

○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	<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4期運用報告書(全体版) (決算日2020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、2020年3月5日に第4期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間 (営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

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

◎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
4期('20年 3月 5日)	10,047	0	1.8	10,125	1.9	99.1	-	2,247

(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	%		%	%	%
'19年 3月 5日	9,871	-	9,935	-	99.5	-
3月末	9,965	1.0	10,031	1.0	99.6	-
4月末	9,932	0.6	10,000	0.7	99.3	-
5月末	9,993	1.2	10,061	1.3	99.5	-
6月末	10,053	1.8	10,122	1.9	99.4	-
7月末	10,063	1.9	10,134	2.0	99.7	-
8月末	10,196	3.3	10,272	3.4	99.3	-
9月末	10,088	2.2	10,163	2.3	99.6	-
10月末	10,048	1.8	10,120	1.9	99.8	-
11月末	10,012	1.4	10,087	1.5	99.5	-
12月末	9,981	1.1	10,057	1.2	99.8	-
'20年 1月末	10,021	1.5	10,099	1.7	99.6	-
2月末	10,099	2.3	10,175	2.4	99.3	-
(期末)						
'20年 3月 5日	10,047	1.8	10,125	1.9	99.1	-

(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。

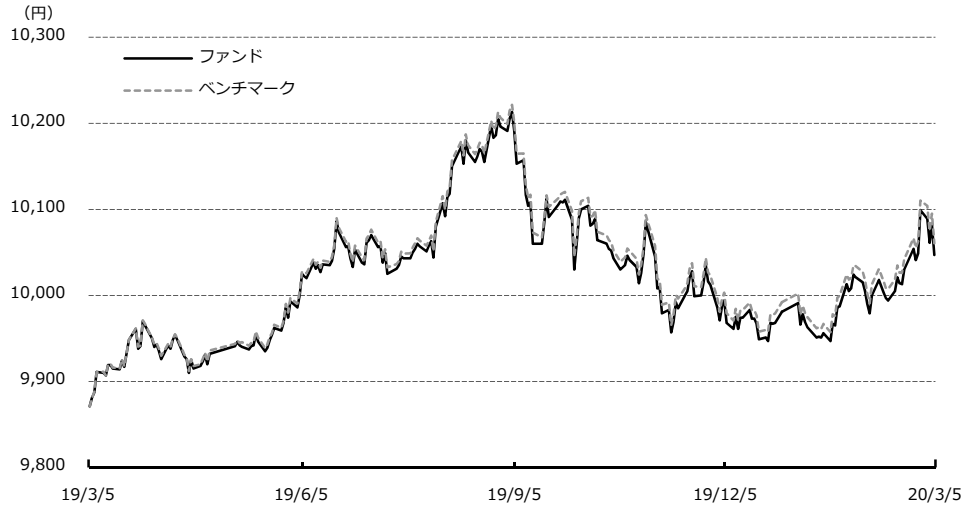
(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

(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

(2019年3月6日から2020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4期	9,871円	10,047円	0円	+1.8%	+1.9%

当期末の基準価額は10,047円となり、前期末の9,871円に比べて176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】

－米中貿易摩擦に対する懸念の高まりを受けて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】

－期後半、米中貿易協議への進展期待や英総選挙の結果を受けて英国の欧州連合(EU)離脱に方向感が見え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+1.8%となり、ベンチマークの騰落率(+1.9%)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。

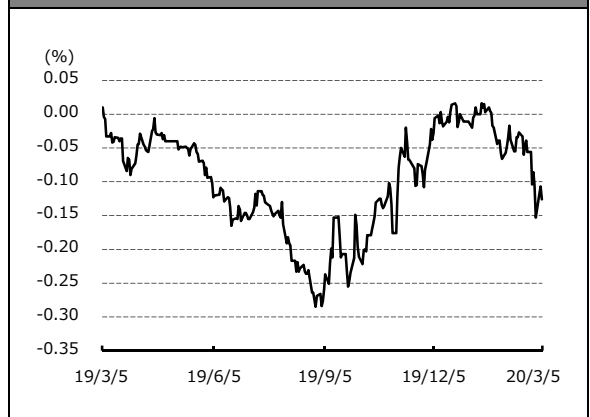
投資環境

(2019年3月6日から2020年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期前半、2019年1-3月期GDP(速報値)が事前予想を上回って上昇しましたが、個人消費や設備投資などがマイナスとなり、日本経済の悪化を示したことが債券の買い材料となりました。また、世界的な貿易摩擦激化が世界経済へ与える影響が懸念されたことや、海外中央銀行が金融政策に関して緩和的なスタンスを示す中で海外債券が買われたことも国内債券の買い材料となりました。その後、米中貿易摩擦に対する懸念の高まりを受けて、8月に債券が大きく買われました。期後半は米中貿易協議への進展期待や英総選挙の結果を受けて英国のEU離脱に方向感が見えたことが債券の売り材料となりました。期末にかけては、新型コロナウイルスが世界経済へ与える影響が懸念され債券が買い進まれる展開となりました。結果として、日本10年国債利回りは前期末の0.01%から0.12%低下の-0.11%で当期末を迎えました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2019年3月6日から2020年3月5日まで)

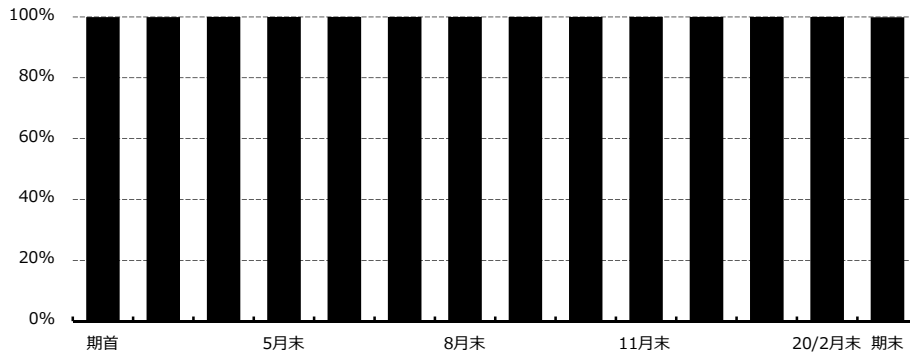
当ファンドは「日本債券インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ちます。

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 (2019年3月6日~2020年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	10,037円	-	期中の平均基準価額です。
(a) 信託報酬	14円	0.143%	(a)信託報酬 = 期中の平均基準価額×信託報酬率 消費税は報告日の税率を採用しています。
(投信会社)	(10)	(0.099)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の 情報提供等の対価
(受託会社)	(3)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) その他費用	1	0.011	(b)その他費用 = 期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.011)	・ 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	・ その他は、金銭信託手数料
合 計	15円	0.154%	

