

東京海上・円資産バランスファンド

(毎月決算型)

<愛称 円奏会>

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／資産複合 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2012年11月9日から2032年7月23日	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。	
主要投資対象	東京海上・円資産 バランスファンド (毎月決算型)	「東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド」、「東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド」、「TMA日本REITマザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上・円建て 投資適格債券 マザーファンド	わが国の法人が発行する円建ての社債(金融機関劣後債、生保基金債等を含みます。)を主要投資対象とします。
	東京海上・高配当 低ボラティリティ 日本株マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	TMA日本REIT マザーファンド	わが国の不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上・円資産 バランスファンド (毎月決算型)	<ul style="list-style-type: none"> 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	東京海上・円建て 投資適格債券 マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
	東京海上・高配当 低ボラティリティ 日本株マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資割合には、制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	TMA日本REIT マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 株式への直接投資は行いません。 外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	第1回目から第5回目の決算時には、分配を行いません。第6回目以降の毎決算時に、原則として、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水増し、市況動向等を勘案して分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。収益の分配に充当せず、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。	

運用報告書 (全体版)

第136期 (決算日 2024年2月26日)
 第137期 (決算日 2024年3月25日)
 第138期 (決算日 2024年4月23日)
 第139期 (決算日 2024年5月23日)
 第140期 (決算日 2024年6月24日)
 第141期 (決算日 2024年7月23日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
 さて、「東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型) <愛称 円奏会>」は、このたび、第141期の決算を行いましたので、第136期～第141期の運用状況をまとめてご報告申し上げます。今後とも一層のお引き立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額			株 組 入 比 率	債 組 入 比 率	投 資 信 託 券 組 入 比 率	純 資 産 額
		税 分	込 配	み 期 金 騰 落 中 率				
	円		円	%	%	%	%	百万円
112期(2022年2月24日)	9,940		30	△1.1	11.7	70.1	11.4	544,600
113期(2022年3月23日)	9,978		30	0.7	10.9	68.5	11.4	540,176
114期(2022年4月25日)	9,919		30	△0.3	9.2	69.7	9.3	530,588
115期(2022年5月23日)	9,908		30	0.2	11.6	69.6	11.9	525,770
116期(2022年6月23日)	9,764		30	△1.2	7.2	69.8	8.4	512,567
117期(2022年7月25日)	9,837		30	1.1	9.0	69.3	9.0	510,304
118期(2022年8月23日)	9,806		30	△0.0	11.0	69.3	11.4	503,933
119期(2022年9月26日)	9,644		30	△1.3	11.7	69.7	11.8	490,314
120期(2022年10月24日)	9,491		30	△1.3	6.9	69.7	6.7	476,223
121期(2022年11月24日)	9,583		30	1.3	7.2	69.2	6.9	473,682
122期(2022年12月23日)	9,381		30	△1.8	7.0	69.3	6.8	457,538
123期(2023年1月23日)	9,335		20	△0.3	4.8	69.7	5.2	447,506
124期(2023年2月24日)	9,272		20	△0.5	5.8	69.4	5.9	430,211
125期(2023年3月23日)	9,353		20	1.1	3.9	69.1	4.1	425,463
126期(2023年4月24日)	9,321		20	△0.1	4.4	69.2	4.3	417,788
127期(2023年5月23日)	9,399		20	1.1	9.7	69.6	9.5	415,089
128期(2023年6月23日)	9,402		20	0.2	14.4	69.4	13.2	408,553
129期(2023年7月24日)	9,377		20	△0.1	14.6	69.1	14.2	401,663
130期(2023年8月23日)	9,248		20	△1.2	14.3	68.8	14.0	390,206
131期(2023年9月25日)	9,266		20	0.4	15.0	69.2	13.9	384,113
132期(2023年10月23日)	9,061		20	△2.0	12.1	69.7	12.0	369,123
133期(2023年11月24日)	9,149		20	1.2	9.6	69.3	10.0	361,830
134期(2023年12月25日)	9,161		20	0.3	9.6	69.2	9.7	350,949
135期(2024年1月23日)	9,240		20	1.1	10.1	68.9	9.9	347,246
136期(2024年2月26日)	9,157		20	△0.7	10.8	69.7	10.2	335,517
137期(2024年3月25日)	9,212		20	0.8	11.6	68.4	12.1	329,086
138期(2024年4月23日)	9,093		20	△1.1	9.9	69.1	9.8	318,540
139期(2024年5月23日)	8,975		20	△1.1	9.7	69.4	9.9	308,590
140期(2024年6月24日)	8,959		20	0.0	9.8	69.5	9.8	299,670
141期(2024年7月23日)	8,931		20	△0.1	10.3	68.9	9.7	289,800

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 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」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		株 組 入 比 率	債 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率	騰 落 率			
第136期	(期 首) 2024年 1月23日	円 9,240	% -	% 10.1	% 68.9	% 9.9	
	1月末	9,177	△0.7	10.3	69.1	9.8	
	(期 末) 2024年 2月26日	9,177	△0.7	10.8	69.7	10.2	
第137期	(期 首) 2024年 2月26日	9,157	-	10.8	69.7	10.2	
	2月末	9,137	△0.2	12.3	69.5	10.9	
	(期 末) 2024年 3月25日	9,232	0.8	11.6	68.4	12.1	
第138期	(期 首) 2024年 3月25日	9,212	-	11.6	68.4	12.1	
	3月末	9,209	△0.0	9.8	68.6	10.7	
	(期 末) 2024年 4月23日	9,113	△1.1	9.9	69.1	9.8	
第139期	(期 首) 2024年 4月23日	9,093	-	9.9	69.1	9.8	
	4月末	9,109	0.2	9.7	69.1	10.0	
	(期 末) 2024年 5月23日	8,995	△1.1	9.7	69.4	9.9	
第140期	(期 首) 2024年 5月23日	8,975	-	9.7	69.4	9.9	
	5月末	8,944	△0.3	9.9	69.3	9.9	
	(期 末) 2024年 6月24日	8,979	0.0	9.8	69.5	9.8	
第141期	(期 首) 2024年 6月24日	8,959	-	9.8	69.5	9.8	
	6月末	8,938	△0.2	10.0	69.3	9.8	
	(期 末) 2024年 7月23日	8,951	△0.1	10.3	68.9	9.7	

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

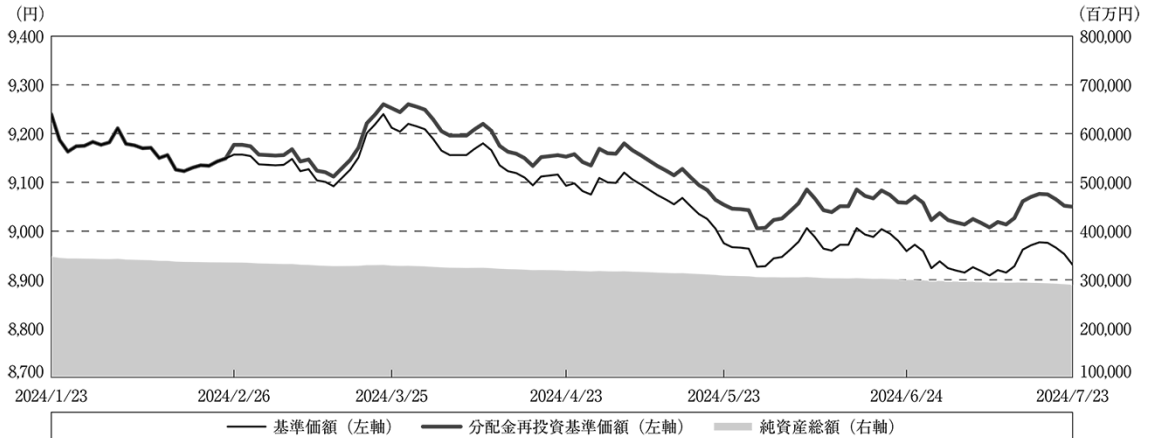
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

○運用経過

(2024年1月24日～2024年7月23日)

■作成期間中の基準価額等の推移



(注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)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はありません。

(注) 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、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首(2024年1月23日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

【日本債券】

- ・社債の信用スプレッド(国債に対する上乘せ利回り)が縮小したこと

【日本株式】

- ・米国における利下げ期待の高まり
- ・国内外投資家から日本株が再評価されたこと

【日本REIT】

- ・J-REIT各社による自己投資口買いなどの増加による投資主還元姿勢の向上

マイナス要因

【日本債券】

- ・日銀の金融政策変更を背景とした国内金利の上昇

【日本株式】

- ・中東地域での地政学的リスクの高まり
- ・自動車セクターの業況判断の悪化

【日本REIT】

- ・一部J-REITの公募増資実施やグローバル株式インデックス構成銘柄からの除外等による需給環境の悪化

■投資環境

【日本債券市場】

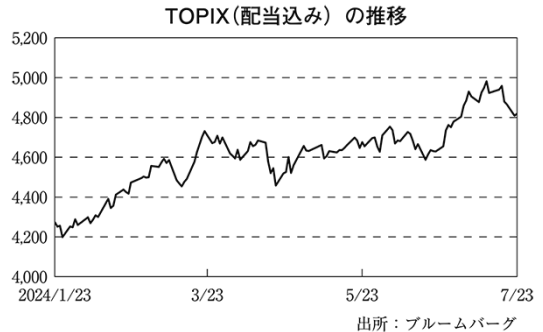
作成期初、0.6%台半ばであった10年国債利回りは、2024年3月の日銀金融政策決定会合でYCC（イールドカーブ・コントロール）政策の撤廃およびマイナス金利の解除などが決定されたことを受けて、5月下旬には1.0%を上回る水準まで上昇しました。その後は、国債買入オペの減額や利上げの前倒しなど金融政策に対する不透明感から、0.9%～1.1%程度の間で適正な金利水準を探る展開が継続し、10年国債利回りは1.0%台で当作成期を終えました。

社債の信用スプレッドは、本邦企業のファンダメンタルズ（経済の基礎的条件）が良好であったことなどから堅調な需給環境が継続するなか、縮小しました。



【日本株式市場】

作成期初から2024年3月までは、需給面での良好な環境から日本株式市場に国内外の投資家の注目が集まったほか、米国大手半導体企業の好調な決算を受けて半導体関連企業を買われたことや、米国経済の先行きに対する楽観的な見方が広がったことなどから、日本株式市場は堅調に推移しました。4月に入り、日銀短観で自動車セクターの業況判断が悪化したことや、中東情勢に対する地政学的リスクの高まりなどが嫌気され、日本株式市場は一進一退の展開となりました。6月半ば以降は、配当金再投資による日本株の買い需要期待や、円安を背景とした外需企業の増益期待などを受けて日本株式市場は上昇しました。



【日本REIT市場】

作成期初から2024年3月上旬にかけては、欧米で商業用不動産への投資家心理が悪化するなか、国内のインフレ圧力の高まりを受けて日銀の金融政策変更への観測が強まり日本REIT市場は下落しました。その後、3月の日銀金融政策決定会合でマイナス金利の解除が決定されたことを受けて、長期金利上昇に対する過度な警戒感が払拭されて反発上昇したものの、投資家の様子見姿勢が続き、日本REIT市場は上値の重い展開となりました。作成期末にかけては、日銀による国債買入額の減額や早期利上げが警戒されるなか、長期金利の上昇のほか、一部J-REITによる公募増資の実施や主要なグローバル株式インデックス構成銘柄からの除外などから、日本REIT市場は下落しました。



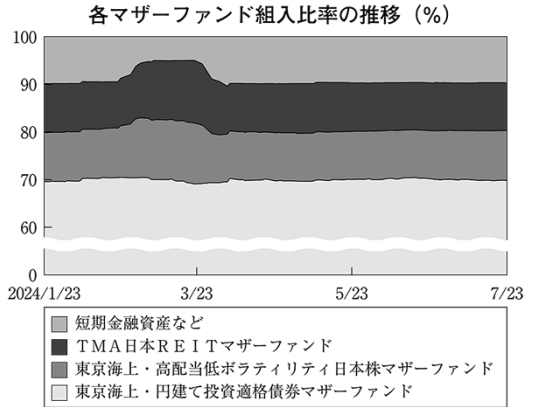
■ポートフォリオについて

<東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)>

マザーファンドへの投資を通じて、日本債券70%、日本株式15%、日本REIT15%の資産配分比率を基本としますが、基準価額の変動リスクが大きくなった場合は、日本株式と日本REITの資産配分比率を引き下げて運用を行います。

当作成期は、日本REIT市場の急反発を受けてリスク資産(日本株式と日本REITの合計)の配分比率を抑制する場面がありましたが、全般的には市場環境が比較的落ち着いたことから、基準価額の変動リスクは大きく高まらず、日本株式と日本REITの資産配分比率はそれぞれ10%程度となりました。

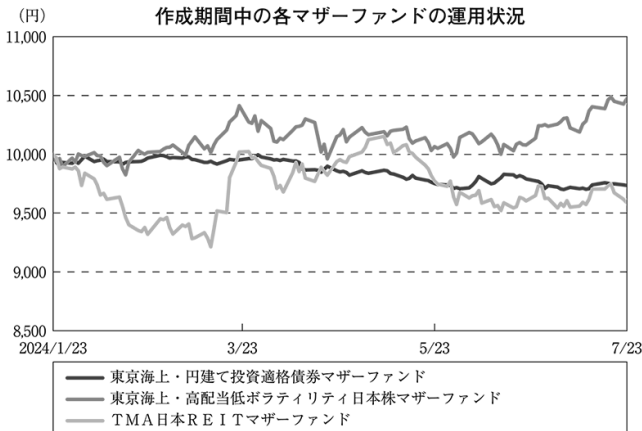
以上の運用の結果、当ファンドの基準価額(税引前分配金再投資)は、2.1%下落しました。



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

各資産の運用は、「東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド」「東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド」「TMA日本REITマザーファンド」にて行っています。

各マザーファンドにおける当作成期の運用経過は以下の通りです。



※各マザーファンドは2024年1月23日を10,000円として指数化したものです。

期間中の騰落率 (%)

東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	△2.6
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	4.7
TMA日本REITマザーファンド	△4.1

<東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド>

ポートフォリオの利回りの向上を目指し、金融政策の動向を注視しながら、社債(金融機関劣後債、生保基金債等を含む)を中心とした運用を行いました。銘柄選択にあたっては、個別企業の信用リスクが変動した際の影響を可能な限り回避するよう銘柄分散を図るとともに、信用力に応じた残存年限を選択しました。なお、作成期末におけるポートフォリオの平均残存期間は10年程度、平均格付は「AA-」となりました。

以上の運用の結果、基準となる国債利回りが上昇したことから、基準価額は2.6%下落しました。

<東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド>

ポートフォリオ全体の配当利回りを高めつつ、価格変動リスクがTOPIX(配当込み)に比べて低くなるようなポートフォリオを構築しました。

以上の運用の結果、基準価額は4.7%上昇しましたが、当マザーファンドで多く保有する内需ディフェンシブ銘柄のパフォーマンスが相対的に劣化したことや、株価が大きく上昇した保険セクター銘柄の保有割合が相対的に低かったことがマイナスに影響したため、参考指数であるTOPIX(配当込み)の騰落率を下回りました。なお、価格変動リスクはTOPIX(配当込み)と比較して低い水準を維持しました。

<TMA日本REITマザーファンド>

市場流動性(流動性基準)とスポンサー企業の信用力や財務健全性(信用リスク基準)に基づいて絞り込んだ日本REITの銘柄を対象として、時価加重比率と売買金額加重比率を合成したポートフォリオを構築し、組入比率を高位に維持して運用を行いました。

以上の運用の結果、日本REIT市場の弱含む相場展開を受けて基準価額は4.1%下落し、参考指数である東証REIT指数(配当込み)を小幅に下回りました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

■分配金

当ファンドの収益分配方針に基づき、基準価額の水準や市況動向などを勘案して、次表の通りとしました。なお、収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位:円、1万口当たり、税込み)

項 目	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
	2024年1月24日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月23日	2024年4月24日～ 2024年5月23日	2024年5月24日～ 2024年6月24日	2024年6月25日～ 2024年7月23日
当期分配金 (対基準価額比率)	20 0.218%	20 0.217%	20 0.219%	20 0.222%	20 0.223%	20 0.223%
当期の収益	—	10	5	0	2	2
当期の収益以外	20	10	15	19	17	17
翌期繰越分配対象額	716	707	698	679	662	644

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

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下四捨五入して算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

○今後の運用方針

〈東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)〉

マザーファンドへの投資を通じて、日本債券70%、日本株式15%、日本REIT15%の資産配分比率を基本とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

今後も基準価額変動リスクの変化に合わせて日本株式と日本REITの資産配分比率をコントロールする方針です。

各マザーファンドにおける今後の運用方針は以下の通りです。

〈東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド〉

引き続き個別企業の信用力分析を重視し、相対的に信用力が高いと考える銘柄でポートフォリオを構築します。また、残存期間と銘柄の分散ならびに流動性の確保に留意しながら、安定運用を行う方針です。

〈東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド〉

今後も日本の株式を主要投資対象とし、流動性や信用リスクなどを勘案して選定した銘柄に投資します。ポートフォリオ全体の配当利回りを高める戦略と価格変動リスクを低く抑える戦略を組み合わせることで、ポートフォリオ全体の価格変動リスクをTOPIX(配当込み)の価格変動リスクより低く抑えながら、中長期的にTOPIX(配当込み)と同程度のリターンを目指します。

〈TMA日本REITマザーファンド〉

今後も日本REITの市場流動性とスポンサー企業の信用力や財務健全性に基づいて絞り込んだ銘柄を対象として、時価加重比率と売買金額加重比率を合成したポートフォリオを構築し、中長期的に日本REIT市場全体の動きをおおむね捉える運用を機動的に行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2024年 1月24日～2024年 7月23日)

項 目	第136期～第141期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	42	0.459	(a)信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(20)	(0.224)	*委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
(販 売 会 社)	(20)	(0.224)	*購入後の情報提供、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および事務手続き等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.011)	*運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.005	(b)売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数
(株 式)	(0)	(0.000)	*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
(投 資 信 託 証 券)	(0)	(0.005)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.000	(c)その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.000)	*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
合 計	42	0.464	
作成期間の平均基準価額は、9,085円です。			

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

(注) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

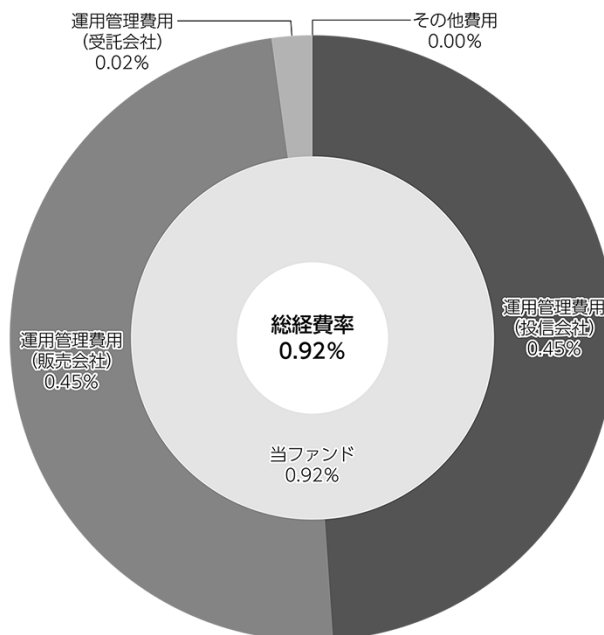
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を作成期間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

作成期間の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.92%です。



(注) 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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(注) 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。

○売買及び取引の状況

(2024年1月24日～2024年7月23日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第136期～第141期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	5,453,227	6,384,851	34,116,249	39,721,756
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	2,089,297	7,187,902	4,072,258	14,285,904
TMA日本REITマザーファンド	3,374,003	9,533,107	5,190,109	15,321,120

○株式売買比率

(2024年1月24日～2024年7月23日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第136期～第141期	
	東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	
(a) 当作成期中の株式売買金額	38,093,803千円	
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	48,586,211千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.78	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2024年1月24日～2024年7月23日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2024年7月23日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第135期末	第141期末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	204,744,423	176,081,402	202,476,004
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	10,431,636	8,448,674	30,356,088
TMA日本REITマザーファンド	11,881,407	10,065,301	28,996,121

○投資信託財産の構成

(2024年7月23日現在)

項 目	第141期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	202,476,004	69.3
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	30,356,088	10.4
TMA日本REITマザーファンド	28,996,121	9.9
コール・ローン等、その他	30,425,804	10.4
投資信託財産総額	292,254,017	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第136期末	第137期末	第138期末	第139期末	第140期末	第141期末
	2024年2月26日現在	2024年3月25日現在	2024年4月23日現在	2024年5月23日現在	2024年6月24日現在	2024年7月23日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	337,798,523,116	331,408,773,914	320,486,593,223	310,709,796,889	301,723,137,437	292,254,017,317
コール・ローン等	26,610,175,701	16,357,983,790	31,540,942,254	30,009,284,574	29,035,944,387	28,208,702,727
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド(評価額)	236,246,946,481	227,748,780,228	222,307,324,305	216,183,196,745	210,282,548,597	202,476,004,439
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド(評価額)	37,958,010,292	40,638,118,318	32,091,140,856	31,099,924,277	30,377,918,813	30,356,088,405
TMA日本REITマザーファンド(評価額)	34,907,902,347	42,427,237,082	32,792,252,334	31,502,618,454	30,171,352,336	28,996,121,485
未収入金	2,075,488,295	4,236,625,509	1,754,875,906	1,914,717,746	1,855,319,274	2,217,047,051
未収利息	—	28,987	57,568	55,093	54,030	53,210
(B) 負債	2,280,549,704	2,321,978,613	1,946,405,842	2,118,948,159	2,052,679,549	2,453,640,556
未払収益分配金	732,845,252	714,440,543	700,601,653	687,640,572	668,994,731	648,967,981
未払解約金	1,255,757,764	1,373,466,711	1,007,919,824	1,191,518,916	1,136,988,258	1,587,780,727
未払信託報酬	291,881,413	234,020,875	237,832,078	239,734,581	246,638,864	216,839,561
未払利息	3,973	—	—	—	—	—
その他未払費用	61,302	50,484	52,287	54,090	57,696	52,287
(C) 純資産総額(A-B)	335,517,973,412	329,086,795,301	318,540,187,381	308,590,848,730	299,670,457,888	289,800,376,761
元本	366,422,626,273	357,220,271,720	350,300,826,814	343,820,286,219	334,497,365,872	324,483,990,739
次期繰越損益金	△ 30,904,652,861	△ 28,133,476,419	△ 31,760,639,433	△ 35,229,437,489	△ 34,826,907,984	△ 34,683,613,978
(D) 受益権総口数	366,422,626,273口	357,220,271,720口	350,300,826,814口	343,820,286,219口	334,497,365,872口	324,483,990,739口
1万円当たり基準価額(C/D)	9,157円	9,212円	9,093円	8,975円	8,959円	8,931円

(注) 当ファンドの第136期首元本額は375,807,723,007円、第136～141期中追加設定元本額は2,830,645,744円、第136～141期中一部解約元本額は54,154,378,012円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

