

STATE STREET GLOBAL ADVISORS.

○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。	

ステート・ストリート 日本債券インデックス・オープン

第2期運用報告書(全体版) (決算日2018年3月5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、2018年3月5日に第2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>

営業本部

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

◎設定以来の運用実績

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			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
'16年 5月 9日	10,000	-	-	10,000	-	-	-	9
1期('17年 3月 6日)	9,724	0	△ 2.8	9,759	△ 2.4	99.3	-	1,127
2期('18年 3月 5日)	9,789	0	0.7	9,840	0.8	99.0	-	1,392

(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、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、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	%		%	%	%
'17年 3月 6日	9,724	-	9,759	-	99.3	-
3月末	9,719	△ 0.1	9,756	△ 0.0	99.7	-
4月末	9,765	0.4	9,804	0.5	99.6	-
5月末	9,745	0.2	9,784	0.2	99.5	-
6月末	9,716	△ 0.1	9,758	△ 0.0	99.7	-
7月末	9,716	△ 0.1	9,758	△ 0.0	99.6	-
8月末	9,767	0.4	9,810	0.5	99.4	-
9月末	9,731	0.1	9,776	0.2	99.7	-
10月末	9,731	0.1	9,776	0.2	99.8	-
11月末	9,755	0.3	9,802	0.4	99.5	-
12月末	9,759	0.4	9,808	0.5	99.5	-
'18年 1月末	9,742	0.2	9,791	0.3	99.2	-
2月末	9,779	0.6	9,829	0.7	99.5	-
(期末)						
'18年 3月 5日	9,789	0.7	9,840	0.8	99.0	-

(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。

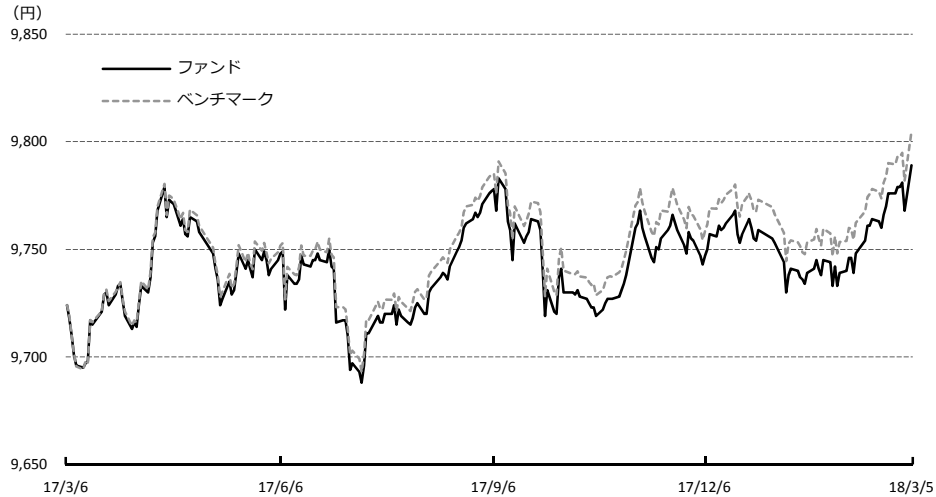
(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

(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

(2017年3月7日から2018年3月5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2期	9,724円	9,789円	0円	+0.7%	+0.8%

当期末の基準価額は9,789円となり、前期末の9,724円に比べて65円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 朝鮮半島の軍事的な緊張を巡る地政学的リスクの高まりを受けて、日本国債が選好されたことが基準価額にプラスに寄与しました。
- 日銀が指し値オペを実施することで債券利回りの上昇を抑制する姿勢を示したことが債券の買い材料となり基準価額にプラスに寄与しました。

【マイナスの要因】

- 期後半、GDP成長率や全国消費者物価指数の上昇など堅調な経済指標や、日銀の金融政策の出口戦略が市場で意識されたことが債券の売り材料となり基準価額にマイナスに寄与しました。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+0.7%となり、ベンチマークの騰落率(+0.8%)を0.2%下回りました。主な要因は以下の通りです。

【マイナスの要因】

- 信託報酬等の費用控除がマイナスに寄与しました。

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。

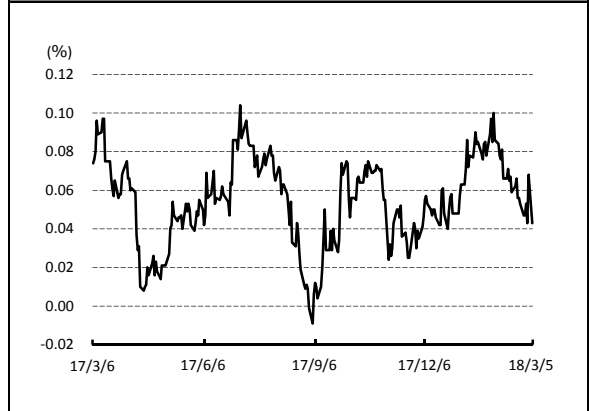
投資環境

(2017年3月7日から2018年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期を通じて日本10年国債利回りが概ね0.00%から0.10%の範囲で推移するレンジ相場となりました。期前半、朝鮮半島の軍事的な緊張を巡る地政学的リスクの高まりが債券の買い材料となりました。4月に日本10年国債利回りが0.00%近辺まで低下した後は、欧米の長期金利の上昇が影響し、債券が軟調となりました。7月に入ると、日銀が指し値オペによって利回りの上昇抑制姿勢を示したことから債券が買い戻されました。8月は朝鮮半島を巡る地政学的リスクの高まりに加え、海外投資家からの需要や日銀の国債買い入れオペによる需給のタイト化が見られたことを背景に債券が買われました。期後半はGDP成長率の継続的な上昇や全国消費者物価指数の上昇など堅調な経済指標が債券の売り材料となりました。2018年に入ると、日銀が国債買い入れオペで超長期国債の買い入れ額を減らしたことを受けて、市場で金融政策の出口戦略が意識されたことが債券の売り材料となりました。しかし、2月には債券利回り上昇時に日銀が指し値オペを実施したことに加え、黒田日銀総裁の続投や金融緩和積極派の副総裁への起用など日銀人事に関する報道が金融緩和継続観測につながり債券が買われました。日本10年国債利回りは前期末から0.03%低下の0.04%となりました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2017年3月7日から2018年3月5日まで)

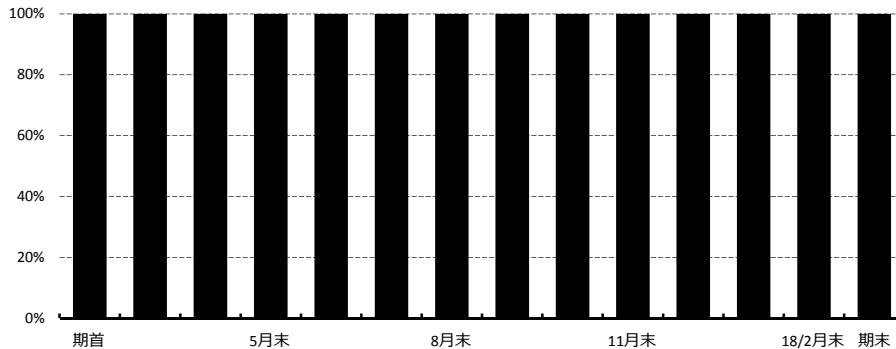
当ファンドは「日本債券インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ちます。

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 (2017年3月7日~2018年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	9,743円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	14円	0.140%	(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)	(0.097)	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)	(0.032)	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)	(0.010)	・ 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	0.151%	

(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。

◎売買および取引の状況('17年3月7日から'18年3月5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	717,406	905,207	516,208	649,128

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('17年3月7日から'18年3月5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 131 回 利付国債(5 年)	2,526,812	第 298 回 利付国債(10 年)	1,624,592
第 133 回 利付国債(5 年)	2,524,912	第 344 回 利付国債(10 年)	1,339,146
第 347 回 利付国債(10 年)	1,560,528	第 133 回 利付国債(5 年)	1,312,308
第 132 回 利付国債(5 年)	1,311,998	第 297 回 利付国債(10 年)	1,219,644
第 134 回 利付国債(5 年)	1,212,276	第 131 回 利付国債(5 年)	1,210,256
第 346 回 利付国債(10 年)	1,005,468	第 295 回 利付国債(10 年)	1,114,333
第 349 回 利付国債(10 年)	965,039	第 293 回 利付国債(10 年)	1,021,113
第 160 回 利付国債(20 年)	868,477	第 130 回 利付国債(5 年)	910,923
第 129 回 利付国債(5 年)	807,320	第 302 回 利付国債(10 年)	816,240
第 54 回 利付国債(30 年)	608,405	第 300 回 利付国債(10 年)	712,201

