

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2期(決算日2016年12月19日)

作成対象期間(2015年12月19日～2016年12月19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。
	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。
主な投資制限	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。
	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。
分配方針	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 (分配落)	価額		株 組入比率	株 先物比率	債 組入比率	債 先物比率	純 資 産 額
		税 分 配	達 金 騰 落 率					
(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
2期(2016年12月19日)	11,049	0	8.8	66.5	1.4	31.1	—	123

*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		株 組入比率	株 先物比率	債 組入比率	債 先物比率
		騰 落	率				
(期首)	円		%	%	%	%	%
2015年12月18日	10,157	—	—	29.7	3.5	66.2	—
12月末	10,172	0.1	29.7	3.5	66.2	—	—
2016年1月末	9,986	△1.7	32.8	1.4	64.8	—	—
2月末	9,823	△3.3	33.5	1.4	64.1	—	—
3月末	10,047	△1.1	37.7	1.1	60.9	—	—
4月末	10,069	△0.9	39.3	2.1	58.4	—	—
5月末	10,245	0.9	43.1	2.0	54.7	—	—
6月末	9,864	△2.9	44.2	1.0	53.9	—	—
7月末	10,106	△0.5	49.1	1.1	49.7	—	—
8月末	10,154	△0.0	52.0	1.6	46.1	—	—
9月末	10,045	△1.1	53.8	2.2	43.7	—	—
10月末	10,373	2.1	58.1	2.3	39.3	—	—
11月末	10,674	5.1	61.3	3.3	35.3	—	—
(期末)							
2016年12月19日	11,049	8.8	66.5	1.4	31.1	—	—

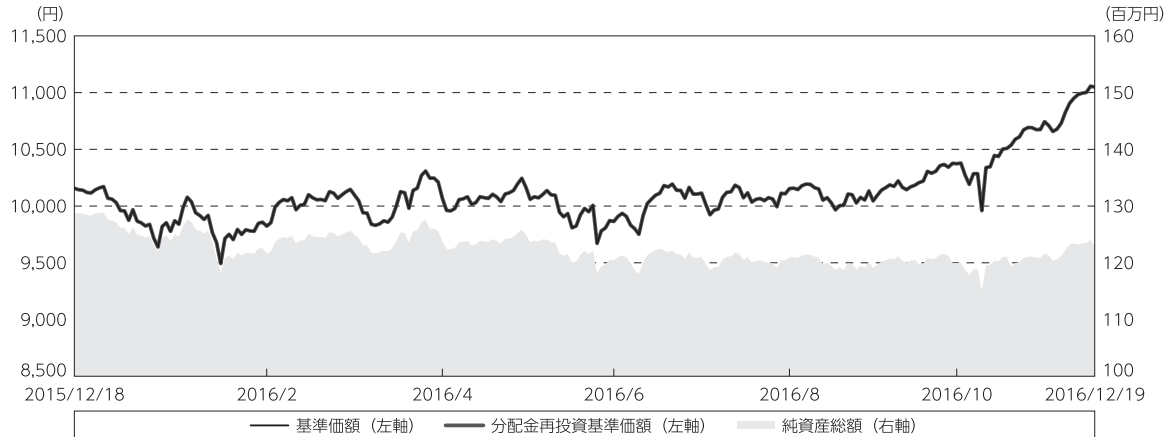
*騰落率は期首比です。

*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



- (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。作成期首(2015年12月18日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (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、期首10,157円から期末11,049円に892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

○投資環境

<国内株式>

2015年12月の日銀金融政策決定会合の内容が金融緩和への手詰まり感の表れと受け取られたことや、中国経済への懸念が再び高まったこと、原油価格下落などを背景とした世界的な株安、為替が円高に進行したことなどをを受けて、国内株式市場は下落しました。

2016年1月の日銀金融政策決定会合においてマイナス金利導入などの追加金融緩和を決定したことから、株式市場は上昇しましたが、その後、原油価格が乱高下したことや米国景気の鈍化傾向の高まりなどから円高米ドル安が進み国内株式市場は下落しました。

6月には英国のEU(欧州連合)離脱を問う国民投票にて、離脱派の勝利が決定したことを受け、リスク回避の動きが鮮明となったことから国内株式市場は下落しました。

7月には米国株式市場が過去最高値を更新したことや参議院議員選挙での与党勝利を受けて政府による大規模な景気対策への期待が高まったことなどから、国内株式市場は上昇しました。

11月には米国大統領選挙において、トランプ氏の政策期待の高まりなどから米国株式市場が過去最高値を更新、外国為替市場では円安米ドル高が進行、国内株式市場も上昇しました。

<国内債券>

期首から2016年7月上旬にかけては、日銀のマイナス金利政策の導入や、英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱支持という結果になったことを受けたリスク回避的な投資家動向から、国債の需要が高まり国内債券市場は堅調となりました。その後、期末にかけては日銀による長短金利を誘導目標とした金融政策の導入や、米国の大統領選の結果を受けた円安進行に伴い、国内株式市場が上昇したことなどから、国内債券市場は軟調となりました。

○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。

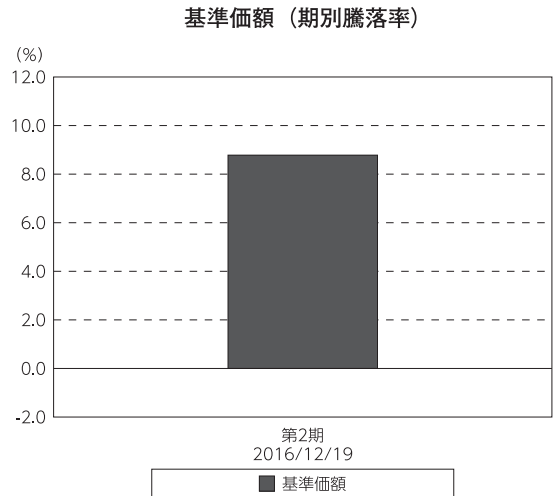
[国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド]

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2期
	2015年12月19日～ 2016年12月19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	1,049

(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。

- | |
|---|
| <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p> |
|---|

<p>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。</p>
--

○ 1 万口当たりの費用明細

(2015年12月19日～2016年12月19日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 55	% 0.541	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(25)	(0.249)	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)	(25)	(0.249)	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)	(4)	(0.043)	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	55	0.545	
期中の平均基準価額は、10,129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

(2015年12月19日～2016年12月19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	千口 —	千円 —	千口 38,386	千円 50,481
野村日経225 マザーファンド	37,790	42,154	7,155	8,238

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年12月19日～2016年12月19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	29,883,286千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	38,996,539千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.76

*(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

(2015年12月19日～2016年12月19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)>

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	$\frac{D}{C}$	
預金	百万円 5	百万円 5	% 100.0	百万円 5	百万円 5	% 100.0

<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 7,477	百万円 10	% 0.1	百万円 22,405	百万円 32	% 0.1
預金	30,841	30,841	100.0	30,841	30,841	100.0

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	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	126,314	7,424	5.9	99,844	3,707	3.7
預金	73,491	73,491	100.0	73,491	73,491	100.0

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
	百万円	百万円	百万円
株式	8	27	52

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)	0.018千円
(B) / (A)	1.6%

* 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、野村信託銀行です。

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2015年12月19日～2016年12月19日)

期首残高 (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

(2016年12月19日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	口 数	評 価 額
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	千口	千口	千口	千円
	68,033	29,646	38,573	
野村日経225 マザーファンド	口	口	口	千円
	34,221	64,856	84,404	

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年12月19日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	38,573	31.0
野村日経225 マザーファンド	84,404	67.9
コール・ローン等、その他	1,344	1.1
投資信託財産総額	124,321	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 (2016年12月19日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	124,321,448
コール・ローン等	344,170
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	38,573,158
野村日経225 マザーファンド(評価額)	84,404,251
未収入金	999,869
(B) 負債	1,319,633
未払解約金	994,260
未払信託報酬	323,508
その他未払費用	1,865
(C) 純資産総額(A-B)	123,001,815
元本	111,323,122
次期繰越損益金	11,678,693
(D) 受益権総口数	111,323,122口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,049円

(注) 期首元本額は126,884,491円、期中追加設定元本額は0円、期中一部解約元本額は15,561,369円、1口当たり純資産額は1.1049円です。

○損益の状況 (2015年12月19日～2016年12月19日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 25
受取利息	4
支払利息	△ 29
(B) 有価証券売買損益	10,590,709
売買益	11,235,118
売買損	△ 644,409
(C) 信託報酬等	△ 666,612
(D) 当期損益金(A+B+C)	9,924,072
(E) 前期繰越損益金	1,014,308
(F) 追加信託差損益金	740,313
(配当等相当額)	(116,154)
(売買損益相当額)	(624,159)
(G) 計(D+E+F)	11,678,693
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	11,678,693
追加信託差損益金	740,313
(配当等相当額)	(116,154)
(売買損益相当額)	(624,159)
分配準備積立金	10,938,380

*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(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。

(注) 分配金の計算過程(2015年12月19日～2016年12月19日)は以下の通りです。

項 目	当 期
	2015年12月19日～ 2016年12月19日
a. 配当等収益(経費控除後)	1,447,905円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	8,476,167円
c. 信託約款に定める収益調整金	740,313円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	1,014,308円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	11,678,693円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,049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

1万口当たり分配金(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

該当事項はございません。

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2016年12月19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(28,857,085千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.2%)				
日本水産	108	72	39,456	
マルハニチロ	10.8	7.2	21,996	
鉱業 (0.1%)				
国際石油開発帝石	43.2	28.8	35,467	
建設業 (2.9%)				
コムシスホールディングス	108	72	152,568	
大成建設	108	72	60,480	
大林組	108	72	81,144	
清水建設	108	72	78,768	
長谷工コーポレーション	21.6	14.4	17,179	
鹿島建設	108	72	59,184	
大和ハウス工業	108	72	237,024	
積水ハウス	108	72	138,564	
日揮	108	72	158,112	
千代田化工建設	108	72	61,704	
食料品 (4.9%)				
日清製粉グループ本社	108	72	124,848	
明治ホールディングス	21.6	14.4	130,176	
日本ハム	108	72	224,640	
サッポロホールディングス	108	14.4	43,344	
アサヒグループホールディングス	108	72	253,080	
キリンホールディングス	108	72	139,104	
宝ホールディングス	108	72	74,736	
キッコーマン	108	72	268,920	
味の素	108	72	174,960	
ニチレイ	108	36	85,356	
日本たばこ産業	108	72	282,672	
繊維製品 (0.3%)				
東洋紡	108	72	12,672	
ユニチカ	108	72	6,048	
帝人	108	14.4	34,113	
東レ	108	72	68,918	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
パルプ・紙 (0.3%)				
王子ホールディングス	108	72	36,072	
日本製紙	10.8	7.2	14,911	
北越紀州製紙	108	72	49,104	
化学 (8.6%)				
クラレ	108	72	127,152	
旭化成	108	72	75,384	
昭和電工	108	7.2	12,643	
住友化学	108	72	42,264	
日産化学工業	108	72	285,840	
日本曹達	108	—	—	
東ソー	108	72	61,560	
トクヤマ	108	72	33,480	
デンカ	108	72	38,160	
信越化学工業	108	72	660,168	
三井化学	108	72	39,456	
三菱ケミカルホールディングス	54	36	28,479	
宇部興産	108	72	17,856	
日本化薬	108	72	103,176	
花王	108	72	404,352	
富士フイルムホールディングス	108	72	322,344	
資生堂	108	72	215,352	
日東電工	108	72	657,144	
医薬品 (6.8%)				
協和発酵キリン	108	72	117,144	
武田薬品工業	108	72	347,040	
アステラス製薬	540	360	586,980	
大日本住友製薬	108	72	140,184	
塩野義製薬	108	72	377,496	
中外製薬	108	72	238,680	
エーザイ	108	72	487,008	
第一三共	108	72	173,556	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	108	72	82,584
J Xホールディングス	108	72	36,244
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	54	36	78,840
ブリヂストン	108	72	317,880
ガラス・土石製品 (1.5%)			
旭硝子	108	72	60,624
日本板硝子	108	7.2	6,480
日本電気硝子	162	108	71,604
住友大阪セメント	108	72	30,456
太平洋セメント	108	72	26,496
東海カーボン	108	72	28,152
TOTO	54	36	167,040
日本碍子	108	72	169,992
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	10.8	7.2	19,461
神戸製鋼所	108	7.2	8,748
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.8	7.2	13,478
日新製鋼	10.8	7.2	10,648
大太平洋金属	108	72	28,512
非鉄金属 (1.3%)			
日本軽金属ホールディングス	108	72	18,144
三井金属鉱業	108	72	22,608
東邦亜鉛	108	72	34,200
三菱マテリアル	108	7.2	26,712
住友金属鉱山	108	72	110,664
DOWAホールディングス	108	72	65,952
古河機械金属	108	72	16,056
古河電気工業	108	7.2	24,084
住友電気工業	108	72	121,608
フジクラ	108	72	45,792
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	10.8	7.2	11,232
東洋製織グループホールディングス	108	72	159,984
機械 (5.3%)			
日本製鋼所	108	14.4	30,124
オークマ	108	72	82,584
アマダホールディングス	108	72	94,896
小松製作所	108	72	190,764

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
住友重機械工業	108	72	54,432
日立建機	108	72	180,936
クボタ	108	72	124,236
荏原製作所	108	14.4	46,152
ダイキン工業	108	72	770,400
日本精工	108	72	101,520
NTN	108	72	36,792
ジェイテクト	108	72	139,824
日立造船	21.6	14.4	8,956
三菱重工業	108	72	39,657
I H I	108	72	23,328
電気機器 (17.0%)			
日清紡ホールディングス	108	72	83,736
コニカミノルタ	108	72	83,592
ミネベア	108	72	86,256
日立製作所	108	72	46,886
東芝	108	72	33,343
三菱電機	108	72	119,232
富士電機	108	72	43,632
安川電機	108	72	132,264
明電舎	108	72	28,728
ジーエス・ユアサ コーポレーション	108	72	35,496
日本電気	108	72	23,112
富士通	108	72	49,600
沖電気工業	108	7.2	12,103
パナソニック	108	72	92,232
シャープ	108	—	—
ソニー	108	72	243,432
TDK	108	72	601,200
ミツミ電機	108	72	50,616
アルプス電気	108	72	210,096
パイオニア	108	72	18,144
横河電機	108	72	121,680
アドバンテスト	216	144	236,160
カシオ計算機	108	72	122,832
ファナック	108	72	1,464,480
京セラ	216	144	843,840
太陽誘電	108	72	101,520
S C R E E Nホールディングス	108	14.4	98,928
キヤノン	162	108	369,036

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リコー	108	72	73,008
東京エレクトロン	108	72	770,400
輸送用機器 (7.0%)			
デンソー	108	72	372,600
三井造船	108	72	13,248
川崎重工業	108	72	28,080
日産自動車	108	72	84,168
いすゞ自動車	54	36	54,594
トヨタ自動車	108	72	514,368
日野自動車	108	72	86,400
三菱自動車工業	10.8	7.2	4,744
マツダ	21.6	14.4	29,397
本田技研工業	216	144	508,752
スズキ	108	72	302,760
富士重工業	108	72	350,712
ヤマハ発動機	—	72	200,592
精密機器 (3.0%)			
テルモ	216	144	606,960
ニコン	108	72	127,728
オリンパス	108	72	309,600
シチズン時計	108	72	53,496
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	108	72	81,432
大日本印刷	108	72	83,592
ヤマハ	108	72	260,280
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力ホールディングス	10.8	7.2	3,859
中部電力	10.8	7.2	12,600
関西電力	10.8	7.2	9,716
東京瓦斯	108	72	39,074
大阪瓦斯	108	72	33,199
陸運業 (2.3%)			
東武鉄道	108	72	41,472
東京急行電鉄	108	72	63,504
小田急電鉄	108	36	83,808
京王電鉄	108	72	69,192
京成電鉄	108	36	102,672
東日本旅客鉄道	10.8	7.2	73,692
西日本旅客鉄道	10.8	7.2	51,796
東海旅客鉄道	10.8	7.2	140,112

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本通運	108	72	44,352
ヤマトホールディングス	108	72	170,748
海運業 (0.2%)			
日本郵船	108	72	16,488
商船三井	108	72	24,120
川崎汽船	108	72	19,872
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	108	72	23,241
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	108	72	119,520
情報・通信業 (11.5%)			
ヤフー	43.2	28.8	12,758
トレンドマイクロ	108	72	312,480
スカパーJ S A Tホールディングス	10.8	7.2	4,039
日本電信電話	21.6	14.4	70,430
KDD I	648	432	1,321,488
NTTドコモ	10.8	7.2	19,522
東宝	10.8	7.2	23,364
エヌ・ティ・ティ・データ	108	72	419,760
コナミホールディングス	108	72	297,360
ソフトバンクグループ	324	216	1,689,552
卸売業 (2.2%)			
双日	10.8	7.2	2,131
伊藤忠商事	108	72	114,768
丸紅	108	72	48,564
豊田通商	108	72	220,320
三井物産	108	72	121,032
住友商事	108	72	100,584
三菱商事	108	72	184,536
小売業 (12.3%)			
J. フロント リテイリング	54	36	63,864
三越伊勢丹ホールディングス	108	72	99,432
セブン&アイ・ホールディングス	108	72	330,840
ユニー・ファミリーマートホールディングス	—	72	548,640
高島屋	108	72	76,320
丸井グループ	108	72	131,832
イオン	108	72	123,588
ユニーグループ・ホールディングス	108	—	—
ファーストリテイリング	108	72	3,105,360