項 目	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
	2024年1月24日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月23日	2024年4月24日～ 2024年5月23日	2024年5月24日～ 2024年6月24日	2024年6月25日～ 2024年7月23日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 205,661	55,005	1,498,024	1,780,973	1,838,111	1,568,002
受取利息	9,088	136,886	1,498,024	1,780,973	1,838,111	1,568,002
支払利息	△ 214,749	△ 81,881	—	—	—	—
(B) 有価証券売買損益	△ 2,030,461,936	2,943,654,042	△ 3,234,109,947	△ 3,130,601,746	361,240,878	△ 34,507,058
売買益	344,359,658	3,600,340,969	41,941,258	17,531,080	923,789,986	1,011,751,052
売買損	△ 2,374,821,594	△ 656,686,927	△ 3,276,051,205	△ 3,148,132,826	△ 562,549,108	△ 1,046,258,110
(C) 信託報酬等	△ 291,942,715	△ 234,071,359	△ 237,884,365	△ 239,788,671	△ 246,696,560	△ 216,891,848
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	△ 2,322,610,312	2,709,637,688	△ 3,470,496,288	△ 3,368,609,444	116,382,429	△ 249,830,904
(E) 前期繰越損益金	△39,428,229,746	△40,690,387,279	△37,543,278,267	△40,369,683,385	△42,659,763,218	△41,372,570,264
(F) 追加信託差損益金	11,579,032,449	10,561,713,715	9,953,736,775	9,196,495,912	8,385,467,536	7,587,755,171
(配当等相当額)	(26,009,346,440)	(24,678,645,977)	(23,851,918,912)	(22,897,087,043)	(21,775,999,437)	(20,638,796,530)
(売買損益相当額)	(△14,430,313,991)	(△14,116,932,262)	(△13,898,182,137)	(△13,700,591,131)	(△13,390,531,901)	(△13,051,041,359)
(G) 計(D+E+F)	△30,171,807,609	△27,419,035,876	△31,060,037,780	△34,541,796,917	△34,157,913,253	△34,034,645,997
(H) 収益分配金	△ 732,845,252	△ 714,440,543	△ 700,601,653	△ 687,640,572	△ 668,994,731	△ 648,967,981
次期繰越損益金(G+H)	△30,904,652,861	△28,133,476,419	△31,760,639,433	△35,229,437,489	△34,826,907,984	△34,683,613,978
追加信託差損益金	10,882,829,459	10,204,493,443	9,428,285,535	8,680,765,483	7,883,721,487	7,101,029,185
(配当等相当額)	(25,313,304,905)	(24,321,751,934)	(23,327,021,051)	(22,381,544,048)	(21,274,437,122)	(20,152,309,370)
(売買損益相当額)	(△14,430,475,446)	(△14,117,258,491)	(△13,898,735,516)	(△13,700,778,565)	(△13,390,715,635)	(△13,051,280,185)
分配準備積立金	932,740,736	946,504,453	1,157,867,556	992,600,043	878,457,760	773,206,012
繰越損益金	△42,720,223,056	△39,284,474,315	△42,346,792,524	△44,902,803,015	△43,589,087,231	△42,557,849,175

(注) (B) 有価証券売買損益は、各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (F) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
	2024年1月24日～ 2024年2月26日	2024年2月27日～ 2024年3月25日	2024年3月26日～ 2024年4月23日	2024年4月24日～ 2024年5月23日	2024年5月24日～ 2024年6月24日	2024年6月25日～ 2024年7月23日
a. 配当等収益(費用控除後)	0円	395,472,309円	406,133,210円	29,672,443円	81,372,869円	84,510,997円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	26,009,507,895円	24,678,972,206円	23,852,472,291円	22,897,274,477円	21,776,183,171円	20,639,035,356円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	969,382,998円	908,252,415円	926,884,759円	1,134,837,743円	964,333,573円	850,937,010円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	26,978,890,893円	25,982,696,930円	25,185,490,260円	24,061,784,663円	22,821,889,613円	21,574,483,363円
f. 分配対象収益(1万円当たり)	736円	727円	718円	699円	682円	664円
g. 分配金	732,845,252円	714,440,543円	700,601,653円	687,640,572円	668,994,731円	648,967,981円
h. 分配金(1万円当たり)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

○分配金のお知らせ

	第136期	第137期	第138期	第139期	第140期	第141期
1万口当たり分配金(税込み)	20円	20円	20円	20円	20円	20円

(注) 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、分配金は全額普通分配金となります。

(注) 分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

(注) 分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合は、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

(注) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2024年7月23日現在)

<東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド>

下記は、東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド全体(273,967,110千円)の内容です。

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第141期末							
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB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	16,800,000 (1,000,000)	16,009,451 (1,126,314)	5.1 (0.4)	— (—)	5.1 (0.4)	— (—)	— (—)	
地方債証券	60,677,500 (60,677,500)	54,465,929 (54,465,929)	17.3 (17.3)	— (—)	17.0 (17.0)	0.3 (0.3)	— (—)	
特殊債券 (除く金融債)	11,600,000 (11,600,000)	10,630,868 (10,630,868)	3.4 (3.4)	— (—)	3.4 (3.4)	— (—)	— (—)	
普通社債券 (含む投資法人債券)	242,176,000 (242,176,000)	229,585,818 (229,585,818)	72.9 (72.9)	— (—)	50.2 (50.2)	20.9 (20.9)	1.8 (1.8)	
合 計	331,253,500 (315,453,500)	310,692,067 (295,808,930)	98.6 (93.9)	— (—)	75.6 (70.9)	21.1 (21.1)	1.8 (1.8)	

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	第141期末				銘 柄	第141期末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		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					国債証券				
第25回利付国債 (30年)	2.3	100,000	111,159	2036/12/20	第163回利付国債 (20年)	0.6	300,000	270,462	2037/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	100,000	112,319	2037/3/20	第164回利付国債 (20年)	0.5	200,000	176,932	2038/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	200,000	226,712	2037/9/20	第165回利付国債 (20年)	0.5	200,000	175,974	2038/6/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	300,000	339,579	2038/3/20	第166回利付国債 (20年)	0.7	200,000	180,156	2038/9/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	100,000	111,684	2038/9/20	第167回利付国債 (20年)	0.5	500,000	435,345	2038/12/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	400,000	440,560	2039/3/20	第168回利付国債 (20年)	0.4	400,000	341,192	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	500,000	542,890	2039/9/20	第169回利付国債 (20年)	0.3	400,000	333,992	2039/6/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	500,000	548,275	2040/3/20	第170回利付国債 (20年)	0.3	700,000	581,175	2039/9/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	500,000	525,675	2040/9/20	第171回利付国債 (20年)	0.3	700,000	577,871	2039/12/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	500,000	538,035	2041/3/20	第172回利付国債 (20年)	0.4	700,000	584,234	2040/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	500,000	521,655	2041/9/20	第173回利付国債 (20年)	0.4	700,000	580,965	2040/6/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	500,000	520,015	2042/3/20	第180回利付国債 (20年)	0.8	700,000	600,985	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	500,000	510,685	2042/9/20	第181回利付国債 (20年)	0.9	700,000	609,322	2042/6/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	500,000	500,345	2043/3/20	第182回利付国債 (20年)	1.1	700,000	628,208	2042/9/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	500,000	507,050	2043/6/20	第183回利付国債 (20年)	1.4	700,000	658,553	2042/12/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	200,000	183,570	2036/12/20	第184回利付国債 (20年)	1.1	700,000	623,294	2043/3/20

銘柄	第141期末				償還年月日	銘柄	第141期末				償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円			利率	額面金額	評価額	千円	
国債証券	%	千円	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円		
第185回利付国債 (20年)	1.1	700,000	620,802	2043/6/20		第17回千葉県公募債 (20年)	1.403	300,000	306,111	2034/10/13	
第186回利付国債 (20年)	1.5	700,000	663,467	2043/9/20		第24回千葉県公募債 (20年)	0.559	200,000	176,256	2038/4/15	
第27回利付国債 (物価連動・10年)	0.005	1,000,000	1,126,314	2032/3/10		第27回千葉県公募債 (20年)	0.251	800,000	650,344	2039/10/14	
小計		16,800,000	16,009,451			第33回千葉県公募債 (20年)	1.545	300,000	282,474	2043/10/15	
地方債証券						第34回千葉県公募債 (20年)	1.59	700,000	664,013	2044/4/15	
第6回東京都公募債 (30年)	2.58	100,000	113,183	2037/9/18		平成30年度第1回新潟県公募債	0.653	400,000	354,828	2038/8/20	
第7回東京都公募債 (30年)	2.51	100,000	111,801	2038/9/17		令和元年度第1回新潟県公募債	0.2	800,000	647,464	2039/8/19	
第35回東京都公募債 (20年)	0.525	700,000	611,583	2038/6/18		令和2年度第1回新潟県公募債	0.435	800,000	657,744	2040/8/17	
第37回東京都公募債 (20年)	0.444	800,000	660,936	2040/6/20		第5回群馬県公募債 (20年)	1.529	200,000	207,390	2034/6/16	
平成30年度第9回北海道公募債 (20年)	0.654	500,000	442,770	2038/9/24		第6回群馬県公募債 (20年)	1.267	300,000	300,330	2035/6/11	
令和元年度第4回北海道公募債 (20年)	0.323	700,000	579,768	2039/6/24		第10回群馬県公募債 (20年)	0.338	500,000	415,335	2039/6/17	
令和元年度第9回北海道公募債 (20年)	0.2	200,000	161,488	2039/9/22		第11回群馬県公募債 (20年)	0.416	400,000	329,164	2040/6/12	
第37回神奈川県公募債 (20年)	0.53	200,000	174,952	2038/6/18		第14回群馬県公募債 (20年)	1.101	500,000	437,435	2043/6/19	
第40回神奈川県公募債 (20年)	0.2	800,000	649,920	2039/6/20		第15回群馬県公募債 (20年)	1.846	400,000	395,448	2044/6/20	
第42回神奈川県公募債 (20年)	0.34	500,000	413,055	2039/9/20		平成30年度第2回島根県公募債	0.668	400,000	354,908	2038/9/17	
第52回神奈川県公募債 (20年)	1.163	600,000	530,742	2043/6/19		令和元年度第2回島根県公募債	0.2	400,000	323,000	2039/9/20	
第53回神奈川県公募債 (20年)	1.921	800,000	801,264	2044/6/20		令和2年度第2回島根県公募債	0.459	800,000	658,664	2040/9/21	
第17回大阪府公募債 (20年)	0.668	400,000	354,836	2038/9/27		令和5年度第1回島根県公募債	1.419	300,000	276,633	2043/9/18	
第24回大阪府公募債 (20年)	1.41	300,000	276,258	2043/9/18		令和5年度第3回奈良県公募債	1.395	300,000	276,435	2043/6/19	
平成26年度第5回京都府公募債 (20年)	1.455	600,000	615,966	2034/8/10		第18回大阪府公募債 (20年)	1.262	700,000	702,443	2035/2/27	
平成30年度第5回京都府公募債 (20年)	0.658	600,000	532,656	2038/8/13		第19回大阪府公募債 (20年)	1.138	600,000	593,628	2035/4/24	
令和元年度第5回京都府公募債 (20年)	0.2	400,000	323,732	2039/8/19		第1回名古屋市公募債 (30年)	2.53	200,000	225,796	2035/3/20	
令和5年度第4回京都府公募債 (20年)	1.339	300,000	273,207	2043/8/14		第3回名古屋市公募債 (30年)	2.5	100,000	112,168	2037/9/18	
第22回兵庫県公募債 (20年)	1.4	300,000	306,264	2034/9/8		第6回名古屋市公募債 (30年)	2.45	100,000	110,462	2039/12/20	
第37回兵庫県公募債 (20年)	0.472	200,000	170,896	2039/2/18		第21回名古屋市公募債 (20年)	0.568	500,000	440,330	2038/5/18	
第45回兵庫県公募債 (20年)	1.101	800,000	699,896	2043/6/19		第22回名古屋市公募債 (20年)	0.431	700,000	590,961	2039/5/22	
第46回兵庫県公募債 (20年)	1.846	300,000	296,160	2044/6/20		第27回名古屋市公募債 (20年)	1.116	500,000	439,245	2043/5/22	
第2回静岡県公募債 (30年)	2.54	300,000	336,453	2038/9/17		第29回名古屋市公募債 (20年)	1.719	600,000	581,394	2044/5/20	
第18回静岡県公募債 (20年)	1.473	400,000	412,496	2034/7/10		第17回京都市公募債 (20年)	0.683	700,000	620,004	2038/11/26	
第19回静岡県公募債 (20年)	1.253	300,000	299,487	2035/7/27		第18回京都市公募債 (20年)	0.355	400,000	329,988	2039/11/18	
第28回静岡県公募債 (20年)	0.31	700,000	575,428	2039/9/20		平成30年度第6回神戸市公募債 (20年)	0.668	300,000	266,181	2038/9/17	
第35回静岡県公募債 (20年)	1.163	300,000	265,371	2043/6/19		令和元年度第6回神戸市公募債 (20年)	0.2	400,000	323,000	2039/9/20	
平成27年度第3回愛知県公募債 (20年)	1.115	400,000	394,668	2035/5/8		第30回横浜市公募債 (20年)	1.376	550,000	559,608	2034/10/20	
令和元年度第5回愛知県公募債 (20年)	0.288	400,000	329,072	2039/7/12		第31回横浜市公募債 (20年)	1.18	300,000	298,011	2035/4/16	
令和5年度第4回愛知県公募債 (20年)	1.101	600,000	524,976	2043/6/12		第40回横浜市公募債 (20年)	0.559	500,000	440,630	2038/4/16	
令和6年度第4回愛知県公募債 (20年)	1.846	500,000	494,665	2044/6/14		第48回横浜市公募債 (20年)	1.097	700,000	612,661	2043/5/26	
平成27年度第1回広島県公募債 (20年)	1.212	200,000	198,366	2035/9/25		第49回横浜市公募債 (20年)	1.719	300,000	290,697	2044/5/20	
平成31年度第1回広島県公募債 (20年)	0.419	400,000	337,792	2039/4/19		平成30年度第8回札幌市公募債 (20年)	0.626	300,000	263,295	2038/12/20	
令和元年度第2回広島県公募債 (20年)	0.2	300,000	242,250	2039/9/20		令和2年度第5回札幌市公募債 (20年)	0.445	700,000	574,413	2040/10/12	
令和2年度第1回広島県公募債 (20年)	0.315	800,000	649,552	2040/4/17		令和5年度第2回札幌市公募債 (20年)	1.11	200,000	175,220	2043/6/19	
令和5年度第1回広島県公募債 (20年)	1.41	400,000	368,344	2043/9/18		令和6年度第1回札幌市公募債 (20年)	1.568	800,000	756,360	2044/4/15	
第15回埼玉県公募債 (20年)	1.166	400,000	397,608	2035/2/16		第20回川崎市公募債 (20年)	1.133	200,000	197,992	2035/3/20	
第22回埼玉県公募債 (20年)	0.568	600,000	528,360	2038/5/21		第27回川崎市公募債 (20年)	0.559	300,000	264,378	2038/4/16	
第23回埼玉県公募債 (20年)	0.626	300,000	263,310	2038/12/17		第30回川崎市公募債 (20年)	0.2	600,000	487,440	2039/6/20	
第24回埼玉県公募債 (20年)	0.431	100,000	84,479	2039/5/17		第33回川崎市公募債 (20年)	0.44	600,000	495,402	2040/6/20	
第25回埼玉県公募債 (20年)	0.32	450,000	368,320	2039/12/20		第42回川崎市公募債 (20年)	1.719	400,000	387,596	2044/5/20	
平成26年度第4回福岡県公募債 (20年)	1.249	200,000	200,452	2035/2/23		第17回北九州市公募債 (20年)	1.529	300,000	311,103	2034/6/20	
令和元年度第1回福岡県公募債 (20年)	0.359	600,000	495,168	2039/11/25		第18回北九州市公募債 (20年)	1.376	200,000	203,494	2034/10/20	
令和5年度第1回福岡県公募債 (20年)	1.093	600,000	524,790	2043/5/29		第19回北九州市公募債 (20年)	1.312	600,000	603,246	2035/6/19	
令和5年度第2回福岡県公募債 (20年)	1.168	300,000	265,257	2043/7/27		平成26年度第2回福岡市公募債 (20年)	1.49	400,000	413,224	2034/6/20	
令和6年度第1回福岡県公募債 (20年)	1.772	600,000	585,942	2044/6/17		平成26年度第6回福岡市公募債 (20年)	1.371	200,000	203,568	2034/9/20	

銘柄	第141期末				償還年月日	銘柄	第141期末				償還年月日
	利率	額面金額	評価額	千円			利率	額面金額	評価額	千円	
地方債証券	%	千円	千円			特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
平成31年度第3回福岡市公募債(20年)	0.419	600,000	506,652	2039/4/22		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	500,000	500,300	2035/3/30	
2019年度第5回福岡市公募債(20年)	0.286	300,000	246,456	2039/7/29		第245回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.079	600,000	591,666	2035/4/27	
2019年度第7回福岡市公募債(20年)	0.271	500,000	407,525	2039/10/24		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	300,000	298,638	2035/5/31	
2023年度第3回福岡市公募債(20年)	1.294	400,000	361,256	2043/8/21		第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.278	600,000	602,742	2035/6/29	
平成30年度第2回広島市公募債	0.639	700,000	619,472	2038/8/20		第284回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.149	500,000	433,830	2036/7/31	
令和元年度第2回広島市公募債	0.2	800,000	647,464	2039/8/19		第293回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.397	500,000	445,125	2036/10/31	
令和元年度第4回広島市公募債	0.355	400,000	329,956	2039/11/21		第296回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.522	200,000	180,648	2036/11/28	
令和2年度第2回広島市公募債	0.435	500,000	410,790	2040/8/21		第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.547	500,000	452,450	2036/12/26	
平成30年度第2回仙台市公募債	0.729	700,000	625,632	2038/10/18		第301回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.618	600,000	546,816	2037/1/30	
令和5年度第3回千葉市公募債	1.101	300,000	262,446	2043/6/23		第304回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.737	700,000	646,877	2037/2/27	
令和5年度第5回千葉市公募債	1.405	300,000	276,849	2043/6/19		第307回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.681	100,000	91,620	2037/3/31	
令和6年度第3回千葉市公募債	1.846	400,000	395,448	2044/6/20		第314回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.59	600,000	541,764	2037/5/29	
平成26年度第1回福井県公募債	1.482	100,000	103,165	2034/7/18		第316回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.569	100,000	89,910	2037/6/30	
平成27年度第1回福井県公募債	1.28	600,000	600,540	2035/7/17		第322回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	600,000	537,024	2037/8/31	
令和元年度第1回福井県公募債	0.286	400,000	328,608	2039/7/29		第325回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.549	100,000	89,230	2037/9/30	
令和6年度第3回福井県公募債	0.449	600,000	494,850	2040/8/3		第328回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.585	600,000	537,132	2037/10/30	
令和5年度第4回福井県公募債	1.168	300,000	265,269	2043/7/24		第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	700,000	619,626	2038/8/31	
第5回神奈川県住宅供給公社債券	0.709	600,000	526,644	2038/4/23		第370回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.419	400,000	339,148	2039/3/31	
第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	400,000	387,948	2039/4/23		第22回政府保証民間都市開発債券	0.245	1,000,000	807,130	2040/2/28	
第7回神奈川県住宅供給公社債券	0.534	300,000	252,048	2039/4/22		第23回政府保証民間都市開発債券	0.397	800,000	657,352	2040/6/29	
第8回地方公共団体金融機構債券(30年)	2.5	200,000	223,724	2035/9/21		小計		11,600,000	10,630,868		
第51回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.377	200,000	177,712	2036/4/28		普通社債券(含む投資法人債券)					
第80回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.354	500,000	406,640	2040/1/27		第530回中部電力株式会社社債	0.274	200,000	193,638	2029/6/25	
第83回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.44	400,000	327,576	2040/6/28		第554回中部電力株式会社社債	0.463	100,000	94,576	2032/2/25	
第106回地方公共団体金融機構債券	1.156	400,000	350,360	2043/7/28		第556回中部電力株式会社社債	0.544	800,000	759,032	2032/4/23	
第107回地方公共団体金融機構債券	1.485	400,000	370,444	2043/9/28		第566回中部電力株式会社社債	1.071	600,000	578,928	2034/4/25	
第108回地方公共団体金融機構債券	1.562	300,000	281,616	2043/10/28		第568回中部電力株式会社社債	1.214	200,000	195,410	2034/5/25	
第111回地方公共団体金融機構債券	1.577	100,000	94,601	2044/4/28		第541回関西電力株式会社社債	0.37	800,000	750,776	2031/9/19	
第112回地方公共団体金融機構債券	1.859	600,000	591,738	2044/6/28		第544回関西電力株式会社社債	0.34	500,000	467,615	2031/10/24	
第11回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.763	300,000	271,833	2037/2/27		第548回関西電力株式会社社債	0.574	900,000	850,716	2032/4/23	
第12回大阪府住宅供給公社債券	0.34	500,000	491,460	2028/6/20		第551回関西電力株式会社社債	0.664	800,000	760,576	2032/5/25	
第13回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.514	200,000	191,248	2032/2/27		第567回関西電力株式会社社債	1.339	500,000	490,520	2034/5/25	
第135回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.768	400,000	362,652	2037/2/27		第434回中国電力株式会社社債	0.463	500,000	469,620	2032/2/25	
第151回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.32	400,000	320,080	2040/2/28		第454回中国電力株式会社社債	1.34	1,000,000	988,170	2033/10/25	
第147回福岡北九州高速道路債券	0.502	300,000	286,431	2032/3/19		第457回中国電力株式会社社債	1.401	800,000	789,408	2034/5/25	
第148回福岡北九州高速道路債券	0.731	500,000	450,985	2037/3/19		第459回中国電力株式会社社債	1.238	300,000	299,871	2031/7/25	
第150回福岡北九州高速道路債券	0.396	300,000	279,780	2033/3/18		第311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	200,630	2027/9/24	
第24回東京都住宅供給公社債券	0.519	500,000	441,890	2036/9/12		第318回北陸電力株式会社社債	0.26	50,000	49,546	2026/12/25	
第26回東京都住宅供給公社債券	0.697	600,000	531,918	2037/9/11		第342回北陸電力株式会社社債	0.3	100,000	94,155	2031/4/25	
第29回東京都住宅供給公社債券	0.749	200,000	175,090	2038/9/17		第349回北陸電力株式会社社債	0.544	600,000	565,878	2032/4/23	
第30回東京都住宅供給公社債券	0.496	145,000	139,118	2038/9/17		第536回東北電力株式会社社債	0.29	200,000	186,560	2031/9/25	
第32回東京都住宅供給公社債券	0.341	300,000	242,046	2039/9/26		第538回東北電力株式会社社債	0.33	700,000	653,338	2031/11/25	
第33回東京都住宅供給公社債券	0.25	232,500	216,841	2039/9/26		第541回東北電力株式会社社債	0.35	700,000	652,757	2032/1/23	
第36回東京都住宅供給公社債券	0.416	200,000	180,692	2034/12/22		第544回東北電力株式会社社債	0.574	700,000	661,668	2032/4/23	
第37回東京都住宅供給公社債券	0.435	200,000	178,582	2035/9/21		第563回東北電力株式会社社債	1.161	500,000	482,980	2034/4/25	
小計		60,677,500	54,465,929			第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	197,650	2027/11/25	
特殊債券(除く金融債)						第309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	481,850	2030/5/24	
第61回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	114,770	2038/6/30		第317回四国電力株式会社社債	0.6	200,000	155,714	2041/10/25	
第233回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.315	500,000	506,920	2034/11/30		第320回四国電力株式会社社債	0.534	200,000	188,750	2032/4/23	
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	500,000	502,020	2034/12/28		第323回四国電力株式会社社債	0.659	800,000	760,448	2032/6/25	
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	500,000	498,130	2035/2/28		第502回九州電力株式会社社債	0.493	200,000	188,326	2032/2/25	

