

○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	<ul style="list-style-type: none"> 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	ベビーファンド	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	ベビーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 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	<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。
分配方針	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>	

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3期運用報告書(全体版) (決算日2019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、2019年3月5日に第3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
3期('19年 3月 5日)	9,871	0	0.8	9,935	1.0	99.5	-	1,972

(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	%		%	%	%
'18年 3月 5日	9,789	-	9,840	-	99.0	-
3月末	9,794	0.1	9,844	0.0	99.6	-
4月末	9,786	△ 0.0	9,837	△ 0.0	99.6	-
5月末	9,807	0.2	9,860	0.2	99.4	-
6月末	9,811	0.2	9,864	0.2	99.5	-
7月末	9,792	0.0	9,846	0.1	99.5	-
8月末	9,738	△ 0.5	9,792	△ 0.5	99.6	-
9月末	9,713	△ 0.8	9,769	△ 0.7	99.6	-
10月末	9,728	△ 0.6	9,786	△ 0.6	99.2	-
11月末	9,768	△ 0.2	9,827	△ 0.1	99.7	-
12月末	9,838	0.5	9,902	0.6	98.1	-
'19年 1月末	9,877	0.9	9,939	1.0	99.5	-
2月末	9,897	1.1	9,961	1.2	99.6	-
(期末)						
'19年 3月 5日	9,871	0.8	9,935	1.0	99.5	-

(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。

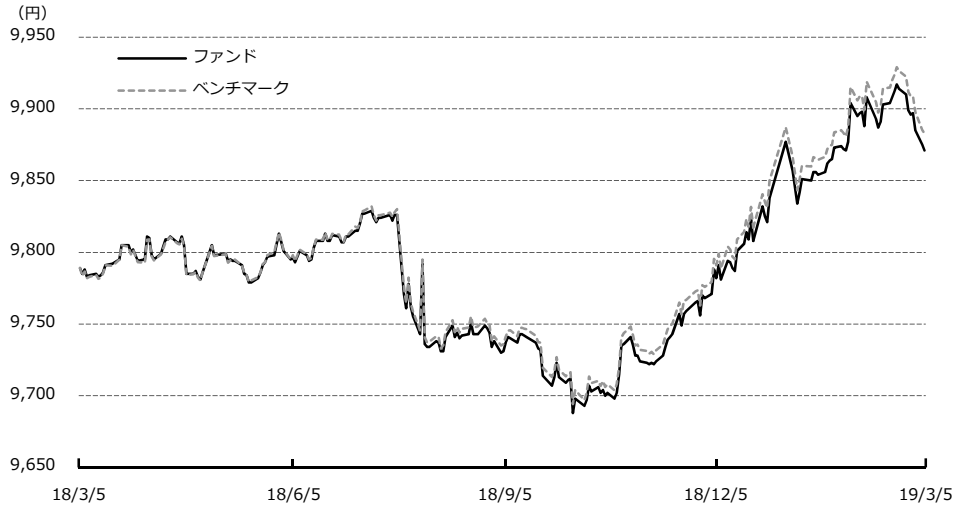
(注3) 先物比率 = 買建比率 - 売建比率

(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

(2018年3月6日から2019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3期	9,789円	9,871円	0円	+0.8%	+1.0%

当期末の基準価額は9,871円となり、前期末の9,789円に比べて82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】

– 2018年後半、世界的に株式市場が大幅に調整したことで投資家のリスク許容度が悪化し、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。

【マイナスの要因】

– 2018年7月、日銀の金融政策の正常化へ向けた動向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+0.8%となり、ベンチマークの騰落率(+1.0%)を0.1%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。

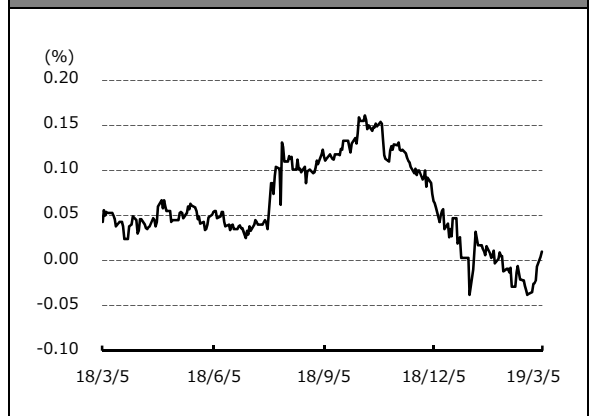
投資環境

(2018年3月6日から2019年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期前半、日本10年国債利回りが0.05%近辺で推移する安定的な展開が続きましたが、7月に日銀が長短金利操作(イールドカーブ・コントロール政策)について長短金利目標の柔軟化を検討するとの報道を受けて債券が売られました。その後、7月末の金融政策決定会合において日銀が金融緩和の持続性強化策の一環として長期金利の変動幅拡大を容認したことも債券の売り材料となりました。8月に入ると4-6月期実質GDP(速報値)が事前予想を上回って増加するなど経済指標が堅調であったことが債券の売り材料となりました。さらに、8月末に日銀が発表した9月の国債買い入れオペの実施回数について、前月よりも減らす方針を公表したことから債券が売られました。期後半は2018年末にかけて世界的に株式市場が大幅に調整し投資家のリスク許容度が悪化したことに加え、7-9月期の実質GDP(速報値)が2四半期ぶりのマイナス成長となるなど軟調な経済指標が発表されたことから安全資産として日本国債が買われました。2019年に入ると1月上旬に商いが薄い中で海外債券市場の影響を受けて債券の値動きが大きくなり、日本10年国債利回りが一時マイナスとなりました。2月には10-12月期実質GDP(速報値)が事前予想を下回るなど経済指標が軟調である中、黒田日銀総裁が衆院の財務金融委員会で追加緩和に関する発言をしたことが債券の買い材料となりました。結果として日本10年国債利回りは前期末から0.03%低下の0.01%となりました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2018年3月6日から2019年3月5日まで)

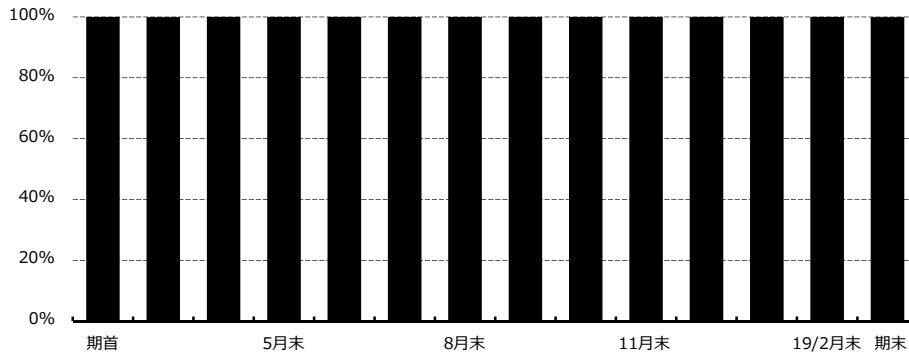
当ファンドは「日本債券インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ちます。

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 (2018年3月6日~2019年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	9,795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)	(10)	(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)	(0.011)	・ 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	0.151%	

(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('18年3月6日から'19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	735,885	934,113	295,121	375,818

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('18年3月6日から'19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136回 利付国債(5年)	3,627,491	第386回 利付国債(2年)	2,106,922
第135回 利付国債(5年)	3,334,579	第136回 利付国債(5年)	1,916,545
第392回 利付国債(2年)	3,313,266	第385回 利付国債(2年)	1,605,882
第350回 利付国債(10年)	3,017,200	第350回 利付国債(10年)	1,592,339
第386回 利付国債(2年)	2,110,231	第135回 利付国債(5年)	1,413,082
第353回 利付国債(10年)	2,023,817	第304回 利付国債(10年)	1,118,317
第388回 利付国債(2年)	1,807,974	第305回 利付国債(10年)	1,016,031
第351回 利付国債(10年)	1,700,241	第134回 利付国債(5年)	1,009,742
第132回 利付国債(5年)	1,613,888	第132回 利付国債(5年)	1,009,232
第131回 利付国債(5年)	1,613,392	第58回 利付国債(30年)	957,670

