

○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5期運用報告書(全体版) (決算日2021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、2021年3月5日に第5期の決算を行いましたので、運用状況をご報告させていただきます。

今後とも、ご愛顧のほどよろしくお願い申し上げます。

<ファンドに関する照会先>

営業部

電話番号 03(4530)7333

お問い合わせ時間 (営業日) 9:00~17:00

ホームページアドレス www.ssga.com/jp

ステート・ストリート・グローバル・アドバイザーズ株式会社

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

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			<ベンチマーク> NOMURA-BPI総合指数		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
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
5期('21年 3月 5日)	9,849	0	△ 2.0	9,944	△ 1.8	99.3	-	2,416

(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	%		%	%	%
'20年 3月 5日	10,047	-	10,125	-	99.1	-
3月末	9,935	△ 1.1	10,013	△ 1.1	98.8	-
4月末	9,967	△ 0.8	10,048	△ 0.8	99.6	-
5月末	9,922	△ 1.2	10,005	△ 1.2	99.9	-
6月末	9,881	△ 1.7	9,964	△ 1.6	99.5	-
7月末	9,914	△ 1.3	9,999	△ 1.2	99.5	-
8月末	9,868	△ 1.8	9,952	△ 1.7	99.6	-
9月末	9,895	△ 1.5	9,981	△ 1.4	99.4	-
10月末	9,877	△ 1.7	9,966	△ 1.6	99.7	-
11月末	9,889	△ 1.6	9,979	△ 1.4	99.7	-
12月末	9,889	△ 1.6	9,981	△ 1.4	99.7	-
'21年 1月末	9,864	△ 1.8	9,956	△ 1.7	99.5	-
2月末	9,781	△ 2.6	9,874	△ 2.5	99.1	-
(期末)						
'21年 3月 5日	9,849	△ 2.0	9,944	△ 1.8	99.3	-

(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

(2020年3月6日から2021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5期	10,047円	9,849円	0円	-2.0%	-1.8%

当期末の基準価額は9,849円となり、前期末の10,047円に比べて198円の下落となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

－期初、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たことを背景に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】

－前期の2020年2月下旬から3月上旬にかけて日本債券が大きく買われましたが、当期に入り3月中旬からはその反動で大幅に売り戻され、債券価格が下落したことが基準価額にマイナスの寄与となりました。
－期後半、新型コロナウイルスのワクチン普及への期待と世界的景気回復期待の高まりを背景に債券が売られ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-2.0%となり、ベンチマークの騰落率(-1.8%)を0.2%下回りました。主な要因は以下の通りです。

【マイナスの要因】

－信託報酬等の費用控除がマイナスに寄与しました。

収益分配金

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

投資環境

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期前半、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たことを背景に前期の2020年2月下旬から3月上旬にかけて債券が大きく買われた反動から3月中旬は大幅に売り戻されました。3月、日銀は金融政策決定会合を予定よりも前倒しで実施し、金融緩和の強化を決定しました。その後は日本10年国債利回りが概ね0.00%から0.05%の範囲で推移する安定的な展開が続きました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチン普及への期待と世界的景気回復期待の高まりを背景に債券が売ら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-0.11%から0.21%上昇の0.10%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

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

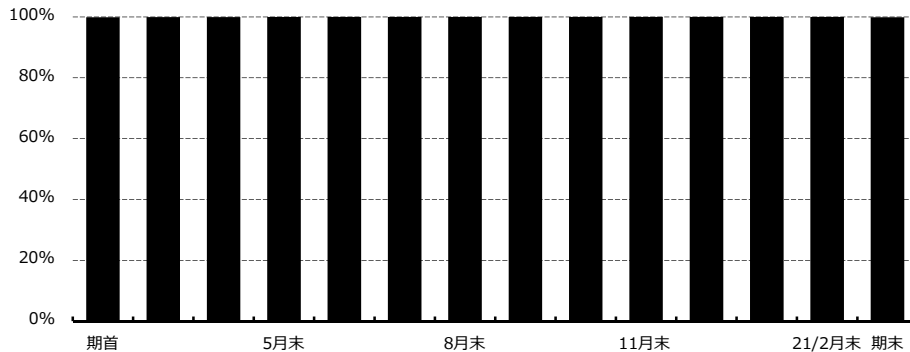
当ファンドは「日本債券インデックス・マザーファンド」(以下、マザーファンドといいます)受益証券を主な投資対象としています。マザーファンドの組入比率は原則として高位を保ちます。

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 (2020年3月6日~2021年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	9,890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。

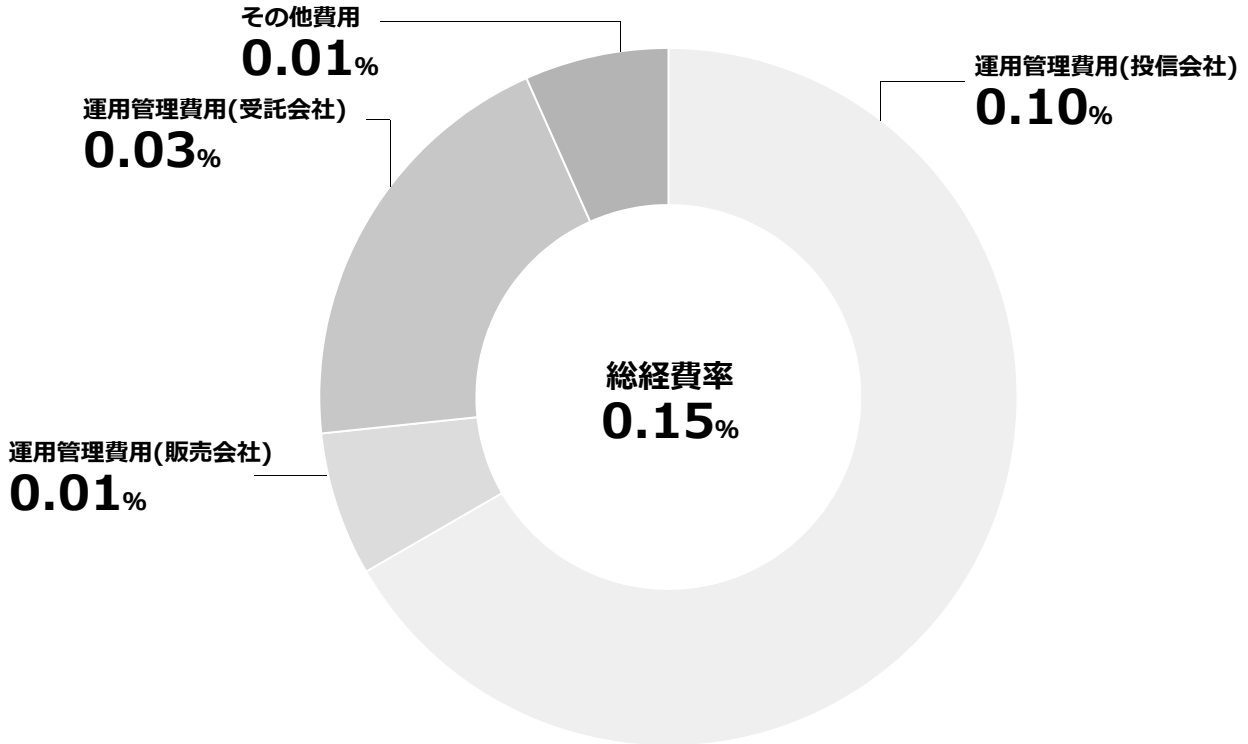
(注3) その他費用は、当ファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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('20年3月6日から'21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	1,348,794	1,741,199	1,186,114	1,526,399

(注) 単位未満は切り捨てています。

◎主要な売買銘柄('20年3月6日から'21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143回 利付国債(5年)	2,830,672	第356回 利付国債(10年)	2,078,308
第358回 利付国債(10年)	2,321,803	第143回 利付国債(5年)	1,919,802
第145回 利付国債(5年)	2,120,928	第129回 利付国債(5年)	1,754,182
第360回 利付国債(10年)	2,116,113	第139回 利付国債(5年)	1,315,017
第144回 利付国債(5年)	2,017,530	第401回 利付国債(2年)	1,303,971
第146回 利付国債(5年)	1,913,093	第130回 利付国債(5年)	1,202,676
第418回 利付国債(2年)	1,808,406	第131回 利付国債(5年)	1,102,475
第359回 利付国債(10年)	1,609,853	第128回 利付国債(5年)	1,002,790
第173回 利付国債(20年)	1,547,602	第404回 利付国債(2年)	902,025
第174回 利付国債(20年)	1,281,156	第358回 利付国債(10年)	807,985

