

野村時間分散投資「日経225・国内債券」 (限定追加型)

愛称：地道にコツコツ

運用報告書(全体版)

第1期(決算日2015年12月18日)

作成対象期間(2014年11月21日～2015年12月18日)

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/資産複合	
信託期間	2014年11月21日から2020年12月18日までです。	
運用方針	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券および野村日経225 マザーファンド受益証券を主要投資対象とし、信託財産の成長を図ることを目的に運用を行うことを基本とします。 信託契約締結日から2014年末までの期間は、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。なお、野村日経225 マザーファンド受益証券には原則として投資を行いません。 2015年から2017年までの期間は、原則として、毎月、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券への投資金額のうち、当該期間における残存月数(該当月を含みます。)で割った金額相当を野村日経225 マザーファンド受益証券に組み替えていきます。各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。 2018年以降は、野村日経225 マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。なお、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券には原則として投資を行いません。 効率的な運用を行うため、債券先物取引および株価指数先物取引等のデリバティブ取引を活用する場合があります。	
主な投資対象	野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券および野村日経225 マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	野村日経225 マザーファンド	日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とします。
主な投資制限	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
	野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	株式への実質投資割合には制限を設けません。
	野村日経225 マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。
分配方針	国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	株式への投資は行いません。 外貨建て資産への投資は行いません。
	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、利子・配当等収益等の水準及び基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。	

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

(受付時間) 営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額 (分配落)	騰落率		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産額
		税金	み					
(設定日)	円	円	%	%	%	%	%	百万円
2014年11月21日	10,000	—	—	—	—	—	—	1
1期(2015年12月18日)	10,157	0	1.6	29.7	3.5	66.2	—	128

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドの運用方法は、設定日から2014年末までの期間は、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。2015年から2017年までの期間は、原則として、毎月、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券への投資金額のうち、当該期間における残存月数(該当月を含みます。)で割った金額相当を野村日経225 マザーファンド受益証券に組み替えていきます。2018年以降は、野村日経225 マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。以上を目指した運用を行なうため、該当するベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率
		騰	落				
(設定日)	円	%	%	%	%	%	%
2014年11月21日	10,000	—	—	—	—	—	—
11月末	10,029	0.3	—	—	—	98.8	—
12月末	10,129	1.3	—	—	—	99.4	—
2015年1月末	10,143	1.4	2.7	0.3	0.3	96.2	—
2月末	10,117	1.2	5.4	0.6	0.6	93.4	—
3月末	10,134	1.3	8.2	0.8	0.8	90.7	—
4月末	10,169	1.7	10.8	1.0	1.0	87.9	—
5月末	10,200	2.0	13.6	1.9	1.9	84.3	—
6月末	10,165	1.7	15.8	2.0	2.0	81.6	—
7月末	10,217	2.2	18.5	2.5	2.5	79.0	—
8月末	10,030	0.3	19.4	2.5	2.5	76.6	—
9月末	9,880	△1.2	21.8	1.7	1.7	76.1	—
10月末	10,148	1.5	27.0	0.9	0.9	71.7	—
11月末	10,243	2.4	28.4	3.0	3.0	68.1	—
(期末)							
2015年12月18日	10,157	1.6	29.7	3.5	3.5	66.2	—

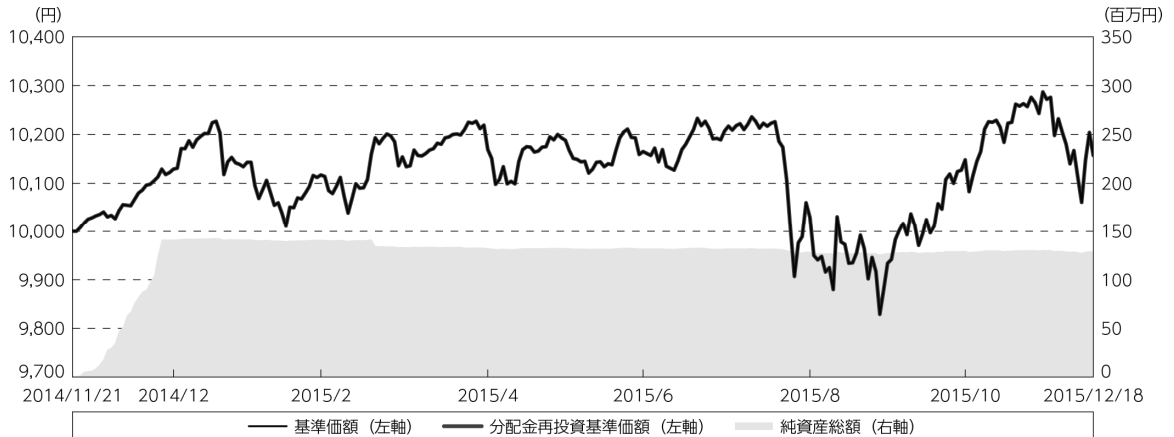
*騰落率は設定日比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

*株式先物比率、債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



設定日：10,000円

期末：10,157円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 1.6% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なり、また、ファンドの購入価額により課税条件も異なりますので、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から期末10,157円に157円の値上がりとなりました。

国内株式の価格の変動

国内債券の価格の変動と利金収入

○投資環境

<国内株式>

設定時から2015年1月までは一進一退の展開が続きましたが、1月中旬以降は、世界的な金融緩和が継続していることや、国内公的年金が株式比率を上昇させるとの観測が広がったこと、国内企業の業績拡大への期待感が膨らんだことなどから上昇しました。一段と円安が進んだこともあり株価の上昇が続きました。

8月中旬以降は、中国や新興国への景気減速への懸念が高まったことや、為替が円高に進行したことが企業収益への不安につながり大きく下落しました。

10月以降は国内企業の決算への期待などが相場を押し上げました。

<国内債券>

米国での金融引き締めペースが緩やかなものになるとの観測や、日銀による「量的・質的金融緩和」の拡大政策により国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

2015年1月中旬から6月中旬にかけては、円安の進行や2015年1-3月期実質GDP（国内総生産）成長率が景気の拡大を示したことを受けて国内株式市場が上昇したことなどから、国内債券利回りは上昇（価格は低下）しました。その後、中国株の急落や世界経済の先行きに不透明感が高まったことなどから、国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

[野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)]

当ファンドの運用方法は、設定日から2014年末までの期間は、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。2015年から2017年までの期間は、原則として、毎月、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券への投資金額のうち、当該期間における残存月数（該当月を含みます。）で割った金額相当を野村日経225 マザーファンド受益証券に組み替えていきます。各マザーファンド受益証券の合計組入比率は、原則として高位を維持することを基本とします。2018年以降は、野村日経225 マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。当ファンドのポートフォリオは以上の運用方法を目指して国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券と野村日経225 マザーファンド受益証券を組み入れました。

[野村日経225 マザーファンド]

当ファンドは、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行ないます。先物を含む実質株式組入比率は期を通じて概ね高位を維持しました。

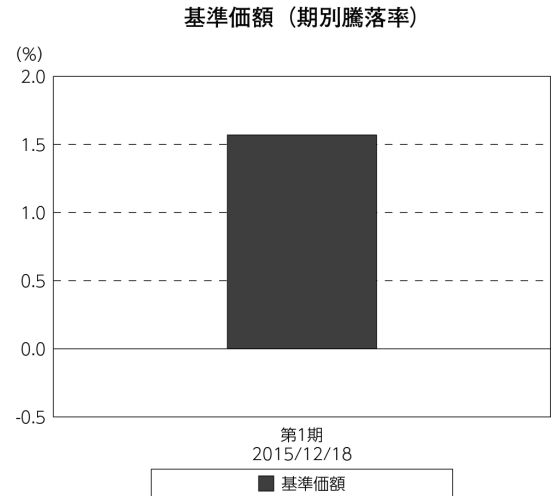
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドの運用方法は、設定日から2014年末までの期間は、国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。2015年から2017年までの期間は、原則として、毎月、国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド受益証券への投資金額のうち、当該期間における残存月数(該当月を含みます。)で割った金額相当を野村日経225マザーファンド受益証券に組み替えていきます。2018年以降は、野村日経225マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。以上を目指した運用を行なうため、該当するベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金は基準価額水準等を勘案し見送らせていただきました。

留保益の運用については特に制限を設けず元本部分と同一の運用を行ないます。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項目	第1期
	2014年11月21日～ 2015年12月18日
当期分配金 (対基準価額比率)	— —%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	156

(注) 対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

◎今後の運用方針

[野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)]

2015年から2017年までの期間は、原則として、毎月、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド受益証券への投資金額のうち、当該期間における残存月数(該当月を含みます。)で割った金額相当を野村日経225 マザーファンド受益証券に組み替えることを目指して運用してまいります。2018年以降は、野村日経225 マザーファンド受益証券を高位に組み入れることを基本とします。

[野村日経225 マザーファンド]

先物を含む実質株式組入比率は高位を維持し、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用してまいります。

[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

債券組入比率を高位に保ち、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値(デュレーションなど)を指数に合わせることで、NOMURA-BPI総合との連動をできる限り高めるように運用してまいります。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

- ①「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。
- ②「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- ③「野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)」は、野村アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び「野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。
- ⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属しております。また、野村証券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2014年11月21日～2015年12月18日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 59	% 0.581	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(27)	(0.267)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、 基準価額の算出等
(販 売 会 社)	(27)	(0.267)	購入後の情報提供、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 および事務手続き等
(受 託 会 社)	(5)	(0.047)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.001)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.003	(c) 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)	(0)	(0.003)	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
合 計	59	0.585	
期中の平均基準価額は、10,123円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料およびその他費用は、この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。

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

○売買及び取引の状況

(2014年11月21日～2015年12月18日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	112,981	140,602	44,948	56,153
野村日経225 マザーファンド	35,548	44,105	1,326	1,682

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年11月21日～2015年12月18日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	野村日経225 マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	121,495,838千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	34,502,356千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.52	

*(b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年11月21日～2015年12月18日)

利害関係人との取引状況

<野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)>
該当事項はございません。

<野村日経225 マザーファンド>

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 76,992	百万円 3,578	% 4.6	百万円 44,503	百万円 -	% -

平均保有割合 0.1%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該子ファンドのマザーファンド所有口数の割合。

<国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド>

区分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人との取引状況 B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人との取引状況 D	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 308,756	百万円 30,700	% 9.9	百万円 75,964	百万円 1,216	% 1.6

平均保有割合 0.0%

利害関係人の発行する有価証券等

<野村日経225 マザーファンド>

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 120	百万円 66	百万円 75

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.0%

*売買委託手数料総額は、この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です。

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2014年11月21日～2015年12月18日)

設定時残高 (元 本)	当期設定 元 本	当期解約 元 本	期末残高 (元 本)	取 引 の 理 由
百万円 1	百万円 -	百万円 -	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2015年12月18日現在)

親投資信託残高

銘 柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	千口 68,033	千円 86,089
野村日経225 マザーファンド	34,221	42,766

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年12月18日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	千円 86,089	% 66.6
野村日経225 マザーファンド	42,766	33.1
コール・ローン等、その他	432	0.3
投資信託財産総額	129,287	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年12月18日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	129,287,049
コール・ローン等	430,803
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	86,089,331
野村日経225 マザーファンド(評価額)	42,766,915
(B) 負債	411,147
未払信託報酬	408,772
その他未払費用	2,375
(C) 純資産総額(A-B)	128,875,902
元本	126,884,491
次期繰越損益金	1,991,411
(D) 受益権総口数	126,884,491口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,157円

(注) 期首元本額1百万円、期中追加設定元本額139百万円、期中一部解約元本額13百万円、計算口数当たり純資産額10,157円。

○損益の状況 (2014年11月21日～2015年12月18日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	52
受取利息	52
(B) 有価証券売買損益	1,881,245
売買益	2,063,370
売買損	△ 182,125
(C) 信託報酬等	△ 733,680
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,147,617
(E) 追加信託差損益金	843,794
(配当等相当額)	(57)
(売買損益相当額)	(843,737)
(F) 計(D+E)	1,991,411
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	1,991,411
追加信託差損益金	843,794
(配当等相当額)	(132,390)
(売買損益相当額)	(711,404)
分配準備積立金	1,147,617

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注) 分配金の計算過程(2014年11月21日～2015年12月18日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2014年11月21日～ 2015年12月18日
a. 配当等収益(経費控除後)	924,156円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	223,461円
c. 信託約款に定める収益調整金	843,794円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,991,411円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	156円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1 万円当たり分配金 (税込み)	0円
------------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

※分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合

分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

○お知らせ

- ①運用報告書(全体版)について電磁的方法により提供する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日: 2014年12月1日>
- ②書面決議の要件緩和等に関する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日: 2014年12月1日>
- ③書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用とする所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日: 2014年12月1日>
- ④有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日: 2015年8月3日>
- ⑤デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
 <変更適用日: 2015年8月13日>

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2015年12月18日現在)

<野村日経225 マザーファンド>

下記は、野村日経225 マザーファンド全体(46,800,436千口)の内容です。

国内株式

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)		
日本水産	108	50,760
マルハニチロ	10.8	21,589
鉱業 (0.1%)		
国際石油開発帝石	43.2	49,291
建設業 (2.8%)		
コムシスホールディングス	108	184,896
大成建設	108	86,076
大林組	108	124,524
清水建設	108	111,888
長谷工コーポレーション	21.6	29,376
鹿島建設	108	78,408
大和ハウス工業	108	363,744
積水ハウス	108	212,274
日揮	108	201,096
千代田化工建設	108	99,468
食料品 (5.3%)		
日清製粉グループ本社	108	211,896
明治ホールディングス	21.6	215,352
日本ハム	108	249,372
サッポロホールディングス	108	58,860
アサヒグループホールディングス	108	417,636
キリンホールディングス	108	185,544
宝ホールディングス	108	101,088
キッコーマン	108	445,500
味の素	108	295,488
ニチレイ	108	90,504
日本たばこ産業	108	484,704
繊維製品 (0.4%)		
東洋紡	108	18,144
ユニチカ	108	6,372
帝人	108	44,388

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
東レ	108	118,044
パルプ・紙 (0.3%)		
王子ホールディングス	108	52,164
日本製紙	10.8	20,012
北越紀州製紙	108	77,328
化学 (8.1%)		
クラレ	108	163,728
旭化成	108	83,754
昭和電工	108	15,768
住友化学	108	73,332
日産化学工業	108	303,696
日本曹達	108	76,140
東ソー	108	67,176
トクヤマ	108	29,268
デンカ	108	56,700
信越化学工業	108	714,744
三井化学	108	56,484
三菱ケミカルホールディングス	54	41,277
宇部興産	108	27,000
日本化薬	108	144,504
花王	108	652,104
富士フイルムホールディングス	108	524,016
資生堂	108	279,936
日東電工	108	928,368
医薬品 (8.0%)		
協和発酵キリン	108	231,876
武田薬品工業	108	645,948
アステラス製薬	540	918,540
大日本住友製薬	108	158,112
塩野義製薬	108	583,416
中外製薬	108	481,140
エーザイ	108	872,316

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
第一三共	108	273,078
石油・石炭製品 (0.3%)		
昭和シェル石油	108	112,320
J Xホールディングス	108	53,060
ゴム製品 (1.1%)		
横浜ゴム	54	105,030
ブリヂストン	108	465,588
ガラス・土石製品 (1.6%)		
旭硝子	108	75,384
日本板硝子	108	10,800
日本電気硝子	162	100,116
住友大阪セメント	108	49,356
太平洋セメント	108	39,312
東海カーボン	108	37,260
TOTO	54	218,430
日本碍子	108	298,944
鉄鋼 (0.2%)		
新日鐵住金	10.8	25,461
神戸製鋼所	108	14,256
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.8	20,066
日新製鋼	10.8	13,521
大平洋金属	108	34,560
非鉄金属 (1.3%)		
日本軽金属ホールディングス	108	22,896
三井金属鉱業	108	23,544
東邦亜鉛	108	28,944
三菱マテリアル	108	42,228
住友金属鉱山	108	148,770
DOWAホールディングス	108	91,476
古河機械金属	108	24,624
古河電気工業	108	28,620
住友電気工業	108	180,036
フジクラ	108	72,468
金属製品 (0.5%)		
SUMCO	10.8	10,670
東洋製綱グループホールディングス	108	250,128
機械 (4.7%)		
日本製鋼所	108	46,116

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
オークマ	108	108,972
アマダホールディングス	108	123,984
小松製作所	108	208,548
住友重機械工業	108	57,672
日立建機	108	194,832
クボタ	108	210,330
荏原製作所	108	61,668
ダイキン工業	108	923,184
日本精工	108	152,172
N T N	108	55,944
ジェイテクト	108	221,184
日立造船	21.6	14,385
三菱重工業	108	59,562
I H I	108	35,640
電気機器 (16.9%)		
日清紡ホールディングス	108	140,184
コニカミノルタ	108	129,276
ミネベア	108	116,100
日立製作所	108	74,854
東芝	108	30,510
三菱電機	108	136,512
富士電機	108	56,268
安川電機	108	172,692
明電舎	108	51,732
ジーエス・ユアサ コーポレーション	108	48,816
日本電気	108	41,796
富士通	108	67,402
沖電気工業	108	16,308
パナソニック	108	134,730
シャープ	108	12,960
ソニー	108	323,838
T D K	108	840,240
ミツミ電機	108	65,880
アルプス電気	108	350,460
パイオニア	108	35,748
横河電機	108	152,064
アドバンテスト	216	225,288
カシオ計算機	108	290,844

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
ファナック	108	2,277,180
京セラ	216	1,204,848
太陽誘電	108	182,844
S C R E E Nホールディングス	108	95,148
キヤノン	162	596,160
リコー	108	131,328
東京エレクトロン	108	810,000
輸送用機器 (7.1%)		
デンソー	108	625,320
三井造船	108	20,412
川崎重工業	108	48,600
日産自動車	108	135,756
いすゞ自動車	54	71,955
トヨタ自動車	108	827,064
日野自動車	108	152,496
三菱自動車工業	10.8	11,253
マツダ	21.6	54,162
本田技研工業	216	846,504
スズキ	108	395,928
富士重工業	108	533,736
精密機器 (3.1%)		
テルモ	216	851,040
ニコン	108	174,852
オリンパス	108	507,600
シチズンホールディングス	108	93,744
その他製品 (1.1%)		
凸版印刷	108	114,912
大日本印刷	108	129,384
ヤマハ	108	313,632
電気・ガス業 (0.3%)		
東京電力	10.8	7,959
中部電力	10.8	17,674
関西電力	10.8	15,832
東京瓦斯	108	59,907
大阪瓦斯	108	46,116
陸運業 (2.5%)		
東武鉄道	108	63,396
東京急行電鉄	108	101,952

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
小田急電鉄	108	133,056
京王電鉄	108	110,916
京成電鉄	108	160,056
東日本旅客鉄道	10.8	122,742
西日本旅客鉄道	10.8	85,384
東海旅客鉄道	10.8	226,584
日本通運	108	59,076
ヤマトホールディングス	108	268,758
海運業 (0.2%)		
日本郵船	108	31,644
商船三井	108	32,184
川崎汽船	108	26,892
空運業 (0.1%)		
A N Aホールディングス	108	37,206
倉庫・運輸関連業 (0.3%)		
三菱倉庫	108	171,396
情報・通信業 (10.9%)		
ヤフー	43.2	21,772
トレンドマイクロ	108	568,080
スカパー J S A Tホールディングス	10.8	7,149
日本電信電話	21.6	102,081
K D D I	648	1,988,712
N T Tドコモ	10.8	26,665
東宝	10.8	36,180
エヌ・ティ・ティ・データ	108	643,680
コナミホールディングス	108	327,240
ソフトバンクグループ	324	1,978,344
卸売業 (2.0%)		
双日	10.8	2,818
伊藤忠商事	108	154,332
丸紅	108	67,586
豊田通商	108	303,588
三井物産	108	154,170
住友商事	108	135,108
三菱商事	108	213,840
小売業 (11.9%)		
J. フロント リテイリング	54	98,064
三越伊勢丹ホールディングス	108	174,744

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
セブン&アイ・ホールディングス	108	589,032
高島屋	108	114,696
丸井グループ	108	209,952
イオン	108	197,802
ユニーグループ・ホールディングス	108	84,024
ファーストリテイリング	108	4,759,560
銀行業 (1.2%)		
新生銀行	108	23,760
あおぞら銀行	108	45,684
三菱UFJフィナンシャル・グループ	108	81,885
りそなホールディングス	10.8	6,298
三井住友トラスト・ホールディングス	108	49,366
三井住友フィナンシャルグループ	10.8	49,064
千葉銀行	108	89,208
横浜銀行	108	77,166
ふくおかフィナンシャルグループ	108	61,560
静岡銀行	108	125,280
みずほフィナンシャルグループ	108	26,287
証券、商品先物取引業 (0.5%)		
大和証券グループ本社	108	81,216
野村ホールディングス	108	75,200
松井証券	108	120,636
保険業 (1.1%)		
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	27	101,979

銘柄	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
MS & ADインシュアランスグループホール	32.4	109,155
ソニーフィナンシャルホールディングス	21.6	46,569
第一生命保険	10.8	21,859
東京海上ホールディングス	54	244,350
T & Dホールディングス	21.6	34,516
その他金融業 (0.5%)		
クレディセゾン	108	262,116
不動産業 (2.2%)		
東急不動産ホールディングス	108	82,728
三井不動産	108	339,120
三菱地所	108	274,806
東京建物	54	74,088
住友不動産	108	393,120
サービス業 (3.3%)		
ディー・エヌ・エー	32.4	61,916
電通	108	730,080
東京ドーム	108	61,668
セコム	108	883,980
合 計	株数・金額 22,739	52,273,254
	銘柄数<比率> 225	<89.4%>