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
銀行業 (1.1%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	—	72	42,120
新生銀行	108	72	14,760
あおぞら銀行	108	72	30,744
三菱UFJフィナンシャル・グループ	108	72	54,691
りそなホールディングス	10.8	7.2	4,564
三井住友トラスト・ホールディングス	108	7.2	32,983
三井住友フィナンシャルグループ	10.8	7.2	33,804
千葉銀行	108	72	54,216
横浜銀行	108	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	108	72	39,960
静岡銀行	108	72	74,088
みずほフィナンシャルグループ	108	72	15,904
証券、商品先物取引業 (0.5%)			
大和証券グループ本社	108	72	54,655
野村ホールディングス	108	72	52,977
松井証券	108	72	73,080
保険業 (1.1%)			
SOMPOホールディングス	27	18	72,306
MS&ADインシュアランスグループホール	32.4	21.6	79,963
ソニーフィナンシャルホールディングス	21.6	14.4	27,072
第一生命ホールディングス	10.8	7.2	14,774

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
東京海上ホールディングス	54	36	180,756	
T&Dホールディングス	21.6	14.4	22,896	
その他金融業 (0.4%)				
クレディセゾン	108	72	154,944	
不動産業 (1.9%)				
東急不動産ホールディングス	108	72	50,904	
三井不動産	108	72	197,784	
三菱地所	108	72	168,192	
東京建物	54	36	55,944	
住友不動産	108	72	226,800	
サービス業 (3.3%)				
ディー・エヌ・エー	32.4	21.6	56,980	
電通	108	72	411,120	
楽天	—	72	82,620	
東京ドーム	108	36	42,012	
セコム	108	72	612,216	
合 計	株数・金額	22,739	14,274	36,387,630
	銘柄数<比率>	225	225	<96.9%>

*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、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	百万円
	日経225	755	—

*単位未満は切り捨て。

<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(518,923,650千口)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	490,265,000 (2,360,000)	538,483,300 (3,293,839)	79.8 (0.5)	— (—)	52.3 (0.4)	21.2 (0.1)	6.3 (—)
地方債証券	47,636,420 (47,636,420)	50,111,119 (50,111,119)	7.4 (7.4)	— (—)	3.7 (3.7)	2.1 (2.1)	1.6 (1.6)
特殊債券 (除く金融債)	47,326,494 (47,326,494)	50,195,776 (50,195,776)	7.4 (7.4)	— (—)	4.8 (4.8)	1.4 (1.4)	1.2 (1.2)
金融債券	3,200,000 (3,200,000)	3,216,963 (3,216,963)	0.5 (0.5)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	27,407,000 (27,407,000)	28,256,242 (28,256,242)	4.2 (4.2)	— (—)	1.8 (1.8)	1.8 (1.8)	0.6 (0.6)
合 計	615,834,914 (127,929,914)	670,263,402 (135,073,940)	99.3 (20.0)	— (—)	62.7 (10.8)	26.7 (5.6)	9.9 (3.6)

* ()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。

*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360回	0.1	2,200,000	2,208,954
国庫債券	利付(2年)第362回	0.1	1,400,000	1,406,034
国庫債券	利付(2年)第366回	0.1	4,000,000	4,019,440
国庫債券	利付(2年)第368回	0.1	1,500,000	1,507,830
国庫債券	利付(2年)第369回	0.1	1,500,000	1,508,055
国庫債券	利付(5年)第109回	0.1	2,800,000	2,812,376
国庫債券	利付(5年)第110回	0.3	1,000,000	1,006,920
国庫債券	利付(5年)第111回	0.4	1,400,000	1,411,438
国庫債券	利付(5年)第112回	0.4	2,200,000	2,220,460
国庫債券	利付(5年)第113回	0.3	7,000,000	7,054,600
国庫債券	利付(5年)第114回	0.3	1,500,000	1,513,275
国庫債券	利付(5年)第115回	0.2	7,300,000	7,351,173
国庫債券	利付(5年)第116回	0.2	8,100,000	8,161,641
国庫債券	利付(5年)第117回	0.2	5,900,000	5,949,147
国庫債券	利付(5年)第118回	0.2	5,000,000	5,045,700
国庫債券	利付(5年)第119回	0.1	4,700,000	4,731,208
国庫債券	利付(5年)第120回	0.2	5,500,000	5,553,075
国庫債券	利付(5年)第121回	0.1	3,500,000	3,524,115
国庫債券	利付(5年)第122回	0.1	7,800,000	7,855,146
国庫債券	利付(5年)第123回	0.1	7,300,000	7,352,268
国庫債券	利付(5年)第124回	0.1	8,100,000	8,158,239
国庫債券	利付(5年)第125回	0.1	8,200,000	8,261,664
国庫債券	利付(5年)第126回	0.1	5,500,000	5,543,010
国庫債券	利付(5年)第127回	0.1	6,000,000	6,048,540
国庫債券	利付(5年)第128回	0.1	6,200,000	6,250,344
国庫債券	利付(5年)第129回	0.1	3,500,000	3,529,155
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	1,960,000	2,895,880
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	900,000	1,287,306
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	900,000	1,293,723
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,300,000	1,882,842
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	1,300,000	1,811,030
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	1,300,000	1,779,271
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	1,400,000	1,832,530
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	1,500,000	1,819,500
国庫債券	利付(40年)第9回	0.4	1,500,000	1,316,850
国庫債券	利付(10年)第290回	1.4	1,250,000	1,275,725
国庫債券	利付(10年)第291回	1.3	1,400,000	1,427,062
国庫債券	利付(10年)第292回	1.7	1,600,000	1,638,928
国庫債券	利付(10年)第293回	1.8	750,000	772,732
国庫債券	利付(10年)第294回	1.7	500,000	514,405
国庫債券	利付(10年)第295回	1.5	1,600,000	1,641,168
国庫債券	利付(10年)第297回	1.4	1,100,000	1,134,837
国庫債券	利付(10年)第298回	1.3	1,500,000	1,544,490
国庫債券	利付(10年)第299回	1.3	1,400,000	1,446,186
国庫債券	利付(10年)第300回	1.5	1,000,000	1,037,490
国庫債券	利付(10年)第301回	1.5	1,500,000	1,561,995

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302回	1.4	700,000	727,181	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第303回	1.4	3,300,000	3,440,646	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,039,860	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,277,038	2019/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,147,960	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,778,319	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第308回	1.3	1,700,000	1,783,793	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第309回	1.1	3,000,000	3,126,840	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第310回	1.0	3,700,000	3,853,106	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第311回	0.8	1,800,000	1,860,930	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第312回	1.2	4,950,000	5,206,162	2020/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第313回	1.3	3,200,000	3,388,736	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第314回	1.1	2,200,000	2,311,034	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第315回	1.2	2,600,000	2,749,526	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,474,200	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第317回	1.1	1,800,000	1,900,764	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第318回	1.0	3,200,000	3,363,904	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,958,040	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第320回	1.0	3,500,000	3,686,865	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第321回	1.0	3,200,000	3,377,536	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,520,528	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,841,345	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,349,888	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第325回	0.8	4,900,000	5,138,581	2022/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,193,408	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第327回	0.8	3,100,000	3,256,519	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第328回	0.6	5,500,000	5,716,700	2023/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第329回	0.8	5,300,000	5,584,451	2023/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第330回	0.8	3,800,000	4,009,190	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	1,978,926	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第332回	0.6	4,400,000	4,586,296	2023/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第333回	0.6	5,000,000	5,211,650	2024/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,276,382	2024/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第335回	0.5	4,700,000	4,868,871	2024/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,800,116	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第337回	0.3	3,700,000	3,778,181	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第338回	0.4	4,900,000	5,044,942	2025/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第339回	0.4	5,900,000	6,077,236	2025/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第340回	0.4	6,000,000	6,182,880	2025/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第341回	0.3	7,200,000	7,357,896	2025/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第342回	0.1	7,500,000	7,527,525	2026/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第343回	0.1	6,900,000	6,926,013	2026/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第344回	0.1	5,800,000	5,816,820	2026/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	132,815	2029/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	256,778	2030/2/20
国庫債券	利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	203,883	2030/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,224,828	2030/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	190,420	2031/5/20

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6回	2.4	700,000	911,813	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	776,184	2032/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	122,142	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年) 第9回	1.4	65,000	75,396	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	277,962	2033/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	193,384	2033/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	280,022	2033/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	365,005	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,059,808	2034/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,209,042	2034/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,231,379	2034/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,596,228	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	1,500,000	1,971,180	2035/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	2,103,616	2035/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,568,971	2035/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,843,590	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	812,796	2036/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,139,443	2036/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	950,768	2036/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	661,210	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,141,635	2037/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,120,772	2037/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	962,381	2038/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	800,000	1,088,536	2038/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,210,950	2039/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,000,000	1,330,910	2039/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,579,934	2040/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,598,200	2040/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	3,105,161	2041/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	3,010,056	2041/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,362,824	2042/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,976,798	2042/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,782,928	2043/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,080,272	2043/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,404,238	2043/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,252,660	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,505,556	2044/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,633,645	2044/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,762,124	2044/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,296,131	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,300,000	1,573,065	2045/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,900,000	2,350,908	2045/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,662,374	2045/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	1,400,000	1,664,306	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	1,900,000	1,957,988	2046/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第51回	0.3	2,400,000	2,154,744	2046/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第52回	0.5	2,000,000	1,901,500	2046/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第38回	2.7	170,000	176,256	2018/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券					
国庫債券	利付 (20年) 第39回	2.6	511,000	529,166	2018/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第40回	2.3	525,000	547,974	2018/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	264,531	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	725,448	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	433,600	2019/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	162,744	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	261,773	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	97,307	2020/6/22
国庫債券	利付 (20年) 第47回	2.2	1,230,000	1,336,505	2020/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	220,750	2020/12/21
国庫債券	利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	218,636	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第50回	1.9	183,000	198,490	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第51回	2.0	310,000	339,034	2021/6/21
国庫債券	利付 (20年) 第52回	2.1	100,000	110,343	2021/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	277,205	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	278,457	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	255,908	2022/3/21
国庫債券	利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	133,593	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	232,631	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	200,347	2022/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	254,133	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	847,774	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	319,728	2023/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	463,768	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	335,730	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	452,044	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	515,669	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	337,902	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	352,153	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	335,727	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	644,252	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	635,715	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	232,458	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	776,905	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,850,720	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,514,084	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	701,556	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,049,075	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	812,728	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	925,592	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	1,002,295	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,056,528	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	421,326	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	966,829	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,621,545	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,409,592	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	475,448	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,689,828	2026/3/20

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87回	2.2	500,000	598,910	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,333,277	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	565,231	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,810,200	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	304,122	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	1,550,000	1,861,441	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	358,524	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	241,048	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	860,846	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	483,596	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,591,135	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	363,993	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	2,100,000	2,555,469	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	1,520,000	1,872,822	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	313,582	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	629,265	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	748,320	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	489,808	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,333,105	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	495,808	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	369,378	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,932,256	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,089,360	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,357,884	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	999,320	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,226,438	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	1,800,000	2,232,072	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	2,500,000	3,107,625	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	500,000	627,870	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,383,844	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,365,747	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	617,050	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	966,296	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	945,312	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	1,500,000	1,835,040	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	1,100,000	1,331,033	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	2,000,000	2,505,460	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,239,180	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	900,000	1,142,163	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	1,000,000	1,241,540	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	800,000	981,552	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	1,500,000	1,842,360	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	500,000	607,140	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	1,600,000	1,944,432	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	960,888	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,563,432	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,703,814	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	900,000	1,096,785	2032/3/20

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135回	1.7	400,000	481,632	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	832,041	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,204,620	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	940,064	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	832,895	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	3,000,000	3,615,240	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	1,700,000	2,050,761	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	1,250,000	1,526,887	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	2,500,000	2,978,000	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,763,775	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	2,600,000	3,140,046	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	3,700,000	4,469,008	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	2,700,000	3,218,211	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	2,500,000	2,938,850	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	2,600,000	3,055,156	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	2,930,000	3,393,027	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	2,700,000	3,032,073	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	3,200,000	3,589,472	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	3,450,000	3,927,238	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	3,500,000	3,919,930	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	2,800,000	3,029,740	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	2,900,000	2,816,944	2036/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	3,900,000	3,634,020	2036/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	3,700,000	3,644,315	2036/9/20
メキシコ合衆国	第22回円貨社債 (2016)	0.7	300,000	297,186	2021/6/16
ポーランド共和国	第15回円貨債券 (2013)	0.91	100,000	100,773	2020/11/13
小 計			490,265,000	538,483,300	
地方債証券					
東京都	公募第655回	1.42	100,000	101,766	2018/3/20
東京都	公募第659回	1.62	300,000	307,296	2018/6/20
東京都	公募第660回	1.58	100,000	102,372	2018/6/20
東京都	公募第664回	1.4	100,000	102,928	2018/12/20
東京都	公募第668回	1.54	200,000	206,926	2019/3/20
東京都	公募第671回	1.42	100,000	103,551	2019/6/20
東京都	公募第685回	1.13	100,000	103,953	2020/6/19
東京都	公募第690回	1.29	200,000	210,312	2020/12/18
東京都	公募第703回	0.99	100,000	104,768	2021/12/20
東京都	公募第707回	0.87	100,000	104,316	2022/3/18
東京都	公募第708回	0.89	100,000	104,608	2022/6/20
東京都	公募第710回	0.81	100,000	104,169	2022/6/20
東京都	公募第712回	0.77	100,000	104,100	2022/9/20
東京都	公募第715回	0.76	100,000	104,186	2022/12/20
東京都	公募第716回	0.77	200,000	208,492	2022/12/20
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	133,523	2038/9/17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	261,376	2039/9/20
東京都	公募 (7年) 第3回	0.58	100,000	101,008	2018/9/20
東京都	公募第1回	1.54	300,000	328,434	2023/6/20
東京都	公募 (20年) 第3回	2.26	100,000	115,453	2024/3/19

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	117,462	2025/9/19
東京都	公募(20年)第16回	2.01	200,000	239,484	2028/12/20
東京都	公募(20年)第17回	2.09	200,000	241,336	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	122,848	2030/12/20
東京都	公募(20年)第26回	1.74	300,000	355,020	2032/6/18
北海道	公募平成20年度第7回	1.72	300,000	309,096	2018/9/25
北海道	公募平成21年度第6回	1.6	100,000	104,342	2019/8/28
北海道	公募平成21年度第10回	1.5	100,000	104,494	2019/11/27
北海道	公募平成24年度第6回	0.84	100,000	104,340	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回	0.79	100,000	104,175	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回	0.58	300,000	309,183	2023/4/26
北海道	公募(5年)平成25年度第8回	0.31	100,000	100,539	2018/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第8回	0.178	200,000	200,984	2019/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第10回	0.147	100,000	100,432	2019/11/28
北海道	公募平成27年度第7回	0.529	100,000	103,118	2025/8/28
宮城県	公募(5年)第9回1号	0.35	500,000	502,790	2018/7/26
神奈川県	公募第155回	1.61	100,000	102,417	2018/6/20
神奈川県	公募第156回	1.66	101,000	103,933	2018/9/20
神奈川県	公募第184回	1.02	100,000	104,606	2021/6/18
神奈川県	公募第188回	1.05	200,000	210,404	2022/3/18
神奈川県	公募第196回	0.678	100,000	103,718	2023/3/20
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	104,898	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	103,869	2024/3/19
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	103,853	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	204,840	2024/12/20
神奈川県	公募(30年)第3回	2.62	100,000	134,061	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	359,223	2027/3/19
神奈川県	公募(5年)第56回	0.29	100,000	100,355	2018/3/20
大阪府	公募第320回	1.84	400,000	414,300	2018/11/27
大阪府	公募第337回	1.44	200,000	209,564	2020/4/28
大阪府	公募第346回	1.25	100,000	105,199	2021/1/28
大阪府	公募第356回	1.06	100,000	105,345	2021/12/27
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	108,183	2023/11/28
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	103,864	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	308,286	2024/8/28
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	122,443	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	118,807	2031/12/22
大阪府	公募第98回	0.295	200,000	201,028	2018/9/27
大阪府	公募(5年)第99回	0.24	240,000	241,060	2018/10/30
大阪府	公募(5年)第101回	0.23	148,000	148,686	2018/12/26
大阪府	公募第102回	0.223	100,000	100,471	2019/1/30
大阪府	公募(5年)第130回	0.001	600,000	600,126	2021/5/28
京都府	公募平成20年度第3回	1.57	140,000	144,439	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,660	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回	0.8	100,000	104,274	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	113,546	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	206,346	2024/9/19
兵庫県	公募平成20年度第3回	1.76	100,000	102,501	2018/5/22