(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('18年3月6日から'19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('19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 1,096,974	千口 1,537,738	千円 1,970,919

(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120,372,703千口です。

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('19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 1,970,919	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	13,269	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	1,984,188	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

(‘19年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	1,984,188,892
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	9,510,948
日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	1,970,919,011
未 収 入 金	3,758,933
(B) 負 債	11,760,265
未 払 解 約 金	10,442,574
未 払 信 託 報 酬	1,223,594
未 払 利 息	24
そ の 他 未 払 費 用	94,073
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	1,972,428,627
元 本	1,998,123,897
次 期 繰 越 損 益 金	△ 25,695,270
(D) 受 益 権 総 口 数	1,998,123,897口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	9,871円

- (注1) 期首元本額 1,422,063,206円
 期中追加設定元本額 1,449,411,227円
 期中一部解約元本額 873,350,536円
 (注2) 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は25,695,270円です。

◎損益の状況

当期(自‘18年3月6日 至‘19年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 4,514
支 払 利 息	△ 4,514
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	19,249,827
売 買 益	24,445,056
売 買 損	△ 5,195,229
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,417,468
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	16,827,845
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,127,077
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 44,650,192
(配 当 等 相 当 額)	(23,410,135)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 68,060,327)
(G) 計 (D+E+F)	△ 25,695,270
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 25,695,270
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 44,650,192
(配 当 等 相 当 額)	(24,591,652)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 69,241,844)
分 配 準 備 積 立 金	21,042,479
繰 越 損 益 金	△ 2,087,557

- (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3期 (2018年3月6日～ 2019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	228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16期 運用報告書 (決算日2019年3月5日)

日本債券インデックス・マザーファンドの第16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	10,000	騰落率			
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
16期('19年 3月 5日)	12,817	1.0	12,826	1.0	99.6	-	154,276

(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
	円	騰落率	10,000	騰落率		
(期首) '18年 3月 5日	12,689	-	12,704	-	99.0	-
3月末	12,697	0.1	12,710	0.0	99.7	-
4月末	12,688	△0.0	12,701	△0.0	99.6	-
5月末	12,717	0.2	12,729	0.2	99.4	-
6月末	12,723	0.3	12,735	0.2	99.5	-
7月末	12,701	0.1	12,712	0.1	99.5	-
8月末	12,632	△0.4	12,643	△0.5	99.6	-
9月末	12,602	△0.7	12,612	△0.7	99.6	-
10月末	12,624	△0.5	12,634	△0.6	99.2	-
11月末	12,677	△0.1	12,687	△0.1	99.7	-
12月末	12,769	0.6	12,784	0.6	98.1	-
'19年 1月末	12,823	1.1	12,832	1.0	99.5	-
2月末	12,850	1.3	12,860	1.2	99.6	-
(期末) '19年 3月 5日	12,817	1.0	12,826	1.0	99.6	-

(注1) 騰落率は期首比です。

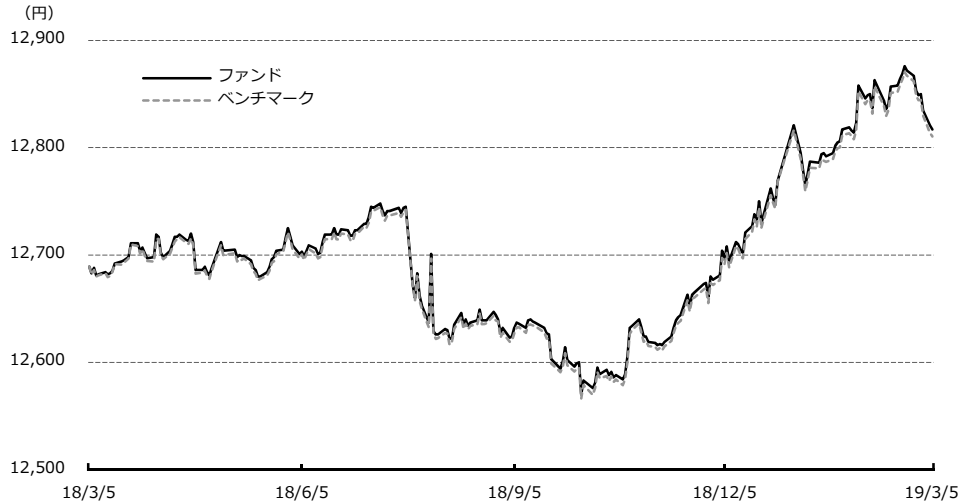
(注2) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合指数で、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

当期の運用実績

(2018年3月6日から2019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12,817円となり、前期末の12,689円に比べて128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】

– 2018年後半、世界的に株式市場が大幅に調整したことで投資家のリスク許容度が悪化し、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。

【マイナスの要因】

– 2018年7月、日銀の金融政策の正常化へ向けた動向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+1.0%と、ベンチマークの騰落率(+1.0%)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。

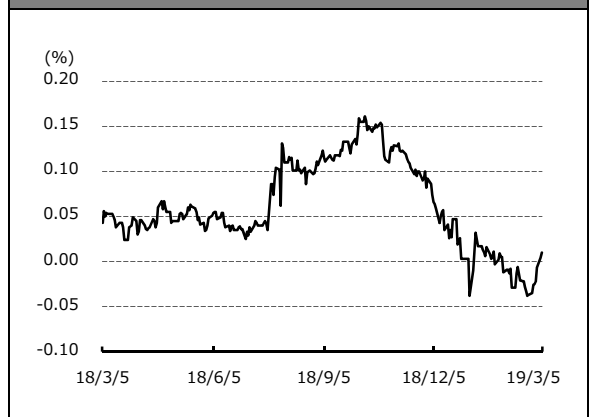
投資環境

(2018年3月6日から2019年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期前半、日本10年国債利回りが0.05%近辺で推移する安定的な展開が続きましたが、7月に日銀が長短金利操作(イールドカーブ・コントロール政策)について長短金利目標の柔軟化を検討するとの報道を受けて債券が売られました。その後、7月末の金融政策決定会合において日銀が金融緩和の持続性強化策の一環として長期金利の変動幅拡大を容認したことも債券の売り材料となりました。8月に入ると4-6月期実質GDP(速報値)が事前予想を上回って増加するなど経済指標が堅調であったことが債券の売り材料となりました。さらに、8月末に日銀が発表した9月の国債買い入れオペの実施回数について、前月よりも減らす方針を公表したことから債券が売られました。期後半は2018年末にかけて世界的に株式市場が大幅に調整し投資家のリスク許容度が悪化したことに加え、7-9月期の実質GDP(速報値)が2四半期ぶりのマイナス成長となるなど軟調な経済指標が発表されたことから安全資産として日本国債が買われました。2019年に入ると1月上旬に商いが薄い中で海外債券市場の影響を受けて債券の値動きが大きくなり、日本10年国債利回りが一時マイナスとなりました。2月には10-12月期実質GDP(速報値)が事前予想を下回るなど経済指標が軟調である中、黒田日銀総裁が衆院の財務金融委員会で追加緩和に関する発言をしたことが債券の買い材料となりました。結果として日本10年国債利回りは前期末から0.03%低下の0.01%となりました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2018年3月6日から2019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、期初時点で508銘柄でしたが、当期を通じて銘柄分散を図り、期末時点では532銘柄へと増加しました。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 (2018年3月6日~2019年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	12,708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('18年3月6日から'19年3月5日まで)