*各銘柄の業種分類は、期末の時点での分類に基づいています。
*銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
*評価額欄の< >内は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の比率。
*評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円 6,215	百万円 -
	日経225		

*単位未満は切り捨て。

*一印は組み入れなし。

<国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド>

下記は、国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド全体(505,841,897千口)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	454,303,000 (3,360,000)	492,005,863 (4,268,183)	76.9 (0.7)	— (—)	50.1 (0.6)	21.2 (0.0)	5.6 (0.0)
地方債証券	48,749,370 (48,749,370)	50,864,097 (50,864,097)	7.9 (7.9)	— (—)	3.3 (3.3)	3.4 (3.4)	1.2 (1.2)
特殊債券 (除く金融債)	50,491,600 (50,491,600)	52,612,944 (52,612,944)	8.2 (8.2)	— (—)	4.0 (4.0)	2.2 (2.2)	2.1 (2.1)
金融債券	6,600,000 (6,600,000)	6,628,570 (6,628,570)	1.0 (1.0)	— (—)	— (—)	0.6 (0.6)	0.5 (0.5)
普通社債券 (含む投資法人債券)	31,107,000 (31,107,000)	31,924,440 (31,924,440)	5.0 (5.0)	— (—)	2.1 (2.1)	1.9 (1.9)	1.0 (1.0)
合 計	591,250,970 (140,307,970)	634,035,915 (146,298,235)	99.1 (22.9)	— (—)	59.5 (10.1)	29.3 (8.1)	10.3 (4.7)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、このファンドが組み入れているマザーファンドの純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*—印は組み入れなし。

*評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
		%	千円	千円	
国債証券					
国庫債券	利付(2年)第348回	0.1	4,200,000	4,206,930	2017/1/15
国庫債券	利付(2年)第349回	0.1	4,300,000	4,307,654	2017/2/15
国庫債券	利付(2年)第350回	0.1	2,300,000	2,304,370	2017/3/15
国庫債券	利付(2年)第351回	0.1	1,600,000	1,603,248	2017/4/15
国庫債券	利付(2年)第353回	0.1	1,600,000	1,603,664	2017/6/15
国庫債券	利付(5年)第103回	0.3	2,100,000	2,109,240	2017/3/20
国庫債券	利付(5年)第104回	0.2	1,000,000	1,003,160	2017/3/20
国庫債券	利付(5年)第105回	0.2	4,500,000	4,517,145	2017/6/20
国庫債券	利付(5年)第106回	0.2	5,600,000	5,624,416	2017/9/20
国庫債券	利付(5年)第107回	0.2	3,800,000	3,818,202	2017/12/20
国庫債券	利付(5年)第108回	0.1	1,800,000	1,805,022	2017/12/20
国庫債券	利付(5年)第109回	0.1	2,800,000	2,808,456	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第110回	0.3	1,000,000	1,007,510	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第111回	0.4	1,400,000	1,413,650	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第112回	0.4	2,200,000	2,223,584	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第113回	0.3	5,000,000	5,041,150	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第114回	0.3	1,500,000	1,513,380	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第115回	0.2	7,300,000	7,345,114	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第116回	0.2	6,100,000	6,139,284	2018/12/20
国庫債券	利付(5年)第117回	0.2	6,400,000	6,444,608	2019/3/20
国庫債券	利付(5年)第118回	0.2	5,000,000	5,035,800	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第119回	0.1	4,000,000	4,014,640	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第120回	0.2	5,500,000	5,541,195	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第121回	0.1	3,500,000	3,513,090	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第122回	0.1	7,300,000	7,326,207	2019/12/20
国庫債券	利付(5年)第123回	0.1	7,300,000	7,324,747	2020/3/20
国庫債券	利付(5年)第124回	0.1	8,600,000	8,628,896	2020/6/20
国庫債券	利付(5年)第125回	0.1	8,700,000	8,728,797	2020/9/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	3,160,000	4,065,150	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	900,000	1,111,221	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	900,000	1,111,671	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,100,000	1,360,634	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	1,200,000	1,417,404	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	1,300,000	1,497,600	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	1,400,000	1,529,360	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	1,300,000	1,298,349	2055/3/20
国庫債券	利付(10年)第285回	1.7	2,620,000	2,676,932	2017/3/20
国庫債券	利付(10年)第286回	1.8	800,000	822,176	2017/6/20
国庫債券	利付(10年)第287回	1.9	1,550,000	1,595,275	2017/6/20
国庫債券	利付(10年)第288回	1.7	1,850,000	1,906,702	2017/9/20
国庫債券	利付(10年)第289回	1.5	2,000,000	2,061,480	2017/12/20
国庫債券	利付(10年)第290回	1.4	1,250,000	1,290,225	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第291回	1.3	1,400,000	1,441,916	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第292回	1.7	1,600,000	1,662,256	2018/3/20
国庫債券	利付(10年)第293回	1.8	750,000	784,140	2018/6/20
国庫債券	利付(10年)第294回	1.7	500,000	521,515	2018/6/20

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (10年) 第295回	1.5	1,600,000	1,660,864	2018/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第297回	1.4	1,100,000	1,146,794	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第298回	1.3	1,500,000	1,559,325	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第299回	1.3	1,400,000	1,459,696	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第300回	1.5	1,000,000	1,049,120	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第301回	1.5	1,500,000	1,578,870	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第302回	1.4	700,000	734,356	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第303回	1.4	3,300,000	3,472,359	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,048,490	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,310,289	2019/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,174,750	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,791,817	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第308回	1.3	1,700,000	1,796,866	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第309回	1.1	3,000,000	3,144,030	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第310回	1.0	3,700,000	3,870,052	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第311回	0.8	1,800,000	1,865,664	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第312回	1.2	4,950,000	5,237,496	2020/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第313回	1.3	3,200,000	3,411,744	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第314回	1.1	2,200,000	2,322,562	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第315回	1.2	2,600,000	2,766,062	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,481,732	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第317回	1.1	1,800,000	1,909,908	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第318回	1.0	3,200,000	3,377,024	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,967,845	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第320回	1.0	3,500,000	3,702,020	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第321回	1.0	3,200,000	3,392,288	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,529,264	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,850,363	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,357,504	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第325回	0.8	4,900,000	5,147,009	2022/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,193,597	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第327回	0.8	3,800,000	3,995,852	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第328回	0.6	5,500,000	5,707,955	2023/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第329回	0.8	5,600,000	5,895,904	2023/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第330回	0.8	3,800,000	4,002,882	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	1,972,238	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第332回	0.6	5,200,000	5,397,600	2023/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第333回	0.6	4,500,000	4,670,505	2024/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,252,930	2024/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第335回	0.5	4,700,000	4,833,621	2024/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,775,222	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第337回	0.3	3,700,000	3,737,629	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第338回	0.4	5,400,000	5,495,472	2025/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第339回	0.4	5,900,000	5,995,934	2025/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第340回	0.4	6,000,000	6,088,500	2025/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	130,251	2029/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	250,430	2030/2/20
国庫債券	利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	198,307	2030/5/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,194,777	2030/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	184,239	2031/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第6回	2.4	700,000	881,734	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	747,336	2032/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	116,639	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年) 第9回	1.4	65,000	71,583	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	262,555	2033/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	183,363	2033/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	266,512	2033/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	346,100	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,007,760	2034/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,148,328	2034/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	1,215,000	1,550,425	2034/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,700,000	2,139,671	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	2,000,000	2,479,560	2035/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	1,981,328	2035/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,419,821	2035/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,732,122	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	763,716	2036/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,069,756	2036/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	891,891	2036/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	618,145	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,066,894	2037/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	1,977,629	2037/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	895,930	2038/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	800,000	1,009,408	2038/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,118,529	2039/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,000,000	1,223,220	2039/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,365,766	2040/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,361,580	2040/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	2,816,511	2041/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	1,700,000	2,006,952	2041/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,123,388	2042/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,100,000	2,429,595	2042/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,585,458	2043/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	1,848,720	2043/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,243,847	2043/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,107,090	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,327,956	2044/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,438,008	2044/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,547,952	2044/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,005,336	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,300,000	1,371,058	2045/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	2,500,000	2,697,250	2045/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,439,284	2045/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第34回	3.5	190,000	198,363	2017/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第35回	3.3	228,000	237,468	2017/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第36回	3.0	380,000	400,174	2017/9/20

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付(20年)第37回	3.1	320,000	337,545	2017/9/20
国庫債券	利付(20年)第38回	2.7	170,000	180,407	2018/3/20
国庫債券	利付(20年)第39回	2.6	511,000	541,138	2018/3/20
国庫債券	利付(20年)第40回	2.3	525,000	558,453	2018/9/20
国庫債券	利付(20年)第41回	1.5	255,000	267,525	2019/3/20
国庫債券	利付(20年)第42回	2.6	683,000	740,911	2019/3/20
国庫債券	利付(20年)第43回	2.9	400,000	443,444	2019/9/20
国庫債券	利付(20年)第44回	2.5	150,000	165,763	2020/3/20
国庫債券	利付(20年)第45回	2.4	242,000	266,405	2020/3/20
国庫債券	利付(20年)第46回	2.2	90,000	98,773	2020/6/22
国庫債券	利付(20年)第47回	2.2	1,230,000	1,356,542	2020/9/21
国庫債券	利付(20年)第48回	2.5	200,000	224,648	2020/12/21
国庫債券	利付(20年)第49回	2.1	200,000	221,744	2021/3/22
国庫債券	利付(20年)第50回	1.9	183,000	200,977	2021/3/22
国庫債券	利付(20年)第51回	2.0	310,000	343,507	2021/6/21
国庫債券	利付(20年)第52回	2.1	100,000	111,845	2021/9/21
国庫債券	利付(20年)第53回	2.1	250,000	280,965	2021/12/20
国庫債券	利付(20年)第54回	2.2	250,000	282,460	2021/12/20
国庫債券	利付(20年)第55回	2.0	231,000	259,279	2022/3/21
国庫債券	利付(20年)第56回	2.0	120,000	135,276	2022/6/20
国庫債券	利付(20年)第57回	1.9	210,000	235,294	2022/6/20
国庫債券	利付(20年)第58回	1.9	180,000	202,453	2022/9/20
国庫債券	利付(20年)第59回	1.7	230,000	256,272	2022/12/20
国庫債券	利付(20年)第60回	1.4	780,000	852,797	2022/12/20
国庫債券	利付(20年)第61回	1.0	300,000	320,100	2023/3/20
国庫債券	利付(20年)第62回	0.8	440,000	463,421	2023/6/20
国庫債券	利付(20年)第63回	1.8	300,000	338,433	2023/6/20
国庫債券	利付(20年)第64回	1.9	400,000	455,336	2023/9/20
国庫債券	利付(20年)第65回	1.9	455,000	519,337	2023/12/20
国庫債券	利付(20年)第66回	1.8	300,000	340,044	2023/12/20
国庫債券	利付(20年)第67回	1.9	310,000	354,739	2024/3/20
国庫債券	利付(20年)第68回	2.2	290,000	338,946	2024/3/20
国庫債券	利付(20年)第69回	2.1	560,000	649,947	2024/3/20
国庫債券	利付(20年)第70回	2.4	540,000	642,162	2024/6/20
国庫債券	利付(20年)第71回	2.2	200,000	234,482	2024/6/20
国庫債券	利付(20年)第72回	2.1	670,000	782,097	2024/9/20
国庫債券	利付(20年)第73回	2.0	1,600,000	1,859,392	2024/12/20
国庫債券	利付(20年)第74回	2.1	1,300,000	1,522,261	2024/12/20
国庫債券	利付(20年)第75回	2.1	600,000	704,070	2025/3/20
国庫債券	利付(20年)第76回	1.9	910,000	1,051,313	2025/3/20
国庫債券	利付(20年)第77回	2.0	700,000	815,059	2025/3/20
国庫債券	利付(20年)第78回	1.9	800,000	925,832	2025/6/20
国庫債券	利付(20年)第79回	2.0	860,000	1,003,276	2025/6/20
国庫債券	利付(20年)第80回	2.1	900,000	1,058,319	2025/6/20
国庫債券	利付(20年)第81回	2.0	360,000	420,732	2025/9/20
国庫債券	利付(20年)第82回	2.1	820,000	966,616	2025/9/20
国庫債券	利付(20年)第83回	2.1	1,370,000	1,618,709	2025/12/20
国庫債券	利付(20年)第84回	2.0	1,200,000	1,406,136	2025/12/20

銘柄	当	期	末													
			利	率	額	面	金	額	評	価	額	償	還	年	月	日
国債証券			%		千円			千円								
国庫債券	利付	(20年)	第85回	2.1	400,000	473,652	2026/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第86回	2.3	1,400,000	1,685,740	2026/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第87回	2.2	500,000	597,055	2026/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第88回	2.3	1,100,000	1,327,854	2026/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第89回	2.2	470,000	562,557	2026/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第90回	2.2	1,500,000	1,799,475	2026/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第91回	2.3	250,000	302,520	2026/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第92回	2.1	1,550,000	1,846,949	2026/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第93回	2.0	300,000	354,879	2027/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第94回	2.1	200,000	238,758	2027/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第95回	2.3	700,000	853,167	2027/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第96回	2.1	400,000	478,396	2027/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第97回	2.2	1,300,000	1,572,194	2027/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第98回	2.1	300,000	359,226	2027/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第99回	2.1	2,100,000	2,518,677	2027/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第100回	2.2	1,520,000	1,843,577	2028/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第101回	2.4	250,000	309,250	2028/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第102回	2.4	500,000	619,720	2028/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第103回	2.3	600,000	736,080	2028/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第104回	2.1	400,000	481,196	2028/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第105回	2.1	1,900,000	2,287,524	2028/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第106回	2.2	400,000	486,720	2028/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第107回	2.1	300,000	361,878	2028/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第108回	1.9	1,600,000	1,889,456	2028/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第109回	1.9	900,000	1,063,737	2029/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第110回	2.1	1,100,000	1,328,470	2029/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第111回	2.2	800,000	977,464	2029/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第112回	2.1	1,800,000	2,175,030	2029/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第113回	2.1	1,800,000	2,177,406	2029/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第114回	2.1	2,500,000	3,027,125	2029/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第115回	2.2	500,000	611,970	2029/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第116回	2.2	1,100,000	1,346,807	2030/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第117回	2.1	2,400,000	2,906,640	2030/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第118回	2.0	500,000	598,925	2030/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第119回	1.8	800,000	936,112	2030/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第120回	1.6	500,000	570,850	2030/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第121回	1.9	3,000,000	3,552,360	2030/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第122回	1.8	1,100,000	1,286,659	2030/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第123回	2.1	2,800,000	3,396,456	2030/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第124回	2.0	1,000,000	1,198,360	2030/12/20									
国庫債券	利付	(20年)	第125回	2.2	1,700,000	2,088,569	2031/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第126回	2.0	1,000,000	1,198,840	2031/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第127回	1.9	800,000	947,872	2031/3/20									
国庫債券	利付	(20年)	第128回	1.9	2,000,000	2,368,560	2031/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第129回	1.8	500,000	584,635	2031/6/20									
国庫債券	利付	(20年)	第130回	1.8	2,300,000	2,689,298	2031/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第131回	1.7	800,000	923,272	2031/9/20									
国庫債券	利付	(20年)	第132回	1.7	1,000,000	1,152,960	2031/12/20									

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,635,620	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	900,000	1,050,498	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	460,684	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	795,935	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,151,260	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	895,952	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	794,913	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	3,100,000	3,567,294	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	2,100,000	2,413,425	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	1,250,000	1,456,612	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	1,700,000	1,923,533	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,673,025	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	2,600,000	2,979,652	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	2,400,000	2,746,296	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	2,700,000	3,039,768	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	2,500,000	2,767,550	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	3,000,000	3,314,250	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	3,030,000	3,288,792	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	2,700,000	2,829,087	2034/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第152回	1.2	3,400,000	3,552,694	2035/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第153回	1.3	3,450,000	3,657,621	2035/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第154回	1.2	3,500,000	3,639,405	2035/9/20
ポーランド共和国 第12回円貨債券 (2012)	1.05	100,000	101,227	2017/11/8
ポーランド共和国 第15回円貨債券 (2013)	0.91	100,000	101,806	2020/11/13
小 計		454,303,000	492,005,863	
地方債証券				
東京都 公募第644回	1.77	60,000	61,276	2017/3/17
東京都 公募第648回	1.84	300,000	308,004	2017/6/20
東京都 公募第655回	1.42	100,000	103,060	2018/3/20
東京都 公募第659回	1.62	300,000	311,709	2018/6/20
東京都 公募第660回	1.58	100,000	103,802	2018/6/20
東京都 公募第664回	1.4	100,000	103,991	2018/12/20
東京都 公募第668回	1.54	200,000	209,580	2019/3/20
東京都 公募第671回	1.42	100,000	104,755	2019/6/20
東京都 公募第685回	1.13	100,000	104,685	2020/6/19
東京都 公募第690回	1.29	200,000	211,848	2020/12/18
東京都 公募第703回	0.99	100,000	105,314	2021/12/20
東京都 公募第707回	0.87	100,000	104,781	2022/3/18
東京都 公募第708回	0.89	100,000	105,004	2022/6/20
東京都 公募第710回	0.81	100,000	104,488	2022/6/20
東京都 公募第712回	0.77	100,000	104,180	2022/9/20
東京都 公募第715回	0.76	100,000	104,191	2022/12/20
東京都 公募第716回	0.77	200,000	208,520	2022/12/20
東京都 公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	123,552	2038/9/17
東京都 公募第10回	2.31	200,000	239,290	2039/9/20
東京都 公募 (7年) 第1回	0.7	300,000	302,865	2017/6/20
東京都 公募 (7年) 第3回	0.58	100,000	101,433	2018/9/20
東京都 公募第1回	1.54	300,000	330,189	2023/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
東京都	公募第7回	2.16	100,000	117,056	2025/9/19
東京都	公募(20年)第16回	2.01	200,000	235,460	2028/12/20
東京都	公募(20年)第17回	2.09	200,000	237,400	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	119,605	2030/12/20
東京都	公募(20年)第26回	1.74	300,000	341,097	2032/6/18
北海道	公募平成19年度第2回	1.84	500,000	512,345	2017/5/31
北海道	公募平成19年度第4回	1.98	100,000	102,816	2017/6/29
北海道	公募平成20年度第7回	1.72	300,000	313,218	2018/9/25
北海道	公募平成21年度第6回	1.6	100,000	105,417	2019/8/28
北海道	公募平成21年度第10回	1.5	100,000	105,373	2019/11/27
北海道	公募(5年)平成23年度第14回	0.35	100,000	100,284	2017/3/23
北海道	公募平成24年度第6回	0.84	100,000	104,300	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回	0.79	100,000	103,925	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回	0.58	300,000	307,368	2023/4/26
北海道	公募(5年)平成25年度第8回	0.31	100,000	100,513	2018/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第8回	0.178	200,000	200,360	2019/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第10回	0.147	100,000	100,047	2019/11/28
宮城県	公募(5年)第9回1号	0.35	500,000	503,475	2018/7/26
神奈川県	公募第155回	1.61	100,000	103,852	2018/6/20
神奈川県	公募第156回	1.66	101,000	105,420	2018/9/20
神奈川県	公募第184回	1.02	100,000	104,915	2021/6/18
神奈川県	公募第188回	1.05	200,000	211,534	2022/3/18
神奈川県	公募第196回	0.678	100,000	103,600	2023/3/20
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	104,699	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	103,053	2024/3/19
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	201,944	2024/12/20
神奈川県	公募(30年)第3回	2.62	100,000	125,118	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	357,630	2027/3/19
神奈川県	公募(5年)第51回	0.28	500,000	501,310	2017/3/17
神奈川県	公募(5年)第56回	0.29	100,000	100,495	2018/3/20
大阪府	公募第300回	1.8	100,000	102,123	2017/3/29
大阪府	公募第301回	1.83	200,000	204,576	2017/4/26
大阪府	公募第303回	1.93	300,000	308,181	2017/6/28
大阪府	公募第304回	1.98	150,000	154,441	2017/7/28
大阪府	公募第320回	1.84	400,000	419,936	2018/11/27
大阪府	公募第337回	1.44	200,000	211,126	2020/4/28
大阪府	公募第346回	1.25	100,000	105,397	2021/1/28
大阪府	公募第356回	1.06	100,000	105,152	2021/12/27
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	107,312	2023/11/28
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	304,074	2024/8/28
大阪府	公募(2年)第26回	0.057	1,130,000	1,129,028	2017/1/27
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	119,421	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	114,469	2031/12/22
大阪府	公募第98回	0.295	200,000	200,890	2018/9/27
大阪府	公募(5年)第99回	0.24	240,000	240,688	2018/10/30
大阪府	公募(5年)第101回	0.23	148,000	148,404	2018/12/26
大阪府	公募第102回	0.223	100,000	100,251	2019/1/30
京都府	公募平成19年度第1回	1.81	100,000	103,073	2017/9/26

