

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／海外／株式
信託期間	信託期間は2006年5月30日から無期限です。
運用方針	主として「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)」(以下、「エマージング成長株ファンド」といいます。)への投資を通じて、新興国の株式に分散投資し、投資信託財産の長期的な成長をはかることを目指して運用を行います。
主要運用対象	「エマージング成長株ファンド」および「国内債券インデックス マザーファンド」を主要投資対象とします。
組入制限	株式への直接投資は行いません。 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
分配方針	原則として、毎年5月29日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、収益の分配を行います。 分配対象額は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益及び売買益等の全額とします。 分配金額については、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

エマージング株式オープン

運用報告書(全体版)

第16期(決算日 2022年5月30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		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
第12期(2018年5月29日)	円 11,501	円 300	% 11.4		% 9.7	% 0.1	% -	% 98.8	百万円 3,115
第13期(2019年5月29日)	9,620	0	△16.4	12,649	△13.1	0.1	0.0	98.2	2,376
第14期(2020年5月29日)	9,211	0	△4.3	11,655	△7.9	0.2	-	98.4	1,900
第15期(2021年5月31日)	13,264	850	53.2	17,495	50.1	0.2	-	97.9	1,832
第16期(2022年5月30日)	11,007	0	△17.0	15,521	△11.3	0.2	0.0	96.5	1,395

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は「買建比率-売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債券組入比率	債券先物比率	投資信託証券組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(当期首) 2021年 5月31日	円 13,264	% -		% -	% 0.2	% -	% 97.9
6月末	13,375	0.8	17,838	2.0	0.2	-	98.1
7月末	12,287	△7.4	16,614	△5.0	0.2	-	99.4
8月末	12,313	△7.2	16,547	△5.4	0.2	-	98.7
9月末	12,228	△7.8	16,404	△6.2	0.2	-	98.4
10月末	12,981	△2.1	16,991	△2.9	0.2	-	98.9
11月末	12,048	△9.2	16,245	△7.1	0.2	-	97.8
12月末	12,027	△9.3	16,409	△6.2	0.2	-	98.2
2022年 1月末	11,527	△13.1	16,107	△7.9	0.2	-	98.7
2月末	11,165	△15.8	15,863	△9.3	0.2	-	98.4
3月末	11,725	△11.6	16,477	△5.8	0.2	-	99.0
4月末	11,325	△14.6	15,754	△10.0	0.2	-	98.0
(当期末) 2022年 5月30日	11,007	△17.0	15,521	△11.3	0.2	0.0	96.5

(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

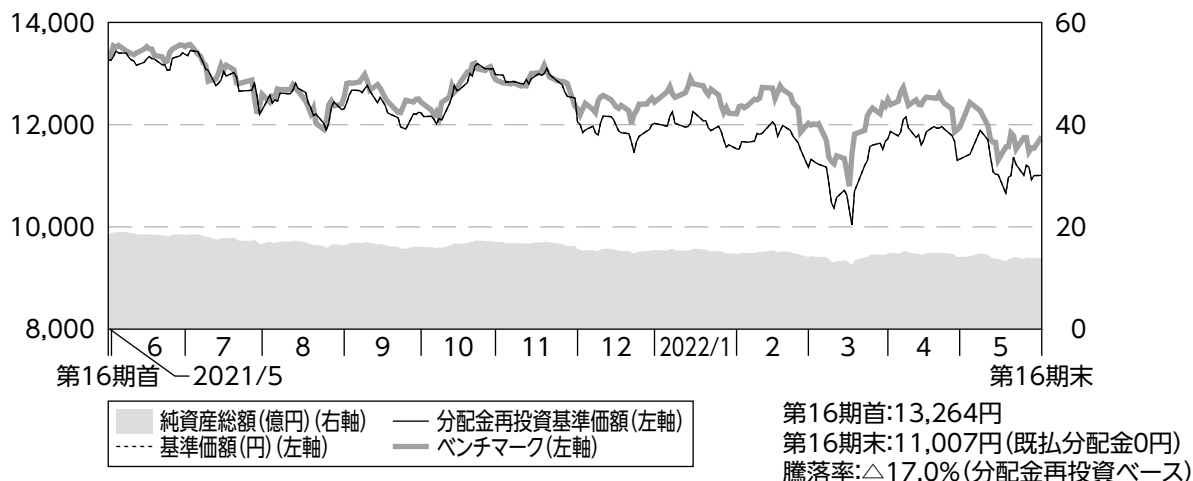
(注3) 債券先物比率は「買建比率-売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、MSCIエマージング・マーケット・インデックス(円換算ベース)です。

MSCIエマージング・マーケット・インデックスとは、MSCI Inc. が開発した世界の新興国株式市場の動きを表す株価指数で、株式時価総額をベースに算出されます。「円換算ベース」は、米ドルベース指数をもとに、当社が独自に円換算した指数です。同指数に関する著作権等の知的財産権及びその他の一切の権利はMSCI Inc. に帰属します。また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利及び公表を停止する権利を有しています。設定日を10,000として指数化したものを掲載しています。

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、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

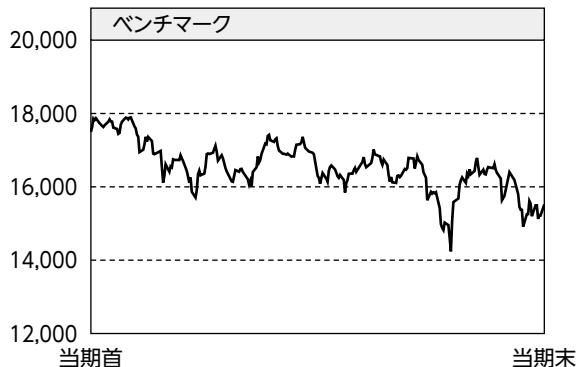
基準価額の主な変動要因

主な投資対象である「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)」の基準価額が下落したことから当ファンドの基準価額も下落しました。

組入ファンド	投資資産	当作成対象 期間末組入比率	騰落率
アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)	新興国株式	96.5%	△16.3%
国内債券インデックス マザーファンド	国内債券	0.2%	△1.7%

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

投資環境



(注)当ファンドの設定日を10,000として指数化しています。

新興国株式市場は、当期を通じて軟調に推移しました。新型コロナウイルスの感染拡大の収束がなかなか見通せない中、中国政府によるインターネット関連業界への規制強化や、中国不動産開発企業の過大債務問題などが嫌気されました。高インフレが世界的に広がり主要国の中央銀行が金融引き締めへ転じたこと、2022年2月下旬以降はロシアのウクライナ軍事侵攻なども悪材料となり、新興国株式市場は下落しました。

外国為替市場では、期初から日本円は新興国通貨に対して概ね横ばいに推移していましたが、2021年9月下旬以降は米国長期金利の上昇に伴い円安傾向に転じました。その後も新興国景気の緩やかな回復と資源価格高、内外金利差の拡大などを背景に円安傾向が続き、当期を通じて新興国通貨高・円安となりました。

当ファンドのポートフォリオ

主な投資対象である「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)」の組入比率を高位に保つ運用を行いました。

【「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)」の運用経過】

当期を通じて、ほぼ全額を「ABエマージング・グロース株式マザーファンド」に投資し、ファンダメンタルズ分析をベースとして市場で過小評価された潜在成長力を有する企業に投資する方針で運用に臨みました。

個別銘柄では、インドネシアの国営銀行であるバンク・マンディリなどを新たに組み入れた一方、ロシアのズベルバンクなどを全て売却しました。

<投資対象ファンドについては、運用会社からの情報に基づき掲載しています。>

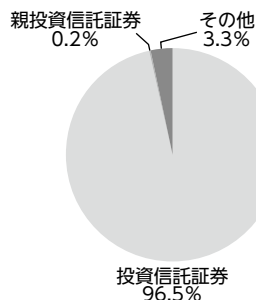
当ファンドの組入資産の内容

○組入ファンド

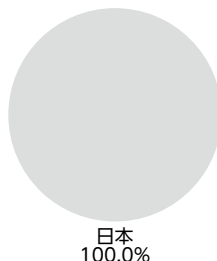
	当期末
	2022年5月30日
アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株 ファンド(適格機関投資家専用)	96.5%
国内債券インデックス マザーファンド	0.2%
その他	3.3%
組入ファンド数	2

(注) 組入比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

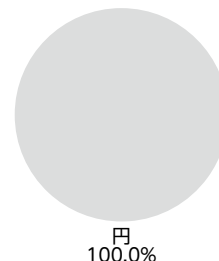
○資産別配分



○国別配分



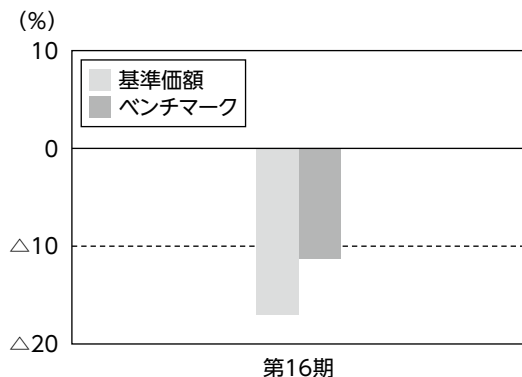
○通貨別配分



(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。



当期の基準価額騰落率はベンチマーク騰落率を下回りました。

配当金要因*がプラスに寄与しましたが、信託報酬要因やコスト要因がマイナスに影響しました。ポートフォリオ要因としては、エネルギーセクターのアンダーウェイト、金融セクターやコミュニケーション・サービスセクターにおける銘柄選択などがマイナスに影響しました。

*ベンチマークが配当相当分を含まない指数であることによって生じる差異要因です。

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16期	
	2021年6月1日~2022年5月30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)	2,658	

(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。

○当ファンド

「アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)」への投資を通じて、新興国の株式に分散投資し、投資信託財産の長期的な成長をはかることを目指して運用を行います。

・アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)

主として「ABエマージング・グロース株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて、新興国の株式に分散投資することにより、長期的な信託財産の成長を目指します。

・国内債券インデックス マザーファンド

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	134円	1.097%	(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12,188円です。 信託報酬に係る消費税は当(作成)期末の税率を採用しています。 委託した資金の運用、基準価額の計算、開示資料作成等の対価 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、 購入後の情報提供等の対価 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(投信会社)	(47)	(0.384)	
(販売会社)	(80)	(0.658)	
(受託会社)	(7)	(0.055)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b) 売買委託手数料＝ $\frac{[期中の売買委託手数料]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(商品)	(-)	(-)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	-	-	(c) 有価証券取引税＝ $\frac{[期中の有価証券取引税]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(株式)	(-)	(-)	
(新株予約権証券)	(-)	(-)	
(オプション証券等)	(-)	(-)	
(新株予約権付社債(転換社債))	(-)	(-)	
(公社債)	(-)	(-)	
(投資信託証券)	(-)	(-)	
(d) その他費用	1	0.005	(d) その他費用＝ $\frac{[期中のその他費用]}{[期中の平均受益権口数]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
(保管費用)	(-)	(-)	
(監査費用)	(1)	(0.005)	
(その他)	(-)	(-)	
合計	135	1.102	

(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。

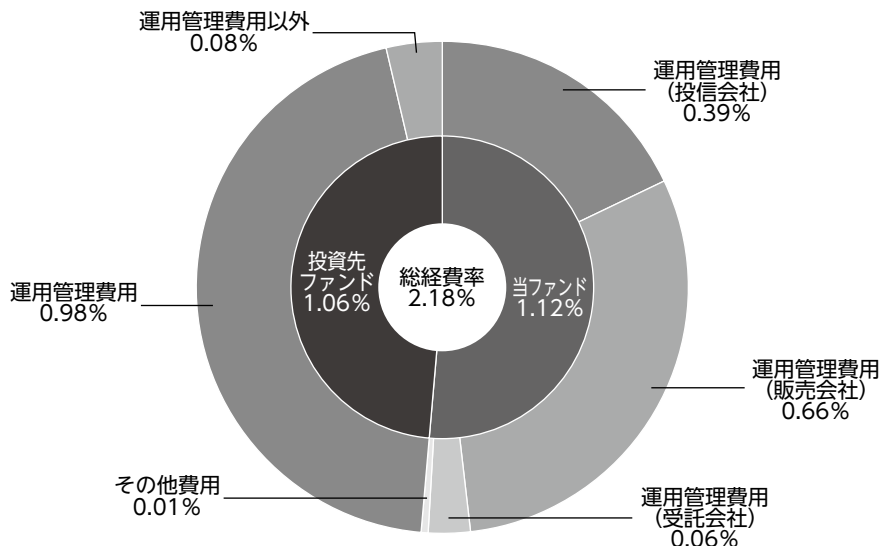
(注3) 「比率」欄は、1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(注4) 各項目の費用は、当ファンドが組み入れている投資信託証券が支払った費用を含みません(マザーファンドを除く)。

<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2.18%です。



総経費率(①+②+③)	2.18%
①当ファンドの費用の比率	1.12%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.98%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.08%

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

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

(注5)当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注6)当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注7)投資先ファンドの運用管理費用の比率は、各月末の投資先ファンドの保有比率に当該投資先ファンドの運用管理費率を乗じて算出した概算値を使用している場合があります。

(注8)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

<投資信託受益証券>

		当 期			
		買 付		売 付	
		口 数	買 付 額	口 数	売 付 額
国内	アライアンス・パースタイン・エマージング 成長株ファンド(適格機関投資家専用)	千口 18,737	千円 44,000	千口 98,488	千円 212,524

(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	$\frac{D}{C}$
投資信託受益証券	百万円 44	百万円 44	% 100.0	百万円 212	百万円 212	% 100.0
コール・ローン	6,753	180	2.7	6,865	175	2.5

(注)当該取引に係る利害関係人は、三井住友信託銀行株式会社です。

<国内債券インデックス マザーファンド>

区 分	当			期		
	買付額等A	うち利害関係人 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	$\frac{D}{C}$
コール・ローン	百万円 296,828	百万円 6,676	% 2.2	百万円 296,847	百万円 6,445	% 2.2

<平均保有割合 0.0%>

(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。

※ 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

<当ファンドが組み入れた邦貨建ファンドの明細>

ファンド名	当 期		末
	口 数	評 価 額	比 率
株式ファンド	千口	千円	%
アライアンス・バーンスタイン・エマージング 成長株ファンド(適格機関投資家専用)	692,280	1,345,863	96.5

(注)比率は純資産総額に対する評価額の比率です。

<親投資信託残高>

	当 期 首(前期末)	当 期		末
	口 数	口 数	評 価 額	額
国内債券インデックス マザーファンド	千口	千口	千円	千円
	2,227	2,227	3,082	3,082