銘柄	第141期末				銘柄	第141期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第504回九州電力株式会社社債	0.589	700,000	662,403	2032/4/23	第49回国際協力機構債券	0.333	300,000	246,099	2039/6/20
第507回九州電力株式会社社債	0.644	800,000	759,440	2032/5/25	第54回国際協力機構債券	0.445	600,000	490,260	2040/6/26
第524回九州電力株式会社社債	1.161	600,000	579,576	2034/4/25	第57回国際協力機構債券	1.459	700,000	570,332	2040/9/20
第527回九州電力株式会社社債	1.425	700,000	692,160	2034/5/25	第77回国際協力機構債券	1.404	900,000	825,300	2043/6/19
第321回北海道電力株式会社社債	0.886	11,000	11,027	2024/12/25	第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.221	200,000	197,596	2035/8/17
第391回北海道電力株式会社社債	1.038	600,000	592,422	2031/5/23	第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.739	500,000	457,405	2037/2/27
第15回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.89	600,000	585,072	2030/7/24	第164回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.326	300,000	270,564	2043/8/28
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	400,000	395,316	2029/10/9	第3回I N P E X株式会社社無担保社債	0.25	600,000	563,718	2031/10/15
第40回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.37	400,000	376,540	2035/7/13	第22回株式会社大林組無担保社債	0.385	600,000	589,542	2028/9/13
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	600,000	575,610	2031/4/22	第27回株式会社大林組無担保社債	0.819	300,000	299,364	2029/6/12
第46回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.05	700,000	626,738	2036/4/22	第11回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.524	700,000	689,591	2028/11/1
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	800,000	695,904	2036/8/29	第12回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.35	300,000	290,262	2029/7/19
第50回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.94	800,000	763,784	2032/4/26	第14回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.47	500,000	481,870	2030/7/12
第5回東京電力リニューアブルパワー株式会社無担保社債	1.431	200,000	193,974	2034/2/28	第5回住友林業株式会社社無担保社債	0.35	400,000	393,576	2028/3/7
第14回新関西国際空港株式会社社債	1.318	600,000	598,212	2034/12/20	第8回住友林業株式会社社無担保社債	0.38	500,000	488,265	2029/3/6
第16回新関西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	294,465	2035/9/20	第9回住友林業株式会社社無担保社債	0.28	500,000	482,290	2029/12/6
第23回新関西国際空港株式会社社債	0.512	700,000	591,689	2038/12/20	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	0.2	600,000	578,514	2029/7/13
第108回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.439	300,000	251,448	2039/4/11	第3回パーソルホールディングス株式会社社無担保社債	0.907	500,000	500,070	2029/7/13
第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.253	400,000	323,604	2039/7/11	第15回森永乳業株式会社社無担保社債	0.37	700,000	692,335	2027/7/23
第125回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.379	400,000	324,656	2040/4/24	第12回森永乳業株式会社社無担保社債	0.395	200,000	196,278	2028/9/14
第130回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.479	500,000	410,335	2040/7/20	第20回森永乳業株式会社社無担保社債	1.43	400,000	401,436	2034/6/5
第135回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.35	500,000	447,700	2035/10/15	第1回雪印メグミルク株式会社社無担保社債	0.45	800,000	781,528	2028/12/25
第147回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.443	200,000	159,832	2041/7/12	第12回日本ハム株式会社社無担保社債	0.36	600,000	585,630	2029/2/20
第175回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	1.111	300,000	260,805	2043/7/14	第3回サッポロホールディングス株式会社社無担保社債	0.3	500,000	480,165	2029/9/5
第34回日本政策投資銀行債券	2.67	200,000	226,620	2037/3/19	第2回アサヒグループホールディングス株式会社社無担保社債	0.509	400,000	395,272	2028/9/7
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	200,000	225,546	2035/12/20	第13回キリンホールディングス株式会社社無担保社債	0.23	800,000	771,344	2029/9/5
第313回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.304	800,000	719,144	2043/8/21	第17回キリンホールディングス株式会社社無担保社債	0.37	100,000	96,360	2030/6/4
第318回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.419	800,000	732,600	2043/9/18	第12回キリンホールディングス株式会社社無担保社債	1.318	1,000,000	996,600	2033/10/26
第327回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.703	800,000	771,184	2044/4/25	第10回サントリーホールディングス株式会社社無担保社債	0.519	800,000	760,760	2032/6/8
第332回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.792	800,000	784,120	2044/6/17	第12回サントリーホールディングス株式会社社無担保社債	0.8	600,000	575,544	2033/5/25
第128回都市再生債券	0.39	500,000	441,095	2036/9/19	第3回コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス社債	0.27	600,000	580,104	2029/9/19
第133回都市再生債券	0.767	200,000	183,524	2037/2/20	第12回日清オリオグループ株式会社社無担保社債	0.365	300,000	295,704	2027/12/3
第156回都市再生債券	0.343	400,000	328,820	2039/6/17	第2回株式会社J-オイルミルズ無担保社債	0.37	600,000	592,932	2027/5/28
第157回都市再生債券	0.2	400,000	319,248	2039/9/16	第35回双日株式会社社無担保社債	0.605	300,000	295,740	2028/3/8
第160回都市再生債券	0.335	600,000	487,206	2039/12/19	第25回味の素株式会社社無担保社債	0.355	700,000	694,764	2027/3/9
第167回都市再生債券	0.43	300,000	242,097	2040/12/20	第25回株式会社ニチレイ無担保社債	0.24	300,000	295,779	2027/8/31
第196回都市再生債券	1.792	300,000	293,199	2044/6/20	第7回日鉄興和不動産株式会社社無担保社債	1.248	500,000	500,000	2029/7/27
第159回一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	300,000	294,312	2035/5/18	第7回中央日本土地建物グループ株式会社社無担保社債	0.909	300,000	296,217	2028/8/15
第168回一般担保住宅金融支援機構債券	1.221	100,000	98,797	2035/8/20	第14回ヒューリック株式会社社無担保社債	0.866	600,000	597,588	2029/4/18
第308回一般担保住宅金融支援機構債券	0.306	200,000	177,506	2035/12/20	第6回J・フロント リテイリング株式会社社無担保社債	0.435	700,000	693,294	2027/8/4
第355回一般担保住宅金融支援機構債券	1.111	300,000	260,790	2043/7/17	第43回東洋紡株式会社社無担保社債	0.25	400,000	388,240	2028/12/7
第357回一般担保住宅金融支援機構債券	1.313	800,000	720,144	2043/8/20	第5回トヨタ紡織株式会社社無担保社債	0.33	300,000	296,505	2027/9/17
第358回一般担保住宅金融支援機構債券	1.558	400,000	375,004	2043/10/20	第8回トヨタ紡織株式会社社無担保社債	1.155	300,000	295,572	2033/10/19
第23回成田国際空港株式会社社債	0.677	400,000	360,664	2036/12/16	第18回野村不動産ホールディングス株式会社社無担保社債	0.913	300,000	300,054	2029/7/10
第25回成田国際空港株式会社社債	0.671	300,000	265,122	2037/12/18	第27回森ビル株式会社社無担保社債	0.893	200,000	200,084	2029/7/30
第35回成田国際空港株式会社社債	0.27	100,000	79,929	2039/9/16	第13回東急不動産ホールディングス株式会社社無担保社債	0.41	500,000	494,865	2027/7/30
第37回成田国際空港株式会社社債	0.424	300,000	243,726	2040/1/27	第19回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	1.392	700,000	707,420	2033/11/2
第39回成田国際空港株式会社社債	0.409	600,000	536,118	2035/10/26	第36回東レ株式会社社無担保社債	1.291	500,000	491,845	2033/11/24
第41回成田国際空港株式会社社債	0.575	600,000	491,466	2040/10/26	第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	589,368	2028/4/25
第33回国際協力機構債券	1.13	100,000	97,441	2035/12/20	第12回旭化成株式会社社無担保社債	0.21	500,000	481,445	2029/9/6
第36回国際協力機構債券	0.313	100,000	87,869	2036/6/20	第15回旭化成株式会社社無担保社債	0.28	500,000	479,105	2030/6/19

銘柄	第141期末				銘柄	第141期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第34回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	197,460	2028/1/26	第18回株式会社小松製作所無担保社債	0.803	500,000	499,865	2029/7/17
第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	294,657	2028/11/29	第6回住友重機工業株式会社無担保社債	0.29	400,000	385,308	2030/1/24
第40回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	700,000	672,525	2030/7/17	第15回株式会社クボタ無担保社債	0.514	600,000	568,572	2032/6/2
第25回レンゴー株式会社無担保社債	0.415	200,000	195,574	2028/12/13	第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,152	2026/9/30
第27回レンゴー株式会社無担保社債	0.3	800,000	766,712	2029/12/12	第24回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.18	600,000	576,198	2029/10/11
第32回レンゴー株式会社無担保社債	1.344	200,000	195,512	2033/12/13	第27回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.26	300,000	285,921	2030/9/18
第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	687,246	2027/9/13	第32回ダイキン工業株式会社無担保社債	1.005	500,000	499,790	2031/7/25
第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	97,482	2028/4/17	第6回株式会社タダノ無担保社債	0.25	800,000	788,816	2026/12/11
第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	386,028	2029/4/16	第3回グローリー株式会社無担保社債	0.804	500,000	498,120	2029/6/13
第1回日産化学株式会社無担保社債	0.764	200,000	199,668	2029/6/13	第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	295,791	2027/12/7
第27回株式会社トクヤマ無担保社債	0.868	300,000	299,073	2029/6/11	第57回日本精工株式会社無担保社債	0.539	200,000	197,278	2028/9/11
第3回レオア・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	393,544	2028/2/29	第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.345	400,000	393,156	2028/3/8
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	600,000	588,936	2028/8/31	第9回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	500,000	481,135	2029/11/28
第6回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.38	400,000	385,260	2030/5/31	第23回株式会社日立製作所無担保社債	1.184	200,000	195,606	2033/12/14
第11回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.84	500,000	478,220	2033/7/21	第32回富士電機株式会社無担保社債	0.892	100,000	99,920	2029/6/6
第24回株式会社カネカ無担保社債	0.24	200,000	192,202	2029/9/12	第63回日本電気株式会社無担保社債	0.84	400,000	376,896	2033/7/11
第23回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	0.34	400,000	381,104	2030/9/3	第64回日本電気株式会社無担保社債	0.868	500,000	499,855	2029/7/9
第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,021	2027/7/23	第65回日本電気株式会社無担保社債	1.59	200,000	200,524	2034/7/7
第50回三井化学株式会社無担保社債	0.27	500,000	480,820	2029/12/5	第17回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.56	700,000	690,242	2027/9/6
第20回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.42	600,000	586,800	2028/12/19	第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	500,000	479,265	2030/7/16
第3回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.28	1,000,000	955,800	2030/2/28	第19回パナソニック株式会社無担保社債	0.37	600,000	577,644	2030/3/5
第17回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.5	200,000	191,890	2030/12/13	第24回パナソニック株式会社無担保社債	0.709	700,000	693,966	2028/9/14
第7回積水化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	482,230	2029/9/13	第36回ソニー株式会社無担保社債	0.3	700,000	677,432	2029/10/10
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	600,000	590,358	2028/3/23	第41回ソニーグループ株式会社無担保社債	1.001	1,000,000	969,100	2034/3/7
第6回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.24	500,000	481,310	2029/9/27	第6回TDK株式会社無担保社債	0.31	200,000	197,360	2027/7/28
第14回株式会社野村総合研究所無担保社債	1.223	200,000	196,508	2033/12/7	第7回TDK株式会社無担保社債	0.43	800,000	768,368	2030/7/26
第3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	687,750	2028/10/25	第5回株式会社堀場製作所無担保社債	0.18	700,000	690,970	2026/10/16
第16回回天薬品工業株式会社無担保社債	0.4	400,000	375,688	2031/10/14	第6回株式会社堀場製作所無担保社債	0.27	600,000	576,090	2029/10/17
第4回アステラス製薬株式会社無担保社債	0.519	500,000	494,905	2028/8/31	第30回JA三井リース株式会社無担保社債	0.923	500,000	500,085	2029/5/30
第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	593,148	2027/6/2	第4回昭和リース株式会社無担保社債	0.3	400,000	399,440	2024/12/18
第11回レモ株式会社無担保社債	0.686	400,000	398,380	2029/4/25	第5回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.37	500,000	499,715	2029/9/4
第3回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.375	700,000	684,467	2029/3/7	第7回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.6	500,000	497,710	2030/9/3
第15回株式会社オリエントランド無担保社債	0.305	700,000	683,291	2029/1/25	第7回株式会社ヤマハ発動機無担保社債	0.745	300,000	298,842	2029/4/23
第20回富士アイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.633	200,000	199,882	2027/7/16	第1回日本生命2021基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	0.28	400,000	395,944	2026/8/3
第21回富士アイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.838	400,000	399,692	2029/7/19	第3回株式会社トプコン無担保社債	0.3	200,000	199,510	2025/6/24
第22回富士アイルムホールディングス株式会社無担保社債	1.039	700,000	698,978	2031/7/18	第4回大日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	775,424	2029/7/19
第23回富士アイルムホールディングス株式会社無担保社債	1.386	500,000	499,890	2034/7/19	第5回株式会社ニフコ無担保社債	0.385	500,000	489,735	2028/5/8
第2回JXTGホールディングス株式会社無担保社債	0.405	700,000	692,678	2027/8/3	第6回株式会社ニフコ無担保社債	0.28	700,000	671,797	2029/9/11
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	0.834	400,000	383,208	2032/6/15	第17回株式会社岡村製作所無担保社債	0.931	400,000	400,968	2029/6/5
第16回回天ゴム株式会社無担保社債	0.58	800,000	756,976	2032/6/4	第80回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.088	500,000	489,380	2034/4/18
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	975,940	2029/4/19	第7回長瀬産業株式会社無担保社債	0.29	600,000	574,728	2029/12/12
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.37	800,000	785,664	2028/6/14	第8回長瀬産業株式会社無担保社債	0.64	400,000	376,672	2032/6/9
第32回住友金属山形株式会社無担保社債	0.27	500,000	483,615	2029/6/20	第23回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	209,358	2027/4/23
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	676,403	2029/6/20	第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	500,000	485,980	2029/7/11
第20回ジェイアールホールディングス株式会社無担保社債	0.365	600,000	582,972	2029/5/25	第75回三井物産株式会社無担保社債	0.23	300,000	289,140	2029/12/12
第38回ジェイアールホールディングス株式会社無担保社債	0.823	400,000	400,072	2029/7/10	第33回三菱商事株式会社無担保社債	1.054	1,000,000	975,630	2034/3/21
第32回住友金属山形株式会社無担保社債	0.25	800,000	766,224	2029/12/13	第3回稲積産業株式会社無担保社債	1.141	300,000	300,717	2029/6/5
第1回住友生命2023基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	0.705	1,000,000	984,510	2028/8/8	第102回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.855	500,000	497,625	2029/4/27
第14回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.29	600,000	576,306	2029/10/25	第105回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.924	300,000	300,000	2029/7/31
第5回日本郵政株式会社無担保社債	0.808	500,000	499,975	2029/7/19	第26回イオン株式会社無担保社債	1.133	400,000	400,072	2029/7/4
第17回株式会社小松製作所無担保社債	0.608	400,000	399,864	2027/7/16	第2回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.29	700,000	698,425	2030/1/15

銘柄	第141期末				銘柄	第141期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第2回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.25	700,000	690,676	2027/11/4	第34回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.476	1,000,000	1,005,700	2034/3/17
第3回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.42	600,000	556,740	2032/11/4	第37回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.813	400,000	399,976	2029/6/6
第7回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	1.393	200,000	199,348	2030/6/18	第27回SBIホールディングス株式会社無担保社債	0.18	800,000	800,216	2024/12/23
第7回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.71	700,000	657,846	2033/6/9	第44回リコーリース株式会社無担保社債	0.904	400,000	399,164	2029/5/22
第3回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.66	430,000	427,746	2026/2/27	第11回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,722	2025/1/30
第3回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.575	800,000	786,792	2027/6/8	第9回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.38	700,000	692,412	2026/9/18
第15回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.53	600,000	597,576	2030/9/2	第41回株式会社ジャックス無担保社債	1.032	300,000	300,735	2029/6/6
第16回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.4	900,000	884,430	2031/12/22	第33回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.55	800,000	741,496	2032/1/20
第4回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.62	725,000	716,379	2026/12/18	第30回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	1.053	500,000	500,090	2029/7/19
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	200,000	208,774	2027/4/20	第217回オリックス株式会社無担保社債	0.589	600,000	593,670	2028/8/30
第24回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.91	600,000	646,920	2029/10/16	第20回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.41	600,000	598,596	2028/8/3
第24回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.27	400,000	418,128	2030/9/27	第45回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.898	400,000	398,932	2029/7/19
第26回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.95	200,000	202,730	2025/11/12	第59回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.385	200,000	196,390	2028/5/26
第29回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.16	100,000	101,814	2026/1/20	第61回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.35	200,000	195,932	2028/7/12
第33回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	102,194	2026/6/9	第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.37	600,000	560,784	2031/12/1
第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.849	400,000	400,056	2024/9/12	第5回野村ホールディングス無担保社債	0.75	800,000	791,856	2027/9/3
第4回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	1.328	800,000	793,752	2030/5/29	第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	400,000	395,340	2026/11/13
第7回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.92	480,000	480,211	2025/10/15	第2回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	0.749	300,000	284,433	2032/10/14
第9回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.469	240,000	237,463	2026/6/15	第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	107,604	2030/12/20
第10回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.545	130,000	128,614	2026/9/15	第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	105,809	2033/8/2
第14回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.585	710,000	694,351	2028/3/16	第67回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	292,806	2029/4/13
第6回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	1.2	800,000	771,208	2034/6/8	第83回三井不動産株式会社無担保社債	0.81	700,000	669,536	2033/6/6
第9回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	500,000	514,070	2026/12/22	第84回三井不動産株式会社無担保社債	1.057	300,000	291,909	2033/9/12
第10回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.464	800,000	824,696	2027/3/15	第87回三井不動産株式会社無担保社債	1.311	800,000	793,584	2034/5/30
第1回株式会社千葉銀行無担保社債(劣後特約付)	0.911	600,000	599,934	2024/8/29	第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	212,186	2032/12/20
第5回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.37	800,000	798,664	2029/11/26	第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	210,446	2027/9/17
第6回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.49	800,000	788,624	2031/10/29	第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.425	300,000	316,566	2027/10/29
第7回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.95	300,000	296,313	2032/9/27	第130回三菱地所株式会社無担保社債	2.27	700,000	676,851	2029/8/3
第8回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.92	100,000	101,297	2025/10/28	第111回住友不動産株式会社無担保社債	0.52	500,000	495,050	2028/4/28
第6回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.78	600,000	617,982	2026/4/27	第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.99	300,000	318,540	2031/9/19
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.49	400,000	414,328	2027/5/10	第11回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.09	200,000	201,836	2029/9/20
第13回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.341	300,000	306,900	2026/6/15	第131回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	200,000	192,164	2031/9/5
第29回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	0.898	500,000	499,975	2029/7/20	第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	443,945	2036/12/5
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	494,185	2027/9/17	第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	900,000	786,240	2037/9/1
第20回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.875	500,000	482,020	2030/10/30	第119回東武鉄道株式会社無担保社債	0.758	500,000	428,635	2038/5/24
第20回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	1.412	1,200,000	1,167,216	2033/7/13	第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	656,288	2039/7/22
第29回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	1.015	500,000	494,575	2033/7/13	第123回東武鉄道株式会社無担保社債	0.8	700,000	577,500	2040/4/20
第30回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	1.837	500,000	501,565	2034/7/18	第135回東武鉄道株式会社無担保社債	1.351	100,000	99,030	2034/5/30
第31回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	1.358	700,000	699,846	2034/7/18	第36回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.7	700,000	673,484	2032/1/30
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	500,000	510,965	2026/6/1	第37回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.681	700,000	662,844	2033/3/4
第28回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.17	600,000	615,438	2026/12/18	第38回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.778	400,000	378,892	2033/9/20
第5回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.49	100,000	102,270	2026/1/30	第40回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.619	400,000	368,212	2034/6/10
第7回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.87	200,000	207,990	2026/11/6	第41回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.71	700,000	574,469	2039/10/25
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.52	500,000	518,780	2027/4/27	第45回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	1.313	600,000	590,658	2034/6/14
第15回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	3.03	200,000	216,292	2029/9/28	第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	647,344	2039/9/16
第18回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.14	400,000	408,836	2026/9/11	第4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	497,784	2040/6/8
第41回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.831	400,000	397,844	2029/4/26	第80回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.211	200,000	209,310	2029/4/27
第24回みずほリース株式会社無担保社債	0.914	500,000	491,490	2031/2/28	第82回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.307	600,000	601,302	2033/6/3
第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.529	600,000	575,310	2031/12/19	第83回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.459	200,000	192,530	2031/4/22
第5回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.489	600,000	567,882	2032/9/17	第84回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.662	100,000	89,723	2036/4/22
第30回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.213	800,000	794,984	2033/9/20	第85回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	540,282	2036/9/26

銘柄	第141期末				銘柄	第141期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第88回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.723	700,000	606,515	2038/5/28	第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	606,788	2036/6/20
第40回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.804	300,000	269,310	2036/12/1	第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	400,000	353,560	2037/6/19
第41回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.751	700,000	617,841	2037/6/12	第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	525,318	2037/12/15
第42回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.77	700,000	613,550	2037/12/4	第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	86,403	2038/5/24
第43回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.676	800,000	682,296	2038/7/12	第38回東京地下鉄株式会社社債	0.445	600,000	484,860	2040/1/31
第44回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.576	600,000	488,058	2039/11/28	第49回東京地下鉄株式会社社債	0.574	300,000	242,391	2041/1/22
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	600,000	494,310	2040/6/11	第62回東京地下鉄株式会社社債	1.648	400,000	370,684	2044/3/31
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	444,230	2036/8/29	第1回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.758	600,000	569,616	2032/3/17
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	620,970	2037/5/29	第2回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.67	500,000	465,145	2032/12/6
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	526,374	2037/11/30	第3回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.445	700,000	682,017	2028/12/6
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	500,000	434,020	2038/8/30	第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	700,000	683,389	2031/3/4
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	300,000	293,745	2028/12/20	第46回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.69	400,000	354,108	2038/9/9
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	497,652	2039/6/20	第47回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.903	700,000	628,950	2037/4/14
第88回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.73	800,000	663,824	2040/4/23	第48回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.782	500,000	438,420	2037/9/4
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	105,536	2027/11/29	第51回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.672	300,000	248,061	2039/5/30
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	97,050	2031/3/10	第56回西日本鉄道株式会社無担保社債	1.125	500,000	485,795	2034/4/11
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	494,710	2027/9/17	第99回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.8	500,000	477,005	2031/9/2
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	529,596	2037/9/18	第102回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.772	700,000	656,726	2032/7/27
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	437,910	2037/11/27	第106回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.505	700,000	689,500	2028/1/25
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	331,828	2040/5/25	第111回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.955	700,000	687,643	2038/7/26
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	573,756	2031/6/20	第112回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.47	300,000	290,016	2029/7/11
第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	520,722	2038/9/7	第117回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.91	900,000	724,401	2040/1/30
第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	851,910	2039/3/8	第47回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.202	500,000	508,320	2029/7/18
第54回京成電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	328,568	2040/6/12	第49回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.817	800,000	721,192	2036/12/15
第57回京成電鉄株式会社無担保社債	0.7	400,000	325,280	2040/8/31	第51回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.789	700,000	607,719	2038/9/13
第73回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.098	100,000	106,911	2030/12/20	第54回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.486	800,000	640,960	2040/2/27
第86回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.732	300,000	313,383	2032/7/23	第69回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.833	400,000	399,500	2029/7/11
第91回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.751	300,000	313,491	2032/12/27	第40回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.841	400,000	391,476	2031/6/3
第103回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	400,000	404,664	2034/7/25	第41回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.7	400,000	385,500	2031/12/8
第106回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.981	100,000	95,540	2035/1/29	第42回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.647	300,000	286,242	2032/5/28
第120回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.675	500,000	446,195	2037/1/27	第43回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.941	700,000	616,175	2037/11/30
第143回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.444	800,000	646,808	2039/12/23	第44回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.878	800,000	691,352	2038/5/21
第198回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.554	200,000	182,612	2044/1/19	第45回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.871	700,000	666,323	2033/12/6
第200回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.12	700,000	700,490	2044/7/12	第46回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.69	500,000	405,350	2039/11/30
第28回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.111	800,000	854,144	2030/6/11	第52回南海電気鉄道株式会社無担保社債	1.381	300,000	297,351	2034/5/29
第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	203,486	2034/6/20	第30回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.74	700,000	594,377	2038/7/16
第38回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.288	400,000	394,660	2034/12/12	第31回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	200,000	196,106	2029/1/24
第40回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.21	400,000	388,552	2035/8/31	第32回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.63	700,000	564,669	2039/12/16
第61回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.591	800,000	658,544	2040/5/21	第52回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.75	600,000	538,320	2036/8/29
第37回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	212,450	2028/5/22	第53回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.85	300,000	279,900	2035/2/28
第65回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.786	500,000	521,975	2033/9/13	第54回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.806	700,000	622,986	2037/5/29
第69回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	600,000	607,002	2034/7/28	第55回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.79	600,000	527,172	2037/12/4
第70回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.309	100,000	101,156	2032/9/30	第56回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.748	300,000	259,218	2038/5/25
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	700,000	695,996	2034/11/28	第57回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.863	500,000	435,790	2038/9/10
第73回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.014	400,000	383,548	2035/1/26	第58回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.725	500,000	420,775	2039/4/25
第75回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.196	100,000	97,366	2035/4/20	第59回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.53	400,000	323,204	2039/9/5
第76回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.297	100,000	98,274	2035/6/18	第63回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.69	300,000	242,355	2040/10/26
第89回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.033	300,000	295,722	2044/5/31	第70回同名古屋鉄道株式会社無担保社債	1.252	500,000	479,260	2036/3/14
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	104,275	2032/5/25	第7回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	0.28	400,000	384,592	2029/10/11
第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	104,338	2033/6/14	第9回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	0.42	800,000	766,312	2030/9/18
第16回東京地下鉄株式会社社債	0.778	300,000	275,538	2036/3/11	第11回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	0.843	200,000	199,476	2029/5/30