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
京都府	公募平成20年度第3回	1.57	140,000	146,273	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	105,066	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回	0.8	100,000	104,400	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	107,500	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	204,070	2024/9/19
兵庫県	公募平成19年度第2回	1.8	100,000	102,394	2017/5/24
兵庫県	公募平成20年度第3回	1.76	100,000	103,963	2018/5/22
兵庫県	公募平成20年度第12回	1.82	100,000	104,971	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回	1.6	100,000	104,561	2019/1/23
兵庫県	公募平成21年度第13回	1.48	100,000	104,850	2019/7/17
兵庫県	公募平成22年度第1回	1.46	100,000	105,675	2020/4/16
兵庫県	公募(30年)第2回	2.36	100,000	119,365	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第3回	1.35	100,000	109,201	2027/7/16
兵庫県	公募(12年)第3回	0.56	300,000	303,912	2025/4/16
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	120,758	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	120,202	2029/11/19
静岡県	公募平成19年度第1回	1.77	100,000	102,452	2017/5/30
静岡県	公募平成19年度第4回	1.94	200,000	206,308	2017/8/28
静岡県	公募平成19年度第7回	1.81	100,000	103,366	2017/11/28
静岡県	公募平成21年度第2回	1.65	100,000	105,545	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回	1.54	100,000	105,729	2019/11/25
静岡県	公募(5年)平成24年度第8回	0.236	100,000	100,291	2017/10/18
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	103,603	2023/3/22
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	170,144	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	102,038	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	100,000	101,927	2024/10/24
静岡県	公募(20年)第11回	1.841	100,000	115,731	2030/10/18
静岡県	公募(20年)第14回	1.736	100,000	113,641	2032/6/18
愛知県	公募平成19年度第3回	1.89	111,000	114,346	2017/8/17
愛知県	公募平成19年度第4回	1.87	100,000	103,282	2017/10/18
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	210,000	218,576	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	117,951	2028/12/20
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	114,000	120,366	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回	1.41	100,000	105,511	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回	1.364	100,000	105,611	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回	1.153	100,000	105,038	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回	1.006	100,000	105,451	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回	0.982	100,000	105,438	2022/4/27
愛知県	公募(5年)平成24年度第6回	0.2	1,100,000	1,102,156	2017/7/13
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	1.314	400,000	436,408	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	114,819	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	108,022	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	105,529	2034/11/14
広島県	公募平成20年度第3回	1.6	300,000	312,654	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回	1.26	200,000	211,520	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	104,427	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	208,952	2023/9/25
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	0.21	300,000	301,236	2019/2/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
埼玉県	公募平成19年度第7回	1.65	200,000	206,916	2018/2/27
埼玉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	103,463	2018/4/24
埼玉県	公募平成21年度第5回	1.41	100,000	105,037	2019/9/25
埼玉県	公募平成22年度第2回	1.37	200,000	211,262	2020/5/26
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	100,000	104,646	2022/7/25
埼玉県	公募(5年)平成24年度第8回	0.21	200,000	200,530	2017/12/28
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	105,435	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	154,756	2023/9/27
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	0.261	100,000	100,531	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	103,112	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	102,988	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	203,908	2024/9/26
福岡県	公募平成19年度第6回	1.72	100,000	102,876	2017/9/20
福岡県	公募平成19年度第8回	1.62	100,000	103,094	2017/12/20
福岡県	公募平成20年度第3回	1.59	100,000	103,801	2018/6/20
福岡県	公募平成22年度第5回	0.94	100,000	103,963	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	105,211	2021/10/25
福岡県	公募平成24年度第10回	0.18	100,000	100,220	2018/1/29
福岡県	公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,225	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	111,101	2026/11/27
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	125,289	2037/9/18
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	1.827	100,000	108,502	2044/6/20
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	2.05	100,000	118,215	2028/12/20
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	1.635	100,000	112,032	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	103,467	2018/4/25
千葉県	公募平成20年度第6回	1.64	200,000	208,914	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第11回	1.42	180,000	189,819	2020/1/24
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,862	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	105,011	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第4回	0.22	100,000	100,244	2017/8/25
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	104,715	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第2回	0.26	900,000	904,131	2018/5/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	105,182	2023/6/23
千葉県	公募(20年)第8回	2.18	100,000	120,394	2030/4/19
千葉県	公募(20年)第17回	1.403	100,000	106,479	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	200,000	209,108	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回	1.55	150,000	158,571	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回	0.24	1,100,000	1,104,994	2018/12/25
群馬県	公募第8回	1.03	100,000	105,325	2021/11/25
群馬県	公募(5年)第4回	0.235	600,000	602,724	2018/11/22
岐阜県	公募平成19年度第1回	1.87	190,000	196,296	2017/10/26
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	190,321	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第51回	1.9	100,000	102,742	2017/6/23
共同発行市場地方債	公募第56回	1.72	400,000	412,608	2017/11/24
共同発行市場地方債	公募第58回	1.59	270,500	279,045	2018/1/25
共同発行市場地方債	公募第62回	1.74	100,000	104,029	2018/5/25
共同発行市場地方債	公募第63回	1.88	100,000	104,526	2018/6/25
共同発行市場地方債	公募第64回	1.78	262,000	273,577	2018/7/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
共同発行市場地方債	公募第65回	1.62	700,000	728,938	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	188,359	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	942,219	2018/11/22
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	326,966	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	316,236	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	527,180	2020/3/25
共同発行市場地方債	公募第85回	1.44	100,000	105,800	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	104,872	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	104,358	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	114,859	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	316,767	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	316,893	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	106,068	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第101回	1.05	300,000	315,546	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	157,728	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	105,033	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	210,940	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	209,632	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	209,754	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	200,000	208,274	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	104,371	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	208,778	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	104,715	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	208,920	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	310,860	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	102,791	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	100,000	103,188	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	105,355	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	104,592	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	310,053	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	103,819	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	103,027	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	205,042	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	204,242	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	157,853	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	544,482	2025/2/25
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	117,321	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	103,873	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	104,640	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	702,625	2019/3/25
福島県	公募平成24年度第2回	0.17	100,000	100,170	2018/2/26
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	202,694	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,279	2023/11/29
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,279	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	242,297	2023/12/26
大阪市	公募平成20年度第3回	1.82	110,000	114,874	2018/7/23
大阪市	公募平成21年度第6回	1.57	100,000	105,702	2019/11/25
大阪市	公募平成25年度第1回	0.401	800,000	805,616	2018/5/23

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券		%	千円	千円	
大阪市	公募平成25年度第6回	0.694	100,000	103,253	2023/11/22
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	113,342	2026/7/17
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	122,746	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	119,719	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	100,000	112,614	2032/12/21
名古屋市	公募第460回	1.74	200,000	205,840	2017/9/20
名古屋市	公募第464回	1.61	300,000	312,717	2018/9/20
名古屋市	公募第469回	1.34	100,000	105,030	2019/12/20
名古屋市	公募第478回	1.063	100,000	105,913	2022/3/18
名古屋市	公募第488回	0.598	200,000	204,736	2024/9/20
名古屋市	公募(6年)第1回	0.283	200,000	201,068	2018/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	212,072	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	103,292	2029/11/16
京都市	公募平成19年度第2回	1.74	300,000	310,011	2017/12/27
京都市	公募平成19年度第4回	1.62	190,000	196,372	2018/2/26
京都市	公募平成23年度第4回	1.067	100,000	105,558	2021/12/22
京都市	公募平成25年度第3回	0.312	100,000	100,631	2018/9/27
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	116,350	2025/9/19
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	104,891	2034/11/24
神戸市	公募平成21年度第7回	1.69	100,000	105,644	2019/6/20
横浜市	公募平成20年度第3回	1.56	100,000	104,033	2018/9/7
横浜市	公募公債平成20年度5回	1.58	200,000	209,030	2018/12/20
横浜市	公募平成21年度第4回	1.35	200,000	209,588	2019/9/20
横浜市	公募平成22年度第5回	1.265	100,000	105,673	2020/12/11
横浜市	公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	208,988	2022/10/17
横浜市	公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	207,080	2023/5/19
横浜市	公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	206,690	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	202,288	2024/12/13
横浜市	公募(20年)第30回	1.376	100,000	105,889	2034/10/20
札幌市	公募平成19年度第3回	1.77	100,000	102,964	2017/9/20
札幌市	公募平成22年度第4回	1.05	100,000	104,256	2020/6/19
札幌市	公募(5年)平成24年度第8回	0.2	200,000	200,480	2017/12/20
札幌市	公募平成26年度第4回	0.54	100,000	101,906	2024/6/20
札幌市	公募平成26年度第9回	0.43	200,000	201,576	2024/12/20
川崎市	公募第82回	1.52	100,000	105,431	2019/9/20
川崎市	公募第85回	0.72	100,000	103,878	2022/12/20
川崎市	公募(20年)第17回	1.527	100,000	109,772	2033/5/9
川崎市	公募第32回	0.22	150,000	150,327	2017/6/20
北九州市	公募(5年)平成25年度第2回	0.312	100,000	100,645	2018/9/27
北九州市	公募(20年)第14回	1.732	100,000	113,169	2032/11/12
福岡市	公募平成20年度第3回	1.52	100,000	103,614	2018/6/20
福岡市	公募平成24年度第5回	0.19	100,000	100,223	2017/12/26
福岡市	公募(5年)平成25年度第2回	0.35	300,000	302,121	2018/7/25
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	107,998	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	101,800	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	161,438	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	105,005	2019/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	602,850	2019/1/29

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
		%	千円	千円	
地方債証券					
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,829	2022/4/25
鹿児島県	公募(5年)平成25年度第1回	0.24	100,000	100,445	2018/10/31
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	101,957	2023/4/26
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	417,908	2020/11/30
山梨県	公募平成19年度第1回	1.86	200,000	206,630	2017/10/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	104,971	2019/10/30
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	105,522	2020/3/31
愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	第96回	2.34	100,000	120,779	2028/12/20
福岡北九州高速道路債券	第117回	2.26	100,000	119,602	2028/12/20
東京都住宅供給公社債券	第5回	2.02	200,000	205,938	2017/9/20
小	計		48,749,370	50,864,097	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第344回	1.6	200,000	213,508	2020/7/15
公営企業債券	政府保証第875回	1.7	100,000	102,279	2017/5/22
公営企業債券	政府保証第880回	1.7	131,000	135,023	2017/11/17
公営企業債券	政府保証第881回	1.5	200,000	205,902	2018/1/23
公営企業債券	政府保証第886回	1.8	203,000	211,668	2018/6/19
公営企業債券	政府保証15年第1回	1.6	300,000	319,983	2020/6/22
政保	地方公営企業等金融機構債券 第2回	1.6	400,000	417,492	2018/11/16
地方公共団体金融機構債券	政府保証第5回	1.2	200,000	208,438	2019/10/18
地方公共団体金融機構債券	政府保証第16回	1.0	100,000	104,171	2020/9/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第1回	0.4	100,000	100,533	2017/9/27
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第4回	0.4	500,000	503,515	2018/3/26
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	104,428	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	100,000	104,663	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	105,458	2023/7/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第10回	0.385	300,000	303,138	2019/7/24
政保	地方公共団体金融機構債券(4年) 第6回	0.205	400,000	400,744	2017/8/29
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	120,201	2024/4/12
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第14回	0.199	300,000	301,059	2020/6/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	300,000	303,327	2025/2/17
日本政策金融公庫債券	政府保証第22回	0.243	2,000,000	2,008,460	2018/10/26
新関西国際空港債券	政府保証第1回	0.801	151,000	157,671	2022/8/29
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第2回	0.151	200,000	200,200	2017/11/17
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第3回	0.117	2,100,000	2,101,302	2018/5/23
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第5回	0.059	3,590,000	3,587,558	2017/11/2
日本政策投資銀行債券	政府保証第18回	1.9	100,000	102,993	2017/8/16
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	115,026	2023/6/19
日本政策投資銀行社債	政府保証第5回	1.4	100,000	104,335	2019/4/15
日本政策投資銀行社債	政府保証第9回	1.0	141,000	146,881	2020/9/14
日本政策投資銀行社債	政府保証第10回	0.5	100,000	100,612	2017/6/23
日本政策投資銀行社債	政府保証第16回	0.819	102,000	106,668	2022/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第6回	1.9	100,000	109,186	2021/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第9回	1.9	100,000	109,320	2021/3/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第25回	1.8	100,000	101,909	2017/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第42回	1.8	100,000	103,170	2017/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第56回	1.4	205,000	211,273	2018/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第58回	1.7	136,000	141,343	2018/5/30

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第60回	1.8	283,000	295,219	2018/6/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第62回	1.7	100,000	104,211	2018/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第67回	1.6	341,000	355,690	2018/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第69回	1.6	100,000	104,422	2018/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第71回	1.4	100,000	103,916	2018/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第92回	2.1	200,000	239,800	2029/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第97回	2.1	200,000	239,896	2029/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第98回	1.3	300,000	314,706	2020/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第99回	2.2	200,000	242,690	2030/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第100回	1.4	400,000	421,556	2020/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第106回	2.1	200,000	240,032	2030/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第114回	1.9	200,000	234,528	2030/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第123回	2.1	100,000	117,988	2040/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第137回	1.2	440,000	466,122	2021/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第149回	1.0	140,000	147,270	2021/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第155回	0.9	100,000	104,740	2022/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第157回	0.9	140,000	146,718	2022/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第165回	1.83	100,000	111,835	2042/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第168回	0.839	100,000	104,647	2022/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第169回	1.634	100,000	112,809	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第170回	0.801	218,000	227,639	2022/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第171回	1.56	100,000	111,611	2032/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第172回	1.919	300,000	341,199	2042/8/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第173回	0.819	200,000	209,192	2022/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第175回	0.791	200,000	208,854	2022/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第180回	0.734	200,000	208,124	2022/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第182回	0.834	400,000	419,188	2023/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第183回	1.726	100,000	114,029	2033/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第189回	0.541	196,000	201,282	2023/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第190回	0.605	400,000	412,640	2023/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第193回	0.882	200,000	210,506	2023/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第197回	0.835	272,000	285,434	2023/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第207回	0.693	300,000	311,445	2023/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第211回	0.66	137,000	141,897	2024/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第213回	0.645	145,000	149,945	2024/3/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第216回	1.483	100,000	109,103	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第219回	1.478	100,000	108,977	2034/5/31
首都高速道路債券	政府保証第8回	1.3	100,000	104,866	2020/1/20
阪神高速道路債券	政府保証第2回	1.7	265,000	270,292	2017/3/16
阪神高速道路債券	政府保証第5回	1.3	100,000	105,029	2020/3/18
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	120,000	124,672	2023/10/20
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	264,000	273,614	2023/3/22
預金保険機構債券	政府保証第194回	0.1	300,000	300,024	2017/12/15
中日本高速道路債券	政府保証第13回	1.7	138,000	141,138	2017/5/19
中日本高速道路債券	政府保証第14回	1.9	100,000	102,693	2017/6/16
西日本高速道路債券	政府保証第8回	1.7	100,000	102,274	2017/5/19
銀行等保有株式取得機構債券	政府保証第27回	0.1	3,500,000	3,500,420	2017/4/21
銀行等保有株式取得機構債券	政府保証第28回	0.1	400,000	400,040	2017/5/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
新関西国際空港社債	財投機関債第10回	0.161	100,000	100,071	2017/9/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	104,381	2029/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第25回	0.425	100,000	100,473	2017/6/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第26回	0.573	100,000	101,527	2019/6/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	104,141	2029/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第4回	2.59	100,000	124,646	2035/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第8回	2.45	200,000	238,842	2026/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第23回	2.39	200,000	240,226	2027/7/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第33回	2.91	200,000	261,254	2048/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第38回	1.87	100,000	104,410	2018/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第39回	2.37	100,000	120,694	2028/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第47回	2.41	100,000	121,585	2029/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第86回	0.934	200,000	209,382	2022/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第89回	1.711	100,000	111,817	2032/6/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第102回	0.666	100,000	102,925	2023/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第105回	1.853	100,000	113,640	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第127回	0.184	300,000	300,510	2019/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第130回	0.56	200,000	203,722	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第134回	0.529	200,000	203,126	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第145回	1.523	300,000	299,169	2044/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第149回	1.604	100,000	101,742	2045/3/17
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第33回	2.91	100,000	130,584	2034/6/20
公営企業債券	30年第4回財投機関債	2.95	100,000	131,576	2034/3/24
地方公営企業等金融機構債券	第1回	1.77	200,000	209,202	2018/9/25
地方公共団体金融機構債券	第1回	1.648	100,000	105,311	2019/6/28
地方公共団体金融機構債券	第2回	1.406	100,000	104,545	2019/7/26
地方公共団体金融機構債券	20年第4回	2.12	100,000	118,520	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券	20年第6回	2.242	300,000	360,525	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券	F24回	1.681	100,000	110,214	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券	第13回	1.278	200,000	210,034	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券	第16回	1.164	100,000	104,760	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券	第27回	1.034	300,000	314,493	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券	F106回	1.259	100,000	107,628	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券	第37回	0.852	300,000	312,603	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券	第41回	0.801	100,000	103,960	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券	F142回	1.016	100,000	105,682	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券	F144回	0.562	200,000	203,832	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券	F145回	1.059	200,000	212,034	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	104,008	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	103,793	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F160回	1.052	100,000	105,137	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	300,000	312,687	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	314,001	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	212,472	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	107,401	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	101,865	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	106,149	2034/9/28
地方公共団体金融機構債券	(2年) 第2回	0.1	500,000	499,970	2017/3/28

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
公営企業債券 (20年) 第2回財投機関債	1.45	100,000	108,520	2022/12/20
公営企業債券 (20年) 第25回財投機関債	2.5	100,000	122,387	2028/6/20
公営企業債券 第29回財投機関債	1.77	500,000	516,610	2017/12/20
首都高速道路社債 第12回	0.293	100,000	100,399	2018/12/20
阪神高速道路 第13回	0.18	100,000	100,037	2019/9/20
中小企業債券 第6回財投機関債	0.79	100,000	101,540	2018/3/20
国際協力銀行債券 第27回財投機関債	1.77	200,000	204,152	2017/3/17
都市再生債券 財投機関債第21回	1.72	300,000	313,323	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第55回	1.074	100,000	105,113	2021/9/17
都市再生債券 財投機関債第97回	1.017	100,000	104,146	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	2.26	100,000	116,696	2025/6/20
東京交通債券 第342回	2.4	200,000	227,964	2022/6/21
東京交通債券 第347回	2.05	157,000	178,655	2024/3/8
関西国際空港社債 財投機関債第26回	1.156	300,000	313,788	2020/9/18
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	0.93	100,000	104,823	2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	1.86	200,000	207,888	2018/3/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	2.15	100,000	114,325	2023/9/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第25回	1.67	300,000	313,743	2018/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回	1.5	100,000	105,395	2019/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	1.94	100,000	114,132	2025/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	1.95	100,000	115,731	2030/10/22
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回	1.256	100,000	105,829	2021/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	2.066	100,000	117,295	2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	2.056	100,000	117,150	2031/7/11
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回	1.069	100,000	105,025	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回	1.046	200,000	209,788	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	1.595	200,000	222,400	2026/12/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	2.273	100,000	116,661	2042/9/19
成田国際空港 第17回	0.489	200,000	201,492	2025/2/20
私学振興債券 財投機関債第7回	1.7	300,000	308,376	2017/9/25
日本学生支援債券 財投機関債第38回	0.1	500,000	499,975	2017/2/20
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回	1.208	100,000	105,625	2021/6/18
国際協力機構債券 第6回財投機関債	2.098	100,000	118,243	2030/12/13
東日本高速道路 第21回	0.58	100,000	101,087	2018/6/20
東日本高速道路 第26回	0.305	100,000	100,487	2019/6/20
東日本高速道路 第27回	0.248	100,000	100,289	2019/6/20
中日本高速道路債券 財投機関債第3回	1.92	100,000	103,137	2017/9/20
中日本高速道路社債 第32回	0.64	200,000	202,666	2018/9/20
中日本高速道路社債 第44回	0.536	100,000	101,384	2019/9/20
中日本高速道路社債 第46回	0.351	1,500,000	1,505,805	2017/9/20
中日本高速道路社債 第47回	0.277	100,000	100,297	2018/3/20
中日本高速道路社債 第53回	0.222	100,000	100,138	2017/6/20
西日本高速道路 第20回	0.759	200,000	206,580	2023/9/20
西日本高速道路 第23回	0.602	100,000	101,788	2024/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回	1.165	200,000	209,476	2020/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	1.441	100,000	106,440	2034/8/4
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	1.94	15,766	16,449	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	1.69	56,259	58,660	2038/9/10

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	104,240	109,634
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券		1.43	101,070	104,359
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	63,687	67,443
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	86,112	93,694
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	22,314	24,108
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	56,966	60,608
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	62,154	66,578
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	60,306	63,155
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	124,504	131,641
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	107,830	114,720
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	107,100	116,485
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	62,580	67,044
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	31,143	33,506
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	41,842	45,565
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	142,347	153,075
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券		1.64	36,438	38,149
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	147,178	154,377
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券		1.71	74,714	78,451
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	211,062	225,517
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	150,948	158,972
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	82,100	89,643
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	205,992	221,126
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	207,732	216,797
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	245,991	255,434
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	242,031	253,389
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	161,272	167,964
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	73,028	77,420
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	148,430	157,138
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	87,860	90,415
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	84,884	87,433
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	44,398	46,873
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	253,998	264,508
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	52,850	56,481
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	54,270	57,939
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	58,251	62,188
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	70,616	75,691
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	160,460	168,675
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	237,168	249,434
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	79,561	83,772
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	167,794	174,322
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券		1.82	20,724	21,985
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券		1.7	169,900	177,594
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券		1.65	68,568	71,547
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券		1.75	27,474	28,350
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券		1.82	58,260	60,266
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券		1.52	327,715	344,376
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券		1.4	159,902	167,985
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券		1.16	253,095	262,006

