,380	2037/12/20
第1 1 0 回利付国債 (2 0 年)	2.1	515,000	564,048	2029/3/20	第1 6 4 回利付国債 (2 0 年)	0.5	1,345,000	1,252,302	2038/3/20
第1 1 1 回利付国債 (2 0 年)	2.2	450,000	497,196	2029/6/20	第1 6 5 回利付国債 (2 0 年)	0.5	1,535,000	1,423,113	2038/6/20
第1 1 2 回利付国債 (2 0 年)	2.1	880,000	967,595	2029/6/20	第1 6 6 回利付国債 (2 0 年)	0.7	810,000	769,589	2038/9/20
第1 1 3 回利付国債 (2 0 年)	2.1	1,525,000	1,683,783	2029/9/20	第1 6 7 回利付国債 (2 0 年)	0.5	1,350,000	1,240,690	2038/12/20
第1 1 4 回利付国債 (2 0 年)	2.1	920,000	1,019,663	2029/12/20	第1 6 8 回利付国債 (2 0 年)	0.4	1,660,000	1,495,477	2039/3/20
第1 1 5 回利付国債 (2 0 年)	2.2	370,000	412,235	2029/12/20	第1 6 9 回利付国債 (2 0 年)	0.3	1,255,000	1,107,412	2039/6/20
第1 1 6 回利付国債 (2 0 年)	2.2	330,000	368,771	2030/3/20	第1 7 0 回利付国債 (2 0 年)	0.3	1,300,000	1,141,257	2039/9/20
第1 1 7 回利付国債 (2 0 年)	2.1	935,000	1,039,196	2030/3/20	第1 7 1 回利付国債 (2 0 年)	0.3	1,210,000	1,056,765	2039/12/20
第1 1 8 回利付国債 (2 0 年)	2.0	450,000	498,703	2030/6/20	第1 7 2 回利付国債 (2 0 年)	0.4	1,190,000	1,051,222	2040/3/20
第1 1 9 回利付国債 (2 0 年)	1.8	320,000	350,604	2030/6/20	第1 7 3 回利付国債 (2 0 年)	0.4	1,350,000	1,186,501	2040/6/20
第1 2 0 回利付国債 (2 0 年)	1.6	895,000	969,338	2030/6/20	第1 7 4 回利付国債 (2 0 年)	0.4	1,525,000	1,333,414	2040/9/20
第1 2 1 回利付国債 (2 0 年)	1.9	970,000	1,070,598	2030/9/20	第1 7 5 回利付国債 (2 0 年)	0.5	1,320,000	1,168,767	2040/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
第176回利付国債(20年)	0.5	1,340,000	1,180,526	2041/3/20
第177回利付国債(20年)	0.4	1,495,000	1,288,465	2041/6/20
第178回利付国債(20年)	0.5	1,640,000	1,432,031	2041/9/20
第179回利付国債(20年)	0.5	1,570,000	1,364,753	2041/12/20
第180回利付国債(20年)	0.8	1,610,000	1,471,234	2042/3/20
第181回利付国債(20年)	0.9	1,565,000	1,451,537	2042/6/20
第182回利付国債(20年)	1.1	1,565,000	1,497,751	2042/9/20
第183回利付国債(20年)	1.4	1,443,000	1,448,411	2042/12/20
第184回利付国債(20年)	1.1	1,750,000	1,664,407	2043/3/20
第185回利付国債(20年)	1.1	1,710,000	1,621,815	2043/6/20
第186回利付国債(20年)	1.5	1,300,000	1,318,005	2043/9/20
小計		347,663,000	343,705,699	
地方債証券				
第1回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	0.982	100,000	86,141	2047/9/20
第7回東京都公募公債(30年)	2.51	200,000	235,074	2038/9/17
第11回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000	212,992	2027/3/19
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	150,000	162,094	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	108,449	2028/12/20
第18回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000	218,872	2029/3/19
第20回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	109,593	2029/9/20
第21回東京都公募公債(20年)	2.19	100,000	110,552	2029/12/20
第760回東京都公募公債	0.045	140,000	139,703	2026/9/18
第780回東京都公募公債	0.16	200,000	198,576	2028/9/20
第800回東京都公募公債	0.08	300,000	294,888	2029/12/20
第830回東京都公募公債	0.275	100,000	97,095	2032/6/18
平成27年度第1回北海道公募公債	0.43	200,000	200,910	2025/4/30
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,218	2026/2/26
平成30年度第3回北海道公募公債	0.205	100,000	99,586	2028/6/29
令和4年度第1回北海道公募公債	0.294	100,000	97,328	2032/4/28
第3回神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	118,811	2037/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	109,238	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	300,000	329,490	2030/11/12
第16回神奈川県公募公債(20年)	2.09	600,000	665,862	2031/1/24
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	300,000	326,142	2032/6/18
第21回神奈川県公募公債(20年)	1.732	100,000	108,949	2032/9/17
第243回神奈川県公募公債	0.075	100,000	98,267	2029/12/20
第2回大阪府公募公債(20年)	2.23	300,000	331,725	2029/11/16
第183回大阪府公募公債(5年)	0.001	240,000	239,304	2026/5/28
第403回大阪府公募公債(10年)	0.462	300,000	301,992	2025/12/25
第417回大阪府公募公債(10年)	0.248	108,000	108,308	2027/2/26
第423回大阪府公募公債(10年)	0.185	300,000	299,892	2027/8/30
平成19年度第3回京都府公募公債(20年)	2.22	100,000	107,731	2027/12/20
平成25年度第2回京都府公募公債(15年)	1.05	100,000	103,265	2028/4/28
平成27年度第4回京都府公募公債	0.553	100,000	100,678	2025/6/19
平成27年度第13回京都府公募公債	0.11	105,860	105,870	2026/3/17
令和2年度第1回京都府公募公債(10年)	0.135	100,000	98,394	2030/4/12
令和5年度第6回京都府公募公債	0.767	100,000	100,247	2033/9/20
第3回兵庫県公募公債(20年)	2.31	100,000	107,633	2027/9/21
第4回兵庫県公募公債(15年)	1.31	100,000	104,155	2027/12/24
第8回兵庫県公募公債(15年)	1.09	100,000	103,667	2029/4/16
第11回兵庫県公募公債(15年)	0.718	200,000	203,656	2030/5/10
平成28年度第30回兵庫県公募公債	0.215	100,000	100,188	2027/3/19
令和3年度第9回兵庫県公募公債(5年)	0.001	100,000	99,607	2026/11/24

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
	%	千円	千円	
令和5年度第2回兵庫県公募公債	0.701	100,000	99,837	2033/5/30
令和5年度第4回兵庫県公募公債(グリーンボンド・10年)	0.661	100,000	99,442	2033/6/20
令和3年度第5回兵庫県公募公債	0.815	100,000	100,635	2033/9/22
第4回静岡県公募公債(15年)	1.338	100,000	104,547	2028/6/23
第12回静岡県公募公債(30年)	0.822	100,000	82,498	2048/3/19
第15回静岡県公募公債(20年)	1.701	100,000	108,723	2032/10/15
平成27年度第1回静岡県公募公債	0.425	100,000	100,452	2025/4/21
平成27年度第6回静岡県公募公債	0.494	100,000	100,589	2025/6/20
平成29年度第1回静岡県公募公債	0.215	100,000	100,090	2027/9/17
令和4年度第5回静岡県公募公債	0.29	100,000	97,215	2032/6/18
平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	2.087	100,000	110,891	2030/12/13
平成25年度第8回愛知県公募公債(30年)	2.024	110,000	119,278	2043/6/19
