

ファンドラップ (ウエルス・スクエア) 債券・安定型

運用報告書(全体版)

第6期 (決算日2022年3月29日)

作成対象期間 (2021年3月30日～2022年3月29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/内外/債券
信託期間	2016年10月20日以降、無期限とします。
運用方針	主として、世界の債券(主として、投資適格格付が付与されているもしくは同等の信用度を有すると判断される世界の公社債など)を 実質的な投資対象とする投資信託証券に投資し、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標に運用を行なうことを基本と します。 投資する投資信託証券については、実質的な外貨建資産については為替ヘッジを行なうことを基本とするもの、もしくはこれらに類す るものに限定することを基本とします。ただし、外貨建投資信託証券に投資する場合は、当該投資信託証券に対して為替変動リスクを 回避する目的で外国為替予約取引を用いる場合があります。 投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエアによる各投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析お よび投資環境等の定性判断等に基づく投資配分比率に関する助言をもとに各投資信託証券への配分比率を決定します。なお、組入投資 信託証券については適宜見直しを行ないます。
主な投資対象	主として有価証券に投資する投資信託証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金 融商品等に直接投資する場合があります。
主な投資制限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。
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、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ないません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



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/>

○最近5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 組 入 比 率	信 託 券 率	純 資 産 額
		税 分 配 金	騰 落 率					
2期(2018年3月29日)	円 9,779	円 0	% 0.2	% 98.6	% —	% —	% —	百万円 3,765
3期(2019年3月29日)	9,929	0	1.5	98.4	—	—	—	11,215
4期(2020年3月30日)	10,030	0	1.0	97.8	—	—	—	25,323
5期(2021年3月29日)	9,934	0	△1.0	79.1	—	—	19.9	30,031
6期(2022年3月29日)	9,665	0	△2.7	86.3	—	—	—	62,717

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「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。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、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		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	投 資 組 入 比 率	信 託 券 率
		騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2021年3月29日	円 9,934	% —	% —	% 79.1	% —	% —	% 19.9
3月末	9,914	△0.2	—	79.3	—	—	20.2
4月末	9,919	△0.2	—	88.9	—	—	9.9
5月末	9,923	△0.1	—	93.9	—	—	5.0
6月末	9,929	△0.1	—	93.9	—	—	4.9
7月末	9,991	0.6	—	92.8	—	—	4.9
8月末	9,983	0.5	—	93.9	—	—	5.0
9月末	9,937	0.0	—	92.0	—	—	7.0
10月末	9,925	△0.1	—	92.3	—	—	6.9
11月末	9,949	0.2	—	93.6	—	—	5.0
12月末	9,917	△0.2	—	93.9	—	—	5.0
2022年1月末	9,842	△0.9	—	96.5	—	—	2.0
2月末	9,774	△1.6	—	90.1	—	—	4.0
(期末) 2022年3月29日	9,665	△2.7	—	86.3	—	—	—

*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、「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。

*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



期首：9,934円

期末：9,665円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 2.7% (分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。作成期首(2021年3月29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す。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、個々の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9,934円から期末9,665円となりました。

(変動要因)

- ・国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンドが値下がりしたこと

○投資環境

<国内債券市場>

世界的に債券利回りが上昇する中、日銀は指し値オペを通知するなど緩和的な金融政策を継続する姿勢を強調したものの、海外の債券利回り上昇につれて、債券利回りは上昇し、当作成期間では値下がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

世界の債券（主として、投資適格格付が付与されているもしくは同等の信用度を有すると判断される世界の公社債など）を実質的な投資対象とする投資信託証券を主要投資対象とし、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標に運用を行ないました。

投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエア（以下「ウエルス・スクエア」という）からの助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案して指定投資信託証券の選定および投資信託証券への投資配分比率の決定を行ないました。

※なお、投資する投資信託証券については実質的な外貨建資産について、為替ヘッジを行なうことを基本とするもの、もしくはこれらに類するものに限定することを基本とします。

・投資信託証券組入比率

投資方針に基づいて、当作成期を通じて高位の組入れを維持しました。

・指定投資信託証券の見直し

ウエルス・スクエアからの助言に基づき、クレジット戦略型円建て債券マザーファンドを投資対象ファンドとして追加しました。

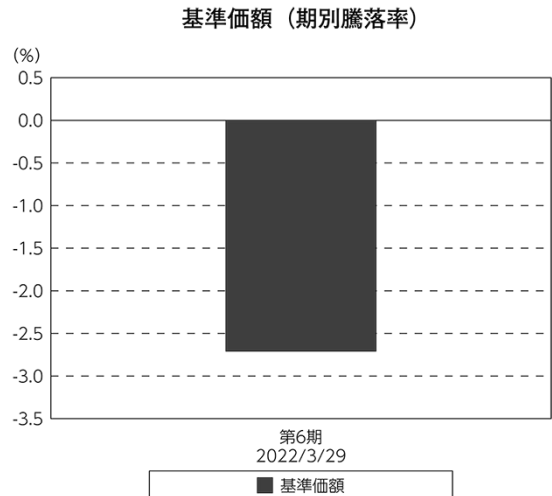
・指定投資信託証券の組入れ比率推移

ファンド名	期首	3月末	4月末	5月末	6月末	7月末	8月末	9月末	10月末	11月末	12月末	1月末	2月末	期末
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド	74.6%	74.7%	77.8%	81.6%	76.6%	66.7%	66.7%	63.8%	63.8%	65.7%	65.8%	68.6%	65.1%	64.9%
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	5.0%	5.0%	11.9%	12.9%	12.9%	13.0%	12.9%	10.9%	11.0%	11.0%	10.9%	10.0%	6.9%	3.0%
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド	—	—	—	—	4.9%	14.6%	14.9%	18.0%	17.9%	17.9%	17.9%	18.9%	19.0%	19.0%
バンガード・米国短期国債ETF	19.9%	20.2%	9.9%	5.0%	4.9%	4.9%	5.0%	7.0%	6.9%	5.0%	5.0%	2.0%	4.0%	—

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、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

収益分配金については、基準価額水準等を勘案して決定しました。

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いません。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第 6 期
	2021年 3月30日～ 2022年 3月29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	421

(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

投資信託証券への投資にあたっては、ウエルス・スクエアからの助言に基づき、定性評価・定量評価等を勘案して指定投資信託証券の選定および投資信託証券への配分比率の決定を行ないます。

ウエルス・スクエアはポートフォリオの構築にあたり、投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析および投資環境等の定性判断等に基づき、投資配分比率に関する助言を行ないます。

組入投資信託証券については適宜見直しを行ないます。

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

(2021年3月30日～2022年3月29日)

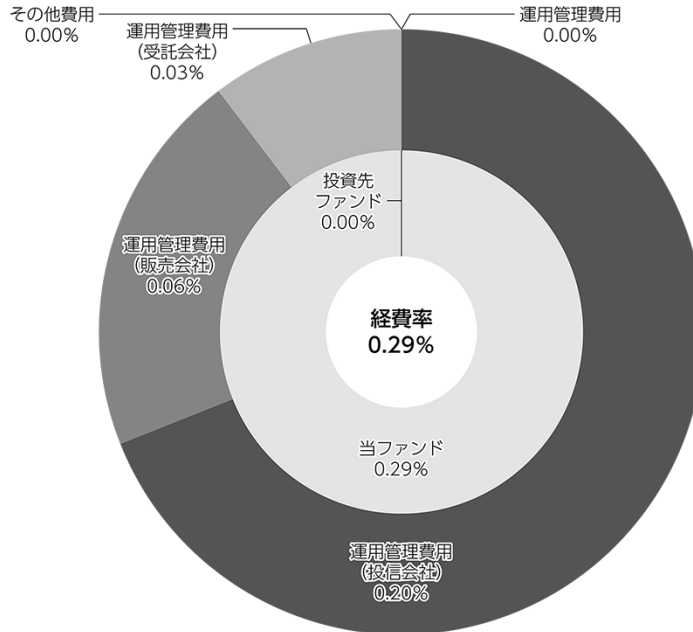
項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 28	% 0.286	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(20)	(0.198)	ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等
（ 販 売 会 社 ）	(5)	(0.055)	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等
（ 受 託 会 社 ）	(3)	(0.033)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.005	(b) 売買委託手数料＝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
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.005)	
（ 先 物 ・ オ プ シ ョ ン ）	(0)	(0.000)	
(c) 有 価 証 券 取 引 税	0	0.000	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 ※有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(0)	(0.000)	
(d) そ の 他 費 用	0	0.003	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(0)	(0.001)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.002)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	28	0.294	
期中の平均基準価額は、9,916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、有価証券取引税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。
- * 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。
- * 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。

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は0.29%です。



(単位: %)

経費率(①+②)	0.29
①当ファンドの費用の比率	0.29
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.00

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含み、投資先ファンドが支払った費用を含みません。

(注) 当ファンドの費用と投資先ファンドの費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注) 投資先ファンドには運用管理費用以外の費用がある場合がありますが、上記には含まれておりません。

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

○売買及び取引の状況

(2021年3月30日～2022年3月29日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国	アメリカ		千米ドル		千米ドル
	バンガード・米国短期国債ETF	545,300	33,230	1,431,500	87,021

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

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
	千口	千円	千口	千円
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	20,762,953	27,559,311	6,301,678	8,346,843
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	5,787,188	7,020,798	5,387,204	6,323,374
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド	11,592,619	12,180,008	24,404	25,700

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2021年3月30日～2022年3月29日)

利害関係人との取引状況

<ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型>
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>

区 分	買付額等 A			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
公社債	百万円 251,756	百万円 907	% 0.4	百万円 136,766	百万円 1,459	% 1.1

平均保有割合 4.0%

※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。

<外国債券為替ヘッジ型マザーファンド>

該当事項はございません。

<クレジット戦略型円建て債券マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$

平均保有割合 66.0%

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です。

○組入資産の明細

(2022年3月29日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた外貨建ファンドの明細

2022年3月29日現在の組入れはございません。

銘	柄	期首(前期末)
		口 数
(アメリカ) バンガード・米国短期国債ETF		口 886,200
合	計	886,200

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
		千口	千口	千円
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド		16,865,747	31,327,023	40,687,537
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド		1,227,842	1,627,825	1,857,349
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド		—	11,568,214	11,892,124

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2022年3月29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	40,687,537	64.6
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	1,857,349	2.9
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド	11,892,124	18.9
コール・ローン等、その他	8,556,548	13.6
投資信託財産総額	62,993,558	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*外国債券為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建純資産(86,074,828千円)の投資信託財産総額(86,542,082千円)に対する比率は99.5%です。

*当期末における外貨建純資産(2,812,749千円)の投資信託財産総額(62,993,558千円)に対する比率は4.5%です。

*外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=124.22円、1カナダドル=99.14円、1英ポンド=162.49円、1スウェーデンクローナ=13.07円、1ノルウェークローネ=14.24円、1デンマーククローネ=18.32円、1ユーロ=136.24円、1ズロチ=29.0174円、1シンガポールドル=91.24円、1人民元=19.4921円、1豪ドル=92.89円、1新シェケル=38.5451円、1メキシコペソ=6.1803円。

○特定資産の価格等の調査

クレジット戦略型円建て債券マザーファンドにおいて調査依頼を行なった取引は2021年2月9日から2022年2月1日までの間でスワップ取引1件でした。これらのスワップ取引について、投資信託及び投資法人に関する法律(昭和26年法律第198号)第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、取引先、通貨の種類、銘柄名、想定元本金額、取引スプレッドその他の当該スワップ取引の内容に関して、EY新日本有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年3月29日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	65,582,287,335
コール・ローン等	8,556,547,624
国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド(評価額)	40,687,537,532
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	1,857,349,184
クレジット戦略型円建て債券マザーファンド(評価額)	11,892,124,221
未収入金	2,588,728,774
(B) 負債	2,865,160,944
未払金	2,767,841,206
未払解約金	18,871,791
未払信託報酬	77,830,159
未払利息	679
その他未払費用	617,109
(C) 純資産総額(A-B)	62,717,126,391
元本	64,892,615,866
次期繰越損益金	△ 2,175,489,475
(D) 受益権総口数	64,892,615,866口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,665円

(注) 期首元本額は30,229,811,638円、期中追加設定元本額は40,154,896,317円、期中一部解約元本額は5,492,092,089円、1口当たり純資産額は0.9665円です。

○損益の状況（2021年3月30日～2022年3月29日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	19,214,943
受取配当金	19,344,902
受取利息	761
支払利息	△ 130,720
(B) 有価証券売買損益	△1,594,987,802
売買益	605,327,584
売買損	△2,200,315,386
(C) 信託報酬等	△ 132,961,136
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,708,733,995
(E) 前期繰越損益金	△ 13,494,814
(F) 追加信託差損益金	△ 453,260,666
(配当等相当額)	(2,088,880,920)
(売買損益相当額)	(△2,542,141,586)
(G) 計(D+E+F)	△2,175,489,475
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	△2,175,489,475
追加信託差損益金	△ 453,260,666
(配当等相当額)	(2,113,864,165)
(売買損益相当額)	(△2,567,124,831)
分配準備積立金	621,914,919
繰越損益金	△2,344,143,728

* 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（2021年3月30日～2022年3月29日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2021年3月30日～ 2022年3月29日
a. 配当等収益(経費控除後)	239,985,355円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	2,113,864,165円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	381,929,564円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	2,735,779,084円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	421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

- ①信託報酬率について、年0.308%（税抜年0.28%）から年0.264%（税抜年0.24%）へ引き下げる所要の約款変更を行ないました。
 <変更適用日：2021年6月24日>
- ②信託報酬率について、年0.264%（税抜年0.24%）から年0.286%（税抜年0.26%）へ引き上げる所要の約款変更を行ないました。
 <変更適用日：2021年12月16日>

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

運用報告書

第19期（決算日2021年3月31日）

作成対象期間（2020年4月1日～2021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

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<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
	期騰落率	期中率	NOMURA-BPI総合	期中率			
	円	%		%	%	%	百万円
15期(2017年3月31日)	12,991	△1.1	378.492	△1.2	99.5	—	687,986
16期(2018年4月2日)	13,114	0.9	381.893	0.9	99.6	—	672,515
17期(2019年4月1日)	13,342	1.7	388.518	1.7	99.3	—	663,317
18期(2020年3月31日)	13,340	△0.0	388.450	△0.0	98.1	—	679,315
19期(2021年3月31日)	13,248	△0.7	385.724	△0.7	99.5	—	735,829

*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	期中率	NOMURA-BPI総合	期中率		
(期首) 2020年3月31日	円	%		%	%	%
	13,340	—	388.450	—	98.1	—
4月末	13,385	0.3	389.790	0.3	98.9	—
5月末	13,328	△0.1	388.127	△0.1	99.5	—
6月末	13,276	△0.5	386.558	△0.5	99.2	—
7月末	13,322	△0.1	387.913	△0.1	99.0	—
8月末	13,261	△0.6	386.087	△0.6	99.0	—
9月末	13,299	△0.3	387.219	△0.3	99.1	—
10月末	13,278	△0.5	386.633	△0.5	99.0	—
11月末	13,296	△0.3	387.118	△0.3	99.4	—
12月末	13,298	△0.3	387.203	△0.3	99.3	—
2021年1月末	13,266	△0.6	386.252	△0.6	99.2	—
2月末	13,156	△1.4	383.056	△1.4	99.6	—
(期末) 2021年3月31日	円	%		%	%	%
	13,248	△0.7	385.724	△0.7	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

当運用期間では、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したことから基準価額は下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

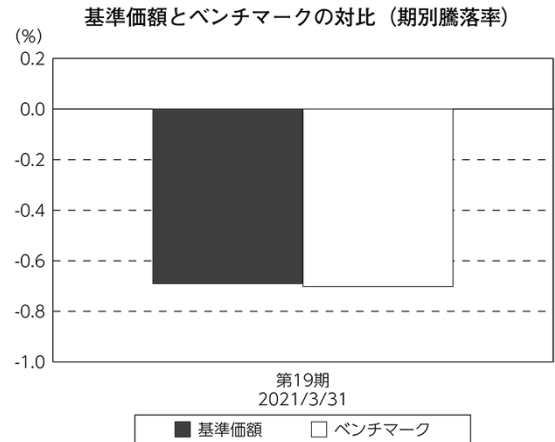
NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行い、満期構成、種別構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した債券銘柄に分散投資しました。指数構成銘柄に変更がある毎月末において、ファンドの特性値（デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は当運用期間を通じて高位に維持しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当運用期間の基準価額の騰落率は-0.7%となり、ベンチマークの-0.7%と同程度となりました。