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

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

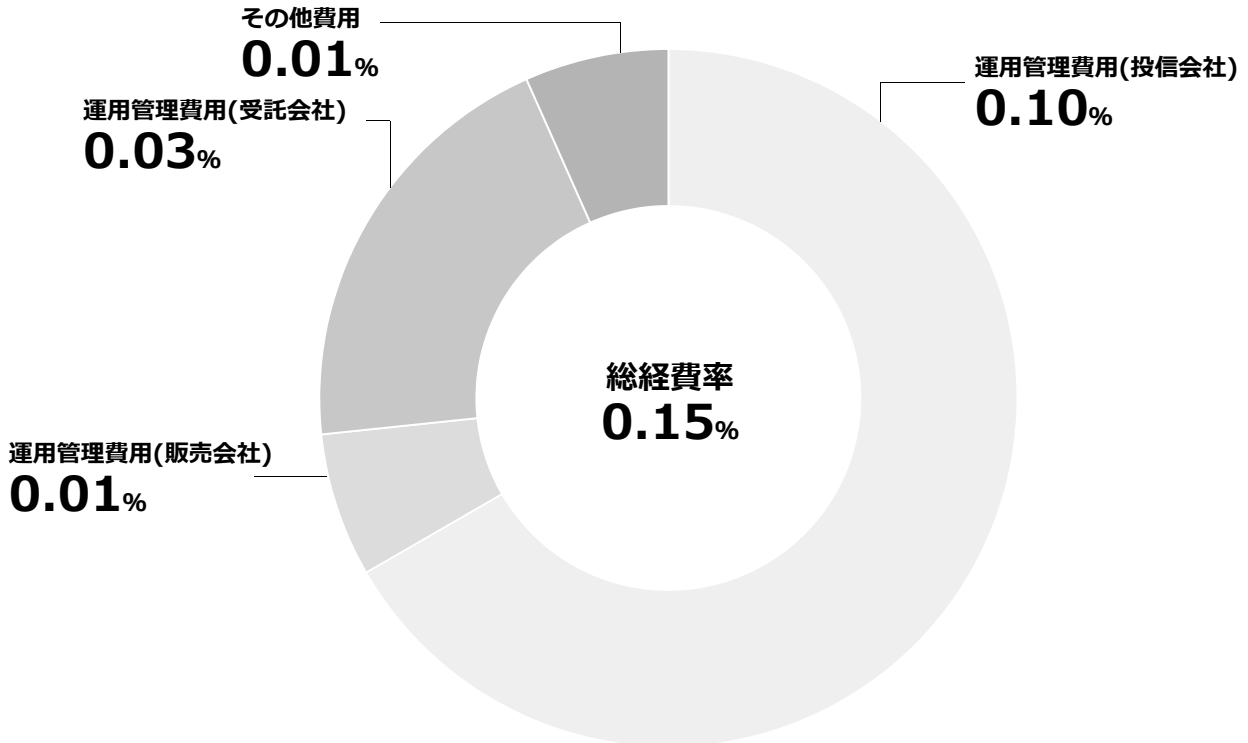
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注4) 各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(参考情報)

○総経費率

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



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

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 費用はマザーファンドが支払った費用を含みます。

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

◎売買および取引の状況('19年3月6日から'20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	521,359	678,989	339,871	441,445

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('19年3月6日から'20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139回 利付国債(5年)	2,533,069	第392回 利付国債(2年)	3,312,159
第356回 利付国債(10年)	2,291,748	第399回 利付国債(2年)	2,006,916
第399回 利付国債(2年)	2,009,800	第131回 利付国債(5年)	1,010,160
第354回 利付国債(10年)	1,934,866	第388回 利付国債(2年)	1,002,706
第355回 利付国債(10年)	1,647,773	第354回 利付国債(10年)	928,735
第141回 利付国債(5年)	1,519,232	第314回 利付国債(10年)	912,348
第140回 利付国債(5年)	1,325,370	第310回 利付国債(10年)	910,823
第401回 利付国債(2年)	1,307,839	第312回 利付国債(10年)	811,360
第357回 利付国債(10年)	1,020,224	第309回 利付国債(10年)	810,632
第142回 利付国債(5年)	915,662	第313回 利付国債(10年)	711,171

(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('19年3月6日から'20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('20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
	千口	千口	千円
日本債券インデックス・マザーファンド	1,537,738	1,719,226	2,246,169

(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126,401,838千口です。

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('20年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックス・マザーファンド	2,246,169	98.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	42,432	1.9
投 資 信 託 財 産 総 額	2,288,601	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

('20年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	2,288,601,875
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,740,715
日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	2,246,169,194
未 収 入 金	24,691,966
(B) 負 債	40,624,235
未 払 解 約 金	39,024,863
未 払 信 託 報 酬	1,485,132
未 払 利 息	48
そ の 他 未 払 費 用	114,192
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	2,247,977,640
元 本	2,237,478,685
次 期 繰 越 損 益 金	10,498,955
(D) 受 益 権 総 口 数	2,237,478,685口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	10,047円

(注)期首元本額	1,998,123,897円
期中追加設定元本額	1,331,974,297円
期中一部解約元本額	1,092,619,509円

◎損益の状況

当期(自'19年3月6日 至'20年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 7,205
支 払 利 息	△ 7,205
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	26,772,338
売 買 益	39,588,958
売 買 損	△12,816,620
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,085,522
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	23,679,611
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	11,133,981
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△24,314,637
(配 当 等 相 当 額)	(38,986,098)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△63,300,735)
(G) 計 (D+E+F)	10,498,955
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	10,498,955
追 加 信 託 差 損 益 金	△24,314,637
(配 当 等 相 当 額)	(39,948,573)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△64,263,210)
分 配 準 備 積 立 金	34,813,592

- (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4期 (2019年3月6日～ 2020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	334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17期 運用報告書 (決算日2020年3月5日)

日本債券インデックス・マザーファンドの第17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	12,704	騰落率			
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
17期('20年 3月 5日)	13,065	1.9	13,072	1.9	99.2	-	165,138

(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	12,826	騰落率		
(期首) '19年 3月 5日	12,817	-	12,826	-	99.6	-
3月末	12,940	1.0	12,950	1.0	99.7	-
4月末	12,898	0.6	12,911	0.7	99.3	-
5月末	12,980	1.3	12,990	1.3	99.5	-
6月末	13,059	1.9	13,069	1.9	99.4	-
7月末	13,074	2.0	13,084	2.0	99.7	-
8月末	13,249	3.4	13,262	3.4	99.3	-
9月末	13,110	2.3	13,121	2.3	99.6	-
10月末	13,059	1.9	13,066	1.9	99.8	-
11月末	13,014	1.5	13,023	1.5	99.5	-
12月末	12,975	1.2	12,984	1.2	99.8	-
'20年 1月末	13,030	1.7	13,038	1.7	99.6	-
2月末	13,132	2.5	13,137	2.4	99.3	-
(期末) '20年 3月 5日	13,065	1.9	13,072	1.9	99.2	-

(注1) 騰落率は期首比です。

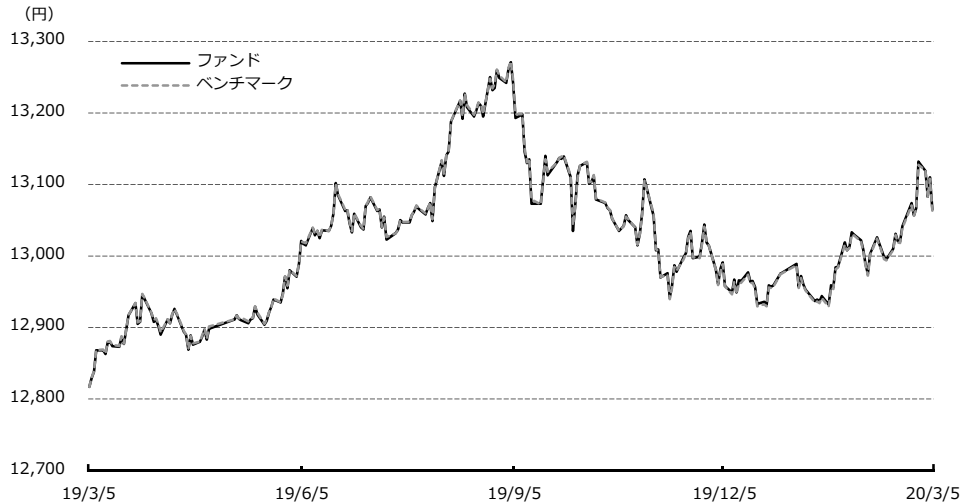
(注2) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合指数で、ファンド設定日の前営業日を10,000として委託会社が独自に指数化したものです。

(注3) 先物比率=買建比率-売建比率

当期の運用実績

(2019年3月6日から2020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13,065円となり、前期末の12,817円に比べて248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】

－米中貿易摩擦に対する懸念の高まりを受けて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】

－期後半、米中貿易協議への進展期待や英総選挙の結果を受けて英国の欧州連合(EU)離脱に方向感が見え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+1.9%と、ベンチマークの騰落率(+1.9%)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。