銘柄	第141期末				銘柄	第141期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第2回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.455	200,000	198,436	2027/2/23	第17回ソフトバンク無担保社債	0.51	700,000	677,740	2029/1/26
第3回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.39	400,000	393,344	2028/2/28	第18回ソフトバンク無担保社債	0.62	600,000	554,568	2032/1/27
第4回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.445	700,000	684,810	2028/12/14	第23回ソフトバンク無担保社債	1.3	700,000	668,598	2033/7/12
第5回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.3	500,000	480,670	2029/12/11	第26回沖繩電力株式会社社債	0.28	700,000	683,578	2028/12/25
第6回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.45	500,000	480,230	2030/9/17	第27回沖繩電力株式会社社債	0.19	300,000	287,334	2030/3/25
第8回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.75	200,000	191,136	2032/8/13	第28回沖繩電力株式会社社債	0.24	300,000	285,153	2030/12/20
第10回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	1.497	200,000	199,974	2034/7/26	第35回沖繩電力株式会社社債	1.276	400,000	395,176	2034/6/23
第1回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.295	600,000	584,682	2029/3/7	第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.31	100,000	95,508	2034/4/24
第3回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.23	300,000	288,882	2029/12/10	第32回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.28	100,000	94,350	2034/10/6
第4回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.51	400,000	325,408	2039/12/9	第36回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.737	400,000	418,108	2032/5/25
第6回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.29	400,000	384,072	2030/6/7	第37回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.764	300,000	312,561	2033/9/26
第7回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.691	500,000	414,285	2040/6/8	第39回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.554	700,000	712,656	2034/5/26
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.616	300,000	236,931	2041/12/9	第43回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.67	700,000	619,864	2037/6/9
第1回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.26	500,000	477,045	2030/10/22	第48回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.704	300,000	258,780	2038/11/29
第2回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.235	400,000	373,988	2031/11/18	第55回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.28	800,000	634,160	2039/9/13
第2回NIPPON EXPRESSホールディングス株式会社	1.158	300,000	292,779	2033/12/13	第68回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.523	500,000	395,880	2041/7/12
第2回日本貨物鉄道株式会社社債	0.849	300,000	247,800	2042/3/17	第73回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.647	100,000	92,658	2044/3/11
第4回日本貨物鉄道株式会社社債	1.37	100,000	88,613	2043/6/15	第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.606	400,000	409,652	2034/3/24
第6回日本貨物鉄道株式会社社債	1.947	600,000	582,546	2044/6/13	第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.402	400,000	399,532	2034/10/24
第1回日本航空株式会社無担保社債	0.47	700,000	691,810	2026/12/18	第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	200,000	160,236	2041/6/3
第3回日本航空株式会社無担保社債	0.399	500,000	484,885	2028/9/21	第45回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.942	800,000	671,808	2042/6/2
第7回日本航空株式会社無担保社債	0.28	800,000	758,152	2029/12/14	第52回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.417	300,000	269,229	2043/6/2
第17回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.34	500,000	493,295	2027/12/8	第54回大阪瓦斯株式会社無担保社債	2.028	900,000	886,536	2044/5/30
第18回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.22	700,000	670,852	2029/12/5	第44回東邦瓦斯株式会社無担保社債	0.835	700,000	567,182	2042/3/3
第19回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.61	400,000	324,996	2039/12/5	第13回広島ガス株式会社無担保社債	0.405	600,000	587,436	2028/9/13
第20回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.759	100,000	98,365	2031/3/14	第14回広島ガス株式会社無担保社債	0.35	700,000	666,568	2030/10/15
第6回株式会社住友倉庫無担保社債	0.838	700,000	606,956	2038/3/26	第16回西部瓦斯株式会社無担保社債	0.355	700,000	683,599	2028/12/13
第8回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	300,000	287,670	2029/9/21	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	900,000	887,634	2028/6/6
第10回株式会社住友倉庫無担保社債	0.27	300,000	284,280	2030/10/15	小計		242,176,000	229,585,818	
第25回KDD I 株式会社無担保社債	0.395	400,000	391,496	2028/11/22	合計		331,253,500	310,692,067	
第33回KDD I 株式会社無担保社債	0.893	300,000	299,841	2029/7/11					
第35回KDD I 株式会社無担保社債	1.42	600,000	601,122	2034/7/11					
第13回ソフトバンク無担保社債	0.52	800,000	742,360	2031/6/3					
第16回ソフトバンク無担保社債	0.52	700,000	645,400	2031/10/10					

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

＜東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド＞

下記は、東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド全体(12,372,792千口)の内容です。

国内株式

銘柄	第135期末		第141期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	千円
水産・農林業 (2.5%)				
ニッスイ	706	596.1	541,854	
マルハニチロ	129.5	86.5	292,716	
サカタのタネ	94.7	76.1	270,535	
建設業 (4.5%)				
ショーボンドホールディングス	69.4	66.9	393,238	
東急建設	73.9	—	—	
長谷工コーポレーション	112.6	26.9	49,603	
西松建設	158.2	95.3	467,637	
奥村組	25.7	20.9	107,217	
熊谷組	79.9	66.7	242,121	
東洋建設	236.5	228.7	354,713	
ライト工業	93.8	92.9	199,827	
三機工業	—	57.6	133,747	
食料品 (5.6%)				
ニッポン	59.7	15.4	35,851	
カルビー	262.4	180.2	597,903	
明治ホールディングス	158	130.7	491,824	
ブリマハム	—	57.6	140,774	
伊藤ハム米久ホールディングス	59.1	41.3	181,926	
日清食品ホールディングス	201	204	890,664	
日本たばこ産業	58.3	20.3	91,167	
繊維製品 (0.5%)				
グンゼ	32.2	24.1	133,755	
ホギメディカル	—	20.7	85,698	
パルプ・紙 (2.6%)				
王子ホールディングス	1,328.4	1,017.7	654,482	
レンゴー	566.9	435.4	456,081	
化学 (7.5%)				
アイカ工業	—	83.4	289,231	
花王	110.3	83.4	583,383	
ライオン	609.6	468.1	609,232	
マンダム	34.5	119.2	148,880	
ノエビアホールディングス	31.6	23.9	138,859	
小林製薬	146.6	—	—	
アース製薬	—	44.3	221,278	
有沢製作所	126.8	70	114,590	
エフビコ	85.8	119.5	293,073	

銘柄	第135期末		第141期末	
	株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	千円
ユニ・チャーム	195	169.2	873,579	
医薬品 (3.7%)				
武田薬品工業	205.2	176.6	757,967	
アステラス製薬	68	102.5	169,535	
科研製薬	110.4	80	322,240	
ツムラ	140.7	10	40,430	
キッセイ薬品工業	46.2	43.8	143,664	
栄研化学	92.2	66.9	158,218	
サワイグループホールディングス	20	—	—	
ガラス・土石製品 (—%)				
日本カーボン	40.1	—	—	
金属製品 (0.2%)				
東洋製罐グループホールディングス	64.7	27	67,932	
機械 (3.4%)				
タクマ	—	53.1	91,809	
ユニオンツール	—	6	34,380	
フジテック	131	92.4	402,586	
アマノ	105	75.2	311,854	
マックス	—	6.5	23,627	
ホシザキ	122.5	121.6	602,528	
電気機器 (15.1%)				
日清紡ホールディングス	366	320.3	351,849	
マブチモーター	210.3	183.5	425,811	
日東工業	88.1	81.9	281,326	
I D E C	76.1	60.6	178,345	
E I Z O	39.6	24.9	121,014	
エレコム	114.7	83.9	137,763	
アンリツ	354.8	250.1	320,128	
富士通ゼネラル	55.8	347.8	719,250	
ホシデン	181.9	—	—	
ヒロセ電機	55	44.2	847,977	
マクセル	122.4	—	—	
日本光電工業	—	184.4	440,255	
ウシオ電機	10.9	57.3	125,171	
日本セラミック	75.7	60	152,820	
カシオ計算機	627.1	516.4	632,848	
浜松トニクス	61.6	17	74,188	
京セラ	470.1	436.1	842,109	

銘柄	第135期末		第141期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
キヤノン電子	—	22.2	50,283	
キヤノン	272.9	169.7	752,619	
象印マホービン	115.2	73.8	110,552	
輸送用機器 (5.8%)				
トヨタ紡織	231.2	14.1	29,229	
トヨタ自動車	321.3	60	186,540	
タチエス	200	144.6	298,888	
NOK	—	7.2	16,005	
カヤバ	—	58	295,220	
プレス工業	324.3	240.5	152,477	
アイシン	32.6	—	—	
エクセディ	94.2	76.1	236,671	
エフ・シー・シー	115.8	73.9	174,034	
シマノ	—	30	762,450	
ティ・エス テック	246	185.5	364,322	
精密機器 (0.7%)				
ニプロ	224.1	224.1	290,545	
その他製品 (2.6%)				
パラマウントベッドホールディングス	53.3	52	138,632	
ビジョン	463.1	348.2	521,081	
リンテック	98.6	88.5	304,440	
コクヨ	94.7	71.7	189,646	
電気・ガス業 (2.7%)				
中部電力	418.3	—	—	
沖縄電力	17.7	—	—	
大阪瓦斯	327.9	250	871,250	
メタウォーター	—	162.7	299,205	
陸運業 (4.1%)				
東武鉄道	218.3	150.8	396,076	
相鉄ホールディングス	138.3	125.3	307,235	
東急	141.3	57.5	103,442	
京浜急行電鉄	—	95.7	114,217	
サカイ引越センター	—	19.6	51,312	
南海電気鉄道	186.7	163.9	441,792	
センコーグループホールディングス	225.8	192.6	214,941	
九州旅客鉄道	55.4	41.8	166,907	
倉庫・運輸関連業 (1.5%)				
住友倉庫	131.6	90.4	254,295	
上組	165.3	117.1	403,526	
情報・通信業 (8.4%)				
NECネットエスアイ	19.3	19.3	48,751	
コーエーテクモホールディングス	208.1	116.4	176,520	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	205.9	145.2	418,974	

銘柄	第135期末		第141期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
オービック	—	3.3	70,438	
電通総研	—	70.2	384,696	
エイバックス	72.8	57.9	88,644	
日本電信電話	5,476.5	5,445.1	875,027	
KDD I	208	191.3	882,275	
ソフトバンク	80.1	63.7	127,400	
TKC	4.3	—	—	
富士ソフト	63.4	57.3	415,425	
NSD	82	61.7	188,802	
卸売業 (9.5%)				
アルフレッサ ホールディングス	291	226.4	527,512	
神戸物産	224.6	228.7	882,324	
TOKAIホールディングス	169.9	142.5	141,075	
シップヘルスケアホールディングス	154.6	134.6	304,667	
コマダホールディングス	127.5	115.9	307,482	
ハビネット	58.5	45.2	145,544	
キヤノンマーケティングジャパン	85.4	66.9	304,060	
サンゲツ	132.5	103	310,030	
伊藤忠エネクス	—	69.6	115,744	
モスフードサービス	64.3	50.8	177,800	
PALTA C	64.3	61.8	267,285	
オートバックスセブン	225.4	192.2	307,327	
イエローハット	100.8	68.5	162,139	
因幡電機産業	58.6	43	173,505	
小売業 (6.3%)				
ローソン	5.6	—	—	
サンエー	48.4	41.4	213,210	
エービーシー・マート	117.6	99.3	279,976	
エディオン	114.5	92.2	163,009	
ビックカメラ	—	32.4	58,190	
DCMホールディングス	305.3	108.1	151,880	
ジョイフル本田	109.9	78.9	172,159	
リンガーハット	73.4	61.5	135,976	
コレリ	76.6	50.3	182,337	
フジ	72.6	58.3	113,976	
ヤオコー	30.5	24.8	228,209	
ケーズホールディングス	110.2	135.9	225,661	
王将フードサービス	17.4	13.7	122,067	
アークス	71.5	56.2	151,683	
サンドラッグ	164.7	137.9	557,253	
銀行業 (5.6%)				
めぶきフィナンシャルグループ	1,446.6	1,162.5	728,073	
ゆうちょ銀行	174.9	138.8	213,335	

銘柄	第135期末		第141期末	
	株数	千株	株数	千株
ひろぎんホールディングス	204.2	—	—	—
武蔵野銀行	—	10.4	33,072	
東邦銀行	—	502.2	159,699	
大垣共立銀行	69.3	54.9	122,921	
滋賀銀行	45.6	38.9	162,018	
南都銀行	64.7	46.8	162,630	
山陰合同銀行	—	158.8	228,195	
セブン銀行	1,286.9	1,200.1	331,827	
山口フィナンシャルグループ	284.3	169	311,467	
証券、商品先物取引業 (1.0%)				
松井証券	745.6	523.1	443,588	
保険業 (0.8%)				
S O M P Oホールディングス	—	76.6	260,057	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	1.3	—	—	
第一生命ホールディングス	—	21.5	101,265	
その他金融業 (0.7%)				
全国保証	—	27.2	164,968	

銘柄	第135期末		第141期末	
	株数	千株	株数	千株
リコーリース	39.1	25.9	139,342	
サービス業 (4.7%)				
M I X I	195.1	123.4	368,102	
総合警備保障	379.6	379.6	367,300	
H. U. グループホールディングス	188.3	169.4	435,696	
ダスキン	67.7	49.4	196,809	
ビー・エム・エル	35.6	44	131,560	
ベルシステム24ホールディングス	164.4	134.2	199,018	
セコム	18.4	13.8	132,314	
メイテックグループホールディングス	—	25.4	86,410	
イオンディライト	41.8	29.9	117,208	
合 計	29,765	25,577	43,516,853	
	株数・金額			
	銘柄数<比率>	138	152	<97.9%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率です。

＜TMA日本REITマザーファンド＞

下記は、TMA日本REITマザーファンド全体(14,740,287千口)の内容です。

国内投資信託証券

銘柄	第135期末		第141期末		
	口数	口数	口数	評価額	比率
				千円	%
SOS i LA物流リート投資法人	2,117	2,140	246,314	0.6	
日本アコモデーションファンド投資法人	62	121	76,714	0.2	
森ヒルズリート投資法人	12,790	5,170	678,304	1.6	
産業ファンド投資法人	7,427	7,657	966,313	2.3	
アドバンス・レジデンス投資法人	4,002	4,900	1,543,500	3.6	
アクティブ・プロパティーズ投資法人	2,585	2,100	740,250	1.7	
GLP投資法人	19,389	15,570	2,056,797	4.8	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	801	801	249,912	0.6	
日本プロロジスリート投資法人	10,226	8,050	1,989,960	4.7	
星野リゾート・リート投資法人	200	305	159,820	0.4	
One リート投資法人	119	119	30,904	0.1	
イオンリート投資法人	370	1,490	197,723	0.5	
ヒューリックリート投資法人	667	595	85,382	0.2	
日本リート投資法人	130	330	108,405	0.3	
積水ハウス・リート投資法人	3,200	11,370	910,737	2.1	
トーセイ・リート投資法人	—	285	39,415	0.1	
ヘルスケア & メディカル投資法人	100	100	12,600	0.0	
サムティ・レジデンシャル投資法人	495	840	88,200	0.2	
野村不動産マスターファンド投資法人	16,400	16,030	2,338,777	5.5	
ラサールロジポート投資法人	8,860	5,900	864,940	2.0	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,869	1,750	748,125	1.8	
投資法人みらい	515	1,240	55,180	0.1	
三菱地所物流リート投資法人	2,166	1,455	552,900	1.3	
CRE ロジスティクスファンド投資法人	3,408	2,550	364,140	0.9	
タカラレーベン不動産投資法人	800	1,555	154,256	0.4	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,714	1,945	232,816	0.5	
日本ビルファンド投資法人	3,230	3,470	1,984,840	4.7	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,351	4,290	2,226,510	5.2	
日本都市ファンド投資法人	35,600	14,910	1,335,936	3.1	
オリックス不動産投資法人	14,300	8,370	1,307,394	3.1	
日本プライムリアルティ投資法人	231	2,220	719,280	1.7	
NTT都市開発リート投資法人	14,052	7,870	905,837	2.1	
東急リアル・エステート投資法人	700	1,195	184,508	0.4	
グローバル・ワン不動産投資法人	1,100	2,970	299,376	0.7	
ユナイテッド・アーバン投資法人	18,037	9,490	1,348,529	3.2	
森トラストリート投資法人	1,880	3,260	228,852	0.5	
インヴィンシブル投資法人	40,685	30,740	2,031,914	4.8	
フロンティア不動産投資法人	100	860	373,240	0.9	
平和不動産リート投資法人	173	173	22,663	0.1	
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,184	3,380	887,250	2.1	
福岡リート投資法人	100	100	15,760	0.0	
KDX不動産投資法人	22,000	15,140	2,337,616	5.5	

銘	柄	第135期末		第141期末		
		口	数	口	数	評 価 額
			口	口	千円	%
いちごオフィスリート投資法人		1,000		1,911	157,084	0.4
大和証券オフィス投資法人		767		3,550	1,041,215	2.5
阪急阪神リート投資法人		300		650	85,345	0.2
スタートアップリート投資法人		350		605	118,459	0.3
大和ハウスリート投資法人		15,000		15,000	3,642,000	8.6
ジャパン・ホテル・リート投資法人		31,545		22,394	1,764,647	4.2
大和証券リビング投資法人		24,650		24,650	2,477,325	5.8
ジャパンエクセレント投資法人		354		2,095	248,886	0.6
合 計			334,101	273,661	41,236,852	
	口 数 ・ 金 額 銘 柄 数 < 比 率 >		49	50	< 97.1% >	

(注) 比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった場合は、別銘柄として掲載しています。

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド

運用報告書 第14期（決算日 2023年9月25日）

（計算期間 2022年9月27日～2023年9月25日）

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債組入比率	純資産額
	騰落	中率	騰落	中率		
	円	%		%	%	百万円
10期(2019年9月24日)	12,407	4.0	186.800	4.2	99.3	650,697
11期(2020年9月23日)	12,230	△1.4	183.157	△2.0	99.0	709,731
12期(2021年9月24日)	12,323	0.8	183.425	0.1	99.6	639,453
13期(2022年9月26日)	11,940	△3.1	177.978	△3.0	99.1	528,752
14期(2023年9月25日)	11,682	△2.2	174.132	△2.2	99.1	416,025

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		債組入比率	券率
	騰落	騰落率	騰落	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2022年9月26日	11,940	—	177.978	—	99.1	99.1
9月末	11,939	△0.0	178.017	0.0	99.6	98.9
10月末	11,923	△0.1	177.941	△0.0	99.6	99.6
11月末	11,853	△0.7	177.013	△0.5	99.3	99.3
12月末	11,653	△2.4	174.250	△2.1	99.1	99.1
2023年1月末	11,607	△2.8	173.319	△2.6	99.1	99.1
2月末	11,694	△2.1	175.197	△1.6	99.3	99.3
3月末	11,879	△0.5	178.070	0.1	98.4	98.4
4月末	11,908	△0.3	178.604	0.4	99.0	99.0
5月末	11,917	△0.2	178.375	0.2	99.0	99.0
6月末	11,969	0.2	178.895	0.5	99.0	99.0
7月末	11,803	△1.1	176.107	△1.1	99.2	99.2
8月末	11,739	△1.7	175.038	△1.7	98.2	98.2
(期末)						
2023年9月25日	11,682	△2.2	174.132	△2.2	99.1	99.1

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数はNOMURA-BPI/Ladder20年です。
 NOMURA-BPI/Ladder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（以下、NFRC）が公表する、日本の国債でラダー型運用を行った場合のパフォーマンスを表すインデックスです。
 その知的財産権はNFRCに帰属します。なお、NFRCは、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果などに関して一切責任を負うものではありません。

○運用経過

(2022年9月27日～2023年9月25日)

■期中の基準価額等の推移

期首：11,940円
 期末：11,682円
 騰落率：△2.2%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- 保有する債券の利息収入

マイナス要因

- 基準となる10年国債利回りの上昇に伴い社債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

■投資環境

【国債市場】

当期の10年国債利回りは上昇しました。

期初、0.25%程度水準で推移していた10年国債利回りは、2022年12月に日銀がYCC（イールドカーブ・コントロール）の修正を行ったことから、0.50%程度まで上昇しました。2023年3月には米国地銀の経営破綻やスイス大手金融機関の経営危機など欧米銀行発の金融市場の混乱を受け、10年国債利回りは0.2%台まで低下しましたが、7月には日銀によるYCC運用の柔軟化が意識され、10年国債利回りは0.6%を上回る水準まで上昇しました。その後も日銀の金融政策修正前倒しへの警戒感などから10年国債利回りは徐々に水準を切り上げ、0.74%程度で期を終えました。

【社債市場】

世界経済の先行きに対する警戒感などを背景とした社債スプレッド（社債と国債の利回り格差）の拡大に加え、2022年12月に日銀がYCCの修正を行ったことによる国債利回りの上昇を受けて、社債利回りは上昇しました。2023年3月の欧米銀行発の金融市場の混乱により社債スプレッドはやや拡大したものの、4月末の日銀金融政策決定会合での金融政策維持の決定を受けて市場に買い安心感が広がったことから社債スプレッドは縮小し、社債利回りは低下に転じました。7月に日銀がYCC運用の柔軟化を発表した後も大きな混乱はなく、相対的に高い利回りを求めて社債市場への資金流入が続きました。しかし、ベースとなる国債の利回り水準が切り上がったことで、社債利回りは前期末対比で上昇しました。

■ポートフォリオについて

わが国の法人が発行する円建ての社債を中心に投資し、投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、年限別の金利変動リスクを出来る限り平均化させ、インカムゲイン（利息等収益）を中心に安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行いました。当期の運用経過は以下の通りです。