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	公募平成20年度第12回	1.82	100,000	103,538	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回	1.6	100,000	103,353	2019/1/23
兵庫県	公募平成21年度第13回	1.48	100,000	103,811	2019/7/17
兵庫県	公募平成21年度第25回	1.54	100,000	104,505	2019/11/20
兵庫県	公募平成22年度第1回	1.46	100,000	104,834	2020/4/16
兵庫県	公募(30年)第2回	2.36	100,000	131,726	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第1回	1.66	300,000	342,096	2026/7/29
兵庫県	公募(15年)第3回	1.35	100,000	110,816	2027/7/16
兵庫県	公募(12年)第3回	0.56	300,000	309,855	2025/4/16
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	121,674	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	123,046	2029/11/19
兵庫県	公募(20年)第14回	1.72	100,000	117,399	2032/5/24
静岡県	公募平成21年度第2回	1.65	100,000	104,193	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回	1.54	100,000	104,602	2019/11/25
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	103,721	2023/3/22
静岡県	公募平成25年度第5回	0.926	101,000	106,536	2023/7/25
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	171,606	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	103,181	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	200,000	206,296	2024/10/24
静岡県	公募平成27年度第11回	0.11	115,400	114,768	2026/3/19
静岡県	公募平成28年度第2回	0.08	300,000	297,540	2026/3/19
静岡県	公募(20年)第11回	1.841	100,000	118,875	2030/10/18
静岡県	公募(20年)第14回	1.736	100,000	118,111	2032/6/18
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	210,000	216,171	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	119,950	2028/12/20
愛知県	公募平成20年度第10回	1.48	100,000	103,357	2019/3/27
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	114,000	118,864	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回	1.41	100,000	104,487	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回	1.364	100,000	104,689	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回	1.153	100,000	104,373	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回	1.006	100,000	104,931	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回	0.982	100,000	104,947	2022/4/27
愛知県	公募(20年)平成24年度第4回	1.687	100,000	117,388	2032/6/11
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	1.314	400,000	445,256	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	119,664	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	123,256	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	111,885	2034/11/14
愛知県	公募平成27年度第15回	0.471	100,000	102,740	2025/11/27
広島県	公募平成20年度第3回	1.6	300,000	308,463	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回	1.26	200,000	210,402	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	104,378	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	209,480	2023/9/25
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	0.21	300,000	301,377	2019/2/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	111,230	2025/1/27
埼玉県	公募平成19年度第7回	1.65	200,000	203,924	2018/2/27
埼玉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	102,083	2018/4/24
埼玉県	公募平成21年度第5回	1.41	100,000	103,942	2019/9/25
埼玉県	公募平成22年度第2回	1.37	200,000	209,406	2020/5/26

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	
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	100,000	104,350	2022/7/25
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	105,447	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	155,078	2023/9/27
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	0.261	100,000	100,477	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	103,908	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	103,815	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第3回	0.67	100,000	103,966	2024/5/20
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	206,210	2024/9/26
埼玉県	公募平成26年度第7回	0.476	400,000	410,488	2024/12/25
埼玉県	公募平成26年度第9回	0.429	100,000	102,256	2025/2/25
福岡県	公募平成20年度第3回	1.59	100,000	102,387	2018/6/20
福岡県	公募平成22年度第5回	0.94	100,000	103,636	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	104,969	2021/10/25
福岡県	公募平成24年度第10回	0.18	100,000	100,194	2018/1/29
福岡県	公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,373	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	112,417	2026/11/27
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	134,396	2037/9/18
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	1.827	100,000	123,551	2044/6/20
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	2.05	100,000	120,066	2028/12/20
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	1.635	100,000	116,559	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	102,087	2018/4/25
千葉県	公募平成20年度第6回	1.64	200,000	206,062	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第1回	1.53	100,000	103,592	2019/4/25
千葉県	公募平成21年度第11回	1.42	180,000	187,920	2020/1/24
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,305	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	104,600	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	104,665	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第2回	0.26	900,000	903,330	2018/5/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	105,211	2023/6/23
千葉県	公募平成25年度第4回	0.92	100,000	105,443	2023/7/25
千葉県	公募(20年)第8回	2.18	100,000	122,998	2030/4/19
千葉県	公募(20年)第17回	1.403	100,000	112,656	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	200,000	206,674	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回	1.55	150,000	156,978	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回	0.24	1,100,000	1,105,313	2018/12/25
群馬県	公募第8回	1.03	100,000	105,104	2021/11/25
群馬県	公募第12回	0.519	100,000	103,108	2025/8/15
群馬県	公募(5年)第4回	0.235	600,000	602,700	2018/11/22
群馬県	公募(20年)第3回	1.687	100,000	117,423	2032/6/25
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	192,477	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第58回	1.59	270,500	275,222	2018/1/25
共同発行市場地方債	公募第62回	1.74	100,000	102,495	2018/5/25
共同発行市場地方債	公募第63回	1.88	200,000	205,730	2018/6/25
共同発行市場地方債	公募第64回	1.78	262,000	269,440	2018/7/25
共同発行市場地方債	公募第65回	1.62	700,000	718,998	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	185,944	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	929,277	2018/11/22
共同発行市場地方債	公募第70回	1.42	110,000	113,281	2019/1/25

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74回	1.57	500,000	519,055	2019/5/24
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	323,119	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	313,200	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	522,455	2020/3/25
共同発行市場地方債	公募第85回	1.44	100,000	104,759	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	104,208	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	103,840	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	114,459	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	315,138	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	315,291	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	105,456	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第101回	1.05	300,000	314,814	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	157,395	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	104,873	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	210,022	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	208,982	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	209,118	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	200,000	207,980	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	104,282	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	208,626	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	104,633	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	208,876	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	311,211	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	103,062	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	400,000	413,684	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	105,377	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	104,807	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	311,442	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	104,553	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	103,850	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	207,020	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	206,362	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	159,761	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	553,008	2025/2/25
共同発行市場地方債	公募第145回	0.406	500,000	510,340	2025/4/25
共同発行市場地方債	公募第156回	0.1	100,000	99,361	2026/3/25
共同発行市場地方債	公募第157回	0.08	100,000	99,172	2026/4/24
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	120,674	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	119,321	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	104,248	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	703,304	2019/3/25
福島県	公募平成24年度第2回	0.17	100,000	100,195	2018/2/26
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	205,476	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,752	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	145,887	2024/11/28
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	103,752	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	243,180	2023/12/26
浜松市	公募平成26年度第1回	0.335	100,000	101,479	2025/1/23

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20年度第3回	1.82	110,000	113,183	2018/7/23
大阪市	公募平成21年度第6回	1.57	100,000	104,617	2019/11/25
大阪市	公募平成25年度第1回	0.401	800,000	804,560	2018/5/23
大阪市	公募平成25年度第6回	0.694	100,000	104,080	2023/11/22
大阪市	公募平成26年度第5回	0.593	100,000	103,407	2024/9/27
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	114,969	2026/7/17
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	124,642	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	121,987	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	100,000	117,913	2032/12/21
名古屋市	公募第464回	1.61	300,000	308,442	2018/9/20
名古屋市	公募第469回	1.34	100,000	104,023	2019/12/20
名古屋市	公募第478回	1.063	100,000	105,270	2022/3/18
名古屋市	公募第488回	0.598	300,000	310,302	2024/9/20
名古屋市	公募(6年)第1回	0.283	200,000	200,848	2018/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	214,734	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	106,542	2029/11/16
京都市	公募平成19年度第4回	1.62	190,000	193,649	2018/2/26
京都市	公募平成20年度第4回	1.54	200,000	206,742	2019/2/26
京都市	公募平成23年度第4回	1.067	100,000	105,105	2021/12/22
京都市	公募平成25年度第3回	0.312	100,000	100,544	2018/9/27
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	117,015	2025/9/19
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	111,837	2034/11/24
神戸市	公募平成21年度第7回	1.69	100,000	104,324	2019/6/20
神戸市	公募平成26年度第17回	0.28	300,000	303,123	2025/1/27
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	198,346	2026/4/17
横浜市	公募平成20年度第3回	1.56	100,000	102,673	2018/9/7
横浜市	公募公債平成20年度5回	1.58	200,000	206,328	2018/12/20
横浜市	公募平成21年度第4回	1.35	200,000	207,690	2019/9/20
横浜市	公募平成22年度第5回	1.265	100,000	105,028	2020/12/11
横浜市	公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	208,706	2022/10/17
横浜市	公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	207,386	2023/5/19
横浜市	公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	207,610	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	205,138	2024/12/13
横浜市	公募(20年)第26回	1.776	100,000	118,841	2033/1/28
横浜市	公募(20年)第30回	1.376	100,000	112,144	2034/10/20
札幌市	公募平成22年度第4回	1.05	100,000	103,673	2020/6/19
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	1.794	100,000	119,113	2033/2/28
札幌市	公募平成26年度第4回	0.54	100,000	103,007	2024/6/20
札幌市	公募平成26年度第9回	0.43	200,000	204,508	2024/12/20
川崎市	公募第81回	1.57	100,000	103,531	2019/3/20
川崎市	公募第82回	1.52	100,000	104,301	2019/9/20
川崎市	公募第85回	0.72	100,000	103,884	2022/12/20
川崎市	公募(20年)第17回	1.527	100,000	114,935	2033/5/9
北九州市	公募(5年)平成25年度第2回	0.312	100,000	100,544	2018/9/27
北九州市	公募(20年)第14回	1.732	100,000	118,052	2032/11/12
福岡市	公募平成20年度第3回	1.52	100,000	102,282	2018/6/20
福岡市	公募(5年)平成25年度第2回	0.35	300,000	301,671	2018/7/25
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	114,175	2034/6/20

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	
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	103,037	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	164,112	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	104,042	2019/12/25
広島市	公募平成26年度第2回	0.456	100,000	102,464	2024/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	603,036	2019/1/29
千葉市	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,305	2022/4/25
鹿児島県	公募(5年)平成25年度第1回	0.24	100,000	100,443	2018/10/31
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	102,368	2023/4/26
福井県	公募平成27年度第4回	0.085	200,000	198,434	2026/4/27
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	416,560	2020/11/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	104,052	2019/10/30
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	104,529	2020/3/31
愛知県・名古屋市	折半保証名古屋高速道路債券 第96回	2.34	100,000	121,661	2028/12/20
愛知県・名古屋市	折半保証名古屋高速道路債券 第102回	2.298	300,000	366,723	2029/12/20
福岡北九州	高速道路債券 第117回	2.26	100,000	120,269	2028/12/20
小	計		47,636,420	50,111,119	
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	211,508	2020/7/15
公営企業債券	政府保証第881回	1.5	200,000	203,296	2018/1/23
公営企業債券	政府保証第886回	1.8	203,000	208,505	2018/6/19
公営企業債券	政府保証15年第1回	1.6	300,000	316,938	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	412,284	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	206,848	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	103,792	2020/9/14
政保	地方公共団体金融機構債券(6年) 第4回	0.4	500,000	502,555	2018/3/26
政保	地方公共団体金融機構債券 第38回	0.839	194,000	203,176	2022/7/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	104,587	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第40回	0.819	101,000	105,809	2022/9/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第41回	0.791	102,000	106,764	2022/10/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第42回	0.805	108,000	113,198	2022/11/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第43回	0.734	202,000	210,881	2022/12/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第44回	0.834	102,000	107,004	2023/1/20
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	223,000	233,795	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	105,705	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	303,072	2019/7/24
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	120,965	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	302,190	2020/6/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第64回	0.544	100,000	103,414	2024/9/13
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	413,680	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	300,000	307,626	2025/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	195,374	2025/5/23
政保	地方公共団体金融機構債券 第78回	0.381	509,000	521,175	2025/11/18
日本政策金融公庫債券	政府保証第22回	0.243	2,000,000	2,009,240	2018/10/26
新関西国際空港債券	政府保証第1回	0.801	151,000	157,973	2022/8/29
新関西国際空港債券	政府保証第2回	0.882	191,000	201,524	2023/6/27
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	2,103,738	2018/5/23
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	114,038	2023/6/19
日本政策投資銀行社債	政府保証第5回	1.4	100,000	103,271	2019/4/15

銘柄	利	当 期		末	
		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	
日本政策投資銀行社債 政府保証第9回	1.0	141,000	146,346	2020/9/14	
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	0.819	102,000	106,866	2022/9/20	
日本政策投資銀行社債 政府保証第19回	0.668	140,000	145,560	2023/3/15	
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	108,002	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	108,151	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56回	1.4	205,000	208,841	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	139,353	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	290,810	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	102,755	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	351,219	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	103,124	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	102,843	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	244,518	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	244,650	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	312,255	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	246,866	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	418,024	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	244,834	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	239,970	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	128,553	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	464,217	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	147,033	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	104,672	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	146,627	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	123,569	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	104,763	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	117,093	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	228,078	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	115,928	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	377,490	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	209,588	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	209,400	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	208,586	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	419,704	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	118,546	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	202,289	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	414,664	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	211,034	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	286,350	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	313,272	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	142,773	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	150,978	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	114,409	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217回	1.72	100,000	122,339	2044/5/31	
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	114,307	2034/5/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	0.644	100,000	104,171	2024/6/28	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第224回	1.72	100,000	122,510	2044/8/31	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	0.556	190,000	196,650	2024/8/30	

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	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第234回	0.466	100,000	102,953	2024/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第239回	1.16	300,000	326,973	2035/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第271回	0.02	151,000	149,613	2026/3/31
首都高速道路債券	政府保証第8回	1.3	100,000	104,046	2020/1/20
阪神高速道路債券	政府保証第5回	1.3	100,000	104,251	2020/3/18
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	120,000	125,216	2023/10/20
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	368,000	382,657	2023/3/22
預金保険機構債券	政府保証第209回	0.1	2,000,000	2,008,780	2020/12/11
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	108,356	2029/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第26回	0.573	100,000	101,433	2019/6/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第31回	0.781	300,000	312,846	2022/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	107,870	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	133,185	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	241,512	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17回	2.35	100,000	120,788	2026/9/18
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	243,502	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	298,704	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	102,807	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	123,221	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	124,474	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80回	1.08	100,000	105,243	2021/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第84回	1.01	400,000	420,412	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86回	0.934	200,000	209,410	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	117,411	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	103,837	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103回	1.69	350,000	410,081	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105回	1.853	100,000	119,692	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	301,380	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	206,310	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	205,850	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136回	0.583	200,000	206,636	2024/9/20
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	341,736	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	115,940	2045/3/17
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第173回	0.652	100,000	86,061	2056/3/17
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	137,370	2034/6/20
公営企業債券	30年第4回財投機関債	2.95	100,000	137,856	2034/3/24
地方公営企業等金融機構債券	第1回	1.77	200,000	206,242	2018/9/25
地方公営企業等金融機構債券	(20年) 第1回	2.07	100,000	120,019	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券	第1回	1.648	100,000	104,158	2019/6/28
地方公共団体金融機構債券	第2回	1.406	100,000	103,655	2019/7/26
地方公共団体金融機構債券	20年第4回	2.12	100,000	121,586	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券	20年第6回	2.242	300,000	370,353	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券	F24回	1.681	100,000	110,148	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券	第13回	1.278	200,000	208,960	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券	第16回	1.164	100,000	104,400	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券	第27回	1.034	300,000	314,391	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券	第28回	1.048	100,000	104,954	2021/9/28
地方公共団体金融機構債券	F104回	1.314	100,000	109,311	2025/3/7

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	
地方公共団体金融機構債券	F 106回	1.259	100,000	108,142	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券	第37回	0.852	400,000	418,012	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券	第41回	0.801	600,000	626,862	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券	F 142回	1.016	100,000	106,829	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券	F 144回	0.562	200,000	204,322	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券	F 145回	1.059	200,000	214,546	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	104,541	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	104,529	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F 160回	1.052	100,000	108,013	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	300,000	315,822	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	315,237	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	218,840	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	113,847	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	103,260	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	112,802	2034/9/28
地方公共団体金融機構債券	第79回	0.484	100,000	102,698	2025/12/26
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債		1.45	100,000	108,410	2022/12/20
公営企業債券(20年) 第5回財投機関債		2.11	200,000	227,730	2023/9/20
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債		2.5	100,000	124,321	2028/6/20
首都高速道路債 第12回		0.293	100,000	100,586	2018/12/20
阪神高速道路 第13回		0.18	100,000	100,495	2019/9/20
中小企業債券 第6回財投機関債		0.79	100,000	100,980	2018/3/20
都市再生債券 財投機関債第21回		1.72	300,000	309,027	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第55回		1.074	100,000	105,045	2021/9/17
都市再生債券 財投機関債第97回		1.017	100,000	107,748	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回		2.26	100,000	117,564	2025/6/20
東京交通債券 第342回		2.4	200,000	223,830	2022/6/21
東京交通債券 第347回		2.05	157,000	176,643	2024/3/8
関西国際空港社債 財投機関債第26回		1.156	300,000	313,038	2020/9/18
関西国際空港社債 財投機関債第32回		1.164	100,000	105,473	2021/9/17
福祉医療機構債券 第31回財投機関債		0.93	100,000	104,913	2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回		2.26	200,000	240,764	2017/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回		1.86	200,000	204,636	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	114,134	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	310,032	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	104,489	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	114,487	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	120,080	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	105,597	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	122,056	2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回		1.751	300,000	344,013	2026/6/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回		2.056	100,000	121,944	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	105,022	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	209,824	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	227,456	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	130,311	2042/9/19
成田国際空港 第13回一般担保付		0.802	200,000	209,232	2023/2/8
成田国際空港 第17回		0.489	200,000	204,318	2025/2/20