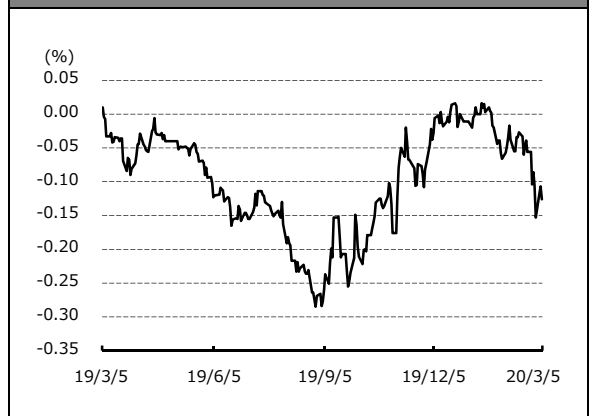
投資環境

(2019年3月6日から2020年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期前半、2019年1-3月期GDP(速報値)が事前予想を上回って上昇しましたが、個人消費や設備投資などがマイナスとなり、日本経済の悪化を示したことが債券の買い材料となりました。また、世界的な貿易摩擦激化が世界経済へ与える影響が懸念されたことや、海外中央銀行が金融政策に関して緩和的なスタンスを示す中で海外債券が買われたことも国内債券の買い材料となりました。その後、米中貿易摩擦に対する懸念の高まりを受けて、8月に債券が大きく買われました。期後半は米中貿易協議への進展期待や英総選挙の結果を受けて英国のEU離脱に方向感が見えたことが債券の売り材料となりました。期末にかけては、新型コロナウイルスが世界経済へ与える影響が懸念され債券が買い進まれる展開となりました。結果として、日本10年国債利回りは前期末の0.01%から0.12%低下の-0.11%で当期末を迎えました。

日本10年国債利回りの推移



運用の概況

(2019年3月6日から2020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、当期を通じて銘柄分散を保ち、500銘柄強での運用を継続しました。ファンドにおける個別発行体の分散度に関しても、安定的な運用が十分可能な水準を引き続き維持しております。債券組入比率は期を通じて高位を維持しました。

今後の運用方針

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

◎1万口(元本10,000円)当たりの費用の明細

項 目	当 期 (2019年3月6日~2020年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	13,043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('19年3月6日から'20年3月5日まで)

○公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 36,418,761	千円 27,639,338
	地 方 債 証 券	1,372,401	627,228 (716,160)
	特 殊 債 券	1,990,045	865,670 (1,124,436)
	社 債 券	616,850	- (1,000,000)

(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('19年3月6日から'20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139回 利付国債(5年)	2,533,069	第392回 利付国債(2年)	3,312,159
第356回 利付国債(10年)	2,291,748	第399回 利付国債(2年)	2,006,916
第399回 利付国債(2年)	2,009,800	第131回 利付国債(5年)	1,010,160
第354回 利付国債(10年)	1,934,866	第388回 利付国債(2年)	1,002,706
第355回 利付国債(10年)	1,647,773	第354回 利付国債(10年)	928,735
第141回 利付国債(5年)	1,519,232	第314回 利付国債(10年)	912,348
第140回 利付国債(5年)	1,325,370	第310回 利付国債(10年)	910,823
第401回 利付国債(2年)	1,307,839	第312回 利付国債(10年)	811,360
第357回 利付国債(10年)	1,020,224	第309回 利付国債(10年)	810,632
第142回 利付国債(5年)	915,662	第313回 利付国債(10年)	711,171

(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('19年3月6日から'20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('20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	123,140,000 (100,000)	135,665,536 (100,859)	82.2 (0.1)	- (-)	55.1 (0.1)	20.5 (-)	6.5 (-)
地 方 債 証 券	9,104,940 (9,004,940)	9,692,709 (9,582,881)	5.9 (5.8)	- (-)	3.6 (3.5)	1.8 (1.8)	0.5 (0.5)
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	11,932,736 (11,502,736)	12,808,459 (12,353,675)	7.8 (7.5)	- (-)	5.1 (5.0)	1.8 (1.8)	0.9 (0.7)
金 融 債 券	800,000 (800,000)	800,735 (800,735)	0.5 (0.5)	- (-)	- (-)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	4,610,000 (4,210,000)	4,884,183 (4,465,835)	3.0 (2.7)	- (-)	1.7 (1.7)	0.6 (0.4)	0.7 (0.6)
合 計	149,587,676 (25,617,676)	163,851,623 (27,303,987)	99.2 (16.5)	- (-)	65.5 (10.2)	24.9 (4.3)	8.8 (2.0)