当期は、ポートフォリオの利回り維持・向上に配慮しながら、社債（金融機関劣後債、生保基金債などを含む）を中心とした組み入れを維持しました。組み入れにあたっては、個別企業の信用リスクが変動した際の影響を可能な限り回避するよう業種分散を図るとともに、信用力の程度に応じた残存年限を選択しました。また、流動性確保の観点から、国債や政府保証債、地方債なども保有しました。期末のポートフォリオの平均残存期間は10年程度、平均格付は「AA-」（格付が取得できない債券を除く）を維持しました。

以上の運用の結果、基準価額は2.2%下落しました。



(注) 参考指数は、期首(2022年9月26日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、NOMURA-BPI/Ladder20年です。

○今後の運用方針

2023年7月末に日銀がYCC政策運用の柔軟化を行った後、日銀による次の金融政策修正への警戒感から、国債利回りには緩やかな上昇圧力がかかっています。加えて、国債利回りの先高観から社債の前倒しの発行が増加しており、新発債の販売状況に注目が集まっています。しかし、ベースとなる国債利回りの水準が安定すれば、利回りを求めて資金が社債に流入するとの見方から、相対的に信用力が高い銘柄を中心に社債利回りもおおむね安定的に推移すると考えます。

このような環境下、現在のポートフォリオでは、相対的に利回りが高い事業債を中心に組み入れる運用を行っています。引き続き流動性の確保に留意しながら、信用力および安定性が高いと判断した銘柄でポートフォリオを構成し、残存年限の分散を図りつつ安定的な運用を目指します。

○1万口当たりの費用明細

(2022年9月27日～2023年9月25日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2022年9月27日～2023年9月25日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	5,316,947	—
	地方債証券	8,800,000	58,252,937 (407,769)
内	特殊債券	—	6,205,163
	社債券（投資法人債券を含む）	16,400,000	63,006,743 (720,000)

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(注) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注) 社債券（投資法人債券を含む）には新株予約権付社債（転換社債）は含まれていません。

○利害関係人との取引状況等

(2022年9月27日～2023年9月25日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2023年9月25日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	当 期 末			残存期間別組入比率			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	26,800,000 (1,000,000)	26,917,470 (1,113,542)	6.5 (0.3)	— (—)	6.5 (0.3)	— (—)	— (—)
地方債証券	85,992,222 (85,992,222)	80,628,651 (80,628,651)	19.4 (19.4)	— (—)	19.0 (19.0)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)
特殊債券 (除く金融債)	17,700,000 (17,700,000)	16,547,179 (16,547,179)	4.0 (4.0)	— (—)	4.0 (4.0)	— (—)	— (—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	298,776,000 (298,776,000)	288,299,620 (288,299,620)	69.3 (69.3)	— (—)	46.5 (46.5)	17.5 (17.5)	5.4 (5.4)
合 計	429,268,222 (403,468,222)	412,392,920 (386,588,992)	99.1 (92.9)	— (—)	75.9 (69.7)	17.6 (17.6)	5.6 (5.6)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 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) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第22回利付国債 (30年)	2.5	500,000	591,745	2036/3/20	第160回利付国債 (20年)	0.7	700,000	671,860	2037/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	500,000	592,055	2036/6/20	第161回利付国債 (20年)	0.6	700,000	661,003	2037/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	500,000	592,310	2036/9/20	第162回利付国債 (20年)	0.6	700,000	658,777	2037/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	500,000	580,370	2036/12/20	第163回利付国債 (20年)	0.6	700,000	656,523	2037/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	500,000	586,630	2037/3/20	第164回利付国債 (20年)	0.5	700,000	644,721	2038/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	500,000	593,830	2037/9/20	第165回利付国債 (20年)	0.5	700,000	642,271	2038/6/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	500,000	594,105	2038/3/20	第166回利付国債 (20年)	0.7	700,000	658,896	2038/9/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	500,000	587,390	2038/9/20	第167回利付国債 (20年)	0.5	700,000	636,888	2038/12/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	500,000	580,130	2039/3/20	第168回利付国債 (20年)	0.4	700,000	624,449	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	500,000	572,430	2039/9/20	第169回利付国債 (20年)	0.3	700,000	611,366	2039/6/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	500,000	578,855	2040/3/20	第170回利付国債 (20年)	0.3	700,000	608,566	2039/9/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	500,000	555,645	2040/9/20	第171回利付国債 (20年)	0.3	700,000	605,353	2039/12/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	500,000	570,180	2041/3/20	第172回利付国債 (20年)	0.4	700,000	612,829	2040/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	500,000	554,245	2041/9/20	第173回利付国債 (20年)	0.4	700,000	610,064	2040/6/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	500,000	553,385	2042/3/20	第180回利付国債 (20年)	0.8	700,000	637,868	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	500,000	543,605	2042/9/20	第181回利付国債 (20年)	0.9	700,000	647,094	2042/6/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	500,000	533,875	2043/3/20	第182回利付国債 (20年)	1.1	700,000	668,003	2042/9/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	500,000	542,000	2043/6/20	第183回利付国債 (20年)	1.4	700,000	701,589	2042/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	700,000	655,578	2036/3/20	第184回利付国債 (20年)	1.1	700,000	664,293	2043/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	700,000	636,391	2036/6/20	第185回利付国債 (20年)	1.1	700,000	662,410	2043/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	700,000	659,022	2036/9/20	第27回利付国債 (物価連動・10年)	0.005	1,000,000	1,113,542	2032/3/10
第159回利付国債 (20年)	0.6	700,000	665,329	2036/12/20	小 計		26,800,000	26,917,470	

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
第6回東京都公募公債(30年)	2.58	100,000	117,775	2037/9/18	第23回埼玉県公募公債(20年)	0.626	300,000	272,919	2038/12/17
第7回東京都公募公債(30年)	2.51	100,000	116,839	2038/9/17	第24回埼玉県公募公債(20年)	0.431	100,000	87,740	2039/5/17
第35回東京都公募公債(20年)	0.525	700,000	632,954	2038/6/18	第25回埼玉県公募公債(20年)	0.32	450,000	383,710	2039/12/20
第37回東京都公募公債(20年)	0.444	800,000	689,824	2040/6/20	平成30年度第2回福岡県公募公債(15年)	0.542	600,000	580,494	2033/10/17
平成29年度第11回北海道公募公債(20年)	0.635	200,000	184,900	2037/12/25	令和元年度第1回福岡県公募公債(15年)	0.254	600,000	558,630	2034/6/14
平成30年度第4回北海道公募公債(20年)	0.569	600,000	545,058	2038/6/25	令和元年度第2回福岡県公募公債(15年)	0.269	400,000	368,996	2034/12/13
平成30年度第9回北海道公募公債(20年)	0.654	500,000	458,035	2038/9/24	平成26年度第2回福岡県公募公債(20年)	1.451	300,000	315,246	2034/9/22
令和元年度第4回北海道公募公債(20年)	0.323	700,000	601,230	2039/6/24	平成26年度第4回福岡県公募公債(20年)	1.249	200,000	205,318	2035/2/23
令和元年度第9回北海道公募公債(20年)	0.2	200,000	167,346	2039/9/22	令和元年度第1回福岡県公募公債(20年)	0.359	600,000	515,658	2039/11/25
第5回1号宮城県公募公債(20年)	0.17	400,000	376,360	2039/8/19	令和5年度第1回福岡県公募公債(20年)	1.093	600,000	559,122	2043/5/29
第5回2号宮城県公募公債(20年)	0.188	330,000	310,671	2039/12/20	令和5年度第2回福岡県公募公債(20年)	1.168	300,000	283,938	2043/7/27
第5回3号宮城県公募公債(20年)	0.158	330,000	309,365	2040/2/20	第15回千葉県公募公債(20年)	1.604	100,000	106,835	2033/10/14
第36回神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	92,450	2037/12/18	第25回千葉県公募公債(20年)	1.403	600,000	627,384	2034/10/13
第37回神奈川県公募公債(20年)	0.53	200,000	180,966	2038/6/18	第23回千葉県公募公債(20年)	0.63	300,000	278,262	2037/10/15
第40回神奈川県公募公債(20年)	0.2	800,000	674,536	2039/6/20	第24回千葉県公募公債(20年)	0.559	200,000	182,200	2038/4/15
第42回神奈川県公募公債(20年)	0.34	500,000	429,680	2039/9/20	第25回千葉県公募公債(20年)	0.701	700,000	645,995	2038/10/15
第52回神奈川県公募公債(20年)	1.163	600,000	567,978	2043/6/19	第27回千葉県公募公債(20年)	0.251	800,000	676,480	2039/10/14
第11回大阪府公募公債(20年)	1.693	500,000	537,875	2033/9/27	平成30年度第1回新潟県公募公債	0.653	700,000	643,069	2038/8/20
第17回大阪府公募公債(20年)	0.668	700,000	642,446	2038/9/27	令和元年度第1回新潟県公募公債	0.2	800,000	673,032	2039/8/19
第24回大阪府公募公債(20年)	1.41	300,000	297,018	2043/9/18	令和5年度第1回新潟県公募公債	0.435	800,000	687,944	2040/8/17
平成26年度第5回京都府公募公債(20年)	1.455	600,000	631,086	2034/8/10	令和元年度第2回茨城県公募公債	0.19	470,600	443,921	2039/7/29
平成30年度第5回京都府公募公債(20年)	0.658	600,000	551,628	2038/8/13	令和2年度第2回茨城県公募公債	0.356	300,000	285,249	2040/7/31
令和元年度第5回京都府公募公債(20年)	0.2	400,000	336,516	2039/8/19	第5回群馬県公募公債(20年)	1.529	600,000	635,988	2034/6/11
令和5年度第4回京都府公募公債(20年)	1.339	300,000	292,629	2043/8/14	第6回群馬県公募公債(20年)	1.267	600,000	616,170	2035/6/11
第19回兵庫県公募公債(20年)	1.57	100,000	106,413	2033/12/9	第9回群馬県公募公債(20年)	0.554	400,000	363,160	2038/6/11
第20回兵庫県公募公債(20年)	1.53	200,000	211,942	2034/3/10	第10回群馬県公募公債(20年)	0.338	500,000	431,315	2039/6/17
第22回兵庫県公募公債(20年)	1.4	500,000	522,295	2034/9/8	第11回群馬県公募公債(20年)	0.416	400,000	343,468	2040/6/12
第35回兵庫県公募公債(20年)	0.578	600,000	546,300	2038/5/28	第14回群馬県公募公債(20年)	1.101	500,000	467,190	2043/6/19
第37回兵庫県公募公債(20年)	0.472	500,000	442,360	2039/2/18	令和2年度第1回大分県公募公債	0.281	510,000	482,164	2040/7/10
第38回兵庫県公募公債(20年)	0.352	300,000	258,978	2039/6/20	令和元年度第2回長崎県公募公債	0.18	376,472	354,640	2039/8/26
第45回兵庫県公募公債(20年)	1.101	800,000	747,504	2043/6/19	平成30年度第2回島根県公募公債	0.668	700,000	643,741	2038/9/17
第2回静岡県公募公債(30年)	2.54	300,000	351,885	2038/9/17	令和元年度第2回島根県公募公債	0.2	400,000	335,796	2039/9/20
第18回静岡県公募公債(20年)	1.473	600,000	632,256	2034/7/10	令和2年度第2回島根県公募公債	0.459	800,000	689,536	2040/9/21
第19回静岡県公募公債(20年)	1.253	300,000	307,380	2035/7/27	令和5年度第1回島根県公募公債	1.419	300,000	297,435	2043/9/18
第25回静岡県公募公債(20年)	0.53	600,000	542,898	2038/6/18	令和元年度第1回栃木県公募公債	0.14	412,500	387,655	2039/10/24
第26回静岡県公募公債(20年)	0.711	600,000	555,354	2038/9/17	令和5年度第3回奈良県公募公債	1.395	300,000	297,039	2043/6/19
第28回静岡県公募公債(20年)	0.31	700,000	598,815	2039/9/20	第18回大阪市公募公債(20年)	1.262	700,000	719,565	2035/2/27
第35回静岡県公募公債(20年)	1.163	300,000	283,989	2043/6/19	第19回大阪市公募公債(20年)	1.138	600,000	607,866	2035/4/24
平成27年度第3回愛知県公募公債(20年)	1.115	700,000	707,672	2035/5/8	第26回大阪市公募公債(20年)	0.635	500,000	464,025	2037/10/23
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	0.606	400,000	369,244	2037/11/20	第27回大阪市公募公債(20年)	0.544	200,000	181,818	2038/4/20
平成30年度第2回愛知県公募公債(20年)	0.54	100,000	90,790	2038/4/30	第1回名古屋市公募公債(30年)	2.53	500,000	582,375	2035/3/20
平成30年度第12回愛知県公募公債(20年)	0.706	300,000	276,762	2038/11/15	第3回名古屋市公募公債(30年)	2.5	100,000	116,737	2037/9/18
令和元年度第5回愛知県公募公債(20年)	0.288	400,000	341,832	2039/7/12	第6回名古屋市公募公債(30年)	2.45	100,000	115,947	2039/12/20
令和5年度第4回愛知県公募公債(20年)	1.101	600,000	561,072	2043/6/12	第21回名古屋市公募公債(20年)	0.568	700,000	637,763	2038/5/18
平成27年度第1回広島県公募公債(20年)	1.212	500,000	509,410	2035/9/25	第22回名古屋市公募公債(20年)	0.431	700,000	614,145	2039/5/20
平成30年度第1回広島県公募公債(20年)	0.568	700,000	637,770	2038/5/17	第27回名古屋市公募公債(20年)	1.116	500,000	468,400	2043/5/22
平成30年度第2回広島県公募公債(20年)	0.668	600,000	551,778	2038/9/17	第16回京都市公募公債(20年)	0.611	600,000	554,172	2037/11/27
平成31年度第1回広島県公募公債(20年)	0.419	700,000	613,844	2039/4/19	第17回京都市公募公債(20年)	0.683	700,000	643,244	2038/11/26
令和元年度第2回広島県公募公債(20年)	0.2	300,000	251,847	2039/9/20	第18回京都市公募公債(20年)	0.355	400,000	343,616	2039/11/18
令和2年度第1回広島県公募公債(20年)	0.315	800,000	677,016	2040/4/17	平成25年度第12回神戸市公募公債(20年)	1.52	100,000	105,997	2034/2/17
令和5年度第1回広島県公募公債(20年)	1.41	400,000	396,024	2043/9/18	平成26年度第3回神戸市公募公債(20年)	1.482	300,000	316,407	2034/7/14
第15回埼玉県公募公債(20年)	1.166	400,000	407,016	2035/2/16	平成30年度第6回神戸市公募公債(20年)	0.668	300,000	275,889	2038/9/17
第21回埼玉県公募公債(20年)	0.625	500,000	462,290	2037/12/11	令和元年度第6回神戸市公募公債(20年)	0.2	400,000	335,796	2039/9/20
第22回埼玉県公募公債(20年)	0.568	600,000	546,624	2038/5/21	第2回横浜市公募公債(30年)	2.49	500,000	580,305	2035/3/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
地方債証券				
第28回横浜市公募公債 (20年)	1.586	300,000	319,998	2033/11/11
第30回横浜市公募公債 (20年)	1.376	550,000	573,347	2034/10/20
第31回横浜市公募公債 (20年)	1.18	300,000	305,451	2035/4/20
第40回横浜市公募公債 (20年)	0.559	700,000	637,693	2038/4/16
第48回横浜市公募公債 (20年)	1.097	700,000	653,233	2043/5/26
平成30年度第8回札幌市公募公債 (20年)	0.626	700,000	636,776	2038/12/20
令和元年度第4回札幌市公募公債 (20年)	0.15	252,660	237,176	2039/9/20
令和2年度第5回札幌市公募公債 (20年)	0.445	700,000	601,363	2040/10/12
令和5年度第2回札幌市公募公債 (20年)	1.11	200,000	187,290	2043/6/19
第18回川崎市公募公債 (20年)	1.541	600,000	637,128	2034/3/17
第20回川崎市公募公債 (20年)	1.133	200,000	202,748	2035/3/20
第27回川崎市公募公債 (20年)	0.559	300,000	273,297	2038/4/16
第30回川崎市公募公債 (20年)	0.2	600,000	505,902	2039/6/20
第33回川崎市公募公債 (20年)	0.44	600,000	517,044	2040/6/20
第16回北九州市公募公債 (20年)	1.604	100,000	106,731	2033/10/11
第17回北九州市公募公債 (20年)	1.529	600,000	635,088	2034/6/20
第18回北九州市公募公債 (20年)	1.376	200,000	208,282	2034/10/20
第19回北九州市公募公債 (20年)	1.312	600,000	618,378	2035/6/19
平成25年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.511	400,000	423,644	2034/2/17
平成26年度第2回福岡市公募公債 (20年)	1.49	600,000	633,426	2034/6/20
平成26年度第6回福岡市公募公債 (20年)	1.371	200,000	208,570	2034/9/20
平成30年度第7回福岡市公募公債 (20年)	0.701	700,000	645,967	2038/10/19
平成31年度第3回福岡市公募公債 (20年)	0.419	600,000	526,122	2039/4/22
2019年度第5回福岡市公募公債 (20年)	0.286	300,000	256,026	2039/7/29
2019年度第7回福岡市公募公債 (20年)	0.271	500,000	424,000	2039/10/24
2023年度第3回福岡市公募公債 (20年)	1.294	400,000	387,408	2043/8/21
平成29年度第4回広島市公募公債	0.62	600,000	554,880	2037/11/20
平成30年度第2回広島市公募公債	0.639	700,000	641,851	2038/8/20
平成30年度第4回広島市公募公債	0.706	700,000	645,337	2038/11/19
令和元年度第2回広島市公募公債	0.2	800,000	673,032	2039/8/19
令和元年度第4回広島市公募公債	0.355	400,000	343,596	2039/11/21
令和2年度第2回広島市公募公債	0.435	500,000	429,925	2040/8/21
平成29年度第1回仙台市公募公債	0.616	700,000	648,074	2037/10/19
平成30年度第2回仙台市公募公債	0.729	700,000	648,431	2038/10/18
令和元年度第1回仙台市公募公債	0.17	320,000	301,257	2039/8/19
令和元年度第2回仙台市公募公債	0.15	679,413	639,218	2039/10/14
令和5年度第3回千葉市公募公債	1.101	300,000	280,305	2043/6/23
令和5年度第5回千葉市公募公債	1.405	300,000	297,270	2043/6/19
平成26年度第1回福井県公募公債	1.482	100,000	105,473	2034/7/18
平成27年度第1回福井県公募公債	1.28	600,000	616,446	2035/7/17
平成30年度第1回福井県公募公債	0.535	500,000	451,855	2038/7/30
令和元年度第1回福井県公募公債	0.286	400,000	341,368	2039/7/29
令和2年度第1回福井県公募公債	0.249	523,077	493,115	2040/7/13
令和2年度第3回福井県公募公債	0.449	600,000	517,608	2040/8/3
令和5年度第4回福井県公募公債	1.168	300,000	283,941	2043/7/24
令和元年度第1回徳島県公募公債	0.18	320,000	301,644	2039/7/29
令和2年度第1回徳島県公募公債	0.281	340,000	321,218	2040/7/31
令和元年度第1回岡山県公募公債	0.192	330,000	310,784	2039/12/20
第5回神奈川県居住宅供給公社債券	0.709	600,000	547,836	2038/4/23
第6回神奈川県居住宅供給公社債券	0.215	400,000	390,852	2029/4/23
第7回神奈川県居住宅供給公社債券	0.534	300,000	263,268	2039/4/22
第1回川崎市土地開発公社債券	0.02	700,000	699,181	2024/6/25
第2回営企業債券 (30年)	2.39	100,000	113,908	2033/12/20
第3回営企業債券 (30年)	2.59	300,000	347,502	2033/12/20
第8回地方公共団体金融機構債券 (30年)	2.5	200,000	231,098	2035/9/21

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
地方債証券				
第37回地方公共団体金融機構債券 (20年)	1.535	200,000	210,804	2034/6/28
第42回地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.999	100,000	99,388	2035/1/12
第44回地方公共団体金融機構債券 (20年)	1.298	300,000	306,993	2035/6/28
第46回地方公共団体金融機構債券 (20年)	1.189	100,000	101,045	2035/9/28
第51回地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.377	400,000	364,992	2036/4/28
第57回地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.564	200,000	181,666	2038/6/28
第77回地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.2	500,000	419,110	2039/9/28
第79回地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.345	400,000	342,104	2039/12/28
第80回地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.354	500,000	427,645	2040/1/27
第83回地方公共団体金融機構債券 (20年)	0.44	400,000	344,632	2040/6/28
第106回地方公共団体金融機構債券	1.156	400,000	377,848	2043/7/28
第107回地方公共団体金融機構債券	1.485	400,000	401,272	2043/9/28
第11回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.763	300,000	281,772	2037/2/27
第10回大阪府住宅供給公社債券	0.395	300,000	299,286	2027/6/18
第12回大阪府住宅供給公社債券	0.34	500,000	494,245	2028/6/18
第134回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.514	500,000	483,765	2032/2/27
第135回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.768	400,000	375,924	2037/2/27
第151回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.32	400,000	335,396	2040/2/28
第121回福岡北九州高速道路債券	2.31	400,000	440,048	2029/12/20
第147回福岡北九州高速道路債券	0.502	500,000	483,205	2032/3/19
第148回福岡北九州高速道路債券	0.731	500,000	467,160	2037/3/19
第150回福岡北九州高速道路債券	0.396	600,000	567,390	2033/3/18
第24回東京都住宅供給公社債券	0.519	500,000	455,670	2036/9/12
第26回東京都住宅供給公社債券	0.697	600,000	551,388	2037/9/11
第29回東京都住宅供給公社債券	0.749	200,000	182,528	2038/9/17
第30回東京都住宅供給公社債券	0.496	150,000	144,921	2038/9/17
第32回東京都住宅供給公社債券	0.341	300,000	252,708	2039/9/26
第33回東京都住宅供給公社債券	0.25	247,500	233,654	2039/9/26
第36回東京都住宅供給公社債券	0.416	400,000	369,156	2034/12/22
第37回東京都住宅供給公社債券	0.435	200,000	183,770	2035/9/21
小 計		85,992,222	80,628,651	
特殊債券 (除く金融債)				
第61回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	119,769	2038/6/30
第233回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.315	500,000	518,245	2034/11/30
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	500,000	512,905	2034/12/28
第237回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.97	500,000	499,005	2035/1/31
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	500,000	509,530	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	500,000	512,220	2035/3/30
第245回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.179	600,000	605,574	2035/4/27
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	300,000	305,757	2035/5/31
第250回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	600,000	617,892	2035/6/29
第284回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.249	500,000	444,235	2036/7/31
第293回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.397	500,000	457,140	2036/10/31
第296回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.522	200,000	185,628	2036/11/28
第298回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.547	500,000	465,060	2036/12/26
第301回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.618	600,000	562,764	2037/1/30
第304回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.737	700,000	666,043	2037/2/27
第307回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.681	100,000	94,359	2037/3/31
第314回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.59	600,000	558,006	2037/5/29
第316回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.569	100,000	92,711	2037/6/30
第322回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	600,000	554,166	2037/8/31
第325回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.549	100,000	92,135	2037/9/30
第328回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.585	600,000	554,844	2037/10/30
第331回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.566	700,000	644,658	2037/11/30
第343回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.562	100,000	91,606	2038/3/31