平成25年度第17回愛知県公募公債(20年)	1.608	100,000	107,963	2033/12/20
平成27年度第6回愛知県公募公債(10年)	0.454	200,000	201,334	2025/12/25
平成27年度第17回愛知県公募公債(10年)	0.38	200,000	201,102	2026/1/27
平成29年度第5回愛知県公募公債(10年)	0.2	200,000	200,204	2027/6/29
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	0.22	100,000	100,139	2027/7/28
平成29年度第6回愛知県公募公債(10年)	0.26	100,000	100,060	2028/2/14
平成30年度第1回愛知県公募公債(10年)	0.185	200,000	199,284	2028/4/27
令和元年度第16回愛知県公募公債(10年)	0.09	100,000	98,224	2030/2/15
令和2年度第7回愛知県公募公債(10年)	0.145	100,000	98,195	2030/7/31
令和3年度第6回愛知県公募公債(30年)	0.718	200,000	152,742	2051/6/20
平成20年度第1回広島県公募公債(20年)	2.34	100,000	109,329	2028/9/21
平成27年度第2回広島県公募公債	0.602	162,000	163,266	2025/7/24
平成29年度第7回広島県公募公債	0.2	131,440	131,114	2028/3/23
令和2年度第7回広島県公募公債	0.214	100,000	97,994	2031/3/19
第2回埼玉県公募公債(10年)	0.706	100,000	100,011	2033/5/20
第5回埼玉県公募公債(20年)	2.35	100,000	108,598	2028/3/17
第7回埼玉県公募公債(15年)	0.34	400,000	374,424	2035/8/17
第8回埼玉県公募公債(15年)	0.867	100,000	92,899	2036/4/18
第9回埼玉県公募公債(30年)	0.345	100,000	82,949	2048/3/19
第18回埼玉県公募公債(20年)	0.323	200,000	184,544	2036/5/20
平成29年度第5回埼玉県公募公債	0.22	100,000	100,156	2027/7/26
平成19年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.62	100,000	118,929	2037/9/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(20年)	2.26	100,000	108,825	2028/8/18
平成20年度第1回福岡県公募公債(30年)	2.28	200,000	228,858	2038/9/17
平成23年度第1回福岡県公募公債(15年)	1.491	100,000	103,844	2026/11/27
平成29年度第8回福岡県公募公債	0.23	200,000	199,836	2028/2/25
令和3年度第2回福岡県公募公債	0.155	100,000	97,351	2031/5/30
令和3年度第5回福岡県公募公債	0.001	100,000	99,634	2026/11/25
令和3年度第1回福岡県公募公債(15年)	0.299	200,000	183,544	2036/7/14
第6回千葉県公募公債(20年)	2.26	200,000	219,542	2029/4/20
第8回千葉県公募公債(20年)	2.18	100,000	110,896	2030/4/19
第9回千葉県公募公債(20年)	1.84	100,000	109,129	2030/10/11
平成28年度第1回千葉県公募公債	0.08	100,000	99,918	2026/5/25
平成28年度第5回千葉県公募公債	0.215	120,000	119,953	2027/12/24
令和元年度第7回千葉県公募公債	0.08	100,000	98,157	2030/2/25
平成27年度第3回新潟県公募公債	0.12	200,000	200,402	2026/3/25
平成28年度第1回新潟県公募公債	0.08	120,000	119,828	2026/11/30
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	0.19	200,000	195,476	2031/4/16
第13回群馬県公募公債(10年)	0.486	100,000	100,714	2025/11/25
第28回群馬県公募公債(10年)	0.656	100,000	99,485	2033/6/20
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	100,000	100,433	2025/4/25

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153回共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	100,696	2025/12/25	
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	300,000	299,535	2026/8/25	
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	100,307	2027/2/25	
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	100,000	100,050	2027/6/25	
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	150,000	150,055	2027/10/25	
第178回共同発行市場公募地方債	0.23	100,000	99,980	2028/1/25	
第181回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	99,621	2028/4/25	
第194回共同発行市場公募地方債	0.11	160,000	157,822	2029/5/25	
第209回共同発行市場公募地方債	0.125	100,000	98,018	2030/8/23	
第228回共同発行市場公募地方債	0.199	200,000	193,464	2032/3/25	
第231回共同発行市場公募地方債	0.309	200,000	194,720	2032/6/25	
第233回共同発行市場公募地方債	0.315	200,000	194,482	2032/8/25	
第243回共同発行市場公募地方債	0.681	100,000	99,703	2033/6/24	
平成27年度第1回熊本市公募債	0.476	100,000	100,689	2025/11/27	
令和3年度第4回奈良県公募債(5年)	0.001	100,000	99,633	2026/11/30	
第7回大阪市公募債(30年)	0.973	100,000	85,921	2047/9/20	
第10回大阪市公募債(20年)	2.22	100,000	110,836	2030/1/25	
第22回大阪市公募債(20年)	0.347	100,000	92,520	2036/5/30	
令和3年度第2回大阪市公募債	0.16	100,000	97,429	2031/5/21	
第3回名古屋市公募債(30年)	2.5	100,000	117,425	2037/9/18	
第13回名古屋市公募債(30年)	0.977	100,000	85,987	2047/9/20	
第4959回名古屋市公募債(10年)	0.11	100,000	100,010	2026/3/19	
第522回名古屋市公募債(10年)	0.554	200,000	197,894	2032/12/20	
第2回京都市公募債(20年)	2.12	100,000	103,359	2025/9/19	
第6回京都市公募債(20年)	2.38	100,000	107,903	2027/9/17	
平成27年度第5回京都市公募債	0.205	200,000	200,416	2026/2/25	
令和4年度第3回京都市公募債	0.554	200,000	197,894	2032/12/20	
令和4年度第4回京都市公募債	0.8	100,000	100,976	2033/1/24	
平成20年度第1回神戸市公募債(20年)	2.38	100,000	109,003	2028/5/26	
平成24年度第12回神戸市公募債(20年)	1.711	100,000	108,834	2032/12/17	
平成26年度第3回神戸市公募債(20年)	1.482	100,000	106,489	2034/7/14	
令和2年度第9回神戸市公募債(30年)	0.674	100,000	76,551	2050/6/20	
第5回横浜市公募債(20年)	2.17	100,000	102,954	2025/6/20	
第5回横浜市公募債(30年)	2.64	100,000	119,043	2037/3/19	
第7回横浜市公募債(30年)	2.54	100,000	118,021	2038/3/19	
第25回横浜市公募債(20年)	1.72	100,000	108,815	2032/7/16	
第26回横浜市公募債(20年)	1.776	100,000	109,397	2033/1/28	
平成28年度第5回横浜市公募債	0.23	100,000	100,260	2027/2/19	
平成29年度第5回横浜市公募債	0.25	100,000	100,039	2028/1/28	
第55回横浜市公募債(5年)	0.01	100,000	99,754	2026/5/28	
令和3年度第2回横浜市公募債	0.16	100,000	97,427	2031/5/23	
平成25年度第5回札幌市公募債(15年)	1.31	200,000	209,040	2028/8/18	
第8回川崎市公募債(20年)	2.2	100,000	110,203	2029/9/20	
第11回川崎市公募債(20年)	1.84	150,000	163,731	2030/10/18	
第13回川崎市公募債(30年)	1.695	200,000	194,088	2053/6/20	
第66回川崎市公募債(5年)	0.14	200,000	199,636	2027/9/17	
第88回川崎市公募債	0.464	100,000	100,681	2025/12/19	
平成25年度第6回福岡市公募債(20年)	1.511	400,000	427,504	2034/2/17	
平成29年度第12回福岡市公募債	0.2	130,000	129,677	2028/3/28	
平成30年度第9回福岡市公募債(10年)	0.289	100,000	99,831	2028/10/30	