(注)親投資信託の当期末現在の受益権総口数は、451,551,932千口です。

投資信託財産の構成

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
投資信託受益証券	千円	%	
	1,345,863	95.8	
国内債券インデックス マザーファンド	3,082	0.2	
コール・ローン等、その他	55,379	4.0	
投資信託財産総額	1,404,324	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 2022年5月30日現在
(A)資 産	1,404,324,943円
コー ル・ロ ー ン 等	55,379,330
投資信託受益証券(評価額)	1,345,863,113
国内債券インデックス マザーファンド(評価額)	3,082,500
(B)負 債	9,189,235
未 払 解 約 金	1,064,585
未 払 信 託 報 酬	8,037,182
未 払 利 息	48
そ の 他 未 払 費 用	87,420
(C)純 資 産 総 額(A-B)	1,395,135,708
元 本	1,267,465,664
次 期 繰 越 損 益 金	127,670,044
(D)受 益 権 総 口 数	1,267,465,664口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,007円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	△10,722円
受 取 利 息	132
支 払 利 息	△10,854
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△260,719,343
売 買 益	16,467,935
売 買 損	△277,187,278
(C)信 託 報 酬 等	△17,595,235
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△278,325,300
(E)前 期 繰 越 損 益 金	226,583,711
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	179,411,633
(配 当 等 相 当 額)	(110,347,643)
(売 買 損 益 相 当 額)	(69,063,990)
(G) 計 (D+E+F)	127,670,044
(H)収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	127,670,044
追 加 信 託 差 損 益 金	179,411,633
(配 当 等 相 当 額)	(110,347,705)
(売 買 損 益 相 当 額)	(69,063,928)
分 配 準 備 積 立 金	226,583,711
繰 越 損 益 金	△278,325,300

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

<注記事項>

※当ファンドの期首元本額は1,381,664,746円、期中追加設定元本額は117,652,975円、期中一部解約元本額は231,852,057円です。

※分配金の計算過程

項 目	当 期
(A) 配当等収益額(費用控除後)	－円
(B) 有価証券売買等損益額(費用控除後・繰越欠損金補填後)	－円
(C) 収益調整金額	110,347,705円
(D) 分配準備積立金額	226,583,711円
(E) 分配対象収益額(A+B+C+D)	336,931,416円
(F) 期末残存口数	1,267,465,664口
(G) 収益分配対象額(1万口当たり)(E/F×10,000)	2,658円
(H) 分配金額(1万口当たり)	－円
(I) 収益分配金金額(F×H/10,000)	－円

お知らせ

該当事項はありません。

組入投資信託証券の内容

■アライアンス・バーンスタイン・エマージング成長株ファンド(適格機関投資家専用)

●ファンドの概要

運用会社	アライアンス・バーンスタイン株式会社
運用方針	主として「ABエマージング・グロース株式マザーファンド」受益証券への投資を通じて、新興国の株式に分散投資することにより、長期的な信託財産の成長を目指します。
主要運用対象	「ABエマージング・グロース株式マザーファンド」受益証券
組入制限	株式への実質投資割合は、制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合は、制限を設けません。 同一銘柄の株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の10%以内とします。

●損益の状況

項目	第16期
	自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配当等収益	△746円
支払利息	△746
(B)有価証券売買損益	△849,837,417
売買益	78,241,367
売買損	△928,078,784
(C)信託報酬等	△65,625,493
(D)当期損益金(A+B+C)	△915,463,656
(E)前期繰越損益金	1,582,714,611
(F)追加信託差損益金	2,552,428,680
(配当等相当額)	(2,979,995,282)
(売買損益相当額)	(△427,566,602)
(G)計(D+E+F)	3,219,679,635
次期繰越損益金(G)	3,219,679,635
追加信託差損益金	2,552,428,680
(配当等相当額)	(2,979,995,282)
(売買損益相当額)	(△427,566,602)
分配準備積立金	1,582,714,611
繰越損益金	△915,463,656

●組入資産の明細

<親投資信託残高>

	第 15 期 末	第 16 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ABエマージング・グロース株式マザーファンド	2,201,831	2,379,829	6,457,904

下記は、ABエマージング・グロース株式マザーファンド全体の内容です。

<外国株式>

銘柄	第15期末 株数 (百株)	第16期末 株数 (百株)	第16期末 評価額		業種	
			外貨建金額			
			外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)		
(アメリカ)			千米ドル			
FREEPORT-MCMORAN INC	242	435	1,727	219,383	素材	
HUYA INC-ADR	508	—	—	—	メディア・娯楽	
SOCIEDAD QUIMICA Y MINERA DE CHILE ADR	—	127	1,439	182,818	素材	
DESPEGAR.COM CORP	425	1,159	1,081	137,402	消費者サービス	
BROADCOM INC	15	15	898	114,095	半導体・半導体製造装置	
GDS HOLDINGS LTD-ADR	162	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
HEADHUNTER GROUP PLC- ADR	352	—	—	—	商業・専門サービス	
MERCADOLIBRE INC	—	5	478	60,810	小売	
MICRON TECHNOLOGY INC	67	—	—	—	半導体・半導体製造装置	
MAKEMYTRIP LTD	—	478	1,398	177,694	消費者サービス	
GLOBALTRA-SPONS GDR REG S	1,532	985	0.00009	0.011	運輸	
MMC NORILSK NICKEL PJSC-ADR	276	—	—	—	素材	
SBERBANK-SPONSORED ADR	1,389	—	—	—	銀行	
TCS GROUP HOLDING -GDR REG S	233	—	—	—	銀行	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5,207 11	3,207 7	7,024 —	892,205 <11.2%>	
(メキシコ)			千メキシコペソ			
GRUPO FINANCIERO BANORTE-0	—	2,204	28,884	187,617	銀行	
GENOMMA LAB INTERNACIONAL - B	10,481	12,987	25,871	168,045	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	10,481 1	15,192 2	54,756 —	355,663 <4.5%>	
(ブラジル)			千ブラジルリアル			
LOJAS RENNER S. A.	229	—	—	—	小売	
EQUATORIAL ENERGIA SA - ORD	1,899	3,536	8,390	225,262	公益事業	
B3 SA-BRASIL BOLSA BALCAO	1,120	—	—	—	各種金融	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,248 3	3,536 1	8,390 —	225,262 <2.8%>	
(ギリシャ)			千ユーロ			
OPAP SA	1,427	1,354	1,828	249,201	消費者サービス	
ユーロ計	株数・金額 銘柄数<比率>	1,427 1	1,354 1	1,828 —	249,201 <3.1%>	
(イギリス)			千英ポンド			
ANTOFAGASTA PLC	85	—	—	—	素材	
ANGLO AMERICAN PLC	152	—	—	—	素材	
NETWORK INTERNATIONAL HOLDIN	405	—	—	—	ソフトウェア・サービス	
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	644 3	— —	— —	— <—%>	
(ポーランド)			千ポーランドズロチ			
DINO POLSKA SA	—	123	3,578	106,834	食品・生活必需品小売り	

銘柄		第15期末	第16期末			業種
		株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
				外貨建金額	邦貨換算金額 (千円)	
ALLEGRO. EU SA		5	—	—	—	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	5	123	3,578	106,834	
		1	1	—	<1.3%>	
(香港)				千香港ドル		
GALAXY ENTERTAINMENT GROUP L		—	1,130	4,621	74,779	消費者サービス
TECHTRONIC INDUSTRIES CO LTD		185	—	—	—	資本財
PING AN INSURANCE GROUP CO-H		305	—	—	—	保険
LI NING CO LTD		—	405	2,132	34,501	耐久消費財・アパレル
SHENZHOU INTERNATIONAL GROUP		—	173	1,742	28,187	耐久消費財・アパレル
ANTA SPORTS PRODUCTS LTD		—	440	3,608	58,377	耐久消費財・アパレル
SAMSONITE INTERNATIONAL SA		1,998	6,132	10,436	168,865	耐久消費財・アパレル
AIA GROUP LTD		1,404	1,952	15,469	250,298	保険
SINOPEC ENGINEERING GROUP-H		15,470	27,460	10,874	175,943	資本財
COUNTRY GARDEN SERVICES HOLDINGS		—	1,820	5,023	81,275	不動産
A-LIVING SMART CITY SERVICES CO-H		3,557	3,027	3,566	57,704	不動産
MEITUAN-CLASS B		—	651	10,669	172,638	小売
FU SHOU YUAN INTERNATIONAL		6,990	—	—	—	消費者サービス
ALIBABA GROUP HOLDING LTD		1,614	983	8,950	144,823	小売
JD.COM INC-CL A		808	759	15,824	256,039	小売
GDS HOLDINGS LTD-CL A		—	2,762	7,003	113,311	ソフトウェア・サービス
TENCENT HOLDINGS LTD		600	929	31,753	513,767	メディア・娯楽
NIO INC		—	496	6,242	100,999	自動車・自動車部品
ALIBABA HEALTH INFORMATION TECHNOLOGY		3,340	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
YESTAR HEALTHCARE HOLDINGS		4,500	—	—	—	ヘルスケア機器・サービス
CHINA OVERSEAS PROPERTY HOLD		5,550	—	—	—	不動産
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	46,322	49,121	137,917	2,231,511	
		13	15	—	<28.0%>	
(タイ)				千タイバツ		
MUANGTHAI CAPITAL PCL-FOREIGN		2,000	3,922	18,629	69,488	各種金融
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	2,000	3,922	18,629	69,488	
		1	1	—	<0.9%>	
(インドネシア)				千インドネシアルピア		
BANK MANDIRI PERSERO TBK		—	36,680	29,710,800	258,483	銀行
BANK RAKYAT INDONESIA		—	10,040	4,558,160	39,655	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	—	46,720	34,268,960	298,139	
		—	2	—	<3.7%>	
(韓国)				千韓国ウォン		
NCSOFT CORP		8	8	374,330	38,031	メディア・娯楽
SK HYNIX INC		211	69	735,640	74,741	半導体・半導体製造装置
NAVER CORP		64	48	1,298,700	131,947	メディア・娯楽
SAMSUNG SDI CO LTD		20	42	2,483,900	252,364	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD		498	220	1,463,000	148,640	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
ECOPRO BM CO LTD		—	21	990,252	100,609	資本財

銘柄		第15期末	第16期末		業種	
		株数 (百株)	株数 (百株)	評価額		
				外貨建金額		邦貨換算金額 (千円)
ECOPRO BM CO LTD -RTS		—	1	9,460	961	資本財
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	803 5	410 7	7,355,282 —	747,296 <9.4%>	
(台湾)				千新台湾ドル		
REALTEK SEMICONDUCTOR CORP		—	360	15,462	67,021	半導体・半導体製造装置
SINBON ELECTRONICS CO LTD		1,160	1,550	40,145	174,012	テクノロジー・ハードウェアおよび機器
MEDIATEK INC		530	490	41,699	180,748	半導体・半導体製造装置
MERIDA INDUSTRY CO LTD		200	990	24,453	105,993	耐久消費財・アパレル
TAIWAN SEMICONDUCTOR MANUFAC		2,710	2,460	130,380	565,145	半導体・半導体製造装置
SUNNY FRIEND ENVIRONMENTAL TECHNOLOGY		950	950	19,522	84,622	商業・専門サービス
UNIVERSAL VISION BIOTECHNOLOGY		1,010	670	17,051	73,911	ヘルスケア機器・サービス
ASPEED TECHNOLOGY INC		—	40	8,640	37,450	半導体・半導体製造装置
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	6,560 6	7,510 8	297,353 —	1,288,906 <16.2%>	
(インド)				千インドルピー		
HOUSING DEVELOPMENT FINANCE		512	697	162,622	268,326	銀行
MANAPPURAM FINANCE LTD		1,699	—	—	—	各種金融
MAX FINANCIAL SERVICES LTD		—	739	55,461	91,510	保険
MUTHOOT FINANCE LTD		423	—	—	—	各種金融
L&T TECHNOLOGY SERVICES LTD		100	—	—	—	商業・専門サービス
INDRAPRASTHA GAS LTD		—	838	30,944	51,057	公益事業
BANDHAN BANK LTD		378	—	—	—	銀行
HDFC BANK LIMITED		808	1,141	158,845	262,094	銀行
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,922 6	3,416 4	407,872 —	672,990 <8.5%>	
(ケニア)				千ケニアシリング		
SAFARICOM LTD		9,198	—	—	—	電気通信サービス
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	9,198 1	— —	— —	— <—%>	
(南アフリカ)				千南アフリカランド		
CAPITEC BANK HOLDINGS LTD		40	—	—	—	銀行
NASPERS LTD-N SHS		16	—	—	—	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	56 2	— —	— —	— <—%>	
(中国)				千中国元		
C&S PAPER CO LTD-A		3,339	—	—	—	家庭用品・パーソナル用品
CONTEMPORARY AMPEREX TECHN-A		—	150	5,936	112,268	資本財
CHINA TOURISM GROUP DUTY FREE CO-A		—	332	5,495	103,924	小売
小計	株数・金額 銘柄数<比率>	3,339 1	482 2	11,431 —	216,192 <2.7%>	
合計	株数・金額 銘柄数<比率>	93,215 55	134,996 51	— —	7,353,694 <92.4%>	

(注1) 邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

<外国オプション証券等>

銘柄	第 15 期 末		第 16 期 末	
	証 券 数 (証券)	証 券 数 (証券)	評 価 額	
			外 貨 建 金 額	邦 貨 換 算 金 額 (千円)
(アメリカ)			千米ドル	
MOBILE WORLD IN (CW/MACQ) 3/31/2023	25,053	37,579	237	30,189
VINCOM RETAIL (CW/MACQ) 3/31/2023	449,672	166,572	214	27,182
BANK OF FOREIGN (CW/MACQ) 06/07/23	195,410	185,905	620	78,797
FPT CORP (CW/MAQ) 03/31/2023	255,852	195,229	941	119,526
合 計	証 券 数 ・ 金 額 925,987	証 券 数 585,285	2,013	255,695
	銘 柄 数 <比 率> 4	4	—	<3.2%>

(注1) 邦貨換算金額は、当該日の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(注2) < >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

国内債券インデックス マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2022年5月30日）

当親投資信託の仕組みは次の通りです。

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

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

三井住友トラスト・アセットマネジメント株式会社

【本運用報告書の記載について】

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

最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
第18期(2018年5月29日)	13,934	0.8	382.463	0.8	99.9	—	百万円 379,135
第19期(2019年5月29日)	14,211	2.0	390.052	2.0	99.7	0.0	462,300
第20期(2020年5月29日)	14,136	△0.5	388.127	△0.5	100.5	—	540,159
第21期(2021年5月31日)	14,082	△0.4	386.621	△0.4	99.8	—	628,366
第22期(2022年5月30日)	13,840	△1.7	379.991	△1.7	99.8	0.1	624,929