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	
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回	1.208	100,000	105,382	2021/6/18
国際協力機構債券 第6回財投機関債	2.098	100,000	122,126	2030/12/13
東日本高速道路 第21回	0.58	100,000	100,870	2018/6/20
東日本高速道路 第26回	0.305	100,000	100,762	2019/6/20
東日本高速道路 第27回	0.248	100,000	100,620	2019/6/20
中日本高速道路社債 第32回	0.64	200,000	202,226	2018/9/20
中日本高速道路社債 第44回	0.536	100,000	101,475	2019/9/20
中日本高速道路社債 第47回	0.277	100,000	100,339	2018/3/20
中日本高速道路 第62回	0.225	100,000	100,848	2020/9/18
中日本高速道路 第63回	0.576	100,000	103,018	2025/11/13
西日本高速道路 第20回	0.759	200,000	209,544	2023/9/20
西日本高速道路 第23回	0.602	100,000	103,084	2024/6/20
西日本高速道路 第30回	0.17	300,000	298,065	2026/5/22
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	208,790	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68回	0.586	200,000	206,652	2024/8/5
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	113,129	2034/8/4
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券	1.94	13,872	14,341	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券	1.69	47,511	49,103	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券	1.8	85,090	88,497	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券	1.43	86,502	88,623	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券	1.76	53,982	56,500	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券	2.34	64,995	69,529	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券	2.25	18,931	20,175	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券	1.84	43,822	46,016	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券	1.93	48,480	51,376	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券	1.69	52,692	54,783	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券	1.69	96,004	100,352	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券	2.12	90,790	95,568	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券	2.3	84,124	90,124	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券	1.99	48,636	51,581	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券	2.14	24,023	25,540	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券	2.28	34,629	37,566	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券	1.98	117,795	126,415	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	29,899	31,068	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	1.43	124,686	131,013	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	61,180	63,731	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	1.79	163,125	173,992	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	1.51	117,438	123,953	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	2.34	65,116	70,672	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	1.89	156,132	167,326	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	1.36	164,604	171,986	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	1.21	207,588	216,512	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	1.34	204,672	214,592	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	1.26	134,308	140,429	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	1.64	55,820	59,236	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	1.6	123,594	130,951	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	1.07	70,250	72,899	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	1.07	147,376	152,999	2049/2/10

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72回住宅金融支援機構債券		1.08	70,199	72,847	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	36,830	38,499	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	206,712	216,448	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	43,342	46,294	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	44,948	47,983	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	46,667	49,736	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	54,957	58,775	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	134,710	141,780	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	196,137	206,477	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	65,954	69,490	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	132,340	138,307	2048/9/10
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券		1.82	17,776	18,633	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	137,045	142,163	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	55,540	57,536	2032/5/10
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券		1.75	23,472	23,911	2036/3/10
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券		1.82	49,984	51,160	2037/8/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券		1.52	259,235	272,616	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券		1.4	135,588	142,607	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券		1.16	216,627	225,383	2047/9/10
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券		1.07	203,685	211,225	2048/4/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券		1.3	148,746	156,412	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券		1.26	132,426	138,781	2048/8/10
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券		1.04	306,692	317,849	2049/4/10
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券		1.01	536,368	555,006	2049/5/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券		0.93	79,347	81,710	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券		0.95	81,118	83,644	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券		0.87	81,684	83,823	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券		0.74	168,228	171,582	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券		0.6	172,144	173,896	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券		0.8	88,048	90,171	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券		0.74	90,373	92,199	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券		0.83	268,845	275,934	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券		0.9	273,366	281,878	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券		0.88	182,704	188,102	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券		0.84	91,568	93,999	2050/9/10
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券		0.89	92,423	95,210	2050/10/10
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券		0.41	300,000	298,728	2051/12/10
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券		0.48	200,000	200,378	2052/1/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)		0.725	100,000	101,998	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)		0.69	100,000	100,584	2019/1/29
小	計		47,326,494	50,195,776	
金融債券					
商工債券	利付第753回い号	0.25	100,000	100,285	2018/2/27
農林債券	利付第752回い号	0.3	100,000	100,320	2018/1/26
農林債券	利付第756回い号	0.3	100,000	100,419	2018/5/25
農林債券	利付第759回い号	0.4	100,000	100,660	2018/8/27
農林債券	利付第760回い号	0.4	100,000	100,692	2018/9/27
農林債券	利付第761回い号	0.3	100,000	100,540	2018/10/26

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764回い号	0.35	100,000	100,703	2019/1/25
農林債券	利付第765回い号	0.3	300,000	301,872	2019/2/27
農林債券	利付第767回い号	0.3	300,000	302,007	2019/4/26
農林債券	利付第773回い号	0.24	300,000	301,878	2019/10/25
農林債券	利付第777回い号	0.25	300,000	302,106	2020/2/27
農林債券	利付第781回い号	0.28	100,000	100,844	2020/6/26
しんきん中金債券	利付第284回	0.4	100,000	100,630	2018/7/27
しんきん中金債券	利付第286回	0.35	100,000	100,603	2018/9/27
しんきん中金債券	利付第287回	0.3	100,000	100,540	2018/10/26
しんきん中金債券	利付第290回	0.3	100,000	100,598	2019/1/25
しんきん中金債券	利付第302回	0.2	100,000	100,528	2020/1/27
しんきん中金債券	利付第308回	0.25	100,000	100,744	2020/7/27
商工債券	利付(3年)第181回	0.15	500,000	500,830	2018/2/27
商工債券	利付(3年)第182回	0.14	100,000	100,164	2018/3/27
小	計		3,200,000	3,216,963	
普通社債券(含む投資法人債券)					
東京電力	第455回	2.075	200,000	206,592	2018/10/23
東京電力	第459回	2.7	100,000	105,026	2019/1/29
東京電力	第542回	1.602	100,000	101,845	2018/4/25
東京電力	第544回	1.976	100,000	102,612	2018/6/25
東京電力	第547回	1.948	100,000	105,473	2020/7/24
東京電力	第548回	2.347	100,000	113,714	2028/9/29
東京電力	第559回	1.377	100,000	102,893	2019/10/29
東京電力	第560回	2.114	100,000	111,445	2029/12/10
東京電力	第565回	1.313	300,000	309,435	2020/6/24
中部電力	第482回	2.17	200,000	210,174	2019/6/25
中部電力	第500回	0.875	200,000	207,750	2024/5/24
関西電力	第448回	2.16	200,000	206,130	2018/6/20
関西電力	第469回	1.7	100,000	102,852	2018/10/25
関西電力	第482回	1.189	100,000	103,351	2020/7/24
関西電力	第484回	0.976	100,000	102,756	2020/10/23
関西電力	第496回	0.908	100,000	103,738	2025/2/25
関西電力	第497回	1.002	200,000	209,210	2025/6/20
関西電力	第498回	0.416	200,000	201,230	2020/9/18
中国電力	第314回	2.875	100,000	103,793	2018/4/25
中国電力	第330回	2.1	100,000	107,872	2021/3/25
中国電力	第377回	1.121	200,000	210,756	2023/8/25
中国電力	第378回	1.004	100,000	104,687	2023/10/25
北陸電力	第301回	1.158	100,000	105,434	2023/3/24
北陸電力	第304回	0.989	100,000	104,586	2023/10/25
北陸電力	第307回	1.055	100,000	106,296	2026/6/25
北陸電力	第308回	0.769	100,000	103,092	2024/9/25
東北電力	第431回	2.05	400,000	409,920	2018/3/23
東北電力	第473回	0.597	100,000	101,411	2021/4/23
東北電力	第475回	0.809	100,000	103,044	2024/9/25
東北電力	第481回	0.803	200,000	206,526	2025/7/25
四国電力	第281回	1.111	200,000	211,036	2023/9/25
九州電力	第400回	1.777	100,000	105,118	2020/4/24

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409回	1.483	100,000	103,429	2019/8/23
九州電力 第420回	0.82	300,000	302,913	2018/4/25
九州電力 第424回	1.233	200,000	211,582	2023/11/24
北海道電力 第296回	2.027	100,000	102,922	2018/6/25
北海道電力 第316回	1.164	207,000	213,667	2020/6/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	109,054	2030/3/25
北海道電力 第338回	0.84	100,000	97,815	2036/11/25
新日本製鐵 第67回社債間限定同順位特約付	1.293	100,000	104,372	2021/3/19
清水建設 第18回社債間限定同順位特約付	0.947	100,000	101,765	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	100,626	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	103,102	2024/5/8
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	100,179	2020/5/28
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	100,387	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	203,380	2025/2/28
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	102,503	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	101,865	2025/5/30
森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	0.34	200,000	197,028	2026/8/28
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	0.466	100,000	100,579	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	102,234	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	102,813	2018/6/20
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	0.451	100,000	100,928	2021/9/3
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	1.58	100,000	104,530	2020/4/23
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	0.302	100,000	100,149	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	99,953	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	202,224	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	100,325	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	101,334	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	101,576	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	103,607	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	102,855	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	100,571	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	200,402	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	102,292	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	100,212	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	98,798	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	99,407	2025/5/21
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	101,250	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	100,271	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	100,361	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	217,360	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	100,776	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	103,678	2022/9/20
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	101,602	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	104,187	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	200,978	2020/3/19
パナソニック 第16回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	99,539	2023/9/20
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	0.47	100,000	99,622	2026/9/18
ソニー 第26回	2.068	100,000	104,610	2019/6/20

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	
ソニー 第32回		0.28	200,000	198,420	2023/9/20
三菱重工業 第26回社債間限定同順位特約付		0.877	100,000	103,658	2023/9/4
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	300,930	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	200,902	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	104,644	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	101,767	2025/2/26
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付		0.652	100,000	101,705	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	104,311	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	208,960	2021/6/4
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付		0.436	100,000	99,750	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	104,048	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	206,666	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	106,931	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	103,175	2022/4/20
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付		1.286	100,000	105,043	2029/1/29
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無		1.657	100,000	103,872	2019/7/29
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付		0.451	200,000	201,176	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	100,190	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	201,144	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	101,639	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	101,455	2024/6/18
イオン 第16回社債間限定同順位特約付		1.01	100,000	101,424	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	102,483	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	204,082	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	123,320	2027/7/27
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	300,846	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	105,526	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	108,483	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	112,077	2022/10/27
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	103,771	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	501,255	2018/1/23
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	304,956	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	102,033	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	106,096	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	106,239	2019/6/20
りそな銀行 第6回劣後特約付		2.084	300,000	316,941	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付		1.68	100,000	105,924	2021/4/28
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付		1.389	300,000	316,323	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	100,571	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	103,656	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	102,042	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	204,330	2024/7/16
三井住友銀行 第24回劣後特約付		1.6	100,000	105,722	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	100,544	2019/1/25
みずほ銀行 第38回特定社債間限定同順位特約付		0.24	1,000,000	1,005,980	2019/10/30
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付		0.36	100,000	100,371	2019/5/23
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付		0.25	100,000	100,272	2019/6/20
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	100,393	2018/9/20

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	
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	100,246	2019/6/20
ジャックス	第12回社債間限定同順位特約付	0.545	100,000	99,899	2021/12/3
オリエントコーポレーション	第2回社債間限定同順位特約付	0.45	200,000	200,118	2020/1/22
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	100,735	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	99,884	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	101,164	2024/12/20
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	102,301	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	100,556	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	100,076	2020/5/28
三菱UFJリース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	100,482	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	100,473	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	100,408	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	102,201	2025/8/12
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	105,311	2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	202,004	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	101,911	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	104,230	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	111,169	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	103,122	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	100,910	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	103,167	2022/9/14
東京建物	第17回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	102,914	2020/3/18
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	102,989	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	204,714	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	101,655	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	102,730	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	103,954	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	100,684	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	101,285	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	215,564	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	103,888	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	109,181	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	213,374	2030/6/12
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	109,288	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	222,700	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	206,828	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	119,724	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	111,765	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	121,199	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	105,302	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	104,916	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	246,844	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	111,657	2032/9/30
東海旅客鉄道	第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	118,429	2045/3/6
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	103,455	2027/4/30
日本通運	第11回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	98,196	2026/7/14
日本通運	第12回社債間限定同順位特約付	0.7	100,000	94,975	2036/7/14
ANAホールディングス	第32回社債間限定同順位特約付	0.99	100,000	96,725	2036/6/9

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	
三菱倉庫 第14回		0.442	100,000	100,814	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	200,524	2019/3/14
日本電信電話 第60回		1.31	100,000	104,443	2020/12/18
KDDI 第20回社債間限定同順位特約付		0.803	100,000	102,746	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	102,859	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	103,462	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	103,573	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	104,052	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	103,826	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	103,072	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	103,845	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	123,925	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	103,193	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	109,453	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	201,344	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	100,737	2022/12/16
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	101,106	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	199,368	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	193,670	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	99,206	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	96,233	2025/6/5
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円		0.842	100,000	99,453	2023/9/26
エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円		1.207	100,000	100,302	2026/9/25
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	107,598	2021/2/16
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	99,434	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	199,906	2020/1/16
ラボバンク・ネダーランド 第23回円貨社債(2013)(コー		0.557	100,000	100,415	2018/12/19
ラボバンク・ネダーランド 第25回円貨社債(2014)(コー		0.434	100,000	100,164	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)		0.552	200,000	200,762	2019/6/13
小 計			27,407,000	28,256,242	
合 計			615,834,914	670,263,402	

*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3期（決算日2016年11月28日）

作成対象期間（2015年12月1日～2016年11月28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。
主な投資対象	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。
主な投資制限	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。
	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	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
3期(2016年11月28日)	12,319	△ 5.2	18,357	△ 7.0	94.5	5.5	37,454

*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

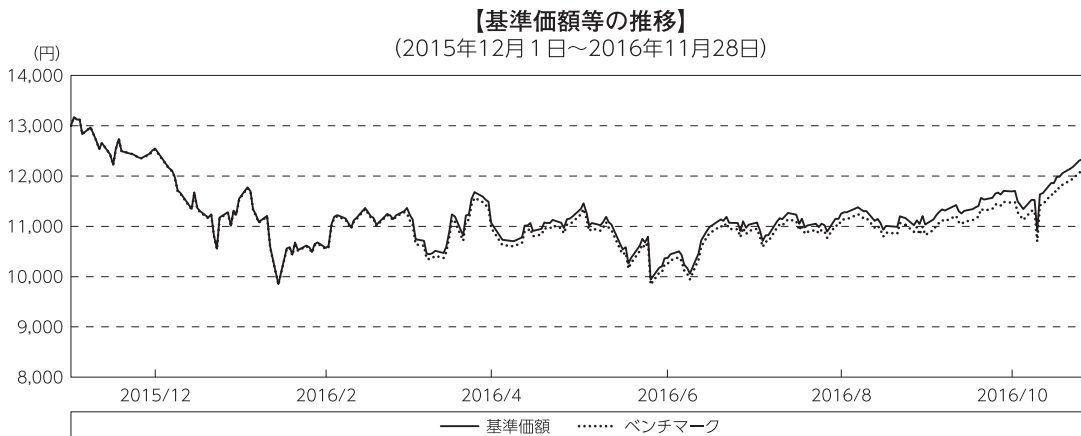
年月日	基準価額		ベンチマーク		株組入比率	株先物比率
	騰落	率	日経平均株価	騰落率		
(期首) 2015年11月30日	円 12,999	% —	円 19,747	% —	% 90.4	% 9.6
12月末	12,546	△ 3.5	19,034	△ 3.6	89.4	10.6
2016年1月末	11,551	△11.1	17,518	△11.3	96.1	4.1
2月末	10,569	△18.7	16,027	△18.8	96.0	4.0
3月末	11,138	△14.3	16,759	△15.1	97.2	2.8
4月末	11,072	△14.8	16,666	△15.6	95.0	5.0
5月末	11,458	△11.9	17,235	△12.7	95.6	4.3
6月末	10,371	△20.2	15,576	△21.1	97.7	2.3
7月末	11,033	△15.1	16,569	△16.1	98.1	2.3
8月末	11,253	△13.4	16,887	△14.5	97.0	3.0
9月末	11,038	△15.1	16,450	△16.7	96.0	3.9
10月末	11,693	△10.0	17,425	△11.8	96.3	3.7
(期末) 2016年11月28日	12,319	△ 5.2	18,357	△ 7.0	94.5	5.5

*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12,999円から期末12,319円に680円の値下がりとなりました。

国内株式の株価の変動。

○投資環境

2015年12月の日銀金融政策決定会合の内容が金融緩和への手詰まり感の表れと受け取られたことや、中国経済への懸念が再び高まったこと、原油価格下落などを背景とした世界的な株安、為替が円高に進行したことなどをを受けて、国内株式市場は下落しました。

2016年1月の日銀金融政策決定会合においてマイナス金利導入などの追加金融緩和を決定したことから、株式市場は上昇しましたが、その後、原油価格が乱高下したことや米国景気の鈍化傾向の高まりなどから円高米ドル安が進み国内株式市場は下落しました。

