

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/債券/インデックス型	
信託期間	無期限	
運用方針	・日本の公社債等を投資対象とする「日本債券インデックス・マザーファンド」受益証券に投資することにより、中長期的にNOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果の獲得を目指して運用を行います。 ・マザーファンド受益証券の組入比率は、原則として高位を維持します。	
主要運用対象	ベビーフンド	日本債券インデックス・マザーファンド受益証券
	マザーファンド	わが国の公社債等
組入制限	ベビーフンド	・マザーファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 ・公社債への実質投資割合には制限を設けません。 ・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。
	マザーファンド	・公社債への投資割合には制限を設けません。 ・株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎決算時に、原則として次の通り収益分配を行う方針です。 ①分配対象額の範囲 分配対象額は、経費控除後の利子・配当収入および売買益(評価益を含みます)等全額とします。 ②分配方針 分配金額は、委託者が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないこともあります。 ③留保益の運用方針 収益分配に充てず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき運用を行います。	

STATE STREET GLOBAL ADVISORS

ステート・ストリート 日本債券インデックス・オープン

第7期運用報告書(全体版) (決算日2023年3月6日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のお引き立てを賜り、厚く御礼申し上げます。

この度、「ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン」は、2023年3月6日に第7期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間 (営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

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

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			<ベンチマーク> NOMURA-BPI総合指数		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
3期('19年 3月 5日)	9,871	0	0.8	9,935	1.0	99.5	-	1,972
4期('20年 3月 5日)	10,047	0	1.8	10,125	1.9	99.1	-	2,247
5期('21年 3月 5日)	9,849	0	△ 2.0	9,944	△ 1.8	99.3	-	2,416
6期('22年 3月 7日)	9,778	0	△ 0.7	9,888	△ 0.6	99.6	-	6,026
7期('23年 3月 6日)	9,378	0	△ 4.1	9,500	△ 3.9	99.6	-	3,948

(注1) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合指数で、ファンド設定日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。
NOMURA-BPI総合指数とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の知的財産です。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

(注3) 当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		<ベンチマーク> NOMURA-BPI総合指数		債券 組入比率	債券 先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
'22年 3月 7日	9,778	-	9,888	-	99.6	-
3月末	9,712	△ 0.7	9,822	△ 0.7	100.4	-
4月末	9,686	△ 0.9	9,798	△ 0.9	99.6	-
5月末	9,670	△ 1.1	9,783	△ 1.1	99.6	-
6月末	9,580	△ 2.0	9,694	△ 2.0	99.7	-
7月末	9,641	△ 1.4	9,758	△ 1.3	99.7	-
8月末	9,618	△ 1.6	9,735	△ 1.5	99.6	-
9月末	9,514	△ 2.7	9,630	△ 2.6	99.6	-
10月末	9,502	△ 2.8	9,621	△ 2.7	99.6	-
11月末	9,454	△ 3.3	9,572	△ 3.2	100.5	-
12月末	9,328	△ 4.6	9,450	△ 4.4	99.6	-
'23年 1月末	9,302	△ 4.9	9,424	△ 4.7	99.7	-
2月末	9,403	△ 3.8	9,526	△ 3.7	99.6	-
(期末)						
'23年 3月 6日	9,378	△ 4.1	9,500	△ 3.9	99.6	-

(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

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

当期の運用実績

(2022年3月8日から2023年3月6日まで)

基準価額とベンチマークの推移



(注) ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数で、前期末の基準価額にあわせて委託会社が独自に指数化したものです。

決算期	期首基準価額 (分配落ち)	期末基準価額 (分配落ち)	分配金	基準価額 騰落率	ベンチマーク 騰落率
第7期	9,778円	9,378円	0円	-4.1%	-3.9%

当期末の基準価額は9,378円となり、前期末の9,778円に比べて400円の下落となりました。

基準価額の変動要因

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

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-4.1%となり、ベンチマークの騰落率(-3.9%)を0.2%下回りました。主な要因は以下の通りです。

【ベンチマークとの差異の要因】

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

収益分配金

当期の収益分配金は基準価額の水準、市況動向などを勘案した結果、見送りとしております。また収益分配に充てず信託財産に留保した収益は、特に制限を設けず、元本部分と同様の運用を行う方針です。

投資環境

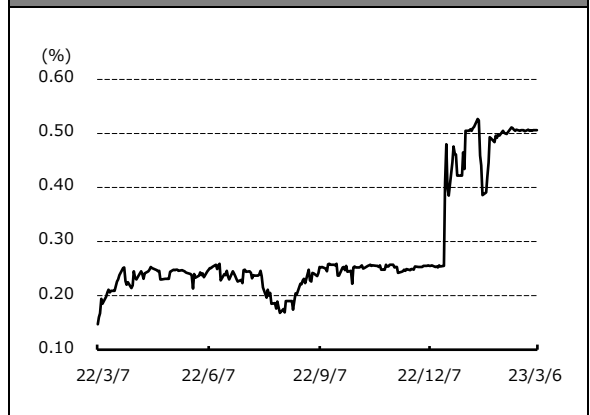
(2022年3月8日から2023年3月6日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

期前半は、インフレ圧力の高まりや海外主要国中央銀行の積極的な金融引き締め姿勢が債券の売り圧力となったものの、日銀は金融緩和政策方針を維持し、金利変動幅の抑制を継続したことで債券の動きは抑制されました。期後半は、インフレの加速に対する警戒感に加えて、12月に日銀が長短金利操作(イールドカーブ・コントロール、YCC)における10年債利回りの変動許容幅の拡大を決定したことを背景に債券が大きく売られました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2022年3月8日から2023年3月6日まで)

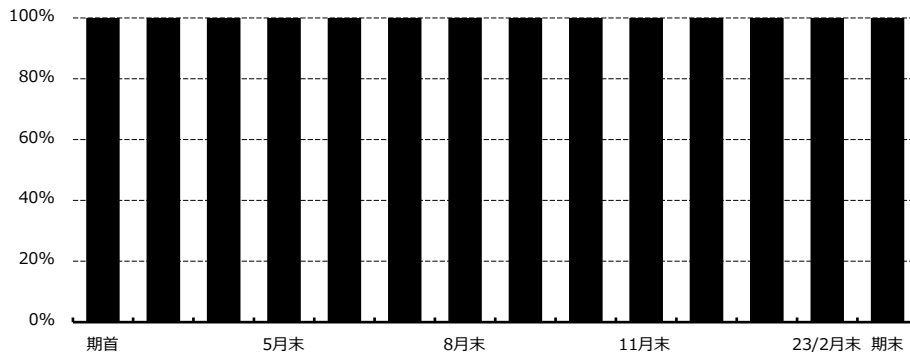
当ファンドは「日本債券インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ちます。

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

マザーファンドの組入状況

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

マザーファンド組入比率の推移



今後の運用方針

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

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2022年3月8日~2023年3月6日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	9,534円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	14円	0.143%	(a)信託報酬 = 期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投信会社)	(9)	(0.099)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	1	0.011	(b)その他費用 = 期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.011)	・ 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ その他は、金銭信託手数料
合 計	15円	0.154%	

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

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

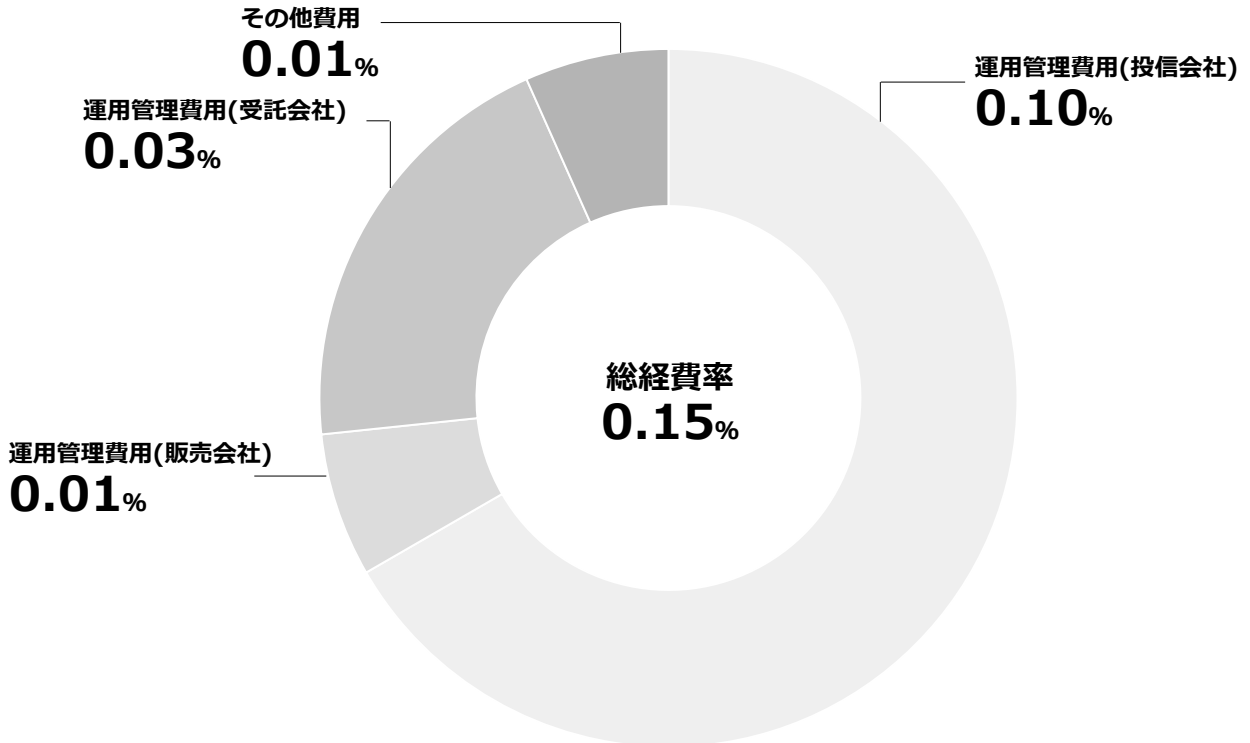
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額(原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。)を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除した**総経費率(年率)は0.15%です。**