(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401回 利付国債(2年)	0.1	1,300,000	1,305,408	2021/ 6 / 1
	第402回 利付国債(2年)	0.1	600,000	602,700	2021/ 7 / 1
	第404回 利付国債(2年)	0.1	900,000	904,572	2021/ 9 / 1
	第406回 利付国債(2年)	0.1	400,000	402,296	2021/11/ 1
	第130回 利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,207,548	2021/12/20
	第131回 利付国債(5年)	0.1	1,100,000	1,107,997	2022/ 3 /20
	第132回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,512,255	2022/ 6 /20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,513,815	2022/ 9 /20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,515,180	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	1,900,000	1,920,938	2023/ 3 /20
	第136回 利付国債(5年)	0.1	1,700,000	1,720,298	2023/ 6 /20
	第137回 利付国債(5年)	0.1	1,550,000	1,569,375	2023/ 9 /20
	第139回 利付国債(5年)	0.1	2,500,000	2,535,675	2024/ 3 /20
	第140回 利付国債(5年)	0.1	1,300,000	1,319,435	2024/ 6 /20
	第141回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,523,415	2024/ 9 /20
	第142回 利付国債(5年)	0.1	900,000	914,607	2024/12/20
	第 32 回 利付国債(30年)	2.3	500,000	704,330	2040/ 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116回	利付国債(20年)	2.2	500,000	615,985	2030/ 3 /20
第128回	利付国債(5 年)	0.1	1,000,000	1,004,140	2021/ 6 /20
第129回	利付国債(5 年)	0.1	1,750,000	1,758,925	2021/ 9 /20
第 1 回	利付国債(40年)	2.4	160,000	248,505	2048/ 3 /20
第 2 回	利付国債(40年)	2.2	500,000	756,790	2049/ 3 /20
第 3 回	利付国債(40年)	2.2	250,000	381,937	2050/ 3 /20
第 4 回	利付国債(40年)	2.2	250,000	385,967	2051/ 3 /20
第 5 回	利付国債(40年)	2.0	130,000	194,880	2052/ 3 /20
第 6 回	利付国債(40年)	1.9	150,000	222,475	2053/ 3 /20
第 7 回	利付国債(40年)	1.7	160,000	229,180	2054/ 3 /20
第 8 回	利付国債(40年)	1.4	50,000	67,224	2055/ 3 /20
第 9 回	利付国債(40年)	0.4	1,930,000	1,957,734	2056/ 3 /20
第 10 回	利付国債(40年)	0.9	100,000	118,616	2057/ 3 /20
第 11 回	利付国債(40年)	0.8	330,000	381,126	2058/ 3 /20
第 12 回	利付国債(40年)	0.5	610,000	639,225	2059/ 3 /20
第315回	利付国債(10年)	1.2	750,000	763,777	2021/ 6 /20
第316回	利付国債(10年)	1.1	500,000	508,540	2021/ 6 /20
第317回	利付国債(10年)	1.1	600,000	612,348	2021/ 9 /20
第318回	利付国債(10年)	1.0	250,000	254,757	2021/ 9 /20
第319回	利付国債(10年)	1.1	300,000	307,233	2021/12/20
第320回	利付国債(10年)	1.0	700,000	715,617	2021/12/20
第321回	利付国債(10年)	1.0	300,000	307,650	2022/ 3 /20
第322回	利付国債(10年)	0.9	700,000	716,415	2022/ 3 /20
第323回	利付国債(10年)	0.9	200,000	205,274	2022/ 6 /20
第324回	利付国債(10年)	0.8	400,000	409,624	2022/ 6 /20
第325回	利付国債(10年)	0.8	500,000	513,365	2022/ 9 /20
第326回	利付国債(10年)	0.7	300,000	308,010	2022/12/20
第327回	利付国債(10年)	0.8	700,000	720,657	2022/12/20
第328回	利付国債(10年)	0.6	500,000	513,010	2023/ 3 /20
第329回	利付国債(10年)	0.8	500,000	517,415	2023/ 6 /20
第330回	利付国債(10年)	0.8	800,000	830,016	2023/ 9 /20
第331回	利付国債(10年)	0.6	500,000	515,190	2023/ 9 /20
第332回	利付国債(10年)	0.6	600,000	619,518	2023/12/20
第333回	利付国債(10年)	0.6	900,000	931,203	2024/ 3 /20
第334回	利付国債(10年)	0.6	700,000	725,802	2024/ 6 /20
第335回	利付国債(10年)	0.5	800,000	827,560	2024/ 9 /20
第336回	利付国債(10年)	0.5	1,000,000	1,036,620	2024/12/20
第337回	利付国債(10年)	0.3	1,000,000	1,026,670	2024/12/20
第338回	利付国債(10年)	0.4	650,000	671,554	2025/ 3 /20
第339回	利付国債(10年)	0.4	900,000	931,356	2025/ 6 /20
第340回	利付国債(10年)	0.4	1,480,000	1,534,493	2025/ 9 /20
第341回	利付国債(10年)	0.3	1,300,000	1,342,796	2025/12/20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
第342回	利付国債(10年)	0.1	800,000	817,664	2026/ 3 /20
第343回	利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,227,624	2026/ 6 /20
第344回	利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,228,752	2026/ 9 /20
第345回	利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,024,880	2026/12/20
第346回	利付国債(10年)	0.1	1,400,000	1,436,638	2027/ 3 /20
第347回	利付国債(10年)	0.1	750,000	770,062	2027/ 6 /20
第348回	利付国債(10年)	0.1	900,000	924,570	2027/ 9 /20
第349回	利付国債(10年)	0.1	1,460,000	1,500,004	2027/12/20
第350回	利付国債(10年)	0.1	1,410,000	1,448,690	2028/ 3 /20
第351回	利付国債(10年)	0.1	1,500,000	1,540,530	2028/ 6 /20
第352回	利付国債(10年)	0.1	1,160,000	1,190,241	2028/ 9 /20
第353回	利付国債(10年)	0.1	1,500,000	1,538,205	2028/12/20
第354回	利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,024,310	2029/ 3 /20
第355回	利付国債(10年)	0.1	1,230,000	1,258,966	2029/ 6 /20
第356回	利付国債(10年)	0.1	2,250,000	2,299,995	2029/ 9 /20
第357回	利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,021,290	2029/12/20
第 1 回	利付国債(30年)	2.8	300,000	384,189	2029/ 9 /20
第 2 回	利付国債(30年)	2.4	380,000	475,345	2030/ 2 /20
第 3 回	利付国債(30年)	2.3	300,000	373,464	2030/ 5 /20
第 5 回	利付国債(30年)	2.2	100,000	125,213	2031/ 5 /20
第 6 回	利付国債(30年)	2.4	180,000	231,125	2031/11/20
第 7 回	利付国債(30年)	2.3	300,000	384,450	2032/ 5 /20
第 8 回	利付国債(30年)	1.8	300,000	367,959	2032/11/22
第 9 回	利付国債(30年)	1.4	100,000	117,607	2032/12/20
第12回	利付国債(30年)	2.1	300,000	382,983	2033/ 9 /20
第13回	利付国債(30年)	2.0	300,000	379,869	2033/12/20
第14回	利付国債(30年)	2.4	200,000	265,150	2034/ 3 /20
第15回	利付国債(30年)	2.5	200,000	268,762	2034/ 6 /20
第16回	利付国債(30年)	2.5	200,000	269,768	2034/ 9 /20
第17回	利付国債(30年)	2.4	200,000	267,830	2034/12/20
第18回	利付国債(30年)	2.3	300,000	398,667	2035/ 3 /20
第19回	利付国債(30年)	2.3	200,000	266,464	2035/ 6 /20
第20回	利付国債(30年)	2.5	100,000	136,731	2035/ 9 /20
第21回	利付国債(30年)	2.3	200,000	268,194	2035/12/20
第22回	利付国債(30年)	2.5	200,000	275,334	2036/ 3 /20
第23回	利付国債(30年)	2.5	100,000	138,138	2036/ 6 /20
第24回	利付国債(30年)	2.5	320,000	443,532	2036/ 9 /20
第25回	利付国債(30年)	2.3	100,000	135,771	2036/12/20
第26回	利付国債(30年)	2.4	150,000	206,757	2037/ 3 /20
第27回	利付国債(30年)	2.5	320,000	449,302	2037/ 9 /20
第28回	利付国債(30年)	2.5	300,000	423,819	2038/ 3 /20
第29回	利付国債(30年)	2.4	200,000	280,676	2038/ 9 /20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
第 30 回	利付国債(30年)	2.3	350,000	487,480	2039/ 3 /20
第 31 回	利付国債(30年)	2.2	400,000	552,536	2039/ 9 /20
第 33 回	利付国債(30年)	2.0	400,000	542,604	2040/ 9 /20
第 34 回	利付国債(30年)	2.2	550,000	772,073	2041/ 3 /20
第 35 回	利付国債(30年)	2.0	520,000	711,838	2041/ 9 /20
第 36 回	利付国債(30年)	2.0	480,000	659,587	2042/ 3 /20
第 37 回	利付国債(30年)	1.9	430,000	584,520	2042/ 9 /20
第 38 回	利付国債(30年)	1.8	400,000	537,400	2043/ 3 /20
第 39 回	利付国債(30年)	1.9	330,000	451,826	2043/ 6 /20
第 40 回	利付国債(30年)	1.8	350,000	472,192	2043/ 9 /20
第 41 回	利付国債(30年)	1.7	300,000	398,577	2043/12/20
第 42 回	利付国債(30年)	1.7	410,000	545,423	2044/ 3 /20
第 43 回	利付国債(30年)	1.7	400,000	532,816	2044/ 6 /20
第 44 回	利付国債(30年)	1.7	350,000	467,351	2044/ 9 /20
第 45 回	利付国債(30年)	1.5	320,000	412,416	2044/12/20
第 46 回	利付国債(30年)	1.5	400,000	516,596	2045/ 3 /20
第 47 回	利付国債(30年)	1.6	500,000	658,210	2045/ 6 /20
第 48 回	利付国債(30年)	1.4	500,000	635,000	2045/ 9 /20
第 49 回	利付国債(30年)	1.4	440,000	559,213	2045/12/20
第 50 回	利付国債(30年)	0.8	350,000	392,738	2046/ 3 /20
第 51 回	利付国債(30年)	0.3	450,000	448,357	2046/ 6 /20
第 52 回	利付国債(30年)	0.5	400,000	418,636	2046/ 9 /20
第 53 回	利付国債(30年)	0.6	400,000	428,692	2046/12/20
第 54 回	利付国債(30年)	0.8	410,000	460,692	2047/ 3 /20
第 55 回	利付国債(30年)	0.8	390,000	438,633	2047/ 6 /20
第 56 回	利付国債(30年)	0.8	320,000	359,788	2047/ 9 /20
第 57 回	利付国債(30年)	0.8	240,000	270,088	2047/12/20
第 58 回	利付国債(30年)	0.8	480,000	539,976	2048/ 3 /20
第 59 回	利付国債(30年)	0.7	450,000	494,356	2048/ 6 /20
第 60 回	利付国債(30年)	0.9	340,000	392,084	2048/ 9 /20
第 61 回	利付国債(30年)	0.7	120,000	131,847	2048/12/20
第 62 回	利付国債(30年)	0.5	250,000	260,915	2049/ 3 /20
第 63 回	利付国債(30年)	0.4	250,000	253,995	2049/ 6 /20
第 64 回	利付国債(30年)	0.4	560,000	568,254	2049/ 9 /20
第 65 回	利付国債(30年)	0.4	500,000	507,425	2049/12/20
第 51 回	利付国債(20年)	2.0	350,000	360,097	2021/ 6 /21
第 52 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	103,621	2021/ 9 /21
第 55 回	利付国債(20年)	2.0	500,000	523,025	2022/ 3 /21
第 57 回	利付国債(20年)	1.9	800,000	839,520	2022/ 6 /20
第 60 回	利付国債(20年)	1.4	700,000	732,571	2022/12/20
第 61 回	利付国債(20年)	1.0	350,000	363,447	2023/ 3 /20
第 63 回	利付国債(20年)	1.8	500,000	534,005	2023/ 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 65 回	利付国債(20年)	1.9	400,000	432,920	2023/12/20
第 68 回	利付国債(20年)	2.2	500,000	549,860	2024/ 3 /20
第 69 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	328,692	2024/ 3 /20
第 70 回	利付国債(20年)	2.4	600,000	668,808	2024/ 6 /20
第 72 回	利付国債(20年)	2.1	600,000	664,476	2024/ 9 /20
第 74 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	333,948	2024/12/20
第 76 回	利付国債(20年)	1.9	200,000	221,828	2025/ 3 /20
第 77 回	利付国債(20年)	2.0	300,000	334,272	2025/ 3 /20
第 78 回	利付国債(20年)	1.9	250,000	278,667	2025/ 6 /20
第 80 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	112,538	2025/ 6 /20
第 81 回	利付国債(20年)	2.0	200,000	225,228	2025/ 9 /20
第 83 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	341,430	2025/12/20
第 85 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	228,744	2026/ 3 /20
第 88 回	利付国債(20年)	2.3	400,000	465,036	2026/ 6 /20
第 89 回	利付国債(20年)	2.2	400,000	462,480	2026/ 6 /20
第 90 回	利付国債(20年)	2.2	300,000	348,768	2026/ 9 /20
第 91 回	利付国債(20年)	2.3	300,000	350,763	2026/ 9 /20
第 92 回	利付国債(20年)	2.1	340,000	395,066	2026/12/20
第 93 回	利付国債(20年)	2.0	300,000	348,357	2027/ 3 /20
第 94 回	利付国債(20年)	2.1	300,000	350,508	2027/ 3 /20
第 95 回	利付国債(20年)	2.3	150,000	178,336	2027/ 6 /20
第 96 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	117,406	2027/ 6 /20
第 97 回	利付国債(20年)	2.2	150,000	178,113	2027/ 9 /20
第 98 回	利付国債(20年)	2.1	100,000	117,974	2027/ 9 /20
第 99 回	利付国債(20年)	2.1	200,000	236,972	2027/12/20
第100回	利付国債(20年)	2.2	200,000	239,606	2028/ 3 /20
第101回	利付国債(20年)	2.4	100,000	121,439	2028/ 3 /20
第102回	利付国債(20年)	2.4	200,000	243,938	2028/ 6 /20
第103回	利付国債(20年)	2.3	200,000	242,252	2028/ 6 /20
第104回	利付国債(20年)	2.1	150,000	179,158	2028/ 6 /20
第105回	利付国債(20年)	2.1	100,000	119,832	2028/ 9 /20
第106回	利付国債(20年)	2.2	200,000	241,400	2028/ 9 /20
第107回	利付国債(20年)	2.1	200,000	240,626	2028/12/20
第108回	利付国債(20年)	1.9	100,000	118,528	2028/12/20
第109回	利付国債(20年)	1.9	200,000	237,674	2029/ 3 /20
第110回	利付国債(20年)	2.1	200,000	241,342	2029/ 3 /20
第111回	利付国債(20年)	2.2	200,000	244,052	2029/ 6 /20
第112回	利付国債(20年)	2.1	200,000	242,168	2029/ 6 /20
第113回	利付国債(20年)	2.1	200,000	242,858	2029/ 9 /20
第114回	利付国債(20年)	2.1	300,000	365,445	2029/12/20
第115回	利付国債(20年)	2.2	500,000	614,020	2029/12/20
第118回	利付国債(20年)	2.0	300,000	364,743	2030/ 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122回	利付国債(20年)	1.8	500,000	599,300	2030/ 9 /20
第123回	利付国債(20年)	2.1	300,000	370,386	2030/12/20
第126回	利付国債(20年)	2.0	600,000	736,524	2031/ 3 /20
第127回	利付国債(20年)	1.9	400,000	486,576	2031/ 3 /20
第128回	利付国債(20年)	1.9	600,000	732,012	2031/ 6 /20
第130回	利付国債(20年)	1.8	400,000	484,784	2031/ 9 /20
第132回	利付国債(20年)	1.7	400,000	481,316	2031/12/20
第133回	利付国債(20年)	1.8	500,000	607,555	2031/12/20
第135回	利付国債(20年)	1.7	400,000	482,440	2032/ 3 /20
第136回	利付国債(20年)	1.6	450,000	537,322	2032/ 3 /20
第137回	利付国債(20年)	1.7	400,000	483,572	2032/ 6 /20
第139回	利付国債(20年)	1.6	300,000	358,992	2032/ 6 /20
第140回	利付国債(20年)	1.7	200,000	242,340	2032/ 9 /20
第141回	利付国債(20年)	1.7	300,000	364,305	2032/12/20
第142回	利付国債(20年)	1.8	600,000	736,266	2032/12/20
第143回	利付国債(20年)	1.6	300,000	361,170	2033/ 3 /20
第144回	利付国債(20年)	1.5	400,000	476,364	2033/ 3 /20
第145回	利付国債(20年)	1.7	450,000	548,752	2033/ 6 /20
第146回	利付国債(20年)	1.7	320,000	391,286	2033/ 9 /20
第147回	利付国債(20年)	1.6	560,000	678,423	2033/12/20
第148回	利付国債(20年)	1.5	500,000	600,230	2034/ 3 /20
第149回	利付国債(20年)	1.5	400,000	480,928	2034/ 6 /20
第150回	利付国債(20年)	1.4	470,000	559,582	2034/ 9 /20
第151回	利付国債(20年)	1.2	550,000	639,584	2034/12/20
第152回	利付国債(20年)	1.2	650,000	757,048	2035/ 3 /20
第153回	利付国債(20年)	1.3	850,000	1,003,612	2035/ 6 /20
第154回	利付国債(20年)	1.2	940,000	1,097,403	2035/ 9 /20
第155回	利付国債(20年)	1.0	600,000	682,884	2035/12/20
第156回	利付国債(20年)	0.4	620,000	647,311	2036/ 3 /20
第157回	利付国債(20年)	0.2	700,000	707,812	2036/ 6 /20
第158回	利付国債(20年)	0.5	670,000	709,570	2036/ 9 /20
第159回	利付国債(20年)	0.6	800,000	860,368	2036/12/20
第160回	利付国債(20年)	0.7	550,000	600,754	2037/ 3 /20
第161回	利付国債(20年)	0.6	550,000	591,211	2037/ 6 /20
第162回	利付国債(20年)	0.6	100,000	107,507	2037/ 9 /20
第163回	利付国債(20年)	0.6	500,000	537,590	2037/12/20
第164回	利付国債(20年)	0.5	700,000	740,425	2038/ 3 /20
第165回	利付国債(20年)	0.5	450,000	475,920	2038/ 6 /20
第166回	利付国債(20年)	0.7	410,000	448,253	2038/ 9 /20
第167回	利付国債(20年)	0.5	600,000	633,744	2038/12/20
第168回	利付国債(20年)	0.4	400,000	415,052	2039/ 3 /20
第169回	利付国債(20年)	0.3	570,000	580,584	2039/ 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170回 利付国債(20年)	0.3	770,000	783,744	2039/ 9 /20
	第171回 利付国債(20年)	0.3	270,000	274,617	2039/12/20
	第 26 回 メキシコ合衆国	0.85	100,000	100,859	2025/ 4 /18
	小 計		123,140,000	135,665,536	
地 方 債 証 券	第739回 東京都公募公債	0.29	100,000	101,192	2024/12/20
	第746回 東京都公募公債	0.499	100,000	102,393	2025/ 6 /20
	第751回 東京都公募公債	0.37	100,000	101,873	2025/12/19
	第759回 東京都公募公債	0.075	100,000	100,091	2026/ 9 /18
	第770回 東京都公募公債	0.18	100,000	100,798	2027/ 6 /18
	第 6 回 東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	109,828	2025/ 3 /19
	第 7 回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	111,702	2025/ 9 /19
	第 12 回 東京都公募公債(20年)	2.31	100,000	116,851	2027/ 9 /17
	第 13 回 東京都公募公債(20年)	2.15	100,000	116,184	2027/12/20
	第 26 回 東京都公募公債(20年)	1.74	100,000	119,476	2032/ 6 /18
	平成24年度第 4 回 北海道公募公債	0.9	100,000	102,013	2022/ 6 /29
	平成24年度第 9 回 北海道公募公債	0.79	7,400	7,548	2022/10/31
	平成27年度第 9 回 北海道公募公債	0.486	100,000	102,399	2025/10/30
	平成27年度第 13 回 北海道公募公債	0.469	100,000	102,363	2025/12/25
	平成29年度第 15 回 北海道公募公債	0.23	100,000	101,224	2028/ 2 /28
	第 30 回 2号宮城県公募公債(10年)	0.53	100,000	102,285	2024/10/29
	第188回 神奈川県公募公債	1.05	100,000	102,074	2022/ 3 /18
	第 3 回 神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	140,072	2037/ 3 /19
	第 14 回 神奈川県公募公債(20年)	1.969	100,000	119,060	2030/ 7 /19
	第 36 回 神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	106,742	2037/12/18
	第346回 大阪府公募公債(10年)	1.25	100,000	101,110	2021/ 1 /28
	第368回 大阪府公募公債(10年)	0.83	100,000	102,318	2023/ 1 /30
	第374回 大阪府公募公債(10年)	0.938	134,000	138,124	2023/ 7 /28
	第387回 大阪府公募公債(10年)	0.521	44,040	45,004	2024/ 8 /28
	第392回 大阪府公募公債(10年)	0.36	100,000	101,593	2025/ 1 /29
	第 2 回 大阪府公募公債(20年)	2.23	100,000	120,608	2029/11/16
	平成24年度第 5 回 京都府公募公債	0.82	30,000	30,598	2022/ 9 /20
	平成24年度第 8 回 京都府公募公債	0.73	30,000	30,580	2022/12/19
	平成27年度第 2 回 京都府公募公債(15年)	0.729	100,000	106,186	2030/ 4 /26
	平成29年度第 22 回 兵庫県公募公債	0.19	100,000	100,938	2028/ 1 /21
	第 2 回 兵庫県公募公債(30年)	2.36	100,000	139,977	2040/ 3 /19
	第 3 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	109,358	2027/ 7 /16
	第 4 回 兵庫県公募公債(12年)	0.73	100,000	104,249	2026/ 8 / 6
	平成26年度第 9 回 静岡県公募公債	0.554	20,000	20,478	2024/10/24
	第 3 回 静岡県公募公債(20年)	2.35	100,000	114,923	2026/ 9 /18
	第 10 回 静岡県公募公債(20年)	2.072	100,000	119,934	2030/ 6 /14
	平成24年度第 8 回 愛知県公募公債(10年)	0.835	100,000	101,989	2022/ 8 /29
	平成24年度第 12 回 愛知県公募公債(30年)	2.12	10,000	13,768	2042/ 9 /19