平成27年度第2回広島市公募債	0.464	100,000	100,687	2025/12/25	
令和3年度第3回仙台市公募債(5年)	0.001	135,000	134,435	2027/1/28	
平成27年度第1回三重県公募債	0.464	100,000	100,687	2025/12/25	

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		
令和3年度第2回三重県公募債	0.269	100,000	97,369	2032/3/4	
令和5年度第5回福井県公募債	0.767	100,000	100,203	2033/9/29	
平成27年度第1回山梨県公募債(10年)	0.495	100,000	100,709	2025/10/30	
小計		20,712,300	21,100,683		
特殊債券(除く金融債)					
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	107,952	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	109,094	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	109,902	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	111,008	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	114,569	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	113,012	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	110,233	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	111,254	2040/11/30	
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.645	100,000	108,520	2032/10/29	
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	108,849	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	109,258	2033/1/31	
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	103,951	2034/12/28	
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	100,000	100,444	2025/2/28	
第241回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.45	300,000	301,545	2025/3/31	
第246回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	100,000	103,131	2035/5/31	
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	301,959	2025/5/30	
第254回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.44	100,000	100,631	2025/8/29	
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	100,513	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	99,886	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	99,798	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	300,135	2027/1/29	
第327回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.17	100,000	100,018	2027/10/29	
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	242,851	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	99,689	2028/10/31	
第400回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.442	500,000	364,785	2050/1/31	
第70回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.45	100,000	100,500	2025/3/14	
第73回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.484	100,000	100,630	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	201,146	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	423,517	2025/12/12	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
第8 2回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	200,000	199,806	2026/3/13	
第9 1回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	99,985	2026/12/14	
第1 0 3回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	133,000	132,870	2027/12/17	
第1 0 5回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	113,000	112,953	2028/2/15	
第1 0 7回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.12	100,000	99,560	2028/4/14	
第1 1 0回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	150,000	149,178	2028/7/18	
第1 1 3回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	99,715	2028/10/16	
第1 2 9回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	60,835	2070/7/16	
第1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.99	100,000	122,919	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	157,404	2026/3/19	
第2 1 回道路債券	2.75	100,000	117,207	2033/6/20	
第2 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	200,000	233,700	2047/3/20	
第2 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	100,000	107,688	2027/10/20	
第2 8 回道路債券	2.83	300,000	355,569	2033/12/20	
第3 3 回道路債券	2.91	100,000	119,634	2034/6/20	
第3 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	109,009	2028/6/20	
第3 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	100,000	109,161	2028/9/20	
第4 2 回道路債券	2.22	100,000	102,452	2025/3/21	
第4 9 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	110,274	2029/5/18	
第1 5 5 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	103,183	2035/6/20	
第3 0 1 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.201	200,000	199,874	2027/5/26	
第3 0 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.934	100,000	96,089	2038/5/26	
第3 0 7 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.101	100,000	95,658	2040/7/27	
第3 1 2 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.186	200,000	196,250	2039/8/19	
第3 1 6 回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.213	200,000	198,956	2038/9/21	
第2 回地方官営企業等金融機構債券(20年)	2.29	100,000	109,707	2029/4/27	
第4 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.12	100,000	109,802	2029/12/28	
第5 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.22	200,000	220,986	2030/1/28	
第7 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	100,000	110,658	2030/4/26	
第1 1 回公営企業債券(20年)	2.11	100,000	102,342	2025/3/24	
