

Smart-i 国内債券インデックス

運用報告書（全体版）

第5期（決算日 2022年6月27日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「Smart-i 国内債券インデックス」は、2022年6月27日に第5期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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	2017年8月29日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	RM国内債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	①株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。 株式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。 ②投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。

<照会先>

電話番号：0120-223351

（委託会社の営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ：<https://www.resona-am.co.jp/>

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債組入比率	純資産額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	(ベンチマーク)	期中騰落率		
(設定日) 2017年8月29日	円 10,000	円 —	% —			% —	百万円 0.1
1期(2018年6月25日)	10,033	0	0.3	382.659	0.6	99.0	1
2期(2019年6月25日)	10,281	0	2.5	392.920	2.7	99.7	237
3期(2020年6月25日)	10,113	0	△1.6	387.109	△1.5	99.2	793
4期(2021年6月25日)	10,098	0	△0.1	387.222	0.0	99.3	1,412
5期(2022年6月27日)	9,773	0	△3.2	375.225	△3.1	99.4	1,663

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額(元本=10,000円)です。

(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おります。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 「NOMURA-BPI総合」は、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入比率
	騰落率	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	
(期首) 2021年6月25日	円 10,098	% —		% —	% 99.3
6月末	10,088	△0.1	387.222	△0.1	98.0
7月末	10,137	0.4	386.903	0.4	98.8
8月末	10,128	0.3	388.809	0.3	98.6
9月末	10,092	△0.1	388.461	△0.0	98.5
10月末	10,080	△0.2	387.116	△0.1	99.1
11月末	10,102	0.0	386.721	0.1	99.1
12月末	10,102	△0.2	387.655	△0.1	99.1
2022年1月末	10,079	△0.2	386.841	△0.1	99.1
2月末	10,007	△0.9	386.841	△0.8	99.3
3月末	9,956	△1.4	384.056	△1.3	99.2
4月末	9,927	△1.7	382.128	△1.6	99.5
5月末	9,901	△2.0	381.037	△1.8	99.4
5月末	9,886	△2.1	380.119	△2.0	99.2
(期末) 2022年6月27日	9,773	△3.2	379.538	△3.1	99.4

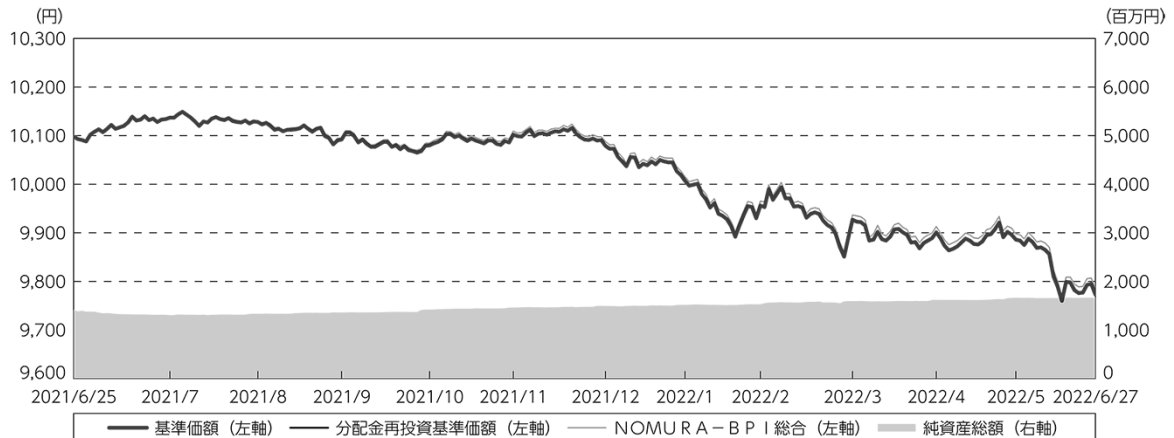
(注) 騰落率は期首比です。

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

○運用経過

(2021年6月26日～2022年6月27日)

期中の基準価額等の推移



期首：10,098円

期末：9,773円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：△ 3.2% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税引前)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 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およびNOMURA-BPI総合は、期首(2021年6月25日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) NOMURA-BPI総合は当ファンドのベンチマークです。
- (注) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は前期末10,098円から当期末9,773円となり、325円の値下がりとなりました。

国内債券の市況(NOMURA-BPI総合)の下落により基準価額は下落しました。

投資環境

国内債券市況

国内の長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。期前半は、度重なる緊急事態宣言の発令・延長による景気回復の後ずれ懸念の高まりから、国内の金利水準は低位での推移となりました。期後半は、海外金利上昇の影響を受け、長期金利は日銀の変動許容幅の上限である0.25%近辺まで上昇する場面がみられました。その後も、日銀は無制限指値オペの対象を拡大するなど現行金融政策の枠組みを維持する方針を改めて示し、長期金利は0.25%近辺での推移となりました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RM国内債券マザーファンド受益証券を高位に組み入れて運用を行いました。

RM国内債券マザーファンド

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は-3.2%となり、ベンチマークの-3.1%を0.1%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