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	174,462	182,312	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	166,992	174,012	2048/8/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	94,109	95,843	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	95,084	96,963	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	94,856	96,230	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	192,216	192,936	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	192,792	191,353	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	96,988	97,816	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	97,290	97,686	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	292,797	295,932	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	294,870	299,419	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	197,260	199,844	2050/8/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券 (2014)	0.725	100,000	102,580	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債 (2014)	0.69	100,000	100,607	2019/1/29
小 計		50,491,600	52,612,944	
金融債券				
商工債券 利付第740回い号	0.45	100,000	100,316	2017/1/27
商工債券 利付第742回い号	0.4	100,000	100,298	2017/3/27
商工債券 利付第753回い号	0.25	100,000	100,181	2018/2/27
農林債券 利付第741回い号	0.5	150,000	150,546	2017/2/27
農林債券 利付第743回い号	0.45	100,000	100,343	2017/4/27
農林債券 利付第745回い号	0.35	100,000	100,228	2017/6/27
農林債券 利付第751回い号	0.3	200,000	200,406	2017/12/27
農林債券 利付第752回い号	0.3	100,000	100,208	2018/1/26
農林債券 利付第756回い号	0.3	100,000	100,252	2018/5/25
農林債券 利付第759回い号	0.4	100,000	100,547	2018/8/27
農林債券 利付第760回い号	0.4	100,000	100,568	2018/9/27
農林債券 利付第761回い号	0.3	100,000	100,286	2018/10/26
農林債券 利付第764回い号	0.35	100,000	100,424	2019/1/25
農林債券 利付第765回い号	0.3	300,000	300,852	2019/2/27
農林債券 利付第767回い号	0.3	300,000	300,894	2019/4/26
農林債券 利付第773回い号	0.24	300,000	300,342	2019/10/25
しんきん中金債券 利付第271回	0.35	350,000	350,959	2017/6/27
しんきん中金債券 利付第277回	0.25	100,000	100,162	2017/12/27
しんきん中金債券 利付第284回	0.4	100,000	100,603	2018/7/27
しんきん中金債券 利付第286回	0.35	100,000	100,513	2018/9/27
しんきん中金債券 利付第287回	0.3	100,000	100,371	2018/10/26
しんきん中金債券 利付第290回	0.3	100,000	100,363	2019/1/25
しんきん中金債券 利付第302回	0.2	100,000	100,040	2020/1/27
商工債券 利付(3年)第171回	0.2	300,000	300,135	2017/4/27
商工債券 利付(3年)第172回	0.2	200,000	200,090	2017/5/26
商工債券 利付(3年)第174回	0.15	200,000	199,936	2017/7/27
商工債券 利付(3年)第178回	0.15	1,000,000	999,560	2017/11/27
商工債券 利付(3年)第181回	0.15	500,000	499,810	2018/2/27
商工債券 利付(3年)第182回	0.14	100,000	99,933	2018/3/27
商工債券 利付(10年)第5回	1.8	600,000	619,548	2017/12/20
あおぞら債券 利付(3年)第71回	0.19	400,000	399,856	2017/12/8
小 計		6,600,000	6,628,570	

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
東京電力 第455回	2.075	200,000	207,970	2018/10/23
東京電力 第459回	2.7	100,000	106,107	2019/1/29
東京電力 第524回	1.795	100,000	101,460	2017/3/14
東京電力 第525回	1.73	100,000	101,422	2017/3/28
東京電力 第542回	1.602	100,000	102,198	2018/4/25
東京電力 第544回	1.976	100,000	103,287	2018/6/25
東京電力 第547回	1.948	100,000	105,253	2020/7/24
東京電力 第548回	2.347	100,000	107,967	2028/9/29
東京電力 第559回	1.377	100,000	102,334	2019/10/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	105,325	2029/12/10
東京電力 第565回	1.313	300,000	307,041	2020/6/24
中部電力 第482回	2.17	200,000	213,318	2019/6/25
中部電力 第500回	0.875	200,000	204,910	2024/5/24
関西電力 第448回	2.16	200,000	209,146	2018/6/20
関西電力 第469回	1.7	100,000	103,859	2018/10/25
関西電力 第482回	1.189	100,000	103,538	2020/7/24
関西電力 第484回	0.976	100,000	102,691	2020/10/23
関西電力 第496回	0.908	100,000	101,581	2025/2/25
関西電力 第497回	1.002	200,000	204,572	2025/6/20
関西電力 第498回	0.416	200,000	200,008	2020/9/18
中国電力 第314回	2.875	100,000	106,228	2018/4/25
中国電力 第330回	2.1	100,000	108,965	2021/3/25
中国電力 第377回	1.121	200,000	208,970	2023/8/25
中国電力 第378回	1.004	100,000	103,617	2023/10/25
北陸電力 第301回	1.158	100,000	104,757	2023/3/24
北陸電力 第304回	0.989	100,000	103,504	2023/10/25
北陸電力 第307回	1.055	100,000	102,905	2026/6/25
北陸電力 第308回	0.769	100,000	101,496	2024/9/25
東北電力 第431回	2.05	400,000	416,000	2018/3/23
東北電力 第473回	0.597	100,000	101,165	2021/4/23
東北電力 第475回	0.809	100,000	101,407	2024/9/25
東北電力 第481回	0.803	200,000	201,684	2025/7/25
四国電力 第281回	1.111	200,000	208,840	2023/9/25
九州電力 第400回	1.777	100,000	105,975	2020/4/24
九州電力 第409回	1.483	100,000	104,147	2019/8/23
九州電力 第420回	0.82	300,000	303,585	2018/4/25
九州電力 第424回	1.233	200,000	209,276	2023/11/24
北海道電力 第296回	2.027	100,000	104,305	2018/6/25
北海道電力 第316回	1.164	107,000	110,701	2020/6/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	101,653	2030/3/25
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	3.175	100,000	105,265	2017/9/11
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	1.293	100,000	104,956	2021/3/19
成田国際空港 第13回一般担保付	0.802	200,000	207,494	2023/2/8
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	0.947	100,000	102,249	2019/3/6
大和ハウス工業 第5回特定社債間限定同順位特約付	0.443	100,000	101,065	2021/6/18
森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	102,279	2024/5/8
サッポロホールディングス 第26回社債間限定同順位特約付	0.64	100,000	100,556	2017/3/2
アサヒグループホールディングス 第7回特定社債間限定同順位特約付	0.237	100,000	100,057	2020/5/28

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
アサヒグループホールディングス	第8回特定社債間限定同順位特約付	0.348	100,000	100,118	2022/5/27
キリンホールディングス	第10回社債間限定同順位特約付	0.603	200,000	200,384	2025/2/28
伊藤園	第1回	0.494	100,000	100,458	2017/2/23
トヨタ紡織	第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	102,705	2023/9/20
野村不動産ホールディングス	第5回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	100,778	2025/5/30
森ビル	第13回社債間限定同順位特約付	0.466	100,000	100,574	2020/5/19
東急不動産ホールディングス	第2回社債間限定同順位特約付	0.856	100,000	101,203	2024/7/29
セブン&アイ・ホールディングス	第3回社債間限定同順位特約付	1.94	100,000	104,550	2018/6/20
日本製紙グループ本社	第8回日本製紙株式会社保証付	1.97	100,000	102,274	2017/3/27
レンゴー	第18回特定社債間限定同順位特約付	0.451	100,000	100,502	2021/9/3
住友化学	第36回社債間限定同順位特約付	1.95	100,000	102,138	2017/2/27
住友化学	第43回社債間限定同順位特約付	1.58	100,000	105,335	2020/4/23
クレハ	第5回社債間限定同順位特約付	0.302	100,000	100,177	2020/3/6
エア・ウォーター	第2回社債間限定同順位特約付	0.271	100,000	100,151	2020/9/3
三菱ケミカルホールディングス	第14回社債間限定同順位特約付	0.482	200,000	201,080	2021/6/17
宇部興産	第10回社債間限定同順位特約付	0.334	100,000	100,129	2019/6/4
花王	第4回特定社債間限定同順位特約付	0.624	100,000	101,873	2020/6/19
武田薬品工業	第15回社債間限定同順位特約付	0.704	100,000	102,315	2020/7/17
第一三共	第4回社債間限定同順位特約付	0.846	100,000	103,851	2023/9/15
JXホールディングス	第9回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	101,134	2024/6/4
横浜ゴム	第10回社債間限定同順位特約付	0.355	100,000	100,168	2021/10/29
ブリヂストン	第8回社債間限定同順位特約付	0.249	200,000	200,626	2019/9/26
住友ゴム工業	第24回社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	102,265	2024/6/25
住友大阪セメント	第14回社債間限定同順位特約付	0.332	100,000	100,259	2020/3/3
神戸製鋼所	第62回社債間限定同順位特約付	0.579	100,000	99,231	2022/5/20
神戸製鋼所	第63回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	99,517	2025/5/21
ジェイ エフ イー	ホールディングス 第16回(JFEス保証)	0.858	100,000	101,033	2017/5/26
ジェイ エフ イー	ホールディングス 第22回(JFEス保証)	0.703	100,000	100,130	2024/9/19
豊田自動織機	第25回社債間限定同順位特約付	0.234	100,000	100,332	2019/9/20
小松製作所	第10回社債間限定同順位特約付	0.275	100,000	100,313	2019/6/20
日立製作所	第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	212,252	2028/12/13
三菱電機	第45回社債間限定同順位特約付	0.428	100,000	101,031	2021/6/4
日本電産	第3回社債間限定同順位特約付	0.956	100,000	103,838	2022/9/20
富士通	第34回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	101,493	2020/10/16
パナソニック	第8回社債間限定同順位特約付	2.05	100,000	105,648	2019/3/20
パナソニック	第12回社債間限定同順位特約付	0.387	200,000	200,272	2020/3/19
ソニー	第26回	2.068	100,000	105,236	2019/6/20
三菱重工業	第26回社債間限定同順位特約付	0.877	100,000	103,189	2023/9/4
川崎重工業	第32回社債間限定同順位特約付	1.062	100,000	101,390	2017/6/21
明治安田生命2014基金特定目的会社	第1回特定社債	0.51	300,000	301,932	2019/8/7
日産自動車	第55回特定社債間限定同順位特約付	0.415	200,000	201,086	2018/3/20
トヨタ自動車	第14回社債間限定同等特約付	0.963	100,000	104,815	2023/3/20
アイシン精機	第15回社債間限定同順位特約付	0.562	100,000	100,845	2025/2/26
エクセディ	第3回社債間限定同順位特約付	0.503	100,000	100,417	2017/3/17
ニコン	第20回特定社債間限定同順位特約付	0.652	100,000	101,689	2022/3/14
大日本印刷	第3回社債間限定同順位特約付	1.358	100,000	105,482	2020/12/18
伊藤忠商事	第59回社債間限定同順位特約付	1.378	200,000	210,882	2021/6/4
丸紅	第101回社債間限定同順位特約付	0.436	100,000	100,381	2021/7/23

銘柄	当	期		末	償還年月日
		利	率		
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	102,746	2025/12/5	
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付	0.954	200,000	202,854	2026/7/10	
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付	1.187	100,000	104,300	2029/7/13	
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付	1.117	100,000	104,240	2022/4/20	
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無	2.08	100,000	103,183	2017/7/28	
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無	1.657	100,000	105,315	2019/7/29	
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	0.451	200,000	201,762	2021/7/30	
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付	0.344	100,000	100,370	2019/6/4	
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付	0.543	200,000	201,620	2022/6/3	
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付	0.904	100,000	101,300	2024/4/24	
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	101,086	2024/6/18	
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	1.01	100,000	102,216	2018/11/21	
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付	0.94	100,000	101,375	2024/6/26	
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付	0.915	200,000	200,088	2025/6/5	
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付	2.54	100,000	120,697	2027/7/27	
みずほコーポレート銀行 第28回特定社債間限定同順位特約付	0.515	300,000	301,185	2017/1/25	
みずほコーポレート銀行 第29回特定社債間限定同順位特約付	0.46	200,000	200,810	2017/4/21	
みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付	0.33	2,000,000	2,006,160	2017/10/25	
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付	0.27	300,000	300,609	2018/1/24	
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付	2.5	100,000	107,433	2019/6/3	
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付	2.69	100,000	110,448	2020/2/27	
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付	2.22	100,000	113,390	2022/10/27	
三菱東京UFJ銀行 第93回特定社債間限定同順位特約付	1.985	100,000	103,327	2017/10/17	
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	104,040	2020/10/15	
三菱東京UFJ銀行 第140回特定社債間限定同順位特約付	0.24	500,000	500,820	2018/1/23	
三菱東京UFJ銀行 第12回(劣後特約付)	2.16	300,000	309,204	2017/7/28	
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.849	300,000	300,285	2024/9/12	
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付	0.884	100,000	99,948	2025/5/29	
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付	1.328	100,000	100,904	2030/5/29	
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付	2.766	100,000	108,416	2019/6/20	
りそな銀行 第6回劣後特約付	2.084	300,000	321,180	2020/3/4	
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	1.68	100,000	106,900	2021/4/28	
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	1.389	300,000	319,128	2022/9/20	
三井住友信託銀行 第7回社債間限定同順位特約付	0.269	100,000	100,309	2019/4/26	
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	103,517	2023/3/20	
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付	0.536	100,000	100,730	2024/12/20	
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付	0.95	200,000	200,832	2024/7/16	
三井住友銀行 第57回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	100,279	2017/10/20	
三井住友銀行 第24回劣後特約付	1.6	100,000	106,677	2021/6/1	
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付	0.285	100,000	100,256	2019/1/25	
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	100,592	2019/5/23	
N T Tファイナンス 第45回社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	100,094	2017/6/20	
N T Tファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,397	2019/6/20	
日産フィナンシャルサービス 第20回社債間限定同順位特約付	0.538	100,000	100,523	2017/3/17	
ホンダファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付	0.315	100,000	100,529	2018/9/20	
ホンダファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,222	2019/6/20	
トヨタファイナンス 第27回社債間限定同等特約付	1.82	200,000	204,276	2017/3/17	
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	0.545	100,000	100,084	2021/12/3	

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
日立キャピタル	第52回社債間限定同順位特約付	0.508	100,000	101,198	2021/6/18
日立キャピタル	第56回社債間限定同順位特約付	0.197	100,000	99,889	2019/12/20
日立キャピタル	第57回社債間限定同順位特約付	0.616	100,000	100,294	2024/12/20
オリックス	第144回社債間限定同順位特約付	1.51	100,000	102,422	2017/12/22
オリックス	第148回社債間限定同順位特約付	1.26	100,000	101,234	2017/2/24
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	102,836	2019/8/7
三井住友ファイナンス&リース	第7回社債間限定同順位特約付	0.442	100,000	100,706	2018/8/6
三井住友ファイナンス&リース	第13回社債間限定同順位特約付	0.257	100,000	99,793	2020/5/28
三菱UFJリース	第19回社債間限定同順位特約付	0.487	100,000	100,562	2017/5/29
三菱UFJリース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	100,754	2021/8/27
大和証券グループ本社	第17回社債間限定同順位特約付	0.398	100,000	100,319	2019/8/28
大和証券グループ本社	第22回社債間限定同順位特約付	0.397	100,000	100,038	2020/8/12
大和証券グループ本社	第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	100,219	2025/8/12
野村ホールディングス	第6回	1.86	100,000	102,116	2017/3/23
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	106,383	2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	202,766	2018/6/20
第1回財政融資マスタートラスト特定目的会社	第1回特定社債	1.83	100,000	103,131	2018/2/20
三井不動産	第34回社債間限定同順位特約付	2.085	100,000	106,102	2019/3/20
三菱地所	第56回担保提供制限等財務上特約無	2.42	100,000	113,565	2022/6/20
三菱地所	第98回担保提供制限等財務上特約無	1.165	100,000	103,916	2020/6/19
三菱地所	第110回担保提供制限等財務上特約無	0.571	100,000	101,449	2019/9/13
三菱地所	第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	100,000	104,061	2022/9/14
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	101,352	2024/1/26
住友不動産	第97回社債間限定同順位特約付	0.904	200,000	201,022	2024/4/26
住友不動産	第100回社債間限定同順位特約付	0.809	100,000	99,527	2024/9/9
エヌ・ティ・ティ都市開発	第10回社債間限定同順位特約付	1.03	100,000	103,694	2020/9/18
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	104,717	2023/6/26
オリックス不動産投資法人	第5回特定投資法人債間限定同順位特約付	0.76	100,000	101,134	2018/2/8
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	100,232	2024/8/30
東武鉄道	第102回社債間限定同順位特約付	1.36	200,000	211,008	2025/10/23
東京急行電鉄	第75回社債間限定同順位特約付	0.982	100,000	104,597	2022/6/7
東京急行電鉄	第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	102,516	2033/6/3
小田急電鉄	第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	205,476	2030/6/12
京成電鉄	第42回社債間限定同順位特約付	2.12	100,000	102,274	2017/2/8
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	111,448	2020/8/25
東日本旅客鉄道	第19回社債間限定同順位特約付	2.36	200,000	226,336	2022/2/25
東日本旅客鉄道	第58回社債間限定同順位特約付	1.58	200,000	209,330	2019/3/20
東日本旅客鉄道	第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	115,072	2030/9/27
東日本旅客鉄道	第107回社債間限定同順位特約付	1.415	100,000	96,737	2045/1/27
西日本旅客鉄道	第15回社債間限定同順位特約付	2.26	100,000	118,863	2027/12/20
西日本旅客鉄道	第31回社債間限定同順位特約付	1.408	100,000	106,182	2021/2/26
東海旅客鉄道	第16回社債間限定同順位特約付	1.875	100,000	106,502	2019/9/20
東海旅客鉄道	第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	238,688	2030/4/23
東海旅客鉄道	第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	105,305	2032/9/30
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	100,222	2027/4/30
三菱倉庫	第14回	0.442	100,000	101,057	2021/3/12
住友倉庫	第1回社債間限定同順位特約付	0.279	200,000	200,756	2019/3/14
日本電信電話	第60回	1.31	100,000	105,525	2020/12/18

銘柄	利 率	当 期		償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
KDDI 第5回2号	3.2	100,000	104,197	2017/4/28
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	103,207	2023/12/20
NTTドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	1.96	100,000	104,574	2018/6/20
電源開発 第31回社債間限定同順位特約付	1.155	100,000	103,745	2020/9/18
電源開発 第37回社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	103,433	2021/7/20
電源開発 第39回社債間限定同順位特約付	0.929	100,000	102,410	2024/2/20
電源開発 第40回社債間限定同順位特約付	0.889	100,000	101,941	2024/6/20
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	101,020	2024/8/20
東京瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	2.625	100,000	106,181	2018/6/11
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	109,907	2043/12/17
大阪瓦斯 第9回社債間限定同順位特約付	2.9	100,000	105,862	2018/1/30
東邦瓦斯 第31回社債間限定同順位特約付	2.06	100,000	111,302	2022/3/18
東京都競馬 第2回社債間限定同順位特約付	0.572	200,000	201,676	2018/7/11
ファーストリテイリング 第3回特定社債間限定同順位特約付	0.491	100,000	100,123	2022/12/16
フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第11回円貨社債	0.528	100,000	100,331	2017/3/17
ノルデア・バンク 第6回円貨社債(2014)	0.288	100,000	100,141	2017/5/26
新韓銀行 第5回円貨社債(2014)	0.39	200,000	199,656	2017/11/13
クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)	0.865	100,000	101,598	2024/11/28
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング 第2回円貨社債	0.345	200,000	200,260	2019/6/27
マラヤン・バンキング・ベルハッド 第2回円貨社債(2015)	0.509	200,000	196,880	2020/4/30
スタンダード・チャータード 第2回円貨社債(2015)	0.453	100,000	99,225	2020/6/5
スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)	1.043	100,000	99,468	2025/6/5
韓国輸出入銀行 第13回円貨債券(2014)	0.45	100,000	100,171	2017/3/14
JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー 第9回円貨社債	1.32	100,000	101,250	2017/2/9
エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション 第12回	2.54	100,000	110,066	2021/2/16
ドイツ銀行AGロンドン支店 第8回円貨社債(2014)	0.47	100,000	99,576	2019/11/14
バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション 第8回円貨社債	2.305	100,000	103,072	2017/6/26
パークレイズ・バンク・ピエールシー 第7回円貨社債	0.478	100,000	100,098	2019/6/24
ナショナル・オーストラリア銀行 第11回円貨社債(2015)	0.284	200,000	200,536	2020/1/16
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第9回円貨社債	1.2	200,000	202,472	2017/3/9
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第7回円貨社債	1.3	100,000	101,232	2017/1/19
ラボバンク・ネダーランド 第16回円貨社債(2012)	1.142	100,000	101,324	2017/5/25
ラボバンク・ネダーランド 第18回円貨社債(2012)	0.778	100,000	101,031	2017/11/2
ラボバンク・ネダーランド 第25回円貨社債(2014)	0.434	100,000	100,577	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)	0.552	200,000	201,348	2019/6/13
小 計		31,107,000	31,924,440	
合 計		591,250,970	634,035,915	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

野村日経225 マザーファンド

運用報告書

第2期（決算日2015年11月30日）

作成対象期間（2014年11月29日～2015年11月30日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。 効率的な運用を行うため、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を活用し、また、わが国の金融商品取引所に上場している日経平均株価を対象指数とする上場投資信託証券（ETF）を活用する場合があります。
主な投資対象	日経平均株価に採用されているまたは採用が決定された銘柄を主要投資対象とし、日経平均株価を対象とした株価指数先物取引を取引対象とします。
主な投資制限	株式への投資割合には制限を設けません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率	純資産額
	騰落	中率	日経平均株価	騰落率			
(設定日) 2013年11月28日	円 10,000	% -	円 15,449	% -	% -	% -	百万円 229
1期(2014年11月28日)	11,309	13.1	17,459	13.0	91.7	8.2	19,394
2期(2015年11月30日)	12,999	14.9	19,747	13.1	90.4	9.6	56,794

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

- ①「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体及び「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有している。
- ②「日経」及び「日経平均株価」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て株式会社日本経済新聞社に帰属している。
- ③「野村日経225 マザーファンド」は、野村アセットマネジメント株式会社の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用及び「野村日経225 マザーファンド」の取引に関して、一切の責任を負わない。
- ④株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負わない。
- ⑤株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」の構成銘柄、計算方法、その他「日経平均株価」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有している。