第1 2 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	110,465	2030/12/27	
第1 5 回公営企業債券(20年)	2.15	100,000	103,386	2025/9/30	
第1 5 回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.03	300,000	330,843	2031/6/27	
第1 7 回公営企業債券(20年)	2.39	100,000	104,815	2026/3/24	
第1 7 回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	109,277	2031/9/26	
第1 9 回公営企業債券(20年)	2.37	100,000	106,265	2026/12/18	
第2 2 回公営企業債券(20年)	2.32	200,000	214,112	2027/6/18	
第2 3 回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	400,000	432,004	2032/7/25	
第2 4 回公営企業債券(20年)	2.29	100,000	108,246	2028/4/28	
第3 0 回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.812	100,000	109,263	2033/7/28	
第3 4 回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	400,000	429,164	2034/1/27	
第7 5 回地方公共団体金融機構債券	0.529	100,000	100,652	2025/8/28	
第7 6 回地方公共団体金融機構債券	1.448	100,000	102,323	2025/10/28	
第8 3 回地方公共団体金融機構債券	0.09	200,000	199,706	2026/4/28	
第9 6 回地方公共団体金融機構債券	0.205	100,000	99,983	2027/5/28	
F 2 0 2 回地方公共団体金融機構債券	0.929	200,000	203,688	2026/6/26	
第2 9 回首都高速道路株式会社社債	0.125	100,000	99,740	2026/12/18	
第2 7 回阪神高速道路株式会社社債	0.27	100,000	100,140	2027/3/19	
第2 8 回阪神高速道路株式会社社債	0.305	100,000	100,263	2026/6/19	
第8 9 回株式会社日本政策金融公庫社債	0.03	100,000	99,930	2025/3/12	
第1 5 5 回都市再生債券	0.43	100,000	61,251	2059/3/19	
第1 6 1 回都市再生債券	0.687	100,000	67,761	2059/3/19	
第1 6 9 回都市再生債券	0.862	100,000	71,508	2060/3/19	
第1 9 1 回都市再生債券	1.907	100,000	95,470	2063/3/19	

銘柄	当期		期末		償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円	
第5 回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	126,225	125,153	2033/7/10	
第2 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.46	100,000	107,510	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	45,064	44,665	2034/2/10	
第9 回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	55,466	54,966	2034/8/10	
第1 2 回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.15	10,594	10,716	2040/11/10	
第2 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.6	100,000	110,239	2028/9/20	
第2 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	13,167	13,650	2044/5/10	
第2 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	14,806	15,473	2044/6/10	
第2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.14	27,152	28,122	2044/7/10	
第2 3 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	10,248	10,343	2040/9/10	
第3 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	19,083	19,952	2045/3/10	
第3 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.87	18,095	18,911	2045/4/10	
第3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	17,369	18,095	2045/5/10	
第3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	37,466	39,242	2045/8/10	
第4 0 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.93	20,052	20,113	2041/3/10	
第4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	22,702	23,483	2045/11/10	
第4 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	22,535	23,440	2045/12/10	
第4 3 回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	110,939	2030/2/18	
第4 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.77	64,296	67,189	2046/1/10	
第4 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	71,036	73,858	2046/2/10	
第4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	16,838	17,469	2046/6/10	
第5 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	17,417	18,041	2046/7/10	
第5 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	18,357	19,020	2046/8/10	
第5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	20,700	21,398	2046/10/10	
第5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.47	21,879	22,632	2046/11/10	
第5 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	24,602	25,432	2046/12/10	
第5 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	23,497	24,305	2047/2/10	
第6 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	32,702	33,340	2047/12/10	
第6 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	34,225	35,195	2048/2/10	
第7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	29,585	30,410	2048/3/10	
第7 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	28,063	28,630	2048/4/10	
第7 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	28,562	29,147	2048/5/10	
第7 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	33,740	34,736	2048/6/10	
第8 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	1.841	100,000	108,928	2031/10/17	
第8 8 回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	109,107	2031/11/18	
第1 0 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	55,663	55,342	2051/1/10	
第1 0 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	127,886	123,216	2051/6/10	
第1 1 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.19	65,831	62,775	2051/8/10	
第1 1 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	67,477	65,041	2051/10/10	
第1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	67,005	64,385	2051/11/10	
第1 1 5 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	67,392	64,981	2051/12/10	