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

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

(注5) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

◎売買および取引の状況('22年3月8日から'23年3月6日まで)

○親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックス・マザーファンド	769,997	952,003	2,271,232	2,841,873

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('22年3月8日から'23年3月6日まで)

○公社債(日本債券インデックス・マザーファンドにおける主要な売買銘柄)

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第366回 利付国債(10年)	1,795,540	第428回 利付国債(2年)	3,003,768
第153回 利付国債(5年)	1,599,750	第136回 利付国債(5年)	1,703,332
第154回 利付国債(5年)	1,597,006	第137回 利付国債(5年)	1,553,859
第439回 利付国債(2年)	1,553,022	第434回 利付国債(2年)	1,401,388
第367回 利付国債(10年)	1,497,357	第140回 利付国債(5年)	1,302,756
第365回 利付国債(10年)	1,481,472	第139回 利付国債(5年)	1,201,822
第434回 利付国債(2年)	1,401,452	第149回 利付国債(5年)	1,100,822
第369回 利付国債(10年)	1,300,729	第365回 利付国債(10年)	1,085,729
第442回 利付国債(2年)	1,200,340	第333回 利付国債(10年)	906,354
第151回 利付国債(5年)	1,000,035	第141回 利付国債(5年)	903,054

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('22年3月8日から'23年3月6日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

◎組入資産の明細('23年3月6日現在)

○親投資信託残高

種 類	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評価額
	千口	千口	千円
日本債券インデックス・マザーファンド	4,721,247	3,220,013	3,947,735

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末における日本債券インデックス・マザーファンド全体の口数は140,194,933千口です。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('23年3月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックス・マザーファンド	3,947,735	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	17,413	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	3,965,148	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('23年3月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	3,965,148,022
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	5,640,864
日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	3,947,735,982
未 収 入 金	11,771,176
(B) 負 債	17,080,038
未 払 解 約 金	14,156,267
未 払 信 託 報 酬	2,714,967
未 払 利 息	15
そ の 他 未 払 費 用	208,789
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	3,948,067,984
元 本	4,209,991,380
次 期 繰 越 損 益 金	△ 261,923,396
(D) 受 益 権 総 口 数	4,209,991,380口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	9,378円

- (注1) 期首元本額 6,163,793,493円
 期中追加設定元本額 1,736,973,508円
 期中一部解約元本額 3,690,775,621円
 (注2) 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は261,923,396円です。

◎損益の状況

当期(自'22年3月8日 至'23年3月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 7,415
支 払 利 息	△ 7,415
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 122,376,101
売 買 益	48,397,299
売 買 損	△ 170,773,400
(C) 信 託 報 酬 等	△ 6,794,434
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 129,177,950
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 22,797,153
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 109,948,293
(配 当 等 相 当 額)	(171,968,953)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 281,917,246)
(G) 計 (D+E+F)	△ 261,923,396
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 261,923,396
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 109,948,293
(配 当 等 相 当 額)	(173,026,956)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 282,975,249)
分 配 準 備 積 立 金	47,004,114
繰 越 損 益 金	△ 198,979,217

- (注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。
 (注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。
 (注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越損益金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。
 (注4) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注5) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	23,568,164 円
B	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0 円
C	収益調整金	173,026,956 円
D	分配準備積立金	23,435,950 円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	220,031,070 円
F	分配対象収益(1万口当たり)	522 円
G	分配金	0 円
H	分配金(1万口当たり)	0 円

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第7期 (2022年3月8日～ 2023年3月6日)
当期分配金	-円
(対基準価額比率)	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	522円

- (注1) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。
- (注2) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

日本債券インデックス・マザーファンド

第20期 運用報告書 (決算日2023年3月6日)

日本債券インデックス・マザーファンドの第20期の運用状況をご報告させていただきます。

○当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	<ul style="list-style-type: none"> ・ 中長期的な観点から、NOMURA-BPI総合指数に連動した投資成果をめざして運用を行います。 ・ 公社債の組入比率は原則として高位を維持します。
主要運用対象	わが国の公社債等
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・ 公社債への投資割合には制限を設けません。 ・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限り、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は行いません。

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

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

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額		＜ベンチマーク＞ NOMURA-BPI総合指数		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率	円	騰落率			
16期('19年 3月 5日)	12,817	1.0	12,826	1.0	99.6	-	154,276
17期('20年 3月 5日)	13,065	1.9	13,072	1.9	99.2	-	165,138
18期('21年 3月 5日)	12,831	△1.8	12,839	△1.8	99.4	-	160,991
19期('22年 3月 7日)	12,762	△0.5	12,766	△0.6	99.6	-	181,773
20期('23年 3月 6日)	12,260	△3.9	12,265	△3.9	99.6	-	171,874

(注1) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合指数で、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。NOMURA-BPI総合指数とは、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社の知的財産です。野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負いません。以下同じです。

(注2) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		＜ベンチマーク＞ NOMURA-BPI総合指数		債券 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	円	騰落率		
(期首) '22年 3月 7日	12,762	-	12,766	-	99.6	-
3月末	12,677	△0.7	12,681	△0.7	100.4	-
4月末	12,645	△0.9	12,650	△0.9	99.6	-
5月末	12,626	△1.1	12,631	△1.1	99.6	-
6月末	12,510	△2.0	12,516	△2.0	99.7	-
7月末	12,591	△1.3	12,598	△1.3	99.7	-
8月末	12,563	△1.6	12,569	△1.5	99.6	-
9月末	12,429	△2.6	12,433	△2.6	99.6	-
10月末	12,415	△2.7	12,422	△2.7	99.6	-
11月末	12,354	△3.2	12,358	△3.2	100.5	-
12月末	12,192	△4.5	12,200	△4.4	99.6	-
'23年 1月末	12,159	△4.7	12,167	△4.7	99.7	-
2月末	12,293	△3.7	12,299	△3.7	99.6	-
(期末) '23年 3月 6日	12,260	△3.9	12,265	△3.9	99.6	-

(注1) 騰落率は期首比です。

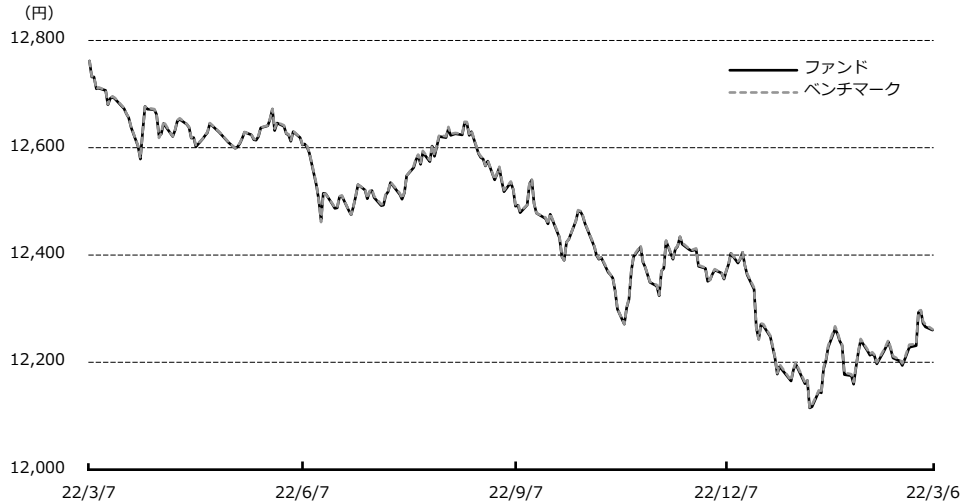
(注2) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合指数で、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

当期の運用実績

(2022年3月8日から2023年3月6日まで)

基準価額とベンチマークの推移



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

当期末の基準価額は12,260円となり、前期末の12,762円に比べて502円の下落となりました。

基準価額の変動要因

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

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は-3.9%となり、ベンチマークの騰落率(-3.9%)と同水準となりました。

投資環境

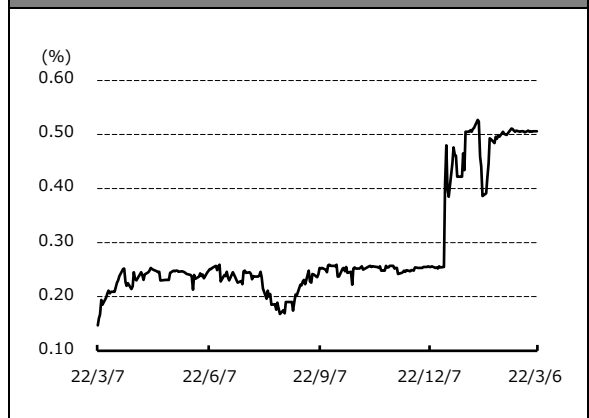
(2022年3月8日から2023年3月6日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、利回りが上昇する軟調な展開となりました。