(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('20年3月6日から'21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('21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 1,719,226	千口 1,881,905	千円 2,414,673

(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125,473,996千口です。

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('21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 2,414,673	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	20,652	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	2,435,325	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

('21年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	2,435,325,879
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,209,350
日本債券インデックス・マザーファンド(評価額)	2,414,673,317
未 収 入 金	3,443,212
(B) 負 債	18,420,052
未 払 解 約 金	16,725,131
未 払 信 託 報 酬	1,573,867
未 払 利 息	46
そ の 他 未 払 費 用	121,008
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	2,416,905,827
元 本	2,453,847,318
次 期 繰 越 損 益 金	△ 36,941,491
(D) 受 益 権 総 口 数	2,453,847,318口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	9,849円

- (注1) 期首元本額 2,237,478,685円
 期中追加設定元本額 2,487,611,461円
 期中一部解約元本額 2,271,242,828円
 (注2) 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は36,941,491円です。

◎損益の状況

当期(自'20年3月6日 至'21年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 7,061
支 払 利 息	△ 7,061
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 21,913,863
売 買 益	16,593,053
売 買 損	△ 38,506,916
(C) 信 託 報 酬 等	△ 3,693,186
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 25,614,110
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	14,086,175
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 25,413,556
(配 当 等 相 当 額)	(68,704,103)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 94,117,659)
(G) 計 (D+E+F)	△ 36,941,491
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G+H)	△ 36,941,491
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 25,413,556
(配 当 等 相 当 額)	(70,445,591)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 95,859,147)
分 配 準 備 積 立 金	30,745,125
繰 越 損 益 金	△ 42,273,060

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

(注5) 分配金の計算過程

A	費用控除後の配当等収益	16,658,950円
B	費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益	0円
C	収益調整金	70,445,591円
D	分配準備積立金	14,086,175円
E	分配対象収益(A+B+C+D)	101,190,716円
F	分配対象収益(1万口当たり)	412円
G	分配金	0円
H	分配金(1万口当たり)	0円

◎1万口当たり分配原資の内訳(税込み)

項 目	第5期 (2020年3月6日～ 2021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	412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18期 運用報告書 (決算日2021年3月5日)

日本債券インデックス・マザーファンドの第18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	%	12,600	%			
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
18期('21年 3月 5日)	12,831	△1.8	12,839	△1.8	99.4	-	160,991

(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	%	13,072	%		
(期首) '20年 3月 5日	13,065	-	13,072	-	99.2	-
3月末	12,922	△1.1	12,927	△1.1	98.9	-
4月末	12,965	△0.8	12,972	△0.8	99.7	-
5月末	12,908	△1.2	12,917	△1.2	99.9	-
6月末	12,857	△1.6	12,864	△1.6	99.5	-
7月末	12,902	△1.2	12,910	△1.2	99.5	-
8月末	12,844	△1.7	12,849	△1.7	99.6	-
9月末	12,881	△1.4	12,886	△1.4	99.4	-
10月末	12,860	△1.6	12,867	△1.6	99.7	-
11月末	12,877	△1.4	12,883	△1.4	99.7	-
12月末	12,879	△1.4	12,886	△1.4	99.7	-
'21年 1月末	12,848	△1.7	12,854	△1.7	99.5	-
2月末	12,742	△2.5	12,748	△2.5	99.1	-
(期末) '21年 3月 5日	12,831	△1.8	12,839	△1.8	99.4	-

(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

(2020年3月6日から2021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12,831円となり、前期末の13,065円に比べて234円の下落となりました。

基準価額の変動要因

【プラスの要因】

－期初、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たことを背景に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】

－前期の2020年2月下旬から3月上旬にかけて日本債券が大きく買われましたが、当期に入り3月中旬からはその反動で大幅に売り戻され、債券価格が下落したことが基準価額にマイナスの寄与となりました。
 －期後半、新型コロナウイルスのワクチン普及への期待と世界的景気回復期待の高まりを背景に債券が売られ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、ベンチマークの騰落率(-1.8%)と同水準となり、当期の運用実績はベンチマークに連動した結果となりました。

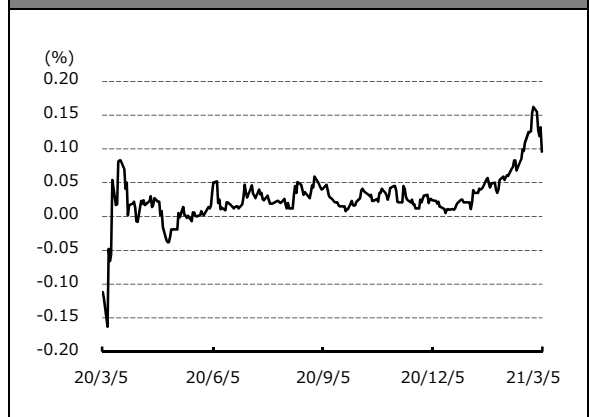
投資環境

(2020年3月6日から2021年3月5日まで)

日本債券市場

日本債券市場は、期前半、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たことを背景に前期の2020年2月下旬から3月上旬にかけて債券が大きく買われた反動から3月中旬は大幅に売り戻されました。3月、日銀は金融政策決定会合を予定よりも前倒しで実施し、金融緩和の強化を決定しました。その後は日本10年国債利回りが概ね0.00%から0.05%の範囲で推移する安定的な展開が続きました。期末にかけては新型コロナウイルスのワクチン普及への期待と世界的景気回復期待の高まりを背景に債券が売ら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-0.11%から0.21%上昇の0.10%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

(2020年3月6日から2021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 (2020年3月6日~2021年3月5日)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
平均基準価額	12,873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('20年3月6日から'21年3月5日まで)

○公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 31,314,995	千円 31,670,772
	地 方 債 証 券	625,652	- (412,000)
	特 殊 債 券	932,431	- (925,205)
	社 債 券	1,217,102	102,536 (600,000)

(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('20年3月6日から'21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143回 利付国債(5年)	2,830,672	第356回 利付国債(10年)	2,078,308
第358回 利付国債(10年)	2,321,803	第143回 利付国債(5年)	1,919,802
第145回 利付国債(5年)	2,120,928	第129回 利付国債(5年)	1,754,182
第360回 利付国債(10年)	2,116,113	第139回 利付国債(5年)	1,315,017
第144回 利付国債(5年)	2,017,530	第401回 利付国債(2年)	1,303,971
第146回 利付国債(5年)	1,913,093	第130回 利付国債(5年)	1,202,676
第418回 利付国債(2年)	1,808,406	第131回 利付国債(5年)	1,102,475
第359回 利付国債(10年)	1,609,853	第128回 利付国債(5年)	1,002,790
第173回 利付国債(20年)	1,547,602	第404回 利付国債(2年)	902,025
第174回 利付国債(20年)	1,281,156	第358回 利付国債(10年)	807,985

(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('20年3月6日から'21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('21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	123,160,000 (100,000)	131,505,351 (98,593)	81.7 (0.1)	- (-)	54.1 (-)	21.1 (0.1)	6.5 (-)
地 方 債 証 券	9,255,340 (9,155,340)	9,784,401 (9,676,322)	6.1 (6.0)	- (-)	3.4 (3.4)	1.6 (1.5)	1.1 (1.1)
特 殊 債 証 券 (除 く 金 融 債)	11,907,531 (11,677,531)	12,615,024 (12,367,347)	7.8 (7.7)	- (-)	4.4 (4.4)	2.3 (2.3)	1.1 (1.0)
金 融 債 証 券	800,000 (800,000)	800,501 (800,501)	0.5 (0.5)	- (-)	- (-)	0.2 (0.2)	0.3 (0.3)
普 通 社 債 証 券 (含む投資法人債券)	5,110,000 (4,810,000)	5,296,135 (4,983,248)	3.3 (3.1)	- (-)	2.2 (2.2)	0.6 (0.5)	0.4 (0.4)
合 計	150,232,871 (26,542,871)	160,001,413 (27,926,011)	99.4 (17.3)	- (-)	64.1 (9.9)	25.8 (4.6)	9.5 (2.9)