第1 1 5 回一般担保住宅金融支援機構債券	1.811	100,000	108,920	2032/9/14	
第1 1 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	67,950	65,782	2052/1/10	
第1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	68,188	65,857	2052/2/10	
第1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	67,697	65,476	2052/3/10	
第1 2 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	69,238	66,624	2052/6/10	
第1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	70,975	68,136	2052/11/10	
第1 2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	72,253	69,168	2052/12/10	
第1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	70,825	67,955	2053/1/10	
第1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	73,005	69,888	2053/6/10	
第1 3 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	73,973	70,569	2053/8/10	
第1 3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	74,625	71,428	2053/9/10	
第1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	74,797	71,664	2053/12/10	
第1 4 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	74,571	71,021	2054/1/10	

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144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	76,469	72,416	2054/5/10	
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	77,743	73,435	2054/6/10	
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	79,253	74,252	2054/7/10	
第151回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.26	247,593	232,187	2054/12/10	
第152回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	246,402	232,426	2055/1/10	
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	82,410	77,726	2055/2/10	
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	166,216	156,253	2055/3/10	
第157回一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	100,403	2025/5/20	
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	85,320	80,530	2055/9/10	
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	85,370	80,456	2055/10/10	
第162回一般担保住宅金融支援機構債券	1.299	100,000	103,172	2035/6/20	
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	86,672	81,600	2055/12/10	
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	87,499	82,189	2056/1/10	
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	87,502	82,758	2056/3/10	
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	87,219	82,349	2056/5/10	
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	177,266	167,113	2056/6/10	
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	90,056	84,419	2056/10/10	
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	91,299	85,833	2056/12/10	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	182,938	173,679	2057/3/10	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	92,641	88,071	2057/6/10	
第184回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	93,996	89,217	2057/9/10	
第184回一般担保住宅金融支援機構債券	0.195	100,000	100,092	2026/2/20	
第185回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.58	189,576	181,128	2057/10/10	
第188回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	95,618	95,078	2058/1/10	
第190回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	96,157	96,153	2058/3/10	
第193回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	97,289	96,811	2058/6/10	
第194回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.94	98,029	97,377	2058/7/10	
第195回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.93	98,491	97,705	2058/8/10	
第196回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	98,783	98,821	2058/9/10	
第199回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.11	99,894	100,683	2058/12/10	
第354回一般担保住宅金融支援機構債券	0.964	200,000	192,148	2038/7/20	
第356回一般担保住宅金融支援機構債券	1.156	500,000	493,570	2038/8/20	
第34回国際協力機構債券	0.245	100,000	100,194	2026/2/12	
第67回東日本高速道路株式会社社債	0.22	200,000	196,902	2030/1/31	
第74回東日本高速道路株式会社社債	0.06	100,000	99,760	2025/12/19	
第87回東日本高速道路株式会社社債	0.1	100,000	98,201	2028/12/20	
第102回東日本高速道路株式会社社債	0.121	100,000	100,000	2025/4/28	
第103回東日本高速道路株式会社社債	0.434	100,000	100,310	2028/4/28	
第88回中日本高速道路株式会社社債	0.05	100,000	99,669	2026/5/8	
第100回中日本高速道路株式会社社債	0.385	100,000	100,085	2028/5/18	
第101回中日本高速道路株式会社社債	0.439	100,000	100,166	2028/8/17	
第103回中日本高速道路株式会社社債	0.588	100,000	100,700	2028/11/21	
第27回西日本高速道路株式会社社債	0.58	100,000	100,699	2025/9/12	
第29回西日本高速道路株式会社社債	0.31	100,000	100,255	2026/2/12	
第54回西日本高速道路株式会社社債	0.07	200,000	199,816	2025/6/20	
第56回西日本高速道路株式会社社債	0.06	100,000	99,851	2025/9/19	
第77回西日本高速道路株式会社社債	0.39	300,000	300,126	2028/5/25	
第80回西日本高速道路株式会社社債	0.484	100,000	100,261	2028/8/31	
第6回回航建設・運輸施設整備支援機構債券	1.086	100,000	103,483	2029/5/29	
第20回アンドン開発公社円貨債券(2023)	0.73	200,000	200,032	2027/1/7	
小計		21,143,055	21,275,138		
金融債券					
い第845号商工債	0.12	200,000	199,636	2025/10/27	
い第853号商工債	0.09	100,000	99,542	2026/6/26	

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		
い第876号商工債	0.45	400,000	399,488	2028/5/26	
い第878号商工債	0.43	100,000	99,700	2028/7/27	
第376回回信中金債(5年)	0.05	200,000	199,436	2026/3/27	