(その他要因)

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。

今後とも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

(2020年4月1日～2021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

(2020年4月1日～2021年3月31日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	161,645,022	88,808,458
	地方債証券	8,748,076	5,511,688
	特殊債券	9,259,092	6,363,803
	社債券（投資法人債券を含む）	9,088,695	(807,197)
			10,747,465

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

○利害関係人との取引状況等

(2020年4月1日～2021年3月31日)

利害関係人との取引状況

区分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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	百万円 188,740	百万円 1,317	% 0.7	百万円 111,431	百万円 850	% 0.8

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021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	552,445,000 (2,460,000)	590,339,899 (3,500,913)	80.2 (0.5)	— (—)	53.7 (0.5)	18.2 (0.0)	8.3 (—)
地方債証券	48,556,100 (48,556,100)	50,873,297 (50,873,297)	6.9 (6.9)	— (—)	3.5 (3.5)	2.6 (2.6)	0.9 (0.9)
特殊債券 (除く金融債)	58,137,926 (58,137,926)	60,862,888 (60,862,888)	8.3 (8.3)	— (—)	4.2 (4.2)	2.7 (2.7)	1.3 (1.3)
金融債券	2,500,000 (2,500,000)	2,506,222 (2,506,222)	0.3 (0.3)	— (—)	— (—)	0.2 (0.2)	0.2 (0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	27,305,000 (27,305,000)	27,858,685 (27,858,685)	3.8 (3.8)	— (—)	2.3 (2.3)	1.3 (1.3)	0.2 (0.2)
合 計	688,944,026 (138,959,026)	732,440,992 (145,602,006)	99.5 (19.8)	— (—)	63.6 (10.4)	25.0 (6.8)	10.9 (2.6)

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

*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415回	0.1	3,700,000	3,711,359
国庫債券	利付(2年)第416回	0.1	3,000,000	3,009,810
国庫債券	利付(2年)第417回	0.1	3,200,000	3,211,296
国庫債券	利付(2年)第418回	0.1	4,400,000	4,416,412
国庫債券	利付(2年)第420回	0.1	500,000	502,065
国庫債券	利付(2年)第421回	0.1	3,500,000	3,515,470
国庫債券	利付(2年)第422回	0.1	600,000	602,880
国庫債券	利付(5年)第132回	0.1	3,000,000	3,008,220
国庫債券	利付(5年)第133回	0.1	6,200,000	6,220,522
国庫債券	利付(5年)第134回	0.1	2,500,000	2,509,900
国庫債券	利付(5年)第135回	0.1	8,500,000	8,539,355
国庫債券	利付(5年)第136回	0.1	3,300,000	3,317,622
国庫債券	利付(5年)第137回	0.1	4,000,000	4,023,800
国庫債券	利付(5年)第138回	0.1	5,500,000	5,536,795
国庫債券	利付(5年)第139回	0.1	5,600,000	5,639,200
国庫債券	利付(5年)第140回	0.1	3,900,000	3,929,601
国庫債券	利付(5年)第141回	0.1	4,500,000	4,536,090
国庫債券	利付(5年)第143回	0.1	5,570,000	5,618,793
国庫債券	利付(5年)第144回	0.1	4,500,000	4,540,995
国庫債券	利付(5年)第145回	0.1	4,900,000	4,946,207
国庫債券	利付(5年)第146回	0.1	2,100,000	2,119,404
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	2,360,000	3,401,279
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	900,000	1,259,937
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	900,000	1,266,300
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,130,000	1,597,345
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	1,200,000	1,643,016
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	1,300,000	1,755,650
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	1,400,000	1,821,344
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	1,500,000	1,825,710
国庫債券	利付(40年)第9回	0.4	2,050,000	1,871,978
国庫債券	利付(40年)第10回	0.9	2,010,000	2,147,082
国庫債券	利付(40年)第11回	0.8	1,750,000	1,814,715
国庫債券	利付(40年)第12回	0.5	2,070,000	1,939,983
国庫債券	利付(40年)第13回	0.5	5,020,000	4,698,218
国庫債券	利付(10年)第323回	0.9	1,700,000	1,721,267
国庫債券	利付(10年)第324回	0.8	3,200,000	3,236,128
国庫債券	利付(10年)第325回	0.8	4,400,000	4,459,972
国庫債券	利付(10年)第326回	0.7	2,100,000	2,129,862
国庫債券	利付(10年)第327回	0.8	3,100,000	3,149,414
国庫債券	利付(10年)第328回	0.6	5,250,000	5,325,547
国庫債券	利付(10年)第329回	0.8	6,000,000	6,124,860
国庫債券	利付(10年)第330回	0.8	3,800,000	3,888,084
国庫債券	利付(10年)第331回	0.6	1,900,000	1,934,618
国庫債券	利付(10年)第332回	0.6	5,900,000	6,019,180
国庫債券	利付(10年)第333回	0.6	3,600,000	3,678,804
国庫債券	利付(10年)第334回	0.6	6,600,000	6,756,816

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335回	0.5	4,600,000	4,700,188	2024/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第336回	0.5	2,750,000	2,813,717	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第337回	0.3	3,000,000	3,047,070	2024/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第338回	0.4	5,000,000	5,103,600	2025/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第339回	0.4	5,000,000	5,109,150	2025/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第340回	0.4	4,200,000	4,296,222	2025/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第341回	0.3	7,300,000	7,438,481	2025/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第342回	0.1	8,350,000	8,429,074	2026/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第343回	0.1	5,900,000	5,957,171	2026/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第344回	0.1	5,800,000	5,855,738	2026/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第345回	0.1	5,000,000	5,048,800	2026/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第346回	0.1	4,900,000	4,946,942	2027/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第347回	0.1	5,400,000	5,452,218	2027/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第348回	0.1	6,800,000	6,863,988	2027/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第349回	0.1	2,800,000	2,826,404	2027/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第350回	0.1	6,150,000	6,207,933	2028/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第351回	0.1	7,700,000	7,766,759	2028/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第352回	0.1	6,600,000	6,654,252	2028/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第353回	0.1	5,100,000	5,139,372	2028/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第354回	0.1	4,350,000	4,379,406	2029/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第355回	0.1	5,100,000	5,131,365	2029/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第356回	0.1	4,800,000	4,826,352	2029/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第357回	0.1	1,900,000	1,909,063	2029/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第358回	0.1	5,470,000	5,491,934	2030/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第359回	0.1	5,600,000	5,617,920	2030/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第360回	0.1	7,900,000	7,914,852	2030/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第361回	0.1	6,900,000	6,906,624	2030/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	500,000	616,505	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第2回	2.4	500,000	604,265	2030/2/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	192,644	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,143,288	2030/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	181,602	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	600,000	743,694	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	742,080	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	118,746	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	265,000	302,630	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	277,105	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	188,963	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	271,189	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	354,751	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,021,800	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,164,339	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,187,944	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,546,344	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	2,200,000	2,812,458	2035/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第19回	2.3	2,050,000	2,627,034	2035/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第20回	2.5	1,270,000	1,667,903	2035/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第21回	2.3	300,000	386,493	2035/12/20

銘柄	当期末				
	利	率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券 利付 (30年) 第22回		2.5	600,000	792,480	2036/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第23回		2.5	840,000	1,112,202	2036/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第24回		2.5	700,000	929,747	2036/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第25回		2.3	500,000	650,125	2036/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第26回		2.4	850,000	1,121,124	2037/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第27回		2.5	1,550,000	2,078,689	2037/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第28回		2.5	1,200,000	1,617,096	2038/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第29回		2.4	1,500,000	2,004,630	2038/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第30回		2.3	1,700,000	2,250,851	2039/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第31回		2.2	1,200,000	1,572,876	2039/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第32回		2.3	1,200,000	1,599,132	2040/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第33回		2.0	2,400,000	3,079,752	2040/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第34回		2.2	1,600,000	2,120,752	2041/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第35回		2.0	2,300,000	2,971,025	2041/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第36回		2.0	2,000,000	2,591,440	2042/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第37回		1.9	2,300,000	2,944,322	2042/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第38回		1.8	1,600,000	2,021,696	2043/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第39回		1.9	1,600,000	2,058,224	2043/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第40回		1.8	1,300,000	1,646,385	2043/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第41回		1.7	1,500,000	1,871,055	2043/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第42回		1.7	1,600,000	1,997,600	2044/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第43回		1.7	1,300,000	1,626,222	2044/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第44回		1.7	1,400,000	1,752,898	2044/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第45回		1.5	1,700,000	2,056,133	2044/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第46回		1.5	1,800,000	2,178,234	2045/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第47回		1.6	1,700,000	2,097,171	2045/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第48回		1.4	1,900,000	2,258,055	2045/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第49回		1.4	2,900,000	3,447,665	2045/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第50回		0.8	1,900,000	1,995,513	2046/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第51回		0.3	2,650,000	2,473,139	2046/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第52回		0.5	1,900,000	1,860,062	2046/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第53回		0.6	1,700,000	1,701,887	2046/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第54回		0.8	1,700,000	1,782,382	2047/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第55回		0.8	1,500,000	1,571,520	2047/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第56回		0.8	1,900,000	1,989,072	2047/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第57回		0.8	1,600,000	1,673,680	2047/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第58回		0.8	2,100,000	2,194,920	2048/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第59回		0.7	1,600,000	1,631,696	2048/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第60回		0.9	1,150,000	1,228,464	2048/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第61回		0.7	1,000,000	1,016,510	2048/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第62回		0.5	500,000	482,250	2049/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第63回		0.4	1,400,000	1,311,842	2049/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第64回		0.4	1,500,000	1,401,480	2049/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第65回		0.4	1,200,000	1,119,264	2049/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第66回		0.4	2,600,000	2,426,736	2050/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第67回		0.6	1,300,000	1,277,757	2050/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第68回		0.6	1,950,000	1,916,401	2050/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第69回		0.7	2,350,000	2,370,398	2050/12/20

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額 償還年月日
国債証券	%	千円	千円
国庫債券 利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	123,112 2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	215,191 2022/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	185,371 2022/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	237,235 2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	800,506 2022/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	306,684 2023/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	449,156 2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	312,921 2023/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	420,180 2023/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	480,348 2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	315,894 2023/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	328,742 2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	310,126 2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	597,195 2024/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	584,161 2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	215,064 2024/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第72回	2.1	1,470,000	1,584,027 2024/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第73回	2.0	1,200,000	1,295,064 2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第74回	2.1	800,000	866,368 2024/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	652,962 2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	983,073 2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	758,996 2025/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	868,160 2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	936,909 2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第80回	2.1	1,400,000	1,531,138 2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	394,041 2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	901,221 2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,512,589 2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,319,208 2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	443,704 2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	1,700,000	1,902,708 2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	557,125 2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,237,533 2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	526,296 2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,687,470 2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	282,617 2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	650,000	731,009 2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	337,008 2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	225,870 2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	100,000	114,696 2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	453,792 2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	300,000	343,710 2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	341,763 2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	1,100,000	1,258,620 2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	820,000	947,993 2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	292,515 2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	587,475 2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	700,632 2028/6/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	461,304	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,199,744	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	466,092	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	348,639	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,834,704	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,035,000	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,282,501	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	942,720	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,106,342	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	2,000,000	2,348,820	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第114回	2.1	1,700,000	2,004,317	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	1,000,000	1,187,700	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,311,123	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	1,400,000	1,656,200	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	588,930	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	927,624	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	912,952	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	1,200,000	1,405,956	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	900,000	1,045,998	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	500,000	597,130	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,184,620	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	400,000	483,132	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	1,200,000	1,425,708	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	500,000	589,105	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	1,800,000	2,126,664	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	2,600,000	3,045,562	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	1,400,000	1,644,076	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	931,192	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,516,593	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,648,066	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	1,400,000	1,651,902	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	700,000	818,391	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	810,824	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,171,660	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	919,664	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	1,000,000	1,160,620	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	2,300,000	2,700,499	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	2,600,000	3,058,874	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	950,000	1,128,590	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	1,300,000	1,517,139	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	1,300,000	1,501,903	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	2,300,000	2,716,346	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	2,400,000	2,839,752	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	4,000,000	4,691,760	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	2,100,000	2,440,410	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	3,850,000	4,480,129	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	3,330,000	3,836,559	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	2,500,000	2,816,900	2034/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	2,650,000	2,987,742	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	1,600,000	1,828,160	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	1,220,000	1,378,014	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	5,350,000	5,890,403	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	5,650,000	5,726,783	2036/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	2,990,000	2,937,914	2036/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	2,100,000	2,155,713	2036/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第159回	0.6	2,000,000	2,080,700	2036/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	2,300,000	2,425,396	2037/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第161回	0.6	2,100,000	2,180,556	2037/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第162回	0.6	1,700,000	1,763,427	2037/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第163回	0.6	2,600,000	2,694,146	2037/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第164回	0.5	2,600,000	2,649,712	2038/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第165回	0.5	2,200,000	2,239,028	2038/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第166回	0.7	2,300,000	2,414,632	2038/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第167回	0.5	2,600,000	2,638,636	2038/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第168回	0.4	2,700,000	2,688,714	2039/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第169回	0.3	2,530,000	2,470,241	2039/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第170回	0.3	2,000,000	1,948,820	2039/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第171回	0.3	1,500,000	1,458,630	2039/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第172回	0.4	3,840,000	3,796,492	2040/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第173回	0.4	3,250,000	3,209,895	2040/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第174回	0.4	3,340,000	3,295,344	2040/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第175回	0.5	4,600,000	4,620,700	2040/12/20
メキシコ合衆国	第25回円貨社債 (2018)	0.6	100,000	99,634	2023/4/20
	小 計		552,445,000	590,339,899	
地方債証券					
東京都	公募第708回	0.89	100,000	101,068	2022/6/20
東京都	公募第710回	0.81	100,000	100,970	2022/6/20
東京都	公募第712回	0.77	100,000	101,114	2022/9/20
東京都	公募第715回	0.76	100,000	101,283	2022/12/20
東京都	公募第716回	0.77	200,000	202,602	2022/12/20
東京都	公募第731回	0.635	100,000	101,826	2024/3/19
東京都	公募第736回	0.505	100,000	101,680	2024/9/20
東京都	公募第745回	0.533	300,000	306,477	2025/6/20
東京都	公募第760回	0.045	100,000	99,999	2026/9/18
東京都	公募第761回	0.075	100,000	100,163	2026/9/18
東京都	公募第769回	0.21	500,000	504,175	2027/6/18
東京都	公募第778回	0.165	100,000	100,588	2028/3/17
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	133,930	2038/9/17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	263,116	2039/9/20
東京都	公募第1回	1.54	300,000	310,167	2023/6/20
東京都	公募 (20年) 第3回	2.26	200,000	213,292	2024/3/19
東京都	公募第7回	2.16	100,000	109,556	2025/9/19
東京都	公募 (20年) 第13回	2.15	100,000	113,882	2027/12/20
東京都	公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	229,210	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第17回	2.09	200,000	230,436	2028/12/20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	118,712	2030/12/20