○当期中の基準価額と市況等の推移

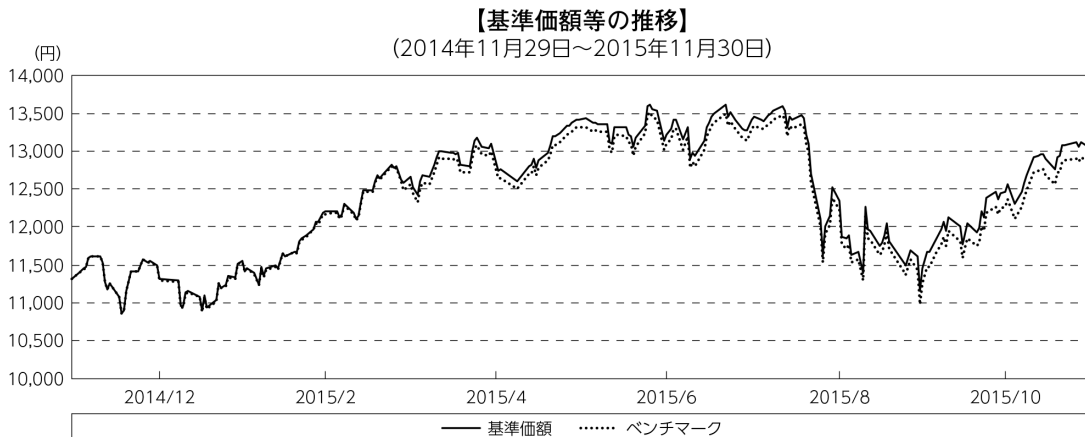
年月日	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
	騰落	騰落率	日経平均株価	騰落率		
(期首) 2014年11月28日	円 11,309	% -	円 17,459	% -	% 91.7	% 8.2
12月末	11,316	0.1	17,451	△ 0.1	93.3	6.8
2015年1月末	11,461	1.3	17,674	1.2	91.4	8.6
2月末	12,198	7.9	18,798	7.7	90.1	9.7
3月末	12,532	10.8	19,207	10.0	91.9	8.5
4月末	12,745	12.7	19,520	11.8	92.1	8.8
5月末	13,429	18.7	20,563	17.8	89.5	12.3
6月末	13,226	17.0	20,236	15.9	88.9	11.1
7月末	13,455	19.0	20,585	17.9	89.6	12.1
8月末	12,350	9.2	18,890	8.2	88.7	11.3
9月末	11,446	1.2	17,388	△ 0.4	93.2	7.2
10月末	12,561	11.1	19,083	9.3	96.6	3.4
(期末) 2015年11月30日	円 12,999	% 14.9	円 19,747	% 13.1	% 90.4	% 9.6

*騰落率は期首比です。

*株式先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注) ベンチマークは、日経平均株価です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首11,309円から期末12,999円に1,690円の値上がりとなりました。

国内株式の株価の変動

○投資環境

<国内株式市場>

期首から1月までは一進一退の展開が続きましたが、1月中旬以降は、世界的な金融緩和が継続していることや、国内公的年金が株式比率を上昇させるとの観測が広がったこと、国内企業の業績拡大への期待感が膨らんだことなどから上昇しました。割安感の低下や、利益確定売り圧力の高まりから一時下落する局面があったものの、実質GDP（国内総生産）成長率が市場予想を上回ったことや、一段と円安が進んだことを受け、5月末までは上昇が続きました。

6月以降は再び一進一退の展開が続きました。

8月中旬以降は、中国や新興国における景気減速の懸念が高まったことや、為替が円高に進行したことなどが企業収益への不安につながり大きく下落しました。

10月に入り、中国の経済指標の改善で中国経済への懸念が後退したことや、TPP（環太平洋経済連携協定）交渉が大筋合意となったことも株価を押し上げました。また米国の利上げも先送りとなり、世界的な金融緩和継続の流れも株価を押し上げる要因となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

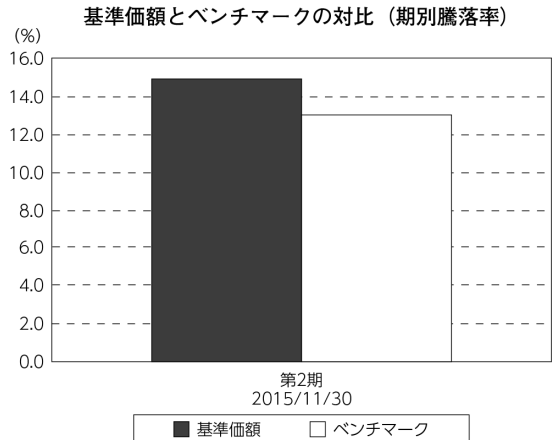
日経平均株価に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率は期を通じて概ね高位を維持しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+14.9%となり、ベンチマークである日経平均株価の+13.1%を1.8ポイント上回りました。

(主なプラス要因)

- ・保有銘柄が配当権利落ちし、ファンドには未収配当金が計上されたこと



(注) ベンチマークは、日経平均株価です。

◎今後の運用方針

今後の運用につきましても、株式組入比率を高位に保ち、日経平均株価と連動する投資成果を目指して参ります。

引き続きご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

○1万口当たりの費用明細

(2014年11月29日～2015年11月30日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 1	% 0.005	(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 ※売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(1)	(0.005)	
合 計	1	0.005	
期中の平均基準価額は、12,335円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2014年11月29日～2015年11月30日)

株式

国	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
内		千株	千円	千株	千円
		32,621	73,126,742	19,439	44,503,040
		(△ 83)	()		

*金額は受け渡し代金。

*単位未満は切り捨て。

* () 内は株式分割、予約権行使、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国	百万円	百万円	百万円	百万円
内	33,194	29,290	—	—
株式先物取引				

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2014年11月29日～2015年11月30日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	117,629,782千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	33,923,864千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.46

* (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2014年11月29日～2015年11月30日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 73,126	百万円 3,578	% 4.9	百万円 44,503	百万円 -	% -

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 114	百万円 66	百万円 74

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1,640千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	0.1%

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村証券株式会社です。

(2015年11月30日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額		株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				パルプ・紙 (0.3%)			
日本水産	40	102	43,146	王子ホールディングス	40	102	54,468
マルハニチロ	4	10.2	19,981	日本製紙	4	10.2	20,216
鉱業 (0.1%)				北越紀州製紙	40	102	82,722
国際石油開発帝石	16	40.8	49,878	化学 (8.0%)			
建設業 (2.8%)				クラレ	40	102	159,834
コムシスホールディングス	40	102	168,810	旭化成	40	102	85,894
大成建設	40	102	77,418	昭和電工	40	102	16,524
大林組	40	102	115,974	住友化学	40	102	72,012
清水建設	40	102	105,366	日産化学工業	40	102	301,308
長谷工コーポレーション	—	20.4	28,070	日本曹達	40	102	75,990
鹿島建設	40	102	68,952	東ソー	40	102	70,380
大和ハウス工業	40	102	349,758	トクヤマ	40	102	26,826
積水ハウス	40	102	212,313	デンカ	40	102	55,488
日揮	40	102	213,384	信越化学工業	40	102	710,226
千代田化工建設	40	102	106,590	三井化学	40	102	52,326
食料品 (5.1%)				三菱ケミカルホールディングス	20	51	41,141
日清製粉グループ本社	40	102	197,268	宇部興産	40	102	26,724
明治ホールディングス	4	20.4	200,940	日本化薬	40	102	135,558
日本ハム	40	102	242,658	花王	40	102	643,722
サッポロホールディングス	40	102	55,284	富士フィルムホールディングス	40	102	508,572
アサヒグループホールディングス	40	102	393,720	資生堂	40	102	300,441
キリンホールディングス	40	102	176,613	日東電工	40	102	846,192
宝ホールディングス	40	102	96,084	医薬品 (7.7%)			
キッコーマン	40	102	413,610	協和発酵キリン	40	102	221,238
味の素	40	102	287,895	武田薬品工業	40	102	610,266
ニチレイ	40	102	82,212	アステラス製薬	200	510	884,085
日本たばこ産業	40	102	449,820	大日本住友製薬	40	102	151,062
繊維製品 (0.4%)				塩野義製薬	40	102	553,452
東洋紡	40	102	18,360	中外製薬	40	102	438,600
ユニチカ	40	102	6,018	ユーザイ	40	102	815,694
日清紡ホールディングス	40	—	—	第一三共	40	102	258,774
帝人	40	102	44,676	石油・石炭製品 (0.3%)			
東レ	40	102	114,138	昭和シェル石油	40	102	110,670
				J Xホールディングス	40	102	50,928

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	40	51	107,967
ブリヂストン	40	102	446,760
ガラス・土石製品 (1.6%)			
日東紡績	40	—	—
旭硝子	40	102	73,848
日本板硝子	40	102	10,812
日本電気硝子	60	153	104,499
住友大阪セメント	40	102	48,348
太平洋セメント	40	102	38,760
東海カーボン	40	102	38,148
TOTO	40	51	216,750
日本碍子	40	102	291,210
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	40	10.2	25,219
神戸製鋼所	40	102	14,688
ジェイ エフ イー ホールディングス	4	10.2	19,808
日新製鋼	4	10.2	13,739
大太平洋金属	40	102	32,946
非鉄金属 (1.3%)			
日本軽金属ホールディングス	40	102	22,440
三井金属鉱業	40	102	24,174
東邦亜鉛	40	102	31,722
三菱マテリアル	40	102	44,370
住友金属鉱山	40	102	141,576
DOWAホールディングス	40	102	96,594
古河機械金属	40	102	24,990
古河電気工業	40	102	27,234
住友電気工業	40	102	178,704
フジクラ	40	102	71,094
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	4	10.2	13,321
東洋製織グループホールディングス	40	102	247,146
機械 (4.8%)			
日本製鋼所	40	102	48,144
オークマ	40	102	114,138
アマダホールディングス	40	102	123,624
小松製作所	40	102	207,672
住友重機械工業	40	102	59,568
日立建機	40	102	197,064

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
クボタ	40	102	209,457
荏原製作所	40	102	61,914
ダイキン工業	40	102	882,300
日本精工	40	102	157,998
NTN	40	102	59,058
ジェイテクト	40	102	232,152
日立造船	8	20.4	13,872
三菱重工業	40	102	64,270
I H I	40	102	32,844
電気機器 (17.3%)			
日清紡ホールディングス	—	102	148,512
コニカミノルタ	40	102	131,988
ミネベア	40	102	137,802
日立製作所	40	102	74,113
東芝	40	102	30,691
三菱電機	40	102	139,026
富士電機	40	102	57,834
安川電機	40	102	165,750
明電舎	40	102	49,980
ジーエス・ユアサ コーポレーション	40	102	47,532
日本電気	40	102	42,024
富士通	40	102	63,403
沖電気工業	40	102	16,320
パナソニック	40	102	142,545
シャープ	40	102	12,852
ソニー	40	102	324,054
TDK	40	102	902,700
ミツミ電機	40	102	68,544
アルプス電気	40	102	394,740
パイオニア	40	102	39,066
横河電機	40	102	149,940
アドバンテスト	80	204	228,072
カシオ計算機	40	102	276,930
ファナック	40	102	2,235,840
京セラ	80	204	1,164,228
太陽誘電	40	102	204,918
S C R E E Nホールディングス	40	102	94,248
キヤノン	60	153	568,548
リコー	40	102	128,724
東京エレクトロン	40	102	836,196

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
輸送用機器 (7.0%)			
デンソー	40	102	599,046
三井造船	40	102	20,604
川崎重工業	40	102	49,878
日産自動車	40	102	134,079
いすゞ自動車	20	51	70,635
トヨタ自動車	40	102	781,014
日野自動車	40	102	152,490
三菱自動車工業	4	10.2	11,179
マツダ	8	20.4	52,173
本田技研工業	80	204	816,408
スズキ	40	102	386,070
富士重工業	40	102	518,976
精密機器 (3.0%)			
テルモ	80	204	801,720
ニコン	40	102	168,504
オリンパス	40	102	500,820
シチズンホールディングス	40	102	92,820
その他製品 (1.1%)			
凸版印刷	40	102	110,160
大日本印刷	40	102	122,706
ヤマハ	40	102	316,200
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力	4	10.2	7,690
中部電力	4	10.2	17,324
関西電力	4	10.2	14,076
東京瓦斯	40	102	59,986
大阪瓦斯	40	102	46,624
陸運業 (2.4%)			
東武鉄道	40	102	61,200
東京急行電鉄	40	102	97,614
小田急電鉄	40	102	127,704
京王電鉄	40	102	103,122
京成電鉄	40	102	150,756
東日本旅客鉄道	4	10.2	118,524
西日本旅客鉄道	4	10.2	79,305
東海旅客鉄道	4	10.2	224,247
日本通運	40	102	56,712
ヤマトホールディングス	40	102	240,108

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
海運業 (0.2%)			
日本郵船	40	102	32,640
商船三井	40	102	32,742
川崎汽船	40	102	25,806
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	40	102	35,343
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	40	102	175,542
情報・通信業 (10.6%)			
ヤフー	16	40.8	20,685
トレンドマイクロ	40	102	512,040
スカパーJ S A Tホールディングス	4	10.2	6,354
日本電信電話	4	20.4	93,126
KDDI	80	612	1,871,496
N T T ドコモ	4	10.2	23,745
東宝	4	10.2	33,405
エス・ティ・ティ・データ	40	102	612,000
コナミホールディングス	40	102	293,862
ソフトバンクグループ	120	306	2,000,322
卸売業 (2.0%)			
双日	4	10.2	2,754
伊藤忠商事	40	102	153,204
丸紅	40	102	69,564
豊田通商	40	102	294,576
三井物産	40	102	154,020
住友商事	40	102	133,365
三菱商事	40	102	211,344
小売業 (12.7%)			
J・フロント リテイリング	20	51	103,581
三越伊勢丹ホールディングス	40	102	191,454
セブン&アイ・ホールディングス	40	102	563,040
高島屋	40	102	114,444
丸井グループ	40	102	186,252
イオン	40	102	194,820
ユニーグループ・ホールディングス	40	102	76,398
ファーストリテイリング	40	102	5,077,560
銀行業 (1.2%)			
新生銀行	40	102	23,868
あおぞら銀行	40	102	44,268
三菱U F J フィナンシャル・グループ	40	102	80,580

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
りそなホールディングス	4	10.2	6,128
三井住友トラスト・ホールディングス	40	102	47,940
三井住友フィナンシャルグループ	4	10.2	47,909
千葉銀行	40	102	86,598
横浜銀行	40	102	73,899
ふくおかフィナンシャルグループ	40	102	60,894
静岡銀行	40	102	122,706
みずほフィナンシャルグループ	40	102	25,347
証券、商品先物取引業 (0.5%)			
大和証券グループ本社	40	102	81,222
野村ホールディングス	40	102	74,480
松井証券	40	102	115,770
保険業 (1.0%)			
損保ジャパン日本興亜ホールディングス	10	25.5	96,772
MS&ADインシュアランスグループホール	12	30.6	106,243
ソニーフィナンシャルホールディングス	8	20.4	46,267
第一生命保険	4	10.2	21,726
東京海上ホールディングス	20	51	231,540
T&Dホールディングス	8	20.4	35,190

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
その他金融業 (0.5%)				
クレディセゾン	40	102	237,048	
不動産業 (2.2%)				
東急不動産ホールディングス	40	102	84,558	
三井不動産	40	102	316,608	
三菱地所	40	102	264,129	
平和不動産	8	—	—	
東京建物	40	51	75,429	
住友不動産	40	102	381,684	
サービス業 (3.3%)				
ディー・エヌ・エー	—	30.6	59,302	
電通	40	102	704,820	
東京ドーム	40	102	59,262	
セコム	40	102	860,574	
合 計	株数・金額	8,378	21,476	51,347,063
	銘柄数<比率>	225	225	<90.4%>

*各銘柄の業種分類は、期首、期末の各時点での分類に基づいています。

*銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

*評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

*一印は組み入れなし。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	百万円 5,451	百万円 —
	日経225		

*単位未満は切り捨て。

*一印は組み入れなし。

○投資信託財産の構成

(2015年11月30日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 51,347,063	% 90.4
コール・ローン等、その他	5,454,926	9.6
投資信託財産総額	56,801,989	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年11月30日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	56,795,444,375
コール・ローン等	5,056,843,405
株式(評価額)	51,347,063,160
未収入金	134,945,864
未収配当金	231,581,820
未収利息	10,126
差入委託証拠金	25,000,000
(B) 負債	1,403,244
未払解約金	1,403,244
(C) 純資産総額(A-B)	56,794,041,131
元本	43,691,030,276
次期繰越損益金	13,103,010,855
(D) 受益権総口数	43,691,030,276口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,999円

(注) 期首元本額17,150百万円、期中追加設定元本額71,042百万円、期中一部解約元本額44,501百万円、計算口数当たり純資産額12,999円。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

- ・野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型) 31百万円
- ・野村日本株リスクコントロール・ファンドVVA(豪ドル投資型)(適格機関投資家専用) 5,270百万円
- ・野村日本株リスクコントロール・ファンドVVA(米ドル投資型)(適格機関投資家専用) 324百万円
- ・野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Eプライス(適格機関投資家専用) 26,739百万円
- ・野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Fプライス(適格機関投資家専用) 3,732百万円
- ・野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Gプライス(適格機関投資家専用) 7,592百万円

○損益の状況 (2014年11月29日～2015年11月30日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	512,025,934
受取配当金	509,695,970
受取利息	2,281,244
その他収益金	48,720
(B) 有価証券売買損益	4,933,169,233
売買益	6,476,577,465
売買損	△1,543,408,232
(C) 先物取引等取引損益	△41,025,495
取引益	713,011,175
取引損	△754,036,670
(D) 当期損益金(A+B+C)	5,404,169,672
(E) 前期繰越損益金	2,244,868,181
(F) 追加信託差損益金	15,863,281,780
(G) 解約差損益金	△10,409,308,778
(H) 計(D+E+F+G)	13,103,010,855
次期繰越損益金(H)	13,103,010,855

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

○お知らせ

①書面決議の要件緩和等に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2014年12月1日＞

②書面決議に反対した受益者が受託者に対して行う受益権の買取請求を不適用とする所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2014年12月1日＞

③有価証券の指図範囲に新投資口予約権証券を加える所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月3日＞

④デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。

＜変更適用日：2015年8月13日＞

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

運用報告書

第13期（決算日2015年3月31日）

作成対象期間（2014年4月1日～2015年3月31日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	わが国の公社債を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合(NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合)の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主な運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋 1-12-1

<http://www.nomura-am.co.jp/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	中率	NOMURA-BPI総合	期騰落			
	円	%			%	%	百万円
9期(2011年3月31日)	11,275	1.8	328.521	1.8	99.5	—	238,120
10期(2012年4月2日)	11,591	2.8	337.688	2.8	98.9	—	233,348
11期(2013年4月1日)	12,027	3.8	350.376	3.8	99.3	—	260,210
12期(2014年3月31日)	12,109	0.7	352.801	0.7	99.0	—	290,791
13期(2015年3月31日)	12,467	3.0	363.279	3.0	99.6	—	510,034

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が作成している指数で、当該指数に関する一切の知的財産権とその他一切の権利は野村證券株式会社に帰属しております。また、野村證券株式会社は、当該インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負うものではありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	NOMURA-BPI総合	騰落		
(期首) 2014年3月31日	円	%			%	%
	12,109	—	352.801	—	99.0	—
4月末	12,127	0.1	353.311	0.1	99.2	—
5月末	12,163	0.4	354.386	0.4	98.0	—
6月末	12,199	0.7	355.413	0.7	99.5	—
7月末	12,219	0.9	356.014	0.9	99.5	—
8月末	12,258	1.2	357.147	1.2	99.5	—
9月末	12,267	1.3	357.407	1.3	99.7	—
10月末	12,324	1.8	359.078	1.8	99.1	—
11月末	12,396	2.4	361.193	2.4	98.8	—
12月末	12,525	3.4	364.960	3.4	99.5	—
2015年1月末	12,528	3.5	365.066	3.5	99.1	—
2月末	12,460	2.9	363.039	2.9	99.4	—
(期末) 2015年3月31日	円	%			%	%
	12,467	3.0	363.279	3.0	99.6	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



(注)ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首12,109円から期末12,467円に358円の値上がりとなりました。

基準価額は、日銀が追加金融緩和を決定したことなどを受けて国内債券利回りが低下(価格は上昇)したことから、上昇しました。

○投資環境

期首から2015年1月中旬にかけては、米国での金融引き締めペースが緩やかなものになるとの観測や、日銀による「量的・質的金融緩和」の拡大において、国債買入れの増額と平均残存年限の長期化が決定されたことなどを受けて、国内債券利回りは低下基調（価格は上昇）となりました。その後、国内株式が一段高となったことや、米長期金利が上昇したことなどを背景に、期末にかけ国内債券利回りは上昇（価格は下落）しました。

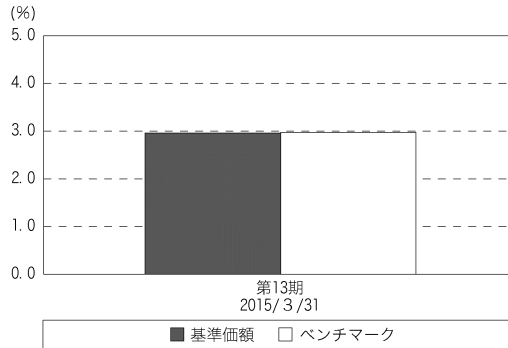
○当ファンドのポートフォリオ

NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した利付債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は+3.0%となり、ベンチマークの+3.0%とほぼ同程度となりました。

基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)