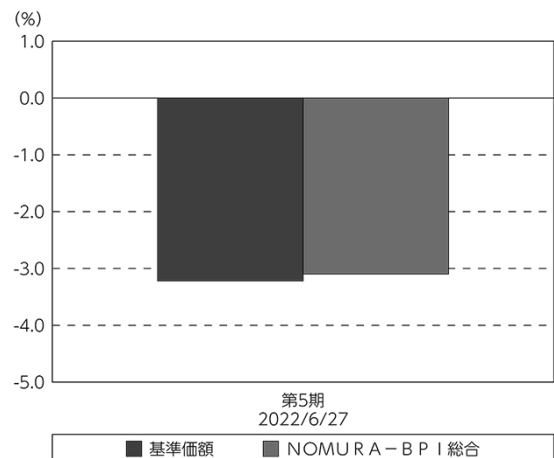
(マイナス要因)

- ・信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・コスト負担（取引費用などのコスト）が生じたこと

(その他の要因)

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本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5期
	2021年6月26日～ 2022年6月27日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	369

(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。

○今後の運用方針

当ファンド

引き続き、RM国内債券マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RM国内債券マザーファンド

引き続き、主としてNOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2021年6月26日～2022年6月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 13	% 0.133	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(6)	(0.055)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(6)	(0.055)	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 ）	(2)	(0.022)	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	0.009	(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)	(0.009)	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、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	14	0.142	
期中の平均基準価額は、10,031円です。			

(注) 期中の費用（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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

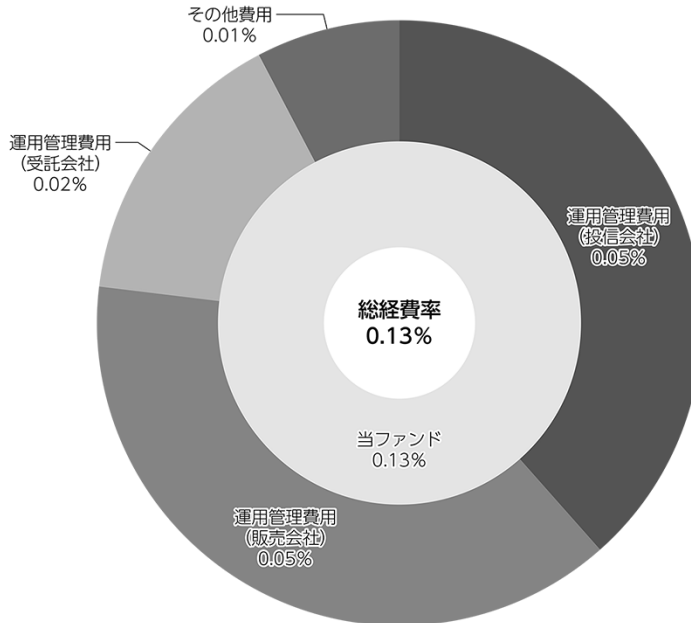
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(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0.13%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、売買委託手数料及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、マザーファンド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

(2021年6月26日～2022年6月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	設 定		解 約	
		口 数	金 額	口 数	金 額
		千口	千円	千口	千円
RM国内債券マザーファンド		541,813	565,410	253,786	266,030

○利害関係人との取引状況等

(2021年6月26日～2022年6月27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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年6月26日～2022年6月27日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年6月26日～2022年6月27日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年6月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
RM国内債券マザーファンド	1,341,184	1,629,211	1,661,307

○投資信託財産の構成

(2022年6月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RM国内債券マザーファンド	千円 1,661,307	% 99.7
コール・ローン等、その他	5,412	0.3
投資信託財産総額	1,666,719	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2021年6月26日～2022年6月27日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年6月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,666,719,184
コール・ローン等	5,262,140
RM国内債券マザーファンド(評価額)	1,661,307,044
未収入金	150,000
(B) 負債	2,922,864
未払解約金	1,818,254
未払信託報酬	1,037,262
未払利息	14
その他未払費用	67,334
(C) 純資産総額(A-B)	1,663,796,320
元本	1,702,526,059
次期繰越損益金	△ 38,729,739
(D) 受益権総口数	1,702,526,059口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,773円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,398,469,466円、期中追加設定元本額は838,186,138円、期中一部解約元本額は534,129,545円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は0.9773円です。

(注) 2022年6月27日現在、純資産総額は元本額を下回っており、その差額は38,729,739円です。

○損益の状況 (2021年6月26日～2022年6月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,867
支払利息	△ 3,867
(B) 有価証券売買損益	△46,375,667
売買益	3,010,050
売買損	△49,385,717
(C) 信託報酬等	△ 2,086,514
(D) 当期損益金(A+B+C)	△48,466,048
(E) 前期繰越損益金	△ 3,497,895
(F) 追加信託差損益金	13,234,204
(配当等相当額)	(47,915,255)
(売買損益相当額)	(△34,681,051)
(G) 計(D+E+F)	△38,729,739
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△38,729,739
追加信託差損益金	13,234,204
(配当等相当額)	(48,187,998)
(売買損益相当額)	(△34,953,794)
分配準備積立金	14,695,821
繰越損益金	△66,659,764

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,468,628円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(48,187,998円)および分配準備積立金(7,227,193円)より分配対象収益は62,883,819円(1万口当たり369円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

該当事項はございません。

RM国内債券マザーファンド

運用報告書

第6期（決算日 2022年1月25日）
（2021年1月26日～2022年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	①主として、NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。なお、NOMURA-BPI総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②債券の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・ NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券
主な投資制限	・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りま す。 ・ 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。

りそなアセットマネジメント 株式会社

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。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。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)			債組入比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
2期(2018年1月25日)	10,328	0.3	379.684	0.3	99.3	46,026	
3期(2019年1月25日)	10,483	1.5	385.440	1.5	99.7	64,555	
4期(2020年1月27日)	10,645	1.5	391.374	1.5	99.3	80,324	
5期(2021年1月25日)	10,506	△1.3	386.571	△1.2	99.3	82,199	
6期(2022年1月25日)	10,475	△0.3	385.520	△0.3	99.3	123,850	