第379回回信中金債(5年)	0.04	100,000	99,637	2026/6/26	
第386回回信中金債(5年)	0.05	100,000	99,520	2027/1/27	
第394回回信中金債(5年)	0.15	100,000	99,581	2027/9/27	
小計		1,300,000	1,296,540		
普通社債券(含む投資法人債券)					
第535回中部電力株式会社社債	0.26	200,000	195,660	2029/11/22	
第509回関西電力株式会社社債	0.47	100,000	100,197	2027/5/25	
第510回関西電力株式会社社債	0.49	100,000	100,155	2027/7/23	
第536回関西電力株式会社社債	0.44	100,000	97,577	2030/12/20	
第541回関西電力株式会社社債	0.37	100,000	96,106	2031/9/19	
第554回関西電力株式会社社債	0.41	100,000	100,168	2025/10/24	
第393回中国電力株式会社社債	0.26	100,000	99,803	2026/11/25	
第425回中国電力株式会社社債	0.37	100,000	97,885	2030/6/25	
第426回中国電力株式会社社債	0.33	100,000	97,550	2030/7/25	
第448回中国電力株式会社社債	0.45	100,000	100,331	2026/9/25	
第448回中国電力株式会社社債	0.92	100,000	98,900	2033/5/25	
第307回北陸電力株式会社社債	1.055	100,000	101,778	2026/6/25	
第325回北陸電力株式会社社債	0.365	100,000	99,967	2027/4/23	
第364回北陸電力株式会社社債	0.9	100,000	98,646	2033/5/25	
第508回東北電力株式会社社債	0.465	100,000	99,136	2029/4/25	
第521回東北電力株式会社社債	0.45	100,000	98,397	2030/5/24	
第535回東北電力株式会社社債	0.2	200,000	198,724	2028/7/25	
第468回九州電力株式会社社債	0.435	100,000	99,323	2028/8/25	
第507回九州電力株式会社社債	0.644	200,000	194,910	2032/5/25	
第516回九州電力株式会社社債	0.92	300,000	296,196	2033/5/25	
第323回北海道電力株式会社社債	1.337	100,000	103,645	2030/3/25	
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	200,000	201,788	2025/12/25	
第375回北海道電力株式会社社債	1.475	100,000	98,996	2029/5/25	
第385回北海道電力株式会社社債	0.403	100,000	99,623	2033/5/25	
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,623	2027/11/30	
第17回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.29	100,000	100,045	2026/3/13	
第12回西松建設株式会社無担保社債	0.6	100,000	99,028	2029/3/1	
第5回五洋建設株式会社無担保社債	0.25	100,000	99,854	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	199,070	2026/6/3	
第3回高砂熟学工業株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,552	2026/7/16	
第2回DM3井製糖ホールディングス株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,973	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	99,559	2026/6/3	
第22回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.673	100,000	100,529	2028/10/26	
第12回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.8	100,000	98,480	2033/5/25	
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	100,000	100,023	2025/8/29	
第11回ヒューリック株式会社無担保社債	0.32	100,000	99,948	2026/4/13	
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	100,181	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	98,772	2030/4/22	
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	99,887	2025/12/19	
第16回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.4	100,000	100,285	2026/11/2	
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,862	2027/7/16	

当 期		末		償還年月日	当 期		末		償還年月日
銘	利率	額面金額	評 価 額		銘	利率	額面金額	評 価 額	
	%	千円	千円			千円	千円		
第19回旭化成株式会社無担保社債	0.23	100,000	99,941	2025/12/5	第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	100,000	99,683	2026/12/11
第31回レンゴウ株式会社無担保社債	0.728	100,000	100,448	2028/12/13	第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,773	2025/12/19
第13回イビデン株式会社無担保社債	0.29	100,000	99,958	2025/9/12	第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.38	100,000	97,775	2030/9/20
第22回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	0.17	100,000	99,766	2025/9/3	第25回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.648	100,000	99,704	2030/6/20
第52回三井化学株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,962	2026/2/27	第28回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.614	100,000	100,456	2028/9/20
第12回J S R株式会社無担保社債	0.544	100,000	99,011	2029/8/31	第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.22	100,000	98,299	2028/7/21
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	99,433	2027/2/26	第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,754	2026/6/19
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	99,887	2025/6/11	第65回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.16	100,000	99,834	2025/9/19
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	81,785	2041/6/3	第76回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.25	200,000	199,966	2025/9/19
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	1.223	100,000	100,756	2033/12/7	第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.11	100,000	99,854	2025/10/21
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	100,000	98,605	2030/7/8	第98回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,958	2025/10/21
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	200,000	190,730	2031/10/14	第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,765	2025/6/24
第1回アステラス製薬株式会社無担保社債	0.26	200,000	199,982	2025/12/5	第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.34	100,000	99,546	2026/7/31
第3回アステラス製薬株式会社無担保社債	0.32	100,000	100,072	2026/8/31	第20回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.59	100,000	100,167	2026/2/24
第3回株式会社ツムラ無担保社債	0.824	100,000	99,820	2029/9/7	第35回株式会社ジャックス無担保社債	0.25	100,000	99,414	2026/12/9
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	96,307	2029/7/31	第217回オリオックス株式会社無担保社債	0.589	100,000	99,911	2028/8/30