6月には英国のEU（欧州連合）離脱を問う国民投票にて、離脱派の勝利が決定したことを受け、リスク回避の動きが鮮明となったことから国内株式市場は下落しました。

7月には米国株式市場が過去最高値を更新したことや参議院議員選挙での与党勝利を受けて政府による大規模な景気対策への期待が高まったことなどから、国内株式市場は上昇しました。

11月には米国大統領選挙において、大方の市場予想に反し共和党のトランプ氏の当選が濃厚となるとリスク回避の動きが強まり、外国為替市場では円高米ドル安が進行、国内株式市場は下落しました。その後は、トランプ氏の政策期待の高まりなどから米国株式市場が過去最高値を更新、外国為替市場では円安米ドル高が進行、国内株式市場も上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・株式組入比率

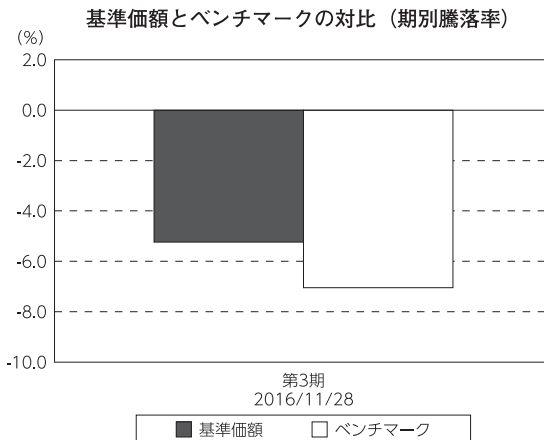
日経平均株価に連動する投資成果を目指し、先物を含む実質の株式組入比率は期を通じて概ね高位を維持しました。

○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-5.2%となり、ベンチマークである日経平均株価の-7.0%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

(2015年12月1日～2016年11月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(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	0.002	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.002)	
期中の平均基準価額は、11,393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

(2015年12月1日～2016年11月28日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 4,751 (△1,060)	千円 10,465,189 ()	千株 10,496	千円 21,404,541

*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 内	株式先物取引	百万円 16,575	百万円 19,290	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

○株式売買比率

(2015年12月1日～2016年11月28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	31,869,731千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	39,331,722千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.81

* (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

(2015年12月1日～2016年11月28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 10,465	百万円 10	0.1	百万円 21,404	百万円 32	0.1
預金	30,841	30,841	100.0	30,841	30,841	100.0

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 未 保 有 額
株式	百万円 12	百万円 26	百万円 45

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)	997千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9千円
(B) / (A)	0.9%

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、野村信託銀行です。

(2016年11月28日現在)

○組入資産の明細

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.2%)			
日本水産	102	74	37,296
マルハニチロ	10.2	7.4	20,949
鉱業 (0.1%)			
国際石油開発帝石	40.8	29.6	32,204
建設業 (2.9%)			
コムシスホールディングス	102	74	144,596
大成建設	102	74	59,644
大林組	102	74	79,846
清水建設	102	74	75,998
長谷工コーポレーション	20.4	14.8	17,390
鹿島建設	102	74	58,164
大和ハウス工業	102	74	239,760
積水ハウス	102	74	138,084
日揮	102	74	146,520
千代田化工建設	102	74	63,714
食料品 (5.1%)			
日清製粉グループ本社	102	74	118,918
明治ホールディングス	20.4	14.8	134,680
日本ハム	102	74	214,082
サッポロホールディングス	102	14.8	45,066
アサヒグループホールディングス	102	74	275,650
キリンホールディングス	102	74	135,494
宝ホールディングス	102	74	77,626
キッコーマン	102	74	256,410
味の素	102	74	162,282
ニチレイ	102	37	82,140
日本たばこ産業	102	74	289,414
繊維製品 (0.3%)			
東洋紡	102	74	12,728
ユニチカ	102	74	6,290
帝人	102	14.8	31,094
東レ	102	74	69,352
パルプ・紙 (0.3%)			
王子ホールディングス	102	74	35,298

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本製紙	10.2	7.4	14,629
北越紀州製紙	102	74	48,618
化学 (8.3%)			
クラレ	102	74	117,882
旭化成	102	74	74,518
昭和電工	102	7.4	11,344
住友化学	102	74	38,998
日産化学工業	102	74	283,420
日本曹達	102	—	—
東ソー	102	74	56,240
トクヤマ	102	74	33,300
デンカ	102	74	37,148
信越化学工業	102	74	604,580
三井化学	102	74	37,666
三菱ケミカルホールディングス	51	37	26,469
宇部興産	102	74	17,316
日本化薬	102	74	97,902
花王	102	74	379,990
富士フイルムホールディングス	102	74	317,164
資生堂	102	74	215,155
日東電工	102	74	588,670
医薬品 (7.1%)			
協和発酵キリン	102	74	124,098
武田薬品工業	102	74	350,908
アステラス製薬	510	370	581,825
大日本住友製薬	102	74	136,678
塩野義製薬	102	74	399,452
中外製薬	102	74	239,390
エーザイ	102	74	492,692
第一三共	102	74	176,490
石油・石炭製品 (0.3%)			
昭和シェル石油	102	74	75,998
JXホールディングス	102	74	32,863
ゴム製品 (1.1%)			
横浜ゴム	51	37	76,627

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブリヂストン	102	74	321,826
ガラス・土石製品 (1.5%)			
旭硝子	102	74	52,910
日本板硝子	102	7.4	6,016
日本電気硝子	153	111	66,267
住友大阪セメント	102	74	29,526
太平洋セメント	102	74	25,826
東海カーボン	102	74	28,194
TOTO	51	37	167,425
日本碍子	102	74	163,466
鉄鋼 (0.2%)			
新日鐵住金	10.2	7.4	18,866
神戸製鋼所	102	7.4	8,428
ジェイ エフ イー ホールディングス	10.2	7.4	13,160
日新製鋼	10.2	7.4	11,092
大太平洋金属	102	74	28,934
非鉄金属 (1.4%)			
日本軽金属ホールディングス	102	74	18,500
三井金属鉱業	102	74	19,610
東邦亜鉛	102	74	32,782
三菱マテリアル	102	7.4	25,789
住友金属鉱山	102	74	117,993
DOWAホールディングス	102	74	65,638
古河機械金属	102	74	15,466
古河電気工業	102	7.4	24,901
住友電気工業	102	74	120,361
フジクラ	102	74	46,472
金属製品 (0.5%)			
SUMCO	10.2	7.4	9,398
東洋製罐グループホールディングス	102	74	164,798
機械 (5.4%)			
日本製鋼所	102	14.8	30,680
オークマ	102	74	74,518
アマダホールディングス	102	74	93,240
小松製作所	102	74	192,881
住友重機械工業	102	74	51,282
日立建機	102	74	174,936
クボタ	102	74	127,058
荏原製作所	102	14.8	45,214
ダイキン工業	102	74	789,950

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	102	74	94,202
NTN	102	74	32,338
ジェイテクト	102	74	137,270
日立造船	20.4	14.8	9,072
三菱重工業	102	74	37,592
I H I	102	74	24,198
電気機器 (16.9%)			
日清紡ホールディングス	102	74	83,324
コニカミノルタ	102	74	79,698
ミネベア	102	74	85,174
日立製作所	102	74	45,702
東芝	102	74	31,006
三菱電機	102	74	119,066
富士電機	102	74	41,736
安川電機	102	74	131,942
明電舎	102	74	27,010
ジーエス・ユアサ コーポレーション	102	74	35,076
日本電気	102	74	22,126
富士通	102	74	48,662
沖電気工業	102	7.4	11,425
パナソニック	102	74	81,585
シャープ	102	—	—
ソニー	102	74	245,902
TDK	102	74	564,620
ミツミ電機	102	74	49,950
アルプス電気	102	74	213,120
パイオニア	102	74	17,094
横河電機	102	74	118,548
アドバンテス	204	148	229,400
カシオ計算機	102	74	109,298
ファナック	102	74	1,428,200
京セラ	204	148	806,600
太陽誘電	102	74	92,500
S C R E E Nホールディングス	102	14.8	100,788
キヤノン	153	111	357,309
リコー	102	74	68,376
東京エレクトロン	102	74	754,800
輸送用機器 (6.9%)			
デンソー	102	74	364,376
三井造船	102	74	12,210

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎重工業	102	74	27,232
日産自動車	102	74	79,698
いすゞ自動車	51	37	49,395
トヨタ自動車	102	74	492,322
日野自動車	102	74	87,468
三菱自動車工業	10.2	7.4	4,010
マツダ	20.4	14.8	27,498
本田技研工業	204	148	492,100
スズキ	102	74	273,356
富士重工業	102	74	344,766
ヤマハ発動機	—	74	196,248
精密機器 (3.1%)			
テルモ	204	148	609,020
ニコン	102	74	122,396
オリンパス	102	74	299,700
シチズン時計	102	74	51,948
その他製品 (1.2%)			
凸版印刷	102	74	77,404
大日本印刷	102	74	80,290
ヤマハ	102	74	252,340
電気・ガス業 (0.3%)			
東京電力ホールディングス	10.2	7.4	3,189
中部電力	10.2	7.4	11,984
関西電力	10.2	7.4	8,273
東京瓦斯	102	74	36,548
大阪瓦斯	102	74	31,982
陸運業 (2.3%)			
東武鉄道	102	74	40,256
東京急行電鉄	102	74	62,086
小田急電鉄	102	37	82,251
京王電鉄	102	74	68,228
京成電鉄	102	37	97,754
東日本旅客鉄道	10.2	7.4	73,067
西日本旅客鉄道	10.2	7.4	50,453
東海旅客鉄道	10.2	7.4	137,159
日本通運	102	74	44,030
ヤマトホールディングス	102	74	172,716
海運業 (0.2%)			
日本郵船	102	74	15,762
商船三井	102	74	21,756

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
川崎汽船	102	74	18,574
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	102	74	23,413
倉庫・運輸関連業 (0.3%)			
三菱倉庫	102	74	115,736
情報・通信業 (11.1%)			
ヤフー	40.8	29.6	12,491
トレンドマイクロ	102	74	302,660
スカパーJ S A Tホールディングス	10.2	7.4	3,929
日本電信電話	20.4	14.8	68,272
KDDI	612	444	1,318,902
NTTドコモ	10.2	7.4	19,547
東宝	10.2	7.4	24,087
エヌ・ティ・ティ・データ	102	74	417,360
コナミホールディングス	102	74	288,970
ソフトバンクグループ	306	222	1,487,844
卸売業 (2.2%)			
双日	10.2	7.4	2,131
伊藤忠商事	102	74	116,439
丸紅	102	74	47,071
豊田通商	102	74	209,272
三井物産	102	74	114,922
住友商事	102	74	100,751
三菱商事	102	74	184,038
小売業 (12.4%)			
J. フロント リテイリング	51	37	61,346
三越伊勢丹ホールディングス	102	74	95,016
セブン&アイ・ホールディングス	102	74	332,778
ユニー・ファミリーマートホールディングス	—	74	540,940
高島屋	102	74	70,448
丸井グループ	102	74	115,736
イオン	102	74	117,216
ユニーグループ・ホールディングス	102	—	—
ファーストリテイリング	102	74	3,053,240
銀行業 (1.0%)			
コンソルディア・フィナンシャルグループ	—	74	38,258
新生銀行	102	74	13,764
あおぞら銀行	102	74	29,008
三菱UFJフィナンシャル・グループ	102	74	49,676
りそなホールディングス	10.2	7.4	4,053

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井住友トラスト・ホールディングス	102	7.4	31,117
三井住友フィナンシャルグループ	10.2	7.4	31,435
千葉銀行	102	74	50,912
横浜銀行	102	—	—
ふくおかフィナンシャルグループ	102	74	36,556
静岡銀行	102	74	68,820
みずほフィナンシャルグループ	102	74	14,955
証券、商品先物取引業 (0.4%)			
大和証券グループ本社	102	74	50,431
野村ホールディングス	102	74	45,406
松井証券	102	74	65,268
保険業 (1.1%)			
SOMPOホールディングス	25.5	18.5	68,320
MS&ADインシュアランスグループホール	30.6	22.2	79,365
ソニーフィナンシャルホールディングス	20.4	14.8	24,730
第一生命ホールディングス	10.2	7.4	13,871
東京海上ホールディングス	51	37	183,742
T&Dホールディングス	20.4	14.8	21,400

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 (0.4%)			
クレディセゾン	102	74	151,774
不動産業 (2.0%)			
東急不動産ホールディングス	102	74	48,766
三井不動産	102	74	198,986
三菱地所	102	74	166,426
東京建物	51	37	55,056
住友不動産	102	74	228,808
サービス業 (3.4%)			
ディー・エヌ・エー	30.6	22.2	79,143
電通	102	74	381,100
楽天	—	74	85,840
東京ドーム	102	37	42,883
セコム	102	74	611,758
合 計	株数・金額 21,476	14,670	35,402,878
	銘柄数<比率>	225	<94.5%>

*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。

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	日経225	百万円 2,052	百万円 —

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年11月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 35,402,878	% 94.4
コール・ローン等、その他	2,087,563	5.6
投資信託財産総額	37,490,441	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 (2016年11月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	37,490,441,611
コール・ローン等	1,776,505,223
株式(評価額)	35,402,878,720
未収入金	112,785,568
未収配当金	198,272,100
(B) 負債	36,412,810
未払解約金	5,330,329
未払利息	2,481
前受金	31,080,000
(C) 純資産総額(A-B)	37,454,028,801
元本	30,404,472,622
次期繰越損益金	7,049,556,179
(D) 受益権総口数	30,404,472,622口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,319円

(注) 期首元本額は43,691,030,276円、期中追加設定元本額は9,993,569,298円、期中一部解約元本額は23,280,126,952円、1口当たり純資産額は1.2319円です。

(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) 13,606,111,842円
- ・ 野村日本株リスタコントロール・ファンドVA(家ドル投資型)(適格機関投資家専用) 6,554,393,754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) 5,637,952,871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) 3,186,316,705円
- ・ 野村日経225ターゲット(公社債運用移行型)Vプライス(適格機関投資家専用) 1,029,693,369円
- ・ 野村日本株リスタコントロール・ファンドVA(米ドル投資型)(適格機関投資家専用) 326,543,157円
- ・ 野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型) 63,460,924円

○損益の状況 (2015年12月1日～2016年11月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	712,362,229
受取配当金	712,003,794
受取利息	621,807
その他収益金	125,718
支払利息	△ 389,090
(B) 有価証券売買損益	△ 5,004,832,912
売買益	1,594,212,615
売買損	△ 6,599,045,527
(C) 先物取引等取引損益	△ 683,111,832
取引益	239,076,148
取引損	△ 922,187,980
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 4,975,582,515
(E) 前期繰越損益金	13,103,010,855
(F) 追加信託差損益金	1,843,707,228
(G) 解約差損益金	△ 2,921,579,389
(H) 計(D+E+F+G)	7,049,556,179
次期繰越損益金(H)	7,049,556,179

* 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

該当事項はございません。

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年3月31日）

作成対象期間（2015年4月1日～2016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。
主な投資対象	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	期中率	NOMURA-BPI総合	期騰落率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
14期(2016年3月31日)	13,141	5.4	382.913	5.4	99.5	—	656,174

*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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

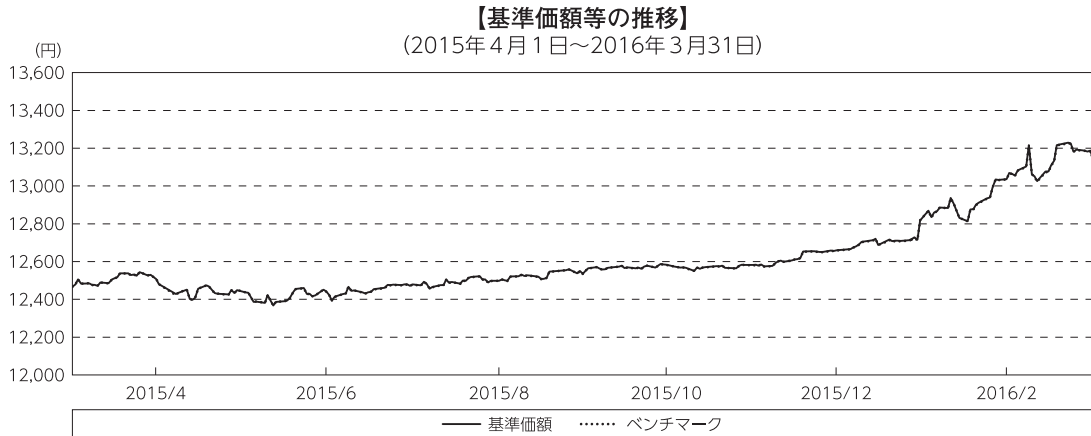
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	NOMURA-BPI総合	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2015年3月31日	12,467	—	363.279	—	99.6	—
4月末	12,507	0.3	364.501	0.3	99.6	—
5月末	12,449	△0.1	362.770	△0.1	99.4	—
6月末	12,443	△0.2	362.542	△0.2	99.2	—
7月末	12,479	0.1	363.584	0.1	99.6	—
8月末	12,499	0.3	364.201	0.3	98.1	—
9月末	12,535	0.5	365.235	0.5	99.3	—
10月末	12,583	0.9	366.655	0.9	99.4	—
11月末	12,582	0.9	366.578	0.9	99.2	—
12月末	12,660	1.5	368.877	1.5	99.2	—
2016年1月末	12,818	2.8	373.520	2.8	98.3	—
2月末	13,036	4.6	379.830	4.6	98.5	—
(期末)						
2016年3月31日	13,141	5.4	382.913	5.4	99.5	—