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26回	1.74	100,000	116,509	2032/6/18
東京都	公募 (20年) 第29回	1.57	200,000	231,230	2033/9/20
北海道	公募平成24年度第6回	0.84	100,000	101,157	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回	0.79	100,000	101,214	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回	0.58	300,000	303,447	2023/4/26
北海道	公募平成26年度第13回	0.461	100,000	101,610	2024/12/26
北海道	公募平成27年度第7回	0.529	100,000	102,193	2025/8/28
北海道	公募平成29年度第5回	0.18	200,000	201,180	2027/6/30
北海道	公募平成29年度第6回	0.01	700,000	699,860	2022/7/28
北海道	公募平成29年度第7回	0.21	100,000	100,798	2027/8/31
北海道	公募平成29年度第9回	0.205	100,000	100,784	2027/10/27
北海道	公募平成30年度第15回	0.291	269,280	269,772	2038/9/24
宮城県	公募第32回2号	0.105	100,000	100,328	2026/9/28
神奈川県	公募第196回	0.678	100,000	101,305	2023/3/20
神奈川県	公募第200回	0.825	100,000	102,004	2023/9/20
神奈川県	公募第205回	0.664	100,000	101,913	2024/3/19
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	102,041	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	203,206	2024/12/20
神奈川県	公募第212回	0.42	100,000	101,585	2025/3/19
神奈川県	公募第231回	0.22	200,000	201,940	2027/12/20
神奈川県	公募第247回	0.12	200,000	199,090	2030/6/20
神奈川県	公募 (30年) 第3回	2.62	100,000	133,750	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	338,433	2027/3/19
神奈川県	公募 (20年) 第14回	1.969	100,000	116,586	2030/7/19
神奈川県	公募 (20年) 第17回	1.975	200,000	235,998	2031/7/11
神奈川県	公募 (20年) 第26回	1.477	100,000	114,891	2034/6/20
大阪府	公募第378回	0.7	104,000	105,857	2023/11/28
大阪府	公募第381回	0.683	100,000	101,902	2024/2/27
大阪府	公募第382回	0.674	100,000	101,927	2024/3/28
大阪府	公募第383回	0.695	100,000	102,042	2024/4/26
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	102,022	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	305,010	2024/8/28
大阪府	公募第389回	0.53	100,000	101,787	2024/10/30
大阪府	公募第396回	0.554	200,000	204,346	2025/5/28
大阪府	公募第417回	0.248	102,000	103,037	2027/2/26
大阪府	公募第423回	0.185	100,000	100,638	2027/8/30
大阪府	公募第429回	0.197	179,000	180,313	2028/2/25
大阪府	公募第452回	0.062	100,000	99,102	2030/1/30
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	117,900	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	116,869	2031/12/22
大阪府	公募 (5年) 第141回	0.001	230,000	229,921	2022/8/30
大阪府	公募 (5年) 第178回	0.001	400,000	399,448	2025/12/25
京都府	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	101,093	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回	0.8	100,000	101,224	2022/10/21
京都府	公募平成25年度第15回	0.66	200,000	203,800	2024/3/19
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	114,694	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回	0.564	200,000	203,766	2024/9/19
京都府	公募 (20年) 平成27年度第5回	1.23	200,000	224,254	2035/8/17

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
京都府	公募 (15年) 平成27年度第8回	0.78	100,000	105,734	2030/10/11
京都府	公募 (20年) 平成28年度第5回	0.327	100,000	98,935	2036/8/15
京都府	公募平成29年度第4回	0.19	100,000	100,712	2027/6/21
兵庫県	公募平成26年度第17回	0.46	100,000	101,679	2025/2/26
兵庫県	公募平成29年度第22回	0.19	100,000	100,676	2028/1/21
兵庫県	公募 (30年) 第2回	2.36	200,000	265,950	2040/3/19
兵庫県	公募 (15年) 第1回	1.66	300,000	325,584	2026/7/29
兵庫県	公募 (15年) 第3回	1.35	200,000	215,838	2027/7/16
兵庫県	公募 (12年) 第3回	0.56	300,000	306,417	2025/4/16
兵庫県	公募 (15年) 第11回	0.718	100,000	104,917	2030/5/10
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	114,695	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	117,864	2029/11/19
兵庫県	公募 (20年) 第11回	1.84	200,000	230,522	2030/8/16
兵庫県	公募 (20年) 第14回	1.72	100,000	116,067	2032/5/24
兵庫県	公募 (20年) 第22回	1.4	100,000	113,851	2034/9/8
静岡県	公募平成24年度第5回	0.849	100,060	101,147	2022/7/20
静岡県	公募平成24年度第10回	0.678	100,000	101,309	2023/3/22
静岡県	公募平成25年度第5回	0.926	101,000	103,134	2023/7/25
静岡県	公募平成26年度第3回	0.679	165,000	168,430	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回	0.564	100,000	101,892	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回	0.554	200,000	203,802	2024/10/24
静岡県	公募平成27年度第11回	0.11	115,400	115,914	2026/3/19
静岡県	公募平成28年度第2回	0.08	300,000	300,891	2026/3/19
静岡県	公募平成29年度第3回	0.17	100,000	100,624	2027/3/19
静岡県	公募 (31年) 第1回	0.095	174,000	173,587	2029/3/19
静岡県	公募 (15年) 第5回	1.087	200,000	214,900	2028/11/20
静岡県	公募 (15年) 第9回	0.739	100,000	105,208	2030/9/20
静岡県	公募 (20年) 第11回	1.841	100,000	115,780	2030/10/18
静岡県	公募 (20年) 第14回	1.736	200,000	232,932	2032/6/18
静岡県	公募 (20年) 第18回	1.473	100,000	114,902	2034/7/10
静岡県	公募 (20年) 第30回	0.449	200,000	197,314	2040/9/20
愛知県	公募平成20年度第8回	2.04	100,000	114,835	2028/12/20
愛知県	公募 (20年) 平成24年度第4回	1.687	100,000	115,903	2032/6/11
愛知県	公募平成24年度第8回	0.835	150,000	151,740	2022/8/29
愛知県	公募 (15年) 平成24年度第14回	1.314	400,000	433,064	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回	1.829	100,000	118,119	2033/2/8
愛知県	公募 (30年) 平成25年度第8回	2.024	120,000	155,031	2043/6/19
愛知県	公募平成26年度第8回	1.814	100,000	125,505	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回	1.363	100,000	113,617	2034/11/14
愛知県	公募平成26年度第17回	0.463	300,000	305,190	2025/2/26
愛知県	公募 (15年) 平成27年度第2回	0.74	100,000	105,187	2030/4/26
愛知県	公募平成27年度第15回	0.471	100,000	102,099	2025/11/27
愛知県	公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,798	2027/8/31
愛知県	公募平成29年度第9回	0.15	100,000	100,482	2027/9/15
広島県	公募平成24年度第4回	0.81	100,000	101,322	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回	0.8	200,000	203,904	2023/9/25
広島県	公募平成26年度第5回	0.33	109,650	110,949	2025/1/27
広島県	公募平成26年度第7回	0.46	200,000	203,502	2025/3/25

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	
広島県	公募平成29年度第3回	0.15	100,000	100,484	2027/9/27
広島県	公募平成29年度第4回	0.22	211,300	213,326	2027/11/24
広島県	公募令和2年度第2回	0.165	100,000	99,907	2030/7/22
埼玉県	公募平成24年度第4回	0.84	300,000	303,261	2022/7/25
埼玉県	公募平成25年度第4回	0.921	100,000	102,098	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回	0.806	148,000	150,917	2023/9/27
埼玉県	公募平成25年度第10回	0.67	100,000	101,892	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回	0.655	100,000	101,898	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第3回	0.67	100,000	102,038	2024/5/20
埼玉県	公募平成26年度第6回	0.554	200,000	203,718	2024/9/26
埼玉県	公募平成26年度第7回	0.476	400,000	406,812	2024/12/25
埼玉県	公募平成26年度第9回	0.429	100,000	101,596	2025/2/25
埼玉県	公募平成27年度第9回	0.235	100,000	101,054	2026/2/25
埼玉県	公募平成28年度第5回	0.05	100,000	100,026	2026/7/28
埼玉県	公募平成30年度第4回	0.205	200,000	201,580	2028/6/26
埼玉県	公募平成30年度第7回	0.02	200,000	200,016	2023/10/26
埼玉県	公募(15年)第1回	0.941	100,000	106,817	2029/10/19
埼玉県	公募(15年)第2回	0.869	200,000	212,780	2030/5/22
埼玉県	公募(15年)第3回	0.43	100,000	102,078	2032/1/30
埼玉県	公募(25年)第2回	0.781	200,000	207,964	2042/9/19
埼玉県	公募(20年)第6回	2.26	100,000	116,075	2028/9/21
埼玉県	公募(20年)第16回	1.216	100,000	111,928	2035/8/14
埼玉県	公募(20年)第20回	0.626	100,000	103,185	2037/5/15
福岡県	公募平成26年度第1回	0.654	100,000	102,051	2024/6/26
福岡県	公募平成27年度第1回	0.578	300,000	307,074	2025/6/26
福岡県	公募平成29年度第1回	0.2	100,000	100,775	2027/6/23
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	108,043	2026/11/27
福岡県	公募(15年)平成27年度第1回	0.784	200,000	211,638	2030/11/25
福岡県	公募(15年)令和元年度第1回	0.254	100,000	99,083	2034/6/14
福岡県	公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	134,435	2037/9/18
福岡県	公募(30年)平成26年度第1回	1.827	100,000	125,772	2044/6/20
福岡県	公募(30年・定時償還)平成29年度第2回	0.937	100,000	105,934	2047/12/20
福岡県	公募(20年)平成20年度第2回	2.05	100,000	114,911	2028/12/20
福岡県	公募(20年)平成22年度第2回	2.116	300,000	357,174	2031/2/21
福岡県	公募(20年)平成24年度第2回	1.635	100,000	115,448	2032/8/16
千葉県	公募平成24年度第2回	0.91	100,000	101,029	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第7回	0.74	100,000	101,253	2022/12/22
千葉県	公募平成24年度第8回	0.84	100,000	101,503	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第3回	0.89	100,000	101,953	2023/6/23
千葉県	公募平成25年度第4回	0.92	100,000	102,099	2023/7/25
千葉県	公募平成26年度第1回	0.679	100,000	102,023	2024/4/25
千葉県	公募平成26年度第3回	0.611	200,000	203,916	2024/7/25
千葉県	公募平成27年度第6回	0.469	200,000	204,250	2025/12/25
千葉県	公募平成28年度第4回	0.085	200,000	200,436	2026/9/25
千葉県	公募平成29年度第4回	0.15	100,000	100,483	2027/9/24
千葉県	公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,798	2028/3/24
千葉県	公募(20年)第1回	2.06	400,000	438,484	2025/12/19
千葉県	公募(20年)第8回	2.18	100,000	118,136	2030/4/19

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	
千葉県 公募(20年) 第16回	1.555	200,000	231,632	2034/4/14
千葉県 公募(20年) 第17回	1.403	100,000	114,131	2034/10/13
群馬県 公募第12回	0.519	100,000	102,177	2025/8/15
群馬県 公募(20年) 第3回	1.687	100,000	115,892	2032/6/25
岐阜県 公募平成26年度第1回	0.554	186,670	190,151	2024/9/30
共同発行市場地方債 公募第110回	0.89	200,000	202,012	2022/5/25
共同発行市場地方債 公募第111回	0.89	200,000	202,156	2022/6/24
共同発行市場地方債 公募第112回	0.84	100,000	101,087	2022/7/25
共同発行市場地方債 公募第113回	0.77	800,000	808,472	2022/8/25
共同発行市場地方債 公募第114回	0.82	243,700	246,604	2022/9/22
共同発行市場地方債 公募第115回	0.8	100,000	101,233	2022/10/25
共同発行市場地方債 公募第116回	0.8	200,000	202,598	2022/11/25
共同発行市場地方債 公募第118回	0.84	100,000	101,503	2023/1/25
共同発行市場地方債 公募第119回	0.8	200,000	202,988	2023/2/24
共同発行市場地方債 公募第120回	0.68	300,000	303,948	2023/3/24
共同発行市場地方債 公募第121回	0.57	100,000	101,148	2023/4/25
共同発行市場地方債 公募第122回	0.62	400,000	405,208	2023/5/25
共同発行市場地方債 公募第124回	0.91	300,000	306,225	2023/7/25
共同発行市場地方債 公募第126回	0.81	100,000	101,977	2023/9/25
共同発行市場地方債 公募第128回	0.66	700,000	711,900	2023/11/24
共同発行市場地方債 公募第129回	0.71	100,000	101,887	2023/12/25
共同発行市場地方債 公募第130回	0.76	100,000	102,088	2024/1/25
共同発行市場地方債 公募第132回	0.66	100,000	101,911	2024/3/25
共同発行市場地方債 公募第136回	0.611	200,000	203,916	2024/7/25
共同発行市場地方債 公募第137回	0.566	500,000	509,255	2024/8/23
共同発行市場地方債 公募第139回	0.544	155,000	157,893	2024/10/25
共同発行市場地方債 公募第143回	0.448	540,000	549,018	2025/2/25
共同発行市場地方債 公募第145回	0.406	1,000,000	1,015,670	2025/4/25
共同発行市場地方債 公募第154回	0.405	300,000	305,556	2026/1/23
共同発行市場地方債 公募第156回	0.1	200,000	200,796	2026/3/25
共同発行市場地方債 公募第157回	0.08	300,000	300,528	2026/4/24
共同発行市場地方債 公募第161回	0.06	300,000	300,240	2026/8/25
共同発行市場地方債 公募第172回	0.225	600,000	605,652	2027/7/23
共同発行市場地方債 公募第184回	0.175	100,000	100,581	2028/7/25
共同発行市場地方債 公募第186回	0.25	400,000	404,308	2028/9/25
共同発行市場地方債 公募第188回	0.264	300,000	303,522	2028/11/24
共同発行市場地方債 公募第190回	0.16	610,000	612,055	2029/1/25
共同発行市場地方債 公募第191回	0.14	100,000	100,130	2029/2/22
共同発行市場地方債 公募第200回	0.07	100,000	99,358	2029/11/22
共同発行市場地方債 公募第213回	0.125	300,000	298,419	2030/12/25
堺市 公募平成22年度第1回	1.97	100,000	117,055	2030/11/19
堺市 公募平成26年度第1回	1.664	100,000	122,133	2044/9/20
島根県 公募(30年) 平成29年度第1回	0.919	100,000	105,531	2047/6/20
佐賀県 公募平成28年度第1回	0.08	100,000	100,084	2026/11/30
福島県 公募平成26年度第1回	0.495	200,000	203,474	2024/11/28
滋賀県 公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,682	2023/11/29
滋賀県 公募平成26年度第1回	0.495	142,000	144,466	2024/11/28
栃木県 公募平成24年度第1回	0.79	100,000	101,293	2022/11/30

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	
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,682	2023/11/29
熊本市	公募平成29年度第1回	0.19	100,000	100,763	2027/11/30
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	237,670	2023/12/26
新潟市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,904	2027/12/24
浜松市	公募平成26年度第1回	0.335	100,000	101,201	2025/1/23
大阪市	公募平成25年度第6回	0.694	100,000	101,787	2023/11/22
大阪市	公募平成26年度第5回	0.593	100,000	101,997	2024/9/27
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	109,025	2026/7/17
大阪市	公募(20年)第1回	2.3	300,000	344,025	2027/11/15
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	117,635	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	116,137	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	100,000	116,690	2032/12/21
大阪市	公募(20年)第26回	0.635	100,000	103,086	2037/10/23
名古屋市	公募第481回	0.744	100,000	101,256	2022/12/20
名古屋市	公募第488回	0.598	300,000	306,009	2024/9/20
名古屋市	公募第489回	0.461	100,000	101,640	2024/12/20
名古屋市	公募第501回	0.175	200,000	201,292	2027/9/29
名古屋市	公募第503回	0.205	100,000	100,832	2028/3/24
名古屋市	公募第504回	0.205	200,000	201,650	2028/6/20
名古屋市	公募第512回	0.15	300,000	299,451	2030/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	208,538	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	106,525	2029/11/16
京都市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,860	2027/8/25
京都市	公募平成29年度第4回	0.235	101,280	102,347	2028/1/31
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	109,377	2025/9/19
京都市	公募(20年)第5回	2.36	200,000	226,150	2026/12/18
京都市	公募(20年)第6回	2.38	100,000	114,833	2027/9/17
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	113,589	2034/11/24
京都市	公募(20年)第15回	0.487	200,000	202,256	2036/11/28
神戸市	公募平成26年度第17回	0.28	300,000	302,982	2025/1/27
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	200,352	2026/4/17
神戸市	公募平成30年度第2回	0.845	200,000	207,040	2048/3/19
横浜市	公募公債平成24年度2回	0.815	200,000	202,478	2022/10/17
横浜市	公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	202,772	2023/5/19
横浜市	公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	203,352	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	203,338	2024/12/13
横浜市	公募平成28年度第5回	0.23	300,000	302,904	2027/2/19
横浜市	公募平成29年度第3回	0.22	100,000	100,919	2027/8/13
横浜市	公募(30年)第2回	2.49	200,000	258,222	2035/3/20
横浜市	公募(20年)第18回	2.21	100,000	116,923	2029/5/25
横浜市	公募(20年)第26回	1.776	100,000	117,466	2033/1/28
横浜市	公募(20年)第30回	1.376	100,000	113,798	2034/10/20
札幌市	公募(15年)平成23年度第9回	1.493	200,000	216,706	2027/2/12
札幌市	公募(20年)平成24年度第1回	1.79	100,000	116,892	2032/4/23
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	1.794	100,000	117,727	2033/2/28
札幌市	公募平成26年度第4回	0.54	100,000	101,674	2024/6/20
札幌市	公募平成26年度第9回	0.43	200,000	203,050	2024/12/20
川崎市	公募第85回	0.72	100,000	101,214	2022/12/20