(注)ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

資金流出入に伴う取引でコストが生じること。

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること。

◎今後の運用方針

当ファンドでは引き続き、債券組入比率を高位に保ち、指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値(デュレーションなど)を指数に合わせることで、NOMURA-BPI総合との連動をできる限り高めるように運用を行ってまいります。

○1万口当たりの費用明細

(2014年4月1日～2015年3月31日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2014年4月1日～2015年3月31日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	209,253,048	39,956,879
	地方債証券	16,855,782	2,906,195
	特殊債券	24,053,329	3,663,102
	社債券(投資法人債券を含む)	14,718,418	(536,003)
			3,958,508

*金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

*単位未満は切り捨て。

*()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

*社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

○利害関係人との取引状況等

(2014年4月1日～2015年3月31日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 264,880	百万円 36,964	% 14.0	百万円 50,484	百万円 1,910	% 3.8

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あり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2015年3月31日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期			末			
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	376,143,000 (1,060,000)	403,190,481 (1,295,344)	79.1 (0.3)	— (—)	47.7 (0.2)	21.9 (0.0)	9.5 (—)
地方債証券	31,317,100 (31,317,100)	32,948,675 (32,948,675)	6.5 (6.5)	— (—)	3.9 (3.9)	1.7 (1.7)	0.9 (0.9)
特殊債券 (除く金融債)	38,966,937 (38,966,937)	40,905,677 (40,905,677)	8.0 (8.0)	— (—)	4.6 (4.6)	1.9 (1.9)	1.5 (1.5)
金融債券	3,900,000 (3,900,000)	3,932,771 (3,932,771)	0.8 (0.8)	— (—)	— (—)	0.6 (0.6)	0.1 (0.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	26,207,000 (26,207,000)	26,971,813 (26,971,813)	5.3 (5.3)	— (—)	2.1 (2.1)	2.1 (2.1)	1.1 (1.1)
合 計	476,534,037 (101,451,037)	507,949,418 (106,054,281)	99.6 (20.8)	— (—)	58.2 (10.8)	28.2 (6.3)	13.2 (3.6)

* ()内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

* —印は組み入れなし。

* 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付(2年)第340回	0.1	1,200,000	1,200,936	2016/5/15
国庫債券	利付(2年)第341回	0.1	2,500,000	2,502,100	2016/6/15
国庫債券	利付(2年)第342回	0.1	1,500,000	1,501,335	2016/7/15
国庫債券	利付(2年)第343回	0.1	2,100,000	2,101,995	2016/8/15
国庫債券	利付(2年)第344回	0.1	1,900,000	1,901,919	2016/9/15
国庫債券	利付(2年)第345回	0.1	1,900,000	1,902,033	2016/10/15
国庫債券	利付(2年)第347回	0.1	3,000,000	3,003,570	2016/12/15
国庫債券	利付(2年)第348回	0.1	4,200,000	4,205,250	2017/1/15
国庫債券	利付(2年)第349回	0.1	4,300,000	4,305,633	2017/2/15
国庫債券	利付(2年)第350回	0.1	2,000,000	2,002,720	2017/3/15
国庫債券	利付(5年)第97回	0.4	1,700,000	1,707,633	2016/6/20
国庫債券	利付(5年)第98回	0.3	900,000	902,952	2016/6/20
国庫債券	利付(5年)第99回	0.4	1,900,000	1,910,317	2016/9/20
国庫債券	利付(5年)第100回	0.3	1,000,000	1,003,960	2016/9/20
国庫債券	利付(5年)第101回	0.4	1,600,000	1,610,160	2016/12/20
国庫債券	利付(5年)第102回	0.3	2,900,000	2,913,427	2016/12/20
国庫債券	利付(5年)第103回	0.3	2,100,000	2,110,710	2017/3/20
国庫債券	利付(5年)第104回	0.2	1,000,000	1,003,140	2017/3/20
国庫債券	利付(5年)第105回	0.2	3,500,000	3,512,005	2017/6/20
国庫債券	利付(5年)第106回	0.2	5,600,000	5,621,392	2017/9/20
国庫債券	利付(5年)第107回	0.2	3,800,000	3,815,466	2017/12/20
国庫債券	利付(5年)第108回	0.1	1,800,000	1,802,430	2017/12/20
国庫債券	利付(5年)第109回	0.1	2,800,000	2,803,724	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第110回	0.3	1,000,000	1,007,250	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第111回	0.4	1,400,000	1,414,294	2018/3/20
国庫債券	利付(5年)第112回	0.4	2,200,000	2,224,002	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第113回	0.3	5,000,000	5,038,500	2018/6/20
国庫債券	利付(5年)第114回	0.3	1,500,000	1,511,925	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第115回	0.2	6,300,000	6,328,287	2018/9/20
国庫債券	利付(5年)第116回	0.2	5,600,000	5,624,864	2018/12/20
国庫債券	利付(5年)第117回	0.2	6,400,000	6,427,776	2019/3/20
国庫債券	利付(5年)第118回	0.2	5,000,000	5,020,950	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第119回	0.1	4,000,000	4,000,000	2019/6/20
国庫債券	利付(5年)第120回	0.2	5,500,000	5,522,000	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第121回	0.1	2,900,000	2,898,695	2019/9/20
国庫債券	利付(5年)第122回	0.1	6,300,000	6,294,078	2019/12/20
国庫債券	利付(5年)第123回	0.1	3,100,000	3,095,412	2020/3/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	860,000	1,092,148	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	800,000	974,224	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	700,000	853,489	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,000,000	1,220,550	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	950,000	1,104,992	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	1,000,000	1,132,360	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	1,100,000	1,180,212	2054/3/20
国庫債券	利付(10年)第280回	1.9	1,350,000	1,380,685	2016/6/20
国庫債券	利付(10年)第281回	2.0	800,000	819,160	2016/6/20
国庫債券	利付(10年)第282回	1.7	1,300,000	1,331,863	2016/9/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (10年) 第283回	1.8	1,400,000	1,436,372	2016/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第284回	1.7	2,200,000	2,263,074	2016/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第285回	1.7	2,620,000	2,705,621	2017/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第286回	1.8	800,000	831,080	2017/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第287回	1.9	1,550,000	1,613,658	2017/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第288回	1.7	1,850,000	1,925,480	2017/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第289回	1.5	2,000,000	2,078,700	2017/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第290回	1.4	1,250,000	1,299,937	2018/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第291回	1.3	1,400,000	1,451,786	2018/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第292回	1.7	1,600,000	1,678,128	2018/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第293回	1.8	750,000	792,015	2018/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第294回	1.7	500,000	526,405	2018/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第295回	1.5	1,600,000	1,674,224	2018/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第297回	1.4	1,100,000	1,154,032	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第298回	1.3	1,500,000	1,568,115	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第299回	1.3	1,400,000	1,467,200	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第300回	1.5	1,000,000	1,055,900	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第301回	1.5	1,500,000	1,588,500	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第302回	1.4	700,000	738,360	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第303回	1.4	1,600,000	1,691,776	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,052,910	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,326,935	2019/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,188,700	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,798,549	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第308回	1.3	1,200,000	1,272,744	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第309回	1.1	2,000,000	2,100,500	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第310回	1.0	2,500,000	2,616,675	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第311回	0.8	1,300,000	1,346,553	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第312回	1.2	4,650,000	4,929,558	2020/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第313回	1.3	2,700,000	2,884,383	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第314回	1.1	1,000,000	1,056,470	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第315回	1.2	2,600,000	2,768,974	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,482,362	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第317回	1.1	1,300,000	1,379,118	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第318回	1.0	2,700,000	2,847,015	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,966,217	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第320回	1.0	3,000,000	3,168,540	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第321回	1.0	2,900,000	3,066,721	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,521,440	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,835,432	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第324回	0.8	2,700,000	2,816,235	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第325回	0.8	4,400,000	4,589,200	2022/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第326回	0.7	1,600,000	1,656,384	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第327回	0.8	3,300,000	3,441,306	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第328回	0.6	5,000,000	5,134,650	2023/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第329回	0.8	4,900,000	5,108,740	2023/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第330回	0.8	2,700,000	2,814,966	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第331回	0.6	1,100,000	1,128,182	2023/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (10年) 第332回	0.6	3,200,000	3,280,160	2023/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第333回	0.6	4,200,000	4,302,480	2024/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,197,129	2024/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第335回	0.5	4,700,000	4,762,416	2024/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,731,644	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第337回	0.3	3,000,000	2,978,880	2024/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	128,603	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	246,338	2030/2/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	194,760	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,175,724	2030/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	180,648	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	500,000	616,545	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	731,190	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	113,701	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	65,000	69,646	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	254,775	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	178,356	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	259,545	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	337,049	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	380,000	466,666	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	450,000	560,610	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,139,586	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	1,700,000	2,085,118	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	1,100,000	1,329,130	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	500,000	603,720	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	1,100,000	1,367,564	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	1,100,000	1,328,316	2035/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	746,916	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	540,000	672,354	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	300,000	373,590	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	603,590	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,042,703	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	950,000	1,186,398	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	875,651	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	800,000	986,624	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,093,410	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	1,000,000	1,197,070	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	1,700,000	2,073,150	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	1,800,000	2,080,890	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	1,900,000	2,280,627	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	1,700,000	1,967,257	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,084,868	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	2,000,000	2,270,460	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	1,600,000	1,778,656	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	1,815,040	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,221,891	2043/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,087,050	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,303,740	2044/3/20

銘柄		当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,100,000	1,194,424	2044/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,200,000	1,302,264	2044/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,100,000	1,139,820	2044/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第33回	3.8	410,000	432,685	2016/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第34回	3.5	190,000	202,921	2017/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第35回	3.3	228,000	242,612	2017/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第36回	3.0	380,000	407,686	2017/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第37回	3.1	320,000	344,060	2017/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第38回	2.7	170,000	183,333	2018/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第39回	2.6	511,000	549,488	2018/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第40回	2.3	525,000	565,509	2018/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	269,254	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	750,862	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	449,724	2019/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	167,535	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	269,094	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	99,636	2020/6/22
国庫債券	利付 (20年) 第47回	2.2	230,000	255,794	2020/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	226,850	2020/12/21
国庫債券	利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	223,206	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第50回	1.9	183,000	202,066	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第51回	2.0	310,000	345,656	2021/6/21
国庫債券	利付 (20年) 第52回	2.1	100,000	112,533	2021/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	282,422	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	284,085	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	260,286	2022/3/21
国庫債券	利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	135,462	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	235,563	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	202,219	2022/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	255,541	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	849,201	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	317,568	2023/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	458,744	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	337,164	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	453,416	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	517,284	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	338,517	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	352,987	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	337,803	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	647,427	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	640,553	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	233,660	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	778,881	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,848,096	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,513,798	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	699,750	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,043,296	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	809,648	2025/3/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	919,136	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	360,000	417,150	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,051,722	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	417,873	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	620,000	726,268	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	370,000	433,973	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,395,168	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	469,944	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,674,988	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	592,975	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,318,691	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	558,416	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,300,000	1,547,260	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	300,272	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	650,000	767,240	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	351,195	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	236,390	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	845,061	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	473,408	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,555,723	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	355,500	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	1,800,000	2,135,430	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	1,220,000	1,462,706	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	306,152	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	612,835	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	728,022	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	475,216	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,400,000	1,663,760	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	480,348	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	356,583	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,861,264	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,047,375	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,309,220	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	500,000	601,640	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,142,450	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	1,800,000	2,142,324	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	2,000,000	2,379,940	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	500,000	602,080	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	700,000	842,793	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,260,297	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	588,170	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	917,856	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	500,000	559,570	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	2,300,000	2,672,163	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	700,000	802,984	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	1,300,000	1,547,845	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	600,000	705,450	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	1,100,000	1,326,457	2031/3/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	600,000	704,418	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	500,000	580,320	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	1,200,000	1,391,472	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	500,000	572,180	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	2,000,000	2,286,020	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	500,000	563,430	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	500,000	562,620	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,598,184	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	400,000	456,000	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	449,740	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	776,111	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,122,600	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	600,000	654,636	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	774,774	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	2,000,000	2,243,200	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	1,700,000	1,903,456	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	1,000,000	1,136,660	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	1,500,000	1,652,145	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,627,845	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	2,300,000	2,563,879	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	2,200,000	2,447,698	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	2,300,000	2,515,579	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	2,300,000	2,471,488	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	2,600,000	2,789,306	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	2,530,000	2,664,520	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	1,700,000	1,724,735	2034/12/20
ポーランド共和国 第12回円貨債券 (2012)	1.05	100,000	101,738	2017/11/8
ポーランド共和国 第15回円貨債券 (2013)	0.91	100,000	101,458	2020/11/13
小 計		376,143,000	403,190,481	
地方債証券				
東京都 公募第639回	1.83	100,000	102,568	2016/9/20
東京都 公募第640回	1.79	100,000	102,933	2016/12/20
東京都 公募第642回	1.84	100,000	103,019	2016/12/20
東京都 公募第644回	1.77	60,000	61,974	2017/3/17
東京都 公募第660回	1.58	100,000	104,719	2018/6/20
東京都 公募第671回	1.42	100,000	105,328	2019/6/20
東京都 公募第685回	1.13	100,000	104,910	2020/6/19
東京都 公募第690回	1.29	200,000	212,508	2020/12/18
東京都 公募第703回	0.99	100,000	105,204	2021/12/20
東京都 公募第707回	0.87	100,000	104,528	2022/3/18
東京都 公募第708回	0.89	100,000	104,579	2022/6/20
東京都 公募第710回	0.81	100,000	104,011	2022/6/20
東京都 公募第712回	0.77	100,000	103,733	2022/9/20
東京都 公募第715回	0.76	100,000	103,630	2022/12/20
東京都 公募第716回	0.77	200,000	207,410	2022/12/20
東京都 公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	122,084	2038/9/17
東京都 公募第10回	2.31	200,000	236,836	2039/9/20
東京都 公募第1回	1.54	300,000	329,736	2023/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第7回	2.16	100,000	117,092	2025/9/19
東京都 公募(20年)第16回	2.01	200,000	233,672	2028/12/20
東京都 公募(20年)第17回	2.09	200,000	235,834	2028/12/20
東京都 公募第23回	2.12	100,000	118,343	2030/12/20
東京都 公募(20年)第26回	1.74	300,000	335,553	2032/6/18
北海道 公募平成18年度第6回	2.1	100,000	102,768	2016/8/31
北海道 公募平成19年度第4回	1.98	100,000	104,096	2017/6/29
北海道 公募平成21年度第6回	1.6	100,000	106,029	2019/8/28
北海道 公募平成21年度第10回	1.5	100,000	105,902	2019/11/27
北海道 公募平成24年度第6回	0.84	100,000	103,763	2022/8/31
北海道 公募平成24年度第9回	0.79	100,000	103,401	2022/10/31
北海道 公募平成25年度第1回	0.58	300,000	305,052	2023/4/26
北海道 公募(5年)平成26年度第8回	0.178	200,000	199,580	2019/9/25
北海道 公募(5年)平成26年度第10回	0.147	100,000	99,636	2019/11/28
神奈川県 公募第143回	1.77	120,900	124,404	2016/12/20
神奈川県 公募第184回	1.02	100,000	105,033	2021/6/18
神奈川県 公募第188回	1.05	200,000	211,456	2022/3/18
神奈川県 公募第200回	0.825	100,000	104,039	2023/9/20
神奈川県 公募第205回	0.664	100,000	102,595	2024/3/19
神奈川県 公募第210回	0.451	200,000	200,390	2024/12/20
神奈川県 公募(30年)第3回	2.62	100,000	123,611	2037/3/19
神奈川県 公募第7回	2.22	200,000	237,572	2027/3/19
大阪府 公募第291回	2.0	100,000	102,352	2016/6/29
大阪府 公募第300回	1.8	100,000	103,332	2017/3/29
大阪府 公募第301回	1.83	200,000	207,044	2017/4/26
大阪府 公募第303回	1.93	300,000	312,111	2017/6/28
大阪府 公募第304回	1.98	150,000	156,450	2017/7/28
大阪府 公募第337回	1.44	200,000	212,356	2020/4/28
大阪府 公募第346回	1.25	100,000	105,916	2021/1/28
大阪府 公募第356回	1.06	100,000	105,439	2021/12/27
大阪府 公募第378回	0.7	104,000	106,835	2023/11/28
大阪府 公募(2年)第26回	0.057	1,130,000	1,128,655	2017/1/27
大阪府 公募第5回	2.16	100,000	118,231	2030/5/28
大阪府 公募第8回	1.83	100,000	112,937	2031/12/22
大阪府 公募(5年)第79回	0.38	100,000	100,451	2016/12/27
大阪府 公募第98回	0.295	100,000	100,484	2018/9/27
大阪府 公募第102回	0.223	100,000	100,181	2019/1/30
京都府 公募平成18年度第1回	1.7	160,000	164,459	2016/12/22
京都府 公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,684	2022/6/20
京都府 公募平成24年度第6回	0.8	100,000	103,884	2022/10/21
京都府 公募平成26年度第5回	1.455	100,000	105,245	2034/8/10
兵庫県 公募平成20年度第3回	1.76	100,000	105,067	2018/5/22
兵庫県 公募平成21年度第13回	1.48	100,000	105,520	2019/7/17
兵庫県 公募平成22年度第1回	1.46	100,000	106,265	2020/4/16
兵庫県 公募(30年)第2回	2.36	100,000	118,193	2040/3/19
兵庫県 公募(15年)第3回	1.35	100,000	108,389	2027/7/16
兵庫県 公募(12年)第3回	0.56	300,000	301,992	2025/4/16
兵庫県 公募第2回	2.37	100,000	120,530	2027/9/17

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
兵庫県 公募第9回	2.25	100,000	119,468	2029/11/19
静岡県 公募平成18年度第6回	1.91	100,000	103,028	2016/11/28
静岡県 公募平成19年度第1回	1.77	100,000	103,617	2017/5/30
静岡県 公募平成19年度第4回	1.94	200,000	208,872	2017/8/28
静岡県 公募平成21年度第2回	1.65	100,000	106,292	2019/6/25
静岡県 公募平成21年度第7回	1.54	100,000	106,349	2019/11/25
静岡県 公募平成24年度第10回	0.678	100,000	102,944	2023/3/22
静岡県 公募平成26年度第3回	0.679	165,000	169,364	2024/5/27
静岡県 公募平成26年度第9回	0.554	100,000	101,260	2024/10/24
静岡県 公募(20年)第11回	1.841	100,000	114,236	2030/10/18
静岡県 公募(20年)第14回	1.736	100,000	111,709	2032/6/18
愛知県 公募平成19年度第3回	1.89	111,000	115,730	2017/8/17
愛知県 公募平成19年度第4回	1.87	100,000	104,501	2017/10/18
愛知県 公募平成20年度第8回	2.04	100,000	117,213	2028/12/20
愛知県 公募平成21年度第3回	1.66	114,000	121,225	2019/6/26
愛知県 公募平成21年度第17回	1.41	100,000	106,011	2020/2/26
愛知県 公募平成22年度第3回	1.364	100,000	106,024	2020/5/28
愛知県 公募平成22年度第9回	1.153	100,000	105,244	2020/9/30
愛知県 公募平成23年度第19回	1.006	100,000	105,388	2022/2/28
愛知県 公募平成24年度第2回	0.982	100,000	105,219	2022/4/27
愛知県 公募平成24年度第17回	1.829	100,000	112,820	2033/2/8
愛知県 公募平成26年度第8回	1.814	100,000	107,262	2044/6/20
愛知県 公募平成26年度第13回	1.363	100,000	103,279	2034/11/14
広島県 公募平成22年度第6回	1.26	200,000	212,238	2021/1/25
広島県 公募平成24年度第4回	0.81	100,000	103,936	2022/11/28
広島県 公募平成25年度第3回	0.8	200,000	207,590	2023/9/25
埼玉県 公募平成18年度第5回	1.9	138,000	142,163	2016/11/29
埼玉県 公募平成19年度第7回	1.65	200,000	208,966	2018/2/27
埼玉県 公募平成21年度第5回	1.41	100,000	105,546	2019/9/25
埼玉県 公募平成22年度第2回	1.37	200,000	212,096	2020/5/26
埼玉県 公募平成24年度第4回	0.84	100,000	104,201	2022/7/25
埼玉県 公募平成25年度第4回	0.921	100,000	104,870	2023/7/24
埼玉県 公募平成25年度第6回	0.806	148,000	153,757	2023/9/27
埼玉県 公募平成25年度第11回	0.655	100,000	102,478	2024/3/26
埼玉県 公募平成26年度第6回	0.554	200,000	202,620	2024/9/26
福岡県 公募平成18年度第1回	2.1	200,000	205,700	2016/8/30
福岡県 公募平成19年度第6回	1.72	100,000	103,995	2017/9/20
福岡県 公募平成19年度第8回	1.62	100,000	104,128	2017/12/20
福岡県 公募平成20年度第3回	1.59	100,000	104,735	2018/6/20
福岡県 公募平成23年度第5回	1.02	100,000	105,248	2021/10/25
福岡県 公募平成26年度第4回	0.135	100,000	99,843	2019/9/26
福岡県 公募平成23年度第1回	1.491	100,000	110,353	2026/11/27
福岡県 公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	123,706	2037/9/18
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	1.635	100,000	110,047	2032/8/16
千葉県 公募平成18年度第6回	1.7	400,000	411,112	2016/12/22
千葉県 公募平成20年度第6回	1.64	100,000	105,377	2018/10/25
千葉県 公募平成21年度第11回	1.42	180,000	190,704	2020/1/24
千葉県 公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,726	2022/4/25