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第349回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.538	700,000	638,190	2038/5/31
第352回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.543	100,000	91,077	2038/6/30
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	700,000	643,741	2038/8/31
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	500,000	459,050	2038/9/30
第364回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	700,000	648,172	2038/10/29
第367回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.676	100,000	92,265	2038/11/30
第370回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.6	700,000	637,630	2038/12/28
第373回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.522	700,000	629,118	2039/1/31
第376回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.46	700,000	622,468	2039/2/28
第379回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.419	700,000	617,232	2039/3/31
第21回政府保証民間都市開発債券	0.618	300,000	274,134	2038/12/27
第22回政府保証民間都市開発債券	0.245	1,000,000	842,450	2040/2/28
第23回政府保証民間都市開発債券	0.397	800,000	687,400	2040/6/29
小 計		17,700,000	16,547,179	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第530回中部電力株式会社社債	0.274	600,000	583,464	2029/6/25
第554回中部電力株式会社社債	0.463	100,000	95,170	2032/2/25
第556回中部電力株式会社社債	0.544	800,000	765,496	2032/4/23
第511回関西電力株式会社社債	0.41	600,000	595,920	2027/9/17
第515回関西電力株式会社社債	0.435	600,000	594,000	2028/4/25
第541回関西電力株式会社社債	0.37	800,000	756,912	2031/9/19
第544回関西電力株式会社社債	0.34	500,000	470,775	2031/10/24
第548回関西電力株式会社社債	0.574	900,000	858,924	2032/4/23
第551回関西電力株式会社社債	0.664	800,000	768,520	2032/5/25
第398回中国電力株式会社社債	0.425	400,000	398,500	2027/7/23
第404回中国電力株式会社社債	0.355	100,000	98,820	2028/4/25
第416回中国電力株式会社社債	0.355	300,000	293,247	2029/5/25
第434回中国電力株式会社社債	0.463	500,000	475,115	2032/2/25
第436回中国電力株式会社社債	0.534	300,000	286,044	2032/4/23
第311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	202,402	2027/9/24
第318回北陸電力株式会社社債	0.26	450,000	447,259	2026/12/25
第321回北陸電力株式会社社債	0.365	300,000	298,740	2027/4/23
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	497,515	2027/6/25
第342回北陸電力株式会社社債	0.3	100,000	94,768	2031/4/25
第349回北陸電力株式会社社債	0.544	600,000	572,556	2032/4/23
第491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	599,106	2027/2/25
第492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	398,884	2027/4/23
第496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	297,537	2027/9/24
第517回東北電力株式会社社債	0.31	100,000	96,388	2030/2/25
第536回東北電力株式会社社債	0.29	400,000	376,200	2031/9/25
第538回東北電力株式会社社債	0.33	700,000	658,875	2031/11/25
第541回東北電力株式会社社債	0.35	700,000	658,455	2032/1/23
第543回東北電力株式会社社債	0.34	700,000	696,444	2027/4/23
第544回東北電力株式会社社債	0.574	700,000	669,095	2032/4/23
第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	99,449	2026/11/25
第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	198,534	2027/11/25
第307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	289,884	2029/9/25
第309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	483,835	2030/5/24
第317回四国電力株式会社社債	0.6	200,000	162,190	2041/10/25
第320回四国電力株式会社社債	0.534	200,000	190,844	2032/4/23
第323回四国電力株式会社社債	0.659	800,000	770,976	2032/6/25
第489回九州電力株式会社社債	0.44	400,000	387,344	2030/5/24
第502回九州電力株式会社社債	0.493	500,000	475,175	2032/2/25
第504回九州電力株式会社社債	0.589	700,000	668,871	2032/4/23
第507回九州電力株式会社社債	0.644	800,000	767,864	2032/5/25

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第321回北海道電力株式会社社債	0.886	11,000	11,091	2024/12/25
第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	199,338	2027/6/25
第15回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.89	600,000	587,202	2030/7/24
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	600,000	596,130	2029/10/9
第40回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.37	500,000	484,580	2035/7/13
第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	800,000	770,680	2031/4/22
第46回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.05	700,000	647,297	2036/4/22
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	800,000	779,960	2036/8/29
第50回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.94	800,000	710,562	2032/4/26
第14回新関西国際空港株式会社社債	1.318	600,000	614,640	2034/12/20
第16回新関西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	303,270	2035/9/20
第18回新関西国際空港株式会社社債	0.675	500,000	458,625	2037/12/18
第23回新関西国際空港株式会社社債	0.512	700,000	616,945	2038/12/20
第97回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.536	700,000	630,532	2038/7/12
第108回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.439	700,000	618,558	2039/4/11
第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.253	400,000	334,724	2039/7/11
第125回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.379	700,000	597,856	2040/4/24
第130回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.479	500,000	432,620	2040/7/20
第135回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.35	500,000	457,650	2035/10/15
第147回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.443	200,000	169,140	2041/7/12
第175回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	1.111	300,000	280,716	2043/7/14
第34回日本政策投資銀行債券	2.67	200,000	235,886	2037/3/19
第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	117,364	2035/9/20
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	200,000	232,986	2035/12/20
第43回日本高速道路保有・債務返済機構債券(指定金融機関等限定)	0.5	700,000	626,675	2038/9/17
第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.55	500,000	527,585	2034/3/17
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.133	100,000	100,598	2035/3/20
第191回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.661	200,000	185,098	2037/12/18
第194回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.64	500,000	461,205	2037/12/18
第210回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.677	700,000	643,720	2038/9/17
第313回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.304	800,000	776,040	2043/8/21
第318回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.419	1,000,000	991,450	2043/9/18
第28回道路債券	2.83	500,000	589,585	2033/12/20
第33回道路債券	2.91	100,000	119,028	2034/6/20
第43回道路債券	2.66	200,000	233,410	2034/12/20
第124回都市再生債券	0.273	300,000	268,986	2036/6/20
第128回都市再生債券	0.39	500,000	453,995	2036/9/19
第131回都市再生債券	0.487	500,000	458,680	2036/11/25
第133回都市再生債券	0.767	200,000	189,684	2037/2/20
第141回都市再生債券	0.63	100,000	91,873	2038/2/19
第145回都市再生債券	0.584	300,000	272,442	2038/6/18
第150回都市再生債券	0.716	500,000	461,005	2038/11/19
第156回都市再生債券	0.343	400,000	344,424	2039/6/17
第157回都市再生債券	0.2	400,000	334,744	2039/9/16
第160回都市再生債券	0.335	600,000	511,134	2039/12/19
第167回都市再生債券	0.43	300,000	255,366	2040/12/20
第6回中部国際空港株式会社社債	0.206	500,000	490,065	2029/2/22
第125回一般担保住宅金融支援機構債券	1.898	100,000	108,959	2033/1/25
第159回一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	300,000	301,101	2035/5/18
第166回一般担保住宅金融支援機構債券	1.221	100,000	101,271	2035/8/20
第220回一般担保住宅金融支援機構債券	0.616	200,000	184,388	2037/10/20
第239回一般担保住宅金融支援機構債券	0.393	300,000	285,261	2033/6/20
第255回一般担保住宅金融支援機構債券	0.548	200,000	179,302	2039/1/20
第257回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	300,000	281,859	2034/2/20
第279回一般担保住宅金融支援機構債券	0.285	800,000	734,872	2034/12/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第283回一般担保住宅金融支援機構債券	0.274	400,000	365,812	2035/2/20
第308回一般担保住宅金融支援機構債券	0.306	200,000	181,504	2035/12/20
第315回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	500,000	455,005	2036/4/18
第355回一般担保住宅金融支援機構債券	1.111	300,000	280,710	2043/7/17
第357回一般担保住宅金融支援機構債券	1.313	800,000	777,152	2043/8/20
第21回成田国際空港株式会社社債	0.427	500,000	453,010	2036/8/22
第23回成田国際空港株式会社社債	0.677	700,000	651,889	2036/12/16
第25回成田国際空港株式会社社債	0.671	300,000	275,031	2037/12/18
第27回成田国際空港株式会社社債	0.657	600,000	547,056	2038/3/12
第30回成田国際空港株式会社社債	0.77	700,000	643,125	2038/10/22
第35回成田国際空港株式会社社債	0.27	100,000	83,405	2039/9/16
第37回成田国際空港株式会社社債	0.424	300,000	254,988	2040/1/27
第39回成田国際空港株式会社社債	0.409	600,000	549,324	2035/10/26
第40回成田国際空港株式会社社債	0.529	500,000	443,005	2038/10/28
第41回成田国際空港株式会社社債	0.575	600,000	516,102	2040/10/26
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	107,298	2033/9/20
第27回国際協力機構債券	1.451	400,000	417,416	2034/9/20
第33回国際協力機構債券	1.13	100,000	100,102	2035/12/20
第36回国際協力機構債券	0.313	100,000	90,153	2036/6/20
第39回国際協力機構債券	0.744	400,000	378,092	2037/2/20
第43回国際協力機構債券	0.625	700,000	644,427	2037/12/18
第45回国際協力機構債券	0.559	600,000	542,706	2038/6/18
第49回国際協力機構債券	0.333	300,000	257,748	2039/6/20
第54回国際協力機構債券	0.445	600,000	516,684	2040/6/26
第56回国際協力機構債券	0.459	700,000	601,314	2040/9/20
第77回国際協力機構債券	1.404	900,000	892,359	2043/6/19
第58回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.81	600,000	649,038	2033/8/19
第63回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.56	400,000	422,552	2034/2/27
第69回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.441	500,000	521,590	2034/8/4
第75回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.157	200,000	201,780	2035/2/26
第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.221	200,000	202,540	2035/8/17
第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.739	500,000	472,295	2037/2/27
第102回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.428	500,000	482,790	2032/5/28
第106回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.616	500,000	461,335	2037/8/25
第113回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.63	200,000	183,728	2038/2/26
第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.663	400,000	366,788	2038/8/27
第121回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.515	500,000	478,310	2033/11/28
第164回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.326	300,000	292,695	2043/8/28
第3回I N P E X株式会社無担保社債	0.25	600,000	566,352	2031/10/15
第22回株式会社大林組無担保社債	0.385	600,000	592,662	2028/9/13
第23回清水建設株式会社無担保社債	0.25	800,000	800,536	2024/8/2
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	200,000	198,242	2027/11/30
第25回清水建設株式会社無担保社債	0.27	200,000	193,946	2029/9/3
第10回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.524	700,000	693,448	2028/11/1
第12回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.35	600,000	583,578	2029/7/19
第14回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.47	500,000	484,415	2030/7/12
第8回西松建設株式会社無担保社債	0.18	800,000	799,176	2024/9/20
第26回前田建設工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	299,568	2024/9/12
第3回住友林業株式会社無担保社債	0.33	600,000	598,704	2026/6/17
第5回住友林業株式会社無担保社債	0.35	400,000	394,900	2028/3/7
第8回住友林業株式会社無担保社債	0.38	500,000	490,860	2029/3/6
第9回住友林業株式会社無担保社債	0.28	700,000	678,755	2029/12/6
第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	99,365	2027/6/1
第21回積水ハウス株式会社無担保社債	0.2	800,000	796,552	2026/7/17
第4回協和エンコ株式会社無担保社債	0.12	500,000	498,930	2024/10/25

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第5回協和エンコ株式会社無担保社債	0.19	200,000	198,094	2026/10/23
第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	0.2	600,000	582,996	2029/7/13
第15回森永乳業株式会社無担保社債	0.37	700,000	696,178	2027/7/23
第16回森永乳業株式会社無担保社債	0.395	200,000	197,458	2028/9/14
第17回森永乳業株式会社無担保社債	0.24	400,000	387,196	2029/9/6
第7回明細ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	300,000	300,234	2024/9/13
第1回雪印メグミルク株式会社無担保社債	0.45	800,000	786,328	2028/12/25
第12回日本ハム株式会社無担保社債	0.36	600,000	589,866	2029/9/20
第30回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.2	600,000	594,876	2026/9/4
第34回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.3	500,000	482,965	2029/9/5
第10回サヒigroupホールディングス株式会社無担保社債	0.33	700,000	696,675	2027/6/11
第2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	0.509	400,000	398,936	2028/9/7
第19回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.23	800,000	774,832	2029/9/5
第1回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.37	100,000	96,938	2030/6/4
第16回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.315	200,000	199,514	2027/4/23
第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.22	800,000	797,544	2026/6/7
第10回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.519	800,000	768,752	2032/6/8
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	600,000	583,632	2033/5/25
第3回コ・コアボトラーズジャパンホールディングス社債	0.27	600,000	581,382	2029/9/19
第12回日清オイログループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	296,994	2027/12/3
第2回株式会社J-オイルミルズ無担保社債	0.37	600,000	596,214	2027/5/28
第35回双日株式会社無担保社債	0.605	300,000	296,532	2028/3/8
第25回味の素株式会社無担保社債	0.355	700,000	699,181	2027/3/9
第3回キユーピー株式会社無担保社債	0.23	700,000	698,740	2026/2/13
第25回株式会社ニチレイ無担保社債	0.24	300,000	296,988	2027/8/31
第7回中央日本地建物グループ株式会社無担保社債	0.909	300,000	297,837	2028/8/15
第6回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.435	700,000	693,280	2027/8/4
第43回東洋紡株式会社無担保社債	0.25	400,000	390,696	2028/12/7
第4回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,877	2024/12/20
第5回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.33	300,000	297,597	2027/9/17
第14回森ビル株式会社無担保社債	0.861	300,000	301,593	2024/8/14
第21回森ビル株式会社無担保社債	0.44	600,000	597,900	2027/1/16
第13回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.41	500,000	496,515	2027/7/30
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	700,000	695,436	2027/7/16
第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	589,620	2028/4/25
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	499,475	2024/9/6
第12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	482,845	2029/9/6
第15回旭化成株式会社無担保社債	0.28	500,000	479,575	2030/6/19
第14回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	198,520	2028/1/26
第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	296,709	2028/11/29
第40回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	700,000	677,124	2030/7/17
第27回北越コーポレーション株式会社無担保社債	0.22	600,000	600,168	2024/3/13
第25回レンゴー株式会社無担保社債	0.415	200,000	196,302	2028/12/13
第27回レンゴー株式会社無担保社債	0.3	800,000	770,224	2029/12/12
第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	692,811	2027/9/13
第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	98,304	2028/4/17
第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	390,680	2029/4/16
第22回デンカ株式会社無担保社債	0.23	500,000	495,375	2026/12/4
第3回エン・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	394,836	2028/2/29
第4回エン・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	600,000	591,306	2028/8/31
第6回エン・ウォーター株式会社無担保社債	0.38	400,000	387,292	2030/5/31
第11回エン・ウォーター株式会社無担保社債	0.84	500,000	485,350	2033/7/21
第8回株式会社カネカ無担保社債	0.24	200,000	192,108	2029/9/12
第23回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	0.34	400,000	382,532	2030/9/3
第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,157	2027/7/23

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第50回三井化学株式会社無担保社債	0.27	500,000	482,120	2029/12/5
第80回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.42	600,000	589,170	2028/12/19
第30回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.28	1,000,000	959,200	2030/2/28
第17回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.5	200,000	192,900	2030/12/13
第6回積水化学工業株式会社無担保社債	0.28	700,000	698,208	2026/6/12
第7回積水化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	485,015	2029/9/13
第4回日本化薬株式会社無担保社債	0.13	400,000	398,556	2024/12/20
第3回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.25	600,000	596,310	2026/9/16
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	600,000	591,630	2028/3/23
第6回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.24	500,000	483,985	2029/9/27
第3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	691,740	2028/10/25
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	1,000,000	948,060	2031/10/14
第4回アステラス製薬株式会社無担保社債	0.519	500,000	498,915	2028/8/31
第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	594,480	2027/6/2
第9回テルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	991,890	2027/4/26
第3回みらいホールディングス株式会社無担保社債	0.15	400,000	399,016	2024/10/25
第3回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.375	1,000,000	983,510	2029/3/7
第15回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.305	700,000	687,050	2029/1/25
第7回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	297,768	2027/3/3
第18回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	499,615	2024/7/26
第13回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	697,550	2026/7/28
第2回JXTGホールディングス株式会社無担保社債	0.405	700,000	695,373	2027/8/3
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	0.834	400,000	386,396	2032/6/15
第16回横浜ゴム株式会社無担保社債	0.58	800,000	758,760	2032/6/4
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	800,000	794,936	2027/4/21
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	982,120	2029/4/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	595,788	2027/5/28
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.37	800,000	785,808	2028/6/14
第11回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.27	500,000	484,440	2029/6/20
第1回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.28	400,000	398,476	2026/9/18
第4回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,498	2027/5/20
第5回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.23	400,000	400,232	2024/12/20
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	680,981	2029/6/20
第20回ジェンエイホールディングス株式会社無担保社債	0.703	600,000	603,006	2024/9/19
第20回ジェンエイホールディングス株式会社無担保社債	0.26	500,000	498,345	2026/5/27
第29回ジェンエイホールディングス株式会社無担保社債	0.365	600,000	586,530	2029/5/25
第32回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.25	800,000	771,032	2029/12/13
第26回住友電気工業株式会社無担保社債	0.3	700,000	695,275	2027/3/1
第31回住友電気工業株式会社無担保社債	0.809	500,000	486,795	2033/7/13
第13回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	600,000	596,772	2026/12/16
第14回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.29	600,000	580,608	2029/10/25
第29回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.08	500,000	496,280	2026/6/19
第5回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.13	500,000	499,660	2024/7/24
第6回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.29	400,000	387,036	2030/1/24
第15回株式会社コプタ無担保社債	0.514	600,000	574,074	2032/6/2
第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,376	2026/9/30
第23回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.13	600,000	594,696	2026/10/9
第24回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.18	600,000	578,424	2029/10/11
第27回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.26	300,000	287,133	2030/9/18
第6回株式会社タダノ無担保社債	0.25	800,000	790,192	2026/12/11
第1回グローリー株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,855	2023/12/7
第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	296,442	2027/12/6
第51回日本精工株式会社無担保社債	0.19	300,000	297,612	2026/9/2
第57回日本精工株式会社無担保社債	0.539	200,000	199,516	2028/9/11
第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.345	400,000	393,536	2028/3/8

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第9回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	500,000	481,900	2029/11/28
第30回富士電機株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,102	2027/5/21
第63回日本電気株式会社無担保社債	0.84	400,000	385,392	2033/7/11
第15回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.34	300,000	298,857	2026/9/18
第17回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.36	700,000	692,972	2027/9/6
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	800,000	772,280	2030/7/16
第19回パナソニック株式会社無担保社債	0.37	600,000	574,740	2030/3/5
第24回パナソニック株式会社無担保社債	0.79	700,000	697,616	2028/9/14
第33回ソニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	299,955	2026/9/18
第35回ソニー株式会社無担保社債	0.18	400,000	396,892	2026/10/9
第36回ソニー株式会社無担保社債	0.3	700,000	678,083	2029/10/10
第6回TDK株式会社無担保社債	0.31	200,000	197,746	2027/7/28
第7回TDK株式会社無担保社債	0.43	800,000	771,640	2030/7/26
第5回株式会社旭硝子無担保社債	0.18	700,000	691,285	2026/10/16
第6回株式会社旭硝子無担保社債	0.27	600,000	577,326	2029/10/17
第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	1,000,000	993,390	2027/6/18
第3回株式会社村田製作所無担保社債	0.06	800,000	798,696	2024/9/10
第1回東海理化電機製作所無担保社債	0.34	300,000	297,066	2027/6/7
第4回昭和リース株式会社無担保社債	0.43	800,000	797,136	2024/12/18
第5回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.37	500,000	498,165	2029/9/4
第7回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.6	500,000	497,110	2030/9/3
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	600,000	595,740	2026/9/25
第13回本田技研工業株式会社無担保社債	0.12	800,000	798,368	2025/3/5
第14回本田技研工業株式会社無担保社債	0.15	800,000	790,528	2027/3/5
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	400,000	399,524	2025/3/13
第1回日本生命2019年金融流動化株式無担保社債(劣後)	0.25	800,000	799,480	2024/8/1
第1回明治安田生命2019年基金特定目的会社特定社債	0.29	800,000	799,064	2024/8/2
第1回日本生命2021年金融流動化株式無担保社債(劣後)	0.28	400,000	397,300	2026/8/3
第3回株式会社トプコン無担保社債	0.3	500,000	498,750	2025/6/24
第4回大日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	782,144	2029/7/19
第4回株式会社ニフコ無担保社債	0.25	500,000	492,755	2025/5/8
第5回株式会社ニフコ無担保社債	0.385	500,000	498,085	2028/5/8
第6回株式会社ニフコ無担保社債	0.28	700,000	676,830	2029/9/11
第102回丸紅株式会社無担保社債	0.756	300,000	301,455	2024/7/25
第7回長瀬産業株式会社無担保社債	0.29	600,000	579,528	2029/12/12
第8回長瀬産業株式会社無担保社債	0.64	400,000	380,936	2032/6/9
第19回豊田通商株式会社無担保社債	0.954	100,000	101,752	2026/7/10
第63回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	213,438	2027/4/23
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	800,000	779,152	2029/7/11
第75回三井物産株式会社無担保社債	0.23	700,000	675,990	2029/12/12
第36回株式会社丸井グループ無担保社債	0.25	300,000	297,432	2026/10/16
第20回株式会社三菱UFフィナンシャル・グループ(劣後)	0.29	700,000	696,290	2030/1/15
第1回株式会社三菱UFフィナンシャル・グループ(劣後)	0.94	100,000	100,181	2024/6/26
第2回株式会社三菱UFフィナンシャル・グループ(劣後)	0.25	700,000	687,435	2027/11/4
第3回株式会社三菱UFフィナンシャル・グループ(劣後)	0.42	600,000	555,504	2032/11/4
第7回株式会社三菱UFフィナンシャル・グループ(劣後)	1.393	200,000	200,978	2030/6/18
第7回株式会社三菱UFフィナンシャル・グループ	0.71	700,000	658,735	2033/6/9
第12回株式会社三菱UFフィナンシャル・グループ	0.521	1,000,000	1,000,510	2025/6/9
第20回株式会社リそなホールディングス無担保社債	0.27	500,000	498,745	2025/7/23
第1回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.857	200,000	200,182	2024/9/5
第3回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.66	430,000	427,592	2026/2/27
第6回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.575	800,000	786,600	2027/6/8
第5回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.53	600,000	596,430	2030/9/2
第10回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.4	1,000,000	980,850	2031/12/22
第4回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.62	725,000	716,495	2026/12/18

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	2.54	600,000	643,980	2027/7/27
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	200,000	213,124	2027/4/20
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	600,000	659,982	2029/10/16
第4回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.27	400,000	424,368	2030/9/27
第26回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.95	200,000	204,798	2025/11/12
第29回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.16	100,000	103,063	2026/1/20
第30回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	103,622	2026/6/9
第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.849	400,000	400,536	2024/9/12
第4回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	1.328	800,000	798,248	2030/5/29
第7回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.92	480,000	480,950	2025/10/15
第9回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.469	240,000	237,379	2026/6/15
第13回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.545	130,000	128,666	2026/9/15
第14回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.585	710,000	693,982	2028/3/16
第6回株式会社三井住友フィナンシャルグループ	1.2	800,000	787,208	2034/6/8
第9回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	500,000	522,470	2026/12/22
第12回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.464	800,000	838,408	2027/3/15
第1回株式会社千葉銀行無担保社債(劣後特約付)	0.911	600,000	599,892	2024/8/29
第4回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.48	800,000	798,656	2029/4/26
第5回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.37	800,000	796,184	2029/11/26
第6回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.49	800,000	789,472	2031/10/29
第7回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.95	300,000	297,300	2032/9/27
第8回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.92	100,000	102,330	2025/10/28
第6回住信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.78	600,000	628,656	2026/4/27
第8回住信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.49	400,000	420,676	2027/5/10
第13回住信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.341	300,000	311,271	2026/6/15
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	0.15	700,000	693,553	2026/11/6
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	500,000	501,925	2024/12/20
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	496,775	2027/9/17
第2回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.875	500,000	482,950	2030/10/30
第28回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	1.412	1,300,000	1,267,240	2033/7/13
第9回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	1.015	1,000,000	992,000	2033/7/13
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	500,000	517,960	2026/6/1
第28回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.17	600,000	623,820	2026/12/18
第5回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.49	100,000	103,712	2026/1/30
第7回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.87	200,000	211,650	2026/11/6
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.52	500,000	526,395	2027/4/27
第15回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	3.03	200,000	219,836	2029/9/28
第18回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.14	400,000	413,776	2026/9/11
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	500,000	496,685	2026/12/11
第21回みずほリース株式会社無担保社債	0.599	300,000	298,776	2028/9/6
第3回NNTファイナンス株式会社無担保社債	0.529	600,000	578,832	2031/12/19
第5回NNTファイナンス株式会社無担保社債	0.489	600,000	569,262	2032/9/17
第27回SBIホールディングス株式会社無担保社債	0.8	800,000	799,280	2024/12/23
第11回オンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.3	800,000	798,688	2025/1/30
第8回オンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,874	2024/9/20
第9回オンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.38	700,000	695,296	2026/9/18
第23回株式会社リेंटコーポレーション無担保社債	0.55	800,000	748,104	2032/1/20
第5回株式会社アブラスフィナンシャル無担保社債	0.25	600,000	599,940	2023/10/13
第6回株式会社アブラスフィナンシャル無担保社債	0.29	600,000	597,450	2024/12/5
第217回オリックス株式会社無担保社債	0.589	600,000	598,128	2028/8/30
第12回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.726	400,000	401,856	2024/8/5
第10回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.25	200,000	200,108	2024/9/13
第17回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.45	300,000	297,891	2028/2/8
第20回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.41	600,000	592,266	2028/8/3
第59回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.385	200,000	197,114	2028/5/26