*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12,467円から期末13,141円に674円の値上がりとなりました。

世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。また日銀による国債買い入れの平均残存年限長期化やマイナス金利政策の導入などを背景に、国内債券利回りが低下（価格は上昇）したため、基準価額は上昇しました。

○投資環境

期首から2015年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、国内債券市場は軟調となりました。その後は8月中旬から9月下旬や2016年1月から2月中旬にかけては、世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。日銀が国債買い入れの平均残存年限長期化を発表したことや、マイナス金利政策の導入を決定したことなどを背景に、国内債券市場は堅調となり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

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

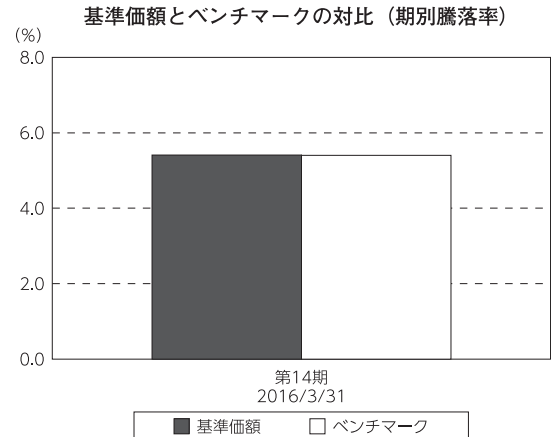
今期の基準価額の騰落率は+5.4%となり、ベンチマークの+5.4%とほぼ同程度となりました。主な差異要因は以下の通りです。

（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。



（注）ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

◎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

(2015年4月1日～2016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

(2015年4月1日～2016年3月31日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	153,978,592	69,665,521
	地方債証券	23,888,366	5,558,234
	特殊債証券	25,130,353	12,498,312 (776,726)
	社債証券 (投資法人債券を含む)	8,796,402	6,062,809

*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。

*社債証券 (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

(2015年4月1日～2016年3月31日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 211,793	百万円 20,247	% 9.6	百万円 93,784	百万円 3,273	% 3.5
預金	38,982	38,982	100.0	37,298	37,298	100.0

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、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	455,315,000 (3,160,000)	513,500,283 (4,743,391)	78.3 (0.7)	— (—)	51.5 (0.7)	21.2 (0.0)	5.6 (0.0)
地方債証券	49,021,020 (49,021,020)	51,844,038 (51,844,038)	7.9 (7.9)	— (—)	3.4 (3.4)	3.4 (3.4)	1.1 (1.1)
特殊債券 (除く金融債)	48,158,183 (48,158,183)	51,196,816 (51,196,816)	7.8 (7.8)	— (—)	4.4 (4.4)	1.9 (1.9)	1.5 (1.5)
金融債券	6,150,000 (6,150,000)	6,191,268 (6,191,268)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.6 (0.6)
普通社債券 (含む投資法人債券)	28,907,000 (28,907,000)	30,007,290 (30,007,290)	4.6 (4.6)	— (—)	2.0 (2.0)	1.8 (1.8)	0.8 (0.8)
合 計	587,551,203 (135,396,203)	652,739,697 (143,982,805)	99.5 (21.9)	— (—)	61.3 (10.4)	28.6 (7.4)	9.7 (4.1)

* ()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。

*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
		%	千円	千円	
国債証券					
国庫債券	利付 (2年) 第359回	0.1	300,000	301,557	2017/12/15
国庫債券	利付 (2年) 第360回	0.1	4,200,000	4,223,268	2018/1/15
国庫債券	利付 (2年) 第362回	0.1	1,200,000	1,207,380	2018/3/15
国庫債券	利付 (5年) 第105回	0.2	4,500,000	4,521,285	2017/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第106回	0.2	5,600,000	5,632,424	2017/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第107回	0.2	3,800,000	3,826,106	2017/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第108回	0.1	1,800,000	1,809,270	2017/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第109回	0.1	2,800,000	2,817,332	2018/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第110回	0.3	1,000,000	1,010,130	2018/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第111回	0.4	1,400,000	1,416,926	2018/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第112回	0.4	2,200,000	2,230,536	2018/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第113回	0.3	7,000,000	7,081,620	2018/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第114回	0.3	1,500,000	1,519,500	2018/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第115回	0.2	7,300,000	7,376,796	2018/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第116回	0.2	8,100,000	8,195,013	2018/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第117回	0.2	5,900,000	5,975,579	2019/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第118回	0.2	5,000,000	5,068,700	2019/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第119回	0.1	4,000,000	4,042,040	2019/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第120回	0.2	5,500,000	5,579,585	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第121回	0.1	3,500,000	3,538,465	2019/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第122回	0.1	7,800,000	7,890,402	2019/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第123回	0.1	7,300,000	7,388,841	2020/3/20
国庫債券	利付 (5年) 第124回	0.1	8,100,000	8,203,194	2020/6/20
国庫債券	利付 (5年) 第125回	0.1	8,200,000	8,308,896	2020/9/20
国庫債券	利付 (5年) 第126回	0.1	4,500,000	4,562,010	2020/12/20
国庫債券	利付 (5年) 第127回	0.1	1,000,000	1,014,510	2021/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第1回	2.4	2,960,000	4,540,995	2048/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第2回	2.2	900,000	1,338,606	2049/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第3回	2.2	900,000	1,348,065	2050/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第4回	2.2	1,100,000	1,658,932	2051/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第5回	2.0	1,200,000	1,743,300	2052/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第6回	1.9	1,300,000	1,856,153	2053/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第7回	1.7	1,400,000	1,914,598	2054/3/20
国庫債券	利付 (40年) 第8回	1.4	1,600,000	2,029,824	2055/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第288回	1.7	1,850,000	1,901,430	2017/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第289回	1.5	2,000,000	2,058,580	2017/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第290回	1.4	1,250,000	1,289,450	2018/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第291回	1.3	1,400,000	1,441,440	2018/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第292回	1.7	1,600,000	1,659,936	2018/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第293回	1.8	750,000	783,652	2018/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第294回	1.7	500,000	521,325	2018/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第295回	1.5	1,600,000	1,661,136	2018/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第297回	1.4	1,100,000	1,148,774	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第298回	1.3	1,500,000	1,562,415	2018/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第299回	1.3	1,400,000	1,463,588	2019/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第300回	1.5	1,000,000	1,051,380	2019/3/20

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 (10年) 第301回	1.5	1,500,000	1,583,430	2019/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第302回	1.4	700,000	736,666	2019/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第303回	1.4	3,300,000	3,485,328	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,052,670	2019/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,331,609	2019/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,192,180	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,802,102	2020/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第308回	1.3	1,700,000	1,808,290	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第309回	1.1	3,000,000	3,165,600	2020/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第310回	1.0	3,700,000	3,898,172	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第311回	0.8	1,800,000	1,880,208	2020/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第312回	1.2	4,950,000	5,277,145	2020/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第313回	1.3	3,200,000	3,437,824	2021/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第314回	1.1	2,200,000	2,341,482	2021/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第315回	1.2	2,600,000	2,790,918	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,495,438	2021/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第317回	1.1	1,800,000	1,928,700	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第318回	1.0	3,200,000	3,411,136	2021/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,988,380	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第320回	1.0	3,500,000	3,741,605	2021/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第321回	1.0	3,200,000	3,430,528	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,558,424	2022/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,885,868	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,400,160	2022/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第325回	0.8	4,900,000	5,217,373	2022/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,226,315	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第327回	0.8	3,800,000	4,054,372	2022/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第328回	0.6	5,500,000	5,802,280	2023/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第329回	0.8	5,300,000	5,675,293	2023/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第330回	0.8	4,800,000	5,149,968	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	2,009,820	2023/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第332回	0.6	6,400,000	6,777,152	2023/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第333回	0.6	5,500,000	5,829,890	2024/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,350,182	2024/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第335回	0.5	4,700,000	4,951,215	2024/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,846,124	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第337回	0.3	3,700,000	3,835,124	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第338回	0.4	4,900,000	5,123,783	2025/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第339回	0.4	5,900,000	6,168,509	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	6,000,000	6,274,560	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	5,900,000	6,110,453	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	1,300,000	1,319,513	2026/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	136,047	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	262,624	2030/2/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	208,449	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,256,112	2030/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	195,046	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	700,000	935,529	2031/11/20

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7回	2.3	600,000	796,212	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	124,955	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	65,000	76,991	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	283,877	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	197,467	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	286,662	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	373,227	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,086,280	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,239,750	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,262,736	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,636,332	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	1,500,000	2,021,835	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	2,159,664	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,637,143	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,892,940	2035/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	835,200	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,170,943	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	978,047	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	680,410	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,175,329	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,184,740	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	990,731	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回	2.4	800,000	1,121,680	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,249,065	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回	2.2	1,000,000	1,372,840	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,663,059	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,680,180	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	3,199,553	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	3,107,323	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,442,816	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回	1.9	2,100,000	2,810,073	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,845,522	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,154,576	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,455,850	2043/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,299,980	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,560,876	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,694,056	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,827,700	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,383,018	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回	1.5	1,300,000	1,632,969	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回	1.6	1,900,000	2,438,916	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,723,554	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回	1.4	1,400,000	1,725,948	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第50回	0.8	300,000	320,940	2046/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第36回	3.0	380,000	397,841	2017/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第37回	3.1	320,000	335,494	2017/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第38回	2.7	170,000	179,712	2018/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第39回	2.6	511,000	539,186	2018/3/20

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40回	2.3	525,000	557,555	2018/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	267,982	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	740,030	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	443,240	2019/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	166,095	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	267,001	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	99,079	2020/6/22
国庫債券	利付 (20年) 第47回	2.2	1,230,000	1,362,089	2020/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	225,488	2020/12/21
国庫債券	利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	222,840	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	112,616	2021/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	282,980	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	284,422	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	261,425	2022/3/21
国庫債券	利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	136,430	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	237,434	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	204,415	2022/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	259,377	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	863,733	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	324,831	2023/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	471,156	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	343,020	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	462,236	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	527,777	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	345,645	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	360,898	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	344,615	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	660,956	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	653,383	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	238,674	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	797,166	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,896,960	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,552,044	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	718,998	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,074,036	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	832,510	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	947,424	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	1,026,461	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,082,556	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	430,988	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	989,502	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,659,083	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,441,488	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	485,832	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,728,412	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	612,290	2026/3/20

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88回	2.3	1,100,000	1,363,208	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	577,644	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,850,115	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	310,975	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	1,550,000	1,901,741	2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	366,153	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	246,296	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	880,495	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	494,172	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,625,975	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	371,790	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	2,100,000	2,610,384	2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	1,520,000	1,913,041	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	320,602	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	643,385	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	764,772	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	500,128	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,382,410	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	506,516	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	377,208	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,972,656	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,111,509	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,386,770	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	1,021,712	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,275,326	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	1,800,000	2,281,248	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第114回	2.1	2,500,000	3,176,325	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	500,000	642,030	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,416,052	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,419,802	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	630,900	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	987,096	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	964,760	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	2,000,000	2,500,760	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	1,100,000	1,359,809	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	2,300,000	2,947,703	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,266,300	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	1,700,000	2,208,249	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	1,000,000	1,269,730	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	800,000	1,004,088	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	1,500,000	1,886,160	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	500,000	621,305	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	1,800,000	2,240,370	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	983,672	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,599,481	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,743,882	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	900,000	1,122,696	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	492,788	2032/3/20

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136回	1.6	700,000	850,899	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,232,620	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	960,280	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	700,000	851,200	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	2,300,000	2,836,291	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	1,700,000	2,097,103	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	1,250,000	1,562,062	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	1,700,000	2,070,005	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	1,500,000	1,802,100	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	2,600,000	3,211,468	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	2,400,000	2,964,912	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	2,700,000	3,293,082	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	2,500,000	3,006,100	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	2,600,000	3,125,252	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	2,930,000	3,469,530	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	2,700,000	3,097,602	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	3,400,000	3,899,936	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	3,450,000	4,018,249	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	3,500,000	4,009,215	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	2,300,000	2,547,480	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	1,000,000	992,660	2036/3/20
ポーランド共和国	第12回円貨債券 (2012)	1.05	100,000	101,104	2017/11/8
ポーランド共和国	第15回円貨債券 (2013)	0.91	100,000	101,292	2020/11/13
小 計			455,315,000	513,500,283	
地方債証券					
東京都	公募第648回	1.84	300,000	306,537	2017/6/20
東京都	公募第655回	1.42	100,000	102,686	2018/3/20
東京都	公募第659回	1.62	300,000	310,521	2018/6/20
東京都	公募第660回	1.58	100,000	103,418	2018/6/20
東京都	公募第664回	1.4	100,000	103,699	2018/12/20
東京都	公募第668回	1.54	200,000	208,864	2019/3/20
東京都	公募第671回	1.42	100,000	104,421	2019/6/20
東京都	公募第685回	1.13	100,000	104,546	2020/6/19
東京都	公募第690回	1.29	200,000	211,622	2020/12/18
東京都	公募第703回	0.99	100,000	105,356	2021/12/20
東京都	公募第707回	0.87	100,000	104,867	2022/3/18
東京都	公募第708回	0.89	100,000	105,239	2022/6/20
東京都	公募第710回	0.81	100,000	104,742	2022/6/20
東京都	公募第712回	0.77	100,000	104,571	2022/9/20
東京都	公募第715回	0.76	100,000	104,644	2022/12/20
東京都	公募第716回	0.77	200,000	209,422	2022/12/20
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	137,100	2038/9/17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	268,402	2039/9/20
東京都	公募 (7年) 第1回	0.7	300,000	302,343	2017/6/20
東京都	公募 (7年) 第3回	0.58	100,000	101,370	2018/9/20
東京都	公募第1回	1.54	300,000	331,335	2023/6/20
東京都	公募第7回	2.16	100,000	119,523	2025/9/19
東京都	公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	245,972	2028/12/20

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(20年)第17回	2.09	200,000	247,970	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	126,553	2030/12/20
東京都	公募(20年)第26回	1.74	300,000	365,193	2032/6/18
北海道	公募平成19年度第2回	1.84	500,000	509,910	2017/5/31
北海道	公募平成19年度第4回	1.98	100,000	102,308	2017/6/29
北海道	公募平成20年度第7回	1.72	300,000	312,324	2018/9/25
北海道	公募平成21年度第6回	1.6	100,000	105,137	2019/8/28
北海道	公募平成21年度第10回	1.5	100,000	105,142	2019/11/27
北海道	公募平成24年度第6回	0.84	100,000	104,619	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回	0.79	100,000	104,370	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回	0.58	300,000	309,657	2023/4/26
北海道	公募(5年)平成25年度第8回	0.31	100,000	100,606	2018/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第8回	0.178	200,000	200,604	2019/9/25
北海道	公募(5年)平成26年度第10回	0.147	100,000	100,204	2019/11/28
宮城県	公募(5年)第9回1号	0.35	500,000	503,715	2018/7/26
神奈川県	公募第155回	1.61	100,000	103,462	2018/6/20
神奈川県	公募第156回	1.66	101,000	105,083	2018/9/20
神奈川県	公募第184回	1.02	100,000	105,070	2021/6/18
神奈川県	公募第188回	1.05	200,000	211,950	2022/3/18
神奈川県	公募第196回	0.678	100,000	104,216	2023/3/20
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	105,571	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	104,573	2024/3/19
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	104,637	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	206,224	2024/12/20
神奈川県	公募(30年)第3回	2.62	100,000	137,479	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	368,364	2027/3/19
神奈川県	公募(5年)第56回	0.29	100,000	100,452	2018/3/20
大阪府	公募第303回	1.93	300,000	306,666	2017/6/28
大阪府	公募第304回	1.98	150,000	153,673	2017/7/28
大阪府	公募第320回	1.84	400,000	418,516	2018/11/27
大阪府	公募第337回	1.44	200,000	210,732	2020/4/28
大阪府	公募第346回	1.25	100,000	105,298	2021/1/28
大阪府	公募第356回	1.06	100,000	105,507	2021/12/27
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	108,743	2023/11/28
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	104,605	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	310,500	2024/8/28
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	125,430	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	121,789	2031/12/22
大阪府	公募第98回	0.295	200,000	201,040	2018/9/27
大阪府	公募(5年)第99回	0.24	240,000	240,921	2018/10/30
大阪府	公募(5年)第101回	0.23	148,000	148,520	2018/12/26
大阪府	公募第102回	0.223	100,000	100,339	2019/1/30
京都府	公募平成19年度第1回	1.81	100,000	102,598	2017/9/26
京都府	公募平成20年度第3回	1.57	140,000	145,800	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	105,297	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回	0.8	100,000	104,758	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	117,034	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	208,124	2024/9/19