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 14 回 愛知県公募公債(15年)	1.314	100,000	109,671	2027/12/13
	平成25年度第 6 回 愛知県公募公債(10年)	0.877	100,000	102,786	2023/ 6 /27
	平成29年度第 6 回 愛知県公募公債(10年)	0.22	100,000	101,120	2027/ 7 /28
	平成30年度第 6 回 愛知県公募公債(30年)	0.777	100,000	109,299	2048/ 6 /19
	平成28年度第 1 回 広島県公募公債	0.08	100,000	100,117	2026/ 5 /25
	平成29年度第 5 回 広島県公募公債	0.245	100,000	101,411	2028/ 1 /25
	平成26年度第 1 回 広島県公募公債(20年)	1.41	100,000	117,481	2034/ 9 /12
	平成24年度第 1 回 埼玉県公募公債	1.05	100,000	102,183	2022/ 4 /26
	平成25年度第 1 回 埼玉県公募公債	0.586	100,000	101,716	2023/ 4 /18
	平成26年度第 5 回 埼玉県公募公債	0.611	100,000	102,527	2024/ 7 /29
	平成29年度第 4 回 埼玉県公募公債	0.19	100,000	100,872	2027/ 6 /22
	平成23年度第 3 回 福岡県公募公債	1.07	100,000	101,534	2021/ 8 /26
	平成24年度第 11 回 福岡県公募公債	0.8	100,000	102,277	2023/ 2 /27
	平成28年度第 6 回 福岡県公募公債	0.175	100,000	100,773	2026/12/22
	平成30年度第 2 回 福岡県公募公債(15年)	0.542	100,000	105,102	2033/10/17
	第 10 回 千葉県公募公債(20年)	1.8	100,000	118,974	2031/ 8 /18
	第 24 回 千葉県公募公債	0.559	100,000	105,819	2038/ 4 /15
	平成24年度第 2 回 新潟県公募公債	0.79	100,000	102,248	2023/ 2 /27
	第 84 回 共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	100,073	2020/ 3 /25
	第 85 回 共同発行市場公募地方債	1.44	100,000	100,191	2020/ 4 /24
	第 90 回 共同発行市場公募地方債	1.12	100,000	100,615	2020/ 9 /25
	第 96 回 共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	101,333	2021/ 3 /25
	第100回 共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	101,632	2021/ 7 /23
	第101回 共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	101,502	2021/ 8 /25
	第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,979	2022/ 6 /24
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,018	2022/10/25
	第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,271	2023/ 2 /24
	第129回 共同発行市場公募地方債	0.71	100,000	102,564	2023/12/25
	第130回 共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	102,816	2024/ 1 /25
	第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	102,521	2024/ 7 /25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	102,365	2024/ 8 /23
	第147回 共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	102,659	2025/ 6 /25
	第157回 共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,116	2026/ 4 /24
	第181回 共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,841	2028/ 4 /25
	第184回 共同発行市場公募地方債	0.175	100,000	100,809	2028/ 7 /25
	第188回 共同発行市場公募地方債	0.264	30,000	30,487	2028/11/24
	平成24年度第 1 回 滋賀県公募公債	0.79	30,600	31,231	2022/11/30
	平成30年度第 1 回 熊本市公募公債	0.264	100,000	101,630	2028/11/30
	平成22年度第 1 回 静岡市公募公債	1.008	12,000	12,086	2020/11/25
	第 5 回 大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	120,306	2028/ 9 /21
	第480回 名古屋市公募公債(10年)	0.825	100,000	102,009	2022/ 9 /20
	第 6 回 京都市公募公債(20年)	2.38	200,000	234,752	2027/ 9 /17