(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416回 利付国債(2年)	0.1	1,000,000	1,003,490	2022/ 9 / 1
	第418回 利付国債(2年)	0.1	1,800,000	1,807,146	2022/11/ 1
	第132回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,504,440	2022/ 6 /20
	第133回 利付国債(5年)	0.1	1,500,000	1,505,310	2022/ 9 /20
	第134回 利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,004,110	2022/12/20
	第135回 利付国債(5年)	0.1	1,900,000	1,908,892	2023/ 3 /20
	第136回 利付国債(5年)	0.1	1,700,000	1,708,959	2023/ 6 /20
	第137回 利付国債(5年)	0.1	1,550,000	1,559,067	2023/ 9 /20
	第139回 利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,208,400	2024/ 3 /20
	第140回 利付国債(5年)	0.1	1,300,000	1,309,646	2024/ 6 /20
	第141回 利付国債(5年)	0.1	900,000	907,029	2024/ 9 /20
	第142回 利付国債(5年)	0.1	1,200,000	1,209,804	2024/12/20
	第143回 利付国債(5年)	0.1	900,000	907,650	2025/ 3 /20
	第144回 利付国債(5年)	0.1	1,900,000	1,916,758	2025/ 6 /20
	第145回 利付国債(5年)	0.1	2,100,000	2,119,614	2025/ 9 /20
	第146回 利付国債(5年)	0.1	1,900,000	1,917,803	2025/12/20
	第 32 回 利付国債(30年)	2.3	500,000	667,430	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	
国 債 証 券	第116回 利付国債(20年)	2.2	500,000	596,935	2030/ 3 /20
	第 1 回 利付国債(40年)	2.4	160,000	230,473	2048/ 3 /20
	第 2 回 利付国債(40年)	2.2	500,000	698,675	2049/ 3 /20
	第 3 回 利付国債(40年)	2.2	250,000	351,072	2050/ 3 /20
	第 4 回 利付国債(40年)	2.2	250,000	353,587	2051/ 3 /20
	第 5 回 利付国債(40年)	2.0	130,000	178,079	2052/ 3 /20
	第 6 回 利付国債(40年)	1.9	150,000	202,665	2053/ 3 /20
	第 7 回 利付国債(40年)	1.7	160,000	208,233	2054/ 3 /20
	第 8 回 利付国債(40年)	1.4	50,000	60,874	2055/ 3 /20
	第 9 回 利付国債(40年)	0.4	1,730,000	1,577,327	2056/ 3 /20
	第 10 回 利付国債(40年)	0.9	100,000	106,986	2057/ 3 /20
	第 11 回 利付国債(40年)	0.8	110,000	114,242	2058/ 3 /20
	第 12 回 利付国債(40年)	0.5	1,050,000	985,435	2059/ 3 /20
	第 13 回 利付国債(40年)	0.5	600,000	561,486	2060/ 3 /20
	第323回 利付国債(10年)	0.9	200,000	202,638	2022/ 6 /20
	第324回 利付国債(10年)	0.8	400,000	404,760	2022/ 6 /20
	第325回 利付国債(10年)	0.8	500,000	507,120	2022/ 9 /20
	第326回 利付国債(10年)	0.7	300,000	304,428	2022/12/20
	第327回 利付国債(10年)	0.8	700,000	711,592	2022/12/20
	第328回 利付国債(10年)	0.6	500,000	507,435	2023/ 3 /20
	第329回 利付国債(10年)	0.8	500,000	510,595	2023/ 6 /20
	第330回 利付国債(10年)	0.8	800,000	818,832	2023/ 9 /20
	第331回 利付国債(10年)	0.6	500,000	509,225	2023/ 9 /20
	第332回 利付国債(10年)	0.6	600,000	612,246	2023/12/20
	第333回 利付国債(10年)	0.6	900,000	919,863	2024/ 3 /20
	第334回 利付国債(10年)	0.6	700,000	716,618	2024/ 6 /20
	第335回 利付国債(10年)	0.5	800,000	817,472	2024/ 9 /20
	第336回 利付国債(10年)	0.5	1,000,000	1,023,190	2024/12/20
	第337回 利付国債(10年)	0.3	1,000,000	1,015,580	2024/12/20
	第338回 利付国債(10年)	0.4	650,000	663,422	2025/ 3 /20
	第339回 利付国債(10年)	0.4	900,000	919,557	2025/ 6 /20
	第340回 利付国債(10年)	0.4	1,480,000	1,514,069	2025/ 9 /20
	第341回 利付国債(10年)	0.3	1,300,000	1,324,687	2025/12/20
	第342回 利付国債(10年)	0.1	800,000	807,680	2026/ 3 /20
	第343回 利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,211,460	2026/ 6 /20
	第344回 利付国債(10年)	0.1	1,200,000	1,211,676	2026/ 9 /20
	第345回 利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,009,870	2026/12/20
	第346回 利付国債(10年)	0.1	800,000	807,992	2027/ 3 /20
	第347回 利付国債(10年)	0.1	750,000	757,567	2027/ 6 /20
	第348回 利付国債(10年)	0.1	900,000	909,144	2027/ 9 /20
	第349回 利付国債(10年)	0.1	1,260,000	1,272,864	2027/12/20
	第350回 利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,010,230	2028/ 3 /20