期前半は、インフレ圧力の高まりや海外主要国中央銀行の積極的な金融引き締め姿勢が債券の売り圧力となったものの、日銀は金融緩和政策方針を維持し、金利変動幅の抑制を継続したことで債券の動きは抑制されました。期後半は、インフレの加速に対する警戒感に加えて、12月に日銀が長短金利操作(イールドカーブ・コントロール、YCC)における10年債利回りの変動許容幅の拡大を決定したことを背景に債券が大きく売られました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2022年3月8日から2023年3月6日まで)

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

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

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

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

今後の運用方針

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

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2022年3月8日~2023年3月6日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	12,454円	-	期中の平均基準価額です。
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	(a) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 ・その他は、金銭信託手数料
合 計	0円	0.000%	

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

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

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

◎売買および取引の状況('22年3月8日から'23年3月6日まで)

○公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 29,628,374	千円 29,818,284
	地 方 債 証 券	756,925	803,529 (903,000)
	特 殊 債 券	992,396	1,001,558 (1,042,541)
	社 債 券	1,081,380	100,928 (300,000)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれていません。

(注4) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('22年3月8日から'23年3月6日まで)

○公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第366回 利付国債(10年)	1,795,540	第428回 利付国債(2年)	3,003,768
第153回 利付国債(5年)	1,599,750	第136回 利付国債(5年)	1,703,332
第154回 利付国債(5年)	1,597,006	第137回 利付国債(5年)	1,553,859
第439回 利付国債(2年)	1,553,022	第434回 利付国債(2年)	1,401,388
第367回 利付国債(10年)	1,497,357	第140回 利付国債(5年)	1,302,756
第365回 利付国債(10年)	1,481,472	第139回 利付国債(5年)	1,201,822
第434回 利付国債(2年)	1,401,452	第149回 利付国債(5年)	1,100,822
第369回 利付国債(10年)	1,300,729	第365回 利付国債(10年)	1,085,729
第442回 利付国債(2年)	1,200,340	第333回 利付国債(10年)	906,354
第151回 利付国債(5年)	1,000,035	第141回 利付国債(5年)	903,054

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれていません)。

(注2) 国内の現先取引によるものは含まれていません。

(注3) 単位未満は切り捨てています。

◎利害関係人との取引状況等('22年3月8日から'23年3月6日まで)

当期中における利害関係人との取引はありません。

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

◎組入資産の明細('23年3月6日現在)

○国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額面金額	評 価 額	組入比率	組入比率 (うちBB格以下)	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	142,050,000 (200,000)	141,347,597 (198,529)	82.2 (0.1)	- (-)	54.3 (-)	20.2 (0.1)	7.7 (-)
地 方 債 証 券	9,810,340 (9,710,340)	9,858,436 (9,754,500)	5.7 (5.7)	- (-)	3.2 (3.2)	1.8 (1.8)	0.7 (0.7)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	11,393,069 (11,293,069)	11,564,042 (11,453,888)	6.7 (6.7)	- (-)	3.6 (3.5)	1.9 (1.9)	1.3 (1.3)
金 融 債 券	800,000 (800,000)	791,850 (791,850)	0.5 (0.5)	- (-)	0.1 (0.1)	0.3 (0.3)	0.1 (0.1)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	7,910,000 (7,710,000)	7,643,370 (7,440,212)	4.4 (4.3)	- (-)	2.5 (2.5)	1.4 (1.3)	0.6 (0.5)
合 計	171,963,409 (29,713,409)	171,205,296 (29,638,979)	99.6 (17.2)	- (-)	63.6 (9.2)	25.7 (5.4)	10.3 (2.5)

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

(注2) ()内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注4) 格付については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注5) 金額の単位未満は切り捨てています。