◎公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 55,660,313	千円 31,804,513 (100,000)
	地 方 債 証 券	2,638,554	203,572 (488,250)
	特 殊 債 券	3,706,937	224,336 (1,010,129)
	社 債 券	1,696,232	- (1,550,000)

(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('18年3月6日から'19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136回 利付国債(5年)	3,627,491	第386回 利付国債(2年)	2,106,922
第135回 利付国債(5年)	3,334,579	第136回 利付国債(5年)	1,916,545
第392回 利付国債(2年)	3,313,266	第385回 利付国債(2年)	1,605,882
第350回 利付国債(10年)	3,017,200	第350回 利付国債(10年)	1,592,339
第386回 利付国債(2年)	2,110,231	第135回 利付国債(5年)	1,413,082
第353回 利付国債(10年)	2,023,817	第304回 利付国債(10年)	1,118,317
第388回 利付国債(2年)	1,807,974	第305回 利付国債(10年)	1,016,031
第351回 利付国債(10年)	1,700,241	第134回 利付国債(5年)	1,009,742
第132回 利付国債(5年)	1,613,888	第132回 利付国債(5年)	1,009,232
第131回 利付国債(5年)	1,613,392	第 58 回 利付国債(30年)	957,670

(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('18年3月6日から'19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('19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	114,650,000	125,121,114	81.1	-	54.3	20.1	6.7
地 方 債 証 券	9,160,500 (9,060,500)	9,677,854 (9,565,912)	6.3 (6.2)	- (-)	3.8 (3.7)	1.7 (1.7)	0.7 (0.7)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	11,809,947 (11,379,947)	12,718,411 (12,256,067)	8.2 (7.9)	- (-)	5.9 (5.8)	1.5 (1.4)	0.9 (0.7)
金 融 債 券	900,000 (900,000)	901,573 (901,573)	0.6 (0.6)	- (-)	- (-)	0.3 (0.3)	0.3 (0.3)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	5,010,000 (4,610,000)	5,234,124 (4,810,197)	3.4 (3.1)	- (-)	1.5 (1.4)	0.8 (0.7)	1.0 (1.0)
合 計	141,530,447 (25,950,447)	153,653,077 (27,533,751)	99.6 (17.8)	- (-)	65.6 (11.0)	24.4 (4.1)	9.7 (2.8)