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第351回 利付国債(10年)	0.1	1,500,000	1,514,775	2028/ 6 /20
	第352回 利付国債(10年)	0.1	1,160,000	1,170,938	2028/ 9 /20
	第353回 利付国債(10年)	0.1	1,500,000	1,513,440	2028/12/20
	第354回 利付国債(10年)	0.1	1,100,000	1,108,833	2029/ 3 /20
	第355回 利付国債(10年)	0.1	930,000	936,537	2029/ 6 /20
	第356回 利付国債(10年)	0.1	1,150,000	1,157,337	2029/ 9 /20
	第357回 利付国債(10年)	0.1	1,100,000	1,106,259	2029/12/20
	第358回 利付国債(10年)	0.1	1,500,000	1,507,410	2030/ 3 /20
	第359回 利付国債(10年)	0.1	1,150,000	1,154,772	2030/ 6 /20
	第360回 利付国債(10年)	0.1	2,100,000	2,105,964	2030/ 9 /20
	第361回 利付国債(10年)	0.1	1,000,000	1,001,450	2030/12/20
	第 1 回 利付国債(30年)	2.8	300,000	370,602	2029/ 9 /20
	第 2 回 利付国債(30年)	2.4	380,000	460,031	2030/ 2 /20
	第 3 回 利付国債(30年)	2.3	300,000	361,815	2030/ 5 /20
	第 5 回 利付国債(30年)	2.2	100,000	121,326	2031/ 5 /20
	第 6 回 利付国債(30年)	2.4	180,000	223,608	2031/11/20
	第 7 回 利付国債(30年)	2.3	300,000	371,865	2032/ 5 /20
	第 8 回 利付国債(30年)	1.8	300,000	356,754	2032/11/22
	第 9 回 利付国債(30年)	1.4	100,000	114,344	2032/12/20
	第 12 回 利付国債(30年)	2.1	300,000	370,617	2033/ 9 /20
	第 13 回 利付国債(30年)	2.0	300,000	367,782	2033/12/20
	第 14 回 利付国債(30年)	2.4	200,000	256,050	2034/ 3 /20
	第 15 回 利付国債(30年)	2.5	200,000	259,360	2034/ 6 /20
	第 16 回 利付国債(30年)	2.5	200,000	260,284	2034/ 9 /20
	第 17 回 利付国債(30年)	2.4	200,000	258,338	2034/12/20
	第 18 回 利付国債(30年)	2.3	200,000	256,278	2035/ 3 /20
	第 19 回 利付国債(30年)	2.3	200,000	256,902	2035/ 6 /20
	第 20 回 利付国債(30年)	2.5	100,000	131,653	2035/ 9 /20
	第 21 回 利付国債(30年)	2.3	200,000	258,094	2035/12/20
	第 22 回 利付国債(30年)	2.5	200,000	264,622	2036/ 3 /20
	第 23 回 利付国債(30年)	2.5	100,000	132,637	2036/ 6 /20
	第 24 回 利付国債(30年)	2.5	320,000	425,456	2036/ 9 /20
	第 25 回 利付国債(30年)	2.3	100,000	130,144	2036/12/20
	第 26 回 利付国債(30年)	2.4	150,000	198,033	2037/ 3 /20
	第 27 回 利付国債(30年)	2.5	320,000	429,561	2037/ 9 /20
第 28 回 利付国債(30年)	2.5	300,000	404,331	2038/ 3 /20	
第 29 回 利付国債(30年)	2.4	200,000	267,300	2038/ 9 /20	
第 30 回 利付国債(30年)	2.3	350,000	463,407	2039/ 3 /20	
第 31 回 利付国債(30年)	2.2	400,000	524,252	2039/ 9 /20	
第 33 回 利付国債(30年)	2.0	400,000	514,108	2040/ 9 /20	
第 34 回 利付国債(30年)	2.2	550,000	730,224	2041/ 3 /20	
第 35 回 利付国債(30年)	2.0	520,000	672,786	2041/ 9 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第 36 回 利付国債(30年)	2.0	480,000	622,953	2042/ 3 /20
	第 37 回 利付国債(30年)	1.9	330,000	423,116	2042/ 9 /20
	第 38 回 利付国債(30年)	1.8	200,000	253,106	2043/ 3 /20
	第 39 回 利付国債(30年)	1.9	330,000	425,191	2043/ 6 /20
	第 40 回 利付国債(30年)	1.8	350,000	443,954	2043/ 9 /20
	第 41 回 利付国債(30年)	1.7	300,000	374,406	2043/12/20
	第 42 回 利付国債(30年)	1.7	330,000	412,216	2044/ 3 /20
	第 43 回 利付国債(30年)	1.7	400,000	500,112	2044/ 6 /20
	第 44 回 利付国債(30年)	1.7	350,000	437,983	2044/ 9 /20
	第 45 回 利付国債(30年)	1.5	420,000	507,662	2044/12/20
	第 46 回 利付国債(30年)	1.5	350,000	423,272	2045/ 3 /20
	第 47 回 利付国債(30年)	1.6	500,000	616,435	2045/ 6 /20
	第 48 回 利付国債(30年)	1.4	500,000	593,805	2045/ 9 /20
	第 49 回 利付国債(30年)	1.4	440,000	522,715	2045/12/20
	第 50 回 利付国債(30年)	0.8	350,000	367,230	2046/ 3 /20
	第 51 回 利付国債(30年)	0.3	250,000	232,767	2046/ 6 /20
	第 52 回 利付国債(30年)	0.5	400,000	390,708	2046/ 9 /20
	第 53 回 利付国債(30年)	0.6	400,000	399,552	2046/12/20
	第 54 回 利付国債(30年)	0.8	410,000	428,942	2047/ 3 /20
	第 55 回 利付国債(30年)	0.8	390,000	407,706	2047/ 6 /20
	第 56 回 利付国債(30年)	0.8	320,000	334,265	2047/ 9 /20
	第 57 回 利付国債(30年)	0.8	340,000	354,871	2047/12/20
	第 58 回 利付国債(30年)	0.8	480,000	500,582	2048/ 3 /20
	第 59 回 利付国債(30年)	0.7	400,000	406,516	2048/ 6 /20
	第 60 回 利付国債(30年)	0.9	340,000	362,389	2048/ 9 /20
	第 61 回 利付国債(30年)	0.7	120,000	121,698	2048/12/20
	第 62 回 利付国債(30年)	0.5	250,000	240,537	2049/ 3 /20
	第 63 回 利付国債(30年)	0.4	250,000	233,670	2049/ 6 /20
	第 64 回 利付国債(30年)	0.4	310,000	289,254	2049/ 9 /20
	第 65 回 利付国債(30年)	0.4	310,000	288,755	2049/12/20
	第 66 回 利付国債(30年)	0.4	290,000	269,656	2050/ 3 /20
	第 67 回 利付国債(30年)	0.6	750,000	736,245	2050/ 6 /20
	第 68 回 利付国債(30年)	0.6	800,000	785,216	2050/ 9 /20
	第 69 回 利付国債(30年)	0.7	100,000	100,744	2050/12/20
第 57 回 利付国債(20年)	1.9	800,000	820,848	2022/ 6 /20	
第 60 回 利付国債(20年)	1.4	700,000	719,110	2022/12/20	
第 61 回 利付国債(20年)	1.0	350,000	358,060	2023/ 3 /20	
第 63 回 利付国債(20年)	1.8	500,000	522,055	2023/ 6 /20	
第 65 回 利付国債(20年)	1.9	400,000	422,704	2023/12/20	
第 68 回 利付国債(20年)	2.2	500,000	535,390	2024/ 3 /20	
第 69 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	320,319	2024/ 3 /20	
第 70 回 利付国債(20年)	2.4	600,000	649,860	2024/ 6 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第 72 回 利付国債(20年)	2.1	600,000	647,196	2024/ 9 /20
	第 74 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	325,206	2024/12/20
	第 76 回 利付国債(20年)	1.9	200,000	216,284	2025/ 3 /20
	第 77 回 利付国債(20年)	2.0	300,000	325,641	2025/ 3 /20
	第 78 回 利付国債(20年)	1.9	250,000	271,515	2025/ 6 /20
	第 80 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	109,467	2025/ 6 /20
	第 81 回 利付国債(20年)	2.0	200,000	219,142	2025/ 9 /20
	第 83 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	331,581	2025/12/20
	第 85 回 利付国債(20年)	2.1	200,000	222,144	2026/ 3 /20
	第 88 回 利付国債(20年)	2.3	400,000	450,524	2026/ 6 /20
	第 89 回 利付国債(20年)	2.2	400,000	448,400	2026/ 6 /20
	第 90 回 利付国債(20年)	2.2	300,000	337,947	2026/ 9 /20
	第 91 回 利付国債(20年)	2.3	300,000	339,615	2026/ 9 /20
	第 92 回 利付国債(20年)	2.1	340,000	382,863	2026/12/20
	第 93 回 利付国債(20年)	2.0	300,000	337,518	2027/ 3 /20
	第 94 回 利付国債(20年)	2.1	300,000	339,336	2027/ 3 /20
	第 95 回 利付国債(20年)	2.3	150,000	172,332	2027/ 6 /20
	第 96 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	113,626	2027/ 6 /20
	第 97 回 利付国債(20年)	2.2	150,000	172,191	2027/ 9 /20
	第 98 回 利付国債(20年)	2.1	100,000	114,138	2027/ 9 /20
	第 99 回 利付国債(20年)	2.1	200,000	229,280	2027/12/20
	第100回 利付国債(20年)	2.2	200,000	231,676	2028/ 3 /20
	第101回 利付国債(20年)	2.4	100,000	117,249	2028/ 3 /20
	第102回 利付国債(20年)	2.4	200,000	235,568	2028/ 6 /20
	第103回 利付国債(20年)	2.3	200,000	234,106	2028/ 6 /20
	第104回 利付国債(20年)	2.1	150,000	173,389	2028/ 6 /20
	第105回 利付国債(20年)	2.1	100,000	116,046	2028/ 9 /20
	第106回 利付国債(20年)	2.2	200,000	233,602	2028/ 9 /20
	第107回 利付国債(20年)	2.1	100,000	116,487	2028/12/20
	第108回 利付国債(20年)	1.9	100,000	114,928	2028/12/20
	第109回 利付国債(20年)	1.9	200,000	230,524	2029/ 3 /20
	第110回 利付国債(20年)	2.1	200,000	233,738	2029/ 3 /20
	第111回 利付国債(20年)	2.2	200,000	236,160	2029/ 6 /20
	第112回 利付国債(20年)	2.1	200,000	234,504	2029/ 6 /20
第113回 利付国債(20年)	2.1	200,000	235,352	2029/ 9 /20	
第114回 利付国債(20年)	2.1	300,000	354,264	2029/12/20	
第115回 利付国債(20年)	2.2	500,000	594,820	2029/12/20	
第118回 利付国債(20年)	2.0	300,000	353,901	2030/ 6 /20	
第122回 利付国債(20年)	1.8	500,000	582,220	2030/ 9 /20	
第123回 利付国債(20年)	2.1	300,000	358,842	2030/12/20	
第126回 利付国債(20年)	2.0	300,000	357,150	2031/ 3 /20	
第127回 利付国債(20年)	1.9	400,000	472,220	2031/ 3 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第128回 利付国債(20年)	1.9	500,000	591,920	2031/ 6 /20
	第130回 利付国債(20年)	1.8	400,000	470,656	2031/ 9 /20
	第132回 利付国債(20年)	1.7	400,000	467,544	2031/12/20
	第133回 利付国債(20年)	1.8	500,000	589,760	2031/12/20
	第135回 利付国債(20年)	1.7	400,000	468,560	2032/ 3 /20
	第136回 利付国債(20年)	1.6	450,000	522,234	2032/ 3 /20
	第137回 利付国債(20年)	1.7	400,000	469,580	2032/ 6 /20
	第139回 利付国債(20年)	1.6	300,000	348,852	2032/ 6 /20
	第140回 利付国債(20年)	1.7	300,000	352,932	2032/ 9 /20
	第141回 利付国債(20年)	1.7	300,000	353,649	2032/12/20
	第142回 利付国債(20年)	1.8	300,000	357,120	2032/12/20
	第143回 利付国債(20年)	1.6	400,000	467,724	2033/ 3 /20
	第144回 利付国債(20年)	1.5	400,000	463,004	2033/ 3 /20
	第145回 利付国債(20年)	1.7	450,000	532,530	2033/ 6 /20
	第146回 利付国債(20年)	1.7	520,000	616,522	2033/ 9 /20
	第147回 利付国債(20年)	1.6	560,000	658,151	2033/12/20
	第148回 利付国債(20年)	1.5	500,000	582,190	2034/ 3 /20
	第149回 利付国債(20年)	1.5	400,000	466,388	2034/ 6 /20
	第150回 利付国債(20年)	1.4	470,000	542,544	2034/ 9 /20
	第151回 利付国債(20年)	1.2	550,000	620,873	2034/12/20
	第152回 利付国債(20年)	1.2	550,000	621,252	2035/ 3 /20
	第153回 利付国債(20年)	1.3	750,000	858,022	2035/ 6 /20
	第154回 利付国債(20年)	1.2	940,000	1,063,017	2035/ 9 /20
	第155回 利付国債(20年)	1.0	600,000	661,332	2035/12/20
	第156回 利付国債(20年)	0.4	620,000	628,915	2036/ 3 /20
	第157回 利付国債(20年)	0.2	400,000	393,288	2036/ 6 /20
	第158回 利付国債(20年)	0.5	570,000	585,184	2036/ 9 /20
	第159回 利付国債(20年)	0.6	600,000	624,306	2036/12/20
	第160回 利付国債(20年)	0.7	550,000	580,541	2037/ 3 /20
	第161回 利付国債(20年)	0.6	550,000	571,180	2037/ 6 /20
	第162回 利付国債(20年)	0.6	100,000	103,745	2037/ 9 /20
	第163回 利付国債(20年)	0.6	500,000	518,175	2037/12/20
	第164回 利付国債(20年)	0.5	500,000	509,190	2038/ 3 /20
第165回 利付国債(20年)	0.5	450,000	457,641	2038/ 6 /20	
第166回 利付国債(20年)	0.7	410,000	430,155	2038/ 9 /20	
第167回 利付国債(20年)	0.5	500,000	507,035	2038/12/20	
第168回 利付国債(20年)	0.4	400,000	397,988	2039/ 3 /20	
第169回 利付国債(20年)	0.3	270,000	263,379	2039/ 6 /20	
第170回 利付国債(20年)	0.3	420,000	408,870	2039/ 9 /20	
第171回 利付国債(20年)	0.3	400,000	388,596	2039/12/20	
第172回 利付国債(20年)	0.4	300,000	296,589	2040/ 3 /20	
第173回 利付国債(20年)	0.4	1,100,000	1,086,382	2040/ 6 /20	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国 債 証 券	第174回 利付国債(20年)	0.4	1,180,000	1,164,176	2040/ 9 /20
	第175回 利付国債(20年)	0.5	380,000	382,063	2040/12/20
	第 26 回 メキシコ合衆国	0.85	100,000	98,593	2025/ 4 /18
	小 計		123,160,000	131,505,351	
地 方 債 証 券	第739回 東京都公募公債	0.29	100,000	101,097	2024/12/20
	第746回 東京都公募公債	0.499	100,000	102,160	2025/ 6 /20
	第751回 東京都公募公債	0.37	100,000	101,795	2025/12/19
	第759回 東京都公募公債	0.075	100,000	100,165	2026/ 9 /18
	第770回 東京都公募公債	0.18	100,000	100,751	2027/ 6 /18