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第6回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.35	200,000	196,622	2028/7/12
第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.37	600,000	563,220	2031/12/1
第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.33	200,000	195,004	2029/1/24
第51回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.34	200,000	199,790	2024/8/9
第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.75	800,000	793,912	2027/9/3
第6回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.13	400,000	399,856	2024/7/31
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	400,000	396,912	2026/11/13
第2回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	2.749	300,000	288,318	2032/10/14
第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	109,638	2030/12/20
第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	107,836	2033/8/2
第67回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	294,261	2029/4/13
第71回三井不動産株式会社無担保社債	0.31	600,000	580,140	2030/4/16
第42回三井不動産株式会社無担保社債	0.81	700,000	682,647	2033/6/6
第84回三井不動産株式会社無担保社債	1.057	300,000	297,954	2033/9/12
第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	216,516	2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	214,694	2032/9/17
第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.425	300,000	323,019	2027/10/29
第113回三菱地所株式会社無担保社債	1.067	100,000	101,068	2024/12/27
第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	298,662	2026/12/18
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	297,414	2027/6/18
第130回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	700,000	681,387	2029/8/3
第108回三井不動産株式会社無担保社債	0.4	500,000	498,575	2027/5/7
第111回住友不動産株式会社無担保社債	0.52	500,000	497,995	2028/4/28
第8回NNTファイナンス株式会社無担保社債	1.99	300,000	324,144	2031/9/19
第13回NNTファイナンス株式会社無担保社債	1.09	200,000	204,724	2029/9/20
第111回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	600,000	578,784	2031/9/5
第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	459,565	2036/12/5
第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	900,000	816,210	2037/9/1
第8回東武鉄道株式会社無担保社債	1.758	500,000	446,630	2038/5/24
第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	687,632	2039/7/22
第123回東武鉄道株式会社無担保社債	0.8	700,000	607,586	2040/4/20
第35回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.733	600,000	585,816	2031/6/27
第36回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.7	700,000	677,691	2032/1/30
第37回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.681	700,000	667,940	2033/3/4
第38回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.778	400,000	381,964	2033/9/20
第39回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.495	200,000	197,242	2029/1/25
第40回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.619	700,000	651,252	2034/6/20
第41回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.71	700,000	600,775	2039/10/25
第2回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.6	700,000	685,146	2030/5/22
第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	674,336	2039/9/16
第4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	518,250	2040/6/8
第76回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.563	500,000	520,420	2027/6/7
第78回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.528	400,000	417,488	2028/6/12
第80回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.211	200,000	205,888	2029/4/27
第82回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.307	600,000	612,306	2033/6/3
第83回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.459	200,000	193,498	2031/4/22
第84回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.662	100,000	92,274	2036/4/22
第85回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	556,986	2036/9/26
第39回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.723	700,000	629,755	2038/5/28
第38回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.291	600,000	618,774	2028/12/11
第39回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.222	500,000	513,645	2029/6/12
第40回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.804	300,000	277,518	2036/12/1
第41回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.751	700,000	637,931	2037/6/12
第42回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.77	700,000	634,732	2037/12/4
第43回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.676	1,000,000	885,370	2038/7/12

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第44回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.576	600,000	509,640	2039/11/28
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	600,000	517,542	2040/6/11
第68回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.098	600,000	611,808	2030/6/12
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	457,985	2036/8/29
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	642,817	2037/5/29
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	545,898	2037/11/30
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	800,000	724,128	2038/8/30
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	700,000	689,213	2028/12/20
第83回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.209	400,000	389,088	2029/6/20
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	520,008	2039/6/20
第88回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.73	800,000	696,064	2040/4/23
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	107,652	2027/11/29
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	97,646	2031/3/10
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	496,865	2027/9/17
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	549,462	2037/9/18
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	0.295	100,000	99,119	2027/11/29
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	454,880	2037/11/27
第40回京王電鉄株式会社無担保社債	0.205	600,000	580,050	2030/1/30
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	348,400	2040/5/25
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	577,392	2031/6/20
第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	543,558	2038/9/7
第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	891,090	2039/3/8
第54回京成電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	345,464	2040/6/12
第57回京成電鉄株式会社無担保社債	0.7	400,000	342,464	2040/8/31
第45回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.55	100,000	106,354	2026/7/17
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	106,349	2026/9/18
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.26	500,000	532,520	2027/4/16
第51回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	215,202	2027/9/17
第55回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.149	300,000	326,271	2029/12/21
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.249	300,000	328,509	2030/3/22
第71回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.905	400,000	430,168	2030/9/27
第73回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.098	100,000	108,869	2030/12/20
第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	200,000	208,056	2026/12/22
第86回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.732	300,000	319,224	2032/7/23
第91回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.751	300,000	319,737	2032/12/27
第103回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	400,000	413,564	2034/7/25
第106回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.981	100,000	97,528	2035/1/29
第120回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.675	500,000	458,765	2037/1/27
第143回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.444	800,000	673,888	2039/12/23
第15回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	200,000	214,730	2027/12/20
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	108,336	2028/3/17
第21回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.247	300,000	326,058	2029/3/21
第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.175	200,000	217,430	2029/9/18
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.262	200,000	219,158	2030/3/12
第28回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.111	800,000	870,368	2030/6/11
第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	207,830	2034/6/20
第38回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.288	400,000	403,512	2034/12/12
第40回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.21	400,000	398,328	2035/8/31
第44回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.175	500,000	496,820	2026/12/11
第61回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.591	800,000	685,376	2040/5/21
第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.31	300,000	321,804	2027/9/17
第34回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.3	300,000	322,527	2027/12/20
第37回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	216,798	2028/5/22
第58回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.895	200,000	215,222	2031/12/16
第65回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.786	500,000	532,015	2033/9/13

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第69回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	600,000	620,058	2034/7/28
第70回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.309	100,000	102,761	2032/9/30
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	700,000	711,627	2034/11/28
第73回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.014	700,000	684,999	2035/1/26
第75回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.196	100,000	99,712	2035/4/20
第76回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.297	100,000	100,692	2035/6/18
第6回東京地下鉄株式会社社債	2.43	100,000	107,737	2027/9/17
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.21	200,000	215,146	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.33	500,000	546,865	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	106,147	2032/5/25
第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	106,544	2033/6/14
第16回東京地下鉄株式会社社債	0.778	300,000	282,753	2036/3/11
第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	621,390	2036/6/20
第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	700,000	638,225	2037/6/19
第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	543,204	2037/12/15
第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	89,483	2038/5/24
第38回東京地下鉄株式会社社債	0.445	600,000	505,332	2040/1/31
第41回東京地下鉄株式会社社債	0.275	300,000	290,340	2030/6/12
第49回東京地下鉄株式会社社債	0.574	300,000	253,632	2041/1/22
第1回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.758	600,000	573,990	2032/3/17
第2回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.67	500,000	470,195	2032/12/6
第3回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.445	700,000	683,711	2028/12/6
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	700,000	686,364	2031/3/4
第46回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.69	700,000	636,538	2036/9/9
第47回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.903	700,000	648,284	2037/4/14
第48回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.782	500,000	452,930	2037/9/4
第50回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.395	700,000	690,151	2028/9/6
第51回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.672	700,000	604,639	2039/5/30
第90回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.8	500,000	477,980	2031/9/2
第100回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.772	700,000	660,422	2032/7/27
第106回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.505	700,000	690,480	2028/1/25
第111回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.955	700,000	613,984	2038/7/26
第112回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.47	800,000	772,616	2029/7/11
第117回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.91	900,000	761,418	2040/1/30
第4回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.202	500,000	514,175	2029/7/18
第19回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.817	800,000	745,568	2036/12/15
第51回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.789	700,000	632,667	2038/9/13
第52回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.215	500,000	484,435	2029/11/21
第54回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.486	800,000	669,776	2040/2/27
第37回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.87	200,000	201,092	2024/7/29
第40回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.841	600,000	589,692	2031/6/3
第41回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.7	700,000	676,515	2031/12/8
第42回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.647	600,000	574,074	2032/5/28
第43回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.941	700,000	642,313	2037/11/30
第44回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.878	800,000	721,272	2038/5/21
第45回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.871	700,000	669,186	2033/12/6
第46回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.69	500,000	426,240	2039/11/28
第47回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.48	300,000	290,787	2030/6/4
第30回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.74	700,000	620,249	2038/7/16
第31回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	200,000	196,834	2029/1/24
第32回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.63	700,000	592,753	2039/12/16
第50回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.857	200,000	202,768	2027/4/30
第52回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.75	600,000	554,070	2036/8/29
第53回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.85	600,000	571,812	2035/2/28
第54回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.806	700,000	643,146	2037/5/29

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第55回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.79	600,000	545,442	2037/12/4
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.748	600,000	538,086	2038/5/25
第57回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.863	500,000	453,660	2038/9/10
第58回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.725	800,000	703,120	2039/4/25
第59回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.53	400,000	338,152	2039/9/5
第63回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.69	300,000	254,826	2040/10/26
第11回日本通運株式会社無担保社債	0.2	300,000	298,710	2026/7/14
第14回日本通運株式会社無担保社債	0.28	300,000	297,855	2027/6/16
第7回ニコソホールディングス株式会社無担保社債	0.28	400,000	386,144	2029/10/11
第9回ニコソホールディングス株式会社無担保社債	0.42	800,000	769,544	2030/9/18
第2回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.455	200,000	199,196	2027/2/23
第3回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.39	400,000	394,424	2028/2/28
第4回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.445	700,000	688,100	2028/12/14
第5回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.3	800,000	771,824	2029/12/11
第6回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.45	500,000	482,265	2030/9/17
第8回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.75	200,000	193,286	2032/8/13
第1回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.295	600,000	587,592	2029/3/7
第3回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.23	300,000	290,592	2029/12/10
第4回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.51	400,000	337,412	2039/12/9
第6回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.29	400,000	385,836	2030/6/7
第7回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.691	500,000	431,295	2040/6/8
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.616	300,000	248,382	2041/12/9
第1回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.26	500,000	480,200	2030/10/22
第2回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.235	400,000	377,732	2031/11/18
第2回日本貨物鉄道株式会社社債	0.849	300,000	260,760	2042/3/17
第4回日本貨物鉄道株式会社社債	1.37	100,000	93,904	2043/6/15
第1回日本航空株式会社無担保社債	0.47	700,000	691,642	2026/12/18
第3回日本航空株式会社無担保社債	0.399	500,000	483,340	2028/9/21
第5回日本航空株式会社無担保社債	0.22	500,000	499,325	2024/3/19
第7回日本航空株式会社無担保社債	0.28	800,000	755,296	2029/12/14
第17回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.34	500,000	493,855	2027/12/8
第18回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.22	700,000	671,923	2029/12/5
第19回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.61	400,000	336,764	2039/12/5
第6回株式会社住友倉庫無担保社債	0.838	700,000	627,361	2038/3/26
第7回株式会社住友倉庫無担保社債	0.08	200,000	199,712	2024/9/24
第8回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	600,000	575,370	2029/9/21
第10回株式会社住友倉庫無担保社債	0.27	300,000	283,821	2030/10/15
第21回KDDI株式会社無担保社債	0.669	500,000	502,295	2024/9/20
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	400,000	393,748	2028/11/22

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第13回ソフトバンク無担保社債	0.52	800,000	744,816	2031/6/3
第16回ソフトバンク無担保社債	0.52	700,000	647,906	2031/10/10
第17回ソフトバンク無担保社債	0.51	700,000	677,859	2029/1/26
第18回ソフトバンク無担保社債	0.62	600,000	556,464	2032/1/27
第23回ソフトバンク無担保社債	1.3	700,000	677,782	2033/7/12
第25回沖繩電力株式会社社債	0.25	700,000	695,737	2027/6/25
第26回沖繩電力株式会社社債	0.28	700,000	688,429	2028/12/25
第27回沖繩電力株式会社社債	0.19	800,000	770,784	2030/3/25
第28回沖繩電力株式会社社債	0.24	300,000	287,127	2030/12/20
第49回電源開発株式会社無担保社債	0.4	300,000	298,974	2027/5/20
第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.31	100,000	97,527	2034/4/24
第32回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.28	100,000	96,791	2034/10/6
第36回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.737	400,000	425,712	2032/5/25
第37回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.764	300,000	318,531	2033/9/26
第39回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.554	700,000	627,937	2034/5/26
第43回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.67	700,000	738,300	2037/6/9
第46回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.58	700,000	619,339	2038/7/20
第48回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.704	300,000	268,662	2038/11/29
第52回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.486	1,000,000	857,910	2039/5/23
第55回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.28	800,000	658,248	2039/9/13
第68回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.523	500,000	415,125	2041/7/12
第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.606	400,000	418,268	2034/3/24
第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.402	600,000	613,236	2034/10/24
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	200,000	167,968	2041/6/3
第45回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.942	800,000	706,952	2042/6/2
第52回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.417	300,000	284,772	2043/6/2
第36回東邦瓦斯株式会社無担保社債	1.628	300,000	312,060	2027/3/19
第44回東邦瓦斯株式会社無担保社債	0.835	700,000	600,656	2042/3/3
第13回広島ガス株式会社無担保社債	0.405	600,000	590,682	2028/9/13
第14回広島ガス株式会社無担保社債	0.35	800,000	765,552	2030/10/15
第16回西部瓦斯株式会社無担保社債	0.355	700,000	685,468	2028/12/13
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	900,000	891,387	2028/6/6
小 計		298,776,000	288,299,620	
合 計		429,268,222	412,392,920	

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

○投資信託財産の構成

(2023年9月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	412,392,920	98.6
コール・ローン等、その他	5,807,806	1.4
投資信託財産総額	418,200,726	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年9月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	418,200,726,215
コール・ローン等	5,125,765,232
公社債(評価額)	412,392,920,969
未収利息	680,500,014
前払費用	1,540,000
(B) 負債	2,175,510,075
未払解約金	2,175,501,866
未払利息	8,209
(C) 純資産総額(A-B)	416,025,216,140
元本	356,115,305,023
次期繰越損益金	59,909,911,117
(D) 受益権総口数	356,115,305,023口
1万円当たり基準価額(C/D)	11,682円

(注) 当親ファンドの期首元本額は442,830,342,239円、期中追加設定元本額は21,470,079,449円、期中一部解約元本額は108,185,116,665円です。

<元本の内訳>

東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)	229,535,018,902円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)	106,810,736,970円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)	16,135,029,297円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(年2回決算型)	3,470,707,939円
TMA債券バランスファンド<適格機関投資家限定>	163,811,915円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2022年9月27日～2023年9月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,368,074,473
受取利息	3,370,725,490
支払利息	△ 2,651,017
(B) 有価証券売買損益	△13,762,943,354
売買益	209,856,688
売買損	△13,972,800,042
(C) 当期損益金(A+B)	△10,394,868,881
(D) 前期繰越損益金	85,922,630,732
(E) 追加信託差損益金	3,900,313,254
(F) 解約差損益金	△19,518,163,988
(G) 計(C+D+E+F)	59,909,911,117
次期繰越損益金(G)	59,909,911,117

(注) (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) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド

運用報告書 第12期 (決算日 2024年5月28日)

(計算期間 2023年5月30日～2024年5月28日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		株組入比率	純資産額
	騰落率	中率	騰落率	中率		
	円	%		%	%	百万円
8期(2020年5月28日)	26,104	1.4	2,437.16	4.4	96.1	37,394
9期(2021年5月28日)	27,192	4.2	3,071.22	26.0	98.0	107,201
10期(2022年5月30日)	27,003	△ 0.7	3,103.72	1.1	96.0	92,333
11期(2023年5月29日)	30,348	12.4	3,585.71	15.5	98.0	59,613
12期(2024年5月28日)	34,486	13.6	4,699.31	31.1	96.5	45,326

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		株組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首)	円	%		%	%
2023年5月29日	30,348	—	3,585.71	—	98.0
5月末	29,924	△ 1.4	3,537.93	△ 1.3	98.2
6月末	31,196	2.8	3,805.00	6.1	97.5
7月末	31,481	3.7	3,861.80	7.7	98.1
8月末	32,469	7.0	3,878.51	8.2	98.1
9月末	32,813	8.1	3,898.26	8.7	97.5
10月末	32,308	6.5	3,781.64	5.5	98.1
11月末	32,767	8.0	3,986.65	11.2	96.4
12月末	32,865	8.3	3,977.63	10.9	97.9
2024年1月末	34,316	13.1	4,288.36	19.6	98.8
2月末	34,511	13.7	4,499.61	25.5	97.9
3月末	35,288	16.3	4,699.20	31.1	95.1
4月末	35,084	15.6	4,656.27	29.9	96.3
(期末)					
2024年5月28日	34,486	13.6	4,699.31	31.1	96.5

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数はTOPIX（配当込み）です。
 配当込みTOPIX（以下「TOPIX（配当込み）」といいます。）の指数値およびTOPIX（配当込み）にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIX（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIX（配当込み）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIX（配当込み）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるのではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○運用経過

(2023年5月30日～2024年5月28日)

■期中の基準価額等の推移

期首：30,348円
 期末：34,486円
 騰落率：13.6%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米国経済のソフトランディング（実体経済への悪影響を最小限にとどめること）に対する期待
- ・新NISA（少額投資非課税制度）開始に伴う資金流入期待

マイナス要因

- ・米国の金融引き締め長期化に対する懸念
- ・日銀の金融政策変更による長期金利の上昇

■投資環境

当期の国内株式市場は上昇しました。

期初、大手格付会社の米国価格下げを受けた米国株式市場の下落に連れて、国内株式市場は下落する場面もありましたが、緩和的な国内金利環境への安心感や、東京証券取引所の要請による企業改革への期待から、国内株式市場は上昇基調で推移しました。期半ばに入ると、中東の地政学的リスクの高まりなどから国内株式市場は軟調に推移しましたが、2023年11月には、日銀の金融緩和と政策解除への警戒感が和らいだことや、米国経済のソフトランディングに対する期待から上昇に転じました。その後2023年末にかけて、先行き不透明な日米金融政策への警戒はくすぶり続け、国内株式市場はボックス圏で推移しました。2024年以降は、新NISA開始に伴う資金流入期待や円安米ドル高の進行などが好感され、国内株式市場は上昇基調となり、期初から大きく上昇した水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

ポートフォリオ全体の配当利回りを高めつつ、価格変動リスクがTOPIX（配当込み）よりも低くなるようなポートフォリオを構築しました。

当期の基準価額は13.6%上昇しましたが、参考指数であるTOPIX（配当込み）を下回る結果となりました。当ファンドで多く保有する中小型銘柄のパフォーマンスが相対的に劣後したことや、価格変動リスクの低い銘柄を多く保有していたことが、相場上昇局面ではマイナスに影響しました。なお、価格変動リスクはTOPIX（配当込み）と比較して低い水準を維持しました。

○今後の運用方針

今後も日本の株式を主要投資対象とし、流動性や信用リスクなどを勘案して選定した銘柄に投資します。

ポートフォリオ全体の配当利回りを高める戦略と価格変動リスクを低く抑える戦略を組み合わせることで、ポートフォリオ全体の価格変動リスクをTOPIX（配当込み）より低く抑えながら、中長期的にTOPIX（配当込み）と同程度のリターンを目指します。

基準価額と参考指数の推移



(注) 参考指数は、期首(2023年5月29日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、TOPIX(配当込み)です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年5月30日～2024年5月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 1 (1)	% 0.003 (0.003)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
合 計	1	0.003	
期中の平均基準価額は、32,918円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○ 売買及び取引の状況

(2023年5月30日～2024年5月28日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 27,161 (11,086)	千円 49,995,523 ()	千株 40,268	千円 71,607,935

(注) 金額は受渡代金です。

(注) () 内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

○ 株式売買比率

(2023年5月30日～2024年5月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	121,603,459千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	62,997,609千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.93

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2023年5月30日～2024年5月28日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2024年5月28日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (2.5%)			
ニッスイ	1,122.6	557.4	497,590
マルハニチロ	206.2	93	299,367
サカタのタネ	49.7	82.2	283,179
鉱業 (1%)			
石油資源開発	97.1	—	—
建設業 (4.4%)			
ショーボンドホールディングス	95.8	61.6	375,760
東急建設	90.4	—	—
コムシスホールディングス	13.9	—	—
長谷工コーポレーション	74.1	26.9	47,707
西松建設	183.5	107.3	472,334
大豊建設	44.4	—	—
奥村組	39.3	22.9	111,981
熊谷組	93.9	78.2	280,347
東洋建設	233.9	243.6	342,745
ライト工業	—	92.9	184,963
関電工	82.8	—	—
三機工業	120.1	59.8	131,320
食料品 (5.6%)			
ニッポン	89.6	15.4	34,958
カルビー	350.4	189.8	585,722
明治ホールディングス	191.8	139.9	486,572
プリマハム	—	57.6	134,784
伊藤ハム米久ホールディングス	370.9	44.3	182,959
日清オイリオグループ	43.4	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日清食品ホールディングス	57	213.1	852,613
日本たばこ産業	202.3	37	163,836
繊維製品 (0.3%)			
グンゼ	36.9	26.3	134,919
ホギメディカル	55.3	—	—
パルプ・紙 (2.5%)			
王子ホールディングス	1,632.5	1,017.7	639,115
レンゴー	676.6	435.4	476,327
化学 (8.1%)			
アイカ工業	—	79.1	267,437
花王	123.5	83	578,925
ライオン	730.5	480	605,760
マンダム	—	119	142,562
ファンケル	—	154.2	303,928
ノエビアホールディングス	35.3	27.1	144,443
小林製薬	76	—	—
アース製薬	—	42.2	196,652
有沢製作所	155.1	70	107,170
エフビコ	34.2	116.5	290,551
ユニ・チャーム	223	179.6	885,966
医薬品 (3.8%)			
武田薬品工業	180.1	186.9	775,821
アステラス製薬	83.2	102.5	160,156
科研製薬	115	97	334,068
ロート製薬	230.1	—	—
ツムラ	—	28.3	107,709