銘柄	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	
川崎市	公募 (20年) 第17回	1.527	100,000	114,868	2033/5/9
川崎市	公募 (20年) 第19回	1.362	100,000	113,541	2034/9/20
川崎市	公募 (30年) 第11回	0.817	100,000	102,882	2048/3/19
北九州市	公募 (10年) 令和2年度第2回	0.125	200,000	198,756	2030/12/24
北九州市	公募 (20年) 第3回	2.33	200,000	228,924	2027/9/21
北九州市	公募 (20年) 第14回	1.732	100,000	116,666	2032/11/12
福岡市	公募 (20年) 平成21年度第3回	2.14	200,000	233,684	2029/9/18
福岡市	公募 (20年) 平成23年度第4回	1.89	100,000	117,197	2031/8/19
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	115,056	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	101,853	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	162,833	2025/3/25
広島市	公募平成26年度第2回	0.456	100,000	101,628	2024/12/25
広島市	公募平成27年度第2回	0.464	500,000	510,505	2025/12/25
広島市	公募 (10年) 平成30年度第6回	0.146	241,000	241,426	2029/2/22
千葉県	公募平成26年度第2回	0.505	200,000	203,546	2024/11/27
三重県	公募平成24年度第1回	0.801	140,660	142,395	2022/10/25
三重県	公募平成28年度第1回	0.165	155,000	155,885	2026/12/25
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	100,922	2023/4/26
福井県	公募平成27年度第4回	0.085	200,000	200,404	2026/4/27
山梨県	公募平成24年度第1回	0.8	200,000	202,478	2022/10/28
岡山県	公募平成28年度第2回	0.205	168,900	170,312	2027/3/31
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	115,540	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	351,120	2029/12/20
福岡北九州高速道路債券	第117回	2.26	100,000	115,022	2028/12/20
福岡北九州高速道路債券	第136回	0.833	100,000	104,655	2030/3/19
小 計			48,556,100	50,873,297	
特殊債券(除く金融債)					
政保	地方公共団体金融機構債券 第37回	0.895	604,000	610,662	2022/6/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第38回	0.839	194,000	196,135	2022/7/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第39回	0.801	100,000	101,123	2022/8/15
政保	地方公共団体金融機構債券 第40回	0.819	101,000	102,233	2022/9/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第41回	0.791	102,000	103,276	2022/10/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第42回	0.805	108,000	109,438	2022/11/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第43回	0.734	202,000	204,589	2022/12/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第44回	0.834	145,000	147,225	2023/1/20
政保	地方公共団体金融機構債券 第45回	0.815	223,000	226,487	2023/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第48回	0.605	500,000	506,390	2023/5/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第49回	0.882	13,000	13,252	2023/6/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	102,076	2023/7/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第56回	0.747	591,000	603,221	2024/1/19
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	118,302	2024/4/12
政保	地方公共団体金融機構債券 第64回	0.544	100,000	101,823	2024/9/13
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	407,416	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	320,000	324,956	2025/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	192,861	2025/5/23
政保	地方公共団体金融機構債券 第78回	0.381	509,000	517,622	2025/11/18
政保	地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回	0.173	500,000	502,310	2024/1/29
政保	地方公共団体金融機構債券 第83回	0.02	116,000	115,998	2026/4/17

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	
政保	地方公共団体金融機構債券 第108回	0.145	157,000	157,891	2028/5/19
政保	地方公共団体金融機構債券 第110回	0.13	100,000	100,399	2028/7/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第113回	0.219	110,000	111,106	2028/10/16
新関西	国際空港債券 政府保証第1回	0.801	151,000	152,742	2022/8/29
新関西	国際空港債券 政府保証第2回	0.882	191,000	194,760	2023/6/27
新関西	国際空港債券 政府保証第5回	0.145	117,000	117,699	2027/3/30
原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券	政府保証第16回	0.001	300,000	299,937	2023/11/27
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	104,875	2023/6/19
日本政策投資銀行社債	政府保証第16回	0.819	102,000	103,254	2022/9/20
日本政策投資銀行社債	政府保証第19回	0.668	159,000	161,124	2023/3/15
日本政策投資銀行社債	政府保証第38回	0.001	1,500,000	1,500,450	2023/2/17
日本政策投資銀行社債	政府保証第42回	0.155	300,000	302,004	2027/12/15
日本政策投資銀行社債	政府保証第55回	0.105	300,000	300,000	2029/3/19
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	233,766	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	234,284	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99回	2.2	200,000	236,292	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106回	2.1	200,000	235,380	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	232,444	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	129,153	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163回	0.901	1,000,000	1,010,680	2022/5/31
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	124,971	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	101,134	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	115,503	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第170回	0.801	218,000	220,524	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	114,732	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	380,460	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	202,506	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	202,558	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	202,614	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	900,000	914,040	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	116,970	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	198,181	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	405,208	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	1,000,000	1,019,740	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	277,464	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	305,625	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	139,597	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	147,759	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	115,027	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	123,621	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	115,063	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	300,000	306,117	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	123,752	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	193,503	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229回	0.539	630,000	641,818	2024/10/31
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	101,686	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	500,000	555,540	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241回	0.45	200,000	203,476	2025/3/31

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第261回	0.381	401,000	407,833	2025/11/28
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	151,036	2026/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第297回	0.085	100,000	100,286	2026/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第306回	0.145	403,000	405,409	2027/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第315回	0.13	100,000	100,498	2027/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第321回	0.155	600,000	604,026	2027/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第324回	0.09	100,000	100,226	2027/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第335回	0.84	100,000	103,735	2047/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第339回	0.195	500,000	504,645	2028/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第342回	0.145	131,000	131,729	2028/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第351回	0.145	100,000	100,504	2028/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第354回	0.13	200,000	200,802	2028/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第357回	0.209	100,000	100,951	2028/8/31
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	360,000	366,372	2023/10/20
関西国際空港債券	政府保証第54回	2.4	300,000	350,292	2028/6/23
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	368,000	372,964	2023/3/22
中部国際空港債券	政府保証第22回	0.001	300,000	299,925	2024/3/1
預金保険機構債券	政府保証第230回	0.1	300,000	300,846	2024/8/6
預金保険機構債券	政府保証第231回	0.1	300,000	300,885	2024/10/4
新関西国際空港社債	財投機関債第6回	1.445	300,000	328,422	2028/9/15
新関西国際空港社債	財投機関債第9回	1.231	100,000	108,097	2028/12/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	107,181	2029/9/20
新関西国際空港社債	財投機関債第22回	0.05	200,000	199,972	2023/12/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第31回	0.781	300,000	303,414	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	107,027	2029/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第78回	0.225	200,000	201,378	2027/4/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第82回	0.27	100,000	100,935	2027/7/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第86回	0.235	300,000	302,334	2027/10/13
日本政策投資銀行社債	財投機関債第96回	0.195	200,000	200,720	2028/7/12
道路債券	財投機関債第17回	1.54	300,000	307,911	2022/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第4回	2.59	100,000	130,731	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	223,840	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	112,269	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	300,000	342,612	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	304,988	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39回	2.37	200,000	232,906	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	117,852	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89回	1.711	100,000	115,622	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100回	0.784	200,000	202,666	2022/12/20
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	101,291	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	405,944	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	117,936	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107回	0.935	100,000	102,034	2023/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第116回	0.722	400,000	406,948	2023/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第122回	0.704	100,000	102,016	2024/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第123回	0.69	100,000	101,974	2024/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第130回	0.56	200,000	203,378	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第134回	0.529	200,000	203,180	2024/6/20

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	
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	203,796	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	351,960	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	119,043	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157回	0.857	100,000	105,902	2030/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第164回	1.149	100,000	110,176	2035/9/20
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	92,372	2056/3/17
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第188回	0.614	100,000	102,117	2037/9/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第260回	0.651	200,000	195,200	2050/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第13回	2.28	130,000	134,353	2022/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第28回	2.83	400,000	523,100	2033/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第33回	2.91	100,000	132,697	2034/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第38回	2.26	1,000,000	1,077,170	2024/9/20
公営企業債券	30年第4回財投機関債	2.95	100,000	132,788	2034/3/24
地方公営企業等金融機構債券(20年)	第1回	2.07	100,000	114,713	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券	20年第4回	2.12	100,000	116,708	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券	F16回	2.042	100,000	111,179	2027/1/7
地方公共団体金融機構債券	20年第6回	2.242	300,000	354,600	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券	F24回	1.681	100,000	103,278	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第10回	1.752	300,000	342,864	2030/8/28
地方公共団体金融機構債券	F104回	1.314	100,000	105,046	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券	F106回	1.259	100,000	103,662	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券	F122回	1.412	100,000	108,039	2027/6/18
地方公共団体金融機構債券	F124回	1.418	100,000	108,027	2027/6/4
地方公共団体金融機構債券	第37回	0.852	400,000	404,184	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券	F132回	1.09	500,000	522,905	2025/7/30
地方公共団体金融機構債券	第41回	0.801	600,000	607,494	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券	F142回	1.016	100,000	103,626	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券	F145回	1.059	200,000	208,154	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	F147回	1.291	100,000	107,065	2027/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	101,316	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	101,427	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F160回	1.052	100,000	106,497	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第29回	1.725	100,000	116,689	2033/6/28
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	600,000	611,880	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	305,880	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	215,490	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	114,404	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	F240回	1.069	300,000	322,983	2030/2/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	101,913	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	113,714	2034/9/28
地方公共団体金融機構債券	第74回	0.519	300,000	306,324	2025/7/28
地方公共団体金融機構債券	第77回	0.491	100,000	102,105	2025/10/28
地方公共団体金融機構債券	第79回	0.484	400,000	408,592	2025/12/26
地方公共団体金融機構債券	第95回	0.2	200,000	201,208	2027/4/28
地方公共団体金融機構債券	第101回	0.235	400,000	403,396	2027/10/28
公営企業債券(20年)	第2回財投機関債	1.45	100,000	102,482	2022/12/20
公営企業債券(20年)	第5回財投機関債	2.11	200,000	210,338	2023/9/20
公営企業債券(20年)	第19回財投機関債	2.37	100,000	112,939	2026/12/18

銘柄	当期末		
	利率	額面金額	評価額 償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円
公営企業債券 (20年) 第20回財投機関債	2.25	100,000	112,784 2027/3/24
公営企業債券 (20年) 第24回財投機関債	2.29	100,000	115,171 2028/4/25
公営企業債券 (20年) 第25回財投機関債	2.5	100,000	117,001 2028/6/20
都市再生債券 財投機関債第96回	0.599	200,000	203,906 2024/9/20
都市再生債券 財投機関債第97回	1.017	100,000	106,943 2029/9/20
都市再生債券 財投機関債第101回	0.935	100,000	106,290 2029/11/20
都市再生債券 財投機関債第109回	0.918	100,000	106,455 2030/6/20
都市再生債券 財投機関債第113回	0.851	300,000	317,718 2030/9/20
都市再生債券 財投機関債第121回	0.482	200,000	205,072 2031/2/20
都市再生債券 財投機関債第127回	0.075	100,000	99,891 2026/9/18
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	2.26	100,000	109,238 2025/6/20
東京交通債券 第342回	2.4	200,000	205,826 2022/6/21
東京交通債券 第347回	2.05	157,000	166,261 2024/3/8
福祉医療機構債券 第31回財投機関債	0.93	100,000	101,123 2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	2.26	400,000	450,988 2027/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第6回	2.46	200,000	228,880 2027/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回	2.15	100,000	105,268 2023/9/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回	1.94	100,000	107,547 2025/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	2.11	100,000	117,291 2030/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回	1.95	100,000	116,334 2030/10/22
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回	2.066	100,000	118,368 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	325,971 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	118,338 2031/7/11
住宅金融支援機構債券 財投機関債第85回	1.841	200,000	232,938 2031/10/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回	1.595	200,000	216,938 2026/12/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	1.836	100,000	117,376 2032/11/12
住宅金融支援機構債券 財投機関債第123回	1.801	100,000	116,830 2032/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回	2.273	100,000	131,936 2042/9/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第132回	1.092	200,000	213,202 2028/3/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	1.31	100,000	108,366 2028/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第143回	1.192	100,000	107,789 2028/10/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第177回	0.484	250,000	255,170 2025/12/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回	0.155	300,000	300,852 2026/12/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	0.403	100,000	101,031 2032/11/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第244回	0.274	130,000	131,176 2028/8/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第301回	0.04	300,000	299,928 2025/12/19
成田国際空港 第13回一般担保付	0.802	200,000	202,908 2023/2/8
成田国際空港 第17回	0.489	400,000	406,584 2025/2/20
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第6回	2.04	200,000	216,806 2025/6/20
国際協力機構債券 第6回財投機関債	2.098	200,000	236,022 2030/12/13
東日本高速道路 第61回	0.14	200,000	198,932 2029/7/31
中日本高速道路 第63回	0.576	100,000	102,353 2025/11/13
中日本高速道路 第79回	0.04	300,000	299,940 2024/8/19
西日本高速道路 第20回	0.759	200,000	203,606 2023/9/20
西日本高速道路 第22回	0.744	400,000	408,296 2024/3/19
西日本高速道路 第23回	0.602	100,000	101,792 2024/6/20
西日本高速道路 第30回	0.17	300,000	301,149 2026/5/22
西日本高速道路 第50回	0.04	200,000	199,966 2024/6/20

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	
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第57回	0.835	300,000	305,436	2023/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第62回	0.714	100,000	101,875	2023/12/20
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	203,682	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	113,838	2034/8/4
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第71回	0.525	500,000	508,950	2024/11/27
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第90回	0.2	300,000	298,827	2031/5/30
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	28,431	28,443	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	53,635	54,249	2039/6/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	32,019	32,288	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	35,682	36,687	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	11,122	11,308	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	24,136	24,688	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	27,768	28,921	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	30,945	31,126	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	49,964	51,152	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	53,820	54,582	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	47,976	49,247	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	77,898	80,140	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	13,391	13,884	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	20,661	22,122	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	66,873	71,174	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	11,720	11,842	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	64,656	68,016	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	23,604	23,869	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	79,515	84,157	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	64,354	67,856	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	36,752	39,169	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	78,813	83,495	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	81,531	85,186	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	124,833	130,606	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	120,600	126,920	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	78,046	81,821	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	29,434	31,082	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	64,030	67,835	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	40,357	41,973	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	87,898	91,508	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	39,108	40,682	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	22,170	22,479	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	117,561	123,175	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	25,110	26,769	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	27,170	28,993	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	25,312	26,907	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	27,323	29,006	2046/3/10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	78,558	82,932	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	111,222	117,232	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	37,127	39,157	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	76,806	80,291	2048/9/10
貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券		1.82	10,265	10,336	2036/5/10

銘柄	当 期 末		
	利 率	額 面 金 額	評 価 額
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円
貸付債権担保S種第14回住宅金融支援機構債券	1.7	46,550	46,574
貸付債権担保S種第15回住宅金融支援機構債券	1.65	18,996	19,006
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	2.25	72,192	76,534
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	1.82	73,071	77,611
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	1.52	134,480	141,182
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	80,366	84,800
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	1.16	131,952	137,893
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	1.07	115,059	119,602
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	89,550	94,263
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	75,868	79,505
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	1.04	184,444	191,871
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	1.01	319,753	332,140
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	48,694	50,402
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	50,684	52,524
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	51,924	53,598
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	109,014	111,802
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	114,502	116,558
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	60,519	62,267
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	64,313	65,976
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	191,736	197,662
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	197,769	204,684
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	132,800	137,297
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	0.84	64,768	66,841
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	0.89	65,349	67,627
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	0.41	242,898	244,250
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	0.48	162,800	164,528
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	0.46	164,048	165,542
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	0.47	81,986	82,793
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	0.46	163,854	165,351
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	0.4	82,632	83,069
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	0.43	83,037	83,628
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	0.46	84,470	85,219
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	0.42	337,656	339,708
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	0.43	254,952	256,637
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	0.42	170,066	171,074
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	0.46	173,062	174,513
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	0.39	176,570	177,163
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	0.39	88,301	88,590
貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	0.44	89,084	89,745
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	0.38	89,671	89,933
貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	0.32	273,804	273,324
貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	0.33	275,004	274,629
貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	0.21	471,440	465,938
貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	0.33	190,682	190,338
貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	0.3	192,240	191,378
貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	0.33	298,476	297,744
貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券	0.36	199,644	199,747
貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券	0.41	300,000	301,416