(注) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物率
	円	騰落率	円	騰落率		
(当期首) 2021年 5月31日	14,082	—	386.621	—	99.8	—
6月末	14,091	0.1	386.903	0.1	100.0	—
7月末	14,160	0.6	388.809	0.6	99.8	—
8月末	14,149	0.5	388.461	0.5	99.7	—
9月末	14,101	0.1	387.116	0.1	99.9	—
10月末	14,086	0.0	386.721	0.0	99.8	—
11月末	14,120	0.3	387.655	0.3	99.9	—
12月末	14,088	0.0	386.841	0.1	99.8	—
2022年 1月末	13,989	△0.7	384.056	△0.7	99.8	—
2月末	13,919	△1.2	382.128	△1.2	99.7	—
3月末	13,880	△1.4	381.037	△1.4	99.9	—
4月末	13,845	△1.7	380.119	△1.7	99.9	—
(当期末) 2022年 5月30日	13,840	△1.7	379.991	△1.7	99.8	0.1

(注1) 騰落率は期首比です。

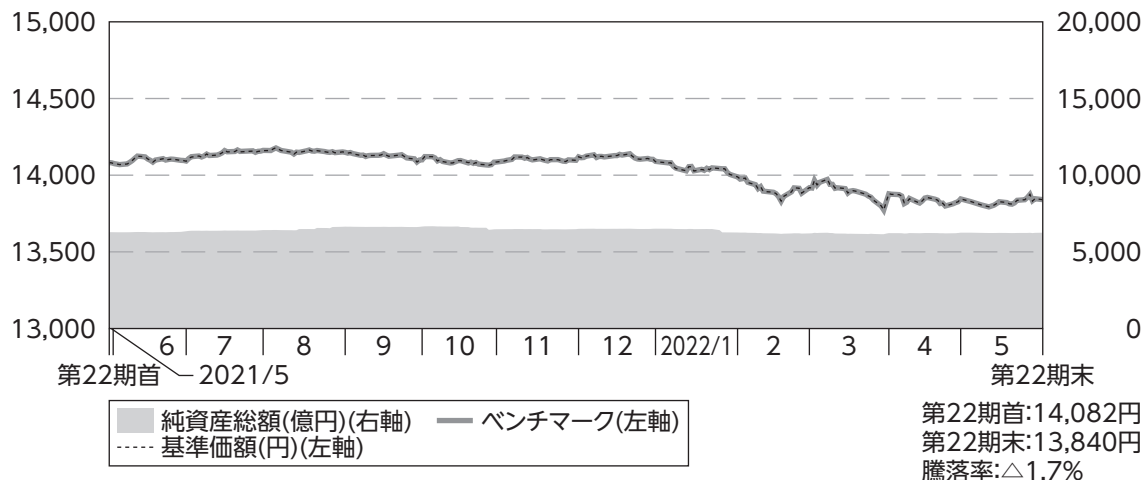
(注2) 債券先物比率は「買建比率－売建比率」で算出しております。

ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

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

当期中の運用経過と今後の運用方針

基準価額等の推移

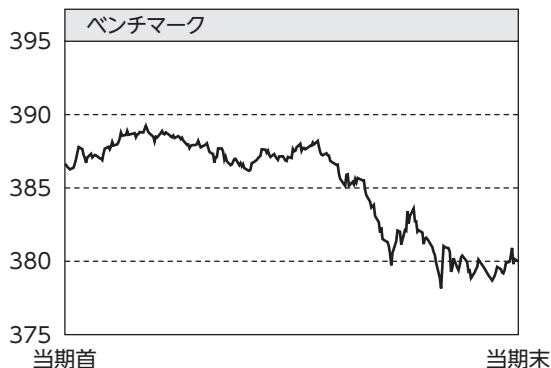


(注)ベンチマークは、2021年5月31日の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

2021年8月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に緊急事態宣言が発出されたことなどから国内金利が低下(債券価格は上昇)し、基準価額は上昇しました。8月中旬以降10月下旬にかけては、岸田新政権の経済対策による先行きの国債増発に対する警戒感が高まったことなどにより国内金利が上昇(債券価格は下落)し、基準価額は下落しました。11月以降12月中旬にかけては、主要国の中央銀行が利上げに慎重な姿勢を示した影響から国内金利が低下しましたが、米国で早期の利上げ観測が強まった影響から再び上昇し、基準価額はレンジ内推移となりました。12月下旬以降2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響から国内金利が上昇し、基準価額は下落しました。2月下旬から3月上旬にかけて、ウクライナ情勢の深刻化によるリスク回避の動きから国内金利が低下し、基準価額は上昇しましたが、3月中旬以降は、インフレ指標の上昇を背景に欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて国内金利が上昇推移となったことから、再び下落しました。

投資環境



国内金利は、2021年8月上旬にかけて、新型コロナウイルスの感染拡大を背景に低下しました。8月中旬以降10月下旬にかけては、先行きの国債増発に対する警戒感が高まったことなどにより、上昇しました。11月以降12月中旬にかけては、主要国の中央銀行が利上げに慎重な姿勢を示した影響から低下しましたが、米国で早期の利上げ観測が強まった影響から再び上昇しました。12月下旬以降2022年2月中旬にかけては、米長期金利が上昇した影響から、上昇しました。2月下旬から3月上旬にかけてはリスク回避の動きから低下しましたが、3月中旬以降は、欧米主要国の長期金利が上昇した影響を受けて上昇推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

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

(1) 債券組入比率

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

(2) ポートフォリオ構成

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

当ファンドの組入資産の内容

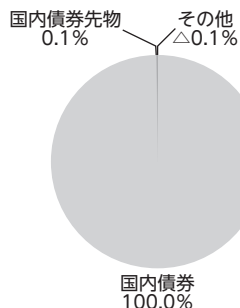
○上位10銘柄

順位	銘柄名	国・地域	組入比率
1	第141回利付国債(5年)	日本	1.2%
2	第148回利付国債(5年)	日本	1.1%
3	第138回利付国債(5年)	日本	1.1%
4	第137回利付国債(5年)	日本	1.1%
5	第365回利付国債(10年)	日本	1.1%
6	第350回利付国債(10年)	日本	1.1%

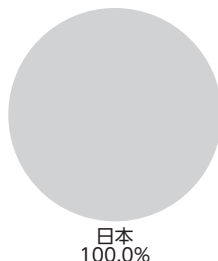
順位	銘柄名	国・地域	組入比率
7	第144回利付国債(5年)	日本	1.0%
8	第344回利付国債(10年)	日本	0.9%
9	第150回利付国債(5年)	日本	0.9%
10	第145回利付国債(5年)	日本	0.9%
組入銘柄数		992	

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

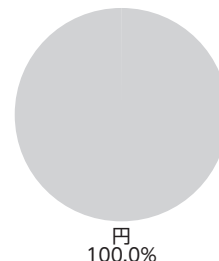
○資産別配分



○国別配分



○通貨別配分

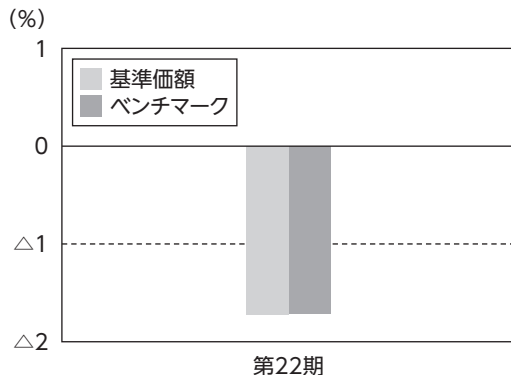


(注1) 資産別・通貨別配分の比率は純資産総額に対する評価額の割合、国別配分の比率は組入証券評価額に対する評価額の割合です。その他は未収・未払金等の発生により、数値がマイナスになることがあります。

(注2) 国別配分においては、上記の他、オフバランスで国内債券先物を想定元本ベースで純資産総額に対して0.1%買建てております。

当ファンドのベンチマークとの差異

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークの騰落率の対比です。



当ファンドは、期を通じて概ねベンチマークに連動しました。

今後の運用方針

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

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2021年6月1日~2022年5月30日)		
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料 (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円 (-) (-) (-) (-) (-) (-) (0)	0.000% (-) (-) (-) (-) (-) (-) (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
(b) 有価証券取引税 (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)	- (-) (-) (-) (-) (-)	- (-) (-) (-) (-) (-)	(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
(c) その他費用 (保管費用) (監査費用) (その他)	- (-) (-) (-)	- (-) (-) (-)	(c) その他費用 = $\frac{[\text{期中のその他費用}]}{[\text{期中の平均受益権口数}]} \times 10,000$ 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用 その他は、金銭信託預入に係る手数料等
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(14,042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	135,414,533	123,527,580
	地 方 債 証 券	5,665,813	5,654,159
	特 殊 債 券	9,608,254	10,670,914 (800,945)
	社債券(投資法人債券を含む)	5,921,474	3,618,993

(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 21,148	百万円 20,546	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	B A	売付額等C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
コ ー ル ・ ロ ー ン	百万円 296,828	百万円 6,676	% 2.2	百万円 296,847	百万円 6,445	% 2.2

(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 B B 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	503,715,000 (-)	523,319,672 (-)	83.7 (-)	- (-)	54.5 (-)	20.2 (-)	9.0 (-)
地 方 債 証 券	32,361,680 (32,361,680)	33,511,126 (33,511,126)	5.4 (5.4)	- (-)	3.3 (3.3)	1.4 (1.4)	0.7 (0.7)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	33,652,796 (33,652,796)	34,709,232 (34,709,232)	5.6 (5.6)	- (-)	3.3 (3.3)	1.2 (1.2)	1.1 (1.1)
金 融 債 証 券	2,200,000 (2,200,000)	2,200,178 (2,200,178)	0.4 (0.4)	- (-)	- (-)	0.3 (0.3)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	30,126,000 (30,126,000)	30,041,507 (30,041,507)	4.8 (4.8)	- (-)	2.2 (2.2)	1.8 (1.8)	0.8 (0.8)
合 計	602,055,476 (98,340,476)	623,781,716 (100,462,043)	99.8 (16.1)	- (-)	63.3 (8.8)	24.8 (4.6)	11.7 (2.7)

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) ()内は非上場債で内書きです。

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

(B) 個別銘柄開示

銘 柄 名	当 期			末
	利率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日
国債証券				
第425回利付国債(2年)	0.005	2,750,000	2,752,750	2023/6/1
第426回利付国債(2年)	0.005	620,000	620,638	2023/7/1
第427回利付国債(2年)	0.005	3,260,000	3,263,618	2023/8/1
第428回利付国債(2年)	0.005	230,000	230,273	2023/9/1
第429回利付国債(2年)	0.005	950,000	951,140	2023/10/1
第430回利付国債(2年)	0.005	2,010,000	2,012,572	2023/11/1
第434回利付国債(2年)	0.005	1,915,000	1,917,681	2024/3/1
第435回利付国債(2年)	0.005	780,000	781,146	2024/4/1
第436回利付国債(2年)	0.005	720,000	721,036	2024/5/1
第136回利付国債(5年)	0.1	4,330,000	4,338,660	2023/6/20
第137回利付国債(5年)	0.1	6,760,000	6,776,359	2023/9/20
第138回利付国債(5年)	0.1	6,890,000	6,909,292	2023/12/20
第139回利付国債(5年)	0.1	5,590,000	5,607,105	2024/3/20
第140回利付国債(5年)	0.1	4,660,000	4,675,797	2024/6/20
第141回利付国債(5年)	0.1	7,750,000	7,778,597	2024/9/20
第142回利付国債(5年)	0.1	4,370,000	4,387,873	2024/12/20
第143回利付国債(5年)	0.1	4,910,000	4,931,358	2025/3/20
第144回利付国債(5年)	0.1	6,310,000	6,338,899	2025/6/20

銘 柄 名	当 期			末
	利率 (%)	額 面 金 額 (千円)	評 価 額 (千円)	償 還 年 月 日
第145回利付国債(5年)	0.1	5,750,000	5,777,600	2025/9/20
第146回利付国債(5年)	0.1	3,150,000	3,165,687	2025/12/20
第147回利付国債(5年)	0.005	4,170,000	4,175,546	2026/3/20
第148回利付国債(5年)	0.005	6,950,000	6,958,409	2026/6/20
第149回利付国債(5年)	0.005	5,130,000	5,135,489	2026/9/20
第150回利付国債(5年)	0.005	5,880,000	5,883,998	2026/12/20
第151回利付国債(5年)	0.005	1,620,000	1,620,388	2027/3/20
第1回利付国債(40年)	2.4	400,000	535,164	2048/3/20
第2回利付国債(40年)	2.2	1,130,000	1,459,813	2049/3/20
第3回利付国債(40年)	2.2	550,000	715,363	2050/3/20
第4回利付国債(40年)	2.2	950,000	1,239,569	2051/3/20
第5回利付国債(40年)	2.0	1,070,000	1,345,500	2052/3/20
第6回利付国債(40年)	1.9	1,260,000	1,558,229	2053/3/20
第7回利付国債(40年)	1.7	1,240,000	1,472,524	2054/3/20
第8回利付国債(40年)	1.4	1,230,000	1,361,610	2055/3/20
第9回利付国債(40年)	0.4	2,050,000	1,688,072	2056/3/20
第10回利付国債(40年)	0.9	2,100,000	2,024,862	2057/3/20
第11回利付国債(40年)	0.8	1,635,000	1,524,670	2058/3/20
第12回利付国債(40年)	0.5	1,290,000	1,081,561	2059/3/20