(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('17年3月7日から'18年3月5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('18年3月5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
日本債券インデックス・マザーファンド	千口 895,776	千口 1,096,974	千円 1,391,950

(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99,700,726千口です。

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('18年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本債券インデックス・マザーファンド	千円 1,391,950	% 98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	26,506	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,418,456	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

(’18年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	1,418,456,183
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	16,761,180
日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	1,391,950,325
未 収 入 金	9,744,678
(B) 負 債	26,372,340
未 払 解 約 金	25,468,974
未 払 信 託 報 酬	838,844
未 払 利 息	41
そ の 他 未 払 費 用	64,481
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	1,392,083,843
元 本	1,422,063,206
次 期 繰 越 損 益 金	△ 29,979,363
(D) 受 益 権 総 口 数	1,422,063,206口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	9,789円

- (注1) 期首元本額 1,159,092,350円
 期中追加設定元本額 1,421,530,528円
 期中一部解約元本額 1,158,559,672円
 (注2) 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は29,979,363円です。

◎損益の状況

当期(自’17年3月7日 至’18年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 4,625
支 払 利 息	△ 4,625
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,692,870
売 買 損 益	10,237,107
売 買 損 益	△ 1,544,237
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,589,322
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	7,098,923
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 3,731,896
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 33,346,390
(配当等相当額)	(7,903,874)
(売買損益相当額)	(△ 41,250,264)
(G) 計 (D+E+F)	△ 29,979,363
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 29,979,363
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 33,346,390
(配当等相当額)	(9,219,507)
(売買損益相当額)	(△ 42,565,897)
分 配 準 備 積 立 金	12,474,403
繰 越 損 益 金	△ 9,107,376

- (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。

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第2期 (2017年3月7日～ 2018年3月5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	152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15期 運用報告書

(決算日2018年3月5日)

日本債券インデックス・マザーファンドの第15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
	期 騰	中 落率	期 騰	中 落率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期('14年 3月 5日)	11,740	1.6	11,766	1.6	99.6	-	187,884
12期('15年 3月 5日)	12,033	2.5	12,057	2.5	99.4	-	175,617
13期('16年 3月 7日)	12,687	5.4	12,704	5.4	99.5	-	138,382
14期('17年 3月 6日)	12,581	△ 0.8	12,600	△ 0.8	99.3	-	130,176
15期('18年 3月 5日)	12,689	0.9	12,704	0.8	99.0	-	126,515

(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、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、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
	騰	落率	騰	落率		
(期首) '17年 3月 6日	円	%		%	%	%
	12,581	-	12,600	-	99.3	-
3月末	12,576	△ 0.0	12,596	△ 0.0	99.7	-
4月末	12,639	0.5	12,657	0.5	99.6	-
5月末	12,615	0.3	12,631	0.2	99.5	-
6月末	12,580	△ 0.0	12,599	△ 0.0	99.7	-
7月末	12,582	0.0	12,598	△ 0.0	99.6	-
8月末	12,650	0.5	12,665	0.5	99.4	-
9月末	12,605	0.2	12,622	0.2	99.7	-
10月末	12,606	0.2	12,622	0.2	99.8	-
11月末	12,639	0.5	12,655	0.4	99.4	-
12月末	12,647	0.5	12,663	0.5	99.5	-
'18年 1月末	12,626	0.4	12,641	0.3	99.2	-
2月末	12,675	0.7	12,689	0.7	99.5	-
(期末) '18年 3月 5日	12,689	0.9	12,704	0.8	99.0	-

(注1) 騰落率は期首比です。

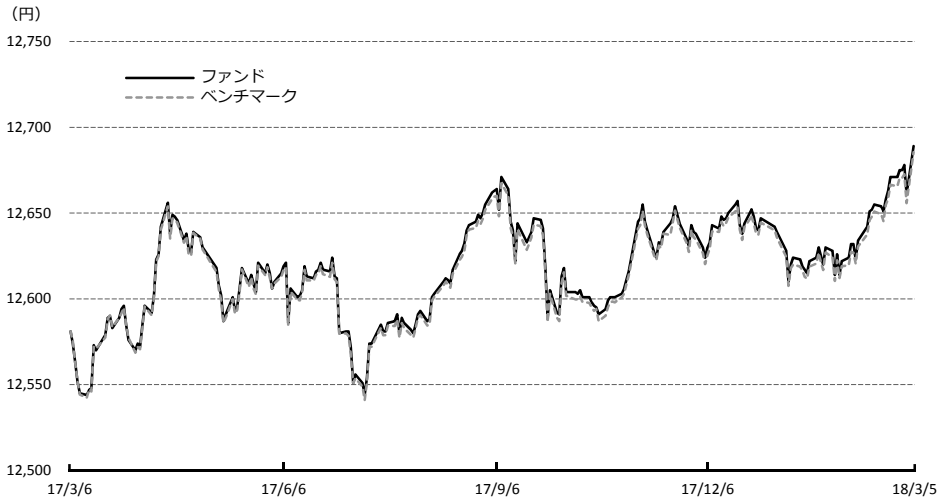
(注2) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合指数で、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

当期の運用実績

(2017年3月7日から2018年3月5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12,689円となり、前期末の12,581円に比べて108円の上昇となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

- 朝鮮半島の軍事的な緊張を巡る地政学的リスクの高まりを受けて、日本国債が選好されたことが基準価額にプラスに寄与しました。
- 日銀が指し値オペを実施することで債券利回りの上昇を抑制する姿勢を示したことが債券の買い材料となり基準価額にプラスに寄与しました。

【マイナスの要因】

- 期後半、GDP成長率や全国消費者物価指数の上昇など堅調な経済指標や、日銀の金融政策の出口戦略が市場で意識されたことが債券の売り材料となり基準価額にマイナスに寄与しました。

ベンチマークとの比較

基準価額の騰落率は+0.9%と、ベンチマークの騰落率(+0.8%)と同水準となり、当期の運用実績はベンチマークに連動した結果となりました。

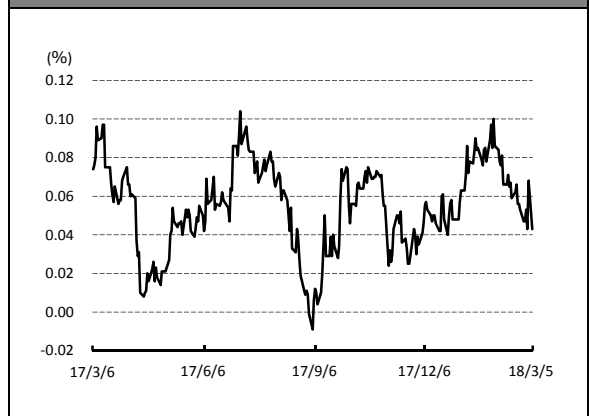
投資環境

(2017年3月7日から2018年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期を通じて日本10年国債利回りが概ね0.00%から0.10%の範囲で推移するレンジ相場となりました。期前半、朝鮮半島の軍事的な緊張を巡る地政学的リスクの高まりが債券の買い材料となりました。4月に日本10年国債利回りが0.00%近辺まで低下した後は、欧米の長期金利の上昇が影響し、債券が軟調となりました。7月に入ると、日銀が指し値オペによって利回りの上昇抑制姿勢を示したことから債券が買い戻されました。8月は朝鮮半島を巡る地政学的リスクの高まりに加え、海外投資家からの需要や日銀の国債買い入れオペによる需給のタイト化が見られたことを背景に債券が買われました。期後半はGDP成長率の継続的な上昇や全国消費者物価指数の上昇など堅調な経済指標が債券の売り材料となりました。2018年に入ると、日銀が国債買い入れオペで超長期国債の買い入れ額を減らしたことを受けて、市場で金融政策の出口戦略が意識されたことが債券の売り材料となりました。しかし、2月には債券利回り上昇時に日銀が指し値オペを実施したことに加え、黒田日銀総裁の続投や金融緩和積極派の副総裁への起用など日銀人事に関する報道が金融緩和継続観測につながり債券が買われました。日本10年国債利回りは前期末から0.03%低下の0.04%となりました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2017年3月7日から2018年3月5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、期初時点で547銘柄でしたが、期中の資金流出に対応した債券の売却により期末時点では508銘柄へと減少しました。ファンドにおける個別発行体の分散度もやや縮小しましたが、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 (2017年3月7日~2018年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	12,620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('17年3月7日から'18年3月5日まで)