(注) 「NOMURA-BPI総合」は、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)			債組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2021年1月25日	10,506	—	386.571	—	99.3	
1月末	10,497	△0.1	386.252	△0.1	99.2	
2月末	10,410	△0.9	383.056	△0.9	99.2	
3月末	10,482	△0.2	385.724	△0.2	99.3	
4月末	10,502	△0.0	386.440	△0.0	99.1	
5月末	10,506	0.0	386.621	0.0	99.0	
6月末	10,512	0.1	386.903	0.1	98.1	
7月末	10,564	0.6	388.809	0.6	98.9	
8月末	10,556	0.5	388.461	0.5	98.6	
9月末	10,520	0.1	387.116	0.1	98.6	
10月末	10,508	0.0	386.721	0.0	99.2	
11月末	10,533	0.3	387.655	0.3	99.1	
12月末	10,510	0.0	386.841	0.1	99.2	
(期末) 2022年1月25日	10,475	△0.3	385.520	△0.3	99.3	

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2021年1月26日～2022年1月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,506円から当期末10,475円となり、31円の値下がりとなりました。

国内債券の市況（NOMURA-BPI総合）の下落により、基準価額は下落しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内債券市況

国内の長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。期初は、主要海外金利の上昇や、日銀の長期金利変動許容幅の拡大観測の強まりを背景に、長期金利は一時0.1%台後半まで上昇しました。期央には、度重なる緊急事態宣言の発令・延長による景気回復の後ずれ懸念の高まりから、国内の金利水準は低下しました。期末にかけて、主要国中央銀行の金融政策正常化の前倒し観測の影響を受けて、国内の長期金利は水準を切り上げました。

当ファンドのポートフォリオ

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は-0.3%となり、ベンチマークの-0.3%とほぼ同水準となりました。

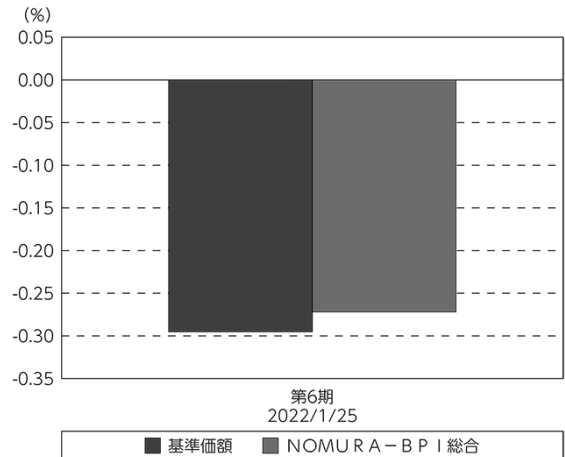
(マイナス要因)

- ・コスト負担(債券等に係る取引費用)が生じたこと

(その他の要因)

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



○今後の運用方針

引き続き、主としてNOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (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、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,508円です。			

(注) 期中の費用（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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2021年1月26日～2022年1月25日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	58,763,196	23,001,692
	地方債証券	3,085,191	602,947
	特殊債券	2,532,987	303,645
	社債券（投資法人債券を含む）	2,820,410	(126,087)
			602,221

(注) 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(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）は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2021年1月26日～2022年1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。

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2021年1月26日～2022年1月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2022年1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			
	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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	97,414,000 (900,000)	102,703,182 (873,804)	82.9 (0.7)	— (—)	53.7 (0.7)	19.3 (—)	9.9 (—)
地方債証券	6,684,500 (6,684,500)	6,899,600 (6,899,600)	5.6 (5.6)	— (—)	3.8 (3.8)	1.4 (1.4)	0.3 (0.3)
特殊債券 (除く金融債)	7,064,579 (7,064,579)	7,278,388 (7,278,388)	5.9 (5.9)	— (—)	3.8 (3.8)	1.7 (1.7)	0.3 (0.3)
金融債券	400,000 (400,000)	399,999 (399,999)	0.3 (0.3)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	0.1 (0.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	5,700,000 (5,700,000)	5,724,692 (5,724,692)	4.6 (4.6)	— (—)	2.4 (2.4)	1.8 (1.8)	0.4 (0.4)
合 計	117,263,079 (20,749,079)	123,005,862 (21,176,483)	99.3 (17.1)	— (—)	63.8 (10.8)	24.4 (5.1)	11.1 (1.2)