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第13回利付国債(40年)	0.5	2,140,000	1,785,252	2060/3/20	
第14回利付国債(40年)	0.7	2,130,000	1,898,277	2061/3/20	
第329回利付国債(10年)	0.8	4,410,000	4,451,409	2023/6/20	
第330回利付国債(10年)	0.8	3,910,000	3,955,238	2023/9/20	
第331回利付国債(10年)	0.6	900,000	908,064	2023/9/20	
第332回利付国債(10年)	0.6	4,800,000	4,850,832	2023/12/20	
第333回利付国債(10年)	0.6	3,030,000	3,066,632	2024/3/20	
第334回利付国債(10年)	0.6	4,260,000	4,318,276	2024/6/20	
第335回利付国債(10年)	0.5	2,310,000	2,339,868	2024/9/20	
第336回利付国債(10年)	0.5	1,110,000	1,125,906	2024/12/20	
第337回利付国債(10年)	0.3	2,800,000	2,825,788	2024/12/20	
第338回利付国債(10年)	0.4	4,560,000	4,618,231	2025/3/20	
第339回利付国債(10年)	0.4	4,750,000	4,815,360	2025/6/20	
第340回利付国債(10年)	0.4	4,830,000	4,901,145	2025/9/20	
第341回利付国債(10年)	0.3	5,340,000	5,404,614	2025/12/20	
第342回利付国債(10年)	0.1	4,760,000	4,783,514	2026/3/20	
第343回利付国債(10年)	0.1	2,670,000	2,683,536	2026/6/20	
第344回利付国債(10年)	0.1	5,900,000	5,930,503	2026/9/20	
第345回利付国債(10年)	0.1	3,780,000	3,798,937	2026/12/20	
第346回利付国債(10年)	0.1	5,750,000	5,777,600	2027/3/20	
第347回利付国債(10年)	0.1	3,850,000	3,867,479	2027/6/20	
第348回利付国債(10年)	0.1	4,340,000	4,359,530	2027/9/20	
第349回利付国債(10年)	0.1	5,000,000	5,020,800	2027/12/20	
第350回利付国債(10年)	0.1	6,630,000	6,653,006	2028/3/20	
第351回利付国債(10年)	0.1	4,940,000	4,953,387	2028/6/20	
第352回利付国債(10年)	0.1	4,510,000	4,518,478	2028/9/20	
第353回利付国債(10年)	0.1	4,915,000	4,921,389	2028/12/20	
第354回利付国債(10年)	0.1	4,790,000	4,793,209	2029/3/20	
第355回利付国債(10年)	0.1	3,710,000	3,708,664	2029/6/20	
第356回利付国債(10年)	0.1	4,080,000	4,074,084	2029/9/20	
第357回利付国債(10年)	0.1	2,770,000	2,763,767	2029/12/20	
第358回利付国債(10年)	0.1	3,560,000	3,548,999	2030/3/20	
第359回利付国債(10年)	0.1	3,420,000	3,406,388	2030/6/20	
第360回利付国債(10年)	0.1	4,890,000	4,863,936	2030/9/20	
第361回利付国債(10年)	0.1	3,940,000	3,915,059	2030/12/20	
第362回利付国債(10年)	0.1	3,790,000	3,762,067	2031/3/20	
第363回利付国債(10年)	0.1	5,460,000	5,411,406	2031/6/20	
第364回利付国債(10年)	0.1	5,110,000	5,058,644	2031/9/20	
第365回利付国債(10年)	0.1	6,770,000	6,693,905	2031/12/20	
第366回利付国債(10年)	0.2	810,000	807,667	2032/3/20	
第1回利付国債(30年)	2.8	110,000	131,447	2029/9/20	
第2回利付国債(30年)	2.4	160,000	187,852	2030/2/20	
第3回利付国債(30年)	2.3	120,000	140,485	2030/5/20	
第4回利付国債(30年)	2.9	110,000	135,254	2030/11/20	
第5回利付国債(30年)	2.2	50,000	58,915	2031/5/20	
第6回利付国債(30年)	2.4	350,000	421,592	2031/11/20	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第7回利付国債(30年)	2.3	180,000	216,419	2032/5/20	
第8回利付国債(30年)	1.8	350,000	404,985	2032/11/22	
第9回利付国債(30年)	1.4	240,000	267,832	2032/12/20	
第10回利付国債(30年)	1.1	160,000	173,665	2033/3/20	
第11回利付国債(30年)	1.7	260,000	299,267	2033/6/20	
第12回利付国債(30年)	2.1	190,000	227,525	2033/9/20	
第13回利付国債(30年)	2.0	400,000	475,416	2033/12/20	
第14回利付国債(30年)	2.4	800,000	989,248	2034/3/20	
第15回利付国債(30年)	2.5	340,000	425,537	2034/6/20	
第16回利付国債(30年)	2.5	200,000	250,882	2034/9/20	
第17回利付国債(30年)	2.4	1,150,000	1,432,681	2034/12/20	
第18回利付国債(30年)	2.3	345,000	426,651	2035/3/20	
第19回利付国債(30年)	2.3	530,000	656,972	2035/6/20	
第20回利付国債(30年)	2.5	480,000	608,505	2035/9/20	
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	622,155	2035/12/20	
第22回利付国債(30年)	2.5	540,000	687,879	2036/3/20	
第23回利付国債(30年)	2.5	430,000	548,697	2036/6/20	
第24回利付国債(30年)	2.5	780,000	998,283	2036/9/20	
第25回利付国債(30年)	2.3	350,000	439,054	2036/12/20	
第26回利付国債(30年)	2.4	1,140,000	1,448,506	2037/3/20	
第27回利付国債(30年)	2.5	1,920,000	2,476,550	2037/9/20	
第28回利付国債(30年)	2.5	2,090,000	2,704,146	2038/3/20	
第29回利付国債(30年)	2.4	1,670,000	2,141,942	2038/9/20	
第30回利付国債(30年)	2.3	1,770,000	2,248,147	2039/3/20	
第31回利付国債(30年)	2.2	1,100,000	1,382,447	2039/9/20	
第32回利付国債(30年)	2.3	1,360,000	1,733,265	2040/3/20	
第33回利付国債(30年)	2.0	1,820,000	2,231,083	2040/9/20	
第34回利付国債(30年)	2.2	1,795,000	2,264,948	2041/3/20	
第35回利付国債(30年)	2.0	2,300,000	2,825,343	2041/9/20	
第36回利付国債(30年)	2.0	2,130,000	2,620,688	2042/3/20	
第37回利付国債(30年)	1.9	2,225,000	2,699,703	2042/9/20	
第38回利付国債(30年)	1.8	1,410,000	1,685,514	2043/3/20	
第39回利付国債(30年)	1.9	1,480,000	1,799,295	2043/6/20	
第40回利付国債(30年)	1.8	1,380,000	1,650,742	2043/9/20	
第41回利付国債(30年)	1.7	1,150,000	1,353,975	2043/12/20	
第42回利付国債(30年)	1.7	1,120,000	1,319,371	2044/3/20	
第43回利付国債(30年)	1.7	1,340,000	1,579,404	2044/6/20	
第44回利付国債(30年)	1.7	1,210,000	1,426,928	2044/9/20	
第45回利付国債(30年)	1.5	1,410,000	1,638,864	2044/12/20	
第46回利付国債(30年)	1.5	1,650,000	1,878,162	2045/3/20	
第47回利付国債(30年)	1.6	1,560,000	1,808,196	2045/6/20	
第48回利付国債(30年)	1.4	1,710,000	1,909,659	2045/9/20	
第49回利付国債(30年)	1.4	1,700,000	1,898,407	2045/12/20	
第50回利付国債(30年)	0.8	1,590,000	1,569,584	2046/3/20	
第51回利付国債(30年)	0.3	1,710,000	1,499,704	2046/6/20	
第52回利付国債(30年)	0.5	1,680,000	1,541,319	2046/9/20	

銘柄名	期 末			
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第53回利付国債(30年)	0.6	1,320,000	1,237,856	2046/12/20
第54回利付国債(30年)	0.8	1,680,000	1,645,929	2047/3/20
第55回利付国債(30年)	0.8	1,440,000	1,409,112	2047/6/20
第56回利付国債(30年)	0.8	1,480,000	1,445,012	2047/9/20
第57回利付国債(30年)	0.8	1,410,000	1,373,565	2047/12/20
第58回利付国債(30年)	0.8	2,350,000	2,284,035	2048/3/20
第59回利付国債(30年)	0.7	1,410,000	1,334,973	2048/6/20
第60回利付国債(30年)	0.9	1,530,000	1,515,480	2048/9/20
第61回利付国債(30年)	0.7	1,460,000	1,373,845	2048/12/20
第62回利付国債(30年)	0.5	480,000	427,910	2049/3/20
第63回利付国債(30年)	0.4	1,260,000	1,089,736	2049/6/20
第64回利付国債(30年)	0.4	1,830,000	1,579,235	2049/9/20
第65回利付国債(30年)	0.4	1,555,000	1,343,271	2049/12/20
第66回利付国債(30年)	0.4	1,030,000	888,787	2050/3/20
第67回利付国債(30年)	0.6	1,865,000	1,692,282	2050/6/20
第68回利付国債(30年)	0.6	1,490,000	1,351,057	2050/9/20
第69回利付国債(30年)	0.7	1,340,000	1,247,928	2050/12/20
第70回利付国債(30年)	0.7	1,740,000	1,617,834	2051/3/20
第71回利付国債(30年)	0.7	1,430,000	1,327,426	2051/6/20
第72回利付国債(30年)	0.7	1,070,000	991,622	2051/9/20
第73回利付国債(30年)	0.7	1,870,000	1,732,124	2051/12/20
第74回利付国債(30年)	1.0	720,000	720,000	2052/3/20
第62回利付国債(20年)	0.8	320,000	323,004	2023/6/20
第63回利付国債(20年)	1.8	200,000	203,990	2023/6/20
第64回利付国債(20年)	1.9	320,000	328,307	2023/9/20
第65回利付国債(20年)	1.9	220,000	226,787	2023/12/20
第66回利付国債(20年)	1.8	330,000	339,665	2023/12/20
第67回利付国債(20年)	1.9	130,000	134,621	2024/3/20
第68回利付国債(20年)	2.2	190,000	197,784	2024/3/20
第69回利付国債(20年)	2.1	390,000	405,272	2024/3/20
第70回利付国債(20年)	2.4	400,000	420,284	2024/6/20
第71回利付国債(20年)	2.2	200,000	209,320	2024/6/20
第72回利付国債(20年)	2.1	630,000	661,430	2024/9/20
第73回利付国債(20年)	2.0	360,000	378,936	2024/12/20
第74回利付国債(20年)	2.1	200,000	211,032	2024/12/20
第75回利付国債(20年)	2.1	130,000	137,863	2025/3/20
第76回利付国債(20年)	1.9	270,000	284,814	2025/3/20
第77回利付国債(20年)	2.0	290,000	306,727	2025/3/20
第78回利付国債(20年)	1.9	170,000	180,140	2025/6/20
第79回利付国債(20年)	2.0	270,000	286,931	2025/6/20
第80回利付国債(20年)	2.1	220,000	234,469	2025/6/20
第81回利付国債(20年)	2.0	390,000	416,410	2025/9/20
第82回利付国債(20年)	2.1	600,000	642,618	2025/9/20
第83回利付国債(20年)	2.1	290,000	312,100	2025/12/20
第84回利付国債(20年)	2.0	470,000	504,140	2025/12/20
第85回利付国債(20年)	2.1	290,000	313,516	2026/3/20

銘柄名	期 末			
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第86回利付国債(20年)	2.3	510,000	555,237	2026/3/20
第87回利付国債(20年)	2.2	1,830,000	1,985,348	2026/3/20
第88回利付国債(20年)	2.3	420,000	459,631	2026/6/20
第89回利付国債(20年)	2.2	350,000	381,608	2026/6/20
第90回利付国債(20年)	2.2	630,000	690,284	2026/9/20
第91回利付国債(20年)	2.3	450,000	495,000	2026/9/20
第92回利付国債(20年)	2.1	880,000	964,629	2026/12/20
第93回利付国債(20年)	2.0	410,000	449,380	2027/3/20
第94回利付国債(20年)	2.1	610,000	671,518	2027/3/20
第95回利付国債(20年)	2.3	610,000	680,570	2027/6/20
第96回利付国債(20年)	2.1	1,590,000	1,757,888	2027/6/20
第97回利付国債(20年)	2.2	400,000	446,344	2027/9/20
第98回利付国債(20年)	2.1	440,000	488,642	2027/9/20
第99回利付国債(20年)	2.1	1,290,000	1,438,517	2027/12/20
第100回利付国債(20年)	2.2	480,000	540,019	2028/3/20
第101回利付国債(20年)	2.4	715,000	812,683	2028/3/20
第102回利付国債(20年)	2.4	1,260,000	1,438,731	2028/6/20
第103回利付国債(20年)	2.3	400,000	454,328	2028/6/20
第104回利付国債(20年)	2.1	160,000	179,798	2028/6/20
第105回利付国債(20年)	2.1	1,180,000	1,330,827	2028/9/20
第106回利付国債(20年)	2.2	380,000	430,958	2028/9/20
第107回利付国債(20年)	2.1	260,000	294,348	2028/12/20
第108回利付国債(20年)	1.9	660,000	738,579	2028/12/20
第109回利付国債(20年)	1.9	520,000	583,830	2029/3/20
第110回利付国債(20年)	2.1	1,100,000	1,249,908	2029/3/20
第111回利付国債(20年)	2.2	970,000	1,112,696	2029/6/20
第112回利付国債(20年)	2.1	790,000	900,679	2029/6/20
第113回利付国債(20年)	2.1	2,020,000	2,311,364	2029/9/20
第114回利付国債(20年)	2.1	2,330,000	2,675,445	2029/12/20
第115回利付国債(20年)	2.2	700,000	809,025	2029/12/20
第116回利付国債(20年)	2.2	1,490,000	1,728,236	2030/3/20
第117回利付国債(20年)	2.1	1,080,000	1,244,343	2030/3/20
第118回利付国債(20年)	2.0	660,000	757,772	2030/6/20
第119回利付国債(20年)	1.8	530,000	600,071	2030/6/20
第120回利付国債(20年)	1.6	1,570,000	1,752,559	2030/6/20
第121回利付国債(20年)	1.9	1,500,000	1,714,665	2030/9/20
第122回利付国債(20年)	1.8	940,000	1,066,815	2030/9/20
第123回利付国債(20年)	2.1	1,870,000	2,175,277	2030/12/20
第124回利付国債(20年)	2.0	610,000	704,434	2030/12/20
第125回利付国債(20年)	2.2	1,770,000	2,081,626	2031/3/20
第126回利付国債(20年)	2.0	730,000	845,858	2031/3/20
第127回利付国債(20年)	1.9	1,020,000	1,173,040	2031/3/20
第128回利付国債(20年)	1.9	970,000	1,118,148	2031/6/20
第129回利付国債(20年)	1.8	740,000	846,426	2031/6/20
第130回利付国債(20年)	1.8	1,285,000	1,473,522	2031/9/20
第131回利付国債(20年)	1.7	1,000,000	1,137,570	2031/9/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第132回利付国債(20年)	1.7	1,160,000	1,321,912	2031/12/20
第133回利付国債(20年)	1.8	1,230,000	1,413,208	2031/12/20
第134回利付国債(20年)	1.8	830,000	955,836	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	1,030,000	1,176,270	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	1,450,000	1,642,009	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	1,060,000	1,212,534	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	620,000	697,035	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	830,000	941,278	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	2,420,000	2,772,569	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	1,600,000	1,835,760	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	980,000	1,134,467	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	1,920,000	2,185,728	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	1,150,000	1,297,108	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	2,675,000	3,079,005	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	2,700,000	3,113,370	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	2,380,000	2,721,006	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	2,000,000	2,265,820	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	2,600,000	2,947,542	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	2,730,000	3,064,588	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	2,255,000	2,478,087	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	2,860,000	3,144,398	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	2,440,000	2,714,134	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	2,790,000	3,068,107	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	2,800,000	3,006,360	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	2,620,000	2,601,267	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	2,950,000	2,843,092	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	2,530,000	2,538,450	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	2,400,000	2,437,512	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	1,890,000	1,943,430	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	1,990,000	2,015,034	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	630,000	636,690	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	1,980,000	1,997,047	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	1,320,000	1,309,440	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	2,150,000	2,127,855	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	1,620,000	1,650,180	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	2,150,000	2,119,212	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	1,410,000	1,363,822	2039/3/20
第169回利付国債(20年)	0.3	1,990,000	1,887,395	2039/6/20
第170回利付国債(20年)	0.3	2,390,000	2,259,864	2039/9/20
第171回利付国債(20年)	0.3	1,670,000	1,574,158	2039/12/20
第172回利付国債(20年)	0.4	2,470,000	2,362,036	2040/3/20
第173回利付国債(20年)	0.4	2,350,000	2,240,584	2040/6/20
第174回利付国債(20年)	0.4	2,480,000	2,359,248	2040/9/20
第175回利付国債(20年)	0.5	1,960,000	1,892,497	2040/12/20
第176回利付国債(20年)	0.5	2,850,000	2,743,866	2041/3/20
第177回利付国債(20年)	0.4	2,390,000	2,254,271	2041/6/20