○公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 19,900,240	千円 23,410,407
	地 方 債 証 券	1,218,450	825,595 (526,020)
	特 殊 債 券	2,547,192	715,475 (1,012,842)
	社 債 券	601,700	200,726 (1,322,000)

(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('17年3月7日から'18年3月5日まで)

○公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第 131 回 利付国債(5年)	2,526,812	第 298 回 利付国債(10年)	1,624,592
第 133 回 利付国債(5年)	2,524,912	第 344 回 利付国債(10年)	1,339,146
第 347 回 利付国債(10年)	1,560,528	第 133 回 利付国債(5年)	1,312,308
第 132 回 利付国債(5年)	1,311,998	第 297 回 利付国債(10年)	1,219,644
第 134 回 利付国債(5年)	1,212,276	第 131 回 利付国債(5年)	1,210,256
第 346 回 利付国債(10年)	1,005,468	第 295 回 利付国債(10年)	1,114,333
第 349 回 利付国債(10年)	965,039	第 293 回 利付国債(10年)	1,021,113
第 160 回 利付国債(20年)	868,477	第 130 回 利付国債(5年)	910,923
第 129 回 利付国債(5年)	807,320	第 302 回 利付国債(10年)	816,240
第 54 回 利付国債(30年)	608,405	第 300 回 利付国債(10年)	712,201

(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('17年3月7日から'18年3月5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('18年3月5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	91,860,000 (100,000)	101,139,325 (100,210)	79.9 (0.1)	— (—)	53.3 (—)	22.0 (—)	4.7 (0.1)
地 方 債 証 券	7,272,850 (7,142,850)	7,754,317 (7,610,470)	6.1 (6.0)	— (—)	3.4 (3.3)	1.8 (1.8)	1.0 (0.9)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	9,276,730 (8,768,730)	10,089,955 (9,541,926)	8.0 (7.5)	— (—)	5.6 (5.5)	1.6 (1.4)	0.7 (0.7)
金 融 債 券	1,100,000 (1,100,000)	1,102,804 (1,102,804)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	0.6 (0.6)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	4,910,000 (4,410,000)	5,124,691 (4,593,681)	4.1 (3.6)	— (—)	1.3 (1.1)	1.2 (1.1)	1.5 (1.4)
合 計	114,419,580 (21,521,580)	125,211,094 (22,949,091)	99.0 (18.1)	— (—)	63.6 (9.9)	26.9 (4.4)	8.5 (3.8)