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167回住宅金融支援機構債券	0.41	200,000	200,904	2056/4/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券(2014)	0.725	100,000	101,818	2024/7/30
小計		58,137,926	60,862,888	
金融債券				
商工債券 利付第806回い号	0.1	300,000	300,258	2022/7/27
商工債券 利付第811回い号	0.17	300,000	300,705	2022/12/27
商工債券 利付第815回い号	0.17	100,000	100,270	2023/4/27
商工債券 利付第818回い号	0.17	100,000	100,291	2023/7/27
商工債券 利付第819回い号	0.18	300,000	300,975	2023/8/25
商工債券 利付第829回い号	0.13	200,000	200,354	2024/6/27
商工債券 利付第831回い号	0.08	200,000	200,028	2024/8/27
商工債券 利付第833回い号	0.05	100,000	99,855	2024/10/25
しんきん中金債券 利付第335回	0.1	200,000	200,222	2022/10/27
商工債券 利付(3年)第236回	0.02	500,000	499,890	2022/9/27
商工債券 利付(10年)第15回	0.48	200,000	203,374	2025/9/19
小計		2,500,000	2,506,222	
普通社債券(含む投資法人債券)				
東京電力 第548回	2.347	100,000	111,181	2028/9/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	110,191	2029/12/10
中部電力 第500回	0.875	200,000	205,122	2024/5/24
中部電力 第524回	0.39	100,000	101,154	2027/5/25
中部電力 第530回	0.274	200,000	199,660	2029/6/25
関西電力 第509回	0.47	100,000	101,424	2027/5/25
関西電力 第511回	0.41	100,000	100,985	2027/9/17
関西電力 第527回	0.28	200,000	201,228	2024/4/25
関西電力 第535回	0.18	200,000	200,374	2025/12/19
中国電力 第377回	1.121	100,000	102,584	2023/8/25
中国電力 第378回	1.004	100,000	102,444	2023/10/25
中国電力 第400回	0.34	100,000	100,767	2027/9/24
中国電力 第402回	0.25	100,000	100,602	2024/10/25
北陸電力 第301回	1.158	100,000	102,202	2023/3/24
北陸電力 第307回	1.055	100,000	104,674	2026/6/25
北陸電力 第308回	0.769	100,000	102,375	2024/9/25
北陸電力 第326回	0.719	100,000	101,127	2038/4/23
東北電力 第475回	0.809	100,000	102,514	2024/9/25
東北電力 第481回	0.803	200,000	205,814	2025/7/25
東北電力 第484回	0.758	100,000	102,187	2036/5/23
東北電力 第491回	0.42	100,000	101,254	2027/2/25
東北電力 第521回	0.45	100,000	100,975	2030/5/24
四国電力 第281回	1.111	100,000	102,624	2023/9/25
九州電力 第424回	1.233	100,000	103,110	2023/11/24
九州電力 第428回	0.936	105,000	107,972	2024/7/25
九州電力 第449回	0.43	200,000	202,572	2027/4/23
九州電力 第451回	0.45	100,000	101,395	2027/5/25
九州電力 第476回	0.43	100,000	100,873	2029/5/25
九州電力 第484回	0.375	200,000	200,670	2029/11/22
北海道電力 第321回	0.886	100,000	102,888	2024/12/25
北海道電力 第323回	1.337	100,000	108,456	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	
北海道電力 第338回	0.84	100,000	102,912	2036/11/25
北海道電力 第345回	0.27	300,000	301,761	2024/9/25
東京電力パワーグリッド 第6回	0.85	100,000	101,869	2027/8/31
東京電力パワーグリッド 第11回	0.79	300,000	303,741	2028/1/25
東京電力パワーグリッド 第14回	0.43	100,000	100,677	2023/7/24
東京電力パワーグリッド 第28回	1.01	100,000	102,167	2029/7/10
東京電力パワーグリッド 第35回	1.2	100,000	103,655	2030/4/23
東京電力パワーグリッド 第38回	0.58	200,000	202,422	2025/7/16
東京電力パワーグリッド 第40回	1.37	400,000	418,808	2035/7/13
長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付	0.47	200,000	199,572	2030/7/12
大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付	0.69	100,000	99,996	2036/11/28
日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付	0.03	200,000	199,786	2023/7/14
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	100,280	2024/3/8
日本たばこ産業 第13回	0.355	100,000	100,254	2028/9/8
三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付	0.41	100,000	98,833	2027/8/31
トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	101,297	2023/9/20
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	197,676	2026/8/28
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	0.97	100,000	98,811	2038/5/17
セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付	0.06	100,000	100,034	2023/12/20
セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約付	0.28	200,000	200,736	2027/12/20
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	0.375	100,000	100,153	2027/7/16
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,822	2028/7/18
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	0.734	200,000	198,262	2028/10/25
王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	0.425	100,000	100,737	2028/1/26
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	100,039	2027/9/13
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	99,821	2028/6/19
三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,469	2029/5/30
三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付	0.83	100,000	99,456	2040/6/11
電通 第3回社債間限定同順位特約付	0.424	100,000	100,095	2028/10/25
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	100,084	2024/5/31
オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	100,091	2025/9/17
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	99,282	2024/12/6
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	0.37	100,000	98,781	2026/7/31
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	0.45	100,000	97,389	2029/6/25
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	0.295	100,000	100,222	2027/4/21
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付	0.385	300,000	298,416	2028/6/20
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	99,315	2026/5/27
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,045	2025/7/14
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	0.3	200,000	199,624	2027/3/1
LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付	0.01	300,000	299,679	2023/7/18
荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,889	2025/10/22
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	215,658	2028/12/13
日本電気 第48回社債間限定同順位特約付	0.658	100,000	100,673	2022/7/15
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付	0.47	200,000	202,196	2026/9/18
パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付	0.08	100,000	100,006	2023/12/22
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	100,048	2025/12/24
ソニー 第32回	0.28	100,000	100,383	2023/9/20
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	99,379	2027/6/7

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
三菱重工	第35回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,936 2027/8/27
J A 三井リース	第8回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	100,468 2024/9/13
三井住友トラスト・バナソニックファイナンス	第2回社債間限定	0.25	100,000	100,181 2022/10/31
トヨタ自動車	第14回社債間限定同等特約付	0.963	100,000	101,806 2023/3/20
楽天カード	第3回社債間限定同順位特約付	0.42	100,000	99,299 2026/12/11
ドンキホーテホールディングス	第12回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	100,493 2024/3/21
ニコソ	第22回特定社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	99,816 2025/12/2
豊田通商	第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	103,826 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	207,542 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	107,172 2029/7/13
住友商事	第49回社債間限定同順位特約付	1.286	100,000	106,882 2029/1/29
住友商事	第53回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	100,165 2027/7/26
丸井グループ	第28回社債間限定同順位特約付	0.543	200,000	200,908 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	102,385 2024/4/24
クレディセゾン	第65回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	100,476 2027/7/30
イオン	第20回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	102,086 2024/6/28
三菱UFJフィナンシャル・グループ	第1回劣後特約付	0.94	100,000	101,715 2024/6/26
りそなホールディングス	第20回社債間限定同順位特約付	0.27	100,000	100,152 2025/7/23
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	203,280 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	114,270 2027/7/27
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	103,384 2022/10/27
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	304,341 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	101,714 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	105,283 2030/5/29
三井住友信託銀行	第1回劣後特約付	1.389	300,000	305,148 2022/9/20
三井住友信託銀行	第18回社債間限定同順位特約付	0.16	200,000	199,954 2026/1/27
セブン銀行	第10回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	101,380 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	101,415 2024/12/20
セブン銀行	第12回社債間限定同順位特約付	0.39	300,000	303,276 2027/9/17
みずほフィナンシャルグループ	第1回劣後特約付	0.95	200,000	202,958 2024/7/16
みずほ銀行	第7回劣後特約付	2.87	100,000	112,571 2026/11/6
芙蓉総合リース	第26回社債間限定同順位特約付	0.03	200,000	199,378 2023/10/20
みずほリース	第3回社債間限定同順位特約付	0.24	300,000	300,645 2025/7/15
みずほリース	第7回社債間限定同順位特約付	0.33	200,000	199,872 2028/1/20
NTTファイナンス	第2回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,471 2026/12/18
NTTファイナンス	第18回日本電信電話保証付	0.38	200,000	201,210 2030/9/20
トヨタファイナンス	第81回社債間限定同順位特約付	0.265	100,000	99,806 2027/10/22
リコーリース	第28回社債間限定同順位特約付	0.345	100,000	99,948 2027/7/20
アコム	第77回特定社債間限定同順位特約付	0.274	100,000	100,017 2023/8/30
ジャックス	第19回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,205 2023/6/15
日立キャピタル	第61回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	100,513 2026/6/19
日立キャピタル	第80回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	99,025 2029/10/19
三井住友ファイナンス&リース	第27回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	99,965 2026/10/16
三菱UFJリース	第52回社債間限定同順位特約付	0.375	100,000	100,597 2027/7/13
三菱UFJリース	第56回社債間限定同順位特約付	0.455	100,000	101,137 2028/1/18
三菱UFJリース	第76回社債間限定同順位特約付	0.37	300,000	299,280 2030/1/23
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	102,100 2025/8/12
三井不動産	第71回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	197,246 2030/4/16

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
三菱地所	第120回担保提供制限等財務上特約無	0.24	100,000	99,706 2027/6/18
東京建物	第25回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	100,334 2027/3/19
ダイビル	第19回特定社債間限定同順位特約付	0.96	100,000	96,424 2039/7/19
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	102,289 2024/1/26
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	102,005 2023/6/26
野村不動産オフィスファンド投資法人	第7回特定投資法人債間限定	2.9	100,000	115,181 2028/3/17
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	101,695 2024/8/30
東武鉄道	第124回社債間限定同順位特約付	0.001	100,000	99,704 2023/11/27
相鉄ホールディングス	第32回相模鉄道株式会社保証付	0.58	200,000	202,782 2025/1/28
東京急行電鉄	第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	109,243 2033/6/3
東京急行電鉄	第83回社債間限定同順位特約付	0.459	200,000	202,214 2031/4/22
小田急電鉄	第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	214,224 2030/6/12
小田急電鉄	第74回社債間限定同順位特約付	0.756	100,000	101,619 2037/5/29
東日本旅客鉄道	第57回社債間限定同順位特約付	2.376	200,000	232,586 2028/12/12
東日本旅客鉄道	第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	115,196 2030/9/27
東日本旅客鉄道	第106回社債間限定同順位特約付	0.981	100,000	106,415 2035/1/29
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	113,425 2045/1/27
東日本旅客鉄道	第133回社債間限定同順位特約付	1.246	100,000	108,180 2058/9/27
東日本旅客鉄道	第145回社債間限定同順位特約付	0.771	200,000	186,832 2059/12/23
西日本旅客鉄道	第13回社債間限定同順位特約付	2.34	100,000	112,689 2027/2/19
西日本旅客鉄道	第15回社債間限定同順位特約付	2.26	300,000	341,229 2027/12/20
西日本旅客鉄道	第65回社債間限定同順位特約付	0.24	200,000	199,630 2030/8/27
西日本旅客鉄道	第66回社債間限定同順位特約付	0.629	200,000	200,138 2040/8/27
東海旅客鉄道	第17回社債間限定同順位特約付	2.21	200,000	214,864 2024/9/20
東海旅客鉄道	第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	234,580 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	110,048 2032/9/30
東海旅客鉄道	第73回社債間限定同順位特約付	1.014	300,000	320,313 2035/1/26
東海旅客鉄道	第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	118,970 2045/3/6
東京地下鉄	第22回	0.215	100,000	100,246 2027/6/21
東京地下鉄	第23回	0.661	100,000	101,343 2037/6/19
東京地下鉄	第24回	1.035	100,000	104,952 2047/6/21
西武ホールディングス	第1回社債間限定同順位特約付	0.758	200,000	199,832 2032/3/17
西日本鉄道	第45回社債間限定同順位特約付	0.717	100,000	102,733 2031/3/4
阪急阪神ホールディングス	第47回	1.202	400,000	429,672 2029/7/18
阪急阪神ホールディングス	第49回	0.817	100,000	102,600 2036/12/15
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	103,558 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	99,683 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	99,040 2036/7/14
日本郵船	第32回社債間限定同順位特約付	2.13	100,000	105,775 2031/9/9
横浜高速鉄道	第2回社債間限定同順位特約付	0.455	100,000	100,535 2027/2/23
九州旅客鉄道	第2回社債間限定同順位特約付	0.929	200,000	200,880 2049/3/5
九州旅客鉄道	第4回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	96,896 2039/12/9
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	91,129 2036/6/9
澁澤倉庫	第8回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	99,462 2023/6/14
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	101,805 2023/12/20
KDDI	第25回社債間限定同順位特約付	0.395	100,000	99,991 2028/11/22
電源開発	第39回社債間限定同順位特約付	0.929	100,000	102,486 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	102,622 2024/6/20

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	
電源開発 第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	102,361	2024/8/20
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	0.415	100,000	101,097	2027/7/20
電源開発 第59回社債間限定同順位特約付	0.414	100,000	100,827	2028/9/20
東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	124,669	2043/12/17
東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	94,282	2039/9/13
大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付	0.642	100,000	94,603	2049/6/4
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,344	2024/3/14
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	98,068	2034/12/12
広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付	0.405	100,000	100,357	2028/9/13
東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付	0.18	100,000	99,895	2023/7/5
ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付	0.405	100,000	101,056	2028/6/6
ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付	1.569	100,000	100,924	2024/6/12
フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第29回円貨社債	0.25	200,000	199,406	2024/10/10
フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第31回円貨社債	0.423	100,000	98,904	2029/10/10
ビー・ビー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	0.45	100,000	100,186	2026/6/17
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	102,127	2024/11/28
クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債(2018)	0.204	100,000	99,739	2023/6/8
クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債(2018)	0.509	100,000	99,453	2028/6/8
スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)	1.043	100,000	100,595	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	100,728	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	100,978	2026/9/25
ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第6回円貨社債	0.65	100,000	100,381	2023/5/30
ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債	0.968	100,000	99,262	2028/5/30
サンタンデール銀行 第1回円貨社債	0.568	100,000	99,990	2023/1/11
フランス電力 第4回円貨社債(2017)	1.088	100,000	102,314	2027/1/26
現代キャピタル・サービシズ・インク 第15回円貨社債	0.65	200,000	196,070	2023/8/2
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債(2017)	0.967	100,000	100,823	2024/3/1
ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	0.32	200,000	199,848	2023/7/6
オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債	0.293	200,000	200,264	2024/1/23
ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債(2017)	0.448	100,000	99,983	2022/5/26
小 計		27,305,000	27,858,685	
合 計		688,944,026	732,440,992	

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 732,440,992	% 98.8
コール・ローン等、その他	9,002,388	1.2
投資信託財産総額	741,443,380	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 (2021年3月31日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	741,443,380,268
コール・ローン等	6,658,847,151
公社債(評価額)	732,440,992,596
未収入金	1,527,665,360
未収利息	798,689,638
前払費用	17,185,523
(B) 負債	5,613,526,512
未払金	5,020,835,000
未払解約金	592,685,149
未払利息	6,363
(C) 純資産総額(A-B)	735,829,853,756
元本	555,429,500,070
次期繰越損益金	180,400,353,686
(D) 受益権総口数	555,429,500,070口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,248円

(注) 期首元本額は509,213,794,132円、期中追加設定元本額は109,094,889,019円、期中一部解約元本額は62,879,183,081円、1口当たり純資産額は1.3248円です。

○損益の状況 (2020年4月1日～2021年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,636,811,966
受取利息	5,639,165,376
支払利息	△ 2,353,410
(B) 有価証券売買損益	△ 10,484,385,273
売買益	397,903,581
売買損	△ 10,882,288,854
(C) 当期損益金(A+B)	△ 4,847,573,307
(D) 前期繰越損益金	170,101,972,795
(E) 追加信託差損益金	35,853,917,336
(F) 解約差損益金	△ 20,707,963,138
(G) 計(C+D+E+F)	180,400,353,686
次期繰越損益金(G)	180,400,353,686