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キッセイ薬品工業	62.5	43.8	133,809
栄研化学	129	73.6	152,425
ゼリア新薬工業	53.2	—	—
サワイグループホールディングス	131.5	—	—
ガラス・土石製品 (0.0%)			
住友大阪セメント	21.6	—	—
日本カーボン	36.6	1.8	9,810
金属製品 (0.2%)			
東洋製織グループホールディングス	160.3	27	69,714
文化シヤッター	126.2	—	—
機械 (3.2%)			
タクマ	20.8	—	—
椿本チエイン	18.2	—	—
フジテック	119.4	99.4	416,784
マースグループホールディングス	49.2	—	—
アマノ	148	82	307,910
マックス	—	6.5	23,465
ホシザキ	122.2	121.6	668,435
電気機器 (14.9%)			
日清紡ホールディングス	530.4	329.8	359,482
マブチモーター	156.7	180.7	436,390
日東工業	127.8	81.9	294,840
I D E C	87	70.2	190,452
日本電気	73.5	—	—
沖電気工業	378.6	—	—
E I Z O	38.9	30.2	149,792
エレコム	194.7	99.2	153,164
アンリツ	444.9	268.5	313,876
富士通ゼネラル	39.2	157.3	342,992
ホシデン	279.5	—	—
ヒロセ電機	61.3	50	874,500
マクセル	30	—	—
アズビル	51.2	—	—
日本光電工業	—	107.3	496,906
ウシオ電機	—	57.3	120,014
日本セラミック	75.2	65.9	166,463
図研	41.5	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
カシオ計算機	691.6	525.2	599,253
浜松トホニクス	—	17	80,784
京セラ	160.1	472.3	864,781
キヤノン電子	—	22.2	49,617
キヤノン	358.1	202.5	914,085
象印マホービン	93.8	91	135,135
輸送用機器 (6.3%)			
トヨタ紡織	112.2	251.1	570,373
東海理化電機製作所	4.9	—	—
トヨタ自動車	616.6	100	344,800
タチエス	—	160.4	315,988
NOK	36.1	7.2	15,278
カヤバ	—	58	305,660
プレス工業	316.2	240.5	163,780
アイシン	95.3	—	—
エクセディ	121	76.1	196,946
エフ・シー・シー	107.3	84.6	186,966
シマノ	—	11.1	288,433
テイ・エス テック	259.8	205.1	387,331
精密機器 (0.6%)			
ニプロ	111.1	224.1	267,575
その他製品 (2.6%)			
パラマウントベッドホールディングス	71.7	53.1	138,272
ビジョン	411.7	358.5	540,438
リンテック	128.8	88.5	284,527
コクヨ	131.3	73.9	193,211
電気・ガス業 (2.7%)			
中部電力	594.4	—	—
沖縄電力	19.4	15.5	17,980
大阪瓦斯	537.6	246.6	842,385
メタウォーター	—	162.7	317,427
陸運業 (4.6%)			
東武鉄道	289.9	212.5	591,493
相鉄ホールディングス	163.1	125.3	308,300
東急	—	57.5	105,368
京浜急行電鉄	—	95.7	111,969
サカイ引越センター	—	19.6	45,648

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
近鉄グループホールディングス	29.8	—	—
南海電気鉄道	198.7	173.7	457,091
センコーグループホールディングス	317.4	192.6	219,371
九州旅客鉄道	66.9	47.1	161,647
倉庫・運輸関連業 (1.6%)			
住友倉庫	—	108.7	274,250
上組	252.2	133.2	416,116
情報・通信業 (7.6%)			
NECネットエスアイ	23.5	19.3	42,826
コーエーテックモホールディングス	81.7	208.1	259,604
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	—	167.2	425,942
オービック	—	0.8	16,368
伊藤忠テクノソリューションズ	266.2	—	—
電通総研	—	3.9	20,241
エイベックス	75.8	71.4	86,322
スカパーJ S A Tホールディングス	31.7	—	—
日本電信電話	290.2	5,659.4	870,415
KDD I	268	203.1	879,626
ソフトバンク	113.2	69.3	131,947
富士ソフト	59.4	64.2	410,880
NSD	98.4	65.9	181,356
卸売業 (9.6%)			
アルフレッサ ホールディングス	374.6	269.2	573,261
神戸物産	—	248.4	847,044
TOKAIホールディングス	243.9	147.8	141,149
シップヘルスケアホールディングス	211.9	128.9	288,349
コマダホールディングス	149.1	118.9	314,014
ハビネット	81.9	51.7	172,678
キヤノンマーケティングジャパン	140.2	70.8	310,812
菱洋エレクトロ	167.9	—	—
サンゲツ	164.7	106.9	319,951
伊藤忠エネクス	—	75.6	115,970
モスフードサービス	91.1	52.4	181,042
PAL TAC	61.2	65	272,935
オートバックスセブン	275.5	204.8	310,886
イエローハット	92.2	79.1	160,810
因幡電機産業	76.9	47.6	179,214

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
スズケン	54.2	—	—
小売業 (6.6%)			
ローソン	8.5	—	—
サンエー	52.4	45.2	211,536
カワチ薬品	54.9	—	—
エービーシー・マート	18.2	99.3	297,105
エディオン	155.8	103.7	159,801
ビックカメラ	—	32.4	48,729
DCMホールディングス	405.8	155.6	234,956
ジョイフル本田	158.4	78.9	165,374
リンガーハット	101.8	65.4	150,812
コメリ	90.6	50.7	186,829
平和堂	137.9	—	—
フジ	66.3	64.8	122,925
ヤオコー	48	27.1	242,870
ケーズホールディングス	42.3	150.3	212,148
王将フードサービス	25.3	15.3	132,345
アークス	84.1	59.1	172,512
サンドラッグ	203.8	137.9	541,671
銀行業 (5.5%)			
めぶきフィナンシャルグループ	—	1,151.3	683,296
ゆうちょ銀行	—	144	219,600
ひろぎんホールディングス	311	6.9	8,493
群馬銀行	1,028.6	—	—
東邦銀行	—	413.9	151,073
大垣共立銀行	89.3	54.9	121,054
滋賀銀行	—	45.6	191,748
南都銀行	72.6	47	165,440
山陰合同銀行	—	158.8	229,624
セブン銀行	1,600.2	1,228.9	327,010
みずほフィナンシャルグループ	22.1	—	—
山口フィナンシャルグループ	556.6	169	309,439
証券・商品先物取引業 (1.1%)			
松井証券	608.9	591.4	476,077
保険業 (0.4%)			
SOMPOホールディングス	75.5	51	161,823
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	41.7	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
第一生命ホールディングス	—	0.7	2,857
その他金融業 (0.7%)			
全国保証	—	28.3	159,102
リコーリース	54.6	28.7	146,083
サービス業 (4.6%)			
M I X I	188.3	143	397,254
総合警備保障	93	379.6	359,671
H. U. グループホールディングス	220.2	175.8	435,896
ダスキン	82.6	54.5	194,401

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ビー・エム・エル	—	51.7	141,451
ベルシステム24ホールディングス	—	132.9	212,640
セコム	36.8	13.8	137,793
イオンディライト	68.3	31.2	120,588
合 計	株 数 ・ 金 額	28,644	26,623
	銘柄数 < 比率 >	152	151 < 96.5% >

(注) 銘柄欄の () 内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

○投資信託財産の構成

(2024年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	43,759,459	96.1
コール・ローン等、その他	1,767,793	3.9
投資信託財産総額	45,527,252	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	45,527,252,721
コール・ローン等	1,117,583,653
株式(評価額)	43,759,459,940
未収配当金	650,207,030
未収利息	2,098
(B) 負債	200,479,512
未払解約金	200,479,512
(C) 純資産総額(A-B)	45,326,773,209
元本	13,143,392,579
次期繰越損益金	32,183,380,630
(D) 受益権総口数	13,143,392,579口
1万口当たり基準価額(C/D)	34,486円

(注) 当親ファンドの期首元本額は19,643,027,229円、期中追加設定元本額は15,226,624,624円、期中一部解約元本額は21,726,259,274円です。

<元本の内訳>

東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型) 8,974,983,947円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) 4,168,408,632円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2023年5月30日～2024年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	1,885,555,620
受取配当金	1,886,177,750
受取利息	176,871
その他収益金	17,733
支払利息	△ 816,734
(B) 有価証券売買損益	6,933,757,310
売買益	10,386,508,002
売買損	△ 3,452,750,692
(C) 当期損益金(A+B)	8,819,312,930
(D) 前期繰越損益金	39,970,333,653
(E) 追加信託差損益金	32,979,164,998
(F) 解約差損益金	△49,585,430,951
(G) 計(C+D+E+F)	32,183,380,630
次期繰越損益金(G)	32,183,380,630

(注) (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) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

- ・当ファンドが参照している指数について配当込み指数であることを明確にするため、表記を「TOPIX(配当込み)」とする約款変更を2023年10月1日付で行いました。
- ・当ファンドを投資対象とする公募投信が、NISA「成長投資枠」の対象商品になるための要件を満たすため、当ファンドにおいて所要の約款変更を2024年10月24日付で行いました。

TMA日本REITマザーファンド

運用報告書 第13期 (決算日 2024年7月10日)

(計算期間 2023年7月11日～2024年7月10日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		参 考 指 数	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額	
	期 騰 落	中 率				期 騰 落
	円	%		%	百万円	
9期(2020年7月10日)	23,933	△12.2	3,521.95	△13.4	98.2	37,309
10期(2021年7月12日)	32,566	36.1	4,800.45	36.3	98.4	131,857
11期(2022年7月11日)	30,458	△6.5	4,485.26	△6.6	98.0	51,251
12期(2023年7月10日)	29,715	△2.4	4,402.46	△1.8	95.8	87,997
13期(2024年7月10日)	28,766	△3.2	4,253.53	△3.4	97.1	43,246

参考指数は東証REIT指数（配当込み）です。

配当込み東証REIT指数（以下「東証REIT指数（配当込み）」といいます。）の指数値および東証REIT指数（配当込み）にかかる標章または商標は、株式会社J P X総研または株式会社J P X総研の関連会社（以下「J P X」といいます。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等東証REIT指数（配当込み）に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数（配当込み）にかかる標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、東証REIT指数（配当込み）の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数	投 資 信 託 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年 7 月10日	円 29,715	% —	4,402.46	% 95.8
7 月末	30,187	1.6	4,472.88	94.3
8 月末	30,590	2.9	4,539.20	94.1
9 月末	30,193	1.6	4,468.30	95.1
10月末	29,547	△0.6	4,372.14	96.1
11月末	30,009	1.0	4,455.46	96.4
12月末	29,606	△0.4	4,382.85	96.9
2024年 1 月末	29,625	△0.3	4,378.56	95.9
2 月末	28,173	△5.2	4,166.74	96.8
3 月末	29,763	0.2	4,410.17	93.0
4 月末	30,098	1.3	4,455.74	96.3
5 月末	29,077	△2.1	4,302.09	97.5
6 月末	28,924	△2.7	4,277.59	97.1
(期 末) 2024年 7 月10日	28,766	△3.2	4,253.53	97.1

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2023年7月11日～2024年7月10日)

■期中の基準価額等の推移

期首：29,715円

期末：28,766円

騰落率：△3.2%

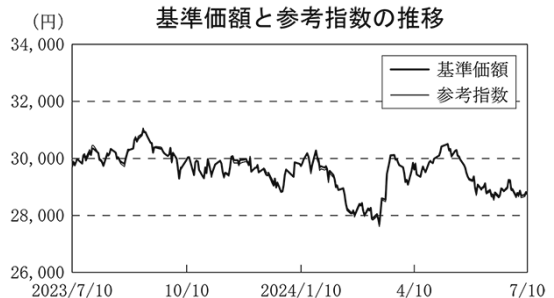
◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・都心オフィスビルの平均空室率の低下と平均募集賃料の底打ち
- ・日本REIT各社による自己投資口買入などによる投資家への還元策の強化

マイナス要因

- ・日銀の金融政策変更による長期金利の上昇
- ・一部の日本REITにおける公募増資の実施や主要なグローバル株式インデックス構成銘柄からの除外などによる需給環境の悪化



(注) 参考指数は、期首(2023年7月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、東証REIT指数(配当込み)です。

■投資環境

期初、2023年7月の金融政策決定会合において日銀がYCC(イールドカーブ・コントロール)政策を修正したことで、長期金利は上昇したものの、金融政策変更に対する過度な警戒感が弱まったことから、日本REIT市場は上昇しました。9月から2024年2月にかけては、国内のインフレ圧力を受けて日銀の更なる金融政策変更への警戒感が再度強まるなか、日本REIT市場は下落基調となりました。3月の金融政策決定会合で日銀がマイナス金利の解除を決定すると、長期金利上昇に対する過度な警戒感が払拭され、日本REIT市場は反発上昇したものの、その後は投資家の様子見姿勢が続き上値の重い展開となりました。期末にかけては、日銀による国債買入の減額や早期利上げが警戒されるなか、長期金利の上昇や一部の日本REITによる公募増資の実施、また、主要なグローバル株式インデックス構成銘柄からの除外を受けてインデックスファンドによる除外対象銘柄売却で市場需給が悪化し、日本REIT市場は下落しました。

■ポートフォリオについて

市場流動性(流動性基準)とスポンサー企業の信用力や財務健全性(信用リスク基準)に基づいて絞り込んだ銘柄を対象として、時価加重比率と売買金額加重比率を組み合わせた投資比率でポートフォリオを構築し、中長期的に日本REIT市場全体の動きをおおむね捉える運用を機動的に行いました。

以上の運用の結果、基準価額は3.2%下落し、参考指数である東証REIT指数(配当込み)におおむね連動する値動きとなりました。

○今後の運用方針

日本REIT市場は、今後、都心オフィスビルの空室率低下や募集賃料の底打ちを受けてオフィスビルの賃貸市況の回復が見込まれることや、足元では賃料上昇期待が強い都心の賃貸住宅セクターや訪日外国人旅行者の増加による宿泊需要増加の恩恵を受けやすい宿泊施設セクターなどの銘柄の業績は好調であることから、長期金利上昇による一定程度の業績へのマイナスの影響を考慮しても、底堅い展開を想定します。

今後も運用方針に基づき、ファンドにおけるREITの組入比率は高位を維持してポートフォリオを構築し、中長期的に日本REIT市場全体の動きをおおむね捉える運用を機動的に行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2023年 7月11日～2024年 7月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (投 資 信 託 証 券)	円 28 (28)	% 0.094 (0.094)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
合 計	28	0.094	
期中の平均基準価額は、29,649円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2023年 7月11日～2024年 7月10日)

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
国 内		口	千円	口	千円
	S O S i L A 物 流 リー ト 投 資 法 人	290	33,308	1,570	192,161
	日 本 ア コ モ デー シ ョ ン フ ェ ン ド 投 資 法 人	683	396,208	3,162	2,061,463
	森 ヒ ル ズ リー ト 投 資 法 人	3,700	537,669	9,560	1,300,001
	産 業 フ ェ ン ド 投 資 法 人	3,593	451,399	8,413	1,157,931
	ア ド バ ン ス ・ レ ジ デ ン ス 投 資 法 人	3,850	1,229,292	7,550	2,521,840
	ケ ネ デ ィ ク ス ・ レ ジ デ ン シ ョ ン ・ ネ ク ス ト 投 資 法 人	— (△ 2,700)	— (△ 624,780)	2,900	652,512
	ア ク テ ィ ビ ア ・ プ ロ バ ティー ズ 投 資 法 人	2,875	1,186,707	2,220	896,038
	G L P 投 資 法 人	15,375	1,948,239	39,805	5,265,595
	コ ン フ ェ リ ア ・ レ ジ デ ン シ ョ ン 投 資 法 人	282	92,807	1,356	435,681
	日 本 プ ロ ロ ジ ス リー ト 投 資 法 人	5,959	1,556,673	14,669	4,028,737
	星 野 リ ゴ ー ト ・ リー ト 投 資 法 人	395	240,948	1,530	944,321
	O n e リー ト 投 資 法 人	19	5,015	830	212,524
	イ オ ン リー ト 投 資 法 人	2,160	287,006	3,470	503,424
	ヒ ュ ー リ ッ ク リー ト 投 資 法 人	67	10,306	5,872	948,254
	日 本 リー ト 投 資 法 人	265	87,757	795	277,758
	積 水 ハ ウ ス ・ リー ト 投 資 法 人	13,060	1,011,192	3,000	245,028
	ト ー セ イ ・ リー ト 投 資 法 人	285	39,302	—	—
	ケ ネ デ ィ ク ス 商 業 リー ト 投 資 法 人	— (△ 1,000)	— (△ 291,500)	2,470	711,147

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
		千円		千円	
国内	ヘルスケア & メディカル投資法人	—	—	1,050	151,534
	サムティ・レジデンシャル投資法人	390	40,327	1,250	141,838
	野村不動産マスターファンド投資法人	12,237	2,018,167	18,184	2,982,185
	ラサールロジポート投資法人	600	89,455	6,930	1,040,816
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	824	352,492	2,768	1,280,288
	投資法人みらい	840	37,054	2,600	121,278
	三菱地所物流リート投資法人	100	39,420	2,175	825,552
	CREロジスティクスファンド投資法人	—	—	2,600	413,390
	タカラレーベン不動産投資法人	755	71,481	4,103	400,553
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	270	32,165	1,525	192,535
	日本ビルファンド投資法人	7,772	4,596,095	9,552	5,784,102
	ジャパンリアルエステイト投資法人	8,371	4,645,818	10,381	5,817,579
	日本都市ファンド投資法人	900	88,455	43,750	4,182,928
	オリックス不動産投資法人	500	92,282	17,230	2,944,262
	日本プライムリアルティ投資法人	2,841	938,519	591	196,071
	NTT都市開発リート投資法人	5,000	685,293	9,360	1,166,242
	東急リアル・エステート投資法人	2,595	475,670	4,770	872,413
	グローバル・ワン不動産投資法人	3,410	366,094	4,990	564,405
	ユナイテッド・アーバン投資法人	3,600	553,945	17,200	2,609,908
	森トラストリート投資法人	1,970	137,830	5,110	372,125
	インヴェンシブル投資法人	—	—	43,340	2,597,857
	フロンティア不動産投資法人	810	345,707	4,125	1,919,134
	平和不動産リート投資法人	73	9,912	1,280	184,510
	日本ロジスティクスファンド投資法人	910	246,614	1,920	536,226
	福岡リート投資法人	—	—	2,908	477,155
	KDX不動産投資法人	11,502 (7,898)	1,870,251 (916,280)	9,510	1,977,894
	いちごオフィスリート投資法人	911	71,934	2,180	188,614
	大和証券オフィス投資法人	1,170 (1,870)	692,646 (—)	2,590	1,669,806
阪急阪神リート投資法人	350	47,847	1,150	163,527	
スターツプロシード投資法人	255	49,291	1,000	213,656	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	1,234	95,663	34,440	2,474,844	
大和証券リビング投資法人	2,300	255,619	2,750	305,865	
ジャパンエクセレント投資法人	2,260	272,724	1,342	174,721	
合 計	127,608 (6,068)	28,332,621 (—)	383,826	67,298,250	

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

○利害関係人との取引状況等

(2023年7月11日～2024年7月10日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2024年7月10日現在)

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
S O S i L A物流リート投資法人	3,600	2,320	267,264	0.6
日本アコモデーションファンド投資法人	2,600	121	77,077	0.2
森ヒルズリート投資法人	11,500	5,640	740,532	1.7
産業ファンド投資法人	13,000	8,180	1,034,770	2.4
アドバンス・レジデンス投資法人	8,600	4,900	1,585,150	3.7
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	5,600	—	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人	1,560	2,215	807,367	1.9
G L P投資法人	40,000	15,570	2,027,214	4.7
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,875	801	247,509	0.6
日本プロロジスリート投資法人	16,760	8,050	2,002,840	4.6
星野リゾート・リート投資法人	1,460	325	166,725	0.4
O n e リート投資法人	930	119	29,988	0.1
イオンリート投資法人	2,800	1,490	196,382	0.5
ヒューリックリート投資法人	6,400	595	85,739	0.2
日本リート投資法人	860	330	108,900	0.3
積水ハウス・リート投資法人	1,500	11,560	919,020	2.1
トーセイ・リート投資法人	—	285	39,073	0.1
ケネディクス商業リート投資法人	3,470	—	—	—
ヘルスケア & メディカル投資法人	1,150	100	12,670	0.0
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,700	840	87,696	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	22,460	16,513	2,430,713	5.6
ラサールロジポート投資法人	12,500	6,170	904,522	2.1
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	3,754	1,810	771,060	1.8
投資法人みらい	3,000	1,240	54,622	0.1
三菱地所物流リート投資法人	3,650	1,575	590,625	1.4
C R E ロジスティクスファンド投資法人	5,300	2,700	377,190	0.9
タカラレーベン不動産投資法人	4,903	1,555	152,701	0.4
アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,200	1,945	232,038	0.5
日本ビルファンド投資法人	5,250	3,470	1,964,020	4.5
ジャパンリアルエステイト投資法人	6,300	4,290	2,175,030	5.0
日本都市ファンド投資法人	57,760	14,910	1,340,409	3.1
オリックス不動産投資法人	25,300	8,570	1,342,062	3.1
日本プライムリアルティ投資法人	100	2,350	757,875	1.8
N T T 都市開発リート投資法人	12,600	8,240	945,128	2.2

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数		口 数	評 価 額	比 率
	口	口	口	千円	%
東急リアル・エステート投資法人	3,370		1,195	184,030	0.4
グローバル・ワン不動産投資法人	4,650		3,070	308,535	0.7
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,200		9,600	1,368,960	3.2
森トラストリート投資法人	6,400		3,260	224,288	0.5
インヴィンシブル投資法人	75,000		31,660	2,083,228	4.8
フロンティア不動産投資法人	4,200		885	383,647	0.9
平和不動産リート投資法人	1,380		173	22,628	0.1
日本ロジスティクスファンド投資法人	4,700		3,690	976,005	2.3
福岡リート投資法人	3,008		100	15,750	0.0
KDX不動産投資法人	5,250		15,140	2,345,186	5.4
いちごオフィスリート投資法人	3,180		1,911	156,510	0.4
大和証券オフィス投資法人	3,250		3,700	1,052,280	2.4
阪急阪神リート投資法人	1,450		650	85,995	0.2
スターツプロシード投資法人	1,350		605	118,217	0.3
大和ハウスリート投資法人	15,000		15,000	3,661,500	8.5
ジャパン・ホテル・リート投資法人	56,000		22,794	1,748,299	4.0
大和証券リビング投資法人	25,100		24,650	2,516,765	5.8
ジャパンエクセレント投資法人	1,177		2,095	246,372	0.6
合 計	口 数	金 額	口 数	金 額	比 率
	529,107		278,957	41,972,111	<97.1%>
	銘 柄 数	<比 率>	50		

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しています。

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

○投資信託財産の構成

(2024年7月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	41,972,111	96.6
コール・ローン等、その他	1,471,451	3.4
投資信託財産総額	43,443,562	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年7月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	43,443,562,069
コール・ローン等	914,945,457
投資証券(評価額)	41,972,111,200
未収入金	139,926,013
未収配当金	416,577,679
未収利息	1,720
(B) 負債	196,638,134
未払解約金	196,638,134
(C) 純資産総額(A-B)	43,246,923,935
元本	15,034,006,079
次期繰越損益金	28,212,917,856
(D) 受益権総口数	15,034,006,079口
1万口当たり基準価額(C/D)	28,766円

(注) 当親ファンドの期首元本額は29,614,072,620円、期中追加設定元本額は6,408,168,863円、期中一部解約元本額は20,988,235,404円です。

<元本の内訳>

東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型) 10,266,596,315円

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) 4,767,409,764円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2023年7月11日～2024年7月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,637,089,002
受取配当金	2,637,575,042
受取利息	368,357
その他収益金	5
支払利息	△ 854,402
(B) 有価証券売買損益	△ 3,329,010,431
売買益	1,375,185,659
売買損	△ 4,704,196,090
(C) 当期損益金(A+B)	△ 691,921,429
(D) 前期繰越損益金	58,383,909,339
(E) 追加信託差損益金	11,918,297,286
(F) 解約差損益金	△41,397,367,340
(G) 計(C+D+E+F)	28,212,917,856
次期繰越損益金(G)	28,212,917,856

(注) (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) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。