銘柄名	期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第178回利付国債(20年)	0.5	1,690,000	1,620,101	2041/9/20
第179回利付国債(20年)	0.5	3,015,000	2,886,440	2041/12/20
第180回利付国債(20年)	0.8	800,000	808,288	2042/3/20
小計		503,715,000	523,319,672	
地方債証券				
第2回東京都公募公債(東京ソーシャルボンド(5年))	0.1	100,000	100,182	2026/12/18
第3回東京都公募公債(20年)	2.26	100,000	104,057	2024/3/19
第5回東京都公募公債(東京グリーンボンド(30年))	0.74	100,000	91,912	2051/9/20
第6回東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	105,531	2025/3/19
第9回東京都公募公債(30年)	2.37	100,000	126,922	2039/3/18
第11回東京都公募公債(30年)	2.19	100,000	124,591	2040/9/20
第13回東京都公募公債(30年)	1.93	100,000	120,579	2042/3/19
第15回東京都公募公債(30年)	1.827	100,000	118,811	2044/6/20
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	200,000	223,872	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	100,000	112,455	2028/12/20
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	100,000	113,512	2029/6/20
第19回東京都公募公債(30年)	0.725	100,000	92,016	2050/9/20
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	200,000	228,092	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	200,000	227,310	2032/12/20
第33回東京都公募公債(5年)	0.01	200,000	199,786	2025/12/19
第720回東京都公募公債	0.87	100,000	100,908	2023/6/20
第726回東京都公募公債	0.73	200,000	202,240	2023/12/20
第728回東京都公募公債	0.65	100,000	100,995	2023/12/20
第751回東京都公募公債	0.37	100,000	101,171	2025/12/19
第765回東京都公募公債	0.21	100,000	100,674	2027/3/19
第770回東京都公募公債	0.18	100,000	100,452	2027/6/18
第781回東京都公募公債	0.16	300,000	300,270	2028/6/20
第800回東京都公募公債	0.08	200,000	197,918	2029/12/20
平成27年度第15回北海道公募公債	0.22	100,000	100,635	2026/2/26
平成28年度第1回北海道公募公債	0.085	100,000	100,136	2026/4/28
平成28年度第14回北海道公募公債	0.24	100,000	100,806	2027/2/24
平成30年度第14回北海道公募公債	0.195	200,000	200,194	2028/12/28
第29回1号宮城県公募公債(10年)	0.68	100,000	100,941	2023/10/25
第4回神奈川県公募公債(30年)	2.62	200,000	260,052	2038/3/19
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	100,000	113,275	2029/7/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	200,000	227,894	2030/11/12
第17回神奈川県公募公債(20年)	1.975	100,000	115,116	2031/7/11
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	100,000	113,715	2032/6/18
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	111,318	2034/9/20
第78回神奈川県公募公債(5年)	0.005	200,000	199,958	2024/6/20
第201回神奈川県公募公債	0.704	200,250	202,068	2023/9/20
第210回神奈川県公募公債	0.451	200,000	202,204	2024/12/20
第215回神奈川県公募公債	0.494	100,000	101,420	2025/6/20
第218回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,550	2025/12/19
第226回神奈川県公募公債	0.195	100,000	100,603	2027/3/19

銘柄名	期			末
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
第227回神奈川県公債	0.18	100,000	100,452	2027/6/18
第243回神奈川県公債	0.075	200,000	197,842	2029/12/20
第6回大阪府公債(20年)	1.98	200,000	228,020	2030/9/13
第7回大阪府公債(20年)	1.84	200,000	228,038	2031/9/26
第10回大阪府公債(20年)	1.72	100,000	113,808	2032/9/24
第375回大阪府公債(10年)	0.835	100,000	101,030	2023/8/29
第377回大阪府公債(10年)	0.729	100,000	101,019	2023/10/30
第389回大阪府公債(10年)	0.53	100,000	101,233	2024/10/30
第395回大阪府公債(10年)	0.435	151,000	152,780	2025/4/28
第399回大阪府公債(10年)	0.529	100,000	101,605	2025/8/28
第402回大阪府公債(10年)	0.493	100,000	101,582	2025/11/27
第407回大阪府公債(10年)	0.09	156,000	156,243	2026/4/27
第410回大阪府公債(10年)	0.001	200,000	199,550	2026/7/28
第439回大阪府公債(10年)	0.193	200,000	200,168	2028/12/27
第440回大阪府公債(10年)	0.2	100,000	100,098	2029/1/30
第465回大阪府公債(10年)	0.12	160,000	157,729	2031/2/25
第468回大阪府公債(10年)	0.129	182,000	179,351	2031/5/28
第469回大阪府公債(10年)	0.128	200,000	196,960	2031/6/27
平成21年度第3回京都府公債(20年)	2.19	100,000	114,297	2029/9/20
平成23年度第5回京都府公債(20年)	1.79	100,000	113,739	2031/10/17
平成25年度第7回京都府公債	0.8	100,000	101,032	2023/9/19
平成27年度第4回京都府公債	0.553	100,000	101,599	2025/6/19
平成28年度第5回京都府公債(20年)	0.327	100,000	97,121	2036/8/15
平成29年度第5回京都府公債(20年)	0.63	100,000	100,696	2037/8/14
令和2年度第12回京都府公債	0.12	140,500	138,795	2030/12/16
第2回兵庫県公債(20年)	2.37	100,000	111,940	2027/9/17
第3回兵庫県公債(12年)	0.56	100,000	101,525	2025/4/16
第6回兵庫県公債(15年)	1.35	100,000	107,272	2028/7/14
第7回兵庫県公債(15年)	1.12	100,000	106,141	2028/12/25
第8回兵庫県公債(15年)	1.09	100,000	106,112	2029/4/16
第9回兵庫県公債(20年)	2.25	400,000	459,988	2029/11/19
平成25年度第7回兵庫県公債	0.7	100,000	100,978	2023/10/30
平成26年度第17回兵庫県公債	0.46	100,000	101,193	2025/2/26
第35回兵庫県公債(20年)	0.578	100,000	99,316	2038/5/28
令和元年度第17回兵庫県公債	0.15	300,000	298,416	2030/1/28
第9回静岡県公債(30年)	1.539	100,000	112,734	2045/6/20
第12回静岡県公債(30年)	0.822	100,000	95,853	2048/3/19
第15回静岡県公債(20年)	1.701	100,000	113,750	2032/10/15
第18回静岡県公債(20年)	1.473	100,000	112,138	2034/7/10
平成26年度第3回静岡県公債	0.679	100,000	101,322	2024/5/27
平成29年度第5回静岡県公債	0.19	100,000	100,503	2027/6/18
平成29年度第8回静岡県公債	0.21	100,000	100,603	2027/6/18
平成29年度第11回静岡県公債	0.215	100,000	100,605	2027/9/17
令和2年度第11回静岡県公債	0.204	310,000	308,412	2030/12/20
平成21年度第5回愛知県公債(20年)	2.28	100,000	114,557	2029/6/20
第18回愛知県公債(10年)	0.665	100,000	101,246	2024/4/30

銘柄名	期			末
	利率(%)	額面金額(千円)	評価額(千円)	償還年月日
平成26年度第5回愛知県公債(10年)	0.66	200,000	202,572	2024/5/28
平成27年度第17回愛知県公債(10年)	0.38	100,000	101,225	2026/1/27
平成28年度第5回愛知県公債(10年)	0.07	100,000	100,061	2026/6/29
平成29年度第6回愛知県公債(10年)	0.22	200,000	201,252	2027/7/28
平成29年度第12回愛知県公債(20年)	0.606	300,000	300,456	2037/11/20
平成30年度第1回愛知県公債(10年)	0.185	100,000	100,322	2028/4/27
平成30年度第6回愛知県公債(30年)	0.777	100,000	94,602	2048/6/19
令和元年度第16回愛知県公債(10年)	0.09	200,000	197,952	2030/2/15
令和2年度第7回愛知県公債(10年)	0.145	100,000	99,181	2030/7/31
令和3年度第6回愛知県公債(30年)	0.718	200,000	183,164	2051/6/20
平成20年度第1回広島県公債(20年)	2.34	100,000	113,625	2028/9/21
平成21年度第1回広島県公債(20年)	2.21	200,000	227,890	2029/5/28
平成25年度第4回広島県公債	0.67	100,000	100,986	2023/11/27
平成27年度第4回広島県公債	0.476	125,230	127,133	2025/11/25
平成29年度第1回広島県公債	0.175	100,000	100,423	2027/5/25
令和2年度第7回広島県公債	0.214	390,000	388,116	2031/3/19
第3回埼玉県公債(20年)	2.42	100,000	111,719	2027/6/18
第6回埼玉県公債(20年)	2.26	100,000	113,125	2028/9/21
第6回埼玉県公債(30年)	0.957	100,000	99,942	2046/12/20
第7回埼玉県公債(20年)	2.29	200,000	229,276	2029/6/22
第8回埼玉県公債(15年)	0.367	200,000	195,778	2036/4/18
第10回埼玉県公債(20年)	1.94	200,000	227,894	2030/11/12
第18回埼玉県公債(20年)	0.323	200,000	194,480	2036/5/20
平成25年度第11回埼玉県公債	0.655	100,000	101,165	2024/3/26
平成27年度第7回埼玉県公債	0.469	100,000	101,512	2025/12/25
平成28年度第6回埼玉県公債	0.085	100,000	100,127	2026/9/29
平成28年度第9回埼玉県公債	0.249	100,000	100,849	2027/2/24
平成29年度第4回埼玉県公債	0.19	100,000	100,479	2027/6/22
令和2年度第7回埼玉県公債	0.125	100,000	98,932	2030/10/16
令和2年度第8回埼玉県公債	0.12	100,000	98,786	2030/12/17
令和3年度第8回埼玉県公債	0.125	150,000	147,568	2031/10/27
平成19年度第1回福岡県公債(20年)	2.38	100,000	111,841	2027/8/20
平成20年度第2回福岡県公債(20年)	2.05	100,000	112,196	2028/12/20
平成22年度第1回福岡県公債(15年)	1.67	100,000	105,664	2025/11/21
平成23年度第1回福岡県公債(20年)	2.008	100,000	115,188	2031/5/23
平成23年度第1回福岡県公債(15年)	1.491	100,000	106,422	2026/11/27
平成24年度第1回福岡県公債(30年)	2.12	100,000	124,151	2042/9/19
平成26年度第4回福岡県公債(20年)	1.249	100,000	109,626	2035/2/23
平成27年度第7回福岡県公債	0.464	100,000	101,494	2025/12/25
平成30年度第1回福岡県公債(30年)	0.777	100,000	94,602	2048/6/19
平成30年度第1回福岡県公債(20年)	0.639	100,000	100,055	2038/8/20
令和2年度第1回福岡県公債	0.155	300,000	297,975	2030/6/24
令和3年度第2回福岡県公債	0.155	100,000	98,859	2031/5/30
令和3年度第1回福岡県公債(15年)	0.299	100,000	96,770	2036/7/14
第5回千葉県公債(20年)	2.26	200,000	226,250	2028/9/21