	第 6 回 東京都公募公債(20年)	2.0	100,000	108,079	2025/ 3 /19
	第 7 回 東京都公募公債(20年)	2.16	100,000	109,834	2025/ 9 /19
	第 12 回 東京都公募公債(20年)	2.31	100,000	114,641	2027/ 9 /17
	第 13 回 東京都公募公債(20年)	2.15	100,000	114,094	2027/12/20
	第 26 回 東京都公募公債(20年)	1.74	100,000	116,677	2032/ 6 /18
	平成24年度第 4 回 北海道公募公債	0.9	100,000	101,145	2022/ 6 /29
	平成24年度第 9 回 北海道公募公債	0.79	7,400	7,493	2022/10/31
	平成27年度第 9 回 北海道公募公債	0.486	100,000	102,216	2025/10/30
	平成27年度第 13 回 北海道公募公債	0.469	100,000	102,206	2025/12/25
	平成29年度第 15 回 北海道公募公債	0.23	100,000	101,000	2028/ 2 /28
	第 30 回 2号宮城県公募公債(10年)	0.53	100,000	101,930	2024/10/29
	第188回 神奈川県公募公債	1.05	100,000	101,071	2022/ 3 /18
	第 3 回 神奈川県公募公債(30年)	2.62	100,000	134,270	2037/ 3 /19
	第 14 回 神奈川県公募公債(20年)	1.969	100,000	116,776	2030/ 7 /19
	第 36 回 神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	102,892	2037/12/18
	第368回 大阪府公募公債(10年)	0.83	100,000	101,538	2023/ 1 /30
	第374回 大阪府公募公債(10年)	0.938	134,000	136,948	2023/ 7 /28
	第387回 大阪府公募公債(10年)	0.521	44,040	44,816	2024/ 8 /28
	第392回 大阪府公募公債(10年)	0.36	100,000	101,346	2025/ 1 /29
	第 2 回 大阪府公募公債(20年)	2.23	100,000	117,934	2029/11/16
	平成24年度第 5 回 京都府公募公債	0.82	30,000	30,372	2022/ 9 /20
	平成24年度第 8 回 京都府公募公債	0.73	30,000	30,387	2022/12/19
	平成25年度第 10 回 京都府公募公債(15年)	1.14	100,000	107,917	2028/10/13
	平成27年度第 2 回 京都府公募公債(15年)	0.729	100,000	105,261	2030/ 4 /26
	平成29年度第 22 回 兵庫県公募公債	0.19	100,000	100,735	2028/ 1 /21
	第 2 回 兵庫県公募公債(30年)	2.36	100,000	133,245	2040/ 3 /19
	第 3 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	108,103	2027/ 7 /16
	第 6 回 兵庫県公募公債(15年)	1.35	100,000	109,236	2028/ 7 /14
	第 4 回 兵庫県公募公債(12年)	0.73	100,000	103,660	2026/ 8 / 6
	平成26年度第 9 回 静岡県公募公債	0.554	20,000	20,403	2024/10/24
	第 3 回 静岡県公募公債(20年)	2.35	100,000	112,726	2026/ 9 /18
第 10 回 静岡県公募公債(20年)	2.072	100,000	117,605	2030/ 6 /14	
平成24年度第 8 回 愛知県公募公債(10年)	0.835	100,000	101,217	2022/ 8 /29	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
地 方 債 証 券	平成24年度第 12 回 愛知県公募公債(30年)	2.12	10,000	13,074	2042/ 9 /19
	平成24年度第 14 回 愛知県公募公債(15年)	1.314	100,000	108,386	2027/12/13
	平成25年度第 6 回 愛知県公募公債(10年)	0.877	100,000	102,016	2023/ 6 /27
	平成29年度第 6 回 愛知県公募公債(10年)	0.22	100,000	100,989	2027/ 7 /28
	平成30年度第 6 回 愛知県公募公債(30年)	0.777	100,000	101,211	2048/ 6 /19
	平成28年度第 1 回 広島県公募公債	0.08	100,000	100,208	2026/ 5 /25
	平成29年度第 5 回 広島県公募公債	0.245	100,000	101,183	2028/ 1 /25
	平成26年度第 1 回 広島県公募公債(20年)	1.41	100,000	114,351	2034/ 9 /12
	平成24年度第 1 回 埼玉県公募公債	1.05	100,000	101,182	2022/ 4 /26
	平成25年度第 1 回 埼玉県公募公債	0.586	100,000	101,232	2023/ 4 /18
	平成26年度第 5 回 埼玉県公募公債	0.611	100,000	102,077	2024/ 7 /29
	平成29年度第 4 回 埼玉県公募公債	0.19	100,000	100,815	2027/ 6 /22
	平成23年度第 3 回 福岡県公募公債	1.07	100,000	100,500	2021/ 8 /26
	平成24年度第 11 回 福岡県公募公債	0.8	100,000	101,574	2023/ 2 /27
	平成28年度第 6 回 福岡県公募公債	0.175	100,000	100,729	2026/12/22
	平成30年度第 2 回 福岡県公募公債(15年)	0.542	100,000	103,064	2033/10/17
	第 10 回 千葉県公募公債(20年)	1.8	100,000	116,388	2031/ 8 /18
	第 24 回 千葉県公募公債	0.559	100,000	101,656	2038/ 4 /15
	平成24年度第 2 回 新潟県公募公債	0.79	100,000	101,554	2023/ 2 /27
	第 96 回 共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	100,069	2021/ 3 /25
	第100回 共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	100,457	2021/ 7 /23
	第101回 共同発行市場公募地方債	1.05	100,000	100,488	2021/ 8 /25
	第111回 共同発行市場公募地方債	0.89	100,000	101,141	2022/ 6 /24
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	101,291	2022/10/25
	第119回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	101,567	2023/ 2 /24
	第129回 共同発行市場公募地方債	0.71	100,000	101,980	2023/12/25
	第130回 共同発行市場公募地方債	0.76	100,000	102,184	2024/ 1 /25
	第136回 共同発行市場公募地方債	0.611	100,000	102,070	2024/ 7 /25
	第137回 共同発行市場公募地方債	0.566	100,000	101,965	2024/ 8 /23
	第147回 共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	102,334	2025/ 6 /25
	第157回 共同発行市場公募地方債	0.08	100,000	100,205	2026/ 4 /24
	第181回 共同発行市場公募地方債	0.18	100,000	100,781	2028/ 4 /25
	第184回 共同発行市場公募地方債	0.175	100,000	100,658	2028/ 7 /25
	第188回 共同発行市場公募地方債	0.264	30,000	30,376	2028/11/24
	令和 2 年度第 3 回 長崎県公募公債(10年)	0.13	12,400	12,366	2030/ 6 /20
	平成24年度第 1 回 滋賀県公募公債	0.79	30,600	31,014	2022/11/30
	平成30年度第 1 回 熊本市公募公債	0.264	100,000	101,257	2028/11/30
	第 5 回 大阪市公募公債(20年)	2.47	100,000	117,852	2028/ 9 /21
	第 13 回 大阪市公募公債(20年)	2.08	50,000	58,839	2030/ 6 /14
	第480回 名古屋市公募公債(10年)	0.825	100,000	101,251	2022/ 9 /20
	第 6 回 京都市公募公債(20年)	2.38	200,000	230,192	2027/ 9 /17
	第 2 回 横浜市公募公債(30年)	2.49	100,000	129,460	2035/ 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	
地 方 債 証 券	第 4 回 横浜市公募公債(30年)	2.54	100,000	132,464	2036/12/19
	第 14 回 横浜市公募公債(20年)	2.32	100,000	115,804	2028/ 3 /17
	平成24年度第 10 回 札幌市公募公債(10年)	0.8	100,000	101,417	2022/12/20
	平成27年度第 4 回 札幌市公募公債(10年)	0.51	100,000	102,202	2025/ 6 /20
	平成29年度第 3 回 札幌市公募公債(10年)	0.23	100,000	101,064	2027/ 6 /18
	第 6 回 札幌市公募公債(20年)	2.24	100,000	117,573	2029/ 6 /20
	第 4 回 川崎市公募公債(20年)	2.35	100,000	116,520	2028/ 6 /20
	第 11 回 川崎市公募公債(30年)	0.817	100,000	102,331	2048/ 3 /19
	平成23年度第 2 回 北九州市公募公債	1.06	11,000	11,090	2021/12/22
	平成24年度第 8 回 福岡市公募公債	0.68	100,000	101,385	2023/ 3 /24
	平成28年度第 5 回 広島市公募公債	0.24	100,000	101,096	2027/ 2 /26
	平成30年度第 6 回 広島市公募公債	0.146	100,000	100,285	2029/ 2 /22
	平成24年度第 1 回 福井県公募公債	0.8	100,000	101,293	2022/10/26
	平成25年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.75	100,000	102,169	2024/ 1 /31
	平成27年度第 1 回 岡山県公募公債(10年)	0.395	100,000	101,971	2026/ 1 /29
	平成29年度第 1 回 秋田県公募公債	0.2	145,900	147,230	2028/ 3 /24
	第120回 愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.699	100,000	101,555	2023/12/20
第135回 福岡北九州高速道路債券	0.5	100,000	101,221	2025/ 3 /19	
第160回 福岡北九州高速道路債券	0.573	100,000	100,000	2041/ 3 /22	
	小 計		9,255,340	9,784,401	
特 殊 債 券 (除く金融債)	第 25 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.2	100,000	100,335	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	100,447	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	24,654	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	74,524	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	14,121	2021/12/14
	F 116回 地方公共団体金融機構債券	1.481	100,000	108,675	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	101,175	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	101,287	2022/ 9 /16
	第 42 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.805	300,000	304,212	2022/11/14
	第 45 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.815	100,000	101,650	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	33,454	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	101,172	2023/ 4 /21
	第 28 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.396	100,000	112,862	2033/ 4 /28
	F 181回 地方公共団体金融機構債券	1.109	100,000	105,736	2026/ 7 /28
	F 190回 地方公共団体金融機構債券	0.792	100,000	102,880	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	102,148	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	102,145	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	101,874	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	14,179	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	101,992	2025/ 9 /12	
F 308回 地方公共団体金融機構債券	1.192	100,000	111,170	2037/ 3 /19	
第 89 回 地方公共団体金融機構債券	0.075	100,000	100,171	2026/10/28	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第 98 回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	100,667	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	100,645	2027/ 8 /13
	第 68 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	0.53	100,000	100,333	2038/ 7 /28
	第112回 地方公共団体金融機構債券	0.269	100,000	100,997	2028/ 9 /28
	F 538回 地方公共団体金融機構債券	0.02	100,000	100,096	2025/12/25
	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	100,105	2021/ 3 /26
	第 8 回 公営企業債券(30年)	2.5	10,000	12,944	2035/ 9 /21
	第 13 回 公営企業債券(20年)	2.16	10,000	10,924	2025/ 6 /20
	第 22 回 公営企業債券(20年)	2.32	100,000	114,069	2027/ 6 /18
	第 10 回 日本政策金融公庫社債	2.167	100,000	117,691	2030/ 3 /19
	第 19 回 政府保証日本政策金融公庫債券	1.1	100,000	100,876	2021/12/17
	第 47 回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.09	100,000	100,202	2027/ 9 /24
	第 53 回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.209	162,000	163,551	2028/ 9 /15
	第 6 回 政府保証新関西国際空港債券	0.155	100,000	100,650	2027/ 8 /27
	第 11 回 政府保証日本政策投資銀行債券	1.0	100,000	100,536	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	142,617	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	113,024	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	149,315	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	144,816	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	137,565	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	13,479	2037/ 9 /18
	第123回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	100,000	102,052	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	101,977	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	101,711	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	101,079	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	103,872	2023/ 1 /31