(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 118 回 利付国債(5年)	0.2	500,000	502,320	2019/6/20
	第 119 回 利付国債(5年)	0.1	500,000	501,675	2019/6/20
	第 120 回 利付国債(5年)	0.2	500,000	502,775	2019/9/20
	第 121 回 利付国債(5年)	0.1	200,000	200,802	2019/9/20
	第 122 回 利付国債(5年)	0.1	550,000	552,464	2019/12/20
	第 123 回 利付国債(5年)	0.1	600,000	603,060	2020/3/20
	第 124 回 利付国債(5年)	0.1	500,000	502,865	2020/6/20
	第 125 回 利付国債(5年)	0.1	500,000	503,120	2020/9/20
	第 130 回 利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,210,740	2021/12/20
	第 131 回 利付国債(5年)	0.1	1,300,000	1,312,129	2022/3/20
	第 132 回 利付国債(5年)	0.1	900,000	908,919	2022/6/20
	第 133 回 利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,212,600	2022/9/20
	第 134 回 利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,213,296	2022/12/20
	第 32 回 利付国債(30年)	2.3	430,000	580,745	2040/3/20
	第 116 回 利付国債(20年)	2.2	200,000	249,354	2030/3/20
	第 128 回 利付国債(5年)	0.1	300,000	302,427	2021/6/20
	第 129 回 利付国債(5年)	0.1	1,750,000	1,764,927	2021/9/20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
第 1 回	利付国債(40年)	2.4	160,000	230,942	2048/3/20
第 2 回	利付国債(40年)	2.2	500,000	698,345	2049/3/20
第 3 回	利付国債(40年)	2.2	250,000	350,882	2050/3/20
第 4 回	利付国債(40年)	2.2	250,000	352,507	2051/3/20
第 5 回	利付国債(40年)	2.0	130,000	176,209	2052/3/20
第 6 回	利付国債(40年)	1.9	150,000	199,521	2053/3/20
第 7 回	利付国債(40年)	1.7	160,000	203,120	2054/3/20
第 8 回	利付国債(40年)	1.4	50,000	58,738	2055/3/20
第 9 回	利付国債(40年)	0.4	650,000	552,428	2056/3/20
第 10 回	利付国債(40年)	0.9	340,000	342,471	2057/3/20
第 301 回	利付国債(10年)	1.5	600,000	612,846	2019/6/20
第 302 回	利付国債(10年)	1.4	200,000	204,038	2019/6/20
第 303 回	利付国債(10年)	1.4	600,000	614,442	2019/9/20
第 304 回	利付国債(10年)	1.3	1,100,000	1,124,783	2019/9/20
第 305 回	利付国債(10年)	1.3	1,000,000	1,026,100	2019/12/20
第 306 回	利付国債(10年)	1.4	800,000	825,400	2020/3/20
第 307 回	利付国債(10年)	1.3	900,000	926,739	2020/3/20
第 308 回	利付国債(10年)	1.3	700,000	723,296	2020/6/20
第 309 回	利付国債(10年)	1.1	800,000	822,952	2020/6/20
第 310 回	利付国債(10年)	1.0	900,000	926,379	2020/9/20
第 311 回	利付国債(10年)	0.8	600,000	614,526	2020/9/20
第 312 回	利付国債(10年)	1.2	800,000	830,128	2020/12/20
第 313 回	利付国債(10年)	1.3	700,000	730,835	2021/3/20
第 314 回	利付国債(10年)	1.1	900,000	934,164	2021/3/20
第 315 回	利付国債(10年)	1.2	750,000	783,322	2021/6/20
第 316 回	利付国債(10年)	1.1	500,000	520,560	2021/6/20
第 317 回	利付国債(10年)	1.1	600,000	626,466	2021/9/20
第 318 回	利付国債(10年)	1.0	250,000	260,137	2021/9/20
第 319 回	利付国債(10年)	1.1	300,000	314,169	2021/12/20
第 320 回	利付国債(10年)	1.0	700,000	730,394	2021/12/20
第 321 回	利付国債(10年)	1.0	300,000	313,815	2022/3/20
第 322 回	利付国債(10年)	0.9	700,000	729,393	2022/3/20
第 323 回	利付国債(10年)	0.9	200,000	208,882	2022/6/20
第 324 回	利付国債(10年)	0.8	400,000	416,036	2022/6/20
第 325 回	利付国債(10年)	0.8	500,000	521,115	2022/9/20
第 326 回	利付国債(10年)	0.7	300,000	311,847	2022/12/20
第 327 回	利付国債(10年)	0.8	700,000	731,017	2022/12/20
第 328 回	利付国債(10年)	0.6	500,000	518,105	2023/3/20
第 329 回	利付国債(10年)	0.8	500,000	524,195	2023/6/20
第 330 回	利付国債(10年)	0.8	800,000	840,576	2023/9/20
第 331 回	利付国債(10年)	0.6	500,000	519,785	2023/9/20
第 332 回	利付国債(10年)	0.6	600,000	624,636	2023/12/20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
第 333 回	利付国債(10年)	0.6	700,000	729,526	2024/ 3 /20
第 334 回	利付国債(10年)	0.6	350,000	365,155	2024/ 6 /20
第 335 回	利付国債(10年)	0.5	800,000	830,496	2024/ 9 /20
第 336 回	利付国債(10年)	0.5	200,000	207,846	2024/12/20
第 337 回	利付国債(10年)	0.3	700,000	717,906	2024/12/20
第 338 回	利付国債(10年)	0.4	650,000	671,599	2025/ 3 /20
第 339 回	利付国債(10年)	0.4	1,100,000	1,137,037	2025/ 6 /20
第 340 回	利付国債(10年)	0.4	980,000	1,013,369	2025/ 9 /20
第 341 回	利付国債(10年)	0.3	900,000	924,264	2025/12/20
第 342 回	利付国債(10年)	0.1	800,000	808,696	2026/ 3 /20
第 343 回	利付国債(10年)	0.1	700,000	707,266	2026/ 6 /20
第 344 回	利付国債(10年)	0.1	800,000	807,864	2026/ 9 /20
第 345 回	利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,009,230	2026/12/20
第 346 回	利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,008,570	2027/ 3 /20
第 347 回	利付国債(10年)	0.1	1,150,000	1,159,602	2027/ 6 /20
第 348 回	利付国債(10年)	0.1	300,000	302,427	2027/ 9 /20
第 349 回	利付国債(10年)	0.1	960,000	967,027	2027/12/20
第 1 回	利付国債(30年)	2.8	300,000	392,628	2029/ 9 /20
第 2 回	利付国債(30年)	2.4	380,000	482,429	2030/ 2 /20
第 3 回	利付国債(30年)	2.3	300,000	378,426	2030/ 5 /20
第 5 回	利付国債(30年)	2.2	100,000	126,131	2031/ 5 /20
第 6 回	利付国債(30年)	2.4	100,000	129,436	2031/11/20
第 7 回	利付国債(30年)	2.3	300,000	386,205	2032/ 5 /20
第 8 回	利付国債(30年)	1.8	300,000	366,243	2032/11/22
第 9 回	利付国債(30年)	1.4	100,000	116,318	2032/12/20
第 12 回	利付国債(30年)	2.1	300,000	381,309	2033/ 9 /20
第 13 回	利付国債(30年)	2.0	300,000	377,166	2033/12/20
第 14 回	利付国債(30年)	2.4	300,000	396,690	2034/ 3 /20
第 15 回	利付国債(30年)	2.5	200,000	268,118	2034/ 6 /20
第 16 回	利付国債(30年)	2.5	200,000	268,698	2034/ 9 /20
第 17 回	利付国債(30年)	2.4	200,000	265,646	2034/12/20
第 18 回	利付国債(30年)	2.3	100,000	131,350	2035/ 3 /20
第 19 回	利付国債(30年)	2.3	200,000	263,146	2035/ 6 /20
第 20 回	利付国債(30年)	2.5	100,000	135,194	2035/ 9 /20
第 21 回	利付国債(30年)	2.3	200,000	263,764	2035/12/20
第 22 回	利付国債(30年)	2.5	100,000	135,554	2036/ 3 /20
第 23 回	利付国債(30年)	2.5	100,000	135,786	2036/ 6 /20
第 24 回	利付国債(30年)	2.5	320,000	435,232	2036/ 9 /20
第 25 回	利付国債(30年)	2.3	100,000	132,624	2036/12/20
第 26 回	利付国債(30年)	2.4	150,000	201,816	2037/ 3 /20
第 27 回	利付国債(30年)	2.5	320,000	437,427	2037/ 9 /20
第 28 回	利付国債(30年)	2.5	300,000	411,513	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	
第 29 回	利付国債(30年)	2.4	200,000	271,286	2038/ 9 /20
第 30 回	利付国債(30年)	2.3	350,000	469,462	2039/ 3 /20
第 31 回	利付国債(30年)	2.2	300,000	397,623	2039/ 9 /20
第 33 回	利付国債(30年)	2.0	360,000	465,145	2040/ 9 /20
第 34 回	利付国債(30年)	2.2	500,000	669,355	2041/ 3 /20
第 35 回	利付国債(30年)	2.0	350,000	454,821	2041/ 9 /20
第 36 回	利付国債(30年)	2.0	420,000	546,961	2042/ 3 /20
第 37 回	利付国債(30年)	1.9	380,000	487,752	2042/ 9 /20
第 38 回	利付国債(30年)	1.8	300,000	379,182	2043/ 3 /20
第 39 回	利付国債(30年)	1.9	330,000	425,125	2043/ 6 /20
第 40 回	利付国債(30年)	1.8	280,000	354,410	2043/ 9 /20
第 41 回	利付国債(30年)	1.7	150,000	186,433	2043/12/20
第 42 回	利付国債(30年)	1.7	300,000	373,047	2044/ 3 /20
第 43 回	利付国債(30年)	1.7	300,000	373,233	2044/ 6 /20
第 44 回	利付国債(30年)	1.7	320,000	398,307	2044/ 9 /20
第 45 回	利付国債(30年)	1.5	240,000	287,198	2044/12/20
第 46 回	利付国債(30年)	1.5	400,000	478,732	2045/ 3 /20
第 47 回	利付国債(30年)	1.6	200,000	244,602	2045/ 6 /20
第 48 回	利付国債(30年)	1.4	200,000	234,762	2045/ 9 /20
第 49 回	利付国債(30年)	1.4	50,000	58,688	2045/12/20
第 50 回	利付国債(30年)	0.8	500,000	510,520	2046/ 3 /20
第 51 回	利付国債(30年)	0.3	500,000	445,930	2046/ 6 /20
第 52 回	利付国債(30年)	0.5	500,000	470,615	2046/ 9 /20
第 53 回	利付国債(30年)	0.6	400,000	386,708	2046/12/20
第 54 回	利付国債(30年)	0.8	410,000	417,371	2047/ 3 /20
第 55 回	利付国債(30年)	0.8	440,000	447,431	2047/ 6 /20
第 56 回	利付国債(30年)	0.8	220,000	223,469	2047/ 9 /20
第 57 回	利付国債(30年)	0.8	240,000	243,513	2047/12/20
第 45 回	利付国債(20年)	2.4	650,000	683,910	2020/ 3 /20
第 47 回	利付国債(20年)	2.2	600,000	635,904	2020/ 9 /21
第 48 回	利付国債(20年)	2.5	300,000	322,242	2020/12/21
第 49 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	106,841	2021/ 3 /22
第 50 回	利付国債(20年)	1.9	50,000	53,115	2021/ 3 /22
第 51 回	利付国債(20年)	2.0	350,000	374,759	2021/ 6 /21
第 52 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	107,955	2021/ 9 /21
第 55 回	利付国債(20年)	2.0	500,000	543,345	2022/ 3 /21
第 57 回	利付国債(20年)	1.9	800,000	869,832	2022/ 6 /20
第 60 回	利付国債(20年)	1.4	700,000	751,429	2022/12/20
第 61 回	利付国債(20年)	1.0	350,000	369,764	2023/ 3 /20
第 63 回	利付国債(20年)	1.8	500,000	550,935	2023/ 6 /20
第 65 回	利付国債(20年)	1.9	400,000	446,452	2023/12/20
第 68 回	利付国債(20年)	2.2	500,000	569,485	2024/ 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	
第 69 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	339,870	2024/3/20
第 70 回	利付国債(20年)	2.4	600,000	694,032	2024/6/20
第 72 回	利付国債(20年)	2.1	600,000	685,764	2024/9/20
第 74 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	344,406	2024/12/20
第 76 回	利付国債(20年)	1.9	200,000	227,856	2025/3/20
第 77 回	利付国債(20年)	2.0	300,000	343,905	2025/3/20
第 78 回	利付国債(20年)	1.9	250,000	285,865	2025/6/20
第 80 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	115,810	2025/6/20
第 81 回	利付国債(20年)	2.0	200,000	230,942	2025/9/20
第 83 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	350,160	2025/12/20
第 85 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	234,408	2026/3/20
第 88 回	利付国債(20年)	2.3	400,000	477,232	2026/6/20
第 89 回	利付国債(20年)	2.2	400,000	473,912	2026/6/20
第 90 回	利付国債(20年)	2.2	300,000	356,817	2026/9/20
第 91 回	利付国債(20年)	2.3	300,000	359,382	2026/9/20
第 92 回	利付国債(20年)	2.1	340,000	402,930	2026/12/20
第 93 回	利付国債(20年)	2.0	300,000	354,213	2027/3/20
第 94 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	356,922	2027/3/20
第 95 回	利付国債(20年)	2.3	150,000	181,873	2027/6/20
第 96 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	119,393	2027/6/20
第 97 回	利付国債(20年)	2.2	150,000	181,221	2027/9/20
第 98 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	119,861	2027/9/20
第 99 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	240,524	2027/12/20
第 100 回	利付国債(20年)	2.2	200,000	243,302	2028/3/20
第 101 回	利付国債(20年)	2.4	100,000	123,651	2028/3/20
第 102 回	利付国債(20年)	2.4	200,000	248,104	2028/6/20
第 103 回	利付国債(20年)	2.3	200,000	246,056	2028/6/20
第 104 回	利付国債(20年)	2.1	150,000	181,471	2028/6/20
第 105 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	364,095	2028/9/20
第 106 回	利付国債(20年)	2.2	200,000	244,826	2028/9/20
第 107 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	243,474	2028/12/20
第 108 回	利付国債(20年)	1.9	100,000	119,595	2028/12/20
第 109 回	利付国債(20年)	1.9	300,000	359,727	2029/3/20
第 110 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	244,192	2029/3/20
第 111 回	利付国債(20年)	2.2	200,000	247,154	2029/6/20
第 112 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	244,920	2029/6/20
第 113 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	245,632	2029/9/20
第 114 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	369,477	2029/12/20
第 115 回	利付国債(20年)	2.2	300,000	372,969	2029/12/20
第 118 回	利付国債(20年)	2.0	400,000	490,168	2030/6/20
第 122 回	利付国債(20年)	1.8	300,000	361,146	2030/9/20
第 123 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	248,626	2030/12/20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	第 126 回 利付国債(20年)	2.0	500,000	616,685	2031/ 3 /20
	第 127 回 利付国債(20年)	1.9	400,000	488,248	2031/ 3 /20
	第 128 回 利付国債(20年)	1.9	400,000	489,280	2031/ 6 /20
	第 130 回 利付国債(20年)	1.8	400,000	485,008	2031/ 9 /20
	第 132 回 利付国債(20年)	1.7	200,000	240,094	2031/12/20
	第 133 回 利付国債(20年)	1.8	300,000	364,164	2031/12/20
	第 135 回 利付国債(20年)	1.7	300,000	360,696	2032/ 3 /20
	第 136 回 利付国債(20年)	1.6	200,000	237,576	2032/ 3 /20
	第 137 回 利付国債(20年)	1.7	100,000	120,417	2032/ 6 /20
	第 139 回 利付国債(20年)	1.6	200,000	238,066	2032/ 6 /20
	第 140 回 利付国債(20年)	1.7	200,000	241,024	2032/ 9 /20
	第 141 回 利付国債(20年)	1.7	200,000	241,358	2032/12/20
	第 142 回 利付国債(20年)	1.8	200,000	244,384	2032/12/20
	第 143 回 利付国債(20年)	1.6	300,000	358,167	2033/ 3 /20
	第 144 回 利付国債(20年)	1.5	200,000	235,714	2033/ 3 /20
	第 145 回 利付国債(20年)	1.7	350,000	423,479	2033/ 6 /20
	第 146 回 利付国債(20年)	1.7	470,000	568,963	2033/ 9 /20
	第 147 回 利付国債(20年)	1.6	560,000	669,743	2033/12/20
	第 148 回 利付国債(20年)	1.5	900,000	1,062,792	2034/ 3 /20
	第 149 回 利付国債(20年)	1.5	680,000	803,590	2034/ 6 /20
	第 150 回 利付国債(20年)	1.4	400,000	466,392	2034/ 9 /20
	第 151 回 利付国債(20年)	1.2	400,000	453,552	2034/12/20
	第 152 回 利付国債(20年)	1.2	350,000	396,553	2035/ 3 /20
	第 153 回 利付国債(20年)	1.3	550,000	632,082	2035/ 6 /20
	第 154 回 利付国債(20年)	1.2	240,000	271,689	2035/ 9 /20
	第 155 回 利付国債(20年)	1.0	150,000	164,536	2035/12/20
	第 156 回 利付国債(20年)	0.4	650,000	644,572	2036/ 3 /20
	第 157 回 利付国債(20年)	0.2	600,000	572,718	2036/ 6 /20
	第 158 回 利付国債(20年)	0.5	600,000	603,066	2036/ 9 /20
	第 159 回 利付国債(20年)	0.6	550,000	561,374	2036/12/20
	第 160 回 利付国債(20年)	0.7	550,000	570,108	2037/ 3 /20
	第 161 回 利付国債(20年)	0.6	450,000	457,110	2037/ 6 /20
	第 162 回 利付国債(20年)	0.6	100,000	101,418	2037/ 9 /20
	第 163 回 利付国債(20年)	0.6	300,000	303,759	2037/12/20
	第 14 回 ポーランド共和国	0.67	100,000	100,210	2018/11/15
	小 計		91,860,000	101,139,325	
地 方 債 証 券	第 658 回 東京都公募公債	1.95	10,000	10,056	2018/ 6 /20
	第 662 回 東京都公募公債	1.67	10,000	10,089	2018/ 9 /20
	第 739 回 東京都公募公債	0.29	100,000	101,593	2024/12/20
	第 746 回 東京都公募公債	0.499	100,000	103,147	2025/ 6 /20
	第 751 回 東京都公募公債	0.37	100,000	102,243	2025/12/19
	第 759 回 東京都公募公債	0.075	100,000	99,621	2026/ 9 /18