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 横浜市公募公債(30年)	2.49	100,000	134,069	2035/ 3 /20
	第 4 回 横浜市公募公債(30年)	2.54	100,000	138,093	2036/12/19
	第 14 回 横浜市公募公債(20年)	2.32	100,000	117,933	2028/ 3 /17
	平成24年度第 10 回 札幌市公募公債(10年)	0.8	100,000	102,133	2022/12/20
	平成27年度第 4 回 札幌市公募公債(10年)	0.51	100,000	102,451	2025/ 6 /20
	平成29年度第 3 回 札幌市公募公債(10年)	0.23	100,000	101,161	2027/ 6 /18
	第 11 回 川崎市公募公債(30年)	0.817	100,000	110,376	2048/ 3 /19
	平成23年度第 2 回 北九州市公募公債	1.06	11,000	11,203	2021/12/22
	平成24年度第 8 回 福岡市公募公債	0.68	100,000	101,964	2023/ 3 /24
	平成28年度第 5 回 広島市公募公債	0.24	100,000	101,277	2027/ 2 /26
	平成30年度第 6 回 広島市公募公債	0.146	100,000	100,626	2029/ 2 /22
	平成24年度第 1 回 福井県公募公債	0.8	100,000	102,020	2022/10/26
	平成25年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.75	100,000	102,788	2024/ 1 /31
	平成27年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.395	100,000	102,056	2026/ 1 /29
	平成29年度第 1 回 秋田県公募公債	0.2	145,900	147,347	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	102,435	2023/12/20
	第135回 福岡北九州高速道路債券	0.5	100,000	102,154	2025/ 3 /19
	小 計		9,104,940	9,692,709	
特殊債券(除く金融債)	第340回 政府保証道路債券	1.7	100,000	100,257	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	101,513	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	101,597	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	101,513	2021/ 8 /13
	第 29 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	24,500	24,917	2021/10/18
	第 30 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.0	74,000	75,320	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	14,286	2021/12/14
	F 116回 地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	109,932	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	102,021	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	102,038	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	102,362	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	33,652	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	101,643	2023/ 4 /21
	第 28 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.396	100,000	115,540	2033/ 4 /28
	F 181回 地方公共団体金融機構債券	1.109	100,000	106,582	2026/ 7 /28
	F 190回 地方公共団体金融機構債券	0.792	100,000	103,374	2024/10/24
	第 60 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.66	100,000	102,711	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	102,685	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	102,238	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	14,205	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	102,235	2025/ 9 /12
	F 308回 地方公共団体金融機構債券	1.192	100,000	115,314	2037/ 3 /19
	第 89 回 地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	100,125	2026/10/28
	第 98 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	101,003	2027/ 7 /16