	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	115,024	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	101,377	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	101,183	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	101,376	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	1,020	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	101,860	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	101,979	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	2,042	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	101,889	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	13,236	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	101,655	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	100,373	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	102,126	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	102,458	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	13,077	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	102,674	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	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	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	98,905	2039/ 3 /31
	第 11 回 公営企業債券(20年)	2.11	100,000	108,526	2025/ 3 /24
	第 7 回 阪神高速道路債券	2.18	100,000	108,637	2025/ 3 /21
	第 18 回 政府保証中部国際空港債券	0.668	100,000	101,387	2023/ 3 /22
	第 21 回 政府保証中部国際空港債券	0.45	100,000	101,854	2025/ 3 /17
	第 3 回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.26	100,000	113,154	2027/ 3 /19
	第 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.19	26,658	27,594	2042/ 6 /10
	第 30 回 一般担保住宅金融支援機構債券	2.08	100,000	106,817	2024/ 6 /20
	第 30 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.97	24,872	26,643	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	12,127	12,255	2032/11/10
	第 36 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.81	25,152	26,637	2045/ 5 /10
	第 38 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	27,307	28,849	2045/ 7 /10
	第 39 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.52	27,253	28,645	2045/ 8 /10
	第 43 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6	65,416	69,364	2045/12/10
	第 45 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.79	27,224	28,859	2046/ 2 /10
	第 55 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.41	40,020	42,281	2046/12/10
	第 60 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	40,692	42,862	2047/ 5 /10
	第106回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.794	100,000	116,822	2032/ 6 /18
	第108回 一般担保住宅金融支援機構債券	1.434	100,000	108,462	2027/ 6 /18
	第 96 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	64,874	66,580	2050/ 5 /10
	第101回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.89	65,877	68,207	2050/10/10
	第106回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.54	72,886	73,941	2051/ 3 /10
	第110回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.23	157,996	157,305	2051/ 7 /10
	第115回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.41	81,392	81,867	2051/12/10
	第203回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.24	100,000	101,021	2027/ 3 /19
	第119回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	82,417	83,193	2052/ 4 /10
	第215回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.23	100,000	100,968	2027/ 8 /20
	第125回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	84,880	85,416	2052/10/10
	第132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	87,113	87,512	2053/ 5 /10
	第133回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	87,812	88,334	2053/ 6 /10
	第240回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.04	100,000	100,090	2023/ 9 /20
	第135回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.39	88,752	89,059	2053/ 8 /10
	第137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	89,883	90,758	2053/10/10
第138回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	90,228	91,299	2053/11/10	
第139回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	89,945	90,748	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	65,036	65,013	2033/ 1 /10	
第 2 回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.61	20,900	21,047	2036/ 5 /10	
第 29 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.81	11,316	11,507	2040/ 4 /10	
第 34 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.82	14,270	14,787	2040/ 9 /10	
第 38 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.91	12,192	12,497	2041/ 1 /10	
第 29 回 西日本高速道路株式会社債	0.31	200,000	202,742	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	101,170	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	
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債)	第 65 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.67	100,000	102,132	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	101,972	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	102,543	2038/ 8 /27
	第 7 回 本州四国連絡橋債券	2.26	100,000	109,511	2025/ 6 /20
	第 9 回 新関西国際空港	1.231	100,000	108,275	2028/12/20
	第 78 回 株式会社日本政策投資銀行	0.225	100,000	100,942	2027/ 4 /13
	第 96 回 株式会社日本政策投資銀行	0.195	100,000	100,472	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	116,647	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	118,122	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	100,811	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	116,858	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	126,685	2042/ 8 /29
	第 7 回 道路債券	2.7	50,000	51,742	2022/ 6 /20
	第 28 回 道路債券	2.83	200,000	262,440	2033/12/20
	第 4 回 公営企業債券(30年)	2.95	100,000	133,161	2034/ 3 /24
	第 20 回 地方公共団体金融機構債券(20年)	1.8	100,000	116,520	2032/ 1 /28
	第 23 回 国際協力銀行債券	2.09	100,000	109,931	2025/12/19
	第 3 回 都市再生債券	2.87	100,000	109,417	2024/ 6 /20
	第 96 回 都市再生債券	0.599	100,000	102,090	2024/ 9 /20
	第342回 東京交通債券	2.4	30,000	30,925	2022/ 6 /21
	第 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.99	13,092	13,486	2042/12/10
	第 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1	13,545	14,094	2043/ 1 /10
	第 25 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.28	41,778	44,802	2044/ 6 /10
	第 28 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.98	22,434	23,888	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	12,119	12,255	2032/11/10
	第 29 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.95	25,330	27,143	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	12,179	12,326	2032/11/10
	第 31 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.89	25,457	27,223	2044/12/10
	第 32 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.82	24,579	26,124	2045/ 1 /10
	第 42 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.43	32,940	34,681	2045/11/10
	第 66 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.12	44,191	46,133	2047/11/10
	第 69 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.28	45,679	48,085	2048/ 2 /10
	第 70 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.25	39,638	41,558	2048/ 3 /10
	第 71 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	38,706	40,266	2048/ 4 /10
	第 79 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	40,667	42,330	2048/12/10
	第146回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.757	100,000	102,164	2024/ 1 /19
第 81 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.07	44,347	46,209	2049/ 2 /10	
第149回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.704	100,000	102,095	2024/ 3 /19	
第157回 一般担保住宅金融支援機構債券	0.411	100,000	101,643	2025/ 5 /20	
第 1 回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	1.51	30,927	31,128	2036/ 5 /10	
第 6 回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.26	11,243	11,452	2037/ 5 /10	
第 9 回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.19	23,690	24,285	2037/ 5 /10	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特 殊 債 券 (除く金融債)	第 5 回 国際協力機構債券	1.918	100,000	116,074	2030/ 9 /13
	第 36 回 中日本高速道路株式会社社債	1.066	100,000	100,567	2021/ 9 /17
	第 85 回 中日本高速道路	0.07	100,000	100,164	2025/10/21
	小 計		11,907,531	12,615,024	
金 融 債 券	い第803号商工債	0.06	100,000	100,034	2022/ 4 /27
	第321回 信金中金債(5年)	0.03	100,000	100,002	2021/ 8 /27
	第326回 信金中金債(5年)	0.05	100,000	100,028	2022/ 1 /27
	第338回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,165	2023/ 1 /27
	第343回 信金中金債(5年)	0.11	100,000	100,208	2023/ 6 /27
	第352回 信金中金債(5年)	0.07	100,000	100,141	2024/ 3 /27
	第364回 信金中金債(5年)	0.01	100,000	99,939	2025/ 3 /27
	第236号 商工債(3年)	0.02	100,000	99,984	2022/ 9 /27
	小 計		800,000	800,501	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第506回 中部電力	0.695	100,000	102,633	2025/ 9 /25
	第517回 中部電力	0.706	100,000	101,909	2036/12/25
	第510回 関西電力	0.49	100,000	101,638	2027/ 7 /23
	第524回 関西電力	0.514	100,000	101,633	2028/10/25
	第422回 中国電力	0.35	100,000	100,539	2030/ 4 /25
	第426回 中国電力	0.33	100,000	100,276	2030/ 7 /25
	第323回 北陸電力	0.858	100,000	103,683	2037/ 6 /25
	第521回 東北電力	0.45	100,000	101,304	2030/ 5 /24
	第245回 四国電力	2.0	100,000	100,616	2021/ 6 /25
	第298回 四国電力	0.962	100,000	102,965	2043/ 4 /24
	第465回 九州電力	0.38	100,000	100,942	2028/ 7 /25
	第489回 九州電力	0.44	200,000	202,248	2030/ 5 /24
	第350回 北海道電力	0.754	100,000	101,302	2038/ 3 /25
	第 6 回 東京電力パワーグリッド	0.85	100,000	101,993	2027/ 8 /31
	第 7 回 東京電力パワーグリッド	0.46	100,000	100,608	2022/10/24
	第 26 回 東京電力パワーグリッド	1.31	100,000	104,278	2034/ 4 /24
	第 15 回 東急不動産ホールディングス	0.78	100,000	99,212	2032/10/20
	第 22 回 三菱瓦斯化学	0.17	100,000	100,177	2025/ 9 / 3
	第 3 回 富士フイルムホールディングス	0.882	100,000	101,393	2022/12/ 2
	第 14 回 トヨタ自動車	0.963	100,000	101,799	2023/ 3 /20
	第 57 回 三菱東京UFJ銀行	2.22	100,000	103,548	2022/10/27
	第 9 回 三菱UFJ信託銀行	1.68	100,000	100,226	2021/ 4 /28
	第 3 回 NTTファイナンス	0.529	100,000	100,752	2031/12/19
	第 28 回 リコーリース	0.345	100,000	99,923	2027/ 7 /20
	第 54 回 日立キャピタル	0.416	100,000	100,199	2021/ 9 /17
	第 65 回 三菱地所	2.04	100,000	116,413	2032/12/20
	第 18 回 イオンモール	1.05	100,000	98,054	2038/ 7 / 2
第 32 回 東日本旅客鉄道	2.26	100,000	106,706	2024/ 3 /19	
第107回 東日本旅客鉄道	1.415	200,000	227,046	2045/ 1 /27	