* 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
	円
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	160,072,020,061
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)	50,684,248,245
マイバランス50(確定拠出年金向け)	48,012,057,740
野村世界6資産分散投信(安定コース)	41,279,288,281
マイバランス30(確定拠出年金向け)	36,957,694,659
マイ・ロード	33,474,705,153
マイバランス70(確定拠出年金向け)	18,180,099,308
野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け)	18,055,531,807
野村世界6資産分散投信(分配コース)	17,613,590,187
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	16,865,747,649
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	13,072,423,854
マイバランスDC30	13,048,928,547
のむらっぴ・ファンド(保守型)	13,035,131,169
マイバランスDC50	10,536,432,250
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	10,440,101,077
のむらっぴ・ファンド(普通型)	10,396,404,692
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信	5,996,645,094
野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用)	3,630,888,862
マイバランスDC70	3,483,226,048
野村世界6資産分散投信(成長コース)	3,101,234,791
野村6資産均等バランス	2,647,040,693
マイターゲット2030(確定拠出年金向け)	2,341,271,307

ファンド名	当期末 元本額
	円
野村インデックスファンド・国内債券	2,336,235,916
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)	1,889,625,001
野村世界6資産分散投信(配分変更コース)	1,585,821,345
のむらっぴ・ファンド(積極型)	1,445,869,703
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)	1,352,621,530
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	1,303,446,491
マイターゲット2040(確定拠出年金向け)	1,066,154,772
マイターゲット2050(確定拠出年金向け)	963,345,785
野村日本債券インデックスファンド	892,862,563
のむらっぴ・ファンド(やや保守型)	890,461,251
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)	883,874,195
野村円債投資インデックスファンド	870,238,879
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)	690,877,988
マイターゲット2035(確定拠出年金向け)	677,187,339
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)	570,588,956
野村国内債券インデックスファンド	412,178,214
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)	369,436,143
野村資産設計ファンド2015	349,341,186
マイターゲット2045(確定拠出年金向け)	349,283,317
野村資産設計ファンド2020	347,706,914
野村資産設計ファンド2025	326,485,501
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)	324,043,679

ファンド名	当期末
	元本額
	円
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用)	313,430,101
のむらっぴ・ファンド(やや積極型)	293,178,353
野村資産設計ファンド2030	257,830,546
野村資産設計ファンド2040	187,640,575
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	177,555,444
マイターゲート2060(確定拠出年金向け)	154,432,605
野村世界6資産分散投信(DC)安定コース	150,612,897
野村資産設計ファンド2035	135,243,787
マイターゲート2055(確定拠出年金向け)	122,979,708
世界6資産分散ファンド	118,151,164
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)	87,956,063
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)	82,252,473
インデックス・ブレンド(タイプⅢ)	75,337,676
野村世界インデックス・バランス40VA(適格機関投資家専用)	68,486,483
インデックス・ブレンド(タイプⅠ)	48,855,898
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A) 2030	44,498,366
インデックス・ブレンド(タイプⅡ)	28,563,778
野村世界6資産分散投信(DC)成長コース	26,270,204
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	24,962,651
野村世界6資産分散投信(DC)インカムコース	24,925,840

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村資産設計ファンド2050	21,680,129
野村資産設計ファンド2045	18,534,637
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)	18,435,781
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A) 2040	17,498,696
インデックス・ブレンド(タイプⅣ)	14,641,420
マイターゲート2065(確定拠出年金向け)	14,051,378
野村FOFs用・ターゲット・リターン・8資産バランス(2%コース向け)(適格機関投資家専用)	13,844,948
インデックス・ブレンド(タイプⅤ)	12,579,673
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)	10,912,684
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)	10,272,001
野村資産設計ファンド2060	7,884,577
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A) 2050	7,173,206
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	6,735,994
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	3,747,903
野村資産設計ファンド(DC・つみたてN I S A) 2060	2,996,018
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	2,261,041
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)	498,750
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	188,480

〇お知らせ

該当事項はございません。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書

第8期（決算日2021年9月6日）

作成対象期間（2020年9月8日～2021年9月6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	FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。
主な投資対象	外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。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<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
	騰落	中率	騰落	中率			
	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%	百万円
4期(2017年9月6日)	11,412	△2.6	114.81	△2.5	84.6	—	15,515
5期(2018年9月6日)	11,174	△2.1	112.61	△1.9	98.8	—	50,125
6期(2019年9月6日)	12,118	8.4	122.22	8.5	99.7	—	59,275
7期(2020年9月7日)	12,502	3.2	126.25	3.3	99.2	—	69,653
8期(2021年9月6日)	12,332	△1.4	124.58	△1.3	99.3	—	85,718

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

*FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている日本を除く世界主要国の国債の総合投資収益を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックス(為替ヘッジを行なう円ベースの指数)です。なお、設定時を100として再指数化しています。

*FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営されている債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

(出所) FTSE Fixed Income LLC

○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	中率	騰落	中率		
(期首)	円	%	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	%	%	%
2020年9月7日	12,502	—	126.25	—	99.2	—
9月末	12,596	0.8	127.21	0.8	97.9	—
10月末	12,571	0.6	126.96	0.6	97.1	—
11月末	12,587	0.7	127.07	0.7	99.9	—
12月末	12,576	0.6	126.99	0.6	99.4	—
2021年1月末	12,498	△0.0	126.24	△0.0	99.2	—
2月末	12,127	△3.0	122.45	△3.0	100.3	—
3月末	12,104	△3.2	122.26	△3.2	101.0	—
4月末	12,092	△3.3	122.17	△3.2	98.7	—
5月末	12,117	△3.1	122.37	△3.1	99.6	—
6月末	12,165	△2.7	122.89	△2.7	98.2	—
7月末	12,378	△1.0	125.03	△1.0	97.7	—
8月末	12,381	△1.0	125.06	△0.9	98.9	—
(期末)						
2021年9月6日	12,332	△1.4	124.58	△1.3	99.3	—

*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、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）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

外国債券利回りが米国を中心に上昇（価格は下落）したため、基準価額は下落しました。

○当ファンドのポートフォリオ

FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、満期構成、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指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均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）を行ないました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行ないました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

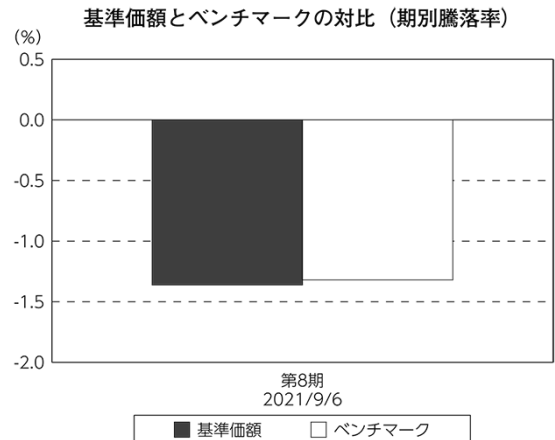
今期の基準価額の騰落率は-1.4%となり、ベンチマークの-1.3%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）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に用いる債券時価が異なること



(注) ベンチマークは、FTSE 世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。

◎今後の運用方針

引き続き、外国債券の組入比率を高位に保つとともに、ポートフォリオの特性値を指数に近似させることで、FTSE世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行なってまいります。

今後とも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

(2020年9月8日～2021年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(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
(b) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	1 (1) (0)	0.009 (0.009) (0.000)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	1	0.009	
期中の平均基準価額は、12,349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

(2020年9月8日～2021年9月6日)

公社債

			買付額	売付額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 175,302	千米ドル 90,146
	カナダ	国債証券	千カナダドル 6,591	千カナダドル 2,744
	イギリス	国債証券	千英ポンド 11,839	千英ポンド 7,400
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 7,541	千スウェーデンクローナ 3,621
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 8,272	千デンマーククローネ 1,551
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	16,413	9,817
	イタリア	国債証券	24,817	18,489
	フランス	国債証券	29,262	16,842
	オランダ	国債証券	2,889	503
	スペイン	国債証券	15,867	9,530
	ベルギー	国債証券	4,159	3,186
	オーストリア	国債証券	4,516	2,329
	フィンランド	国債証券	1,587	301
	アイルランド	国債証券	696	1,325
	国	ポーランド	国債証券	千ズロチ 20,177
シンガポール		国債証券	千シンガポールドル 1,673	千シンガポールドル 1,039
オーストラリア		国債証券	千豪ドル 5,779	千豪ドル 6,595
イスラエル		国債証券	千新シェケル 4,684	千新シェケル -
メキシコ		国債証券	千メキシコペソ 25,781	千メキシコペソ 18,028

*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。

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
外国	債券先物取引	百万円 4,660	百万円 4,658	百万円 -	百万円 -

*単位未満は切り捨て。

*外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年9月8日～2021年9月6日)

該当事項はございません。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

○組入資産の明細

(2021年9月6日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)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		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	330,270	353,477	38,822,450	45.3	—	20.2	18.2	6.9
カナダ	千カナダドル 17,050	千カナダドル 19,009	1,664,690	1.9	—	1.0	0.8	0.2
イギリス	千英ポンド 27,830	千英ポンド 35,718	5,433,781	6.3	—	5.1	0.9	0.3
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 19,050	千スウェーデンクローナ 20,494	262,941	0.3	—	0.3	0.1	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 11,600	千ノルウェークローネ 11,980	151,556	0.2	—	0.1	0.1	0.0
デンマーク	千デンマーククローネ 19,650	千デンマーククローネ 24,349	427,098	0.5	—	0.4	0.1	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	37,310	45,778	5,970,873	7.0	—	4.7	1.7	0.5
イタリア	54,660	64,410	8,401,041	9.8	—	5.6	3.3	0.8
フランス	55,070	64,996	8,477,520	9.9	—	6.5	3.2	0.2
オランダ	10,040	12,560	1,638,293	1.9	—	1.4	0.3	0.2
スペイン	35,860	42,072	5,487,504	6.4	—	4.1	1.5	0.8
ベルギー	12,640	15,089	1,968,098	2.3	—	1.8	0.4	0.1
オーストリア	7,720	9,177	1,197,010	1.4	—	1.0	0.3	0.1
フィンランド	3,760	4,207	548,728	0.6	—	0.4	0.2	0.1
アイルランド	5,330	5,831	760,620	0.9	—	0.5	0.2	0.2
ポーランド	千ズロチ 16,700	千ズロチ 16,865	488,040	0.6	—	0.2	0.1	0.3
シンガポール	千シンガポールドル 8,040	千シンガポールドル 8,768	717,624	0.8	—	0.5	0.2	0.1
オーストラリア	千豪ドル 18,660	千豪ドル 20,756	1,694,569	2.0	—	1.4	0.4	0.2
イスラエル	千新シェケル 10,400	千新シェケル 11,676	400,194	0.5	—	0.2	0.2	—
メキシコ	千メキシコペソ 108,500	千メキシコペソ 114,768	632,786	0.7	—	0.4	0.3	—
合 計	—	—	85,145,425	99.3	—	55.8	32.4	11.1

* 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

* 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。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	銘柄	当期末				償還年月日	
		利率	額面金額	評価額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千米ドル	千米ドル	千円		
アメリカ	国債証券	US TREASURY BOND	6.25	70	78	8,589	2023/8/15
		US TREASURY BOND	2.375	500	528	58,098	2024/8/15
		US TREASURY BOND	6.0	610	752	82,625	2026/2/15
		US TREASURY BOND	6.125	1,800	2,360	259,257	2027/11/15
		US TREASURY BOND	5.5	2,280	2,960	325,125	2028/8/15
		US TREASURY BOND	5.25	20	25	2,832	2028/11/15
		US TREASURY BOND	2.875	510	600	65,938	2043/5/15
		US TREASURY BOND	3.75	3,450	4,632	508,735	2043/11/15
		US TREASURY N/B	1.75	3,000	3,051	335,191	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.875	700	713	78,319	2022/9/30
		US TREASURY N/B	1.875	1,500	1,530	168,072	2022/10/31
		US TREASURY N/B	2.0	2,800	2,860	314,130	2022/10/31
		US TREASURY N/B	1.625	2,150	2,188	240,322	2022/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	2,260	2,318	254,634	2022/12/31
		US TREASURY N/B	1.5	1,400	1,425	156,608	2023/1/15
		US TREASURY N/B	1.75	1,000	1,022	112,279	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.375	700	721	79,262	2023/1/31
		US TREASURY N/B	2.0	4,110	4,219	463,373	2023/2/15
		US TREASURY N/B	2.625	1,000	1,036	113,819	2023/2/28
		US TREASURY N/B	0.5	2,500	2,512	275,980	2023/3/15
		US TREASURY N/B	1.5	2,100	2,143	235,372	2023/3/31
		US TREASURY N/B	1.75	1,500	1,539	169,069	2023/5/15
		US TREASURY N/B	0.125	1,000	999	109,744	2023/5/15
		US TREASURY N/B	1.625	2,000	2,050	225,220	2023/5/31
		US TREASURY N/B	0.25	1,500	1,501	164,905	2023/6/15
		US TREASURY N/B	1.375	5,000	5,109	561,226	2023/6/30
		US TREASURY N/B	0.125	1,000	998	109,696	2023/6/30
		US TREASURY N/B	1.25	3,500	3,570	392,123	2023/7/31
		US TREASURY N/B	2.5	2,200	2,297	252,338	2023/8/15
		US TREASURY N/B	0.125	3,100	3,094	339,887	2023/8/15
		US TREASURY N/B	1.375	3,000	3,068	337,057	2023/8/31
		US TREASURY N/B	2.75	3,500	3,675	403,655	2023/8/31
		US TREASURY N/B	0.125	4,000	3,992	438,444	2023/9/15
		US TREASURY N/B	1.375	5,000	5,117	562,063	2023/9/30
		US TREASURY N/B	0.125	4,000	3,990	438,273	2023/10/15
		US TREASURY N/B	1.625	1,700	1,750	192,232	2023/10/31
		US TREASURY N/B	2.75	2,500	2,635	289,483	2023/11/15
		US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,123	343,107	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.875	3,500	3,701	406,553	2023/11/30
		US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,091	229,656	2023/12/31
	US TREASURY N/B	2.25	500	523	57,499	2024/1/31	
	US TREASURY N/B	2.75	400	423	46,549	2024/2/15	
	US TREASURY N/B	2.375	4,000	4,204	461,766	2024/2/29	
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,091	229,742	2024/3/31	
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,088	229,330	2024/4/30	

銘柄		当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.5	1,500	1,585	174,147	2024/5/15
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,089	229,484	2024/5/31
	US TREASURY N/B	2.0	4,000	4,180	459,175	2024/6/30
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,077	228,128	2024/6/30
	US TREASURY N/B	0.375	3,000	2,999	329,387	2024/7/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,000	3,150	346,003	2024/7/31
	US TREASURY N/B	1.875	2,000	2,087	229,235	2024/8/31
	US TREASURY N/B	1.25	3,000	3,074	337,701	2024/8/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,000	2,103	231,003	2024/9/30
	US TREASURY N/B	2.25	2,000	2,112	231,972	2024/10/31
	US TREASURY N/B	2.125	2,400	2,526	277,492	2024/11/30
	US TREASURY N/B	2.25	800	846	92,916	2024/12/31
	US TREASURY N/B	1.75	2,000	2,083	228,841	2024/12/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,000	2,101	230,857	2025/2/15
	US TREASURY N/B	2.625	2,500	2,683	294,749	2025/3/31
	US TREASURY N/B	2.875	4,000	4,333	475,941	2025/4/30
	US TREASURY N/B	0.375	500	496	54,548	2025/4/30
	US TREASURY N/B	2.125	800	845	92,826	2025/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,169	238,288	2025/5/31
	US TREASURY N/B	2.75	4,000	4,324	474,946	2025/6/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,000	2,173	238,742	2025/7/31
	US TREASURY N/B	0.25	2,000	1,972	216,596	2025/7/31
	US TREASURY N/B	2.0	2,780	2,929	321,774	2025/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	600	650	71,398	2025/8/31
	US TREASURY N/B	3.0	3,000	3,283	360,649	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	4,000	3,936	432,301	2025/9/30
	US TREASURY N/B	0.25	4,000	3,933	432,026	2025/10/31
	US TREASURY N/B	2.25	1,640	1,747	191,948	2025/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	2,500	2,708	297,431	2026/1/31
	US TREASURY N/B	0.375	3,500	3,448	378,744	2026/1/31
	US TREASURY N/B	1.625	2,200	2,287	251,243	2026/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,500	3,777	414,887	2026/2/28
	US TREASURY N/B	2.25	3,000	3,205	352,103	2026/3/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,200	4,372	480,205	2026/5/15
	US TREASURY N/B	2.125	3,500	3,724	409,045	2026/5/31
	US TREASURY N/B	1.875	3,000	3,156	346,710	2026/6/30
	US TREASURY N/B	1.875	2,500	2,632	289,086	2026/7/31
	US TREASURY N/B	1.5	2,700	2,794	306,931	2026/8/15
	US TREASURY N/B	1.375	4,000	4,114	451,864	2026/8/31
	US TREASURY N/B	1.625	4,000	4,163	457,304	2026/9/30
	US TREASURY N/B	2.0	2,600	2,757	302,847	2026/11/15
	US TREASURY N/B	2.25	1,500	1,612	177,062	2027/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	3,800	4,113	451,801	2027/5/15
	US TREASURY N/B	0.5	2,000	1,954	214,623	2027/5/31
	US TREASURY N/B	0.5	1,500	1,464	160,858	2027/6/30
	US TREASURY N/B	2.25	3,200	3,445	378,446	2027/8/15
	US TREASURY N/B	2.25	600	646	70,976	2027/11/15