(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。

(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。

(注) 格付のない債券については、BB格以下組入比率に含まれておりません。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第421回利付国債 (2年)	0.1	400,000	400,772	2023/2/1
第423回利付国債 (2年)	0.005	860,000	860,911	2023/4/1
第424回利付国債 (2年)	0.005	600,000	600,678	2023/5/1
第425回利付国債 (2年)	0.005	350,000	350,423	2023/6/1
第426回利付国債 (2年)	0.005	650,000	650,786	2023/7/1
第427回利付国債 (2年)	0.005	840,000	841,075	2023/8/1
第428回利付国債 (2年)	0.005	420,000	420,567	2023/9/1
第429回利付国債 (2年)	0.005	350,000	350,497	2023/10/1
第430回利付国債 (2年)	0.005	630,000	630,888	2023/11/1
第136回利付国債 (5年)	0.1	1,180,000	1,182,961	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	1,070,000	1,073,177	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	1,490,000	1,494,946	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	1,980,000	1,987,444	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	1,710,000	1,716,976	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	1,250,000	1,255,637	2024/9/20
第142回利付国債 (5年)	0.1	1,220,000	1,226,014	2024/12/20
第143回利付国債 (5年)	0.1	1,070,000	1,075,724	2025/3/20
第144回利付国債 (5年)	0.1	1,360,000	1,367,860	2025/6/20
第145回利付国債 (5年)	0.1	1,220,000	1,227,356	2025/9/20
第146回利付国債 (5年)	0.1	1,460,000	1,469,125	2025/12/20
第147回利付国債 (5年)	0.005	980,000	982,440	2026/3/20
第148回利付国債 (5年)	0.005	1,280,000	1,283,097	2026/6/20
第149回利付国債 (5年)	0.005	560,000	561,170	2026/9/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	1,000,000	1,002,120	2023/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	100,000	141,963	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	180,000	247,516	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	110,000	152,194	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	170,000	236,301	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	240,000	322,888	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	240,000	318,528	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	220,000	281,047	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	290,000	346,944	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	480,000	431,980	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	420,000	441,823	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	340,000	346,803	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	360,000	332,402	2059/3/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	430,000	395,767	2060/3/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	330,000	323,535	2061/3/20
第328回利付国債 (10年)	0.6	411,000	414,226	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)	0.8	297,000	300,632	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)	0.8	257,000	260,711	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)	0.6	90,000	91,002	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)	0.6	652,000	660,299	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	225,000	228,237	2024/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第334回利付国債 (10年)		0.6	261,000	265,196	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)		0.5	345,000	350,216	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)		0.5	210,000	213,475	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	170,000	171,825	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	631,000	640,345	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)		0.4	385,000	391,160	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)		0.4	934,000	949,878	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)		0.3	440,000	446,274	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	380,000	382,443	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)		0.1	780,000	785,155	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)		0.1	960,000	966,259	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)		0.1	1,070,000	1,077,083	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	1,310,000	1,319,104	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	680,000	684,773	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	980,000	987,203	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	890,000	896,568	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	980,000	987,232	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)		0.1	710,000	715,225	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)		0.1	800,000	805,848	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)		0.1	940,000	946,805	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)		0.1	720,000	725,140	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)		0.1	800,000	805,320	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)		0.1	1,250,000	1,257,637	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)		0.1	1,010,000	1,015,565	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	820,000	823,993	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	840,000	843,158	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)		0.1	660,000	661,986	2030/9/20
第361回利付国債 (10年)		0.1	980,000	982,156	2030/12/20
第362回利付国債 (10年)		0.1	1,050,000	1,050,945	2031/3/20
第363回利付国債 (10年)		0.1	1,180,000	1,179,445	2031/6/20
第364回利付国債 (10年)		0.1	950,000	948,185	2031/9/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	60,000	72,711	2029/9/20
第7回利付国債 (30年)		2.3	40,000	48,782	2032/5/20
第10回利付国債 (30年)		1.1	30,000	32,997	2033/3/20
第11回利付国債 (30年)		1.7	80,000	93,528	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	80,000	97,414	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	200,000	241,838	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	60,000	75,606	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	200,000	255,184	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	140,000	179,172	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	160,000	203,492	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	60,000	75,750	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	100,000	126,574	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	100,000	129,612	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	180,000	229,100	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	50,000	65,191	2036/3/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第23回利付国債 (30年)		2.5	220,000	287,590	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	170,000	222,793	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	200,000	257,044	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	205,000	266,977	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	295,000	390,547	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	290,000	385,868	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	150,000	198,064	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	190,000	248,719	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	170,000	220,444	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	335,000	441,556	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	290,000	368,288	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	335,000	438,719	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	406,000	518,202	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	375,000	480,142	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	450,000	569,511	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	290,000	362,094	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	300,000	381,183	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	215,000	269,334	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	255,000	314,774	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	190,000	234,754	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	180,000	222,607	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	260,000	321,838	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	290,000	347,086	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	350,000	419,125	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	320,000	390,460	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	353,000	415,357	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	330,000	388,426	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	350,000	365,144	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	350,000	325,230	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	310,000	301,723	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	310,000	308,329	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	360,000	374,500	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	100,000	103,949	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)		0.8	300,000	311,604	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)		0.8	330,000	342,490	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	490,000	507,556	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)		0.7	280,000	282,833	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)		0.9	280,000	295,562	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)		0.7	260,000	261,479	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)		0.5	230,000	219,505	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)		0.4	300,000	278,349	2049/6/20
第64回利付国債 (30年)		0.4	260,000	240,814	2049/9/20
第65回利付国債 (30年)		0.4	300,000	277,374	2049/12/20
第66回利付国債 (30年)		0.4	340,000	314,537	2050/3/20
第67回利付国債 (30年)		0.6	250,000	243,212	2050/6/20
第68回利付国債 (30年)		0.6	360,000	350,571	2050/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第69回利付国債 (30年)	0.7	340,000	339,588	2050/12/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	390,000	388,588	2051/3/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	360,000	358,686	2051/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	180,000	179,119	2051/9/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	50,000	50,621	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	80,000	80,978	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	60,000	61,573	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	120,000	123,913	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	380,000	394,231	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	20,000	20,844	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	90,000	94,378	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	60,000	62,790	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	110,000	116,509	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	100,000	105,438	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	210,000	222,064	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	180,000	190,792	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	100,000	106,823	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	100,000	106,192	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	20,000	21,301	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	50,000	53,345	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	20,000	21,406	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	90,000	96,633	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	30,000	32,260	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	170,000	183,428	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	10,000	10,841	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	120,000	129,633	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	150,000	163,395	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	100,000	109,761	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	90,000	98,411	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	185,000	204,114	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	120,000	131,869	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	170,000	187,736	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	80,000	88,719	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	255,000	281,713	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	80,000	88,391	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	140,000	155,405	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	185,000	208,302	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	70,000	78,059	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	130,000	146,404	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	70,000	78,437	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	85,000	95,670	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	151,000	171,625	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	20,000	22,977	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	145,000	167,422	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	100,000	114,823	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	10,000	11,354	2028/6/20