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	0.834	100,000	97,820	2032/6/15	第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.37	100,000	95,041	2031/12/1
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	98,817	2029/4/19	第7回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.3	100,000	99,844	2026/7/27
第9回住友理工株式会社無担保社債	0.455	100,000	99,821	2027/9/21	第82回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,604	2026/1/21
第9回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.385	100,000	99,123	2028/6/20	第38回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.54	100,000	100,126	2026/2/24
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	100,005	2025/7/14	第3回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.28	100,000	99,132	2026/9/4
第15回大同特殊鋼株式会社無担保社債	0.425	100,000	99,823	2027/9/1	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	300,117	2025/9/5
第34回友金屋鉱山株式会社無担保社債	0.315	100,000	99,579	2027/10/14	第7回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.68	100,000	100,175	2026/9/4
第14回株式会社LIXIL無担保社債	0.475	100,000	99,824	2027/8/27	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	99,523	2026/11/13
第17回株式会社クボタ無担保社債	0.95	100,000	99,260	2033/4/20	第10回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	0.425	100,000	99,799	2027/10/14
第53回日本精工株式会社無担保社債	0.445	100,000	99,876	2027/9/3	第47回三井不動産株式会社無担保社債	1.954	100,000	108,348	2032/12/20
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	97,735	2030/3/12	第78回三井不動産株式会社無担保社債	0.81	100,000	87,121	2040/4/27
第23回パナソニック株式会社無担保社債	0.39	100,000	95,931	2030/12/24	第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	100,000	107,240	2027/9/17
第2回パナソニック株式会社無担保社債	1.342	100,000	100,466	2033/9/14	第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,896	2026/12/18
第37回ソニーグループ株式会社無担保社債	0.28	300,000	299,991	2025/12/8	第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	86,108	2039/8/5
第8回TDK株式会社無担保社債	0.15	100,000	99,318	2026/12/2	第143回三菱地所株式会社無担保社債	0.9	100,000	99,044	2033/5/2
第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	200,000	199,494	2027/6/18	第111回住友不動産株式会社無担保社債	0.52	100,000	100,087	2034/8/28
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	99,452	2027/6/7	第3回東急株式会社無担保社債	0.34	100,000	98,094	2030/6/10
第25回J A 三井リース株式会社無担保社債	0.39	100,000	99,994	2026/9/1	第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	85,771	2040/6/11
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,678	2026/2/4	第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	86,997	2039/6/20
第8回株式会社SUBARU無担保社債	1.059	100,000	100,895	2030/11/29	第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	75,468	2049/12/3
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,950	2025/3/13	第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	87,440	2040/5/25
第1回オリオックス銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,527	2026/3/11	第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.26	100,000	106,201	2027/4/16
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	85,514	2040/3/9	第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.249	100,000	110,023	2030/3/22
第69回三井物産株式会社無担保社債	2.139	100,000	109,428	2031/7/22	第129回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.302	100,000	78,153	2058/1/25
第60回住友商事株式会社無担保社債	0.574	100,000	96,811	2032/5/24	第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	76,172	2058/9/27
第44回株式会社丸井グループ無担保社債	0.629	100,000	199,812	2029/1/23	第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.596	100,000	85,183	2041/4/15
第87回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.29	100,000	98,848	2028/4/14	第176回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.993	100,000	67,119	2061/12/16
第99回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.629	100,000	99,833	2029/1/31	第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	72,346	2056/12/13
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	97,307	2029/12/12	第51回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.033	100,000	82,200	2047/11/29
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	99,752	2027/9/2	第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	100,000	109,871	2030/4/23
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	103,509	2026/10/30	第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	101,389	2044/10/28
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	103,289	2026/6/1	第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	100,000	107,434	2027/12/20
					第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	100,000	109,897	2030/3/19
					第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	107,049	2032/5/25
					第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	75,961	2058/5/24

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56回東京地下鉄株式会社社債	1.066	100,000	78,001	2052/2/28	第38回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.984	100,000	104,593	2043/12/17