種 類	銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
普通社債券 (含む投資法人債券)	第127回 東日本旅客鉄道	0.675	100,000	101,551	2038/ 1 /26
	第152回 東日本旅客鉄道	0.09	100,000	100,029	2025/ 7 /18
	第 52 回 西日本旅客鉄道	1.157	100,000	105,859	2058/ 4 /25
	第 45 回 東海旅客鉄道	2.321	100,000	117,176	2029/ 6 /19
	第 47 回 東海旅客鉄道	2.375	100,000	129,640	2039/12/16
	第 4 回 東京地下鉄	2.38	10,000	11,190	2026/ 6 /19
	第 13 回 東京地下鉄	1.702	100,000	114,486	2032/ 5 /25
	第 47 回 阪急阪神ホールディングス	1.202	100,000	107,430	2029/ 7 /18
	第 25 回 日本郵船	2.65	100,000	108,363	2026/ 6 /22
	第 32 回 ANAホールディングス	0.99	100,000	90,370	2036/ 6 / 9
	第 63 回 日本電信電話	0.69	100,000	101,325	2023/ 3 /20
	第 11 回 電源開発	2.05	100,000	107,745	2025/ 3 /19
	第 58 回 電源開発	0.705	100,000	100,750	2038/ 7 /20
	第 31 回 東京電力パワーグリッド	0.98	100,000	102,176	2029/10/ 9
	第 28 回 東京瓦斯	2.29	100,000	113,299	2027/ 6 /15
	第 27 回 エヌ・ティ・ティ・データ	0.9	100,000	101,806	2023/ 6 /20
	第 30 回 フランス相互信用連合銀行	0.317	100,000	99,473	2026/10/ 9
	第 18 回 ビー・ピー・シー・イー・エス・エー	0.329	100,000	99,624	2025/ 1 /24
	第 14 回 クレディ・アグリコル・エス・エー	0.459	100,000	99,561	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	100,084	2021/ 9 /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	100,183	2024/ 1 /23	
	小 計		5,110,000	5,296,135	
	合 計		150,232,871	160,001,413	