○国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

種 類	銘 柄 名		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
国 債 証 券	第437回	利付国債(2年)	0.005	500,000	500,585	2024/ 6 / 1
	第438回	利付国債(2年)	0.005	600,000	600,708	2024/ 7 / 1
	第439回	利付国債(2年)	0.005	1,550,000	1,551,844	2024/ 8 / 1
	第441回	利付国債(2年)	0.005	600,000	600,750	2024/10/ 1
	第442回	利付国債(2年)	0.005	1,200,000	1,201,584	2024/11/ 1
	第444回	利付国債(2年)	0.005	600,000	600,870	2025/ 1 / 1
	第445回	利付国債(2年)	0.005	500,000	500,665	2025/ 2 / 1
	第141回	利付国債(5年)	0.1	1,600,000	1,604,304	2024/ 9 /20
	第142回	利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,003,040	2024/12/20
	第143回	利付国債(5年)	0.1	400,000	401,260	2025/ 3 /20
	第144回	利付国債(5年)	0.1	1,100,000	1,103,652	2025/ 6 /20
	第145回	利付国債(5年)	0.1	1,800,000	1,806,174	2025/ 9 /20
	第146回	利付国債(5年)	0.1	2,150,000	2,157,181	2025/12/20
	第147回	利付国債(5年)	0.005	1,600,000	1,600,480	2026/ 3 /20
	第148回	利付国債(5年)	0.005	1,500,000	1,499,505	2026/ 6 /20
第149回	利付国債(5年)	0.005	1,500,000	1,497,870	2026/ 9 /20	
第150回	利付国債(5年)	0.005	1,600,000	1,595,760	2026/12/20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第151回 利付国債(5年)	0.005	1,000,000	995,980	2027/ 3 /20
	第152回 利付国債(5年)	0.1	300,000	299,937	2027/ 3 /20
	第153回 利付国債(5年)	0.005	1,500,000	1,491,360	2027/ 6 /20
	第154回 利付国債(5年)	0.1	1,600,000	1,594,944	2027/ 9 /20
	第155回 利付国債(5年)	0.3	600,000	602,844	2027/12/20
	第156回 利付国債(5年)	0.2	700,000	699,832	2027/12/20
	第 32 回 利付国債(30年)	2.3	500,000	589,890	2040/ 3 /20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	500,000	562,355	2030/ 3 /20
	第 1 回 利付国債(40年)	2.4	160,000	195,084	2048/ 3 /20
	第 2 回 利付国債(40年)	2.2	500,000	588,105	2049/ 3 /20
	第 3 回 利付国債(40年)	2.2	250,000	294,420	2050/ 3 /20
	第 4 回 利付国債(40年)	2.2	250,000	294,715	2051/ 3 /20
	第 5 回 利付国債(40年)	2.0	130,000	147,933	2052/ 3 /20
	第 6 回 利付国債(40年)	1.9	150,000	166,738	2053/ 3 /20
	第 7 回 利付国債(40年)	1.7	160,000	170,200	2054/ 3 /20
	第 8 回 利付国債(40年)	1.4	100,000	98,798	2055/ 3 /20
	第 9 回 利付国債(40年)	0.4	1,730,000	1,255,547	2056/ 3 /20
	第 10 回 利付国債(40年)	0.9	150,000	127,848	2057/ 3 /20
	第 11 回 利付国債(40年)	0.8	90,000	73,917	2058/ 3 /20
	第 12 回 利付国債(40年)	0.5	800,000	587,440	2059/ 3 /20
	第 13 回 利付国債(40年)	0.5	740,000	541,879	2060/ 3 /20
	第 14 回 利付国債(40年)	0.7	810,000	633,873	2061/ 3 /20
	第 15 回 利付国債(40年)	1.0	600,000	513,498	2062/ 3 /20
	第334回 利付国債(10年)	0.6	700,000	706,181	2024/ 6 /20
	第335回 利付国債(10年)	0.5	800,000	807,088	2024/ 9 /20
	第336回 利付国債(10年)	0.5	1,000,000	1,010,210	2024/12/20
	第337回 利付国債(10年)	0.3	1,000,000	1,006,620	2024/12/20
	第338回 利付国債(10年)	0.4	650,000	656,025	2025/ 3 /20
	第339回 利付国債(10年)	0.4	900,000	909,171	2025/ 6 /20
	第340回 利付国債(10年)	0.4	1,480,000	1,496,354	2025/ 9 /20
	第341回 利付国債(10年)	0.3	1,300,000	1,311,596	2025/12/20
	第342回 利付国債(10年)	0.1	800,000	802,544	2026/ 3 /20
	第343回 利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,203,348	2026/ 6 /20
	第344回 利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,202,328	2026/ 9 /20
	第345回 利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,000,940	2026/12/20
第346回 利付国債(10年)	0.1	800,000	799,832	2027/ 3 /20	
第347回 利付国債(10年)	0.1	750,000	748,717	2027/ 6 /20	
第348回 利付国債(10年)	0.1	900,000	897,156	2027/ 9 /20	
第349回 利付国債(10年)	0.1	1,260,000	1,254,015	2027/12/20	
第350回 利付国債(10年)	0.1	1,800,000	1,788,786	2028/ 3 /20	
第351回 利付国債(10年)	0.1	1,500,000	1,488,255	2028/ 6 /20	
第352回 利付国債(10年)	0.1	1,260,000	1,247,626	2028/ 9 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第353回 利付国債(10年)	0.1	1,300,000	1,284,829	2028/12/20
	第354回 利付国債(10年)	0.1	1,100,000	1,085,018	2029/ 3 /20
	第355回 利付国債(10年)	0.1	1,230,000	1,210,332	2029/ 6 /20
	第356回 利付国債(10年)	0.1	1,150,000	1,129,081	2029/ 9 /20
	第357回 利付国債(10年)	0.1	1,400,000	1,372,238	2029/12/20
	第358回 利付国債(10年)	0.1	1,300,000	1,272,869	2030/ 3 /20
	第359回 利付国債(10年)	0.1	1,300,000	1,267,890	2030/ 6 /20
	第360回 利付国債(10年)	0.1	1,700,000	1,651,176	2030/ 9 /20
	第361回 利付国債(10年)	0.1	1,100,000	1,065,009	2030/12/20
	第362回 利付国債(10年)	0.1	1,700,000	1,640,483	2031/ 3 /20
	第363回 利付国債(10年)	0.1	1,530,000	1,472,502	2031/ 6 /20
	第364回 利付国債(10年)	0.1	1,700,000	1,632,272	2031/ 9 /20
	第365回 利付国債(10年)	0.1	1,700,000	1,630,385	2031/12/20
	第366回 利付国債(10年)	0.2	1,600,000	1,548,448	2032/ 3 /20
	第367回 利付国債(10年)	0.2	1,200,000	1,185,936	2032/ 6 /20
	第368回 利付国債(10年)	0.2	780,000	788,860	2032/ 9 /20
	第369回 利付国債(10年)	0.5	1,300,000	1,300,000	2032/12/20
	第 1 回 利付国債(30年)	2.8	300,000	346,767	2029/ 9 /20
	第 2 回 利付国債(30年)	2.4	380,000	432,037	2030/ 2 /20
	第 3 回 利付国債(30年)	2.3	300,000	339,786	2030/ 5 /20
	第 5 回 利付国債(30年)	2.2	100,000	113,172	2031/ 5 /20
	第 6 回 利付国債(30年)	2.4	180,000	207,667	2031/11/20
	第 7 回 利付国債(30年)	2.3	300,000	345,834	2032/ 5 /20
	第 8 回 利付国債(30年)	1.8	300,000	332,733	2032/11/22
	第 9 回 利付国債(30年)	1.4	100,000	107,099	2032/12/20
	第12回 利付国債(30年)	2.1	300,000	342,399	2033/ 9 /20
	第13回 利付国債(30年)	2.0	300,000	339,633	2033/12/20
	第14回 利付国債(30年)	2.4	200,000	235,070	2034/ 3 /20
第15回 利付国債(30年)	2.5	200,000	237,534	2034/ 6 /20	
第16回 利付国債(30年)	2.5	500,000	594,505	2034/ 9 /20	
第17回 利付国債(30年)	2.4	200,000	235,870	2034/12/20	
第18回 利付国債(30年)	2.3	200,000	233,834	2035/ 3 /20	
第19回 利付国債(30年)	2.3	200,000	233,956	2035/ 6 /20	
第20回 利付国債(30年)	2.5	100,000	119,510	2035/ 9 /20	
第21回 利付国債(30年)	2.3	200,000	234,668	2035/12/20	
第22回 利付国債(30年)	2.5	200,000	239,852	2036/ 3 /20	
第23回 利付国債(30年)	2.5	100,000	120,058	2036/ 6 /20	
第24回 利付国債(30年)	2.5	320,000	384,809	2036/ 9 /20	
第25回 利付国債(30年)	2.3	100,000	117,823	2036/12/20	
第26回 利付国債(30年)	2.4	150,000	178,818	2037/ 3 /20	
第27回 利付国債(30年)	2.5	320,000	386,323	2037/ 9 /20	
第28回 利付国債(30年)	2.5	300,000	362,607	2038/ 3 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第 29 回 利付国債(30年)	2.4	200,000	239,106	2038/ 9 /20
	第 30 回 利付国債(30年)	2.3	350,000	413,164	2039/ 3 /20
	第 31 回 利付国債(30年)	2.2	400,000	465,808	2039/ 9 /20
	第 33 回 利付国債(30年)	2.0	400,000	452,928	2040/ 9 /20
	第 34 回 利付国債(30年)	2.2	550,000	640,568	2041/ 3 /20
	第 35 回 利付国債(30年)	2.0	520,000	588,889	2041/ 9 /20
	第 36 回 利付国債(30年)	2.0	480,000	543,715	2042/ 3 /20
	第 37 回 利付国債(30年)	1.9	330,000	368,019	2042/ 9 /20
	第 38 回 利付国債(30年)	1.8	800,000	877,528	2043/ 3 /20
	第 39 回 利付国債(30年)	1.9	330,000	367,986	2043/ 6 /20
	第 40 回 利付国債(30年)	1.8	350,000	383,971	2043/ 9 /20
	第 41 回 利付国債(30年)	1.7	300,000	323,877	2043/12/20
	第 42 回 利付国債(30年)	1.7	130,000	140,327	2044/ 3 /20
	第 43 回 利付国債(30年)	1.7	340,000	366,958	2044/ 6 /20
	第 44 回 利付国債(30年)	1.7	350,000	377,688	2044/ 9 /20
	第 45 回 利付国債(30年)	1.5	420,000	437,228	2044/12/20
	第 46 回 利付国債(30年)	1.5	350,000	364,171	2045/ 3 /20
	第 47 回 利付国債(30年)	1.6	500,000	529,580	2045/ 6 /20
	第 48 回 利付国債(30年)	1.4	500,000	509,600	2045/ 9 /20
	第 49 回 利付国債(30年)	1.4	420,000	428,135	2045/12/20
	第 50 回 利付国債(30年)	0.8	350,000	315,066	2046/ 3 /20
	第 51 回 利付国債(30年)	0.3	250,000	200,122	2046/ 6 /20
	第 52 回 利付国債(30年)	0.5	400,000	334,484	2046/ 9 /20
	第 53 回 利付国債(30年)	0.6	400,000	341,368	2046/12/20
	第 54 回 利付国債(30年)	0.8	410,000	365,756	2047/ 3 /20
	第 55 回 利付国債(30年)	0.8	390,000	346,955	2047/ 6 /20
	第 56 回 利付国債(30年)	0.8	650,000	576,660	2047/ 9 /20
	第 57 回 利付国債(30年)	0.8	340,000	300,522	2047/12/20
	第 58 回 利付国債(30年)	0.8	480,000	423,076	2048/ 3 /20
	第 59 回 利付国債(30年)	0.7	400,000	343,220	2048/ 6 /20
	第 60 回 利付国債(30年)	0.9	340,000	305,428	2048/ 9 /20
	第 61 回 利付国債(30年)	0.7	120,000	102,338	2048/12/20
	第 62 回 利付国債(30年)	0.5	250,000	201,680	2049/ 3 /20
	第 63 回 利付国債(30年)	0.4	250,000	195,390	2049/ 6 /20
	第 64 回 利付国債(30年)	0.4	310,000	241,372	2049/ 9 /20
	第 65 回 利付国債(30年)	0.4	310,000	240,919	2049/12/20
	第 66 回 利付国債(30年)	0.4	290,000	224,535	2050/ 3 /20
	第 67 回 利付国債(30年)	0.6	700,000	571,375	2050/ 6 /20
	第 68 回 利付国債(30年)	0.6	600,000	488,568	2050/ 9 /20
	第 69 回 利付国債(30年)	0.7	200,000	167,142	2050/12/20
	第 70 回 利付国債(30年)	0.7	360,000	300,196	2051/ 3 /20
	第 71 回 利付国債(30年)	0.7	680,000	565,773	2051/ 6 /20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第 72 回 利付国債(30年)	0.7	580,000	483,406	2051/ 9 /20
	第 73 回 利付国債(30年)	0.7	720,000	598,766	2051/12/20
	第 74 回 利付国債(30年)	1.0	520,000	468,358	2052/ 3 /20
	第 75 回 利付国債(30年)	1.3	400,000	388,464	2052/ 6 /20
	第 76 回 利付国債(30年)	1.4	260,000	258,648	2052/ 9 /20
	第 77 回 利付国債(30年)	1.6	340,000	353,549	2052/12/20
	第 70 回 利付国債(20年)	2.4	600,000	619,218	2024/ 6 /20
	第 72 回 利付国債(20年)	2.1	600,000	620,112	2024/ 9 /20
	第 74 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	311,661	2024/12/20
	第 76 回 利付国債(20年)	1.9	200,000	207,968	2025/ 3 /20
	第 77 回 利付国債(20年)	2.0	300,000	312,561	2025/ 3 /20
	第 78 回 利付国債(20年)	1.9	250,000	261,135	2025/ 6 /20
	第 80 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	104,912	2025/ 6 /20
	第 81 回 利付国債(20年)	2.0	200,000	210,344	2025/ 9 /20
	第 83 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	317,748	2025/12/20
	第 85 回 利付国債(20年)	2.1	200,000	212,780	2026/ 3 /20
	第 88 回 利付国債(20年)	2.3	400,000	430,032	2026/ 6 /20
	第 89 回 利付国債(20年)	2.2	400,000	428,720	2026/ 6 /20
	第 90 回 利付国債(20年)	2.2	300,000	322,845	2026/ 9 /20
	第 91 回 利付国債(20年)	2.3	300,000	323,907	2026/ 9 /20
	第 92 回 利付国債(20年)	2.1	340,000	366,081	2026/12/20
	第 93 回 利付国債(20年)	2.0	300,000	322,908	2027/ 3 /20
	第 94 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	324,114	2027/ 3 /20
	第 95 回 利付国債(20年)	2.3	150,000	163,843	2027/ 6 /20
	第 96 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	108,376	2027/ 6 /20
	第 97 回 利付国債(20年)	2.2	150,000	163,753	2027/ 9 /20
	第 98 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	108,719	2027/ 9 /20
	第 99 回 利付国債(20年)	2.1	200,000	218,076	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	200,000	219,776	2028/ 3 /20
	第101回 利付国債(20年)	2.4	100,000	110,884	2028/ 3 /20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	200,000	222,556	2028/ 6 /20
	第103回 利付国債(20年)	2.3	200,000	221,512	2028/ 6 /20
	第104回 利付国債(20年)	2.1	150,000	164,566	2028/ 6 /20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	100,000	110,018	2028/ 9 /20
	第106回 利付国債(20年)	2.2	200,000	221,128	2028/ 9 /20
	第107回 利付国債(20年)	2.1	100,000	110,305	2028/12/20
	第108回 利付国債(20年)	1.9	100,000	109,166	2028/12/20
	第109回 利付国債(20年)	1.9	200,000	218,774	2029/ 3 /20
	第110回 利付国債(20年)	2.1	200,000	221,144	2029/ 3 /20
	第111回 利付国債(20年)	2.2	200,000	222,900	2029/ 6 /20
	第112回 利付国債(20年)	2.1	200,000	221,668	2029/ 6 /20
	第113回 利付国債(20年)	2.1	200,000	222,162	2029/ 9 /20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第114回 利付国債(20年)	2.1	300,000	334,260	2029/12/20
	第115回 利付国債(20年)	2.2	500,000	560,410	2029/12/20
	第118回 利付国債(20年)	2.0	300,000	333,399	2030/ 6 /20
	第122回 利付国債(20年)	1.8	500,000	548,420	2030/ 9 /20
	第123回 利付国債(20年)	2.1	300,000	336,237	2030/12/20
	第126回 利付国債(20年)	2.0	300,000	334,245	2031/ 3 /20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	400,000	442,576	2031/ 3 /20
	第128回 利付国債(20年)	1.9	500,000	553,940	2031/ 6 /20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	400,000	440,600	2031/ 9 /20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	400,000	437,828	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	300,000	330,882	2031/12/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	400,000	438,460	2032/ 3 /20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	450,000	489,195	2032/ 3 /20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	400,000	439,092	2032/ 6 /20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	300,000	326,679	2032/ 6 /20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	300,000	329,775	2032/ 9 /20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	300,000	329,901	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	300,000	332,670	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	400,000	436,208	2033/ 3 /20
	第144回 利付国債(20年)	1.5	500,000	540,545	2033/ 3 /20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	450,000	495,319	2033/ 6 /20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	520,000	572,442	2033/ 9 /20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	560,000	610,864	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	500,000	540,145	2034/ 3 /20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	630,000	680,229	2034/ 6 /20
	第150回 利付国債(20年)	1.4	470,000	501,908	2034/ 9 /20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	550,000	574,629	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	750,000	782,505	2035/ 3 /20
	第153回 利付国債(20年)	1.3	750,000	790,185	2035/ 6 /20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	840,000	874,305	2035/ 9 /20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	800,000	812,904	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	620,000	583,488	2036/ 3 /20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	400,000	365,248	2036/ 6 /20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	570,000	540,525	2036/ 9 /20
第159回 利付国債(20年)	0.6	500,000	479,245	2036/12/20	
第160回 利付国債(20年)	0.7	750,000	726,772	2037/ 3 /20	
第161回 利付国債(20年)	0.6	550,000	524,133	2037/ 6 /20	
第162回 利付国債(20年)	0.6	900,000	855,387	2037/ 9 /20	
第163回 利付国債(20年)	0.6	700,000	663,068	2037/12/20	
第164回 利付国債(20年)	0.5	400,000	372,156	2038/ 3 /20	
第165回 利付国債(20年)	0.5	450,000	417,118	2038/ 6 /20	
第166回 利付国債(20年)	0.7	710,000	675,891	2038/ 9 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第167回 利付国債(20年)	0.5	500,000	459,950	2038/12/20
	第168回 利付国債(20年)	0.4	400,000	360,600	2039/ 3 /20
	第169回 利付国債(20年)	0.3	370,000	326,406	2039/ 6 /20
	第170回 利付国債(20年)	0.3	420,000	368,848	2039/ 9 /20
	第171回 利付国債(20年)	0.3	400,000	349,692	2039/12/20
	第172回 利付国債(20年)	0.4	500,000	443,105	2040/ 3 /20
	第173回 利付国債(20年)	0.4	1,100,000	971,223	2040/ 6 /20
	第174回 利付国債(20年)	0.4	900,000	791,649	2040/ 9 /20
	第175回 利付国債(20年)	0.5	480,000	428,544	2040/12/20
	第176回 利付国債(20年)	0.5	600,000	533,766	2041/ 3 /20
	第177回 利付国債(20年)	0.4	820,000	713,588	2041/ 6 /20
	第178回 利付国債(20年)	0.5	750,000	662,835	2041/ 9 /20
	第179回 利付国債(20年)	0.5	1,170,000	1,030,992	2041/12/20
	第180回 利付国債(20年)	0.8	820,000	762,083	2042/ 3 /20
	第181回 利付国債(20年)	0.9	480,000	453,537	2042/ 6 /20
	第182回 利付国債(20年)	1.1	400,000	390,884	2042/ 9 /20
	第183回 利付国債(20年)	1.4	700,000	718,935	2042/12/20
第 2 回	メキシコ合衆国	1.25	100,000	98,939	2027/ 9 / 8
第 26 回	メキシコ合衆国	0.85	100,000	99,590	2025/ 4 /18
	小 計		142,050,000	141,347,597	
地 方 債 証 券	第739回 東京都公募公債	0.29	100,000	100,439	2024/12/20
	第746回 東京都公募公債	0.499	100,000	100,983	2025/ 6 /20
	第751回 東京都公募公債	0.37	100,000	100,764	2025/12/19
	第759回 東京都公募公債	0.075	100,000	99,683	2026/ 9 /18
	第770回 東京都公募公債	0.18	100,000	99,661	2027/ 6 /18
	第800回 東京都公募公債	0.08	200,000	193,584	2029/12/20
	第 6 回 東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	103,936	2025/ 3 /19
	第 7 回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	105,285	2025/ 9 /19
	第 12 回 東京都公募公債(20年)	2.31	100,000	109,071	2027/ 9 /17
	第 13 回 東京都公募公債(20年)	2.15	100,000	108,639	2027/12/20
	第 26 回 東京都公募公債(20年)	1.74	100,000	108,540	2032/ 6 /18
	平成27年度第 9 回 北海道公募公債	0.486	100,000	101,034	2025/10/30
	平成27年度第 13 回 北海道公募公債	0.469	100,000	101,004	2025/12/25
	平成29年度第 15 回 北海道公募公債	0.23	100,000	99,411	2028/ 2 /28
	平成30年度第 18 回 北海道公募公債	0.146	20,000	19,611	2029/ 2 /28
	第 30 回 2号宮城県公募公債(10年)	0.53	100,000	100,807	2024/10/29
	第 3 回 神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	119,883	2037/ 3 /19
	第 14 回 神奈川県公募公債(20年)	1.969	100,000	109,489	2030/ 7 /19
	第 18 回 神奈川県公募公債(20年)	1.825	50,000	54,281	2031/11/14
	第 27 回 神奈川県公募公債(20年)	1.398	100,000	104,818	2034/ 9 /20
	第 36 回 神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	93,299	2037/12/18
	第374回 大阪府公募公債(10年)	0.938	34,000	34,123	2023/ 7 /28