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	公募平成19年度第2回	1.8	100,000	101,898	2017/5/24
兵庫県	公募平成20年度第3回	1.76	100,000	103,571	2018/5/22
兵庫県	公募平成20年度第12回	1.82	100,000	104,618	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回	1.6	100,000	104,250	2019/1/23
兵庫県	公募平成21年度第13回	1.48	100,000	104,560	2019/7/17
兵庫県	公募平成21年度第25回	1.54	100,000	105,241	2019/11/20
兵庫県	公募平成22年度第1回	1.46	100,000	105,448	2020/4/16
兵庫県	公募(30年)第2回	2.36	100,000	134,323	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第1回	1.66	300,000	346,365	2026/7/29
兵庫県	公募(15年)第3回	1.35	100,000	113,054	2027/7/16
兵庫県	公募(12年)第3回	0.56	300,000	311,931	2025/4/16
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	124,747	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	125,701	2029/11/19
静岡県	公募平成19年度第1回	1.77	100,000	101,979	2017/5/30
静岡県	公募平成19年度第4回	1.94	200,000	205,330	2017/8/28
静岡県	公募平成19年度第7回	1.81	100,000	102,906	2017/11/28
静岡県	公募平成21年度第2回	1.65	100,000	105,166	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回	1.54	100,000	105,453	2019/11/25
静岡県	公募(5年)平成24年度第8回	0.236	100,000	100,295	2017/10/18
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	104,219	2023/3/22
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	172,924	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	104,026	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	100,000	103,978	2024/10/24
静岡県	公募(20年)第11回	1.841	100,000	122,066	2030/10/18
静岡県	公募(20年)第14回	1.736	100,000	121,669	2032/6/18
愛知県	公募平成19年度第3回	1.89	111,000	113,818	2017/8/17
愛知県	公募平成19年度第4回	1.87	100,000	102,828	2017/10/18
愛知県	公募平成20年度第7回	1.39	210,000	217,982	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	122,899	2028/12/20
愛知県	公募平成20年度第10回	1.48	100,000	104,297	2019/3/27
愛知県	公募平成21年度第3回	1.66	114,000	119,930	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回	1.41	100,000	105,284	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回	1.364	100,000	105,436	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回	1.153	100,000	104,906	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回	1.006	100,000	105,666	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回	0.982	100,000	105,672	2022/4/27
愛知県	公募(5年)平成24年度第6回	0.2	1,100,000	1,102,046	2017/7/13
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回	1.314	400,000	453,476	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	123,107	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	126,975	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	115,130	2034/11/14
広島県	公募平成20年度第3回	1.6	300,000	311,742	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回	1.26	200,000	211,536	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	104,900	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	210,792	2023/9/25
広島県	公募(5年)平成25年度第6回	0.21	300,000	301,572	2019/2/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	112,012	2025/1/27
埼玉県	公募平成19年度第7回	1.65	200,000	206,074	2018/2/27

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20年度第1回	1.55	100,000	103,085	2018/4/24
埼玉県	公募平成21年度第5回	1.41	100,000	104,751	2019/9/25
埼玉県	公募平成22年度第2回	1.37	200,000	210,908	2020/5/26
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	100,000	104,924	2022/7/25
埼玉県	公募(5年)平成24年度第8回	0.21	200,000	200,484	2017/12/28
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	106,112	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	156,057	2023/9/27
埼玉県	公募(5年)平成25年度第7回	0.261	100,000	100,578	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	104,672	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	104,513	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	207,886	2024/9/26
福岡県	公募平成19年度第6回	1.72	100,000	102,452	2017/9/20
福岡県	公募平成19年度第8回	1.62	100,000	102,702	2017/12/20
福岡県	公募平成20年度第3回	1.59	100,000	103,463	2018/6/20
福岡県	公募平成22年度第5回	0.94	100,000	104,008	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回	1.02	100,000	105,414	2021/10/25
福岡県	公募平成24年度第10回	0.18	100,000	100,246	2018/1/29
福岡県	公募平成26年度第4回	0.135	100,000	100,313	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	114,534	2026/11/27
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	137,985	2037/9/18
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	1.827	100,000	127,284	2044/6/20
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	2.05	100,000	123,177	2028/12/20
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	1.635	100,000	119,990	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第1回	1.55	100,000	103,089	2018/4/25
千葉県	公募平成20年度第6回	1.64	200,000	208,238	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第1回	1.53	100,000	104,532	2019/4/25
千葉県	公募平成21年度第11回	1.42	180,000	189,397	2020/1/24
千葉県	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	106,079	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	105,269	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第4回	0.22	100,000	100,238	2017/8/25
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	105,245	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第2回	0.26	900,000	904,050	2018/5/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	105,817	2023/6/23
千葉県	公募(20年)第8回	2.18	100,000	126,367	2030/4/19
千葉県	公募(20年)第17回	1.403	100,000	116,073	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回	1.52	200,000	208,670	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回	1.55	150,000	158,283	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回	0.24	1,100,000	1,106,435	2018/12/25
群馬県	公募第8回	1.03	100,000	105,466	2021/11/25
群馬県	公募(5年)第4回	0.235	600,000	603,162	2018/11/22
岐阜県	公募平成19年度第1回	1.87	190,000	195,432	2017/10/26
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	193,875	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第51回	1.9	100,000	102,281	2017/6/23
共同発行市場地方債	公募第56回	1.72	400,000	410,884	2017/11/24
共同発行市場地方債	公募第58回	1.59	270,500	278,003	2018/1/25
共同発行市場地方債	公募第62回	1.74	100,000	103,642	2018/5/25
共同発行市場地方債	公募第63回	1.88	100,000	104,110	2018/6/25
共同発行市場地方債	公募第64回	1.78	262,000	272,584	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	726,768	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	187,858	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	939,375	2018/11/22
共同発行市場地方債	公募第70回	1.42	110,000	114,271	2019/1/25
共同発行市場地方債	公募第74回	1.57	500,000	523,960	2019/5/24
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	325,965	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	315,600	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	526,215	2020/3/25
共同発行市場地方債	公募第85回	1.44	100,000	105,630	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	104,813	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	104,331	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	114,977	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	316,935	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	317,091	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	106,135	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第101回	1.05	300,000	315,990	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	157,962	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	105,223	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	211,302	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	210,358	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	210,492	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	200,000	209,128	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	104,835	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	209,726	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	105,209	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	210,046	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	312,708	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	103,475	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	100,000	103,907	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	106,073	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	105,510	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	313,467	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	105,324	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	104,592	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	208,670	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	208,088	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	161,105	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	557,479	2025/2/25
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	123,754	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	122,553	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	104,785	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	703,710	2019/3/25
福島県	公募平成24年度第2回	0.17	100,000	100,238	2018/2/26
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	206,940	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	104,341	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	146,927	2024/11/28
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	104,341	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	244,773	2023/12/26

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	
大阪市 公募平成20年度第3回	1.82	110,000	114,495	2018/7/23
大阪市 公募平成21年度第6回	1.57	100,000	105,486	2019/11/25
大阪市 公募平成25年度第1回	0.401	800,000	805,840	2018/5/23
大阪市 公募平成25年度第6回	0.694	100,000	104,585	2023/11/22
大阪市 公募(15年)第1回	1.753	100,000	116,353	2026/7/17
大阪市 公募(20年)第5回	2.47	100,000	127,473	2028/9/21
大阪市 公募(20年)第6回	2.21	100,000	124,626	2028/12/20
大阪市 公募(20年)第17回	1.721	100,000	120,692	2032/12/21
名古屋市 公募第460回	1.74	200,000	204,964	2017/9/20
名古屋市 公募第464回	1.61	300,000	311,712	2018/9/20
名古屋市 公募第469回	1.34	100,000	104,792	2019/12/20
名古屋市 公募第478回	1.063	100,000	106,021	2022/3/18
名古屋市 公募第488回	0.598	300,000	313,182	2024/9/20
名古屋市 公募(6年)第1回	0.283	200,000	201,010	2018/6/20
名古屋市 公募(12年)第1回	1.033	200,000	217,242	2025/6/20
名古屋市 公募(15年)第2回	0.905	100,000	108,724	2029/11/16
京都市 公募平成19年度第2回	1.74	300,000	308,661	2017/12/27
京都市 公募平成19年度第4回	1.62	190,000	195,614	2018/2/26
京都市 公募平成20年度第4回	1.54	200,000	208,600	2019/2/26
京都市 公募平成23年度第4回	1.067	100,000	105,776	2021/12/22
京都市 公募平成25年度第3回	0.312	100,000	100,675	2018/9/27
京都市 公募(20年)第2回	2.12	100,000	119,147	2025/9/19
京都市 公募(20年)第13回	1.359	100,000	114,482	2034/11/24
神戸市 公募平成21年度第7回	1.69	100,000	105,257	2019/6/20
横浜市 公募平成20年度第3回	1.56	100,000	103,713	2018/9/7
横浜市 公募公債平成20年度5回	1.58	200,000	208,320	2018/12/20
横浜市 公募平成21年度第4回	1.35	200,000	208,976	2019/9/20
横浜市 公募平成22年度第5回	1.265	100,000	105,645	2020/12/11
横浜市 公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	209,628	2022/10/17
横浜市 公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	208,200	2023/5/19
横浜市 公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	208,720	2023/11/17
横浜市 公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	206,646	2024/12/13
横浜市 公募(20年)第30回	1.376	100,000	115,421	2034/10/20
札幌市 公募平成19年度第3回	1.77	100,000	102,533	2017/9/20
札幌市 公募平成22年度第4回	1.05	100,000	104,187	2020/6/19
札幌市 公募(5年)平成24年度第8回	0.2	200,000	200,444	2017/12/20
札幌市 公募平成26年度第4回	0.54	100,000	103,704	2024/6/20
札幌市 公募平成26年度第9回	0.43	200,000	205,860	2024/12/20
川崎市 公募第81回	1.57	100,000	104,536	2019/3/20
川崎市 公募第82回	1.52	100,000	105,115	2019/9/20
川崎市 公募第85回	0.72	100,000	104,341	2022/12/20
川崎市 公募(20年)第17回	1.527	100,000	118,312	2033/5/9
川崎市 公募第32回	0.22	150,000	150,301	2017/6/20
北九州市 公募(5年)平成25年度第2回	0.312	100,000	100,707	2018/9/27
北九州市 公募(20年)第14回	1.732	100,000	121,210	2032/11/12
福岡市 公募平成20年度第3回	1.52	100,000	103,308	2018/6/20
福岡市 公募平成24年度第5回	0.19	100,000	100,241	2017/12/26
福岡市 公募(5年)平成25年度第2回	0.35	300,000	302,226	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	
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	117,306	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	103,855	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	165,414	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	104,838	2019/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	603,174	2019/1/29
千葉市	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,967	2022/4/25
鹿児島県	公募(5年)平成25年度第1回	0.24	100,000	100,546	2018/10/31
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	102,738	2023/4/26
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	418,724	2020/11/30
山梨県	公募平成19年度第1回	1.86	200,000	205,742	2017/10/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	104,755	2019/10/30
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	105,408	2020/3/31
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	第96回	2.34	100,000	126,003	2028/12/20
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券	第102回	2.298	300,000	379,977	2029/12/20
福岡北九州高速道路債券	第117回	2.26	100,000	124,395	2028/12/20
東京都住宅供給公社債券	第5回	2.02	200,000	205,484	2017/9/20
小 計			49,021,020	51,844,038	
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	213,258	2020/7/15
公営企業債券	政府保証第875回	1.7	100,000	101,904	2017/5/22
公営企業債券	政府保証第880回	1.7	131,000	134,557	2017/11/17
公営企業債券	政府保証第881回	1.5	200,000	205,316	2018/1/23
公営企業債券	政府保証第886回	1.8	203,000	210,967	2018/6/19
公営企業債券	政府保証15年第1回	1.6	300,000	319,611	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	416,552	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	208,184	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	104,202	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	100,544	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	503,620	2018/3/26
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	104,713	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	100,000	105,151	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	106,132	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	303,399	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	400,960	2017/8/29
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	121,590	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	301,869	2020/6/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第64回	0.544	100,000	104,062	2024/9/13
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	416,248	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	300,000	309,456	2025/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	196,792	2025/5/23
日本政策金融公庫債券	政府保証第22回	0.243	2,000,000	2,011,160	2018/10/26
新関西国際空港債券	政府保証第1回	0.801	151,000	158,151	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	200,376	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	2,103,675	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	3,591,328	2017/11/2
日本政策投資銀行債券	政府保証第18回	1.9	100,000	102,569	2017/8/16
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	115,351	2023/6/19
日本政策投資銀行社債	政府保証第5回	1.4	100,000	104,129	2019/4/15

銘柄	利 率	当 期 末		償 還 年 月 日
		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 政府保証第9回	1.0	141,000	146,924	2020/9/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第10回	0.5	100,000	100,571	2017/6/23
日本政策投資銀行社債 政府保証第16回	0.819	102,000	106,984	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	109,007	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	109,175	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42回	1.8	100,000	102,798	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	210,746	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	140,897	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	294,243	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	103,895	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	354,875	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	104,190	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	103,745	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	250,242	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	250,478	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	314,421	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	253,508	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	421,176	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	251,352	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	246,338	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	133,216	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	466,479	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	147,512	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	104,944	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	147,012	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	128,360	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	104,925	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	120,116	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	228,331	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	118,861	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	391,917	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	209,816	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	209,576	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	209,034	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	421,004	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	121,626	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	202,562	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	415,380	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	211,780	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	287,455	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	314,517	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	143,412	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	151,675	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	117,753	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	117,651	2034/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第220回	0.644	100,000	104,782	2024/6/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第225回	0.556	190,000	197,873	2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回	0.466	100,000	103,524	2024/12/27

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	
首都高速道路債券 政府保証第8回	1.3	100,000	104,769	2020/1/20
阪神高速道路債券 政府保証第5回	1.3	100,000	104,965	2020/3/18
民間都市開発推進機構 政府保証第16回	0.699	120,000	125,718	2023/10/20
中部国際空港債券 政府保証第18回	0.668	264,000	275,051	2023/3/22
預金保険機構債券 政府保証第194回	0.1	300,000	300,327	2017/12/15
中日本高速道路債券 政府保証第13回	1.7	138,000	140,608	2017/5/19
中日本高速道路債券 政府保証第14回	1.9	100,000	102,258	2017/6/16
西日本高速道路債券 政府保証第8回	1.7	100,000	101,890	2017/5/19
銀行等保有株式取得機構債券 政府保証第28回	0.1	400,000	400,304	2017/5/19
新関西国際空港社債 財投機関債第10回	0.161	100,000	100,156	2017/9/20
新関西国際空港社債 財投機関債第12回	1.067	100,000	109,100	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	100,470	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	101,696	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	109,149	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	135,746	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	244,300	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	247,872	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	306,542	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	104,062	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	125,406	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	126,739	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	210,506	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	119,343	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	104,024	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103回	1.69	350,000	416,703	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105回	1.853	100,000	121,719	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	301,332	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	206,972	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	206,468	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	351,783	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	119,436	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	140,059	2034/6/20
公営企業債券 30年第4回財投機関債	2.95	100,000	141,050	2034/3/24
地方公営企業等金融機構債券 第1回	1.77	200,000	208,674	2018/9/25
地方公営企業等金融機構債券(20年) 第1回	2.07	100,000	122,054	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券 第1回	1.648	100,000	105,189	2019/6/28
地方公共団体金融機構債券 第2回	1.406	100,000	104,504	2019/7/26
地方公共団体金融機構債券 20年第4回	2.12	100,000	123,680	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券 20年第6回	2.242	300,000	376,671	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券 F24回	1.681	100,000	111,056	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券 第13回	1.278	200,000	210,292	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券 第16回	1.164	100,000	104,925	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券 第27回	1.034	300,000	315,912	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券 F104回	1.314	100,000	110,262	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券 F106回	1.259	100,000	108,987	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券 第37回	0.852	300,000	314,856	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券 第41回	0.801	600,000	628,674	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券 F142回	1.016	100,000	107,447	2024/11/28