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
国債証券		%	千円	千円
第105回利付国債 (20年)		2.1	12,000	13,684
第106回利付国債 (20年)		2.2	40,000	45,881
第107回利付国債 (20年)		2.1	80,000	91,620
第108回利付国債 (20年)		1.9	220,000	248,921
第109回利付国債 (20年)		1.9	80,000	90,860
第110回利付国債 (20年)		2.1	195,000	224,257
第111回利付国債 (20年)		2.2	50,000	58,094
第112回利付国債 (20年)		2.1	205,000	236,668
第113回利付国債 (20年)		2.1	85,000	98,540
第114回利付国債 (20年)		2.1	160,000	186,097
第115回利付国債 (20年)		2.2	100,000	117,099
第116回利付国債 (20年)		2.2	140,000	164,617
第117回利付国債 (20年)		2.1	225,000	262,737
第118回利付国債 (20年)		2.0	131,000	152,360
第119回利付国債 (20年)		1.8	150,000	171,949
第120回利付国債 (20年)		1.6	240,000	271,106
第121回利付国債 (20年)		1.9	205,000	237,455
第122回利付国債 (20年)		1.8	190,000	218,446
第123回利付国債 (20年)		2.1	265,000	312,572
第124回利付国債 (20年)		2.0	200,000	234,136
第125回利付国債 (20年)		2.2	120,000	143,030
第126回利付国債 (20年)		2.0	100,000	117,377
第127回利付国債 (20年)		1.9	130,000	151,411
第128回利付国債 (20年)		1.9	225,000	262,824
第129回利付国債 (20年)		1.8	240,000	278,112
第130回利付国債 (20年)		1.8	220,000	255,499
第131回利付国債 (20年)		1.7	30,000	34,554
第132回利付国債 (20年)		1.7	80,000	92,319
第133回利付国債 (20年)		1.8	355,000	413,138
第134回利付国債 (20年)		1.8	45,000	52,472
第135回利付国債 (20年)		1.7	40,000	46,241
第136回利付国債 (20年)		1.6	50,000	57,302
第137回利付国債 (20年)		1.7	170,000	196,975
第138回利付国債 (20年)		1.5	90,000	102,438
第139回利付国債 (20年)		1.6	370,000	424,922
第140回利付国債 (20年)		1.7	420,000	487,725
第141回利付国債 (20年)		1.7	185,000	215,286
第142回利付国債 (20年)		1.8	390,000	458,019
第143回利付国債 (20年)		1.6	335,000	386,971
第144回利付国債 (20年)		1.5	270,000	308,939
第145回利付国債 (20年)		1.7	545,000	637,159
第146回利付国債 (20年)		1.7	560,000	655,995
第147回利付国債 (20年)		1.6	385,000	447,381
第148回利付国債 (20年)		1.5	545,000	627,889
第149回利付国債 (20年)		1.5	540,000	623,035
第150回利付国債 (20年)		1.4	590,000	674,434

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
第151回利付国債 (20年)		1.2	515,000	576,491	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	660,000	739,325	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	440,000	498,916	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	408,000	457,645	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	490,000	536,834	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	630,000	638,114	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	480,000	472,070	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	300,000	307,341	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	370,000	384,185	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	510,000	536,443	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	480,000	497,164	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	290,000	300,086	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	420,000	434,175	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	530,000	539,264	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	430,000	436,948	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	610,000	638,560	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	440,000	445,904	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	530,000	527,456	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	410,000	400,397	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	540,000	526,321	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)		0.3	400,000	389,092	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)		0.4	360,000	355,784	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)		0.4	510,000	503,099	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)		0.4	570,000	561,233	2040/9/20
第175回利付国債 (20年)		0.5	490,000	490,421	2040/12/20
第176回利付国債 (20年)		0.5	530,000	529,533	2041/3/20
第177回利付国債 (20年)		0.4	490,000	479,636	2041/6/20
第178回利付国債 (20年)		0.5	200,000	199,286	2041/9/20
小	計		97,414,000	102,703,182	
地方債証券					
第14回東京都公募公債		2.31	100,000	113,631	2028/3/17
第723回東京都公募公債		0.76	100,000	101,247	2023/9/20
第746回東京都公募公債		0.499	100,000	101,679	2025/6/20
第761回東京都公募公債		0.075	100,000	100,260	2026/9/18
第789回東京都公募公債		0.085	100,000	99,924	2028/12/20
第808回東京都公募公債		0.11	100,000	99,573	2030/9/20
平成28年度第8回北海道公募公債		0.06	100,000	100,180	2026/10/28
第15回神奈川県公募公債 (20年)		1.94	100,000	115,391	2030/11/12
第211回神奈川県公募公債		0.438	100,000	101,256	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債		0.08	100,000	100,285	2026/3/19
第164回大阪府公募公債		0.001	100,000	99,977	2024/7/30
第170回大阪府公募公債		0.001	100,000	99,970	2025/4/28
第376回大阪府公募公債		0.82	110,000	111,488	2023/9/27
第444回大阪府公募公債		0.097	100,000	99,796	2029/5/30
第451回大阪府公募公債		0.063	100,000	99,280	2029/12/26
第471回大阪府公募公債		0.083	140,000	138,458	2031/8/29