銘柄	当	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
千葉県 公募平成24年度第2回		0.91	100,000	104,685	2022/5/25
千葉県 公募平成24年度第4回		0.22	100,000	100,285	2017/8/25
千葉県 公募平成24年度第8回		0.84	100,000	104,208	2023/1/25
千葉県 公募平成25年度第3回		0.89	100,000	104,614	2023/6/23
千葉県 公募(20年)第8回		2.18	100,000	119,182	2030/4/19
千葉県 公募(20年)第17回		1.403	100,000	104,102	2034/10/13
新潟県 公募平成18年度第2回		1.87	128,100	131,867	2016/11/29
新潟県 公募平成21年度第2回		1.55	150,000	159,492	2019/11/27
群馬県 公募第8回		1.03	100,000	105,346	2021/11/25
大分県 公募平成18年度第1回		1.8	111,000	114,001	2016/10/31
共同発行市場地方債 公募第42回		1.8	100,000	102,531	2016/9/23
共同発行市場地方債 公募第43回		1.8	200,000	205,366	2016/10/25
共同発行市場地方債 公募第56回		1.72	400,000	417,136	2017/11/24
共同発行市場地方債 公募第58回		1.59	100,000	104,177	2018/1/25
共同発行市場地方債 公募第62回		1.74	100,000	105,117	2018/5/25
共同発行市場地方債 公募第63回		1.88	100,000	105,689	2018/6/25
共同発行市場地方債 公募第64回		1.78	100,000	105,503	2018/7/25
共同発行市場地方債 公募第65回		1.62	200,000	210,158	2018/8/24
共同発行市場地方債 公募第75回		1.64	310,000	329,371	2019/6/25
共同発行市場地方債 公募第82回		1.42	300,000	317,841	2020/1/24
共同発行市場地方債 公募第84回		1.38	500,000	529,640	2020/3/25
共同発行市場地方債 公募第85回		1.44	100,000	106,298	2020/4/24
共同発行市場地方債 公募第88回		1.17	100,000	105,173	2020/7/24
共同発行市場地方債 公募第92回		1.03	110,000	115,170	2020/11/25
共同発行市場地方債 公募第93回		1.25	300,000	318,045	2020/12/25
共同発行市場地方債 公募第94回		1.24	300,000	318,102	2021/1/25
共同発行市場地方債 公募第96回		1.29	100,000	106,476	2021/3/25
共同発行市場地方債 公募第102回		1.03	150,000	157,867	2021/9/24
共同発行市場地方債 公募第103回		1.0	100,000	105,118	2021/10/25
共同発行市場地方債 公募第110回		0.89	100,000	104,544	2022/5/25
共同発行市場地方債 公募第111回		0.89	200,000	209,096	2022/6/24
共同発行市場地方債 公募第113回		0.77	200,000	207,324	2022/8/25
共同発行市場地方債 公募第115回		0.8	100,000	103,890	2022/10/25
共同発行市場地方債 公募第116回		0.8	200,000	207,792	2022/11/25
共同発行市場地方債 公募第118回		0.84	100,000	104,208	2023/1/25
共同発行市場地方債 公募第119回		0.8	200,000	207,804	2023/2/24
共同発行市場地方債 公募第120回		0.68	300,000	308,886	2023/3/24
共同発行市場地方債 公募第122回		0.62	100,000	102,423	2023/5/25
共同発行市場地方債 公募第124回		0.91	100,000	104,782	2023/7/25
共同発行市場地方債 公募第126回		0.81	100,000	103,921	2023/9/25
共同発行市場地方債 公募第128回		0.66	300,000	307,938	2023/11/24
共同発行市場地方債 公募第130回		0.76	100,000	103,464	2024/1/25
共同発行市場地方債 公募第132回		0.66	100,000	102,520	2024/3/25
共同発行市場地方債 公募第139回		0.544	155,000	156,810	2024/10/25
共同発行市場地方債 公募第143回		0.448	540,000	540,129	2025/2/25
堺市 公募平成22年度第1回		1.97	100,000	115,853	2030/11/19
堺市 公募平成26年度第1回		1.664	100,000	103,044	2044/9/20
島根県 公募平成22年度第1回		1.08	100,000	104,894	2020/11/26

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
福島県 公募平成26年度第1回	0.495	200,000	200,946	2024/11/28
滋賀県 公募平成25年度第1回	0.65	100,000	102,479	2023/11/29
栃木県 公募平成25年度第1回	0.65	100,000	102,479	2023/11/29
熊本県 公募平成18年度第2回	1.8	173,000	177,645	2016/10/27
大阪市 公募平成21年度第6回	1.57	100,000	106,365	2019/11/25
大阪市 公募平成25年度第1回	0.401	100,000	100,816	2018/5/23
大阪市 公募平成25年度第6回	0.694	100,000	102,714	2023/11/22
大阪市 公募(15年)第1回	1.753	100,000	112,843	2026/7/17
大阪市 公募(20年)第5回	2.47	100,000	122,257	2028/9/21
大阪市 公募(20年)第6回	2.21	100,000	118,978	2028/12/20
大阪市 公募(20年)第17回	1.721	100,000	110,600	2032/12/21
名古屋市 公募第460回	1.74	100,000	104,057	2017/9/20
名古屋市 公募第464回	1.61	100,000	105,155	2018/9/20
名古屋市 公募第469回	1.34	100,000	105,503	2019/12/20
名古屋市 公募第478回	1.063	100,000	105,817	2022/3/18
名古屋市 公募第488回	0.598	200,000	203,516	2024/9/20
名古屋市 公募(15年)第2回	0.905	100,000	101,623	2029/11/16
京都市 公募平成19年度第4回	1.62	190,000	198,316	2018/2/26
京都市 公募平成23年度第4回	1.067	100,000	105,650	2021/12/22
京都市 公募(20年)第13回	1.359	100,000	102,632	2034/11/24
神戸市 公募平成21年度第7回	1.69	100,000	106,417	2019/6/20
神戸市 公募平成23年度第12回	0.395	100,000	100,516	2016/12/20
横浜市 公募平成21年度第4回	1.35	200,000	210,526	2019/9/20
横浜市 公募平成22年度第5回	1.265	100,000	106,062	2020/12/11
横浜市 公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	208,056	2022/10/17
横浜市 公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	205,618	2023/5/19
横浜市 公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	205,196	2023/11/17
横浜市 公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	200,770	2024/12/13
横浜市 公募(20年)第30回	1.376	100,000	103,584	2034/10/20
札幌市 公募平成19年度第3回	1.77	100,000	104,119	2017/9/20
札幌市 公募平成22年度第4回	1.05	100,000	104,442	2020/6/19
札幌市 公募平成26年度第4回	0.54	100,000	101,288	2024/6/20
札幌市 公募平成26年度第9回	0.43	200,000	199,904	2024/12/20
川崎市 公募第78回	2.0	100,000	102,386	2016/6/28
川崎市 公募第82回	1.52	100,000	106,042	2019/9/20
川崎市 公募第85回	0.72	100,000	103,327	2022/12/20
川崎市 公募(20年)第17回	1.527	100,000	107,423	2033/5/9
川崎市 公募第32回	0.22	150,000	150,412	2017/6/20
北九州市 公募平成18年度第2回	1.79	170,000	174,957	2016/12/20
北九州市 公募(20年)第14回	1.732	100,000	111,043	2032/11/12
福岡市 公募平成20年度第3回	1.52	100,000	104,493	2018/6/20
福岡市 公募平成24年度第5回	0.19	100,000	100,218	2017/12/26
福岡市 公募平成26年度第2回	1.49	100,000	105,591	2034/6/20
福岡市 公募平成26年度第5回	0.539	100,000	101,075	2024/10/28
広島市 公募平成18年度第1回	1.82	120,900	124,520	2016/12/26
広島市 公募平成21年度第3回	1.34	100,000	105,469	2019/12/25
千葉市 公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,689	2022/4/25
鹿児島県 公募平成18年度第1回	1.9	178,200	183,285	2016/10/31

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	101,140	2023/4/26
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	418,824	2020/11/30
山梨県	公募平成19年度第1回	1.86	200,000	209,040	2017/10/30
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	105,970	2020/3/31
愛知県	・名古屋折半保証名古屋高速道路債券 第96回	2.34	100,000	119,632	2028/12/20
福岡北九州	高速道路債券 第117回	2.26	100,000	118,636	2028/12/20
東京都住宅供給公社	債券 第4回	2.05	300,000	307,659	2016/9/20
東京都住宅供給公社	債券 第5回	2.02	200,000	208,340	2017/9/20
小 計			31,317,100	32,948,675	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構承継	政府保証第344回	1.6	200,000	214,978	2020/7/15
公営企業債券	政府保証第864回	1.9	135,000	138,029	2016/6/22
公営企業債券	政府保証第865回	2.0	102,000	104,564	2016/7/20
公営企業債券	政府保証第875回	1.7	100,000	103,464	2017/5/22
公営企業債券	政府保証第880回	1.7	131,000	136,555	2017/11/17
公営企業債券	政府保証第881回	1.5	200,000	207,948	2018/1/23
公営企業債券	政府保証第886回	1.8	103,000	108,618	2018/6/19
公営企業債券	政府保証15年第1回	1.6	300,000	322,221	2020/6/22
地方公共団体金融機構債券	政府保証第5回	1.2	200,000	209,490	2019/10/18
地方公共団体金融機構債券	政府保証第16回	1.0	100,000	104,462	2020/9/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第1回	0.4	100,000	100,781	2017/9/27
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	104,025	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	100,000	104,129	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	104,900	2023/7/14
政保	地方公共団体金融機構債券(4年) 第6回	0.205	400,000	401,144	2017/8/29
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	119,186	2024/4/12
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第14回	0.199	300,000	300,363	2020/6/18
新関西国際空港債券	政府保証第1回	0.801	151,000	157,049	2022/8/29
原子力損害賠償支援機構債券	政府保証第3回	0.117	1,300,000	1,300,676	2018/5/23
日本政策投資銀行債券	政府保証第18回	1.9	100,000	104,318	2017/8/16
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	115,345	2023/6/19
日本政策投資銀行社債	政府保証第5回	1.4	100,000	105,083	2019/4/15
日本政策投資銀行社債	政府保証第9回	1.0	141,000	147,291	2020/9/14
日本政策投資銀行社債	政府保証第10回	0.5	100,000	100,922	2017/6/23
日本政策投資銀行社債	政府保証第16回	0.819	102,000	106,252	2022/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第6回	1.9	100,000	110,067	2021/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第9回	1.9	100,000	110,188	2021/3/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第14回	1.9	180,000	184,050	2016/6/22
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第16回	2.0	100,000	102,557	2016/7/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第17回	2.0	100,000	102,736	2016/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第20回	1.8	137,000	140,748	2016/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第21回	1.8	3,000,000	3,086,160	2016/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第25回	1.8	100,000	103,162	2017/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第42回	1.8	100,000	104,424	2017/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第56回	1.4	100,000	103,973	2018/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第58回	1.7	136,000	142,862	2018/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第60回	1.8	283,000	298,567	2018/6/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第67回	1.6	200,000	210,628	2018/10/31

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第92回	2.1	200,000	236,736	2029/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第97回	2.1	200,000	236,790	2029/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第98回	1.3	300,000	316,413	2020/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第99回	2.2	200,000	239,524	2030/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第100回	1.4	400,000	424,084	2020/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第106回	2.1	200,000	236,750	2030/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第114回	1.9	200,000	231,004	2030/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第123回	2.1	100,000	116,292	2040/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第137回	1.2	440,000	467,588	2021/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第149回	1.0	140,000	147,417	2021/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第155回	0.9	100,000	104,720	2022/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第157回	0.9	140,000	146,682	2022/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第165回	1.83	100,000	110,418	2042/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第168回	0.839	100,000	104,275	2022/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第169回	1.634	100,000	110,503	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第170回	0.801	218,000	226,739	2022/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第171回	1.56	100,000	109,192	2032/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第172回	1.919	300,000	337,872	2042/8/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第173回	0.819	200,000	208,292	2022/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第175回	0.791	200,000	207,896	2022/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第180回	0.734	200,000	206,964	2022/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第182回	0.834	400,000	417,004	2023/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第183回	1.726	100,000	111,495	2033/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第189回	0.541	196,000	199,802	2023/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第190回	0.605	400,000	409,724	2023/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第193回	0.882	200,000	209,290	2023/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第197回	0.835	272,000	283,603	2023/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第207回	0.693	300,000	308,994	2023/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第211回	0.66	137,000	140,671	2024/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第213回	0.645	145,000	148,664	2024/3/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第216回	1.483	100,000	106,324	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第219回	1.478	100,000	106,211	2034/5/31
首都高速道路債券	政府保証第8回	1.3	100,000	105,437	2020/1/20
阪神高速道路債券	政府保証第2回	1.7	265,000	273,424	2017/3/16
阪神高速道路債券	政府保証第5回	1.3	100,000	105,589	2020/3/18
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	120,000	123,735	2023/10/20
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	264,000	271,885	2023/3/22
預金保険機構債券	政府保証第191回	0.1	400,000	400,180	2016/11/14
預金保険機構債券	政府保証第194回	0.1	300,000	300,078	2017/12/15
中日本高速道路債券	政府保証第13回	1.7	138,000	142,762	2017/5/19
中日本高速道路債券	政府保証第14回	1.9	100,000	104,015	2017/6/16
西日本高速道路債券	政府保証第2回	1.8	176,000	180,766	2016/10/25
西日本高速道路債券	政府保証第3回	1.8	151,000	155,323	2016/11/28
西日本高速道路債券	政府保証第8回	1.7	100,000	103,451	2017/5/19
銀行等保有株式取得機構債券	政府保証第24回	0.1	300,000	300,120	2016/8/5
銀行等保有株式取得機構債券	政府保証第25回	0.1	400,000	400,172	2016/9/16
新関西国際空港社債	財投機関債第10回	0.161	100,000	100,012	2017/9/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	102,378	2029/9/20

銘柄	柄	当期末			償還年月日
		利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
日本政策投資銀行社債	財投機関債第25回	0.425	100,000	100,619	2017/6/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第26回	0.573	100,000	101,540	2019/6/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	102,523	2029/9/20
日本政策投資銀行債券	財投機関債第29回	1.86	200,000	205,948	2016/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第4回	2.59	100,000	122,156	2035/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第8回	2.45	200,000	239,678	2026/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第23回	2.39	200,000	240,470	2027/7/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第33回	2.91	200,000	258,490	2048/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第38回	1.87	100,000	105,481	2018/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第47回	2.41	100,000	121,268	2029/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第86回	0.934	200,000	208,930	2022/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第89回	1.711	100,000	110,356	2032/6/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第102回	0.666	100,000	102,330	2023/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第105回	1.853	100,000	111,969	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第127回	0.184	300,000	299,733	2019/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第130回	0.56	200,000	201,852	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第134回	0.529	200,000	201,302	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第145回	1.523	300,000	297,762	2044/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第33回	2.91	100,000	128,828	2034/6/20
公営企業債券	30年第4回財投機関債	2.95	100,000	129,695	2034/3/24
地方公共団体金融機構債券	第1回	1.648	100,000	106,094	2019/6/28
地方公共団体金融機構債券	20年第4回	2.12	100,000	117,330	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券	20年第6回	2.242	300,000	357,192	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券	F24回	1.681	100,000	110,359	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券	第13回	1.278	200,000	210,732	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券	第16回	1.164	100,000	104,984	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券	(5年)第5回	0.51	200,000	200,886	2016/5/27
地方公共団体金融機構債券	第27回	1.034	200,000	209,754	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券	F106回	1.259	100,000	107,300	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券	第37回	0.852	300,000	311,520	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券	第41回	0.801	100,000	103,478	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券	F142回	1.016	100,000	105,063	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券	F144回	0.562	200,000	203,432	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券	F145回	1.059	200,000	210,716	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	103,480	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	103,400	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F160回	1.052	100,000	104,030	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	(3年)第1回	0.17	200,000	200,112	2016/8/26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	300,000	311,145	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	311,889	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(20年)第38回	1.487	100,000	104,744	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	100,984	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年)第39回	1.425	100,000	103,552	2034/9/28
公営企業債券	20年第2回財投機関債	1.45	100,000	108,399	2022/12/20
公営企業債券	第20回財投機関債	2.05	100,000	102,348	2016/6/20
公営企業債券	第24回財投機関債	1.94	100,000	103,112	2016/12/20
水資源債券	財投機関債第11回	0.167	100,000	100,037	2016/12/20
日本政策金融公庫社債	第20回財投機関債	0.471	100,000	100,501	2016/9/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
中小企業債券 第6回財投機関債	0.79	100,000	101,889	2018/3/20
国際協力銀行債券 第27回財投機関債	1.77	200,000	206,398	2017/3/17
都市再生債券 財投機関債第21回	1.72	300,000	316,113	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第97回	1.017	100,000	102,527	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	2.26	100,000	116,734	2025/6/20
東京交通債券 第342回	2.4	200,000	229,476	2022/6/21
東京交通債券 第347回	2.05	157,000	178,904	2024/3/8
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	0.93	100,000	104,492	2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回	1.86	200,000	210,106	2018/3/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	2.15	100,000	114,636	2023/9/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第25回	1.67	300,000	316,533	2018/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回	1.5	100,000	106,029	2019/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	1.94	100,000	113,900	2025/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	1.95	100,000	114,720	2030/10/22
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	2.066	100,000	116,235	2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回	2.056	100,000	116,007	2031/7/11
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	2.273	100,000	115,150	2042/9/19
私学振興債券 財投機関債第7回	1.7	300,000	311,595	2017/9/25
日本学生支援債券 財投機関債第38回	0.1	500,000	499,635	2017/2/20
国際協力機構債券 第6回財投機関債	2.098	100,000	117,118	2030/12/13
東日本高速道路 第26回	0.305	100,000	100,376	2019/6/20
中日本高速道路債券 財投機関債第3回	1.92	100,000	104,386	2017/9/20
中日本高速道路社債 第32回	0.64	200,000	203,176	2018/9/20
中日本高速道路社債 第44回	0.536	100,000	101,377	2019/9/20
中日本高速道路社債 第46回	0.351	1,500,000	1,507,575	2017/9/20
中日本高速道路社債 第47回	0.277	100,000	100,327	2018/3/20
中日本高速道路社債 第53回	0.222	100,000	100,169	2017/6/20
西日本高速道路 第23回	0.602	100,000	101,118	2024/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回	1.165	200,000	210,046	2020/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回	1.441	100,000	103,943	2034/8/4
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	1.94	17,387	18,236	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	1.69	63,726	66,660	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	1.8	116,435	122,783	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	1.43	112,716	116,765	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	1.76	71,571	75,964	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	2.34	100,332	109,441	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	2.25	24,856	26,903	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	1.84	68,388	72,906	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	1.93	35,795	38,387	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	1.69	68,061	71,514	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	1.69	153,768	162,812	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	2.12	122,070	130,299	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	2.3	125,620	137,004	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	1.99	73,164	78,391	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	2.14	36,852	39,712	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	2.28	47,352	51,555	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	1.98	161,349	173,567	2044/9/10
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券	1.64	41,749	43,829	2032/11/10

銘柄	当期末			償還年月日
	利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	1.43	156,908	164,733	2045/11/10
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券	1.71	85,136	89,649	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	1.79	231,666	247,972	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	1.51	163,586	172,445	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	2.34	94,228	102,894	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	1.89	230,400	247,802	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	1.36	226,050	236,093	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	1.21	261,846	271,201	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	1.34	257,328	268,866	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	1.26	172,256	178,968	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	1.64	80,536	85,490	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	1.6	158,376	167,911	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	1.07	94,017	96,452	2048/12/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	1.08	90,550	93,011	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	1.87	50,352	53,309	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	1.25	90,116	93,677	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	1.88	60,168	64,329	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	1.86	60,647	64,801	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	1.87	66,054	70,608	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	1.85	77,137	82,852	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	1.41	169,778	178,073	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	1.42	168,054	176,357	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	1.44	84,728	89,014	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	1.21	181,538	188,184	2048/9/10
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	1.82	23,226	24,707	2036/5/10
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	1.7	195,535	205,039	2032/5/10
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	1.65	78,920	82,607	2032/5/10
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券	1.75	30,662	31,889	2036/3/10
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	1.82	65,444	68,143	2037/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	169,952	178,128	2047/3/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	181,060	188,255	2048/8/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	98,063	99,507	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	98,365	99,954	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	98,710	99,751	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	198,722	198,549	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	199,632	197,080	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	100,000	100,437	2050/3/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	0.725	100,000	101,298	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	0.69	100,000	100,317	2019/1/29
韓国ガス公社 第6回円貨債券(支配権変更プットオプション条項)	1.38	100,000	101,192	2016/7/14
小計		38,966,937	40,905,677	
金融債券				
商工債券 利付第734回い号	0.55	100,000	100,528	2016/7/27
商工債券 利付第739回い号	0.5	100,000	100,598	2016/12/27
商工債券 利付第740回い号	0.45	100,000	100,533	2017/1/27
商工債券 利付第742回い号	0.4	100,000	100,475	2017/3/27
商工債券 利付第753回い号	0.25	100,000	100,229	2018/2/27
農林債券 利付第741回い号	0.5	150,000	150,888	2017/2/27