(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388回 利付国債(2年)	0.1	1,000,000	1,003,040	2020/ 5 /15
	第392回 利付国債(2年)	0.1	3,300,000	3,312,309	2020/ 9 / 1
	第394回 利付国債(2年)	0.1	200,000	200,814	2020/11/ 1
	第124回 利付国債(5年)	0.1	500,000	501,615	2020/ 6 /20
	第125回 利付国債(5年)	0.1	500,000	501,890	2020/ 9 /20
	第130回 利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,208,232	2021/12/20
	第131回 利付国債(5年)	0.1	2,100,000	2,116,023	2022/ 3 /20
	第132回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,512,390	2022/ 6 /20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,513,620	2022/ 9 /20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,514,580	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	1,900,000	1,919,684	2023/ 3 /20
	第136回 利付国債(5年)	0.1	1,700,000	1,718,717	2023/ 6 /20
	第137回 利付国債(5年)	0.1	1,550,000	1,567,716	2023/ 9 /20
	第 32 回 利付国債(30年)	2.3	430,000	585,698	2040/ 3 /20
	第116回 利付国債(20年)	2.2	500,000	617,330	2030/ 3 /20
	第128回 利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,005,630	2021/ 6 /20
	第129回 利付国債(5年)	0.1	1,750,000	1,760,937	2021/ 9 /20
	第 1 回 利付国債(40年)	2.4	160,000	234,998	2048/ 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 2 回	利付国債(40年)	2.2	500,000	711,760	2049/ 3 /20
第 3 回	利付国債(40年)	2.2	250,000	358,412	2050/ 3 /20
第 4 回	利付国債(40年)	2.2	250,000	360,882	2051/ 3 /20
第 5 回	利付国債(40年)	2.0	130,000	181,181	2052/ 3 /20
第 6 回	利付国債(40年)	1.9	150,000	205,698	2053/ 3 /20
第 7 回	利付国債(40年)	1.7	160,000	210,345	2054/ 3 /20
第 8 回	利付国債(40年)	1.4	50,000	61,217	2055/ 3 /20
第 9 回	利付国債(40年)	0.4	1,740,000	1,565,739	2056/ 3 /20
第 10 回	利付国債(40年)	0.9	100,000	106,007	2057/ 3 /20
第 11 回	利付国債(40年)	0.8	180,000	184,386	2058/ 3 /20
第308回	利付国債(10年)	1.3	700,000	713,118	2020/ 6 /20
第309回	利付国債(10年)	1.1	800,000	812,928	2020/ 6 /20
第310回	利付国債(10年)	1.0	900,000	915,930	2020/ 9 /20
第311回	利付国債(10年)	0.8	600,000	608,760	2020/ 9 /20
第312回	利付国債(10年)	1.2	800,000	819,328	2020/12/20
第313回	利付国債(10年)	1.3	700,000	720,678	2021/ 3 /20
第314回	利付国債(10年)	1.1	900,000	922,905	2021/ 3 /20
第315回	利付国債(10年)	1.2	750,000	773,175	2021/ 6 /20
第316回	利付国債(10年)	1.1	500,000	514,305	2021/ 6 /20
第317回	利付国債(10年)	1.1	600,000	619,062	2021/ 9 /20
第318回	利付国債(10年)	1.0	250,000	257,302	2021/ 9 /20
第319回	利付国債(10年)	1.1	300,000	310,467	2021/12/20
第320回	利付国債(10年)	1.0	700,000	722,463	2021/12/20
第321回	利付国債(10年)	1.0	300,000	310,482	2022/ 3 /20
第322回	利付国債(10年)	0.9	700,000	722,323	2022/ 3 /20
第323回	利付国債(10年)	0.9	200,000	206,908	2022/ 6 /20
第324回	利付国債(10年)	0.8	400,000	412,496	2022/ 6 /20
第325回	利付国債(10年)	0.8	500,000	516,915	2022/ 9 /20
第326回	利付国債(10年)	0.7	300,000	309,723	2022/12/20
第327回	利付国債(10年)	0.8	700,000	725,354	2022/12/20
第328回	利付国債(10年)	0.6	500,000	515,235	2023/ 3 /20
第329回	利付国債(10年)	0.8	500,000	520,510	2023/ 6 /20
第330回	利付国債(10年)	0.8	800,000	834,568	2023/ 9 /20
第331回	利付国債(10年)	0.6	500,000	517,030	2023/ 9 /20
第332回	利付国債(10年)	0.6	600,000	621,564	2023/12/20
第333回	利付国債(10年)	0.6	900,000	934,029	2024/ 3 /20
第334回	利付国債(10年)	0.6	700,000	727,797	2024/ 6 /20
第335回	利付国債(10年)	0.5	800,000	828,824	2024/ 9 /20
第336回	利付国債(10年)	0.5	1,000,000	1,037,670	2024/12/20
第337回	利付国債(10年)	0.3	700,000	718,193	2024/12/20
第338回	利付国債(10年)	0.4	650,000	671,573	2025/ 3 /20
第339回	利付国債(10年)	0.4	1,200,000	1,241,508	2025/ 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	
第340回	利付国債(10年)	0.4	1,380,000	1,429,197	2025/ 9 /20
第341回	利付国債(10年)	0.3	1,200,000	1,236,204	2025/12/20
第342回	利付国債(10年)	0.1	1,100,000	1,118,766	2026/ 3 /20
第343回	利付国債(10年)	0.1	1,500,000	1,525,950	2026/ 6 /20
第344回	利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,220,556	2026/ 9 /20
第345回	利付国債(10年)	0.1	1,040,000	1,057,576	2026/12/20
第346回	利付国債(10年)	0.1	900,000	914,949	2027/ 3 /20
第347回	利付国債(10年)	0.1	750,000	762,217	2027/ 6 /20
第348回	利付国債(10年)	0.1	1,100,000	1,117,028	2027/ 9 /20
第349回	利付国債(10年)	0.1	960,000	973,996	2027/12/20
第350回	利付国債(10年)	0.1	1,410,000	1,429,190	2028/ 3 /20
第351回	利付国債(10年)	0.1	900,000	910,899	2028/ 6 /20
第352回	利付国債(10年)	0.1	1,260,000	1,273,834	2028/ 9 /20
第353回	利付国債(10年)	0.1	2,000,000	2,019,580	2028/12/20
第 1 回	利付国債(30年)	2.8	300,000	386,316	2029/ 9 /20
第 2 回	利付国債(30年)	2.4	380,000	477,093	2030/ 2 /20
第 3 回	利付国債(30年)	2.3	300,000	374,589	2030/ 5 /20
第 5 回	利付国債(30年)	2.2	100,000	125,246	2031/ 5 /20
第 6 回	利付国債(30年)	2.4	180,000	231,231	2031/11/20
第 7 回	利付国債(30年)	2.3	300,000	383,520	2032/ 5 /20
第 8 回	利付国債(30年)	1.8	300,000	365,292	2032/11/22
第 9 回	利付国債(30年)	1.4	100,000	116,418	2032/12/20
第 12 回	利付国債(30年)	2.1	300,000	380,280	2033/ 9 /20
第 13 回	利付国債(30年)	2.0	300,000	376,767	2033/12/20
第 14 回	利付国債(30年)	2.4	300,000	395,199	2034/ 3 /20
第 15 回	利付国債(30年)	2.5	200,000	267,060	2034/ 6 /20
第 16 回	利付国債(30年)	2.5	200,000	267,724	2034/ 9 /20
第 17 回	利付国債(30年)	2.4	200,000	265,124	2034/12/20
第 18 回	利付国債(30年)	2.3	300,000	393,921	2035/ 3 /20
第 19 回	利付国債(30年)	2.3	200,000	263,352	2035/ 6 /20
第 20 回	利付国債(30年)	2.5	100,000	135,098	2035/ 9 /20
第 21 回	利付国債(30年)	2.3	200,000	264,368	2035/12/20
第 22 回	利付国債(30年)	2.5	200,000	271,542	2036/ 3 /20
第 23 回	利付国債(30年)	2.5	100,000	136,051	2036/ 6 /20
第 24 回	利付国債(30年)	2.5	320,000	436,233	2036/ 9 /20
第 25 回	利付国債(30年)	2.3	100,000	133,217	2036/12/20
第 26 回	利付国債(30年)	2.4	150,000	202,689	2037/ 3 /20
第 27 回	利付国債(30年)	2.5	320,000	439,795	2037/ 9 /20
第 28 回	利付国債(30年)	2.5	300,000	414,015	2038/ 3 /20
第 29 回	利付国債(30年)	2.4	200,000	273,244	2038/ 9 /20
第 30 回	利付国債(30年)	2.3	350,000	473,364	2039/ 3 /20
第 31 回	利付国債(30年)	2.2	400,000	535,148	2039/ 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 33 回	利付国債(30年)	2.0	500,000	652,840	2040/ 9 /20
第 34 回	利付国債(30年)	2.2	550,000	742,978	2041/ 3 /20
第 35 回	利付国債(30年)	2.0	450,000	590,935	2041/ 9 /20
第 36 回	利付国債(30年)	2.0	420,000	553,001	2042/ 3 /20
第 37 回	利付国債(30年)	1.9	430,000	558,561	2042/ 9 /20
第 38 回	利付国債(30年)	1.8	500,000	640,170	2043/ 3 /20
第 39 回	利付国債(30年)	1.9	330,000	430,531	2043/ 6 /20
第 40 回	利付国債(30年)	1.8	280,000	359,567	2043/ 9 /20
第 41 回	利付国債(30年)	1.7	350,000	442,151	2043/12/20
第 42 回	利付国債(30年)	1.7	410,000	518,326	2044/ 3 /20
第 43 回	利付国債(30年)	1.7	650,000	822,347	2044/ 6 /20
第 44 回	利付国債(30年)	1.7	300,000	380,247	2044/ 9 /20
第 45 回	利付国債(30年)	1.5	240,000	293,152	2044/12/20
第 46 回	利付国債(30年)	1.5	400,000	488,776	2045/ 3 /20
第 47 回	利付国債(30年)	1.6	380,000	473,822	2045/ 6 /20
第 48 回	利付国債(30年)	1.4	200,000	239,928	2045/ 9 /20
第 49 回	利付国債(30年)	1.4	250,000	299,970	2045/12/20
第 50 回	利付国債(30年)	0.8	350,000	367,997	2046/ 3 /20
第 51 回	利付国債(30年)	0.3	450,000	416,385	2046/ 6 /20
第 52 回	利付国債(30年)	0.5	400,000	389,624	2046/ 9 /20
第 53 回	利付国債(30年)	0.6	400,000	399,048	2046/12/20
第 54 回	利付国債(30年)	0.8	410,000	429,680	2047/ 3 /20
第 55 回	利付国債(30年)	0.8	390,000	408,369	2047/ 6 /20
第 56 回	利付国債(30年)	0.8	220,000	230,159	2047/ 9 /20
第 57 回	利付国債(30年)	0.8	240,000	250,860	2047/12/20
第 58 回	利付国債(30年)	0.8	500,000	522,145	2048/ 3 /20
第 59 回	利付国債(30年)	0.7	550,000	559,515	2048/ 6 /20
第 60 回	利付国債(30年)	0.9	560,000	599,149	2048/ 9 /20
第 61 回	利付国債(30年)	0.7	120,000	121,801	2048/12/20
第 47 回	利付国債(20年)	2.2	600,000	621,786	2020/ 9 /21
第 48 回	利付国債(20年)	2.5	300,000	314,274	2020/12/21
第 49 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	104,602	2021/ 3 /22
第 50 回	利付国債(20年)	1.9	50,000	52,096	2021/ 3 /22
第 51 回	利付国債(20年)	2.0	350,000	367,272	2021/ 6 /21
第 52 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	105,735	2021/ 9 /21
第 55 回	利付国債(20年)	2.0	500,000	532,760	2022/ 3 /21
第 57 回	利付国債(20年)	1.9	800,000	854,088	2022/ 6 /20
第 60 回	利付国債(20年)	1.4	700,000	741,370	2022/12/20
第 61 回	利付国債(20年)	1.0	350,000	366,352	2023/ 3 /20
第 63 回	利付国債(20年)	1.8	500,000	541,985	2023/ 6 /20
第 65 回	利付国債(20年)	1.9	400,000	439,364	2023/12/20
第 68 回	利付国債(20年)	2.2	500,000	559,365	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	334,098	2024/ 3 /20
第 70 回	利付国債(20年)	2.4	600,000	681,222	2024/ 6 /20
第 72 回	利付国債(20年)	2.1	600,000	675,072	2024/ 9 /20
第 74 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	339,237	2024/12/20
第 76 回	利付国債(20年)	1.9	200,000	224,846	2025/ 3 /20
第 77 回	利付国債(20年)	2.0	300,000	339,096	2025/ 3 /20
第 78 回	利付国債(20年)	1.9	250,000	282,365	2025/ 6 /20
第 80 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	114,215	2025/ 6 /20
第 81 回	利付国債(20年)	2.0	200,000	228,184	2025/ 9 /20
第 83 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	345,840	2025/12/20
第 85 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	231,680	2026/ 3 /20
第 88 回	利付国債(20年)	2.3	400,000	471,364	2026/ 6 /20
第 89 回	利付国債(20年)	2.2	400,000	468,424	2026/ 6 /20
第 90 回	利付国債(20年)	2.2	300,000	352,839	2026/ 9 /20
第 91 回	利付国債(20年)	2.3	300,000	355,122	2026/ 9 /20
第 92 回	利付国債(20年)	2.1	340,000	398,894	2026/12/20
第 93 回	利付国債(20年)	2.0	300,000	350,907	2027/ 3 /20
第 94 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	353,337	2027/ 3 /20
第 95 回	利付国債(20年)	2.3	150,000	179,868	2027/ 6 /20
第 96 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	118,243	2027/ 6 /20
第 97 回	利付国債(20年)	2.2	150,000	179,338	2027/ 9 /20
第 98 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	118,699	2027/ 9 /20
第 99 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	238,180	2027/12/20
第100回	利付国債(20年)	2.2	200,000	240,746	2028/ 3 /20
第101回	利付国債(20年)	2.4	100,000	122,189	2028/ 3 /20
第102回	利付国債(20年)	2.4	200,000	245,276	2028/ 6 /20
第103回	利付国債(20年)	2.3	200,000	243,414	2028/ 6 /20
第104回	利付国債(20年)	2.1	150,000	179,764	2028/ 6 /20
第105回	利付国債(20年)	2.1	100,000	120,211	2028/ 9 /20
第106回	利付国債(20年)	2.2	200,000	242,332	2028/ 9 /20
第107回	利付国債(20年)	2.1	200,000	241,124	2028/12/20
第108回	利付国債(20年)	1.9	100,000	118,604	2028/12/20
第109回	利付国債(20年)	1.9	200,000	237,786	2029/ 3 /20
第110回	利付国債(20年)	2.1	200,000	241,796	2029/ 3 /20
第111回	利付国債(20年)	2.2	200,000	244,648	2029/ 6 /20
第112回	利付国債(20年)	2.1	200,000	242,594	2029/ 6 /20
第113回	利付国債(20年)	2.1	200,000	243,380	2029/ 9 /20
第114回	利付国債(20年)	2.1	300,000	366,207	2029/12/20
第115回	利付国債(20年)	2.2	600,000	738,858	2029/12/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	300,000	364,857	2030/ 6 /20
第122回	利付国債(20年)	1.8	500,000	598,355	2030/ 9 /20
第123回	利付国債(20年)	2.1	640,000	790,092	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	600,000	735,600	2031/ 3 /20
	第127回 利付国債(20年)	1.9	400,000	485,644	2031/ 3 /20
	第128回 利付国債(20年)	1.9	600,000	729,792	2031/ 6 /20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	400,000	482,736	2031/ 9 /20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	400,000	478,716	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	300,000	362,808	2031/12/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	300,000	359,694	2032/ 3 /20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	200,000	237,236	2032/ 3 /20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	100,000	120,119	2032/ 6 /20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	200,000	237,634	2032/ 6 /20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	200,000	240,666	2032/ 9 /20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	200,000	241,072	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	300,000	365,649	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	300,000	357,837	2033/ 3 /20
	第144回 利付国債(20年)	1.5	200,000	235,824	2033/ 3 /20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	350,000	422,936	2033/ 6 /20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	320,000	387,283	2033/ 9 /20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	860,000	1,030,013	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	500,000	592,300	2034/ 3 /20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	680,000	806,364	2034/ 6 /20
	第150回 利付国債(20年)	1.4	670,000	784,683	2034/ 9 /20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	600,000	684,510	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	650,000	741,786	2035/ 3 /20
	第153回 利付国債(20年)	1.3	850,000	984,308	2035/ 6 /20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	640,000	730,777	2035/ 9 /20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	500,000	555,065	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	550,000	555,758	2036/ 3 /20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	400,000	389,896	2036/ 6 /20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	500,000	511,970	2036/ 9 /20
	第159回 利付国債(20年)	0.6	400,000	415,704	2036/12/20
	第160回 利付国債(20年)	0.7	350,000	369,530	2037/ 3 /20
	第161回 利付国債(20年)	0.6	350,000	362,855	2037/ 6 /20
	第162回 利付国債(20年)	0.6	100,000	103,541	2037/ 9 /20
	第163回 利付国債(20年)	0.6	500,000	517,025	2037/12/20
	第164回 利付国債(20年)	0.5	1,020,000	1,034,382	2038/ 3 /20
	第165回 利付国債(20年)	0.5	750,000	759,345	2038/ 6 /20
	第166回 利付国債(20年)	0.7	410,000	429,569	2038/ 9 /20
	第167回 利付国債(20年)	0.5	690,000	696,265	2038/12/20
	小 計		114,650,000	125,121,114	
地 方 債 証 券	第739回 東京都公募公債	0.29	100,000	101,533	2024/12/20
	第746回 東京都公募公債	0.499	100,000	103,010	2025/ 6 /20
	第751回 東京都公募公債	0.37	100,000	102,373	2025/12/19