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
第 99 回	政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	100,988	2027/ 8 /13
第 68 回	地方公共団体金融機構債券(20年)	0.53	100,000	104,458	2038/ 7 /28
第112回	地方公共団体金融機構債券	0.269	100,000	101,648	2028/ 9 /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	102,068	2021/ 3 /26
第 8 回	公営企業債券(30年)	2.5	10,000	13,421	2035/ 9 /21
第 13 回	公営企業債券(20年)	2.16	10,000	11,114	2025/ 6 /20
第 22 回	公営企業債券(20年)	2.32	100,000	116,373	2027/ 6 /18
第 10 回	日本政策金融公庫社債	2.167	100,000	120,598	2030/ 3 /19
第 19 回	政府保証日本政策金融公庫債券	1.1	100,000	102,055	2021/12/17
第 47 回	政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	100,000	100,528	2027/ 9 /24
第 53 回	政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	162,000	164,459	2028/ 9 /15
第 6 回	政府保証新関西国際空港債券	0.155	100,000	100,999	2027/ 8 /27
第 11 回	政府保証日本政策投資銀行債券	1.0	100,000	101,605	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	153,953	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	115,386	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	160,037	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	155,380	2047/ 3 /20
第 23 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	120,000	140,463	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	14,086	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	100,049	2020/ 3 /19
第123回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	100,000	102,618	2024/ 3 /19
第125回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.665	100,000	102,517	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	102,092	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	103,349	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	105,772	2023/ 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	100,050	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	100,000	100,628	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	118,317	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	101,977	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	101,654	2023/ 4 /28
第190回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.605	100,000	101,909	2023/ 5 /31
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	1,028	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	102,442	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	102,583	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	2,054	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	102,250	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	13,278	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	100,000	101,765	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	100,622	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	105,988	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	106,389	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	13,124	2028/ 3 /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	107,384	2038/ 8 /31
第379回	政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.419	100,000	103,645	2039/ 3 /31
第 11 回	公営企業債券(20年)	2.11	100,000	110,355	2025/ 3 /24
第 7 回	阪神高速道路債券	2.18	100,000	110,606	2025/ 3 /21
第 18 回	政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	101,986	2023/ 3 /22
第 21 回	政府保証中部国際空港債券	0.45	100,000	102,157	2025/ 3 /17
第 3 回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	100,000	115,390	2027/ 3 /19
第 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	29,514	30,965	2042/ 6 /10
第 30 回	一般担保住宅金融支援機構債券	2.08	100,000	108,743	2024/ 6 /20
第 30 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	27,927	30,188	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	15,895	16,234	2032/11/10
第 36 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	30,294	32,216	2045/ 5 /10
第 38 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	33,160	35,143	2045/ 7 /10
第 39 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	33,070	34,908	2045/ 8 /10
第 43 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	79,816	85,028	2045/12/10
第 45 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	32,988	35,196	2046/ 2 /10
第 55 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	44,457	47,193	2046/12/10
第 60 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	45,266	47,936	2047/ 5 /10
第108回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.434	100,000	109,900	2027/ 6 /18
第 96 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	71,766	74,268	2050/ 5 /10
第101回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.89	71,679	74,850	2050/10/10
第106回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	78,547	80,485	2051/ 3 /10
第110回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.23	167,910	168,961	2051/ 7 /10
第115回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	86,172	87,650	2051/12/10
第203回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.24	100,000	101,226	2027/ 3 /19
第119回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	87,497	89,278	2052/ 4 /10
第215回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.23	100,000	101,213	2027/ 8 /20
第125回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	90,142	91,792	2052/10/10
第132回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	92,212	93,796	2053/ 5 /10
第133回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	92,887	94,617	2053/ 6 /10
第240回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.04	100,000	99,998	2023/ 9 /20
第135回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	93,987	95,522	2053/ 8 /10
第137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	94,804	96,909	2053/10/10
第138回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	95,343	97,671	2053/11/10
第139回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	95,470	97,520	2053/12/10
第 3 回	貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券	0.16	80,513	80,827	2033/ 1 /10
第 2 回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.61	23,614	24,053	2036/ 5 /10
第 29 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	13,044	13,450	2040/ 4 /10
第 34 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	15,998	16,717	2040/ 9 /10
第 38 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.91	13,546	14,073	2041/ 1 /10
第 29 回	西日本高速道路株式会社債	0.31	200,000	202,650	2026/ 2 /12
第 51 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.762	100,000	101,849	2022/ 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 65 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,681	2024/ 5 /29
第 68 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.586	100,000	102,405	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	106,816	2038/ 8 /27
第 7 回	本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	111,492	2025/ 6 /20
第 78 回	株式会社日本政策投資銀行	0.225	100,000	101,123	2027/ 4 /13
第 96 回	株式会社日本政策投資銀行	0.195	100,000	100,978	2028/ 7 /12
第 37 回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	100,000	119,336	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	120,948	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	101,792	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	119,774	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	133,509	2042/ 8 /29
第 7 回	道路債券	2.7	50,000	53,059	2022/ 6 /20
第 28 回	道路債券	2.83	200,000	270,448	2033/12/20
第 4 回	公営企業債券(30年)	2.95	100,000	137,335	2034/ 3 /24
第 20 回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8	100,000	119,144	2032/ 1 /28
第 23 回	国際協力銀行債券	2.09	100,000	111,719	2025/12/19
第 3 回	都市再生債券	2.87	100,000	112,131	2024/ 6 /20
第 96 回	都市再生債券	0.599	100,000	102,556	2024/ 9 /20
第342回	東京交通債券	2.4	30,000	31,609	2022/ 6 /21
第 8 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	15,082	15,753	2042/12/10
第 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1	15,531	16,259	2043/ 1 /10
第 25 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	47,182	51,331	2044/ 6 /10
第 28 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	25,559	27,511	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	15,658	15,998	2032/11/10
第 29 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	28,473	30,801	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	15,807	16,157	2032/11/10
第 31 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	28,832	31,115	2044/12/10
第 32 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	27,469	29,466	2045/ 1 /10
第 42 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	41,317	43,763	2045/11/10
第 66 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	48,646	51,112	2047/11/10
第 69 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	50,158	53,127	2048/ 2 /10
第 70 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	44,156	46,587	2048/ 3 /10
第 71 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	42,651	44,653	2048/ 4 /10
第 79 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	45,420	47,566	2048/12/10
第146回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.757	100,000	102,792	2024/ 1 /19
第 81 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	48,586	50,950	2049/ 2 /10
第149回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.704	100,000	102,695	2024/ 3 /19
第157回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	101,897	2025/ 5 /20
第 1 回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	34,908	35,469	2036/ 5 /10
第 6 回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	12,667	13,107	2037/ 5 /10
第 9 回	貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	26,616	27,696	2037/ 5 /10
第 5 回	国際協力機構債券	1.918	100,000	118,496	2030/ 9 /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 36 回 中日本高速道路株式会社債	1.066	100,000	101,591	2021/ 9 /17
	小 計		11,932,736	12,808,459	
金 融 債 券	い第787号農林債	0.24	200,000	200,282	2020/12/25
	第321回 信金中金債(5 年)	0.03	100,000	99,989	2021/ 8 /27
	第326回 信金中金債(5 年)	0.05	100,000	100,023	2022/ 1 /27
	第338回 信金中金債(5 年)	0.11	100,000	100,191	2023/ 1 /27
	第343回 信金中金債(5 年)	0.11	100,000	100,218	2023/ 6 /27
	第352回 信金中金債(5 年)	0.07	100,000	100,097	2024/ 3 /27
	第236号商工債(3年)	0.02	100,000	99,935	2022/ 9 /27
	小 計		800,000	800,735	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第506回 中部電力	0.695	100,000	102,977	2025/ 9 /25
	第510回 関西電力株式会社社債(一般担保付)	0.49	100,000	100,946	2027/ 7 /23
	第323回 北陸電力	0.858	100,000	105,426	2037/ 6 /25
	第245回 四国電力	2.0	100,000	102,526	2021/ 6 /25
	第298回 四国電力	0.962	100,000	106,811	2043/ 4 /24
	第400回 九州電力	1.777	100,000	100,233	2020/ 4 /24
	第350回 北海道電力	0.754	100,000	101,905	2038/ 3 /25
	第 6 回 東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,847	2027/ 8 /31
	第 7 回 東京電力パワーグリッド	0.46	100,000	100,883	2022/10/24
	第 26 回 東京電力パワーグリッド株式会社社債 (一般担保付)	1.31	100,000	103,405	2034/ 4 /24
	第 3 回 GLP投資法人無担保投資法人債	0.51	100,000	100,237	2020/12/25
	第 15 回 東急不動産ホールディングス	0.78	100,000	101,552	2032/10/20
	第 3 回 富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	102,240	2022/12/ 2
	第 12 回 パナソニック	0.387	100,000	100,013	2020/ 3 /19
	第 14 回 トヨタ自動車	0.963	100,000	102,739	2023/ 3 /20
	第 57 回 三菱東京UFJ銀行	2.22	100,000	105,624	2022/10/27
	第 9 回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	101,801	2021/ 4 /28
	第 3 回 NTTファイナンス	0.529	100,000	102,248	2031/12/19
	第 28 回 リコーリース	0.345	100,000	100,927	2027/ 7 /20
	第 54 回 日立キャピタル	0.416	100,000	100,549	2021/ 9 /17
	第 65 回 三菱地所	2.04	100,000	120,024	2032/12/20
	第 18 回 イオンモール株式会社	1.05	100,000	102,974	2038/ 7 / 2
	第 17 回 東日本旅客鉄道	2.3	100,000	102,211	2021/ 2 /25
	第 32 回 東日本旅客鉄道	2.26	100,000	108,797	2024/ 3 /19
	第 69 回 東日本旅客鉄道	1.222	100,000	100,453	2020/ 7 /22
	第107回 東日本旅客鉄道	1.415	200,000	242,852	2045/ 1 /27
	第127回 東日本旅客鉄道	0.675	100,000	104,841	2038/ 1 /26
	第 52 回 西日本旅客鉄道株式会社	1.157	100,000	116,581	2058/ 4 /25
	第 45 回 東海旅客鉄道	2.321	100,000	119,409	2029/ 6 /19
	第 47 回 東海旅客鉄道	2.375	100,000	136,193	2039/12/16
	第 4 回 東京地下鉄	2.38	10,000	11,407	2026/ 6 /19
	第 13 回 東京地下鉄	1.702	100,000	116,798	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	112,678	2026/ 6 /22
	第 32 回 ANAホールディングス株式会社	0.99	100,000	104,536	2036/ 6 / 9
	第 63 回 日本電信電話	0.69	100,000	101,817	2023/ 3 /20
	第 11 回 電源開発	2.05	100,000	109,453	2025/ 3 /19
	第 58 回 電源開発	0.705	100,000	102,301	2038/ 7 /20
	第 28 回 東京瓦斯	2.29	100,000	115,426	2027/ 6 /15
	第 20 回 大阪瓦斯	1.79	100,000	100,950	2020/ 9 /18
	第 27 回 エヌ・ティ・ティ・データ	0.9	100,000	102,626	2023/ 6 /20
	第 30 回 フランス相互信用連合銀行	0.317	100,000	100,265	2026/10/ 9
	第 18 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.329	100,000	100,368	2025/ 1 /24
	第 14 回 クレディ・アグリコル・エス・エー	0.459	100,000	101,088	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	100,435	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	104,193	2021/12/28
	第 10 回 オーストラリア・ニュージーランド銀行	0.293	100,000	100,618	2024/ 1 /23
	小 計		4,610,000	4,884,183	
	合 計		149,587,676	163,851,623	