銘柄	銘柄	当 期 末				償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額		
				外貨建金額	邦貨換算金額	
		%	千米ドル	千米ドル	千円	
アメリカ	国債証券					
	US TREASURY N/B	2.75	3,200	3,549	389,882	2028/2/15
	US TREASURY N/B	1.25	4,000	4,053	445,154	2028/4/30
	US TREASURY N/B	2.875	2,500	2,796	307,148	2028/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	3,100	3,473	381,529	2028/8/15
	US TREASURY N/B	3.125	5,000	5,701	626,224	2028/11/15
	US TREASURY N/B	2.625	5,400	5,979	656,699	2029/2/15
	US TREASURY N/B	2.375	3,200	3,489	383,210	2029/5/15
	US TREASURY N/B	1.625	3,500	3,620	397,648	2029/8/15
	US TREASURY N/B	1.75	1,700	1,776	195,069	2029/11/15
	US TREASURY N/B	1.5	4,000	4,091	449,359	2030/2/15
	US TREASURY N/B	6.25	500	708	77,867	2030/5/15
	US TREASURY N/B	0.625	3,300	3,131	343,934	2030/5/15
	US TREASURY N/B	0.625	5,500	5,203	571,525	2030/8/15
	US TREASURY N/B	0.875	2,500	2,413	265,061	2030/11/15
	US TREASURY N/B	5.375	500	684	75,186	2031/2/15
	US TREASURY N/B	1.125	4,500	4,436	487,246	2031/2/15
	US TREASURY N/B	1.625	400	411	45,236	2031/5/15
	US TREASURY N/B	5.0	340	504	55,380	2037/5/15
	US TREASURY N/B	4.5	1,760	2,507	275,347	2038/5/15
	US TREASURY N/B	3.5	400	511	56,154	2039/2/15
	US TREASURY N/B	4.25	800	1,117	122,769	2039/5/15
	US TREASURY N/B	4.625	1,150	1,684	184,967	2040/2/15
	US TREASURY N/B	3.875	340	456	50,184	2040/8/15
	US TREASURY N/B	1.125	1,200	1,062	116,742	2040/8/15
	US TREASURY N/B	4.25	2,800	3,945	433,296	2040/11/15
	US TREASURY N/B	4.75	300	449	49,369	2041/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	500	610	67,017	2041/11/15
	US TREASURY N/B	2.75	500	577	63,386	2042/11/15
	US TREASURY N/B	3.125	800	978	107,420	2043/2/15
	US TREASURY N/B	3.625	1,500	1,974	216,845	2043/8/15
	US TREASURY N/B	3.625	700	924	101,539	2044/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	2,500	3,073	337,544	2044/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,600	1,929	211,958	2044/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	1,700	1,888	207,373	2045/2/15
	US TREASURY N/B	3.0	2,540	3,072	337,431	2045/5/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,760	3,272	359,458	2045/8/15
	US TREASURY N/B	3.0	3,020	3,662	402,247	2045/11/15
	US TREASURY N/B	2.5	2,530	2,815	309,184	2046/2/15
	US TREASURY N/B	2.5	3,400	3,787	415,986	2046/5/15
	US TREASURY N/B	2.25	4,030	4,286	470,796	2046/8/15
	US TREASURY N/B	2.875	2,300	2,741	301,117	2046/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,000	1,220	134,014	2047/5/15
	US TREASURY N/B	2.75	3,520	4,112	451,674	2047/8/15
	US TREASURY N/B	2.75	2,600	3,039	333,846	2047/11/15
	US TREASURY N/B	3.0	1,400	1,712	188,040	2048/2/15
	US TREASURY N/B	3.125	1,800	2,254	247,557	2048/5/15
	US TREASURY N/B	3.0	900	1,103	121,164	2048/8/15

銘	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ		%	千米ドル	千米ドル	千円		
	国債証券	US TREASURY N/B	2.875	500	601	66,084	2049/5/15
		US TREASURY N/B	2.25	1,300	1,387	152,360	2049/8/15
		US TREASURY N/B	2.375	1,400	1,534	168,579	2049/11/15
		US TREASURY N/B	1.25	2,900	2,450	269,138	2050/5/15
		US TREASURY N/B	1.375	2,700	2,352	258,361	2050/8/15
		US TREASURY N/B	1.625	1,900	1,761	193,458	2050/11/15
		US TREASURY N/B	1.875	400	393	43,200	2051/2/15
小	計					38,822,450	
カナダ			千カナダドル	千カナダドル			
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	1.75	1,000	1,021	89,454	2023/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,020	89,337	2023/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	150	154	13,549	2023/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	600	626	54,840	2024/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	1,060	1,117	97,839	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	3,000	3,083	270,018	2024/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	1,000	1,021	89,480	2025/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.25	600	585	51,314	2026/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	1,000	1,033	90,487	2026/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.0	1,000	1,006	88,156	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	400	427	37,401	2028/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	1,020	1,376	120,500	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	1,700	1,854	162,395	2029/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	600	884	77,456	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	400	598	52,447	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	780	1,099	96,257	2041/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.75	1,540	1,886	165,196	2048/12/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.0	200	211	18,555	2051/12/1
小	計					1,664,690	
イギリス			千英ポンド	千英ポンド			
	国債証券	UK TREASURY	0.125	600	600	91,304	2023/1/31
		UK TREASURY	0.75	1,100	1,113	169,375	2023/7/22
		UK TREASURY	2.25	950	990	150,707	2023/9/7
		UK TREASURY	1.0	500	511	77,752	2024/4/22
		UK TREASURY	2.75	1,200	1,292	196,633	2024/9/7
		UK TREASURY	0.625	1,000	1,015	154,445	2025/6/7
		UK TREASURY	1.5	1,370	1,450	220,653	2026/7/22
		UK TREASURY	1.25	1,000	1,050	159,864	2027/7/22
		UK TREASURY	4.25	300	371	56,482	2027/12/7
		UK TREASURY	1.625	900	973	148,152	2028/10/22
		UK TREASURY	6.0	90	125	19,074	2028/12/7
		UK TREASURY	0.875	1,200	1,230	187,216	2029/10/22
		UK TREASURY	0.375	1,700	1,660	252,610	2030/10/22
		UK TREASURY	4.75	600	822	125,169	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	600	818	124,511	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	200	290	44,163	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	1,160	1,688	256,879	2036/3/7
		UK TREASURY	1.75	1,170	1,304	198,443	2037/9/7

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
イギリス			%	千英ポンド	千英ポンド	千円	
	国債証券	UK TREASURY	4.25	400	615	93,588	2039/9/7
		UK TREASURY	1.25	700	724	110,292	2041/10/22
		UK TREASURY	4.5	850	1,411	214,735	2042/12/7
		UK TREASURY	3.5	1,000	1,503	228,730	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	2,180	3,713	564,914	2046/12/7
		UK TREASURY	1.5	1,400	1,535	233,639	2047/7/22
		UK TREASURY	1.75	1,150	1,337	203,411	2049/1/22
		UK TREASURY	4.25	1,240	2,208	336,017	2049/12/7
		UK TREASURY	3.75	860	1,473	224,101	2052/7/22
		UK TREASURY	1.625	300	348	53,041	2054/10/22
		UK TREASURY	4.0	200	393	59,848	2060/1/22
		UK TREASURY	3.5	530	1,044	158,953	2068/7/22
		UK TSY 0 5/8% 2050	0.625	500	445	67,784	2050/10/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	100	143	21,823	2044/1/22
		UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	780	1,508	229,459	2055/12/7
小	計					5,433,781	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	3,000	3,118	40,010	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	250	274	3,527	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	1.0	2,700	2,853	36,610	2026/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	4,000	4,197	53,847	2028/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.75	3,500	3,679	47,204	2029/11/12
		SWEDISH GOVERNMENT	0.125	4,000	3,964	50,868	2031/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	1,600	2,406	30,873	2039/3/30
小	計					262,941	
ノルウェー				千ノルウェークローネ	千ノルウェークローネ		
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,900	1,944	24,601	2023/5/24
		NORWEGIAN GOVERNMENT	3.0	2,750	2,895	36,634	2024/3/14
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.5	1,700	1,735	21,948	2026/2/19
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	1,750	1,807	22,862	2027/2/17
		NORWEGIAN GOVERNMENT	2.0	1,500	1,580	19,994	2028/4/26
		NORWEGIAN GOVERNMENT	1.375	2,000	2,016	25,514	2030/8/19
小	計					151,556	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.5	1,650	1,722	30,208	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	3,400	3,721	65,271	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	2,300	2,421	42,472	2027/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.5	6,400	6,781	118,946	2029/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	4,900	8,745	153,396	2039/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	0.25	1,000	958	16,803	2052/11/15
小	計					427,098	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESobligation	—	1,000	1,007	131,448	2022/10/7
		BUNDESobligation	—	1,100	1,117	145,785	2023/10/13
		BUNDESobligation	—	1,000	1,019	132,982	2024/4/5
		BUNDESobligation	—	1,500	1,540	200,892	2025/4/11
		BUNDESobligation	—	1,000	1,033	134,734	2026/4/10

銘柄		当 期 末					償還年月日
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
		%	千ユーロ	千ユーロ	千円		
ユーロ							
ドイツ	国債証券	BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	1,310	1,359	177,371	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	700	737	96,239	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	400	466	60,784	2024/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	610	647	84,494	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	700	742	96,904	2024/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	440	463	60,396	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,043	136,135	2025/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	2,000	2,139	279,010	2025/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	900	949	123,846	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	300	310	40,505	2026/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.25	2,270	2,386	311,270	2027/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.5	2,300	3,284	428,393	2027/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	850	909	118,583	2027/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	1,000	1,073	140,033	2028/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,000	1,375	179,449	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,400	1,458	190,285	2029/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	6.25	500	790	103,135	2030/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,500	1,562	203,846	2030/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	2,000	2,081	271,536	2030/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	1,100	1,731	225,839	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	1,400	2,332	304,226	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	100	102	13,337	2035/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	1,400	2,317	302,304	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.25	1,310	2,353	306,953	2039/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	60	115	15,113	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	750	1,273	166,146	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,100	1,737	226,595	2044/7/4
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	1,410	2,275	296,795	2046/8/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.25	600	785	102,391	2048/8/15		
BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	—	1,300	1,250	163,102	2050/8/15		
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	5.5	200	213	27,891	2022/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.05	1,800	1,813	236,494	2023/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	2,100	2,145	279,849	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,150	1,245	162,417	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	2,500	2,647	345,313	2023/10/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.65	1,000	1,022	133,416	2023/10/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	180	216	28,245	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	2,200	2,466	321,723	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	1,500	1,681	219,298	2024/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	700	738	96,267	2024/11/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	1,500	1,633	213,096	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.35	2,000	2,038	265,920	2025/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,350	1,596	208,285	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	500	530	69,127	2025/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	800	850	110,886	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.85	1,000	1,076	140,381	2025/7/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	1,530	1,666	217,338	2025/12/1

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5	2,000	2,049	267,290	2026/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	1,000	1,205	157,207	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.6	550	592	77,224	2026/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.25	1,100	1,168	152,454	2026/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.2	1,500	1,678	218,868	2027/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.5	400	553	72,206	2027/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.0	800	889	115,999	2028/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.5	600	607	79,181	2028/7/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,040	2,659	346,884	2028/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.25	1,000	1,386	180,828	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	800	999	130,356	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	1,000	1,069	139,468	2030/4/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	3,100	3,201	417,554	2030/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	1,700	1,858	242,377	2030/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	6.0	700	1,053	137,371	2031/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	500	545	71,103	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.75	1,000	1,535	200,288	2033/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.45	1,070	1,257	164,052	2033/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	1,610	2,395	312,384	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.35	800	1,031	134,499	2035/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.45	300	314	40,987	2036/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.25	100	115	15,038	2036/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	1,580	2,201	287,171	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.95	400	504	65,809	2038/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	350	555	72,515	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	300	482	62,895	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.8	800	851	111,022	2041/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	2,180	3,537	461,365	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	860	1,149	149,914	2046/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.7	500	612	79,914	2047/3/1
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.45	800	1,116	145,559	2048/3/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	3.85	900	1,338	174,636	2049/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	1.7	300	299	39,074	2051/9/1		
BUONI POLIENNALI DEL TES	2.8	10	12	1,574	2067/3/1		
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	—	500	505	65,883	2023/2/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	300	312	40,783	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	2,000	2,034	265,333	2024/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	2,010	2,171	283,243	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	3,100	3,169	413,343	2025/3/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	600	625	81,568	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,100	1,155	150,672	2026/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.25	1,050	1,092	142,447	2026/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.0	800	867	113,206	2027/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,300	2,476	322,989	2028/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	1,000	1,078	140,719	2028/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	1,500	1,590	207,452	2029/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	3,700	3,766	491,316	2029/11/25

銘柄			当 期 末				償還年月日
			利 率	額面金額	評 価 額		
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	2.5	2,720	3,367	439,163	2030/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	1,500	1,517	197,864	2030/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,200	1,365	178,112	2034/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.25	1,550	1,771	231,076	2036/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	1,260	1,564	204,086	2039/6/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	700	704	91,847	2040/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.0	1,510	2,000	260,953	2048/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.5	600	719	93,904	2050/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.75	2,400	2,378	310,207	2052/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.25	610	630	82,238	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.25	1,800	1,991	259,800	2023/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.75	2,100	2,264	295,361	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	6.0	1,100	1,404	183,157	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.0	2,100	2,242	292,514	2025/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	—	1,000	1,025	133,714	2026/2/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.5	2,410	2,870	374,453	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	2.75	900	1,079	140,758	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.5	1,200	1,740	226,965	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	1.5	1,640	1,895	247,265	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O.A.T	5.75	300	493	64,341	2032/10/25
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.75	2,290	3,717	484,859	2035/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	400	645	84,173	2038/10/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.5	720	1,270	165,745	2041/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	3.25	1,800	2,873	374,773	2045/5/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	400	779	101,667	2055/4/25		
FRANCE GOVERNMENT O.A.T	4.0	900	1,836	239,549	2060/4/25		
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	630	668	87,199	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	7.5	300	333	43,546	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	1.75	300	314	40,963	2023/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	1,000	1,080	140,981	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	700	725	94,686	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	400	422	55,161	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.75	1,100	1,186	154,797	2027/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	5.5	1,100	1,529	199,513	2028/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	1,000	1,028	134,195	2030/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	1,150	1,507	196,645	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	400	650	84,862	2037/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	—	300	297	38,866	2038/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	610	1,068	139,343	2042/1/15
NETHERLANDS GOVERNMENT	2.75	1,050	1,744	227,528	2047/1/15		
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.45	3,400	3,435	448,118	2022/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	900	976	127,357	2023/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	—	600	606	79,064	2023/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.35	300	305	39,845	2023/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	1,940	2,150	280,537	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	3.8	1,920	2,143	279,587	2024/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	1,400	1,546	201,710	2024/10/31