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第6回千葉県公募公債(20年)	2.26	100,000	114,119	2029/4/20
第13回千葉県公募公債(20年)	1.701	100,000	113,750	2032/10/15
平成25年度第5回千葉県公募公債	0.84	100,000	101,026	2023/8/25
平成25年度第8回千葉県公募公債	0.67	300,000	302,940	2023/11/24
平成25年度第9回千葉県公募公債	0.7	100,000	101,083	2023/12/25
平成26年度第7回千葉県公募公債	0.429	100,000	101,107	2025/2/25
平成27年度第1回千葉県公募公債	0.549	100,000	101,547	2025/5/23
平成28年度第4回千葉県公募公債	0.085	100,000	100,128	2026/9/25
平成28年度第6回千葉県公募公債	0.18	120,000	120,642	2027/1/25
令和元年度第7回千葉県公募公債	0.08	300,000	296,688	2030/2/25
令和2年度第7回千葉県公募公債	0.15	100,000	99,143	2030/9/25
令和3年度第1回長野県公募公債(10年)	0.19	300,000	297,789	2031/4/16
平成30年度第3回茨城県公募公債	0.03	350,000	350,080	2023/8/25
第1回群馬県公募公債(20年)	1.841	200,000	226,140	2030/10/18
平成29年度第1回岐阜県公募公債(10年)	0.205	100,000	100,538	2027/10/29
第125回共同発行市場公募地方債	0.82	200,000	202,004	2023/8/25
第127回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	100,941	2023/10/25
第128回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	100,965	2023/11/24
第130回共同発行市場公募地方債	0.76	200,000	202,482	2024/1/25
第131回共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	101,128	2024/2/23
第132回共同発行市場公募地方債	0.66	300,000	303,546	2024/3/25
第134回共同発行市場公募地方債	0.674	112,000	113,462	2024/5/24
第135回共同発行市場公募地方債	0.659	100,000	101,333	2024/6/25
第136回共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	101,272	2024/7/25
第137回共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	101,218	2024/8/23
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	200,000	202,388	2024/11/25
第145回共同発行市場公募地方債	0.406	200,000	202,184	2025/4/25
第146回共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	203,118	2025/5/23
第148回共同発行市場公募地方債	0.553	125,400	127,449	2025/7/25
第152回共同発行市場公募地方債	0.496	100,000	101,590	2025/11/25
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,190	2026/3/25
第157回共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,116	2026/4/24
第159回共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	200,120	2026/6/25
第160回共同発行市場公募地方債	0.05	200,000	199,958	2026/7/24
第161回共同発行市場公募地方債	0.06	400,000	400,084	2026/8/25
第164回共同発行市場公募地方債	0.05	100,000	99,961	2026/11/25
第166回共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,535	2027/1/25
第167回共同発行市場公募地方債	0.245	100,000	100,830	2027/2/25
第171回共同発行市場公募地方債	0.185	200,000	200,910	2027/6/25
第174回共同発行市場公募地方債	0.145	194,300	194,709	2027/9/24
第175回共同発行市場公募地方債	0.215	100,000	100,591	2027/10/25
第181回共同発行市場公募地方債	0.18	300,000	300,876	2028/4/25
第219回共同発行市場公募地方債	0.145	100,000	98,718	2031/6/25
平成29年度第1回静岡市公募公債	0.22	100,000	100,600	2027/11/24
第13回回大阪市公募公債(20年)	2.08	200,000	229,210	2030/6/14
第15回大阪市公募公債(30年)	0.704	100,000	91,172	2051/6/20

当 期		末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第22回大阪府公募公債(20年)	0.347	300,000	292,452	2036/5/30
第24回大阪府公募公債(20年)	0.655	100,000	101,234	2037/4/21
平成25年度第8回大阪府公募公債	0.767	100,000	101,266	2024/1/31
令和3年度第2回大阪府公募公債	0.16	200,000	197,810	2031/5/21
第1回名古屋市公募公債(30年)	2.53	100,000	125,341	2035/3/20
第5回名古屋市公募公債(30年)	2.49	100,000	128,851	2039/3/18
第9回名古屋市公募公債(20年)	2.07	100,000	112,326	2028/12/20
第11回名古屋市公募公債(30年)	1.774	100,000	117,637	2044/9/20
第499回名古屋市公募公債(10年)	0.225	100,000	100,725	2027/3/26
第512回名古屋市公募公債(10年)	0.15	300,000	297,864	2030/6/20
平成28年度第6回京都市公募公債	0.18	200,000	201,072	2027/1/27
平成18年度第3回神戸市公募公債(20年)	2.54	120,000	132,091	2026/6/19
平成20年度第1回神戸市公募公債(20年)	2.38	200,000	226,606	2028/5/26
平成21年度第11回神戸市公募公債(20年)	2.233	100,000	115,180	2030/1/29
平成24年度第12回神戸市公募公債(20年)	1.711	100,000	113,960	2032/12/17
令和2年度第9回神戸市公募公債(30年)	0.674	100,000	90,854	2050/6/20
令和3年度第6回神戸市公募公債(30年)	0.713	100,000	91,370	2051/6/20
第5回横浜市公募公債(20年)	2.17	100,000	106,540	2025/6/20
第20回横浜市公募公債(20年)	2.1	300,000	341,298	2029/10/19
平成28年度第4回横浜市公募公債	0.175	100,000	100,511	2027/1/22
平成29年度第2回横浜市公募公債	0.24	100,000	100,747	2027/7/16
平成30年度第1回横浜市公募公債	0.195	100,000	100,379	2028/4/17
平成30年度第4回横浜市公募公債	0.289	100,000	100,815	2028/10/17
第30回横浜市公募公債(20年)	1.376	200,000	222,130	2034/10/20
令和2年度第1回横浜市公募公債	0.15	300,000	297,987	2030/6/12
令和3年度第2回横浜市公募公債	0.16	100,000	98,905	2031/5/23
平成23年度第9回札幌市公募公債(15年)	1.493	100,000	106,679	2027/2/12
平成26年度第9回札幌市公募公債(10年)	0.43	100,000	101,048	2024/12/20
第11回川崎市公募公債(20年)	1.84	100,000	113,062	2030/10/18
第89回川崎市公募公債	0.16	100,000	100,454	2026/12/18
第93回川崎市公募公債	0.105	100,000	98,778	2030/9/20
平成26年度第2回北九州市公募公債	0.451	100,000	101,107	2024/12/24
平成27年度第2回北九州市公募公債	0.484	100,000	101,575	2025/12/18
平成28年度第1回北九州市公募公債	0.08	100,000	100,115	2026/4/15
平成21年度第3回福岡市公募公債(20年)	2.14	100,000	113,927	2029/9/18
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)	1.511	100,000	112,377	2034/2/17
平成26年度第5回福岡市公募公債	0.539	200,000	202,504	2024/10/28
平成30年度第5回福岡市公募公債(5年)	0.03	200,000	200,046	2023/8/17
平成30年度第10回福岡市公募公債(5年)	0.02	100,000	100,014	2023/12/26
平成25年度第3回広島市公募公債	0.67	150,000	151,719	2024/2/23
平成26年度第2回広島市公募公債	0.456	100,000	101,121	2024/12/25
平成28年度第4回広島市公募公債	0.165	105,000	105,478	2026/12/25
平成29年度第6回広島市公募公債	0.23	170,000	171,016	2028/2/25
令和元年度第6回広島市公募公債	0.115	550,000	545,391	2030/2/25
令和2年度第3回広島市公募公債(5年)	0.02	200,000	199,868	2025/10/24

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
令和元年度第5回千葉市公債券	0.08	200,000	197,792	2030/2/25	
平成25年度第4回福井県公債券	0.7	100,000	101,303	2024/4/25	
平成26年度第1回岡山県公債券(10年)	0.33	200,000	201,628	2025/1/30	
第113回福岡北九州高速道路債券	2.41	100,000	111,567	2027/12/20	
小計		32,361,680	33,511,126		
特殊債券(除く金融債)					
第40回政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	126,000	126,000	2026/3/13	
第46回政府保証日本政策金融公庫債券	0.16	100,000	100,443	2027/7/20	
第47回政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	210,000	210,109	2027/9/24	
第53回政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	187,000	187,983	2028/9/15	
第54回政府保証日本政策金融公庫債券	0.001	220,000	220,083	2024/10/24	
第2回政府保証新関西国際空港債券	0.882	202,000	203,959	2023/6/27	
第2回政府保証日本政策投資銀行債券	2.2	300,000	307,020	2023/6/19	
第37回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.085	100,000	100,205	2026/12/14	
第52回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	100,029	2025/1/24	
第84回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	132,298	2049/6/30	
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	227,796	2029/9/28	
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	200,000	229,808	2029/11/30	
第109回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	124,889	2040/5/31	
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	115,736	2030/12/27	
第181回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.66	100,000	113,652	2032/12/28	
第193回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.882	200,000	201,954	2023/6/30	
第200回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	148,000	149,619	2023/9/29	
第202回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.699	100,000	101,021	2023/10/31	
第204回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	265,800	268,548	2023/11/30	
第207回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	200,000	202,250	2023/12/28	
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.747	533,000	539,838	2024/1/31	
第213回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.645	100,000	101,217	2024/3/29	
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.475	200,000	224,426	2034/3/31	
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	102,000	103,347	2024/4/30	
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,370	2024/6/28	
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.601	100,000	101,336	2024/7/31	
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.396	200,000	223,024	2034/9/29	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第229回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.539	100,000	101,329	2024/10/31	
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	101,227	2024/12/27	
第236回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	300,000	302,646	2025/1/31	
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	100,000	108,693	2035/2/28	
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.216	200,000	218,720	2035/3/30	
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	200,000	202,238	2026/1/30	
第269回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,468	2026/2/27	
第277回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.394	100,000	88,275	2046/5/31	
第294回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	107,000	106,836	2026/11/30	
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	205,000	205,672	2027/1/29	
第306回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	100,438	2027/3/31	
第309回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.14	200,000	200,838	2027/4/30	
第321回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	100,000	100,413	2027/8/31	
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	120,000	120,651	2028/2/29	
第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	200,000	200,416	2028/5/31	
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	300,000	299,550	2038/9/30	
第363回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.219	214,000	215,211	2028/10/31	
第385回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.005	100,000	98,844	2029/6/29	
第393回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.001	100,000	98,632	2029/10/31	
第4回政府保証地方公共団体金融機構債券(8年)	0.311	100,000	100,383	2023/7/28	
第11回政府保証地方公共団体金融機構債券(4年)	0.001	600,000	600,210	2024/8/28	
第51回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.835	100,000	101,032	2023/8/14	
第54回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.669	105,000	106,060	2023/11/17	
第57回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	200,000	202,334	2024/2/16	
第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.645	100,000	101,191	2024/3/15	
第79回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.379	100,000	101,305	2025/12/12	
第82回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	100,000	2026/3/13	
第91回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,205	2026/12/14	
第95回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.14	251,000	252,046	2027/4/16	
第98回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,441	2027/7/16	
第99回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,404	2027/8/13	
第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	110,000	110,624	2028/2/15	

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第111	回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	156,000	156,825	2028/8/15
第113	回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	100,563	2028/10/16
第120	回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.001	100,000	98,810	2029/7/13
第16	回	政府保証民間都市開発債券	0.699	180,000	181,798	2023/10/20
第129	回	株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.892	100,000	83,736	2070/7/16
第21	回	道路債券	2.75	100,000	125,088	2033/6/20
第27	回	道路債券	2.42	400,000	417,252	2024/3/20
第28	回	道路債券	2.83	200,000	253,424	2033/12/20
第33	回	道路債券	2.91	200,000	256,576	2034/6/20
第34	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	112,841	2028/3/17
第36	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.84	100,000	139,939	2048/3/20
第37	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	113,490	2028/6/20
第42	回	道路債券	2.22	100,000	106,115	2025/3/21
第47	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.41	100,000	114,905	2029/4/20
第95	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	100,000	114,027	2032/9/17
第112	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.85	300,000	302,661	2023/6/20
第115	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.738	100,000	100,945	2023/9/20
第118	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.77	100,000	101,167	2023/12/20
第131	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.445	100,000	111,190	2034/6/20
第134	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.529	100,000	101,026	2024/6/20
第144	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	101,114	2024/12/20
第153	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.974	100,000	121,966	2055/3/19
第158	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.243	200,000	218,082	2035/6/20
第188	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.614	600,000	599,058	2037/9/18
第208	回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.183	100,000	100,172	2058/3/19
第2	回	公営企業債券(30年)	2.39	300,000	365,766	2033/12/20
第3	回	地方公共団体金融機構債券(15年)	1.176	100,000	106,415	2029/1/26
第5	回	公営企業債券(30年)	2.72	300,000	380,145	2034/9/22
第7	回	公営企業債券(20年)	2.2	100,000	103,937	2024/3/22
第7	回	公営企業債券(30年)	2.67	200,000	254,298	2035/6/20
第8	回	公営企業債券(20年)	2.25	40,000	41,611	2024/3/22
第8	回	公営企業債券(30年)	2.5	100,000	125,281	2035/9/21
第8	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	2.043	200,000	228,210	2030/6/28
第10	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.752	200,000	223,934	2030/8/28
第11	回	地方公共団体金融機構債券(30年)	0.633	200,000	178,532	2050/8/26
第18	回	公営企業債券(20年)	2.58	100,000	110,171	2026/6/19
第19	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	200,000	228,566	2031/12/26
第24	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	100,000	113,472	2032/9/28
第34	回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	500,000	566,625	2034/1/27

当		期			末	
銘	柄	名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第58	回	地方公共団体金融機構債券	0.739	100,000	101,295	2024/3/28
第65	回	地方公共団体金融機構債券	0.535	300,000	303,651	2024/10/28
第67	回	地方公共団体金融機構債券	0.501	100,000	101,213	2024/12/27
第69	回	地方公共団体金融機構債券	0.478	100,000	101,217	2025/2/28
第76	回	地方公共団体金融機構債券	0.505	200,000	202,994	2025/9/26
F77	回	地方公共団体金融機構債券	1.519	100,000	106,336	2026/10/20
第83	回	地方公共団体金融機構債券	0.09	200,000	200,194	2026/4/28
第88	回	地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,998	2026/9/28
F95	回	地方公共団体金融機構債券	1.336	100,000	103,497	2025/2/6
F107	回	地方公共団体金融機構債券	1.388	100,000	103,788	2025/3/19
第116	回	地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	99,703	2029/1/26
F132	回	地方公共団体金融機構債券	1.09	100,000	103,291	2025/7/30
F146	回	地方公共団体金融機構債券	1.134	200,000	207,356	2025/10/28
F202	回	地方公共団体金融機構債券	0.929	200,000	207,020	2026/6/26
F208	回	地方公共団体金融機構債券	0.857	100,000	102,930	2026/2/4
F214	回	地方公共団体金融機構債券	0.94	100,000	104,084	2027/4/28
第29	回	首都高速道路株式会社債	0.125	100,000	100,045	2026/12/18
第7	回	阪神高速道路債券	2.18	100,000	105,928	2025/3/21
第19	回	水資源債券(サステナビリティボンド)	0.001	200,000	199,824	2024/12/20
第4	回	株式会社日本政策金融公社債	2.2	100,000	114,081	2029/9/20
第18	回	株式会社日本政策金融公社債	2.157	100,000	116,222	2031/5/9
第87	回	株式会社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,914	2024/3/11
第88	回	株式会社日本政策金融公社債	0.001	200,000	199,956	2023/11/10
第89	回	株式会社日本政策金融公社債	0.03	100,000	99,972	2025/3/12
第117	回	回都市再生債券	0.804	200,000	208,504	2030/11/20
第159	回	回都市再生債券	0.43	200,000	154,990	2059/3/19
第161	回	回都市再生債券	0.687	100,000	85,103	2059/3/19
第171	回	回都市再生債券	0.886	200,000	181,582	2061/3/18
第5	回	本州四国連絡橋債券	2.23	100,000	105,544	2024/12/20
第346	回	東京交通債券	1.13	20,000	20,229	2023/6/20
第62	回	独立行政法人福祉医療機構債券	0.18	100,000	99,211	2030/6/20
第1	回	貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.13	10,245	10,310	2042/5/10
第1	回	貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.08	10,648	10,770	2037/11/10
第2	回	貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.27	10,742	10,893	2037/11/10
第2	回	貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.18	134,739	134,270	2032/5/10
第3	回	貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.16	95,042	94,770	2033/1/10
第4	回	貸付債権担保宅金融支援機構債券	2.29	10,702	10,839	2042/8/10
第4	回	貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.03	11,619	11,841	2038/5/10
第4	回	貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.08	169,236	168,381	2033/4/10
第6	回	貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	1.94	11,501	11,714	2038/11/10
第6	回	貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.06	192,255	191,018	2034/2/10
第7	回	貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.14	68,772	68,503	2034/2/10
第8	回	貸付債権担保S種宅金融公社債券	2.15	9,987	10,047	2037/5/10
第8	回	貸付債権担保S種宅金融支援機構債券	2.09	11,929	12,252	2039/5/10
第8	回	貸付債権担保T種宅金融支援機構債券	0.13	230,094	228,943	2034/6/10
第9	回	貸付債権担保S種宅金融公社債券	2.19	10,194	10,256	2037/5/10