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	第759回 東京都公募公債	0.075	200,000	200,678	2026/ 9 /18
	第762回 東京都公募公債	0.175	100,000	101,048	2026/12/18
	第765回 東京都公募公債	0.21	100,000	101,281	2027/ 3 /19
	第770回 東京都公募公債	0.18	100,000	100,989	2027/ 6 /18
	第 6 回 東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	111,942	2025/ 3 /19
	第 7 回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	113,983	2025/ 9 /19
	第 12 回 東京都公募公債(20年)	2.31	100,000	119,013	2027/ 9 /17
	第 13 回 東京都公募公債(20年)	2.15	100,000	118,029	2027/12/20
	第 26 回 東京都公募公債(20年)	1.74	100,000	118,474	2032/ 6 /18
	平成21年度第 6 回 北海道公募公債	1.6	60,000	60,452	2019/ 8 /28
	平成24年度第 4 回 北海道公募公債	0.9	100,000	102,868	2022/ 6 /29
	平成24年度第 9 回 北海道公募公債	0.79	7,400	7,605	2022/10/31
	平成27年度第 9 回 北海道公募公債	0.486	100,000	102,960	2025/10/30
	平成27年度第13回 北海道公募公債	0.469	100,000	102,912	2025/12/25
	第 30 回 2号宮城県公募公債(10年)	0.53	100,000	102,850	2024/10/29
	第188回 神奈川県公募公債	1.05	100,000	103,107	2022/ 3 /18
	第 3 回 神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	135,863	2037/ 3 /19
	第 36 回 神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	101,446	2037/12/18
	第324回 大阪府公募公債(10年)	1.64	8,000	8,008	2019/ 3 /29
	第325回 大阪府公募公債(10年)	1.66	6,000	6,013	2019/ 4 /26
	第326回 大阪府公募公債(10年)	1.66	56,000	56,208	2019/ 5 /28
	第346回 大阪府公募公債(10年)	1.25	100,000	102,315	2021/ 1 /28
	第368回 大阪府公募公債(10年)	0.83	100,000	103,121	2023/ 1 /30
	第374回 大阪府公募公債(10年)	0.938	134,000	139,330	2023/ 7 /28
	第387回 大阪府公募公債(10年)	0.521	44,040	45,211	2024/ 8 /28
	平成22年度第 3 回 京都府公募公債(20年)	2.0	100,000	119,989	2030/11/22
	平成24年度第 5 回 京都府公募公債	0.82	30,000	30,851	2022/ 9 /20
	平成24年度第 8 回 京都府公募公債	0.73	30,000	30,807	2022/12/19
	平成29年度第22回 兵庫県公募公債	0.19	100,000	100,675	2028/ 1 /21
	第 2 回 兵庫県公募公債(30年)	2.36	100,000	132,877	2040/ 3 /19
	第 3 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	110,279	2027/ 7 /16
	第 4 回 兵庫県公募公債(12年)	0.73	100,000	104,973	2026/ 8 / 6
	平成21年度第 2 回 静岡県公募公債	1.65	100,000	100,498	2019/ 6 /25
	平成26年度第 9 回 静岡県公募公債	0.554	20,000	20,595	2024/10/24
	第 3 回 静岡県公募公債(20年)	2.35	100,000	117,368	2026/ 9 /18
	第 10 回 静岡県公募公債(20年)	2.072	100,000	120,379	2030/ 6 /14
	平成24年度第 8 回 愛知県公募公債(10年)	0.835	100,000	102,836	2022/ 8 /29
	平成24年度第12回 愛知県公募公債(30年)	2.12	10,000	13,026	2042/ 9 /19
	平成24年度第14回 愛知県公募公債(15年)	1.314	100,000	110,610	2027/12/13
	平成25年度第 6 回 愛知県公募公債(10年)	0.877	100,000	103,691	2023/ 6 /27
	平成29年度第 6 回 愛知県公募公債(10年)	0.22	100,000	101,167	2027/ 7 /28
	平成29年度第 8 回 愛知県公募公債(10年)	0.2	100,000	100,969	2027/ 8 /31