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
第 765 回	東京都公募公債	0.21	100,000	100,670	2027/3/19
第 6 回	東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	113,669	2025/3/19
第 7 回	東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	115,662	2025/9/19
第 12 回	東京都公募公債(20年)	2.31	100,000	120,284	2027/9/17
第 13 回	東京都公募公債(20年)	2.15	100,000	119,113	2027/12/20
第 26 回	東京都公募公債(20年)	1.74	100,000	118,358	2032/6/18
平成 21 年度第 6 回	北海道公募公債	1.6	60,000	61,408	2019/8/28
平成 24 年度第 4 回	北海道公募公債	0.9	100,000	103,801	2022/6/29
平成 24 年度第 9 回	北海道公募公債	0.79	7,400	7,664	2022/10/31
第 30 回	2号宮城県公募公債(10年)	0.53	100,000	103,082	2024/10/29
第 188 回	神奈川県公募公債	1.05	100,000	104,194	2022/3/18
第 3 回	神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	135,023	2037/3/19
第 36 回	神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	100,535	2037/12/18
第 312 回	大阪府公募公債(10年)	1.6	10,000	10,010	2018/3/28
第 316 回	大阪府公募公債(10年)	1.85	10,000	10,073	2018/7/30
第 320 回	大阪府公募公債(10年)	1.84	10,000	10,133	2018/11/27
第 323 回	大阪府公募公債(10年)	1.69	40,000	40,656	2019/2/26
第 324 回	大阪府公募公債(10年)	1.64	8,000	8,138	2019/3/29
第 325 回	大阪府公募公債(10年)	1.66	6,000	6,112	2019/4/26
第 326 回	大阪府公募公債(10年)	1.66	56,000	57,132	2019/5/28
第 346 回	大阪府公募公債(10年)	1.25	100,000	103,584	2021/1/28
第 368 回	大阪府公募公債(10年)	0.83	100,000	103,931	2023/1/30
第 374 回	大阪府公募公債(10年)	0.938	134,000	140,497	2023/7/28
第 387 回	大阪府公募公債(10年)	0.521	44,040	45,323	2024/8/28
平成 22 年度第 3 回	京都府公募公債(20年)	2.0	100,000	120,413	2030/11/22
平成 24 年度第 5 回	京都府公募公債	0.82	30,000	31,104	2022/9/20
平成 24 年度第 8 回	京都府公募公債	0.73	30,000	31,020	2022/12/19
平成 20 年度第 7 回	兵庫県公募公債	1.79	10,000	10,065	2018/7/17
第 2 回	兵庫県公募公債(30年)	2.36	100,000	131,331	2040/3/19
第 3 回	兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	110,458	2027/7/16
平成 21 年度第 2 回	静岡県公募公債	1.65	100,000	102,136	2019/6/25
第 10 回	静岡県公募公債(20年)	2.072	100,000	120,913	2030/6/14
平成 24 年度第 8 回	愛知県公募公債(10年)	0.835	100,000	103,695	2022/8/29
平成 24 年度第 14 回	愛知県公募公債(15年)	1.314	100,000	110,993	2027/12/13
平成 25 年度第 6 回	愛知県公募公債(10年)	0.877	100,000	104,497	2023/6/27
平成 29 年度第 8 回	愛知県公募公債(10年)	0.2	100,000	100,375	2027/8/31
平成 21 年度第 2 回	広島県公募公債	1.46	16,160	16,483	2019/7/24
平成 28 年度第 1 回	広島県公募公債	0.08	100,000	99,637	2026/5/25
平成 26 年度第 1 回	広島県公募公債(20年)	1.41	100,000	113,826	2034/9/12
平成 21 年度第 1 回	埼玉県公募公債	1.53	20,000	20,343	2019/4/23
平成 21 年度第 3 回	埼玉県公募公債	1.64	20,000	20,424	2019/6/25
平成 24 年度第 1 回	埼玉県公募公債	1.05	100,000	104,306	2022/4/26