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	
地方公共団体金融機構債券	F 144回	0.562	200,000	204,530	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券	F 145回	1.059	200,000	215,996	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	104,806	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	104,844	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F 160回	1.052	100,000	109,232	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	300,000	316,341	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	316,383	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	221,468	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	115,870	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	103,631	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	114,757	2034/9/28
公営企業債券(20年) 第2回財投機関債		1.45	100,000	109,196	2022/12/20
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債		2.5	100,000	126,615	2028/6/20
公営企業債券 第29回財投機関債		1.77	500,000	514,845	2017/12/20
首都高速道路社債 第12回		0.293	100,000	100,686	2018/12/20
阪神高速道路 第13回		0.18	100,000	100,447	2019/9/20
中小企業債券 第6回財投機関債		0.79	100,000	101,446	2018/3/20
都市再生債券 財投機関債第21回		1.72	300,000	312,567	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第55回		1.074	100,000	105,578	2021/9/17
都市再生債券 財投機関債第97回		1.017	100,000	109,019	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回		2.26	100,000	119,044	2025/6/20
東京交通債券 第342回		2.4	200,000	228,750	2022/6/21
東京交通債券 第347回		2.05	157,000	180,625	2024/3/8
関西国際空港社債 財投機関債第26回		1.156	300,000	314,580	2020/9/18
福祉医療機構債券 第31回財投機関債		0.93	100,000	105,422	2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回		2.26	200,000	243,792	2027/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回		1.86	200,000	207,186	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	115,221	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	313,299	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	105,387	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	115,855	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	121,896	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	106,272	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	124,305	2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回		1.751	300,000	346,365	2026/6/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回		2.056	100,000	124,189	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	105,551	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	210,850	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	228,880	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	133,305	2042/9/19
成田国際空港 第17回		0.489	200,000	205,906	2025/2/20
私学振興債券 財投機関債第7回		1.7	300,000	307,335	2017/9/25
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回		1.208	100,000	106,022	2021/6/18
国際協力機構債券 第6回財投機関債		2.098	100,000	124,607	2030/12/13
東日本高速道路 第21回		0.58	100,000	101,187	2018/6/20
東日本高速道路 第26回		0.305	100,000	100,833	2019/6/20
東日本高速道路 第27回		0.248	100,000	100,650	2019/6/20
中日本高速道路債券 財投機関債第3回		1.92	100,000	102,777	2017/9/20

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	
中日本高速道路社債 第32回		0.64	200,000	203,036	2018/9/20
中日本高速道路社債 第44回		0.536	100,000	101,682	2019/9/20
中日本高速道路社債 第46回		0.351	1,500,000	1,506,975	2017/9/20
中日本高速道路社債 第47回		0.277	100,000	100,476	2018/3/20
中日本高速道路社債 第53回		0.222	100,000	100,222	2017/6/20
西日本高速道路 第20回		0.759	200,000	209,770	2023/9/20
西日本高速道路 第23回		0.602	100,000	103,829	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	209,800	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	114,922	2034/8/4
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券		1.94	15,355	15,963	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	54,378	56,541	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	100,360	105,135	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券		1.43	98,118	101,019	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	61,605	65,027	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	82,758	89,743	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	21,586	23,230	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	54,444	57,753	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	59,696	63,872	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	58,590	61,214	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	120,880	127,600	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	104,645	110,881	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	104,128	112,995	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	59,582	63,696	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	29,714	31,885	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	40,277	44,039	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	137,841	149,150	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	34,882	36,419	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	144,444	153,611	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	71,678	75,042	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	205,452	221,795	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	147,586	157,614	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	79,442	86,968	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	200,343	217,031	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	202,719	214,093	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	241,647	254,618	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	237,912	252,450	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	157,888	166,773	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	71,226	76,438	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	145,356	155,895	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	86,121	90,260	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	175,622	184,194	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	83,400	87,398	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	42,962	45,233	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	249,375	263,716	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	51,197	55,027	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	52,833	56,767	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	56,282	60,360	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	68,858	74,543	2046/3/10

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55回住宅金融支援機構債券	1.41	157,790	168,041	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	1.42	232,569	247,751	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	1.44	78,089	83,259	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	1.21	164,612	173,769	2048/9/10
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券	1.82	20,001	21,141	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	162,515	169,373	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	65,500	68,137	2032/5/10
貸付債権担保第1回住宅金融公庫債券	1.75	26,764	27,495	2036/3/10
貸付債権担保第7回住宅金融公庫債券	1.82	56,040	57,728	2037/8/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	1.52	319,935	338,891	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	157,388	167,548	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	1.16	248,352	261,089	2047/9/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	171,884	182,692	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	163,626	173,232	2048/8/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	92,847	96,612	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	93,619	97,569	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	93,649	97,107	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	189,946	195,243	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	190,318	193,730	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	95,846	98,973	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	96,232	98,992	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	289,587	299,763	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	292,029	303,832	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	195,246	202,839	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	0.84	97,617	101,113	2050/9/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	0.725	100,000	103,095	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債(2014)	0.69	100,000	100,521	2019/1/29
小 計		48,158,183	51,196,816	
金融債券				
商工債券 利付第753回い号	0.25	100,000	100,391	2018/2/27
農林債券 利付第745回い号	0.35	100,000	100,347	2017/6/27
農林債券 利付第751回い号	0.3	200,000	200,848	2017/12/27
農林債券 利付第752回い号	0.3	100,000	100,454	2018/1/26
農林債券 利付第756回い号	0.3	100,000	100,547	2018/5/25
農林債券 利付第759回い号	0.4	100,000	100,864	2018/8/27
農林債券 利付第760回い号	0.4	100,000	100,906	2018/9/27
農林債券 利付第761回い号	0.3	100,000	100,666	2018/10/26
農林債券 利付第764回い号	0.35	100,000	100,837	2019/1/25
農林債券 利付第765回い号	0.3	300,000	302,139	2019/2/27
農林債券 利付第767回い号	0.3	300,000	302,151	2019/4/26
農林債券 利付第773回い号	0.24	300,000	301,803	2019/10/25
農林債券 利付第777回い号	0.25	300,000	301,977	2020/2/27
しんきん中金債券 利付第271回	0.35	350,000	351,256	2017/6/27
しんきん中金債券 利付第277回	0.25	100,000	100,355	2017/12/27
しんきん中金債券 利付第284回	0.4	100,000	100,846	2018/7/27
しんきん中金債券 利付第286回	0.35	100,000	100,807	2018/9/27
しんきん中金債券 利付第287回	0.3	100,000	100,692	2018/10/26
しんきん中金債券 利付第290回	0.3	100,000	100,725	2019/1/25

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	
しんきん中金債券 利付第302回	0.2	100,000	100,511	2020/1/27
商工債券 利付(3年)第172回	0.2	200,000	200,326	2017/5/26
商工債券 利付(3年)第174回	0.15	200,000	200,236	2017/7/27
商工債券 利付(3年)第178回	0.15	1,000,000	1,001,640	2017/11/27
商工債券 利付(3年)第181回	0.15	500,000	501,000	2018/2/27
商工債券 利付(3年)第182回	0.14	100,000	100,188	2018/3/27
商工債券 利付(10年)第5回	1.8	600,000	618,120	2017/12/20
あおぞら債券 利付(3年)第71回	0.19	400,000	400,636	2017/12/8
小 計		6,150,000	6,191,268	
普通社債券(含む投資法人債券)				
東京電力 第455回	2.075	200,000	208,500	2018/10/23
東京電力 第459回	2.7	100,000	106,256	2019/1/29
東京電力 第542回	1.602	100,000	102,413	2018/4/25
東京電力 第544回	1.976	100,000	103,457	2018/6/25
東京電力 第547回	1.948	100,000	105,972	2020/7/24
東京電力 第548回	2.347	100,000	111,369	2028/9/29
東京電力 第559回	1.377	100,000	102,991	2019/10/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	108,684	2029/12/10
東京電力 第565回	1.313	300,000	309,645	2020/6/24
中部電力 第482回	2.17	200,000	213,176	2019/6/25
中部電力 第500回	0.875	200,000	209,038	2024/5/24
関西電力 第448回	2.16	200,000	208,808	2018/6/20
関西電力 第469回	1.7	100,000	103,926	2018/10/25
関西電力 第482回	1.189	100,000	103,931	2020/7/24
関西電力 第484回	0.976	100,000	103,157	2020/10/23
関西電力 第496回	0.908	100,000	103,499	2025/2/25
関西電力 第497回	1.002	200,000	208,538	2025/6/20
関西電力 第498回	0.416	200,000	201,236	2020/9/18
中国電力 第314回	2.875	100,000	105,772	2018/4/25
中国電力 第330回	2.1	100,000	109,375	2021/3/25
中国電力 第377回	1.121	200,000	212,110	2023/8/25
中国電力 第378回	1.004	100,000	105,284	2023/10/25
北陸電力 第301回	1.158	100,000	106,084	2023/3/24
北陸電力 第304回	0.989	100,000	105,173	2023/10/25
北陸電力 第307回	1.055	100,000	105,825	2026/6/25
北陸電力 第308回	0.769	100,000	103,695	2024/9/25
東北電力 第431回	2.05	400,000	415,072	2018/3/23
東北電力 第473回	0.597	100,000	101,753	2021/4/23
東北電力 第475回	0.809	100,000	103,554	2024/9/25
東北電力 第481回	0.803	200,000	206,930	2025/7/25
四国電力 第281回	1.111	200,000	212,102	2023/9/25
九州電力 第400回	1.777	100,000	106,115	2020/4/24
九州電力 第409回	1.483	100,000	104,350	2019/8/23
九州電力 第420回	0.82	300,000	304,206	2018/4/25
九州電力 第424回	1.233	200,000	211,890	2023/11/24
北海道電力 第296回	2.027	100,000	104,158	2018/6/25
北海道電力 第316回	1.164	207,000	214,965	2020/6/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	107,836	2030/3/25

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
新日本製鐵 第30回社債間限定同順位特約付	3.175	100,000	104,503 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	105,472 2021/3/19
成田国際空港 第13回一般担保付	0.802	200,000	209,806 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	102,597 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	101,976 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	103,828 2024/5/8
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	100,643 2020/5/28
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	101,591 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	206,444 2025/2/28
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	103,984 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	102,944 2025/5/30
森ビル 第13回社債間限定同順位特約付	0.466	100,000	101,125 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	103,032 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	104,222 2018/6/20
レンゴー 第18回特定社債間限定同順位特約付	0.451	100,000	101,324 2021/9/3
住友化学 第43回社債間限定同順位特約付	1.58	100,000	105,899 2020/4/23
クレハ 第5回社債間限定同順位特約付	0.302	100,000	100,769 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	100,782 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	203,508 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	100,610 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	102,321 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	102,616 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	104,680 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	102,417 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	101,218 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	201,156 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	104,272 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	100,924 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	99,032 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	99,391 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	100,844 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	101,334 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	100,530 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	100,478 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	220,318 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	101,727 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	104,969 2022/9/20
富士通 第34回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	101,881 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	105,712 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	201,902 2020/3/19
ソニー 第26回	2.068	100,000	105,572 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	104,605 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	101,189 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	303,024 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	201,372 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	105,499 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	103,042 2025/2/26
ニコン 第20回特定社債間限定同順位特約付	0.652	100,000	103,286 2022/3/14

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	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付	1.358	100,000	105,983	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	212,212	2021/6/4
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付	0.436	100,000	100,533	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	105,512	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	209,118	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	108,707	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	104,719	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	102,676	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	105,299	2019/7/29
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付	0.451	200,000	203,900	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	100,546	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	202,412	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	102,601	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	102,446	2024/6/18
イオン 第16回社債間限定同順位特約付	1.01	100,000	102,273	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	103,959	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	206,372	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	123,239	2027/7/27
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	2,008,440	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	301,194	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	107,271	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	110,245	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	113,666	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	102,977	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	104,344	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	501,715	2018/1/23
三菱東京UFJ銀行 第12回(劣後特約付)	2.16	300,000	307,980	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	308,415	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	102,999	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	106,895	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	108,194	2019/6/20
りそな銀行 第6回劣後特約付	2.084	300,000	321,513	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付	1.68	100,000	107,428	2021/4/28
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付	1.389	300,000	321,579	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	100,670	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	104,380	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	102,498	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	206,470	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	100,372	2017/10/20
三井住友銀行 第24回劣後特約付	1.6	100,000	107,288	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	100,638	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	100,781	2019/5/23
NTTファイナンス 第45回社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	100,110	2017/6/20
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,671	2019/6/20
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	100,728	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	100,541	2019/6/20
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付	0.545	100,000	100,912	2021/12/3
オリエントコーポレーション 第2回社債間限定同順位特約付	0.45	200,000	201,170	2020/1/22

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	
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	101,784	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	100,381	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	102,480	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	102,352	2017/12/22
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	103,282	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	100,922	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	100,600	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	100,461	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	101,458	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	100,799	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	100,795	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	103,373	2025/8/12
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	106,733	2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	202,992	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	103,040	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	105,847	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	113,838	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	104,334	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	101,682	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	104,718	2022/9/14
東京建物	第17回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	103,997	2020/3/18
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	103,467	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	205,524	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	101,982	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	104,028	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	105,639	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	101,384	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	102,890	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	216,776	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	105,307	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	109,692	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	215,830	2030/6/12
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	111,212	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	226,884	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	208,946	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	120,925	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	113,159	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	122,680	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	106,414	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	106,217	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	249,552	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	112,194	2032/9/30
東海旅客鉄道	第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	120,055	2045/3/6
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	103,924	2027/4/30
三菱倉庫	第14回	0.442	100,000	101,601	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	201,234	2019/3/14
日本電信電話	第60回	1.31	100,000	105,706	2020/12/18
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	104,548	2023/12/20

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	
N T T ドコモ 第15回社債間限定同順位特約付	1.96	100,000	104,290	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	104,491	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	104,612	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	104,563	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	104,293	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	103,416	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	105,594	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	126,797	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	105,149	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	111,656	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	202,360	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	101,987	2022/12/16
ノルデア・バンク 第6回円貨社債(2014)	0.288	100,000	100,108	2017/5/26
新韓銀行 第5回円貨社債(2014)	0.39	200,000	199,336	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	102,281	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	200,708	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	193,356	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	97,283	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	91,853	2025/6/5
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	108,046	2021/2/16
パークレイズ・バンク・ビーエルシー 第7回円貨社債	0.478	100,000	99,963	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	200,656	2020/1/16
ラボバンク・ネダーランド 第16回円貨社債(2012)(コー)	1.142	100,000	101,177	2017/5/25
ラボバンク・ネダーランド 第18回円貨社債(2012)(コー)	0.778	100,000	101,014	2017/11/2
ラボバンク・ネダーランド 第25回円貨社債(2014)(コー)	0.434	100,000	100,695	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル 第6回円貨社債(2014)	0.552	200,000	202,162	2019/6/13
小 計		28,907,000	30,007,290	
合 計		587,551,203	652,739,697	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	652,739,697	98.7
コール・ローン等、その他	8,642,073	1.3
投資信託財産総額	661,381,770	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 (2016年3月31日現在)

項目	当期末
(A) 資産	661,381,770,545 円
コール・ローン等	3,278,047,781
公社債(評価額)	652,739,697,217
未収入金	4,413,142,000
未収利息	933,136,963
前払費用	17,746,584
(B) 負債	5,207,549,499
未払金	4,860,451,000
未払解約金	347,098,499
(C) 純資産総額(A-B)	656,174,221,046
元本	499,328,368,105
次期繰越損益金	156,845,852,941
(D) 受益権総口数	499,328,368,105口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,141円

(注) 期首元本額409,123百万円、期中追加設定元本額151,219百万円、期中一部解約元本額61,014百万円、計算口数当たり純資産額13,141円。

○損益の状況 (2015年4月1日～2016年3月31日)

項目	当期
(A) 配当等収益	6,249,401,619 円
受取利息	6,249,401,619
(B) 有価証券売買損益	27,558,166,933
売買益	28,422,612,543
売買損	△ 864,445,610
(C) 当期損益金(A+B)	33,807,568,552
(D) 前期繰越損益金	100,910,475,855
(E) 追加信託差損益金	38,498,203,654
(F) 解約差損益金	△ 16,370,395,120
(G) 計(C+D+E+F)	156,845,852,941
次期繰越損益金(G)	156,845,852,941

*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	377
野村世界6資産分散投信(安定コース)	17,103
野村世界6資産分散投信(分配コース)	20,341
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,467
野村資産設計ファンド2015	576
野村資産設計ファンド2020	300
野村資産設計ファンド2025	218
野村資産設計ファンド2030	133
野村資産設計ファンド2035	68
野村資産設計ファンド2040	144
野村日本債券インデックスファンド	1,533
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	257,355
のむラップ・ファンド(保守型)	8,061
のむラップ・ファンド(普通型)	3,815
のむラップ・ファンド(積極型)	652
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	19,402
野村資産設計ファンド2045	10
野村円債投資インデックスファンド	2,165
野村インデックスファンド・国内債券	1,029
マイ・ロード	31,707
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	199
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	69
野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	57

ファンド名	当期末
	元本額
野村日本債券インデックス (野村SMA・EW向け)	百万円 5,160
野村世界6資産分散投信 (配分変更コース)	1,213
野村資産設計ファンド2050	4
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)	1,088
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)	267
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)	12,002
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)	1,759
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)	50
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)	40
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)	7
野村インデックス・バランス60VA (適格機関投資家専用)	7,122
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)	385
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)	2,100
野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用)	930
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)	200
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)	390
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)	864
野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用)	1,865
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)	703
ノムラPOFs用インデックスファンド・国内債券 (適格機関投資家専用)	591
マイバランス30 (確定拠出年金向け)	11,247
マイバランス50 (確定拠出年金向け)	16,227
マイバランス70 (確定拠出年金向け)	7,198
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)	40,965
マイバランスDC30	6,155
マイバランスDC50	3,888
マイバランスDC70	1,171
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	7,890
マイターゲット2050 (確定拠出年金向け)	36
マイターゲット2030 (確定拠出年金向け)	0
マイターゲット2040 (確定拠出年金向け)	0

*単位未満は切り捨て。

○お知らせ

該当事項はございません。