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第387回 大阪府公募公債(10年)	0.521	44,040	44,350	2024/ 8 /28
	第392回 大阪府公募公債(10年)	0.36	100,000	100,576	2025/ 1 /29
	第469回 大阪府公募公債(10年)	0.128	100,000	94,908	2031/ 6 /27
	第479回 大阪府公募公債(10年)	0.29	104,000	99,590	2032/ 5 /28
	第 2 回 大阪府公募公債(20年)	2.23	100,000	110,788	2029/11/16
	平成25年度第 10 回 京都府公募公債(15年)	1.14	100,000	103,919	2028/10/13
	平成27年度第 2 回 京都府公募公債(15年)	0.729	100,000	100,920	2030/ 4 /26
	令和元年度第 8 回 京都府公募公債(30年)	0.3	100,000	73,235	2049/ 6 /18
	平成29年度第22回 兵庫県公募公債	0.19	100,000	99,278	2028/ 1 /21
	第 2 回 兵庫県公募公債(30年)	2.36	100,000	116,670	2040/ 3 /19
	第 3 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	104,658	2027/ 7 /16
	第 6 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	105,066	2028/ 7 /14
	第 4 回 兵庫県公募公債(12年)	0.73	100,000	101,981	2026/ 8 / 6
	平成26年度第 9 回 静岡県公募公債	0.554	20,000	20,168	2024/10/24
	令和2年度第 9 回 静岡県公募公債	0.12	100,000	95,943	2030/ 9 /20
	第 3 回 静岡県公募公債(20年)	2.35	100,000	107,665	2026/ 9 /18
	第 10 回 静岡県公募公債(20年)	2.072	100,000	110,229	2030/ 6 /14
	第 11 回 静岡県公募公債(20年)	1.841	150,000	162,676	2030/10/18
	平成24年度第 12 回 愛知県公募公債(30年)	2.12	10,000	11,312	2042/ 9 /19
	平成24年度第 14 回 愛知県公募公債(15年)	1.314	100,000	104,651	2027/12/13
	平成27年度第 12 回 愛知県公募公債(15年)	0.759	100,000	100,497	2030/10/21
	平成29年度第 6 回 愛知県公募公債(10年)	0.22	100,000	99,762	2027/ 7 /28
	平成30年度第 6 回 愛知県公募公債(30年)	0.777	100,000	84,573	2048/ 6 /19
	令和3年度第 4 回 愛知県公募公債(20年)	0.481	100,000	86,821	2041/ 6 /11
	平成28年度第 1 回 広島県公募公債	0.08	100,000	99,855	2026/ 5 /25
	平成29年度第 5 回 広島県公募公債	0.245	100,000	99,566	2028/ 1 /25
	平成26年度第 1 回 広島県公募公債(20年)	1.41	100,000	104,935	2034/ 9 /12
	平成26年度第 5 回 埼玉県公募公債	0.611	100,000	100,812	2024/ 7 /29
	平成29年度第 4 回 埼玉県公募公債	0.19	100,000	99,681	2027/ 6 /22
	第 11 回 埼玉県公募公債(30年)	0.451	100,000	76,834	2049/ 3 /19
	第 12 回 埼玉県公募公債(30年)	0.474	100,000	76,795	2049/12/20
	第 29 回 埼玉県公募公債(20年)	0.476	100,000	86,135	2041/12/13
	平成28年度第 6 回 福岡県公募公債	0.175	100,000	99,905	2026/12/22
	平成29年度第 1 回 福岡県公募公債	0.2	100,000	99,723	2027/ 6 /23
	令和3年度第 6 回 福岡県公募公債	0.189	100,000	94,802	2032/ 1 /19
	平成30年度第 2 回 福岡県公募公債(15年)	0.542	100,000	96,657	2033/10/17
	第 15 回 千葉県公募公債(20年・定時償還)	0.235	95,000	91,776	2041/10/15
	第 10 回 千葉県公募公債(20年)	1.8	100,000	108,199	2031/ 8 /18
	第 13 回 千葉県公募公債(20年)	1.701	100,000	109,021	2032/10/15
	第 24 回 千葉県公募公債	0.559	100,000	92,116	2038/ 4 /15
令和3年度第 1 回 新潟県公募公債	0.415	100,000	85,496	2041/ 8 /16	
第 24 回 群馬県公募公債(10年)	0.08	100,000	94,310	2031/ 8 /18	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	第129回 共同発行市場公募地方債	0.71	100,000	100,547	2023/12/25
	第130回 共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	100,649	2024/ 1 /25
	第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	100,806	2024/ 7 /25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	100,778	2024/ 8 /23
	第147回 共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	101,101	2025/ 6 /25
	第157回 共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	99,874	2026/ 4 /24
	第181回 共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	99,050	2028/ 4 /25
	第184回 共同発行市場公募地方債	0.175	100,000	98,866	2028/ 7 /25
	第188回 共同発行市場公募地方債	0.264	30,000	29,713	2028/11/24
	第206回 共同発行市場公募地方債	0.131	100,000	96,692	2030/ 5 /24
	第209回 共同発行市場公募地方債	0.125	100,000	96,144	2030/ 8 /23
	第211回 共同発行市場公募地方債	0.125	100,000	95,860	2030/10/25
	令和2年度第 3 回 長崎県公募公債(10年)	0.13	12,400	11,972	2030/ 6 /20
	平成30年度第 1 回 熊本市公募公債	0.264	100,000	99,015	2028/11/30
	第 5 回 大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	111,178	2028/ 9 /21
	第 13 回 大阪市公募公債(20年)	2.08	50,000	55,142	2030/ 6 /14
	第 2 回 名古屋市公募公債(15年)	0.905	100,000	102,295	2029/11/16
	第 6 回 京都市公募公債(20年)	2.38	200,000	218,720	2027/ 9 /17
	第 2 回 横浜市公募公債(30年)	2.49	100,000	116,957	2035/ 3 /20
	第 4 回 横浜市公募公債(30年)	2.54	100,000	118,593	2036/12/19
	第 14 回 横浜市公募公債(20年)	2.32	100,000	109,741	2028/ 3 /17
	平成27年度第 4 回 札幌市公募公債(10年)	0.51	100,000	101,008	2025/ 6 /20
	平成29年度第 3 回 札幌市公募公債(10年)	0.23	100,000	99,872	2027/ 6 /18
	第 6 回 札幌市公募公債(20年)	2.24	100,000	110,547	2029/ 6 /20
	第 4 回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	110,276	2028/ 6 /20
	第 14 回 川崎市公募公債(20年)	1.79	100,000	108,307	2032/ 3 /19
	第 11 回 川崎市公募公債(30年)	0.817	100,000	85,620	2048/ 3 /19
	第 12 回 川崎市公募公債(30年)	0.474	100,000	76,795	2049/12/20
	平成24年度第 8 回 福岡市公募公債	0.68	100,000	100,032	2023/ 3 /24
	平成28年度第 5 回 広島市公募公債	0.24	100,000	100,078	2027/ 2 /26
	平成30年度第 6 回 広島市公募公債	0.146	145,000	142,311	2029/ 2 /22
	平成25年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.75	100,000	100,652	2024/ 1 /31
平成27年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.395	100,000	100,838	2026/ 1 /29	
平成29年度第 1 回 秋田県公募公債	0.2	145,900	144,741	2028/ 3 /24	
第120回 愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	0.699	100,000	100,458	2023/12/20	
第135回 福岡北九州高速道路債券	0.5	100,000	100,610	2025/ 3 /19	
第160回 福岡北九州高速道路債券	0.573	100,000	87,394	2041/ 3 /22	
	小 計		9,810,340	9,858,436	
特 殊 債 券 (除く金融債)	F116回 地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	104,791	2027/ 4 /23
	F149回 地方公共団体金融機構債券	1.145	100,000	102,849	2025/12/19
	第 46 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	33,000	33,005	2023/ 3 /17
	第 28 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.396	100,000	103,590	2033/ 4 /28