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	平成 25 年度第 1 回 埼玉県公募公債	0.586	100,000	102,869	2023/4/18
	平成 23 年度第 3 回 福岡県公募公債	1.07	100,000	103,685	2021/8/26
	平成 24 年度第 11 回 福岡県公募公債	0.8	100,000	103,876	2023/2/27
	平成 20 年度第 7 回 千葉県公募公債	1.56	1,000	1,012	2018/12/25
	平成 21 年度第 1 回 千葉県公募公債	1.53	40,000	40,690	2019/4/25
	平成 21 年度第 2 回 千葉県公募公債	1.57	40,000	40,758	2019/5/24
	平成 21 年度第 8 回 千葉県公募公債	1.53	100,000	102,615	2019/11/25
	第 10 回 千葉県公募公債(20 年)	1.8	100,000	118,402	2031/8/18
	平成 21 年度第 2 回 新潟県公募公債	1.55	10,000	10,265	2019/11/27
	平成 24 年度第 2 回 新潟県公募公債	0.79	100,000	103,826	2023/2/27
	第 60 回 共同発行市場公募地方債	1.49	10,000	10,007	2018/3/23
	第 61 回 共同発行市場公募地方債	1.55	10,000	10,021	2018/4/25
	第 62 回 共同発行市場公募地方債	1.74	20,000	20,076	2018/5/25
	第 63 回 共同発行市場公募地方債	1.88	10,000	10,057	2018/6/25
	第 83 回 共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	102,818	2020/2/25
	第 84 回 共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	102,804	2020/3/25
	第 85 回 共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	103,044	2020/4/24
	第 90 回 共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	102,826	2020/9/25
	第 96 回 共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	103,895	2021/3/25
	第 100 回 共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	104,060	2021/7/23
	第 101 回 共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	103,612	2021/8/25
	第 111 回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	103,790	2022/6/24
	第 115 回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	103,657	2022/10/25
	第 119 回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	103,868	2023/2/24
	第 129 回 共同発行市場公募地方債	0.71	100,000	103,909	2023/12/25
	第 130 回 共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	104,260	2024/1/25
	第 137 回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	103,297	2024/8/23
	第 147 回 共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	103,434	2025/6/25
	第 157 回 共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	99,684	2026/4/24
	平成 21 年度第 2 回 熊本県公募公債(10 年)	1.35	10,000	10,220	2019/10/30
	平成 20 年度第 1 回 浜松市公募公債	1.71	11,000	11,135	2018/11/27
	平成 22 年度第 1 回 静岡市公募公債	1.008	12,000	12,324	2020/11/25
	平成 20 年度第 2 回 大阪市公募公債	1.95	20,000	20,113	2018/6/20
	平成 20 年度第 3 回 大阪市公募公債	1.82	30,000	30,207	2018/7/23
	平成 20 年度第 8 回 大阪市公募公債	1.6	40,000	40,570	2019/1/28
	第 5 回 大阪市公募公債(20 年)	2.47	100,000	123,043	2028/9/21
	第 468 回 名古屋市公募公債(10 年)	1.39	100,000	102,124	2019/9/20
	第 480 回 名古屋市公募公債(10 年)	0.825	100,000	103,706	2022/9/20
	平成 21 年度第 1 回 京都市公募公債	1.55	100,000	102,266	2019/8/26
	第 4 回 横浜市公募公債(30 年)	2.54	100,000	133,260	2036/12/19
	第 14 回 横浜市公募公債(20 年)	2.32	100,000	120,948	2028/3/17
	平成 20 年度第 2 回 札幌市公募公債	1.93	22,550	22,676	2018/6/20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	平成 24 年度第 10 回 札幌市公募公債(10 年)	0.8	100,000	103,737	2022/12/20
	第 82 回 川崎市公募公債	1.52	130,000	133,021	2019/9/20
	平成 23 年度第 2 回 北九州市公募公債	1.06	11,000	11,438	2021/12/22
	平成 19 年度第 5 回 福岡市公募公債	1.49	13,700	13,712	2018/3/28
	平成 24 年度第 8 回 福岡市公募公債	0.68	100,000	103,329	2023/3/24
	平成 28 年度第 5 回 広島市公募公債	0.24	100,000	100,762	2027/2/26
	平成 24 年度第 1 回 福井県公募公債	0.8	100,000	103,660	2022/10/26
	平成 27 年度第 1 回 岡山県公募公債(10 年)	0.395	100,000	102,257	2026/1/29
	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	102,945	2023/12/20
	第 135 回 福岡北九州高速道路債券	0.5	100,000	101,911	2025/3/19
	小 計		7,272,850	7,754,317	
特 殊 債 券 (除く金融債)	第 340 回 政府保証道路債券	1.7	100,000	103,751	2020/4/28
	第 2 回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	105,199	2020/12/27
	第 885 回 政府保証公営企業債券	1.7	40,000	40,148	2018/5/22
	第 886 回 政府保証公営企業債券	1.8	3,000	3,015	2018/6/19
	第 25 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	104,101	2021/6/14
	第 27 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	100,000	103,619	2021/8/13
	第 30 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	74,000	76,877	2021/11/15
	第 31 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	114,000	118,960	2021/12/14
	第 37 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	104,038	2022/6/17
	第 40 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.819	100,000	103,926	2022/9/16
	第 45 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	104,209	2023/2/17
	第 47 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	102,932	2023/4/21
	第 28 回 地方公共団体金融機構債券(20 年)	1.396	100,000	113,511	2033/4/28
	F 181 回 地方公共団体金融機構債券	1.109	100,000	107,900	2026/7/28
	第 60 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	100,000	104,063	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	104,044	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	103,218	2024/11/18
	第 89 回 地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,147	2026/10/28
	第 97 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	100,000	100,319	2027/6/14
	第 12 回 政府保証東日本高速道路債券	1.4	22,000	22,018	2018/3/26
	第 9 回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	105,956	2021/3/26
	第 8 回 公営企業債券(30 年)	2.5	10,000	13,181	2035/9/21
	第 13 回 公営企業債券(20 年)	2.16	10,000	11,481	2025/6/20
	第 22 回 公営企業債券(20 年)	2.32	100,000	119,634	2027/6/18
	第 10 回 日本政策金融公庫社債	2.167	100,000	121,553	2030/3/19
	第 19 回 政府保証日本政策金融公庫債券	1.1	100,000	104,360	2021/12/17
	第 6 回 中小企業債券	0.79	10,000	10,003	2018/3/20
	第 6 回 政府保証新関西国際空港債券	0.155	100,000	100,517	2027/8/27
	第 7 回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	1.4	100,000	102,829	2020/2/17
	第 11 回 政府保証日本政策投資銀行債券	1.0	100,000	103,712	2021/9/14
	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	139,969	2049/6/30