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30年度第 6 回 愛知県公募公債(30年)	0.777	100,000	101,002	2048/ 6 /19
	平成21年度第 2 回 広島県公募公債	1.46	16,160	16,249	2019/ 7 /24
	平成28年度第 1 回 広島県公募公債	0.08	100,000	100,365	2026/ 5 /25
	平成29年度第 5 回 広島県公募公債	0.245	100,000	101,340	2028/ 1 /25
	平成26年度第 1 回 広島県公募公債(20年)	1.41	100,000	114,582	2034/ 9 /12
	平成21年度第 1 回 埼玉県公募公債	1.53	20,000	20,040	2019/ 4 /23
	平成21年度第 3 回 埼玉県公募公債	1.64	20,000	20,099	2019/ 6 /25
	平成24年度第 1 回 埼玉県公募公債	1.05	100,000	103,217	2022/ 4 /26
	平成25年度第 1 回 埼玉県公募公債	0.586	100,000	102,330	2023/ 4 /18
	平成26年度第 5 回 埼玉県公募公債	0.611	100,000	103,160	2024/ 7 /29
	平成29年度第 4 回 埼玉県公募公債	0.19	100,000	100,990	2027/ 6 /22
	平成23年度第 3 回 福岡県公募公債	1.07	100,000	102,587	2021/ 8 /26
	平成24年度第11回 福岡県公募公債	0.8	100,000	103,104	2023/ 2 /27
	平成28年度第 6 回 福岡県公募公債	0.175	100,000	100,971	2026/12/22
	平成30年度第 2 回 福岡県公募公債(15年)	0.542	100,000	102,945	2033/10/17
	平成21年度第 1 回 千葉県公募公債	1.53	40,000	40,084	2019/ 4 /25
	平成21年度第 2 回 千葉県公募公債	1.57	40,000	40,135	2019/ 5 /24
	平成21年度第 8 回 千葉県公募公債	1.53	100,000	101,095	2019/11/25
	第 10 回 千葉県公募公債(20年)	1.8	100,000	118,362	2031/ 8 /18
	第 24 回 千葉県公募公債	0.559	100,000	100,950	2038/ 4 /15
	平成21年度第 2 回 新潟県公募公債	1.55	10,000	10,111	2019/11/27
	平成24年度第 2 回 新潟県公募公債	0.79	100,000	103,064	2023/ 2 /27
	第 83 回 共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	101,388	2020/ 2 /25
	第 84 回 共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	101,433	2020/ 3 /25
	第 85 回 共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	101,614	2020/ 4 /24
	第 90 回 共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	101,714	2020/ 9 /25
	第 96 回 共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	102,598	2021/ 3 /25
	第100回 共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	102,823	2021/ 7 /23
	第101回 共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	102,534	2021/ 8 /25
	第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	102,856	2022/ 6 /24
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,840	2022/10/25
	第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	103,098	2023/ 2 /24
	第129回 共同発行市場公募地方債	0.71	100,000	103,290	2023/12/25
	第130回 共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	103,592	2024/ 1 /25
	第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	103,154	2024/ 7 /25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	102,954	2024/ 8 /23
	第147回 共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	103,325	2025/ 6 /25
	第157回 共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,358	2026/ 4 /24
	平成21年度第 2 回 熊本県公募公債(10年)	1.35	10,000	10,086	2019/10/30
	平成22年度第 1 回 静岡市公募公債	1.008	12,000	12,204	2020/11/25
	第 5 回 大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	121,947	2028/ 9 /21
	第468回 名古屋市公募公債(10年)	1.39	100,000	100,744	2019/ 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480回 名古屋市公募公債(10年)	0.825	100,000	102,855	2022/ 9 /20
	第 6 回 京都市公募公債(20年)	2.38	100,000	119,505	2027/ 9 /17
	第 4 回 横浜市公募公債(30年)	2.54	100,000	134,217	2036/12/19
	第 14 回 横浜市公募公債(20年)	2.32	100,000	119,818	2028/ 3 /17
	平成24年度第10回 札幌市公募公債(10年)	0.8	100,000	102,957	2022/12/20
	平成27年度第 4 回 札幌市公募公債(10年)	0.51	100,000	103,079	2025/ 6 /20
	平成29年度第 3 回 札幌市公募公債(10年)	0.23	100,000	101,318	2027/ 6 /18
	第 82 回 川崎市公募公債	1.52	30,000	30,244	2019/ 9 /20
	第 11 回 川崎市公募公債(30年)	0.817	100,000	102,101	2048/ 3 /19
	平成23年度第 2 回 北九州市公募公債	1.06	11,000	11,318	2021/12/22
	平成24年度第 8 回 福岡市公募公債	0.68	100,000	102,672	2023/ 3 /24
	平成28年度第 5 回 広島市公募公債	0.24	100,000	101,429	2027/ 2 /26
	平成24年度第 1 回 福井県公募公債	0.8	100,000	102,842	2022/10/26
	平成25年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.75	100,000	103,555	2024/ 1 /31
	平成27年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.395	100,000	102,550	2026/ 1 /29
	平成29年度第 1 回 秋田県公募公債	0.2	145,900	147,138	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	102,638	2023/12/20
	第135回 福岡北九州高速道路債券	0.5	100,000	102,063	2025/ 3 /19
	小 計		9,160,500	9,677,854	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第340回 政府保証道路債券	1.7	100,000	102,003	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	103,349	2020/12/27
	第 25 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	102,825	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	102,541	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	76,078	2021/11/15
	第 31 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	14,000	14,443	2021/12/14
	F 116回 地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	111,189	2027/ 4 /23
	第 37 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.895	100,000	103,075	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	103,061	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	103,408	2023/ 2 /17
	第 46 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.668	33,000	33,950	2023/ 3 /17
	第 47 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.541	100,000	102,423	2023/ 4 /21
	第 28 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.396	100,000	113,862	2033/ 4 /28
	F 181回 地方公共団体金融機構債券	1.109	100,000	107,674	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	103,655	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	103,617	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	103,060	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	14,298	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	103,074	2025/ 9 /12
	第 89 回 地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	99,961	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	101,118	2027/ 6 /14
	第 98 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	101,338	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	101,223	2027/ 8 /13