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第9回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.13	158,322	157,661	2034/8/10
第10回貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.09	12,070	12,380	2039/11/10
第12回一般担保住宅金融支援機構債券	2.29	100,000	111,982	2027/12/20
第23回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.25	15,938	16,727	2044/4/10
第24回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.34	16,069	16,910	2044/5/10
第25回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	17,978	19,049	2044/6/10
第28回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	19,816	20,900	2044/9/10
第30回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	21,714	23,035	2044/11/10
第31回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	22,275	23,608	2044/12/10
第34回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.86	46,492	49,148	2045/3/10
第36回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.88	10,407	10,468	2040/11/10
第38回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	20,992	22,078	2045/5/10
第39回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.84	10,670	10,786	2041/2/10
第42回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.34	10,307	10,378	2041/5/10
第45回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	21,375	22,465	2046/2/10
第46回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.85	21,015	22,119	2046/3/10
第48回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	19,831	20,814	2046/5/10
第49回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.27	11,492	11,757	2041/12/10
第50回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.67	42,464	44,341	2046/7/10
第51回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	22,311	23,325	2046/8/10
第53回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.09	11,196	11,406	2042/4/10
第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	29,588	30,941	2046/12/10
第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	28,330	29,606	2047/1/10
第57回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.44	28,630	29,936	2047/2/10
第60回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	64,376	67,144	2047/5/10
第66回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	76,318	79,171	2047/11/10
第67回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.09	39,271	40,694	2047/12/10
第68回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.26	39,842	41,622	2048/1/10
第69回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	40,092	41,932	2048/2/10
第70回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	35,047	36,538	2048/3/10
第72回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	34,329	35,533	2048/5/10
第73回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3	39,865	41,737	2048/6/10
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	150,000	173,310	2031/6/13
第78回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.08	104,565	108,240	2048/11/10
第79回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	142,232	147,197	2048/12/10
第84回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	40,575	41,903	2049/5/10
第85回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.02	41,885	43,280	2049/6/10
第87回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.96	42,880	44,183	2049/8/10
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	114,204	2031/11/18
第89回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.95	134,922	138,949	2049/10/10
第90回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	46,395	47,591	2049/11/10
第92回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	97,682	99,514	2050/1/10
第94回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8	54,295	55,483	2050/3/10
第96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	58,033	59,122	2050/5/10
第97回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.83	57,478	58,841	2050/6/10
第98回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.9	178,620	183,530	2050/7/10

当		期 末		
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	120,492	123,648	2050/8/10
第100回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.84	58,204	59,614	2050/9/10
第104回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.85	63,181	64,725	2051/1/10
第108回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	69,494	69,011	2051/5/10
第113回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	75,109	74,755	2051/10/10
第114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	74,747	74,223	2051/11/10
第115回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	75,046	74,841	2051/12/10
第116回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	75,502	75,619	2052/1/10
第117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	76,026	76,016	2052/2/10
第122回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.44	77,872	77,801	2052/7/10
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	78,273	78,282	2052/8/10
第124回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,125	77,917	2052/9/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	78,131	77,919	2052/10/10
第126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.43	78,840	78,655	2052/11/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	159,830	159,096	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	79,103	78,864	2053/1/10
第129回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	161,548	161,405	2053/2/10
第130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	80,142	79,893	2053/3/10
第131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	160,908	160,116	2053/4/10
第133回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	81,458	81,186	2053/6/10
第134回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	163,600	162,762	2053/7/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	164,636	163,763	2053/8/10
第135回一般担保住宅金融支援機構債券	2.105	100,000	122,408	2043/3/20
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	83,408	83,375	2053/10/10
第138回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	82,925	83,070	2053/11/10
第140回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	83,194	82,653	2054/1/10
第142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	171,234	169,358	2054/3/10
第143回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	85,907	84,871	2054/4/10
第144回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	85,264	84,357	2054/5/10
第145回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	172,908	170,793	2054/6/10
第146回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.21	87,589	85,895	2054/7/10
第148回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	264,483	258,011	2054/9/10
第149回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.15	177,290	172,912	2054/10/10
第153回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.34	90,165	89,166	2055/2/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3	90,795	89,540	2055/3/10
第160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.37	186,272	184,498	2055/9/10
第162回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	94,267	93,245	2055/11/10
第163回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.35	188,800	186,696	2055/12/10
第164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	190,028	187,550	2056/1/10
第165回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	94,657	93,664	2056/2/10
第166回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	190,498	189,250	2056/3/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	191,824	190,625	2056/5/10
第169回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	96,517	95,813	2056/6/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	97,503	96,258	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	292,386	288,614	2056/9/10
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	97,777	96,638	2056/10/10

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第178回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	99,349	99,609	2057/3/10	
第181回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	100,000	100,247	2057/6/10	
第192回一般担保住宅金融支援機構債券	0.18	100,000	94,708	2036/7/18	
第320回一般担保住宅金融支援機構債券	0.753	100,000	91,495	2051/3/20	
第64回日本学生支援債券	0.001	300,000	299,940	2023/9/20	
第65回日本学生支援債券	0.001	200,000	199,940	2023/11/20	
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	106,094	2025/6/20	
第24回沖繩振興開発金融公庫債券	0.09	600,000	600,738	2024/6/20	
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	114,251	2033/9/20	
第53回東日本高速道路株式会社債	0.07	200,000	200,120	2023/12/20	
第64回東日本高速道路株式会社債	0.14	100,000	99,108	2029/11/29	
第67回東日本高速道路株式会社債	0.22	200,000	199,322	2030/1/31	
第73回東日本高速道路株式会社債	0.21	500,000	496,960	2030/7/17	
第86回東日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	99,638	2026/12/18	
第60回西日本高速道路株式会社債	0.001	300,000	299,925	2023/9/4	
第63回西日本高速道路株式会社債	0.001	200,000	199,922	2023/12/11	
第66回西日本高速道路株式会社債	0.08	800,000	800,312	2024/5/20	
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.685	100,000	100,876	2023/9/20	
第92回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.06	100,000	99,936	2026/8/19	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	200,000	195,618	2034/5/30	
小計		33,652,796	34,709,232		
金融債券					
い第823号商工債	0.17	200,000	200,342	2023/12/27	
い第829号商工債	0.13	200,000	200,206	2024/6/27	
い第832号商工債	0.06	200,000	199,906	2024/9/27	
い第833号商工債	0.05	100,000	99,903	2024/10/25	
い第843号商工債	0.12	200,000	200,038	2025/8/27	
い第847号商工債	0.1	100,000	99,910	2025/12/26	
い第850号商工債	0.1	200,000	199,656	2026/3/27	
第350回信金中金債(5年)	0.08	100,000	100,057	2024/1/26	
第360回信金中金債(5年)	0.01	200,000	199,750	2024/11/27	
第376回信金中金債(5年)	0.05	100,000	99,790	2026/3/27	
第379回信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,716	2026/6/26	
第385回信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,613	2026/12/25	
第254号商工債(3年)	0.05	300,000	299,862	2024/3/27	
第2回信金中金債(10年)	0.52	100,000	101,429	2025/9/26	
小計		2,200,000	2,200,178		
普通社債券(含む投資法人債券)					
第507回中部電力株式会社債	0.605	100,000	101,229	2026/1/23	
第511回中部電力株式会社債	0.21	100,000	99,590	2026/7/24	
第519回中部電力株式会社債	0.84	100,000	100,192	2037/1/23	
第540回中部電力株式会社債	0.53	100,000	93,202	2040/2/24	
第508回関西電力株式会社債	0.455	100,000	100,194	2027/4/23	
第510回関西電力株式会社債	0.49	200,000	200,570	2027/7/23	
第511回関西電力株式会社債	0.41	100,000	99,843	2027/9/17	
第524回関西電力株式会社債	0.514	100,000	100,148	2028/10/25	

当		期		末	
銘柄名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日	
第536回関西電力株式会社債	0.44	100,000	98,696	2030/12/20	
第538回関西電力株式会社債	0.39	100,000	98,206	2031/1/24	
第550回関西電力株式会社債	0.39	100,000	99,854	2027/5/25	
第385回中国電力株式会社債	0.728	100,000	101,594	2025/7/25	
第398回中国電力株式会社債	0.425	100,000	100,210	2027/7/23	
第400回中国電力株式会社債	0.34	100,000	99,739	2027/9/24	
第416回中国電力株式会社債	0.355	200,000	198,374	2029/5/25	
第425回中国電力株式会社債	0.37	100,000	98,797	2030/6/25	
第307回北陸電力株式会社債	1.055	100,000	103,036	2026/6/25	
第322回北陸電力株式会社債	0.38	100,000	99,976	2027/6/25	
第330回北陸電力株式会社債	0.34	200,000	198,172	2029/5/25	
第471回東北電力株式会社債	1.168	126,000	127,969	2023/12/25	
第481回東北電力株式会社債	0.803	100,000	101,749	2025/7/25	
第496回東北電力株式会社債	0.355	100,000	99,661	2027/9/24	
第508回東北電力株式会社債	0.465	100,000	99,765	2029/4/25	
第521回東北電力株式会社債	0.45	200,000	198,470	2030/5/24	
第527回東北電力株式会社債	0.32	100,000	97,744	2032/2/25	
第535回東北電力株式会社債	0.2	100,000	98,432	2028/7/25	
第309回四国電力株式会社債	0.4	100,000	99,080	2030/5/24	
第314回四国電力株式会社債	0.29	100,000	97,566	2031/5/23	
第449回九州電力株式会社債	0.43	200,000	200,244	2027/4/23	
第465回九州電力株式会社債	0.38	100,000	99,450	2028/7/25	
第468回九州電力株式会社債	0.435	100,000	99,765	2028/8/25	
第484回九州電力株式会社債	0.375	200,000	197,604	2029/11/22	
第489回九州電力株式会社債	0.44	100,000	99,082	2030/5/24	
第494回九州電力株式会社債	0.31	100,000	97,404	2031/5/23	
第326回北海道電力株式会社債	0.789	100,000	101,764	2025/12/25	
第340回北海道電力株式会社債	0.48	100,000	100,363	2027/4/23	
第350回北海道電力株式会社債	0.754	100,000	97,514	2038/3/25	
第39回大成建設株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,154	2030/6/14	
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	100,000	99,929	2027/11/30	
第15回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.03	200,000	199,610	2023/11/27	
第11回西松建設株式会社無担保社債	0.42	100,000	100,147	2027/3/1	
第24回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.08	300,000	298,950	2026/6/3	
第25回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.28	100,000	98,738	2031/6/3	
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	100,000	100,203	2024/9/13	
第9回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,718	2023/11/27	
第11回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,222	2024/6/13	
第13回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,768	2023/10/13	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.603	100,000	101,209	2025/2/28	
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.09	200,000	198,864	2026/6/3	
第24回株式会社エチレイン無担保社債	0.25	100,000	100,090	2025/8/29	

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第6回ヒューリック株式会社無担保社債	0.494	100,000	99,974	2028/10/20
第10回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.47	100,000	99,433	2028/5/26
第18回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	100,000	99,942	2023/8/30
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	100,309	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	200,000	199,948	2025/12/19
第13回旭化成株式会社無担保社債	0.12	100,000	99,820	2025/6/19
第35回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.45	100,000	100,296	2028/11/29
第25回トクヤマ株式会社無担保社債	0.37	100,000	100,148	2027/3/1
第4回ア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	100,000	99,890	2028/8/31
第24回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.37	100,000	100,265	2028/2/25
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	200,000	199,546	2027/2/26
第35回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.19	200,000	200,170	2025/6/11
第40回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.09	100,000	99,610	2026/6/3
第42回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.74	100,000	95,248	2041/6/3
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	100,000	100,068	2028/3/23
第7回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.01	200,000	199,730	2023/11/27
第4回株式会社電通グループ無担保社債	0.22	100,000	100,009	2025/7/8
第6回株式会社電通無担保社債	0.49	200,000	200,010	2030/7/8
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	300,000	294,528	2031/10/14
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	100,000	100,102	2026/3/6
第13回ヤフー株式会社無担保社債	0.46	100,000	97,603	2029/7/31
第15回楽天グループ株式会社無担保社債	0.5	100,000	99,614	2024/12/2
第9回楽天グループ株式会社無担保社債	1.3	100,000	95,441	2033/12/2
第7回東豊ゼネラル石油株式会社無担保社債	0.925	100,000	101,753	2024/10/23
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	101,293	2024/6/4
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	100,000	100,007	2027/4/21
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	100,000	100,009	2026/4/17
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	99,910	2029/4/19
第2回日本製鉄株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,968	2026/6/19
第34回J F Eホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	300,120	2025/7/14
第8回株式会社タダノ無担保社債	0.28	100,000	99,731	2025/7/17
第17回株式会社日立製作所無担保社債	1.371	100,000	106,562	2028/12/13
第20回株式会社日立製作所無担保社債	0.29	100,000	99,207	2030/3/12
第1回株式会社安川電機無担保社債	0.13	100,000	99,752	2026/5/20
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.23	100,000	100,009	2025/7/16
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	100,000	99,304	2030/7/16
第16回パナソニック株式会社無担保社債	0.3	100,000	100,214	2023/9/20