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
第 12 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.52	100,000	119,484	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	148,673	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	143,959	2047/ 3 /20
第 23 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	120,462	2027/ 7 /20
第 59 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.35	100,000	102,771	2020/ 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	103,513	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	102,751	2024/ 6 /20
第 18 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	107,859	2021/ 8 /30
第 50 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	100,000	109,989	2023/ 1 /31
第 54 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	11,000	11,007	2018/ 3 /23
第 58 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.7	2,000	2,008	2018/ 5 /30
第 60 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	8,000	8,046	2018/ 6 /29
第 69 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.6	77,000	77,927	2018/11/28
第 71 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	62,000	62,721	2018/12/25
第 78 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	100,000	101,667	2019/ 4 /30
第 80 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	66,000	67,262	2019/ 5 /31
第 82 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	100,000	102,032	2019/ 6 /28
第 98 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	102,571	2020/ 1 /31
第 103 回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	102,743	2020/ 3 /19
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	116,299	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	103,541	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	102,944	2023/ 4 /28
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	1,045	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	103,926	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	104,118	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	2,082	2024/ 4 /30
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	103,232	2024/11/29
第 11 回	公営企業債券(20 年)	2.11	100,000	114,067	2025/ 3 /24
第 19 回	都市再生債券	2.04	50,000	50,041	2018/ 3 /20
第 55 回	政府保証関西国際空港債券	1.3	100,000	101,419	2019/ 3 /25
第 18 回	政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	103,551	2023/ 3 /22
第 21 回	政府保証中部国際空港債券	0.45	100,000	103,059	2025/ 3 /17
第 3 回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	200,000	236,962	2027/ 3 /19
第 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	37,880	40,150	2042/ 6 /10
第 30 回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.08	100,000	112,414	2024/ 6 /20
第 30 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	35,180	37,754	2044/11/10
第 18 回	貸付債権担保s種住宅金融支援機構債券	1.57	24,419	25,227	2032/11/10
第 36 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	39,657	42,106	2045/ 5 /10
第 38 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	42,031	44,356	2045/ 7 /10
第 39 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	42,340	44,523	2045/ 8 /10
第 43 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	101,628	107,786	2045/12/10
第 45 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	43,121	45,950	2046/ 2 /10

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
第 55 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	55,407	58,407	2046/12/10
第 60 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	56,667	59,533	2047/ 5 /10
第 108 回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.434	100,000	111,391	2027/ 6 /18
第 119 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	96,638	97,384	2052/ 4 /10
第 2 回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.61	30,472	31,570	2036/ 5 /10
第 29 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	16,695	17,367	2040/ 4 /10
第 34 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	20,571	21,554	2040/ 9 /10
第 38 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.91	17,475	18,300	2041/ 1 /10
第 13 回	沖縄振興開発金融公庫債券	1.67	10,000	10,217	2019/ 6 /20
第 24 回	政府保証中日本高速道路債券	1.3	20,000	20,237	2019/ 1 /22
第 13 回	政府保証西日本高速道路債券	1.4	4,000	4,003	2018/ 3 /27
第 15 回	政府保証西日本高速道路債券	1.8	10,000	10,051	2018/ 6 /15
第 29 回	西日本高速道路株式会社債	0.31	200,000	201,998	2026/ 2 /12
第 25 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.67	20,000	20,349	2019/ 3 /20
第 51 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.762	100,000	103,349	2022/ 9 /20
第 68 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.586	100,000	103,137	2024/ 8 / 5
第 7 回	本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	115,538	2025/ 6 /20
第 37 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	121,840	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	122,985	2029/ 5 /18
第 81 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.03	100,000	103,868	2021/12/20
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	121,083	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	125,100	2042/ 8 /29
第 7 回	道路債券	2.7	50,000	55,724	2022/ 6 /20
第 4 回	公営企業債券(30年)	2.95	100,000	137,291	2034/ 3 /24
第 14 回	地方公共団体金融機構債券(20年)	2.187	100,000	122,868	2031/ 4 /28
第 20 回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8	100,000	118,368	2032/ 1 /28
第 23 回	国際協力銀行債券	2.09	100,000	115,145	2025/12/19
第 3 回	都市再生債券	2.87	100,000	117,425	2024/ 6 /20
第 96 回	都市再生債券	0.599	100,000	103,249	2024/ 9 /20
第 342 回	東京交通債券	2.4	30,000	33,001	2022/ 6 /21
第 8 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	19,728	20,814	2042/12/10
第 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1	20,272	21,456	2043/ 1 /10
第 25 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	59,320	64,513	2044/ 6 /10
第 28 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	33,140	35,612	2044/ 9 /10
第 16 回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.64	23,917	24,744	2032/11/10
第 29 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	35,843	38,499	2044/10/10
第 17 回	貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.71	24,335	25,232	2032/11/10
第 31 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	36,248	38,765	2044/12/10
第 32 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	35,015	37,367	2045/ 1 /10
第 42 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	52,277	55,042	2045/11/10
第 66 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	60,442	63,023	2047/11/10
第 69 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	62,535	65,753	2048/ 2 /10

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	第 70 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	56,141	58,844	2048/ 3 /10
	第 71 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	54,739	56,890	2048/ 4 /10
	第 79 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	56,668	59,006	2048/12/10
	第 146 回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.757	100,000	103,926	2024/ 1 /19
	第 81 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	60,941	63,493	2049/ 2 /10
	第 149 回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.704	100,000	103,685	2024/ 3 /19
	第 157 回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	102,080	2025/ 5 /20
	第 1 回 貸付債権担保s種住宅金融公庫債券	1.51	44,787	46,273	2036/ 5 /10
	第 6 回 貸付債権担保s種住宅金融公庫債券	2.26	16,149	17,116	2037/ 5 /10
	第 9 回 貸付債権担保s種住宅金融公庫債券	2.19	34,034	36,070	2037/ 5 /10
	第 6 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.94	24,018	24,582	2037/ 6 /10
	第 5 回 国際協力機構債券	1.918	100,000	118,965	2030/ 9 /13
	第 36 回 中日本高速道路株式会社債	1.066	100,000	103,661	2021/ 9 /17
	小 計		9,276,730	10,089,955	
金 融 債 券	い第 763 号商工債	0.3	100,000	100,195	2018/12/27
	い第 758 号農林債	0.4	100,000	100,153	2018/ 7 /27
	い第 763 号農林債	0.3	100,000	100,236	2018/12/27
	い第 772 号農林債	0.25	100,000	100,312	2019/ 9 /27
	い第 787 号農林債	0.24	200,000	201,070	2020/12/25
	第 283 回 信金中金債(5 年)	0.35	100,000	100,106	2018/ 6 /27
	第 284 回 信金中金債(5 年)	0.4	100,000	100,153	2018/ 7 /27
	第 300 回 信金中金債(5 年)	0.225	100,000	100,338	2019/11/27
	第 303 回 信金中金債(5 年)	0.25	100,000	100,396	2020/ 2 /27
	第 321 回 信金中金債(5 年)	0.03	100,000	99,845	2021/ 8 /27
	小 計		1,100,000	1,102,804	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第 545 回 東京電力	1.849	100,000	100,695	2018/ 7 /25
	第 486 回 中部電力	1.691	100,000	100,796	2018/ 8 /24
	第 506 回 中部電力	0.695	100,000	103,032	2025/ 9 /25
	第 473 回 関西電力	1.665	100,000	101,874	2019/ 4 /25
	第 354 回 中国電力	1.905	100,000	100,427	2018/ 5 /25
	第 281 回 北陸電力	1.97	100,000	100,279	2018/ 4 /25
	第 445 回 東北電力	1.792	100,000	101,275	2018/11/22
	第 245 回 四国電力	2.0	100,000	106,367	2021/ 6 /25
	第 400 回 九州電力	1.777	100,000	103,719	2020/ 4 /24
	第 7 回 東京電力パワーグリッド株式会社債(一般担保付)	0.46	100,000	100,489	2022/10/24
	第 33 回 大成建設	0.66	100,000	100,144	2018/ 6 /20
	第 4 回 ヒューリック	0.359	100,000	100,212	2019/ 4 /24
	第 3 回 GLP投資法人無担保投資法人債	0.51	100,000	100,408	2020/12/25
	第 37 回 三菱化学	2.03	100,000	100,864	2018/ 8 /10
	第 14 回 武田薬品工業	0.54	100,000	100,629	2019/ 7 /19
	第 3 回 富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	103,411	2022/12/ 2
	第 12 回 パナソニック	0.387	100,000	100,586	2020/ 3 /19