(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('20年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 163,851,623	% 99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,545,618	0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	165,397,241	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

('20年3月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	165,397,241,649
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,109,344,369
公 社 債 (評 価 額)	163,851,623,705
未 収 利 息	429,289,481
前 払 費 用	6,984,094
(B) 負 債	259,191,134
未 払 解 約 金	259,187,265
未 払 利 息	3,058
そ の 他 未 払 費 用	811
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	165,138,050,515
元 本	126,401,838,965
次 期 繰 越 損 益 金	38,736,211,550
(D) 受 益 権 総 口 数	126,401,838,965口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	13,065円

(注1) 期首元本額 120,372,703,902円

期中追加設定元本額 33,057,920,239円

期中一部解約元本額 27,028,785,176円

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

AMC/ステート・ストリート・リスク/ビエット/ランス・オープン (ステイブル)	1,201,682,192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>	3,654,211,428円
バランスファンドVA30A <適格機関投資家限定>	13,344,145円
バランスファンドVA30B <適格機関投資家限定>	403,374,137円
バランスファンドVA40A <適格機関投資家限定>	447,075円
バランスファンドVA40B <適格機関投資家限定>	13,844,979円
バランスファンドVA50A <適格機関投資家限定>	22,249,405円
バランスファンドVA50B <適格機関投資家限定>	13,689,797,366円
バランスファンドVA50C <適格機関投資家限定>	11,575,829円
バランスファンドVA25A <適格機関投資家限定>	6,096,978,524円
バランスファンドVA37.5A <適格機関投資家限定>	2,288,399,296円
バランスファンドVA75A <適格機関投資家限定>	16,953,593円
4資産 バランス20VA <適格機関投資家限定>	1,760,990,089円
4資産 バランス40VA <適格機関投資家限定>	7,079,106,349円
4資産 バランス30VA <適格機関投資家限定>	1,982,955,378円
バランスファンドVA35A <適格機関投資家限定>	6,511,268,166円
バランスファンドVA40C <適格機関投資家限定>	170,437,092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>	125,694,258円
グローバル4資産30VA <適格機関投資家限定>	72,808,304円
グローバル4資産45VA <適格機関投資家限定>	39,196,026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>	9,948,029,496円
4資産 バランス30VA2 <適格機関投資家限定>	67,856,570円
バランスファンドVA25B <適格機関投資家限定>	3,502,323,391円
バランスファンドVA20A <適格機関投資家限定>	21,712,414円
バランスファンドVA35B <適格機関投資家限定>	13,593,884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>	8,592,860,860円
日本債券インデックス・ファンド <適格機関投資家限定>	948,287,635円
4資産インデックスバランスVA20 <適格機関投資家限定>	2,803,150,249円
世界分散ファンドVA25A <適格機関投資家限定>	10,119,485,997円
4資産インデックスバランスVA50 <適格機関投資家限定>	14,633,603円
TaDRISK/ビエット/マルチ/戦略ファンド (ステイブル) 年金 (適格機関投資家限定)	481,452,657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>	719,264,443円
TaDRISK/ビエット/マルチ/戦略ファンド (ステイブル) <適格機関投資家限定>	424,040,756円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,719,226,326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>	38,808,004,071円
グローバルバランス40VA <適格機関投資家限定>	2,958,334円
グローバルバランス40VA2 <適格機関投資家限定>	2,128,245,268円
グローバルバランス40VA3 <適格機関投資家限定>	116,143,221円
グローバルバランス50VA <適格機関投資家限定>	44,898,099円
世界株式VCファンド <適格機関投資家限定>	770,358,060円

◎損益の状況

当期(自'19年3月6日 至'20年3月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,424,294,897
受 取 利 息	1,425,182,505
支 払 利 息	△ 887,608
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,773,319,894
売 買 損 益	2,357,862,471
売 買 損 益	△ 584,542,577
(C) そ の 他 費 用	△ 21,663
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	3,197,593,128
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	33,903,824,341
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,932,151,248
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 8,297,357,167
(H) 計 (D+E+F+G)	38,736,211,550
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	38,736,211,550

(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。