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券		%	千円	千円	
平成27年度第13回京都市公募公債		0.11	100,000	100,409	2026/3/17
平成29年度第4回京都市公募公債		0.19	100,000	100,721	2027/6/21
平成29年度第1回兵庫県公募公債		0.187	100,000	100,694	2027/5/21
令和元年度第2回兵庫県公募公債		0.105	100,000	99,927	2029/5/25
平成25年度第5回静岡県公募公債		0.926	100,000	101,377	2023/7/25
平成26年度第6回静岡県公募公債		0.566	100,000	101,449	2024/8/26
平成30年度第14回静岡県公募公債		0.15	100,000	100,370	2028/12/20
平成22年度第8回愛知県公募公債		1.891	100,000	114,788	2030/9/13
平成28年度第8回愛知県公募公債		0.065	100,000	100,215	2026/8/26
平成29年度第11回愛知県公募公債		0.225	100,000	100,829	2027/10/27
令和3年度第12回愛知県公募公債		0.481	100,000	98,854	2041/11/22
平成29年度第3回広島県公募公債		0.15	100,000	100,390	2027/9/27
平成30年度第1回広島県公募公債		0.2	100,000	100,725	2028/5/25
第8回埼玉県公募公債		2.19	100,000	115,605	2029/9/20
第16回埼玉県公募公債		1.216	100,000	111,419	2035/8/14
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	100,000	101,465	2024/9/26
令和3年度第9回埼玉県公募公債		0.344	100,000	99,150	2036/10/31
平成24年度第2回福岡県公募公債		1.635	100,000	114,479	2032/8/16
平成27年度第1回福岡県公募公債		0.578	100,000	101,957	2025/6/26
第11回千葉県公募公債		1.87	100,000	116,239	2031/12/12
第19回千葉県公募公債		1.166	100,000	110,755	2035/10/15
平成29年度第6回千葉県公募公債		0.245	100,000	100,991	2028/1/25
第15回千葉県公募公債		0.235	100,000	99,395	2041/10/15
第123回共同発行市場公募地方債		0.87	100,000	101,216	2023/6/23
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	100,000	101,536	2024/4/25
第156回共同発行市場公募地方債		0.1	100,000	100,370	2026/3/25
第169回共同発行市場公募地方債		0.205	100,000	100,778	2027/4/23
第174回共同発行市場公募地方債		0.145	100,000	100,361	2027/9/24
第181回共同発行市場公募地方債		0.18	100,000	100,594	2028/4/25
第185回共同発行市場公募地方債		0.245	100,000	101,009	2028/8/25
第187回共同発行市場公募地方債		0.269	100,000	101,172	2028/10/25
第191回共同発行市場公募地方債		0.14	100,000	100,243	2029/2/22
第207回共同発行市場公募地方債		0.15	100,000	100,000	2030/6/25
第209回共同発行市場公募地方債		0.125	100,000	99,746	2030/8/23
第216回共同発行市場公募地方債		0.204	100,000	100,263	2031/3/25
第217回共同発行市場公募地方債		0.199	100,000	100,190	2031/4/25
令和3年度第2回堺市公募公債		0.241	100,000	99,359	2041/11/22
平成27年度第1回静岡市公募公債		0.476	100,000	101,804	2025/11/25
第11回大阪市公募公債		2.25	100,000	116,985	2030/3/26
第17回名古屋市公募公債		1.203	100,000	111,152	2035/5/28
令和元年度第4回京都市公募公債		0.141	114,500	114,508	2030/1/28
平成22年度第9回神戸市公募公債		2.09	100,000	117,118	2031/1/24
第26回横浜市公募公債		1.776	100,000	116,411	2033/1/28
第21回横浜市公募公債		1.969	100,000	115,230	2030/7/19
第37回川崎市公募公債		0.224	100,000	99,138	2041/12/20
平成26年度第5回福岡市公募公債		0.539	100,000	101,471	2024/10/28