銘柄名	期			末
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評価額 (千円)	償還年月日
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	200,000	201,848	2026/9/18
第20回パナソニック株式会社無担保社債	0.08	100,000	99,898	2023/12/22
第21回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	100,000	99,903	2025/12/24
第23回パナソニック株式会社無担保社債	0.39	100,000	98,610	2030/12/24
第18回株式会社デンソー無担保社債	0.315	100,000	99,914	2028/3/17
第19回株式会社デンソー無担保社債	0.001	300,000	299,556	2023/11/20
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,086	2024/9/3
第35回三菱重工株式会社無担保社債	0.33	100,000	99,915	2027/8/27
第11回J A三リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,050	2023/9/7
第30回いすゞ自動車株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,771	2026/2/4
第27回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.219	200,000	198,268	2031/3/18
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	100,000	99,992	2023/9/25
第8回楽天カード株式会社無担保社債	1.07	100,000	96,968	2031/12/17
第1回オリックス銀行株式会社無担保社債	0.16	100,000	99,840	2026/3/11
第6回大日本印刷株式会社無担保社債	0.58	100,000	93,606	2040/3/9
第78回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.785	100,000	101,285	2024/5/30
第108回丸紅株式会社無担保社債	0.38	100,000	100,184	2027/7/12
第70回三井物産株式会社無担保社債	2.021	100,000	114,476	2033/3/4
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	198,544	2029/7/11
第53回住友商事株式会社無担保社債	0.33	100,000	100,008	2027/7/26
第56回住友商事株式会社無担保社債	0.435	100,000	100,288	2028/9/14
第60回住友商事株式会社無担保社債	0.574	100,000	100,032	2032/5/24
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	99,613	2029/12/12
第23回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債 (劣後特約付)	2.91	100,000	116,216	2029/10/16
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	100,000	110,341	2027/4/20
第1回三井住友FG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.849	100,000	101,062	2024/9/12
第11回株式会社セブ銀行無担保社債	0.536	100,000	101,032	2024/12/20
第1回みずほFG無担保社債 (実質破綻時免除特約・劣後特約)	0.95	300,000	303,126	2024/7/16
第3回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,901	2025/7/15
第4回みずほリース株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,826	2025/10/7
第9回みずほリース株式会社無担保社債	0.23	100,000	98,254	2028/9/1
第16回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,054	2025/12/19
第18回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.38	200,000	199,846	2030/9/20
第34回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.22	100,000	98,372	2028/7/21
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	100,000	99,888	2026/6/19
第64回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.001	200,000	199,726	2023/9/19
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	99,976	2025/9/19
第67回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.14	100,000	99,885	2025/12/19

当 期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第94回トヨタファイナンス株式会社無担保社債	0.11	100,000	99,968	2025/10/21
第41回リコーリース株式会社無担保社債	0.14	100,000	99,318	2026/4/17
第16回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,570	2025/6/24
第17回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.34	100,000	99,395	2026/7/31
第30回株式会社ジャックス無担保社債	0.28	100,000	99,683	2026/1/27
第32回株式会社ジャックス無担保社債	0.23	100,000	99,315	2026/6/8
第35回株式会社ジャックス無担保社債	0.25	100,000	99,164	2026/12/9
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	100,000	102,717	2026/9/18
第77回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,123	2023/12/20
第80回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.28	100,000	98,091	2029/10/19
第87回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.06	200,000	199,736	2024/1/19
第21回三井住友フィナンサーズ株式会社無担保社債	0.18	200,000	200,132	2023/11/27
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	100,000	100,034	2023/10/25
第52回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.375	200,000	199,866	2027/7/13
第56回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.455	100,000	100,148	2028/1/18
第64回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.474	100,000	100,005	2028/10/18
第31回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.41	100,000	99,855	2027/8/27
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	800,000	800,240	2023/9/4
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	99,505	2026/9/4
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	200,000	199,618	2026/11/13
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	200,000	200,656	2026/3/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,916	2027/6/18
第131回三菱地所株式会社無担保社債	0.59	100,000	95,337	2039/8/5
第135回三菱地所株式会社無担保社債	0.26	100,000	98,514	2031/6/20
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	100,000	101,365	2024/4/26
第100回住友不動産株式会社無担保社債	0.809	100,000	101,403	2024/9/9
第109回住友不動産株式会社無担保社債	0.31	100,000	98,497	2031/5/9
第13回日本ビルファンド投資法人無担保投資法人債	1.168	100,000	101,025	2023/6/26
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	100,000	103,154	2026/6/17
第124回東武鉄道株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,762	2023/11/27
第132回東武鉄道株式会社無担保社債	0.624	100,000	100,183	2032/6/2
第86回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.951	100,000	93,363	2046/9/26
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	96,334	2040/6/11
第46回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.001	200,000	199,672	2023/11/27
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	100,000	102,485	2025/12/12
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	100,000	95,704	2039/6/20
第86回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.858	100,000	89,112	2049/12/3
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	100,000	96,862	2040/5/25
第51回京成電鉄株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,165	2028/9/7

当 期 末				
銘 柄 名	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.46	100,000	109,784	2026/9/18
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	200,000	227,058	2028/12/12
第115回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.06	100,000	99,524	2026/7/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.133	100,000	100,949	2047/7/26
第133回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.246	100,000	98,024	2058/9/27
第147回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.265	100,000	99,346	2030/4/22
第159回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.836	100,000	92,052	2050/12/16
第165回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.596	100,000	94,640	2041/4/15
第172回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.002	100,000	88,422	2061/7/15
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	112,569	2028/3/17
第46回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.024	100,000	92,058	2056/12/13
第50回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.042	100,000	98,852	2047/8/30
第59回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.13	500,000	499,935	2025/5/21
第75回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.582	100,000	94,409	2041/4/22
第47回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.375	100,000	124,817	2039/12/16
第71回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.917	100,000	117,746	2044/10/28
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	100,000	109,113	2034/11/28
第31回東京地下鉄株式会社社債	1.22	100,000	96,811	2058/5/24
第37回東京地下鉄株式会社社債	0.772	100,000	83,483	2059/6/27
第40回東京地下鉄株式会社社債	0.937	100,000	78,464	2070/1/31
第54回東京地下鉄株式会社社債	1.055	100,000	90,609	2061/10/14
第56回東京地下鉄株式会社社債	1.066	100,000	97,903	2052/2/28
第53回阪急神户ホールディングス株式会社無担保社債	0.878	200,000	179,040	2049/11/19
第6回株式会社日立物流無担保社債	0.25	100,000	99,494	2025/9/4
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	100,000	101,093	2023/12/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	100,000	100,328	2028/11/22
第11回ソフトバンク株式会社無担保社債	0.3	400,000	397,356	2026/6/3
第31回株式会社光通信無担保社債	1.38	200,000	196,328	2036/2/1
第33回株式会社光通信無担保社債	0.85	100,000	97,857	2031/6/16
第36回株式会社光通信無担保社債	0.8	100,000	97,098	2031/11/4
第13回電源開発株式会社無担保社債	2.04	100,000	105,474	2025/6/20
第44回電源開発株式会社無担保社債	0.688	100,000	97,893	2036/10/20
第50回電源開発株式会社無担保社債	0.415	100,000	100,008	2027/7/20
第57回電源開発株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,385	2028/7/20
第77回電源開発株式会社無担保社債	0.4	100,000	100,007	2027/5/20
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	200,000	201,958	2029/10/9
第38回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	300,000	300,675	2025/7/16
第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.08	100,000	101,445	2030/7/16
第41回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.64	300,000	300,660	2026/10/8

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第42回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.13	100,000	101,069	2032/10/8
第44回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.4	100,000	99,436	2026/4/22
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	100,000	98,847	2031/4/22
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	300,000	287,877	2036/8/29
第9回株式会社JERA無担保社債	0.664	100,000	100,032	2032/5/25
第64回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.805	100,000	91,377	2050/9/9
第65回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.225	200,000	197,676	2030/9/10
第41回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.22	200,000	197,040	2031/6/3
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	100,000	94,199	2041/6/3
第27回株式会社エヌ・ティ・ティ・データ無担保社債	0.9	100,000	100,865	2023/6/20
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	200,000	200,910	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債	0.384	100,000	99,918	2024/10/11
第29回フランス相互信用連合銀行 (BFCEM) 円貨社債	0.25	300,000	298,806	2024/10/10
第2回B・P・C・E・S・A円貨社債 (ソーシャルボンド)	0.367	100,000	99,766	2024/6/28
第2回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.645	400,000	400,916	2023/7/12
第8回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー非上位円貨社債	0.499	100,000	99,752	2024/12/12

銘柄名	当 期		末	
	利率 (%)	額面金額 (千円)	評 価 額 (千円)	償還年月日
第14回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.45	100,000	99,223	2026/6/17
第15回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債	0.38	100,000	99,948	2024/1/26
第13回クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債	0.343	100,000	99,626	2024/6/7
第1回バンコ・サンタンデル・エセ・アー円貨社債	0.463	400,000	399,172	2024/12/5
第12回ウエストバック・バンキング・コーポレーション円貨社債	0.32	400,000	400,204	2023/7/6
第8回ソシエテ ジェネラル円貨社債	0.28	100,000	99,636	2023/6/2
小 計		30,126,000	30,041,507	
合 計		602,055,476	623,781,716	

<先物取引の銘柄別期末残高>

銘柄別	当 期 末	
	買 建 額 (百万円)	売 建 額 (百万円)
国内 10年国債標準物	599	—

投資信託財産の構成

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 623,781,716	% 99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	3,677,629	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	627,459,345	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 2022年5月30日現在
(A)資 産	627,559,392,248円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,426,453,894
公 社 債(評価額)	623,781,716,178
未 収 利 息	1,232,469,294
前 払 費 用	18,705,882
差 入 委 託 証 拠 金	100,047,000
(B)負 債	2,629,926,841
未 払 金	2,500,958,920
未 払 解 約 金	28,918,799
未 払 利 息	2,122
差入委託証拠金代用有価証券	100,047,000
(C)純 資 産 総 額(A-B)	624,929,465,407
元 本	451,551,932,225
次 期 繰 越 損 益 金	173,377,533,182
(D)受 益 権 総 口 数	451,551,932,225口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,840円

■損益の状況

項 目	当 期 自 2021年6月 1日 至 2022年5月30日
(A)配 当 等 収 益	4,488,808,714円
受 取 利 息	4,489,369,711
支 払 利 息	△560,997
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	△15,524,030,963
売 買 益	70,367,063
売 買 損	△15,594,398,026
(C)先 物 取 引 等 取 引 損 益	△2,391,080
取 引 益	4,305,780
取 引 損	△6,696,860
(D)当 期 損 益 金(A+B+C)	△11,037,613,329
(E)前 期 繰 越 損 益 金	182,160,310,920
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	24,805,234,643
(G)解 約 差 損 益 金	△22,550,399,052
(H) 計 (D+E+F+G)	173,377,533,182
次 期 繰 越 損 益 金(H)	173,377,533,182

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

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

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

〈注記事項〉

※当ファンドの期首元本額は446,205,859,601円、期中追加設定元本額は61,228,635,499円、期中一部解約元本額は55,882,562,875円です。

※担保に供している資産

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

国債証券 100,347,000円

※当ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は次の通りです。

DC日本債券インデックス・オープンS	92,541,310,930円
FOFs用 国内債券インデックス・ファンドP(適格機関投資家専用)	80,859,739,502円
DC日本債券インデックス・オープンP	66,912,531,360円
DCマイセクション50	29,416,463,980円
DCマイセクション25	25,809,895,198円
分散投資コア戦略ファンドS	25,440,115,400円
SMT 国内債券インデックス・オープン	20,733,806,056円
分散投資コア戦略ファンドA	19,869,312,536円
日本債券ファンド・シリーズ1	15,920,823,109円
DCマイセクションS50	14,198,988,240円
DCマイセクションS25	12,760,944,723円
DCマイセクション75	8,599,031,500円
グローバル・バランスファンド・シリーズ1	6,042,755,457円
SBI資産設計オープン(資産成長型)	4,042,619,488円

世界経済インデックスファンド	3,710,871,247円
DC世界経済インデックスファンド	3,341,731,761円
DCマイセクションS75	3,211,693,140円
バランスC(50)VA1(適格機関投資家専用)	3,196,257,589円
バランスA(25)VA1(適格機関投資家専用)	2,939,383,962円
DCターゲット・イヤールファンド2035	2,202,205,181円
バランスF(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,435,781,360円
DC世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	1,356,312,332円
バランスE(25)VA1(適格機関投資家専用)	1,149,756,134円
バランスD(35)VA1(適格機関投資家専用)	1,003,105,420円
DCターゲット・イヤールファンド2045	821,333,270円
DCターゲット・イヤールファンド2025	795,519,625円
バランスB(37.5)VA1(適格機関投資家専用)	763,422,315円
DC日本債券インデックス・オープン ファンドラップ運用戦略F(中庸型)(適格機関投資家専用)	440,199,184円 418,803,647円
グローバル経済コア	229,985,351円
DC世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	160,194,027円
国内バランス25VA1(適格機関投資家専用)	139,022,548円
バランス50VA1(適格機関投資家専用)	128,536,453円
SMT 世界経済インデックス・オープン(債券シフト型)	114,549,770円
バランス30VA1(適格機関投資家専用)	92,634,852円
世界バランスVA1(適格機関投資家専用)	88,838,138円
FOFs用 世界成長戦略ファンド(適格機関投資家専用)	85,353,934円
世界バランスVA2(適格機関投資家専用)	76,010,188円
SMT 世界経済インデックス・オープン(株式シフト型)	71,893,746円
世界経済インデックスファンド(株式シフト型)	66,236,571円
SMT インデックスバランス・オープン	61,223,294円
世界経済インデックスファンド(債券シフト型)	37,666,819円
SMT 世界経済インデックス・オープン	36,559,382円
バランス25VA2(適格機関投資家専用)	33,130,779円
SBI資産設計オープン(つみたてNISA対応型)	30,283,266円
マイセクション50VA1(適格機関投資家専用)	28,573,508円
バランス50VA2(適格機関投資家専用)	27,610,659円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2030	19,753,874円
DCターゲット・イヤールファンド2055	19,614,917円
SBI資産設計オープン(分配型)	15,462,539円
私募世界経済パッシブファンド(適格機関投資家専用)	12,384,315円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2040	11,059,138円
SMT 8資産インデックスバランス・オープン	10,712,858円
マイセクション75VA1(適格機関投資家専用)	9,959,214円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2050	2,855,640円
エマージング株式オープン	2,227,240円
DCターゲット・イヤールファンド(6資産・運用継続型)2060	2,115,332円
国内バランス60VA1(適格機関投資家専用)	1,435,383円
国内バランス60VA2(適格機関投資家専用)	972,063円
My SMT 国内債券インデックス(ノーロード)	362,781円

お知らせ

該当事項はありません。