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	F181回 地方公共団体金融機構債券	1.109	100,000	103,127	2026/ 7 /28
	F190回 地方公共団体金融機構債券	0.792	100,000	101,188	2024/10/24
	第 60 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	100,000	100,803	2024/ 5 /21
	第 61 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.644	100,000	100,827	2024/ 6 /14
	第 66 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.495	100,000	100,826	2024/11/18
	第 68 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.32	14,000	14,079	2025/ 1 /20
	第 76 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.425	100,000	100,982	2025/ 9 /12
	F308回 地方公共団体金融機構債券	1.192	100,000	100,817	2037/ 3 /19
	第 89 回 地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,457	2026/10/28
	第 98 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	99,698	2027/ 7 /16
	第 99 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	99,628	2027/ 8 /13
	第 68 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	0.53	100,000	90,704	2038/ 7 /28
	第112回 地方公共団体金融機構債券	0.269	100,000	98,779	2028/ 9 /28
	F438回 地方公共団体金融機構債券	0.123	100,000	99,917	2026/ 3 /27
	第114回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.209	100,000	99,020	2028/11/14
	F538回 地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	99,706	2025/12/25
	第145回 地方公共団体金融機構債券	0.13	100,000	94,665	2031/ 6 /27
	第 8 回 公営企業債券(30年)	2.5	10,000	11,628	2035/ 9 /21
	第 13 回 公営企業債券(20年)	2.16	10,000	10,469	2025/ 6 /20
	第 22 回 公営企業債券(20年)	2.32	100,000	108,387	2027/ 6 /18
	第 10 回 日本政策金融公庫社債	2.167	100,000	110,429	2030/ 3 /19
	第 47 回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	100,000	99,259	2027/ 9 /24
	第 53 回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	162,000	160,635	2028/ 9 /15
	第 6 回 政府保証新関西国際空港債券	0.155	100,000	99,604	2027/ 8 /27
	第 55 回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.105	100,000	98,115	2029/ 3 /19
	第 84 回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.4	100,000	120,040	2049/ 6 /30
	第 12 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.52	100,000	107,595	2026/ 6 /19
	第 18 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.87	100,000	124,697	2046/12/20
	第 22 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	100,000	120,796	2047/ 3 /20
	第 23 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	120,000	130,490	2027/ 7 /20
	第 26 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.67	10,000	11,915	2037/ 9 /18
	第123回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	100,000	100,636	2024/ 3 /19
	第125回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.665	100,000	100,610	2024/ 3 /19
	第134回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.529	100,000	100,605	2024/ 6 /20
	第171回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	100,000	110,114	2032/ 8 /31
	第186回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.668	100,000	100,017	2023/ 3 /17
第189回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.541	100,000	100,077	2023/ 4 /28	
第196回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.779	100,000	109,609	2033/ 7 /29	
第200回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	1,000	1,004	2023/ 9 /29	
第204回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	100,000	100,489	2023/11/30	
第207回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.693	100,000	100,556	2023/12/28	
第215回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.669	2,000	2,015	2024/ 4 /30	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第231回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.495	100,000	100,842	2024/11/29
	第234回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	13,000	13,106	2024/12/27
	第237回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.97	100,000	100,499	2035/ 1 /31
	第252回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	100,000	103,274	2035/ 7 /31
	第266回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	100,000	100,739	2026/ 1 /30
	第312回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.11	100,000	99,563	2027/ 5 /31
	第331回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.566	100,000	93,103	2037/11/30
	第337回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.591	100,000	93,184	2038/ 1 /29
	第342回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	13,000	12,886	2028/ 3 /31
	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	100,000	93,036	2038/ 8 /31
	第362回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.838	100,000	86,811	2048/ 9 /30
	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	100,000	89,352	2039/ 3 /31
	第404回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.306	100,000	73,815	2050/ 3 /31
	第 11 回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	104,113	2025/ 3 /24
	第 7 回 阪神高速道路債券	2.18	100,000	104,133	2025/ 3 /21
	第 18 回 政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	100,019	2023/ 3 /22
	第 21 回 政府保証中部国際空港債券	0.45	100,000	100,864	2025/ 3 /17
	第 3 回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	100,000	107,794	2027/ 3 /19
	第 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	21,236	21,439	2042/ 6 /10
	第 30 回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.08	100,000	102,606	2024/ 6 /20
	第 30 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	19,887	20,896	2044/11/10
	第 36 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	19,219	20,062	2045/ 5 /10
	第 38 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	21,513	22,352	2045/ 7 /10
	第 39 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	20,706	21,427	2045/ 8 /10
	第 43 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	49,032	51,072	2045/12/10
	第 45 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	19,538	20,392	2046/ 2 /10
	第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	26,856	27,793	2046/12/10
	第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	27,955	28,881	2047/ 5 /10
	第106回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.794	100,000	108,632	2032/ 6 /18
	第108回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.434	100,000	104,643	2027/ 6 /18
	第 96 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	54,967	54,818	2050/ 5 /10
	第101回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.89	56,300	56,544	2050/10/10
	第106回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	62,218	61,002	2051/ 3 /10
	第110回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.23	137,952	132,824	2051/ 7 /10
	第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	71,629	69,493	2051/12/10
	第203回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.24	100,000	99,740	2027/ 3 /19
	第119回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	72,281	70,279	2052/ 4 /10
	第215回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.23	100,000	99,388	2027/ 8 /20
	第125回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	74,532	72,096	2052/10/10
	第132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	76,611	73,869	2053/ 5 /10
第133回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	77,637	74,944	2053/ 6 /10	
第135回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	78,962	75,973	2053/ 8 /10	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	79,468	76,864	2053/10/10
	第138回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	78,921	76,513	2053/11/10
	第139回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	79,465	76,778	2053/12/10
	第 3 回 貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	39,773	39,439	2033/ 1 /10
	第168回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	92,038	87,841	2056/ 5 /10
	第170回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	93,189	88,582	2056/ 7 /10
	第171回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.31	94,385	89,274	2056/ 8 /10
	第173回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.33	94,702	89,641	2056/10/10
	第174回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.38	94,763	90,133	2056/11/10
	第176回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	95,687	90,411	2057/ 1 /10
	第177回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	96,012	91,343	2057/ 2 /10
	第178回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.48	95,779	91,807	2057/ 3 /10
	第 34 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	11,272	11,431	2040/ 9 /10
	第 38 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.91	9,526	9,538	2041/ 1 /10
	第 29 回 西日本高速道路株式会社債	0.31	200,000	200,524	2026/ 2 /12
	第 63 回 西日本高速道路株式会社債	0.001	100,000	99,950	2023/12/11
	第 64 回 西日本高速道路株式会社債	0.04	100,000	99,038	2026/ 9 /18
	第 65 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	100,744	2024/ 5 /29
	第 68 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.586	100,000	100,738	2024/ 8 / 5
	第118回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.663	100,000	92,327	2038/ 8 /27
	第 7 回 本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	104,794	2025/ 6 /20
	第 9 回 新関西国際空港	1.231	100,000	103,473	2028/12/20
	第 78 回 株式会社日本政策投資銀行	0.225	100,000	99,629	2027/ 4 /13
	第 96 回 株式会社日本政策投資銀行	0.195	100,000	98,564	2028/ 7 /12
	第168回 株式会社日本政策投資銀行	0.854	100,000	99,819	2033/ 1 /19
	第 37 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	110,154	2028/ 6 /20
	第 49 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	110,901	2029/ 5 /18
	第 90 回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	110,389	2029/ 9 /28
	第172回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.919	100,000	110,308	2042/ 8 /29
	第 28 回 道路債券	2.83	200,000	236,128	2033/12/20
	第 4 回 公営企業債券(30年)	2.95	100,000	120,129	2034/ 3 /24
	第 20 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8	100,000	107,804	2032/ 1 /28
第 23 回 国際協力銀行債券	2.09	100,000	105,432	2025/12/19	
第 3 回 都市再生債券	2.87	100,000	103,611	2024/ 6 /20	
第 96 回 都市再生債券	0.599	100,000	100,815	2024/ 9 /20	
第 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	9,993	10,009	2042/12/10	
第 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1	10,682	10,785	2043/ 1 /10	
第 25 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	32,970	34,644	2044/ 6 /10	
第 28 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	18,549	19,444	2044/ 9 /10	
第 29 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	20,217	21,249	2044/10/10	
第 31 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	20,334	21,325	2044/12/10	
第 32 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	19,498	20,342	2045/ 1 /10	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除く金融債)	第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	24,904	25,751	2045/11/10
	第 66 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	34,461	35,244	2047/11/10
	第 69 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	37,066	38,191	2048/ 2 /10
	第 70 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	32,623	33,544	2048/ 3 /10
	第 71 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	30,992	31,624	2048/ 4 /10
	第 79 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	32,548	33,204	2048/12/10
	第146回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.757	100,000	100,617	2024/ 1 /19
	第 81 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	36,221	36,936	2049/ 2 /10
	第149回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.704	100,000	100,656	2024/ 3 /19
	第157回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	100,675	2025/ 5 /20
	第 5 回 国際協力機構債券	1.918	100,000	108,674	2030/ 9 /13
	第 85 回 中日本高速道路株式会社債	0.07	100,000	99,686	2025/10/21
	小 計		11,393,069	11,564,042	
金 融 債 券	い第855号商工債	0.08	100,000	99,349	2026/ 8 /27
	い第856号商工債	0.09	100,000	99,330	2026/ 9 /25
	第352回 信金中金債(5年)	0.07	100,000	99,973	2024/ 3 /27
	第364回 信金中金債(5年)	0.01	100,000	99,765	2025/ 3 /27
	第377回 信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,562	2026/ 4 /27
	第378回 信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,519	2026/ 5 /27
	第379回 信金中金債(5年)	0.04	100,000	99,489	2026/ 6 /26
	第41号商工債(10年)	0.4	100,000	94,863	2032/ 3 /19
	小 計		800,000	791,850	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第506回 中部電力	0.695	100,000	101,014	2025/ 9 /25
	第517回 中部電力	0.706	100,000	90,079	2036/12/25
	第545回 中部電力	0.3	100,000	92,523	2031/ 7 /25
	第510回 関西電力	0.49	100,000	99,171	2027/ 7 /23
	第524回 関西電力	0.514	100,000	97,850	2028/10/25
	第422回 中国電力	0.35	100,000	95,131	2030/ 4 /25
	第426回 中国電力	0.33	100,000	94,554	2030/ 7 /25
	第432回 中国電力	0.04	100,000	99,593	2025/ 1 /24
	第323回 北陸電力	0.858	100,000	91,096	2037/ 6 /25
	第521回 東北電力	0.45	200,000	191,122	2030/ 5 /24
	第534回 東北電力	0.51	100,000	85,134	2038/ 6 /25
	第540回 東北電力	0.19	100,000	98,421	2027/ 1 /25
	第298回 四国電力	0.962	100,000	85,839	2043/ 4 /24
	第465回 九州電力	0.38	100,000	97,428	2028/ 7 /25
	第489回 九州電力	0.44	200,000	190,734	2030/ 5 /24
	第350回 北海道電力	0.754	100,000	88,508	2038/ 3 /25
	第 6 回 東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	99,126	2027/ 8 /31
	第 26 回 東京電力パワーグリッド	1.31	100,000	94,991	2034/ 4 /24
	第 30 回 大和ハウス工業	0.53	100,000	99,868	2027/10/27
	第 21 回 キリンホールディングス	0.29	100,000	99,234	2027/ 6 / 7