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
平成27年度第2回広島市公募公債		0.464	100,000	101,796	2025/12/25
平成29年度第3回千葉市公募公債		0.215	120,000	120,961	2027/12/28
平成29年度第5回福井県公募公債		0.19	100,000	100,656	2028/4/27
平成29年度第2回岡山県公募公債		0.235	100,000	100,934	2028/1/31
小	計		6,684,500	6,899,600	
特殊債券(除く金融債)					
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.699	127,000	128,564	2023/10/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.381	100,000	101,453	2025/11/18
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.13	145,000	145,693	2027/6/14
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.209	213,000	215,061	2028/8/15
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	100,783	2023/3/17
第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.644	114,000	115,804	2024/6/28
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.544	127,000	128,884	2024/9/30
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.466	100,000	101,390	2024/12/27
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.484	100,000	101,675	2025/6/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.557	103,000	105,014	2025/7/31
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	133,000	134,678	2026/1/30
第300回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.115	100,000	100,400	2027/1/29
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.16	100,000	100,673	2027/11/30
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.195	100,000	100,886	2028/2/29
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.12	100,000	100,408	2028/4/28
第375回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.085	100,000	100,104	2029/2/28
第387回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.001	100,000	99,373	2029/7/31
第19回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.668	100,000	100,779	2023/3/15
第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.45	100,000	101,423	2025/3/13
第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.209	100,000	100,980	2028/9/19
第31回国際協力機構債券		0.53	100,000	101,859	2025/9/19
第89回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.26	100,000	100,927	2028/1/18
第131回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.7	100,000	97,360	2050/6/20
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.45	100,000	110,060	2026/3/19
第16回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.7	100,000	132,102	2036/9/19
第27回道路債券		2.42	100,000	105,153	2024/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.42	150,000	172,020	2028/6/20
第1回地方公共団体金融機構債券		1.864	100,000	124,247	2044/6/28
第13回公営企業債券		2.16	100,000	107,308	2025/6/20
F 82回地方公共団体金融機構債券		1.381	100,000	103,864	2024/11/20
第97回地方公共団体金融機構債券		0.205	200,000	201,446	2027/6/28
F 132回地方公共団体金融機構債券		1.09	100,000	103,789	2025/7/30
F 228回地方公共団体金融機構債券		1.269	100,000	109,751	2031/3/20
F 305回地方公共団体金融機構債券		1.33	100,000	113,258	2040/10/26
F 14回地方公共団体金融機構債券		0.736	100,000	99,022	2051/11/28
F 151回地方公共団体金融機構債券		0.13	100,000	99,126	2031/12/26
第10回株式会社日本政策金融公庫社債(一般担保付)		2.167	100,000	116,090	2030/3/19
第97回都市再生債券		1.017	100,000	106,558	2029/9/20
第2回一般担保住宅金融公庫債券		2.54	100,000	111,071	2026/6/19
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.06	69,165	68,810	2034/2/10

銘	柄	当期			償還年月日
		利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.14	74,119	73,938	2034/2/10
第97回一般担保住宅金融支援機構債券		1.903	100,000	116,325	2032/3/12
第117回一般担保住宅金融支援機構債券		1.438	100,000	107,563	2027/9/17
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	80,034	80,758	2052/8/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	80,117	80,623	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	81,750	82,132	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	80,708	81,205	2053/1/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	84,094	84,449	2053/8/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	85,302	86,120	2053/10/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	90,701	89,887	2054/11/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.3	92,424	92,210	2055/3/10
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	95,307	95,446	2055/10/10
第168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	97,243	97,723	2056/5/10
第170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	98,250	98,393	2056/7/10
第171回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	98,640	98,353	2056/8/10
第172回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.31	98,821	98,523	2056/9/10
第173回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	99,077	98,920	2056/10/10
第174回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.38	99,414	99,698	2056/11/10
第175回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	99,861	99,964	2056/12/10
第223回一般担保住宅金融支援機構債券		0.403	100,000	101,131	2032/11/19
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	47,225	47,080	2032/5/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.18	48,421	48,303	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	51,906	51,822	2033/1/10
第334回一般担保住宅金融支援機構債券		0.481	100,000	98,678	2041/11/20
第79回東日本高速道路株式会社債		0.05	100,000	100,043	2026/6/19
第87回中日本高速道路株式会社債		0.06	100,000	100,078	2026/3/18
第88回中日本高速道路株式会社債		0.05	100,000	100,040	2026/5/8
第29回西日本高速道路株式会社債		0.31	100,000	101,089	2026/2/12
第52回西日本高速道路株式会社債		0.03	100,000	99,985	2024/12/20
第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.04	100,000	100,048	2023/9/20
小計			7,064,579	7,278,388	
金融債券					
第340回信金中金債		0.11	100,000	100,086	2023/3/27
第358回信金中金債(5年)		0.01	100,000	99,919	2024/9/27
第372回信金中金債		0.06	100,000	100,019	2025/11/27
第376回信金中金債		0.05	100,000	99,975	2026/3/27
小計			400,000	399,999	
普通社債券(含む投資法人債券)					
第543回中部電力株式会社社債		0.12	100,000	99,860	2025/7/25
第536回関西電力株式会社社債		0.44	100,000	100,257	2030/12/20
第541回関西電力株式会社社債		0.37	100,000	99,768	2031/9/19
第413回中国電力株式会社社債		0.4	100,000	100,586	2029/2/22
第338回北陸電力株式会社社債		0.3	100,000	99,418	2030/8/23
第343回北陸電力株式会社社債		0.29	100,000	99,310	2031/5/23
第531回東北電力株式会社社債		0.31	100,000	99,446	2031/5/23
第540回東北電力株式会社社債		0.19	100,000	100,050	2027/1/25