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券	%	千円	千円	
農林債券 利付第743回い号	0.45	100,000	100,536	2017/4/27
農林債券 利付第745回い号	0.35	100,000	100,344	2017/6/27
農林債券 利付第751回い号	0.3	200,000	200,544	2017/12/27
農林債券 利付第752回い号	0.3	100,000	100,279	2018/1/26
農林債券 利付第756回い号	0.3	100,000	100,249	2018/5/25
農林債券 利付第759回い号	0.4	100,000	100,591	2018/8/27
農林債券 利付第760回い号	0.4	100,000	100,587	2018/9/27
農林債券 利付第764回い号	0.35	100,000	100,377	2019/1/25
農林債券 利付第773回い号	0.24	300,000	299,517	2019/10/25
しんきん中金債券 利付第259回	0.55	100,000	100,507	2016/6/27
しんきん中金債券 利付第271回	0.35	350,000	351,519	2017/6/27
しんきん中金債券 利付第284回	0.4	100,000	100,710	2018/7/27
しんきん中金債券 利付第286回	0.35	100,000	100,553	2018/9/27
しんきん中金債券 利付第287回	0.3	100,000	100,365	2018/10/26
しんきん中金債券 利付第290回	0.3	100,000	100,340	2019/1/25
商工債券 利付(3年)第171回	0.2	300,000	300,246	2017/4/27
商工債券 利付(3年)第172回	0.2	200,000	200,170	2017/5/26
商工債券 利付(3年)第174回	0.15	200,000	199,926	2017/7/27
商工債券 利付(10年)第5回	1.8	500,000	522,160	2017/12/20
小 計		3,900,000	3,932,771	
普通社債券(含む投資法人債券)				
東京電力 第455回	2.075	100,000	101,904	2018/10/23
東京電力 第459回	2.7	100,000	104,122	2019/1/29
東京電力 第524回	1.795	100,000	100,876	2017/3/14
東京電力 第525回	1.73	100,000	100,766	2017/3/28
東京電力 第542回	1.602	100,000	100,429	2018/4/25
東京電力 第544回	1.976	100,000	101,609	2018/6/25
東京電力 第547回	1.948	100,000	101,319	2020/7/24
東京電力 第548回	2.347	100,000	101,342	2028/9/29
東京電力 第559回	1.377	100,000	99,171	2019/10/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	99,403	2029/12/10
東京電力 第565回	1.313	300,000	295,182	2020/6/24
中部電力 第482回	2.17	200,000	215,328	2019/6/25
中部電力 第500回	0.875	200,000	204,320	2024/5/24
関西電力 第448回	2.16	200,000	211,096	2018/6/20
関西電力 第469回	1.7	100,000	104,366	2018/10/25
関西電力 第482回	1.189	100,000	103,048	2020/7/24
関西電力 第484回	0.976	100,000	101,996	2020/10/23
関西電力 第496回	0.908	100,000	99,881	2025/2/25
中国電力 第314回	2.875	100,000	107,860	2018/4/25
中国電力 第330回	2.1	100,000	109,871	2021/3/25
中国電力 第377回	1.121	200,000	208,836	2023/8/25
中国電力 第378回	1.004	100,000	103,460	2023/10/25
北陸電力 第248回	3.95	100,000	104,309	2016/5/25
北陸電力 第308回	0.769	100,000	101,056	2024/9/25
東北電力 第431回	2.05	400,000	420,712	2018/3/23
東北電力 第473回	0.597	100,000	100,893	2021/4/23
四国電力 第281回	1.111	200,000	208,674	2023/9/25

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
九州電力 第389回	2.01	200,000	204,276	2016/6/24
九州電力 第400回	1.777	100,000	106,466	2020/4/24
九州電力 第409回	1.483	100,000	104,590	2019/8/23
九州電力 第420回	0.82	300,000	304,227	2018/4/25
九州電力 第424回	1.233	200,000	207,254	2023/11/24
北海道電力 第285回	1.69	100,000	101,738	2016/6/24
北海道電力 第296回	2.027	100,000	105,281	2018/6/25
北海道電力 第316回	1.164	107,000	110,676	2020/6/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	99,872	2030/3/25
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	3.175	100,000	107,255	2017/9/11
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	1.293	100,000	105,379	2021/3/19
成田国際空港 第13回一般担保付	0.802	200,000	206,600	2023/2/8
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	0.947	100,000	102,567	2019/3/6
大和ハウス工業 第5回特定社債間限定同順位特約付	0.443	100,000	100,886	2021/6/18
森永乳業 第13回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	102,537	2024/5/8
サッポロホールディングス 第26回社債間限定同順位特約付	0.64	100,000	100,749	2017/3/2
麒麟ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付	0.603	200,000	199,450	2025/2/28
伊藤園 第1回	0.494	100,000	100,598	2017/2/23
ニチレイ 第19回社債間限定同順位特約付	0.515	100,000	100,478	2016/9/1
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	0.466	100,000	100,289	2020/5/19
東急不動産ホールディングス 第2回社債間限定同順位特約付	0.856	100,000	101,713	2024/7/29
セブン&アイ・ホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	1.94	100,000	105,605	2018/6/20
日本製紙グループ本社 第8回日本製紙株式会社保証付	1.97	100,000	103,418	2017/3/27
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	0.451	100,000	100,296	2021/9/3
住友化学 第36回社債間限定同順位特約付	1.95	100,000	103,288	2017/2/27
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	1.58	100,000	105,840	2020/4/23
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	0.302	100,000	99,706	2020/3/6
三菱ケミカルホールディングス 第14回社債間限定同順位特約付	0.482	200,000	200,898	2021/6/17
宇部興産 第10回社債間限定同順位特約付	0.334	100,000	99,757	2019/6/4
花王 第4回特定社債間限定同順位特約付	0.624	100,000	101,828	2020/6/19
武田薬品工業 第15回社債間限定同順位特約付	0.704	100,000	102,137	2020/7/17
JXホールディングス 第9回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	100,076	2024/6/4
横浜ゴム 第10回社債間限定同順位特約付	0.355	100,000	100,036	2021/10/29
ブリヂストン 第8回社債間限定同順位特約付	0.249	200,000	200,124	2019/9/26
住友大阪セメント 第14回社債間限定同順位特約付	0.332	100,000	99,803	2020/3/3
ジェイ エフ イー ホールディングス 第16回(JFE保証)	0.858	100,000	101,393	2017/5/26
豊田自動織機 第25回社債間限定同順位特約付	0.234	100,000	99,995	2019/9/20
小松製作所 第10回社債間限定同順位特約付	0.275	100,000	100,250	2019/6/20
三菱電機 第45回社債間限定同順位特約付	0.428	100,000	100,790	2021/6/4
日本電産 第3回社債間限定同順位特約付	0.956	100,000	103,683	2022/9/20
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	101,103	2020/10/16
パナソニック 第8回社債間限定同順位特約付	2.05	100,000	106,732	2019/3/20
パナソニック 第12回社債間限定同順位特約付	0.387	200,000	199,554	2020/3/19
ソニー 第26回	2.068	100,000	105,394	2019/6/20
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付	0.877	100,000	103,257	2023/9/4
川崎重工業 第32回社債間限定同順位特約付	1.062	100,000	101,890	2017/6/21
明治安田生命2014基金特定目的会社 第1回特定社債	0.51	300,000	300,651	2019/8/7
日産自動車 第55回特定社債間限定同順位特約付	0.415	200,000	201,008	2018/3/20

銘柄	柄	当期末			償還年月日
		利率	額面金額	評価額	
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
トヨタ自動車	第14回社債間限定同等特約付	0.963	100,000	104,632	2023/3/20
エクセディ	第3回社債間限定同順位特約付	0.503	100,000	100,517	2017/3/17
ニコン	第20回特定社債間限定同順位特約付	0.652	100,000	101,768	2022/3/14
伊藤忠商事	第59回社債間限定同順位特約付	1.378	100,000	105,786	2021/6/4
丸紅	第101回社債間限定同順位特約付	0.436	100,000	99,557	2021/7/23
豊田通商	第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	103,406	2025/12/5
三井物産	第58回社債間限定同順位特約付	1.94	100,000	103,076	2016/12/20
三井物産	第71回社債間限定同順位特約付	1.187	100,000	103,814	2029/7/13
住友商事	第45回社債間限定同順位特約付	1.117	100,000	103,527	2022/4/20
三菱商事	第66回担保提供制限等財務上特約無	2.08	100,000	104,429	2017/7/28
三菱商事	第74回担保提供制限等財務上特約無	1.657	100,000	106,008	2019/7/29
高島屋	第11回社債間限定同順位特約付	0.451	200,000	201,334	2021/7/30
丸井グループ	第25回社債間限定同順位特約付	0.344	100,000	100,272	2019/6/4
クレディセゾン	第51回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	101,586	2024/6/18
イオン	第16回社債間限定同順位特約付	1.01	100,000	102,482	2018/11/21
三菱UFJフィナンシャル・グループ	第1回劣後特約付	0.94	100,000	101,810	2024/6/26
みずほコーポレート銀行	第8回特定社債間限定同順位特約付	2.54	100,000	120,320	2027/7/27
みずほコーポレート銀行	第26回特定社債間限定同順位特約付	0.54	1,000,000	1,004,580	2016/7/20
みずほコーポレート銀行	第28回特定社債間限定同順位特約付	0.515	300,000	301,725	2017/1/25
みずほコーポレート銀行	第29回特定社債間限定同順位特約付	0.46	200,000	201,072	2017/4/21
みずほコーポレート銀行	第32回特定社債間限定同順位特約付	0.27	300,000	300,513	2018/1/24
みずほコーポレート銀行	第7回劣後特約付	2.5	100,000	108,634	2019/6/3
三菱東京UFJ銀行	第9回特定社債間限定同順位特約付	2.69	100,000	111,760	2020/2/27
東京三菱銀行	第57回特定社債間限定同順位特約付	2.22	100,000	113,762	2022/10/27
三菱東京UFJ銀行	第93回特定社債間限定同順位特約付	1.985	100,000	104,602	2017/10/17
三菱東京UFJ銀行	第119回特定社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	104,093	2020/10/15
三菱東京UFJ銀行	第11回(劣後特約付)	2.28	100,000	103,227	2016/10/31
三菱東京UFJ銀行	第12回(劣後特約付)	2.16	300,000	313,281	2017/7/28
三井住友フィナンシャルグループ	第1回劣後特約付	0.849	300,000	302,448	2024/9/12
りそな銀行	第4回社債間限定同順位特約付	2.766	100,000	109,787	2019/6/20
りそな銀行	第6回劣後特約付	2.084	300,000	323,511	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行	第9回劣後特約付	1.68	100,000	107,614	2021/4/28
三井住友信託銀行	第1回劣後特約付	1.389	100,000	106,355	2022/9/20
三井住友信託銀行	第7回社債間限定同順位特約付	0.269	100,000	100,127	2019/4/26
セブン銀行	第10回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	103,130	2023/3/20
セブン銀行	第11回社債間限定同順位特約付	0.536	100,000	100,084	2024/12/20
みずほフィナンシャルグループ	第1回劣後特約付	0.95	200,000	202,136	2024/7/16
三井住友銀行	第57回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	100,283	2017/10/20
三井住友銀行	第24回劣後特約付	1.6	100,000	107,211	2021/6/1
みずほ銀行	第6回劣後特約付	2.25	200,000	206,142	2016/11/4
みずほ銀行	第35回特定社債間限定同順位特約付	0.285	100,000	100,108	2019/1/25
興銀リース	第4回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	100,378	2019/5/23
N T Tファイナンス	第45回社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	100,037	2017/6/20
N T Tファイナンス	第46回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,279	2019/6/20
日産フィナンシャルサービス	第20回社債間限定同順位特約付	0.538	100,000	100,684	2017/3/17
ホンダファイナンス	第26回社債間限定同順位特約付	0.315	100,000	100,430	2018/9/20
ホンダファイナンス	第30回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,028	2019/6/20
トヨタファイナンス	第27回社債間限定同等特約付	1.82	200,000	206,674	2017/3/17

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
ジャックス	第12回社債間限定同順位特約付	0.545	100,000	99,583	2021/12/3
日立キャピタル	第52回社債間限定同順位特約付	0.508	100,000	100,790	2021/6/18
日立キャピタル	第56回社債間限定同順位特約付	0.197	100,000	99,444	2019/12/20
日立キャピタル	第57回社債間限定同順位特約付	0.616	100,000	99,306	2024/12/20
オリックス	第144回社債間限定同順位特約付	1.51	100,000	103,432	2017/12/22
オリックス	第148回社債間限定同順位特約付	1.26	100,000	101,956	2017/2/24
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	103,307	2019/8/7
三井住友ファイナンス&リース	第7回社債間限定同順位特約付	0.442	100,000	100,721	2018/8/6
三菱UFJリース	第19回社債間限定同順位特約付	0.487	100,000	100,686	2017/5/29
三菱UFJリース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	100,579	2021/8/27
大和証券グループ本社	第17回社債間限定同順位特約付	0.398	100,000	99,993	2019/8/28
野村ホールディングス	第6回	1.86	100,000	103,152	2017/3/23
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	106,804	2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	202,826	2018/6/20
第1回財政融資マスタートラスト特定目的会社	第1回特定社債	1.83	100,000	103,961	2018/2/20
三井不動産	第34回社債間限定同順位特約付	2.085	100,000	107,375	2019/3/20
三菱地所	第56回担保提供制限等財務上特約無	2.42	100,000	114,619	2022/6/20
三菱地所	第98回担保提供制限等財務上特約無	1.165	100,000	104,694	2020/6/19
三菱地所	第110回担保提供制限等財務上特約無	0.571	100,000	101,393	2019/9/13
三菱地所	第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	100,000	104,082	2022/9/14
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	101,540	2024/1/26
住友不動産	第97回社債間限定同順位特約付	0.904	200,000	201,406	2024/4/26
住友不動産	第100回社債間限定同順位特約付	0.809	100,000	99,496	2024/9/9
エヌ・ティ・ティ都市開発	第10回社債間限定同順位特約付	1.03	100,000	103,901	2020/9/18
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	104,513	2023/6/26
オリックス不動産投資法人	第5回特定投資法人債間限定同順位特	0.76	100,000	101,293	2018/2/8
積水ハウス・S Iレジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	100,520	2024/8/30
東京急行電鉄	第75回社債間限定同順位特約付	0.982	100,000	104,313	2022/6/7
京成電鉄	第42回社債間限定同順位特約付	2.12	100,000	103,572	2017/2/8
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	112,715	2020/8/25
東日本旅客鉄道	第19回社債間限定同順位特約付	2.36	200,000	228,194	2022/2/25
東日本旅客鉄道	第58回社債間限定同順位特約付	1.58	200,000	210,618	2019/3/20
東日本旅客鉄道	第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	114,287	2030/9/27
東日本旅客鉄道	第76回社債間限定同順位特約付	0.533	200,000	201,052	2016/7/22
東日本旅客鉄道	第107回社債間限定同順位特約付	1.415	100,000	95,487	2045/1/27
西日本旅客鉄道	第15回社債間限定同順位特約付	2.26	100,000	118,778	2027/12/20
西日本旅客鉄道	第31回社債間限定同順位特約付	1.408	100,000	106,565	2021/2/26
東海旅客鉄道	第16回社債間限定同順位特約付	1.875	100,000	107,191	2019/9/20
東海旅客鉄道	第25回社債間限定同順位特約付	2.0	100,000	102,281	2016/6/20
東海旅客鉄道	第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	237,010	2030/4/23
東海旅客鉄道	第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	103,739	2032/9/30
三菱倉庫	第14回	0.442	100,000	100,878	2021/3/12
住友倉庫	第1回社債間限定同順位特約付	0.279	200,000	200,604	2019/3/14
日本電信電話	第51回	2.06	300,000	307,080	2016/6/20
日本電信電話	第60回	1.31	100,000	105,887	2020/12/18
KDDI	第5回2号	3.2	100,000	106,252	2017/4/28
NTTドコモ	第15回社債間限定同順位特約付	1.96	100,000	105,636	2018/6/20
電源開発	第31回社債間限定同順位特約付	1.155	100,000	103,847	2020/9/18

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
電源開発	第37回社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	103,503	2021/7/20
電源開発	第39回社債間限定同順位特約付	0.929	100,000	102,302	2024/2/20
電源開発	第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	100,755	2024/8/20
東京瓦斯	第17回社債間限定同順位特約付	2.625	100,000	107,789	2018/6/11
東京瓦斯	第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	108,396	2043/12/17
大阪瓦斯	第9回社債間限定同順位特約付	2.9	100,000	107,718	2018/1/30
東邦瓦斯	第31回社債間限定同順位特約付	2.06	100,000	112,239	2022/3/18
フランス相互信用連合銀行 (BF CM)	第11回円貨社債	0.528	100,000	100,532	2017/3/17
ノルデア・バンク	第6回円貨社債 (2014)	0.288	100,000	100,105	2017/5/26
クレディ・アグリコル・エス・エー	第6回円貨社債 (2014)	0.865	100,000	100,550	2024/11/28
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング	第2回円貨社債	0.345	200,000	200,370	2019/6/27
韓国輸出入銀行	第13回円貨債券 (2014)	0.45	100,000	100,281	2017/3/14
GEキャピタルコーポレーション	第23回円貨社債	0.45	100,000	100,401	2016/9/20
JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー	第9回円貨社債	1.32	100,000	101,983	2017/2/9
JPMorgan・チェース・アンド・カンパニー	第10回円貨社債	0.462	100,000	100,287	2016/6/13
エイチエスビーシー・ファイナンス・コーポレーション	第12回	2.54	100,000	110,827	2021/2/16
ザ・ゴールドマン・サックス・グループ・インク	第9回円貨社債	2.11	200,000	206,376	2016/12/28
ドイツ銀行AGロンドン支店	第8回円貨社債 (2014)	0.47	100,000	100,125	2019/11/14
バンク・オブ・アメリカ・コーポレーション	第8回円貨社債	2.305	100,000	104,473	2017/6/26
パークレイズ・バンク・ピーエルシー	第7回円貨社債	0.478	100,000	100,234	2019/6/24
ビー・エヌ・ピー・パリバ	第4回円貨社債 (2013)	0.53	100,000	100,439	2016/9/13
ナショナル・オーストラリア銀行	第6回円貨社債 (2011)	1.03	100,000	101,104	2016/7/8
ナショナル・オーストラリア銀行	第11回円貨社債 (2015)	0.284	200,000	199,564	2020/1/16
オーストラリア・コムウェルズ銀行	第5回円貨社債 (2011)	0.89	200,000	201,740	2016/6/10
ウェストバック・バンキング・コーポレーション	第9回円貨社債	1.2	200,000	203,894	2017/3/9
オーストラリア・ニュージーランド銀行	第7回円貨社債	1.3	100,000	101,998	2017/1/19
ラボバンク・ネダーランド	第16回円貨社債 (2012)	1.142	100,000	101,856	2017/5/25
ラボバンク・ネダーランド	第18回円貨社債 (2012)	0.778	100,000	101,209	2017/11/2
ラボバンク・ネダーランド	第25回円貨社債 (2014)	0.434	100,000	100,068	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル	第6回円貨社債 (2014)	0.552	200,000	201,096	2019/6/13
小計			26,207,000	26,971,813	
合計			476,534,037	507,949,418	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2015年3月31日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 507,949,418	% 98.6
コール・ローン等、その他	7,234,964	1.4
投資信託財産総額	515,184,382	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2015年3月31日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	515,184,382,455
コール・ローン等	3,116,752,373
公社債(評価額)	507,949,418,317
未収入金	3,307,381,000
未収利息	755,156,312
前払費用	55,674,453
(B) 負債	5,150,238,243
未払金	4,925,943,000
未払解約金	224,295,243
(C) 純資産総額(A-B)	510,034,144,212
元本	409,123,668,357
次期繰越損益金	100,910,475,855
(D) 受益権総口数	409,123,668,357口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,467円

(注)期首元本額240,151百万円、期中追加設定元本額207,869百万円、期中一部解約元本額38,897百万円、計算口数当たり純資産額12,467円。

○損益の状況 (2014年4月1日～2015年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,382,847,099
受取利息	4,382,847,099
(B) 有価証券売買損益	6,067,886,945
売買益	7,357,535,351
売買損	△ 1,289,648,406
(C) 当期損益金(A+B)	10,450,734,044
(D) 前期繰越損益金	50,639,913,431
(E) 追加信託差損益金	48,785,253,044
(F) 解約差損益金	△ 8,965,424,664
(G) 計(C+D+E+F)	100,910,475,855
次期繰越損益金(G)	100,910,475,855

*損益の状況の中で(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末
	元本額
	百万円
野村国内債券インデックスファンド	358
野村世界6資産分散投信(安定コース)	17,984
野村世界6資産分散投信(分配コース)	25,714
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,145
野村資産設計ファンド2015	802
野村資産設計ファンド2020	385
野村資産設計ファンド2025	239
野村資産設計ファンド2030	153
野村資産設計ファンド2035	83
野村資産設計ファンド2040	183
野村日本債券インデックスファンド	1,779
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	168,622
のむらっぴ・ファンド(保守型)	5,192
のむらっぴ・ファンド(普通型)	2,378
のむらっぴ・ファンド(積極型)	524
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	23,025
野村資産設計ファンド2045	7
野村円債投資インデックスファンド	1,952
野村インデックスファンド・国内債券	761
マイ・ロード	27,464
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	130
野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	97
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	0
グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,825
グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	377
グローバル・インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	16,355
グローバル・インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	2,443
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型(適格機関投資家専用)	61
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型(適格機関投資家専用)	53
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型(適格機関投資家専用)	13
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	9,062
野村ワールド・インデックス・バランス35VA(適格機関投資家専用)	542
野村ワールド・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	2,856
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	1,290
野村グローバル・インデックス・バランス25VA(適格機関投資家専用)	261
野村グローバル・インデックス・バランス50VA(適格機関投資家専用)	498
野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用)	1,121
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	2,218
ノムラ日本債券インデックスファンドVA(適格機関投資家専用)	997
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用)	0
マイバランス30(確定拠出年金向け)	10,890
マイバランス50(確定拠出年金向け)	16,441
マイバランス70(確定拠出年金向け)	7,737
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合(確定拠出年金向け)	35,908
マイバランスDC30	5,594
マイバランスDC50	3,512
マイバランスDC70	1,078
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	5,988
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	0

*単位未満は切り捨て。

○お知らせ

- ①デリバティブ取引等に係る投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2014年12月16日＞
- ②信用リスク集中回避のための投資制限に関する所要の約款変更を行いました。
＜変更適用日：2015年2月6日＞