(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('21年3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 160,001,413	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,359,532	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	161,360,945	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

('21年3月5日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資 産	161,360,945,078 円
コーポレート債(評価額)	847,821,493
未収入金	160,001,413,285
未収入利息	97,553,000
前払費用	408,354,148
(B) 負 債	5,803,152
未払金	369,887,680
未払解約金	100,000,000
未払利息	269,884,712
その他未払費用	2,311
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	657
元 本	125,473,996,247
次 期 繰 越 損 益 金	35,517,061,151
(D) 受 益 権 総 口 数	125,473,996,247口
1万口当たり基準価額(C/D×10,000)	12,831円

(注1) 期首元本額 126,401,838,965円
 期中追加設定元本額 24,955,873,200円
 期中一部解約元本額 25,883,715,918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・リスクベクト型(ワン・オープン)(ステフル)	2,571,141,239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〉	3,874,648,819円
バランスファンドVA30A〈適格機関投資家限定〉	10,889,302円
バランスファンドVA30B〈適格機関投資家限定〉	357,638,147円
バランスファンドVA40A〈適格機関投資家限定〉	477,163円
バランスファンドVA40B〈適格機関投資家限定〉	11,217,794円
バランスファンドVA50A〈適格機関投資家限定〉	34,926,611円
バランスファンドVA50B〈適格機関投資家限定〉	13,233,537,009円
バランスファンドVA50C〈適格機関投資家限定〉	6,907,212円
バランスファンドVA25A〈適格機関投資家限定〉	5,527,605,323円
バランスファンドVA37.5A〈適格機関投資家限定〉	2,173,363,661円
バランスファンドVA75A〈適格機関投資家限定〉	14,789,840円
4資産バランス20VA〈適格機関投資家限定〉	1,585,112,678円
4資産バランス40VA〈適格機関投資家限定〉	7,032,457,851円
4資産バランス30VA〈適格機関投資家限定〉	1,792,997,772円
バランスファンドVA35A〈適格機関投資家限定〉	6,033,579,881円
バランスファンドVA40C〈適格機関投資家限定〉	157,769,170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〉	90,943,556円
グローバル4資産30VA〈適格機関投資家限定〉	75,236,534円
グローバル4資産45VA〈適格機関投資家限定〉	40,027,077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〉	14,177,637,360円
4資産バランス30VA2〈適格機関投資家限定〉	65,022,360円
バランスファンドVA25B〈適格機関投資家限定〉	3,986,644,669円
バランスファンドVA20A〈適格機関投資家限定〉	19,770,008円
バランスファンドVA35B〈適格機関投資家限定〉	12,328,097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〉	1,689,348,552円
日本債券インデックス・ファンド〈適格機関投資家限定〉	752,359,880円
4資産インデックスバランスVA20〈適格機関投資家限定〉	2,661,470,507円
世界分散ファンドVA25A〈適格機関投資家限定〉	10,517,172,979円
4資産インデックスバランスVA50〈適格機関投資家限定〉	16,269,909円
Taリスクリスクベクト型リバランス戦略ファンド(ステフル)年金〈適格機関投資家限定〉	788,219,500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〉	552,279,862円
Taリスクリスクベクト型リバランス戦略ファンド(ステフル)〈適格機関投資家限定〉	440,001,371円
ステート・ストリート日本債券インデックス・オープン	1,881,905,789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〉	38,694,223,990円
世界バランス40VA〈適格機関投資家限定〉	43,962,044円
世界バランス60VA〈適格機関投資家限定〉	173,708,150円
グローバルバランス40VA〈適格機関投資家限定〉	3,102,578円
グローバルバランス40VA2〈適格機関投資家限定〉	4,220,931,990円
グローバルバランス40VA3〈適格機関投資家限定〉	103,329,690円
グローバルバランス50VA〈適格機関投資家限定〉	49,040,323円

◎損益の状況

当期(自'20年3月6日 至'21年3月5日)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,319,210,683 円
受 取 利 息	1,320,027,720
支 払 利 息	△ 817,037
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 4,229,877,080
売 買 益	36,104,400
売 買 損	△ 4,265,981,480
(C) そ の 他 費 用	△ 30,264
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 2,910,696,661
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	38,736,211,550
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,233,788,969
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 7,542,242,707
(H) 計 (D+E+F+G)	35,517,061,151
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	35,517,061,151

(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。