銘柄	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289回四国電力株式会社社債		0.26	100,000	100,213	2026/11/25
第462回九州電力株式会社社債		0.42	100,000	100,590	2028/5/25
第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債		0.2	100,000	99,125	2029/7/13
第1回ココ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債		0.1	100,000	99,882	2024/9/19
第27回味の素株式会社無担保社債		0.13	100,000	99,439	2028/10/20
第12回日本たばこ産業株式会社社債		0.11	100,000	99,958	2023/9/8
第18回旭化成株式会社無担保社債		0.24	100,000	99,192	2031/12/9
第54回三井化学株式会社無担保社債		0.28	100,000	99,384	2031/12/3
第3回株式会社電通無担保社債		0.424	100,000	100,587	2028/10/25
第20回株式会社オリエントランド無担保社債		0.09	100,000	99,656	2026/9/2
第12回Zホールディングス株式会社無担保社債		0.37	100,000	99,733	2026/7/31
第10回株式会社資生堂無担保社債		0.08	100,000	99,662	2025/2/26
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債		0.375	100,000	100,531	2029/4/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債		0.31	100,000	100,310	2027/5/28
第12回株式会社小松製作所無担保社債		0.11	100,000	99,788	2024/6/6
第18回株式会社日立製作所無担保社債		0.06	100,000	99,926	2023/3/10
第17回J A三井リース株式会社無担保社債		0.19	100,000	99,928	2025/9/4
第5回大日本印刷株式会社無担保社債		0.27	100,000	99,408	2030/3/8
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債		0.535	100,000	100,277	2028/5/31
第19回三井住友信託銀行株式会社無担保社債		0.14	100,000	99,999	2026/4/28
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債		0.15	100,000	99,999	2026/11/6
第14回N T Tファイナンス株式会社無担保社債		0.001	100,000	99,918	2023/6/20
第18回N T Tファイナンス株式会社無担保社債		0.38	100,000	100,760	2030/9/20
第21回N T Tファイナンス株式会社無担保社債		0.1	100,000	99,906	2026/9/18
第71回株式会社ホンダファイナンス無担保社債		0.09	100,000	99,630	2026/9/18
第73回株式会社ホンダファイナンス無担保社債		0.1	100,000	99,635	2026/12/18
第96回トヨタファイナンス株式会社無担保社債		0.06	100,000	99,828	2026/4/15
第81アコム株式会社無担保社債		0.17	100,000	99,521	2026/9/3
第205回オリックス株式会社無担保社債		0.21	100,000	99,405	2028/6/14
第16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	100,000	100,302	2024/9/13
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債		0.22	100,000	100,224	2025/1/23
第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債		0.33	100,000	100,000	2029/1/24
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債		0.19	100,000	99,999	2026/11/13
第120回三菱地所株式会社無担保社債		0.24	100,000	100,159	2027/6/18
第134回三菱地所株式会社無担保社債		0.16	100,000	99,558	2028/6/21
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.757	100,000	101,309	2024/1/30
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.41	100,000	101,054	2026/1/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		1.133	100,000	107,274	2047/7/26
第3回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.264	100,000	99,990	2032/1/21
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債		2.262	100,000	116,024	2030/3/12
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債		0.616	100,000	98,799	2041/12/9
第22回K D D I株式会社無担保社債		0.31	100,000	100,381	2028/7/12
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.43	100,000	100,380	2023/7/24
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債		1.01	100,000	103,442	2029/7/10
第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.68	100,000	100,048	2031/8/29
第70回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.09	100,000	99,685	2026/7/13

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7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債		0.405	100,000	101,002	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債		0.384	100,000	100,102	2024/10/11
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債		0.32	100,000	100,075	2023/7/6
小	計		5,700,000	5,724,692	
合	計		117,263,079	123,005,862	

○投資信託財産の構成

(2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 123,005,862	% 97.2
コール・ローン等、その他	3,553,591	2.8
投資信託財産総額	126,559,453	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2021年1月26日～2022年1月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年1月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	126,559,453,870
コール・ローン等	787,812,261
公社債(評価額)	123,005,862,198
未収入金	2,574,734,900
未収利息	181,925,487
前払費用	9,119,024
(B) 負債	2,709,290,134
未払解約金	2,709,288,000
未払利息	2,134
(C) 純資産総額(A-B)	123,850,163,736
元本	118,230,260,033
次期繰越損益金	5,619,903,703
(D) 受益権総口数	118,230,260,033口
1万円当たり基準価額(C/D)	10,475円

(注) 当ファンドの期首元本額は78,237,839円、期中追加設定元本額は59,135,281,431円、期中一部解約元本額は19,142,299,237円です。

(注) 2022年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな国内債券インデックスファンド	71,437,954,163円
・りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	8,749,263,845円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	7,499,799,918円
・つみたてバランスファンド	3,810,731,129円
・りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	3,804,685,425円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	3,602,656,234円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	3,204,394,830円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,562,608,214円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	1,950,707,494円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	1,590,501,113円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,570,801,401円
・Smart-i 国内債券インデックス	1,432,758,696円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	1,080,095,683円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	945,152,331円
・りそなDAAマルチアセットファンド(適格機関投資家専用)	889,528,096円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	805,438,240円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	805,079,980円
・DCりそな グローバルバランス	618,510,848円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	332,474,172円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	311,267,841円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	275,372,083円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	248,943,469円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	244,955,926円
・FWりそな円建債券アクティブファンド	228,241,199円
・リスクコントロール・オープン	94,120,016円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	80,087,353円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	17,357,885円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	15,403,444円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	14,606,006円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定成長型)(適格機関投資家専用)	3,937,824円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(安定型)(適格機関投資家専用)	2,593,927円
・りそなVIグローバル・バランスファンド(成長型)(適格機関投資家専用)	231,248円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0475円です。

○損益の状況 (2021年1月26日～2022年1月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	704,185,019
受取利息	705,287,074
支払利息	△ 1,102,055
(B) 有価証券売買損益	△1,144,386,790
売買益	14,178,093
売買損	△1,158,564,883
(C) 保管費用等	△ 5,781
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 440,207,552
(E) 前期繰越損益金	3,962,342,549
(F) 追加信託差損益金	3,042,796,869
(G) 解約差損益金	△ 945,028,163
(H) 計(D+E+F+G)	5,619,903,703
次期繰越損益金(H)	5,619,903,703

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

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

○お知らせ

- ・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)