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)	第15回 東急不動産ホールディングス	0.78	100,000	99,989	2032/10/20
	第22回 三菱瓦斯化学	0.17	100,000	99,806	2025/ 9 / 3
	第23回 株式会社三菱ケミカルホールディングス	0.85	200,000	184,536	2036/ 6 / 9
	第21回 株式会社オリエンタルランド	0.04	100,000	99,863	2025/ 1 /20
	第 8 回 楽天	0.32	100,000	96,542	2024/ 6 /25
	第 4 回 ENEOSホールディングス	0.834	100,000	98,414	2032/ 6 /15
	第15回 大同特殊鋼	0.425	100,000	99,413	2027/ 9 / 1
	第59回 日本電気	0.46	100,000	99,154	2027/ 7 /12
	第49回 株式会社 I H I	0.39	100,000	99,074	2027/ 6 / 4
	第14回 トヨタ自動車	0.963	100,000	100,038	2023/ 3 /20
	第26回 トヨタ自動車	0.05	100,000	99,442	2026/ 3 /18
	第60回 住友商事	0.574	100,000	97,298	2032/ 5 /24
	第21回 三井住友信託銀行	0.15	100,000	98,797	2026/11/ 6
	第 3 回 NTTファイナンス	0.529	100,000	97,209	2031/12/19
	第20回 NTTファイナンス	0.001	100,000	99,742	2024/10/28
	第72回 ホンダファイナンス	0.03	100,000	99,674	2024/12/19
	第73回 ホンダファイナンス	0.1	100,000	98,961	2026/12/18
	第96回 トヨタファイナンス	0.06	200,000	199,010	2026/ 4 /15
	第28回 リコーリース	0.345	100,000	98,792	2027/ 7 /20
	第67回 三菱UFJリース	0.39	100,000	96,919	2029/ 4 /11
	第65回 三菱地所	2.04	100,000	110,148	2032/12/20
	第134回 三菱地所	0.16	100,000	97,897	2028/ 6 /21
	第18回 イオンモール	1.05	100,000	89,192	2038/ 7 / 2
	第44回 相鉄ホールディングス	0.36	100,000	98,963	2027/ 6 /15
	第11回 東急	0.479	100,000	94,782	2032/ 6 / 1
	第32回 東日本旅客鉄道	2.26	100,000	102,144	2024/ 3 /19
	第107回 東日本旅客鉄道	1.415	200,000	189,542	2045/ 1 /27
	第122回 東日本旅客鉄道	1.119	100,000	80,029	2057/ 1 /26
	第127回 東日本旅客鉄道	0.675	100,000	90,615	2038/ 1 /26
	第130回 東日本旅客鉄道	0.295	100,000	98,018	2028/ 9 /27
	第152回 東日本旅客鉄道	0.09	100,000	99,660	2025/ 7 /18
	第 52 回 西日本旅客鉄道	1.157	100,000	80,535	2058/ 4 /25
	第45回 東海旅客鉄道	2.321	100,000	109,566	2029/ 6 /19
第47回 東海旅客鉄道	2.375	100,000	112,634	2039/12/16	
第 4 回 東京地下鉄	2.38	10,000	10,668	2026/ 6 /19	
第13回 東京地下鉄	1.702	100,000	106,571	2032/ 5 /25	
第47回 阪急阪神ホールディングス	1.202	100,000	102,287	2029/ 7 /18	
第25回 日本郵船	2.65	100,000	107,308	2026/ 6 /22	
第10回 九州旅客鉄道	0.616	100,000	83,513	2041/12/ 9	
第32回 ANAホールディングス	0.99	100,000	87,503	2036/ 6 / 9	
第14回 ソフトバンク	0.24	100,000	98,635	2026/10/ 9	
第31回 光通信	1.38	100,000	82,928	2036/ 2 / 1	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)	第 11 回 電源開発	2.05	100,000	103,576	2025/ 3 /19
	第 58 回 電源開発	0.705	100,000	87,627	2038/ 7 /20
	第 31 回 東京電力パワーグリッド	0.98	100,000	97,441	2029/10/ 9
	第 35 回 東京電力パワーグリッド	1.2	100,000	98,356	2030/ 4 /23
	第 28 回 東京瓦斯	2.29	100,000	107,655	2027/ 6 /15
	第 67 回 東京瓦斯	0.822	100,000	77,980	2051/ 7 /13
	第 45 回 東邦瓦斯	0.394	100,000	93,864	2032/ 5 /26
	第 30 回 フランス相互信用連合銀行	0.317	100,000	97,605	2026/10/ 9
	第 36 回 フランス相互信用連合銀行	0.315	100,000	95,151	2028/10/20
	第 18 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.329	100,000	99,268	2025/ 1 /24
	第 14 回 クレディ・アグリコル・エス・エー	0.459	100,000	97,670	2027/ 6 / 9
	第 23 回 ルノー	1.03	100,000	99,970	2023/ 7 / 6
第 10 回 オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.293	100,000	99,980	2024/ 1 /23	
	小 計		7,910,000	7,643,370	
	合 計		171,963,409	171,205,296	