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
第 68 回	地方公共団体金融機構債券(20年)	0.53	100,000	100,172	2038/ 7 /28
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	103,994	2021/ 3 /26
第 8 回	公営企業債券(30年)	2.5	10,000	13,197	2035/ 9 /21
第 13 回	公営企業債券(20年)	2.16	10,000	11,323	2025/ 6 /20
第 22 回	公営企業債券(20年)	2.32	100,000	118,202	2027/ 6 /18
第 10 回	日本政策金融公庫社債	2.167	100,000	120,720	2030/ 3 /19
第 19 回	政府保証日本政策金融公庫債券	1.1	100,000	103,179	2021/12/17
第 6 回	政府保証新関西国際空港債券	0.155	100,000	101,185	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	101,381	2020/ 2 /17
第 11 回	政府保証日本政策投資銀行債券	1.0	100,000	102,632	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	143,612	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	117,821	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	151,035	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	146,364	2047/ 3 /20
第 23 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	220,000	261,635	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	13,741	2037/ 9 /18
第 59 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.35	100,000	101,359	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	103,117	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	102,502	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	105,578	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	108,008	2023/ 1 /31
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	100,220	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	66,241	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	100,484	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	101,223	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	101,396	2020/ 3 /19
第120回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.9	300,000	304,695	2020/10/30
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	116,639	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	102,880	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	102,435	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	1,038	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	103,366	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	103,537	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	2,073	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	103,076	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	13,383	2024/12/27
第266回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	200,000	205,056	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	100,947	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	101,301	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	101,664	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	13,128	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	101,854	2038/ 8 /31

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
第 11 回	公営企業債券(20年)	2.11	100,000	112,396	2025/ 3 /24
第 7 回	阪神高速道路債券	2.18	100,000	112,631	2025/ 3 /21
第 55 回	政府保証関西国際空港債券	1.3	100,000	100,072	2019/ 3 /25
第 18 回	政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	102,890	2023/ 3 /22
第 21 回	政府保証中部国際空港債券	0.45	100,000	102,993	2025/ 3 /17
第 3 回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	200,000	234,174	2027/ 3 /19
第 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	32,950	34,736	2042/ 6 /10
第 30 回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.08	100,000	110,688	2024/ 6 /20
第 30 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	31,541	33,966	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	19,975	20,517	2032/11/10
第 36 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	34,662	36,968	2045/ 5 /10
第 38 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	37,469	39,777	2045/ 7 /10
第 39 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	36,779	38,901	2045/ 8 /10
第 43 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	90,080	96,123	2045/12/10
第 45 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	37,490	40,130	2046/ 2 /10
第 55 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	49,364	52,331	2046/12/10
第 60 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	50,194	53,083	2047/ 5 /10
第108回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.434	100,000	110,739	2027/ 6 /18
第 96 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	77,672	79,818	2050/ 5 /10
第101回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.89	77,919	80,823	2050/10/10
第106回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	84,639	86,010	2051/ 3 /10
第115回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	90,800	91,489	2051/12/10
第203回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.24	100,000	100,915	2027/ 3 /19
第119回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	92,261	93,241	2052/ 4 /10
第215回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.23	100,000	100,710	2027/ 8 /20
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	94,663	95,420	2052/10/10
第132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	96,914	97,497	2053/ 5 /10
第135回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	98,250	98,756	2053/ 8 /10
第137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	98,751	99,861	2053/10/10
第138回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	99,203	100,549	2053/11/10
第 2 回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.61	26,974	27,716	2036/ 5 /10
第 29 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	14,517	15,035	2040/ 4 /10
第 34 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	18,136	19,050	2040/ 9 /10
第 38 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.91	15,296	15,966	2041/ 1 /10
第 13 回	沖縄振興開発金融公庫債券	1.67	10,000	10,047	2019/ 6 /20
第 29 回	西日本高速道路株式会社債	0.31	200,000	202,964	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	20,013	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	102,559	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	102,869	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	102,345	2038/ 8 /27
第 7 回	本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	113,650	2025/ 6 /20
第 78 回	株式会社日本政策投資銀行	0.225	100,000	100,964	2027/ 4 /13

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	第 37 回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	120,699	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	121,890	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	102,749	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	120,340	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	127,135	2042/ 8 /29
	第 7 回 道路債券	2.7	50,000	54,329	2022/ 6 /20
	第 28 回 道路債券	2.83	200,000	269,220	2033/12/20
	第 4 回 公営企業債券(30年)	2.95	100,000	136,698	2034/ 3 /24
	第 14 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	2.187	100,000	122,404	2031/ 4 /28
	第 20 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8	100,000	118,408	2032/ 1 /28
	第 23 回 国際協力銀行債券	2.09	100,000	113,731	2025/12/19
	第 3 回 都市再生債券	2.87	100,000	114,889	2024/ 6 /20
	第 96 回 都市再生債券	0.599	100,000	103,007	2024/ 9 /20
	第342回 東京交通債券	2.4	30,000	32,298	2022/ 6 /21
	第 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	17,008	17,870	2042/12/10
	第 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1	17,648	18,619	2043/ 1 /10
	第 25 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	51,988	56,423	2044/ 6 /10
	第 28 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	29,454	31,639	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	19,594	20,153	2032/11/10
	第 29 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	32,018	34,518	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	19,779	20,379	2032/11/10
	第 31 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	32,460	34,902	2044/12/10
	第 32 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	31,138	33,302	2045/ 1 /10
	第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	46,521	49,309	2045/11/10
	第 66 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	53,765	56,277	2047/11/10
	第 69 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	55,445	58,473	2048/ 2 /10
	第 70 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	49,406	51,918	2048/ 3 /10
	第 71 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	47,525	49,536	2048/ 4 /10
	第 79 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	50,804	53,008	2048/12/10
	第146回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.757	100,000	103,465	2024/ 1 /19
	第 81 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	54,255	56,606	2049/ 2 /10
	第149回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.704	100,000	103,313	2024/ 3 /19
	第157回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	101,981	2025/ 5 /20
	第 1 回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	1.51	39,426	40,357	2036/ 5 /10
	第 6 回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	2.26	14,254	14,918	2037/ 5 /10
	第 9 回 貸付債権担保 S 種住宅金融公庫債券	2.19	29,888	31,367	2037/ 5 /10
	第 6 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.94	21,072	21,257	2037/ 6 /10
	第 5 回 国際協力機構債券	1.918	100,000	118,485	2030/ 9 /13
	第 36 回 中日本高速道路株式会社債	1.066	100,000	102,509	2021/ 9 /17
	小 計		11,809,947	12,718,411	
金 融 債 券	い第772号農林債	0.25	100,000	100,121	2019/ 9 /27
	い第787号農林債	0.24	200,000	200,796	2020/12/25