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	200,000	198,420	2031/3/4	第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	100,000	96,409	2031/6/3
第58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	99,689	2026/2/26	第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	84,714	2041/6/3
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	200,000	197,810	2028/11/22	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	99,576	2028/6/6
第17回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.51	100,000	97,322	2029/1/26	第41回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債	0.82	100,000	100,174	2026/10/16
第31回株式会社光通信無担保社債	1.38	100,000	86,071	2036/2/1	第32回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.713	300,000	299,103	2026/7/13
第37回株式会社光通信無担保社債	1.33	100,000	83,964	2036/11/4	第19回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.622	200,000	199,508	2026/6/12
第56回電源開発株式会社無担保社債	0.54	100,000	95,488	2033/5/20	第3回韓国輸出入銀行保証株式会社大韓航空円貨社債(2023)	0.76	100,000	99,666	2026/6/29
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,107	2028/7/20	第8回ビー・エヌ・ピー・バリバ円貨社債(2023)	1.01	200,000	199,880	2028/9/7
第84回電源開発株式会社無担保社債	0.754	100,000	101,036	2028/2/18					
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	100,000	100,339	2029/10/9	小 計		18,900,000	18,514,609	
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	100,000	100,481	2030/7/16	合 計		409,718,355	405,892,670	
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	98,958	2032/10/8					
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	200,000	181,098	2036/8/29					
第66回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.24	100,000	99,180	2033/7/13					
第4回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	1.2	100,000	101,113	2030/9/6					

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末	
	評 価 額	比	評 価 額	率
			千円	%
公 社 債	405,892,670			99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,319,371			0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	407,212,041			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 2024年1月22日現在
(A) 資 産	407,312,088,612円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	259,829,893
公 社 債(評価額)	405,892,670,020
未 収 入 金	298,375,000
未 収 利 息	734,041,879
前 払 費 用	27,124,820
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B) 負 債	536,914,045
未 払 金	300,000,000
未 払 解 約 金	136,866,912
未 払 利 息	133
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	406,775,174,567
元 本	310,651,503,258
次 期 繰 越 損 益 金	96,123,671,309
(D) 受 益 権 総 口 数	310,651,503,258口
1万口当たり基準価額(C/D)	13.094円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2023年1月24日 至 2024年1月22日
(A) 配 当 等 収 益	3,065,893,524円
受 取 利 息	3,066,187,289
支 払 利 息	△293,765
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△4,138,366,410
売 買 益	588,035,571
売 買 損	△4,726,401,981
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	△1,198,380
取 引 益	3,478,780
取 引 損	△4,677,160
(D) そ の 他 費 用	△11
(E) 当 期 損 益 金(A+B+C+D)	△1,073,671,277
(F) 前 期 繰 越 損 益 金	90,378,328,368
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,767,344,013
(H) 解 約 差 損 益 金	△3,948,329,795
(I) 計 (E+F+G+H)	96,123,671,309
次 期 繰 越 損 益 金(I)	96,123,671,309

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は289,563,258,941円、期中追加設定元本額は33,664,181,873円、期中一部解約元本額は12,575,937,556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 99,814,000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)	71,137,294,729円
私募日本債券パッシブファンド (適格機関投資家専用)	56,578,725,923円
DC日本債券インデックスファンドL	44,645,272,090円
インデックスコレクション (国内債券)	38,208,857,968円
バランスファンドVA3 (適格機関投資家専用)	20,888,524,456円
DCバランスファンド30	13,299,483,421円
バランスVA50L (適格機関投資家専用)	11,120,296,277円
インデックスコレクション (バランス株式50)	9,888,787,114円
DCバランスファンド50	9,845,222,317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)	6,779,980,442円
インデックスコレクション (バランス株式70)	4,579,649,325円
DCバランスファンド70	3,038,027,767円
バランスファンドVA (適格機関投資家専用)	2,905,760,030円
VAポートフォリオ40 (適格機関投資家専用)	2,800,580,381円
バランスファンドVA2 (適格機関投資家専用)	2,742,553,340円
バランスVA25 (適格機関投資家専用)	2,303,731,681円
DC日本債券インデックスファンド	1,795,386,135円
バランスVA25L (適格機関投資家専用)	1,305,037,693円
バランスVA37.5 (適格機関投資家専用)	949,326,793円
日本債券インデックスe	921,218,061円
VAバランス50-50 (適格機関投資家専用)	770,866,025円
日本債券インデックスファンド	765,472,526円
バランスVA50 (適格機関投資家専用)	684,928,542円
VAバランス20-80 (適格機関投資家専用)	503,467,476円
世界バランスVA25 (適格機関投資家専用)	423,277,662円
バランスVA40 (適格機関投資家専用)	351,470,804円
VAバランスファンド2 (株40/100) (適格機関投資家専用)	302,211,719円
VAバランスファンド (株40/100) (適格機関投資家専用)	221,987,963円
バランスVA75 (適格機関投資家専用)	141,527,778円
VAポートフォリオ20 (適格機関投資家専用)	134,097,094円
バランスVA30 (適格機関投資家専用)	118,235,231円
VAバランスファンド (株25/100) (適格機関投資家専用)	113,168,137円
国内バランスVA30 (適格機関投資家専用)	104,377,507円
VAバランスファンド (株60/100) (適格機関投資家専用)	100,304,173円
VAバランスファンド (株50/100) (適格機関投資家専用)	87,007,819円
VAファンド25 (適格機関投資家専用)	51,437,942円
国内バランスVA25 (適格機関投資家専用)	39,818,658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)	4,130,259円

お知らせ

当ファンドの運用実態を踏まえ、デリバティブ取引の利用目的を明確化するため、投資信託約款に所要の変更を行いました。

(変更日：2023年10月24日)