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

(注2) 金額の単位未満は切り捨てています。

当期末における株式および新株予約権証券の残高はありません。

◎投資信託財産の構成('23年3月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 171,205,296	% 99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	816,867	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	172,022,163	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

◎資産、負債、元本および基準価額の状況

('23年3月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	172,022,163,740
コーポレート債等	386,803,154
公社債(評価額)	171,205,296,163
未収利息	420,443,547
前払費用	9,620,876
(B) 負 債	147,739,564
未払解約金	147,737,466
未払利息	1,027
その他未払費用	1,071
(C) 純資産総額(A-B)	171,874,424,176
元本	140,194,933,687
次期繰越損益金	31,679,490,489
(D) 受益権総口数	140,194,933,687口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	12,260円

(注1) 期首元本額 142,436,642,156円
 期中追加設定元本額 12,308,510,433円
 期中一部解約元本額 14,550,218,902円

(注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペビーフアンド別内訳は、次の通りです。

日本債券インデックス・ファンドF<適格機関投資家限定>	57,508,761,238円
日本債券インデックス・ファンドVA2<適格機関投資家限定>	22,188,335,427円
バランスファンドVA50B<適格機関投資家限定>	11,663,119,305円
世界分散ファンドVA25A<適格機関投資家限定>	8,521,805,393円
4資産バランス40VA<適格機関投資家限定>	6,276,812,696円
バランスファンドVA35A<適格機関投資家限定>	4,857,200,526円
バランスファンドVA25A<適格機関投資家限定>	4,116,296,185円
日本債券インデックス・ファンド(年金1)<適格機関投資家限定>	3,880,345,608円
グローバルバランス40VA2<適格機関投資家限定>	3,405,362,221円
バランスファンドVA25B<適格機関投資家限定>	3,288,423,635円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	3,220,013,036円
4資産インデックスバランスVA20<適格機関投資家限定>	2,359,389,357円
バランスファンドVA37.5A<適格機関投資家限定>	1,907,390,852円
4資産バランス30VA<適格機関投資家限定>	1,335,193,160円
AMC/ステート・ストリートリスクビェット型(フランス・オープン)	1,164,208,743円
4資産バランス20VA<適格機関投資家限定>	1,116,579,301円
債券マルチ・ファクター戦略ファンド(年金)<適格機関投資家限定>	1,100,556,491円
日本債券インデックス・ファンド<適格機関投資家限定>	714,554,940円
TaDRISKビェット型(分散型)戦略ファンド(ステップ)年金<適格機関投資家限定>	321,228,379円
日本債券インデックス・ファンドVA3<適格機関投資家限定>	257,555,600円
TaDRISKビェット型(分散型)戦略ファンド(ステップ)<適格機関投資家限定>	214,965,344円
バランスファンドVA30B<適格機関投資家限定>	159,443,590円
バランスファンドVA40C<適格機関投資家限定>	137,884,490円
日本債券インデックス・ファンドVA1<適格機関投資家限定>	80,731,518円
グローバルバランス40VA3<適格機関投資家限定>	76,990,756円
グローバル4資産30VA<適格機関投資家限定>	57,894,504円
4資産バランス30VA2<適格機関投資家限定>	46,287,223円
グローバル4資産45VA<適格機関投資家限定>	40,804,518円
グローバルバランス50VA<適格機関投資家限定>	31,175,178円
バランスファンドVA30A<適格機関投資家限定>	20,756,181円
世界バランス40VA<適格機関投資家限定>	19,787,946円
世界バランス60VA<適格機関投資家限定>	16,310,958円
バランスファンドVA50A<適格機関投資家限定>	16,049,773円
バランスファンドVA20A<適格機関投資家限定>	14,961,357円
4資産インデックスバランスVA50<適格機関投資家限定>	14,162,034円
バランスファンドVA75A<適格機関投資家限定>	12,917,978円
バランスファンドVA35B<適格機関投資家限定>	12,663,406円
バランスファンドVA40B<適格機関投資家限定>	10,060,868円
バランスファンドVA50C<適格機関投資家限定>	6,059,994円
グローバルバランス40VA<適格機関投資家限定>	1,392,721円
バランスファンドVA40A<適格機関投資家限定>	501,257円

◎損益の状況

当期(自'22年3月8日 至'23年3月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	1,316,489,685
受 取 利 息	1,317,115,269
支 払 利 息	△ 625,584
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 8,399,551,156
売 買 損 益	38,778,025
売 買 損 益	△ 8,438,329,181
(C) そ の 他 費 用	△ 13,758
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 7,083,075,229
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	39,336,626,051
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,045,746,790
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 3,619,807,123
(H) 計 算 (D+E+F+G)	31,679,490,489
次 期 繰 越 損 益 金(H)	31,679,490,489

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

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

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