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
第 14 回	トヨタ自動車	0.963	100,000	104,274	2023/ 3 /20
第 28 回	みずほコーポレート銀行	2.5	100,000	102,961	2019/ 6 / 3
第 57 回	三菱東京UFJ銀行	2.22	100,000	109,870	2022/10/27
第 6 回	りそな銀行	2.084	100,000	103,853	2020/ 3 / 4
第 9 回	三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	104,572	2021/ 4 /28
第 7 回	三井住友信託銀行	0.269	100,000	100,259	2019/ 4 /26
第 3 回	NTTファイナンス株式会社無担保社債(社債間限定同順位)	0.529	100,000	101,474	2031/12/19
第 60 回	トヨタファイナンス	0.244	100,000	100,185	2019/ 6 /20
第 28 回	リコーリース株式会社無担保社債(社債間限定同順位特約)	0.345	100,000	99,628	2027/ 7 /20
第 54 回	日立キピオ	0.416	100,000	100,524	2021/ 9 /17
第 23 回	三菱UFJリース	0.498	100,000	100,116	2018/ 6 /19
第 65 回	三菱地所	2.04	100,000	119,931	2032/12/20
第 4 回	プレミアム投資法人無担保投資法人債	0.72	100,000	100,234	2018/ 7 /25
第 17 回	東日本旅客鉄道	2.3	100,000	106,787	2021/ 2 /25
第 32 回	東日本旅客鉄道	2.26	100,000	112,920	2024/ 3 /19
第 69 回	東日本旅客鉄道	1.222	100,000	102,897	2020/ 7 /22
第 47 回	東海旅客鉄道	2.375	100,000	131,670	2039/12/16
第 4 回	東京地下鉄	2.38	10,000	11,800	2026/ 6 /19
第 13 回	東京地下鉄	1.702	100,000	117,115	2032/ 5 /25
第 25 回	日本郵船	2.65	100,000	115,803	2026/ 6 /22
第 63 回	日本電信電話	0.69	100,000	102,649	2023/ 3 /20
第 9 回	沖縄電力	0.88	100,000	100,037	2018/ 3 /20
第 11 回	電源開発	2.05	100,000	112,174	2025/ 3 /19
第 28 回	東京瓦斯	2.29	100,000	119,016	2027/ 6 /15
第 20 回	大阪瓦斯	1.79	100,000	104,493	2020/ 9 /18
第 27 回	エヌ・ティ・ティ・データ	0.9	100,000	103,751	2023/ 6 /20
第 8 回	ビー・ピー・シー・イー・エス・イー	0.407	100,000	100,539	2019/12/ 9
第 18 回	ビー・ピー・シー・イー・エス・イー円貨社債(2018)	0.329	100,000	100,142	2025/ 1 /24
第 14 回	クレディ・アグリコル・エス・イー円貨社債(2017)	0.459	100,000	100,308	2027/ 6 / 9
第 1 回	エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー円貨	0.45	100,000	100,935	2021/ 9 /24
第 10 回	ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	2.45	100,000	108,181	2021/12/28
第 9 回	モルガン・スタンレー	0.557	100,000	100,119	2018/ 5 /22
第 9 回	ナショナル・オーストラリア銀行	0.457	100,000	100,267	2019/ 1 /17
	小 計		4,910,000	5,124,691	
	合 計		114,419,580	125,211,094	

(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('18年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 125,211,094	% 98.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,760,596	1.4
投 資 信 託 財 産 総 額	126,971,690	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

('18年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	126,971,690,961
コーポレート債(評価額)	354,143,823
未払費用	125,211,094,027
未払利息	974,659,800
前払費用	426,013,511
(B) 負 債	5,779,800
未払解約金	456,688,485
未払利息	456,686,758
その他未払費用	868
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	859
元 本	126,515,002,476
次 期 繰 越 損 益 金	99,700,726,312
(D) 受 益 権 総 口 数	26,814,276,164
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	99,700,726,312口
	12,689円

(注1) 期首元本額 103,467,931,143円
 期中追加設定元本額 18,505,478,376円
 期中一部解約元本額 22,272,683,207円

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

AMC/スタート・ストリート・リスク(シベット型)バラン・オープン(ステイブル)	996,127,336円
日本債券インデックス・ファンド(年金)〈適格機関投資家限定〉	3,585,937,873円
バラン・オープンVA30A〈適格機関投資家限定〉	30,692,410円
バラン・オープンVA30B〈適格機関投資家限定〉	994,548,711円
バラン・オープンVA40A〈適格機関投資家限定〉	702,375円
バラン・オープンVA40B〈適格機関投資家限定〉	24,286,615円
バラン・オープンVA50A〈適格機関投資家限定〉	36,834,602円
バラン・オープンVA50B〈適格機関投資家限定〉	17,412,161,817円
バラン・オープンVA50C〈適格機関投資家限定〉	23,606,312円
バラン・オープンVA25A〈適格機関投資家限定〉	8,059,929,822円
バラン・オープンVA37.5A〈適格機関投資家限定〉	2,815,090,612円
バラン・オープンVA75A〈適格機関投資家限定〉	21,580,302円
4資産バラン・オープン20VA〈適格機関投資家限定〉	764,233,228円
4資産バラン・オープン40VA〈適格機関投資家限定〉	3,534,211,187円
4資産バラン・オープン30VA〈適格機関投資家限定〉	1,543,469,668円
バラン・オープンVA35A〈適格機関投資家限定〉	8,872,794,412円
バラン・オープンVA40C〈適格機関投資家限定〉	426,469,737円
世界4資産バラン・オープンVA4.5〈適格機関投資家限定〉	2,994,658,480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〉	198,822,863円
グローバル4資産30VA〈適格機関投資家限定〉	75,369,534円
グローバル4資産45VA〈適格機関投資家限定〉	43,638,123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〉	4,992,529,362円
4資産バラン・オープンVA2〈適格機関投資家限定〉	63,887,864円
バラン・オープンVA25B〈適格機関投資家限定〉	4,462,589,214円
バラン・オープンVA20A〈適格機関投資家限定〉	38,652,737円
バラン・オープンVA35B〈適格機関投資家限定〉	14,497,941円
バラン・オープンVA10A〈適格機関投資家限定〉	1,516,511,445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〉	11,413,692,724円
日本債券インデックス・ファンド〈適格機関投資家限定〉	2,179,021,109円
4資産インデックスバラン・オープンVA20〈適格機関投資家限定〉	3,375,206,415円
世界分散ファンドVA25A〈適格機関投資家限定〉	12,856,614,995円
4資産インデックスバラン・オープンVA50〈適格機関投資家限定〉	16,277,413円
Taスリム(シベット型)分散型ファンド(ステイブル)年金〈適格機関投資家限定〉	706,511,655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〉	455,591,289円
Taスリム(シベット型)分散型ファンド(ステイブル)〈適格機関投資家限定〉	207,675,292円
スタート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,096,974,013円
グローバルバラン・オープン40VA〈適格機関投資家限定〉	179,886,878円
グローバルバラン・オープン40VA2〈適格機関投資家限定〉	2,684,143,434円
グローバルバラン・オープン40VA3〈適格機関投資家限定〉	146,428,074円
グローバルバラン・オープン50VA〈適格機関投資家限定〉	48,933,976円
ワールドバラン・オープンVA0809〈適格機関投資家限定〉	232,599,022円
ワールドバラン・オープンVA0902〈適格機関投資家限定〉	99,892,305円
世界株式VCファンド〈適格機関投資家限定〉	457,443,136円

◎損益の状況

当期(自'17年3月7日 至'18年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	1,456,101,949
受 取 利 息	1,456,726,614
支 払 利 息	△ 624,665
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 365,303,757
売 買 損 益	518,514,998
売 買 損 益	△ 883,818,755
(C) そ の 他 費 用	△ 14,951
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	1,090,783,241
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	26,708,771,775
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,848,401,556
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 5,833,680,408
(H) 計 (D+E+F+G)	26,814,276,164
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	26,814,276,164

- (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。