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	第300回 信金中金債(5年)	0.225	100,000	100,138	2019/11/27
	第303回 信金中金債(5年)	0.25	100,000	100,225	2020/ 2 /27
	第321回 信金中金債(5年)	0.03	100,000	99,950	2021/ 8 /27
	第326回 信金中金債(5年)	0.05	100,000	99,999	2022/ 1 /27
	第338回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,174	2023/ 1 /27
	第343回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,170	2023/ 6 /27
	小 計		900,000	901,573	
普通社債券 (含む投資法人債券)	第506回 中部電力	0.695	100,000	102,705	2025/ 9 /25
	第473回 関西電力	1.665	100,000	100,230	2019/ 4 /25
	第323回 北陸電力	0.858	100,000	101,734	2037/ 6 /25
	第245回 四国電力	2.0	100,000	104,385	2021/ 6 /25
	第298回 四国電力	0.962	100,000	100,514	2043/ 4 /24
	第400回 九州電力	1.777	100,000	101,939	2020/ 4 /24
	第350回 北海道電力	0.754	100,000	98,033	2038/ 3 /25
	第 6 回 東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	100,163	2027/ 8 /31
	第 7 回 東京電力パワーグリッド	0.46	100,000	100,011	2022/10/24
	第 4 回 ヒューリック	0.359	100,000	100,041	2019/ 4 /24
	第 3 回 GLP投資法人無担保投資法人債	0.51	100,000	100,556	2020/12/25
	第 15 回 東急不動産ホールディングス	0.78	100,000	99,952	2032/10/20
	第 14 回 武田薬品工業	0.54	100,000	100,172	2019/ 7 /19
	第 3 回 富士フィルムホールディングス	0.882	100,000	102,815	2022/12/ 2
	第 12 回 パナソニック	0.387	100,000	100,323	2020/ 3 /19
	第 14 回 トヨタ自動車	0.963	100,000	103,452	2023/ 3 /20
	第 28 回 みずほコーポレート銀行	2.5	100,000	100,583	2019/ 6 / 3
	第 57 回 三菱東京UFJ銀行	2.22	100,000	107,665	2022/10/27
	第 6 回 りそな銀行	2.084	100,000	101,982	2020/ 3 / 4
	第 9 回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	103,317	2021/ 4 /28
	第 7 回 三井住友信託銀行	0.269	100,000	100,027	2019/ 4 /26
	第 3 回 NTTファイナンス	0.529	100,000	101,831	2031/12/19
	第 60 回 トヨタファイナンス	0.244	100,000	100,047	2019/ 6 /20
	第 28 回 リコーリース	0.345	100,000	100,208	2027/ 7 /20
	第 54 回 日立 ^株 外	0.416	100,000	100,720	2021/ 9 /17
	第 65 回 三菱地所	2.04	100,000	119,734	2032/12/20
	第 17 回 東日本旅客鉄道	2.3	100,000	104,418	2021/ 2 /25
	第 32 回 東日本旅客鉄道	2.26	100,000	110,857	2024/ 3 /19
	第 69 回 東日本旅客鉄道	1.222	100,000	101,631	2020/ 7 /22
	第107回 東日本旅客鉄道	1.415	200,000	228,096	2045/ 1 /27
	第127回 東日本旅客鉄道	0.675	100,000	101,019	2038/ 1 /26
	第 45 回 東海旅客鉄道	2.321	100,000	120,709	2029/ 6 /19
	第 47 回 東海旅客鉄道	2.375	100,000	132,068	2039/12/16
	第 4 回 東京地下鉄	2.38	10,000	11,625	2026/ 6 /19
	第 13 回 東京地下鉄	1.702	100,000	116,475	2032/ 5 /25

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	第 25 回 日本郵船	2.65	100,000	114,057	2026/ 6 /22
	第 63 回 日本電信電話	0.69	100,000	102,436	2023/ 3 /20
	第 11 回 電源開発	2.05	100,000	110,445	2025/ 3 /19
	第 58 回 電源開発	0.705	100,000	97,948	2038/ 7 /20
	第 28 回 東京瓦斯	2.29	100,000	117,407	2027/ 6 /15
	第 20 回 大阪瓦斯	1.79	100,000	102,700	2020/ 9 /18
	第 27 回 エヌ・ティ・ティ・データ	0.9	100,000	103,441	2023/ 6 /20
	第 8 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.407	100,000	100,176	2019/12/ 9
	第 18 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.329	100,000	99,298	2025/ 1 /24
	第 14 回 クレディ・アグリコル・エス・エー	0.459	100,000	99,500	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	0.45	100,000	100,482	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	105,968	2021/12/28
	第 7 回 バークレイズ・バンク・ピーエルシー	0.478	200,000	200,270	2019/ 6 /24
	第 10 回 オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.293	100,000	99,959	2024/ 1 /23
	小 計		5,010,000	5,234,124	
	合 計		141,530,447	153,653,077	

(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('19年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 153,653,077	% 99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,360,991	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	155,014,068	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

('19年3月5日現在)

項目	当期末
(A) 資産	155,014,068,960
コーポレート債(評価額)	914,750,388
未払利息	153,653,077,923
前払費用	439,977,540
(B) 負債	6,263,109
未払金	737,540,717
未払解約金	617,888,000
未払利息	119,648,633
その他未払費用	2,332
(C) 純資産総額(A-B)	1,752
元本	154,276,528,243
次期繰越損益金	120,372,703,902
(D) 受益権総口数	33,903,824,341
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	120,372,703,902口
	12,817円

(注1) 期首元本額 99,700,726,312円
 期中追加設定元本額 55,177,461,989円
 期中一部解約元本額 34,505,484,399円
 (注2) 当マザーファンドの当期末元本額におけるペーパーファンド別内訳は、次の通りです。

AMC/ステート・ストリート・リソクビエツト(ランス・オープン(ステイブル))	1,020,195,393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〉	3,613,278,568円
バランスファンドVA30A〈適格機関投資家限定〉	20,393,321円
バランスファンドVA30B〈適格機関投資家限定〉	629,531,427円
バランスファンドVA40A〈適格機関投資家限定〉	441,651円
バランスファンドVA40B〈適格機関投資家限定〉	13,607,088円
バランスファンドVA50A〈適格機関投資家限定〉	30,909,739円
バランスファンドVA50B〈適格機関投資家限定〉	14,495,610,506円
バランスファンドVA50C〈適格機関投資家限定〉	13,220,708円
バランスファンドVA25A〈適格機関投資家限定〉	6,841,375,099円
バランスファンドVA37.5A〈適格機関投資家限定〉	2,419,966,112円
バランスファンドVA75A〈適格機関投資家限定〉	15,921,237円
4資産バランス20VA〈適格機関投資家限定〉	504,487,126円
4資産バランス40VA〈適格機関投資家限定〉	2,460,605,055円
4資産バランス30VA〈適格機関投資家限定〉	1,015,017,445円
バランスファンドVA35A〈適格機関投資家限定〉	7,361,808,915円
バランスファンドVA40C〈適格機関投資家限定〉	188,030,514円
世界4資産/ランスVA45〈適格機関投資家限定〉	574,933,484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〉	156,290,382円
グローバル4資産30VA〈適格機関投資家限定〉	71,078,595円
グローバル4資産45VA〈適格機関投資家限定〉	39,696,976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〉	7,171,714,709円
4資産/ランス30VA2〈適格機関投資家限定〉	51,555,202円
バランスファンドVA25B〈適格機関投資家限定〉	3,870,811,212円
バランスファンドVA20A〈適格機関投資家限定〉	29,043,471円
バランスファンドVA35B〈適格機関投資家限定〉	13,545,590円
バランスファンドVA10A〈適格機関投資家限定〉	1,436,495,240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〉	7,122,046,185円
日本債券インデックス・ファンド〈適格機関投資家限定〉	222,841,684円
4資産インデックス/ランスVA20〈適格機関投資家限定〉	3,001,698,395円
世界分散ファンドVA25A〈適格機関投資家限定〉	11,140,648,736円
4資産インデックス/ランスVA50〈適格機関投資家限定〉	15,375,763円
Taのリスクビエツト型リソクビエツト(ステイブル)年金〈適格機関投資家限定〉	401,942,513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〉	935,906,250円
Taのリスクビエツト型リソクビエツト(ステイブル)〈適格機関投資家限定〉	355,242,299円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,537,738,169円
日本債券インデックス・ファンドF〈適格機関投資家限定〉	37,979,532,536円
グローバル/ランス40VA〈適格機関投資家限定〉	5,315,827円
グローバル/ランス40VA2〈適格機関投資家限定〉	2,313,139,108円
グローバル/ランス40VA3〈適格機関投資家限定〉	118,121,700円
グローバル/ランス50VA〈適格機関投資家限定〉	46,123,798円
ワールド/ランスVA0902〈適格機関投資家限定〉	71,183,421円
世界株VCファンド〈適格機関投資家限定〉	1,046,282,753円

◎損益の状況

当期(自'18年3月6日 至'19年3月5日)

項目	当期
(A) 配当等収益	1,443,627,938
受取利息	1,444,367,382
支払利息	△ 739,444
(B) 有価証券売買損益	120,745,605
売買益	954,754,705
売買損	△ 834,009,100
(C) その他の費用	△ 124,618
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,564,248,925
(E) 前期繰越損益金	26,814,276,164
(F) 追加信託差損益金	14,812,466,996
(G) 解約差損益金	△ 9,287,167,744
(H) 計(D+E+F+G)	33,903,824,341
次期繰越損益金(H)	33,903,824,341

(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。