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.6	800	861	112,363	2025/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	1,000	1,202	156,777	2025/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.15	700	776	101,233	2025/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	720	798	104,126	2026/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	400	523	68,313	2026/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.3	1,000	1,084	141,514	2026/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.5	1,500	1,650	215,336	2027/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.8	800	847	110,547	2027/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.45	1,300	1,432	186,904	2027/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	1,600	1,761	229,787	2028/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	900	994	129,665	2028/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	330	454	59,251	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.6	800	835	108,956	2029/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.5	2,000	2,065	269,430	2030/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	1,000	1,160	151,375	2030/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.25	600	658	85,911	2030/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.35	2,100	2,556	333,476	2033/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.85	400	465	60,735	2035/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.9	400	685	89,362	2040/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.2	500	521	67,995	2040/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	1,000	1,689	220,362	2041/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	900	1,667	217,541	2044/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.9	950	1,324	172,733	2046/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.7	600	813	106,051	2048/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.0	1,200	1,126	146,935	2050/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	90	130	17,032	2029/1/31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	1,100	1,739	226,945	2032/7/30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	710	1,078	140,613	2037/1/31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	4.25	700	736	96,112	2022/9/28
		BELGIUM KINGDOM	2.25	200	210	27,478	2023/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.2	600	611	79,803	2023/10/22
		BELGIUM KINGDOM	2.6	230	251	32,791	2024/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.5	300	311	40,603	2024/10/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,100	1,184	154,463	2026/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	950	1,023	133,484	2027/6/22
		BELGIUM KINGDOM	—	1,000	1,029	134,260	2027/10/22
		BELGIUM KINGDOM	0.8	300	325	42,405	2028/6/22
		BELGIUM KINGDOM	0.9	1,400	1,532	199,942	2029/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.0	1,200	1,333	173,898	2031/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	550	788	102,909	2032/3/28
		BELGIUM KINGDOM	1.45	500	589	76,917	2037/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.9	720	903	117,831	2038/6/22
		BELGIUM KINGDOM	4.25	300	512	66,844	2041/3/28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	650	1,106	144,265	2045/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.6	500	608	79,399	2047/6/22
		BELGIUM KINGDOM	1.7	700	873	113,943	2050/6/22
		BELGIUM KINGDOM	2.15	370	542	70,694	2066/6/22

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	370	613	80,047	2035/3/28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	—	700	705	91,978	2022/9/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	120	126	16,495	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.65	1,500	1,613	210,422	2024/10/21
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	300	320	41,819	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	400	423	55,266	2027/4/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	700	754	98,472	2028/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.5	1,500	1,592	207,755	2029/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	2.4	530	689	89,963	2034/5/23
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	230	372	48,616	2037/3/15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	400	650	84,815	2044/6/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	400	503	65,689	2047/2/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	400	428	55,913	2051/3/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.8	330	710	92,664	2062/1/26
REPUBLIC OF AUSTRIA	1.5	210	284	37,135	2086/11/2		
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	1.625	300	307	40,075	2022/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.5	150	155	20,277	2023/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	200	214	27,960	2024/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.5	810	852	111,193	2026/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.75	740	905	118,123	2028/7/4
		FINNISH GOVERNMENT	—	300	306	39,941	2030/9/15
		FINNISH GOVERNMENT	1.125	500	572	74,614	2034/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	0.125	400	400	52,296	2036/4/15
		FINNISH GOVERNMENT	2.625	160	239	31,212	2042/7/4
FINNISH GOVERNMENT	1.375	200	253	33,033	2047/4/15		
アイルランド	国債証券	IRISH GOVERNMENT	0.9	800	867	113,155	2028/5/15
		IRISH TSY 0.2% 2030	0.2	1,100	1,129	147,348	2030/10/18
		IRISH TSY 1% 2026	1.0	650	697	90,922	2026/5/15
		IRISH TSY 1.5% 2050	1.5	200	238	31,063	2050/5/15
		IRISH TSY 1.7% 2037	1.7	550	665	86,766	2037/5/15
		IRISH TSY 2% 2045	2.0	450	589	76,894	2045/2/18
		IRISH TSY 2022	—	1,000	1,007	131,357	2022/10/18
		IRISH TSY 3.4% 2024	3.4	500	551	71,941	2024/3/18
REPUBLIC OF IRELAND	3.9	80	85	11,171	2023/3/20		
小 計						34,449,689	
ポーランド				千ズロチ	千ズロチ		
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	2.5	8,700	8,960	259,296	2023/1/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	2.25	3,000	3,129	90,568	2024/10/25
		POLAND GOVERNMENT BOND	1.25	5,000	4,775	138,175	2030/10/25
小 計						488,040	
シンガポール				千シンガポールドル	千シンガポールドル		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	1,400	1,460	119,502	2023/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.0	400	429	35,187	2024/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	400	426	34,883	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.125	700	743	60,883	2026/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	3.5	730	829	67,868	2027/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.625	300	329	26,982	2028/5/1

銘柄	柄	当 期 末				償還年月日	
		利 率	額面金額	評 価 額			
				外貨建金額	邦貨換算金額		
シンガポール		%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円		
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	400	450	36,837	2029/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	1,210	1,368	111,988	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.25	900	969	79,371	2036/8/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	700	767	62,844	2039/7/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	500	587	48,101	2046/3/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	1.875	400	405	33,171	2050/3/1
小	計					717,624	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	1,200	1,232	100,593	2022/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.5	800	871	71,121	2023/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,000	1,071	87,477	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	0.25	1,100	1,098	89,716	2024/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,340	1,478	120,707	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	520	607	49,605	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.75	820	1,002	81,859	2027/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	1,006	82,154	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.25	820	891	72,805	2028/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	900	1,014	82,863	2028/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	1,000	1,168	95,375	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	800	905	73,952	2029/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.5	1,600	1,788	146,038	2030/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	200	197	16,108	2030/12/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.5	1,200	1,235	100,839	2031/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.0	150	146	11,947	2031/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.25	500	499	40,807	2032/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	1,170	1,577	128,759	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	300	347	28,376	2035/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.75	150	193	15,836	2037/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	320	390	31,864	2039/6/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	1,100	1,255	102,479	2041/5/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.0	270	318	26,014	2047/3/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	500	456	37,264	2051/6/21
小	計					1,694,569	
イスラエル				千新シェケル	千新シェケル		
	国債証券	ISRAEL FIXED BOND	1.5	1,500	1,546	53,010	2023/11/30
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	1,500	1,638	56,139	2024/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	0.5	2,500	2,523	86,485	2025/4/30
		ISRAEL FIXED BOND	2.0	2,000	2,159	74,007	2027/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	1.0	1,000	998	34,210	2030/3/31
		ISRAEL FIXED BOND	5.5	1,100	1,767	60,587	2042/1/31
		ISRAEL FIXED BOND	3.75	800	1,043	35,752	2047/3/31
小	計					400,194	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	13,100	13,737	75,744	2024/9/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	11,000	12,202	67,278	2024/12/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	5.75	14,000	13,558	74,755	2026/3/5
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.5	20,100	20,799	114,679	2027/6/3

銘	柄	当 期 末					
		利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
				外貨建金額	邦貨換算金額		
メキシコ		%	千メキシコペソ	千メキシコペソ	千円		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	12,400	13,074	72,085	2031/5/29
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	3,100	3,256	17,954	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	6,000	7,506	41,385	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	10,200	11,261	62,089	2038/11/18
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	5,000	5,144	28,364	2042/11/13
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	4,300	4,522	24,934	2047/11/7
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	9,300	9,705	53,513	2023/12/7
小	計					632,786	
合	計					85,145,425	

*邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 85,145,425	% 98.1
コール・ローン等、その他	1,651,150	1.9
投資信託財産総額	86,796,575	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

*当期末における外貨建て純資産（85,151,488千円）の投資信託財産総額（86,796,575千円）に対する比率は98.1%です。

*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル=109.83円、1カナダドル=87.57円、1英ポンド=152.13円、1スウェーデンクローナ=12.83円、1ノルウェークローネ=12.65円、1デンマーククローネ=17.54円、1ユーロ=130.43円、1ズロチ=28.9372円、1シンガポールドル=81.84円、1豪ドル=81.64円、1新シェケル=34.2728円、1メキシコペソ=5.5136円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年9月6日現在)

項目	当期末
	円
(A) 資産	172,759,657,418
コール・ローン等	961,507,974
公社債(評価額)	85,145,425,312
未収入金	86,203,948,604
未収利息	422,399,606
前払費用	24,251,911
差入委託証拠金	2,124,011
(B) 負債	87,041,055,896
未払金	87,036,198,683
未払解約金	4,104,481
未払利息	632
その他未払費用	752,100
(C) 純資産総額(A-B)	85,718,601,522
元本	69,507,998,280
次期繰越損益金	16,210,603,242
(D) 受益権総口数	69,507,998,280口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,332円

(注) 期首元本額は55,714,203,773円、期中追加設定元本額は26,603,112,010円、期中一部解約元本額は12,809,317,503円、1口当たり純資産額は1.2332円です。

○損益の状況 (2020年9月8日～2021年9月6日)

項目	当期
	円
(A) 配当等収益	1,531,599,676
受取利息	1,532,133,328
支払利息	△ 533,652
(B) 有価証券売買損益	△ 2,509,913,115
売買益	8,374,311,843
売買損	△10,884,224,958
(C) 先物取引等取引損益	△ 1,753,635
取引益	1,908,213
取引損	△ 3,661,848
(D) 保管費用等	△ 7,012,938
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	△ 987,080,012
(F) 前期繰越損益金	13,938,897,618
(G) 追加信託差損益金	6,306,274,978
(H) 解約差損益金	△ 3,047,489,342
(I) 計(E+F+G+H)	16,210,603,242
次期繰越損益金(I)	16,210,603,242

* 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(G)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(H)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
	円
野村外国債券インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	33,969,196,969
野村外国債券インデックス Aコース(野村SMA・EW向け)	12,342,972,136
野村外国債券(含む新興国)インデックス Aコース(野村投資一任口座向け)	8,452,456,658
オルウェザー・ファクターアロケーションオープン投信(適格機関投資家専用)	6,047,758,615
ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型	4,660,804,118
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	1,556,273,232
野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型	876,355,232
野村国内外マルチアセット(6資産)ファンド(適格機関投資家専用)	568,452,306
多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け)	471,820,275
野村国内外マルチアセット(6資産)オープン投信(適格機関投資家専用)	294,994,115

ファンド名	当期末
	元本額
	円
野村世界バランス25VA(適格機関投資家専用)	186,323,900
野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型	30,562,537
インデックス・ブレンド(タイプIII)	14,815,568
野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型	8,244,243
インデックス・ブレンド(タイプI)	7,314,172
インデックス・ブレンド(タイプV)	5,424,084
野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型	4,469,776
インデックス・ブレンド(タイプII)	3,791,671
インデックス・ブレンド(タイプIV)	3,114,434
野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型	2,854,239

○お知らせ

該当事項はございません。

クレジット戦略型円建て債券 マザーファンド

運用報告書

第5期（決算日2021年8月27日）

作成対象期間（2020年8月28日～2021年8月27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	内外の金融機関、事業会社等が発行する円建ての社債（シニア債、劣後債等を含みます。）、資産担保証券、モーゲージ担保証券およびわが国の国債等を主要投資対象とし、わが国の国債を対象とした先物取引（以下「国債先物取引」といいます。）および、わが国の企業の信用リスクに係る円建てのデリバティブ取引を主要取引対象とし、信託財産の成長を目標に積極的な運用を行うことを基本とします。
主な投資対象	内外の金融機関、事業会社等が発行する円建ての社債（シニア債、劣後債等を含みます。）、資産担保証券、モーゲージ担保証券およびわが国の国債等を主要投資対象とし、国債先物取引および、わが国の企業の信用リスクに係る円建てのデリバティブ取引を主要取引対象とします。また、選択権付債券売買取引（債券店頭オプション取引）および金利スワップ取引等を活用する場合があります。
主な投資制限	外貨建て資産への投資は行いません。 株式への直接投資は行いません。株式への投資は、転換社債を転換したものに限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の20%以内とします。

野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<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		債組入比率	債券先物比率	純資産額
	期騰落	中率	NOMURA-BPI総合	期騰落			
(設定日) 2016年9月14日	円 10,000	% -	382.436	% -	% -	% -	百万円 1,994
1期(2017年8月28日)	10,041	0.4	380.422	△0.5	94.3	-	1,998
2期(2018年8月27日)	10,105	0.6	380.372	△0.0	92.8	-	2,003
3期(2019年8月27日)	10,581	4.7	397.960	4.6	99.0	△7.4	2,089
4期(2020年8月27日)	10,366	△2.0	386.308	△2.9	96.6	-	4,702
5期(2021年8月27日)	10,534	1.6	388.404	0.5	98.8	-	10,825

*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

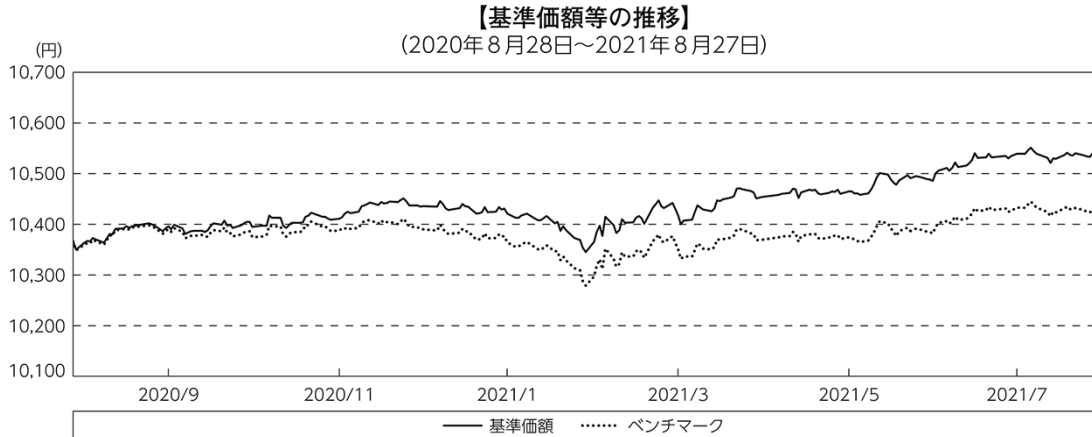
年月日	基準価額		ベンチマーク		債組入比率	債券先物比率
	騰落	率	NOMURA-BPI総合	騰落率		
(期首) 2020年8月27日	円 10,366	% -	386.308	% -	% 96.6	% -
8月末	10,364	△0.0	386.087	△0.1	97.7	-
9月末	10,396	0.3	387.219	0.2	97.9	-
10月末	10,395	0.3	386.633	0.1	97.5	-
11月末	10,411	0.4	387.118	0.2	98.3	-
12月末	10,436	0.7	387.203	0.2	98.3	-
2021年1月末	10,421	0.5	386.252	△0.0	97.7	-
2月末	10,345	△0.2	383.056	△0.8	99.0	-
3月末	10,417	0.5	385.724	△0.2	99.3	-
4月末	10,454	0.8	386.440	0.0	98.9	-
5月末	10,465	1.0	386.621	0.1	99.3	-
6月末	10,486	1.2	386.903	0.2	99.2	-
7月末	10,539	1.7	388.809	0.6	98.4	-
(期末) 2021年8月27日	円 10,534	% 1.6	388.404	% 0.5	% 98.8	% -

*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



○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首10,366円から期末10,534円に168円の値上がりとなりました。

上昇要因：・主に保有する社債からインカム収益を得たこと
・保有する社債の価格が上昇したこと

下落要因：・保有する超長期国債の利回りが上昇（価格は下落）したこと

○投資環境

国内社債市場におけるクレジットスプレッド（国債利回りに対する社債利回りの上乗せ部分）は、相対的にスプレッド水準の厚い事業債A・BBB格セクターや円建外債セクターを中心に縮小基調で推移しました。引き続き、新型コロナウイルスの感染拡大に伴う不確実性は残るものの、各国政府・中央銀行による積極的な財政・金融緩和政策を背景に、グローバル金融市場は堅調に推移しました。また、2020年11月に実施された米国大統領選挙において民主党候補のバイデン氏が勝利し、大規模な追加財政政策の実施による景気・企業業績の回復期待が高まったことも、相場の押し上げ要因となりました。こうしたグローバルなリスク資産価格上昇の他、日本銀行による社債買入オペの実施も、国内クレジットスプレッドの低位安定に寄与しました。

○当ファンドのポートフォリオ

・デュレーション

基本運用方針に従いポートフォリオのデュレーション（金利感応度）は、ベンチマークのデュレーション程度に維持しました。

・現物債券ポートフォリオの推移

<種別構成>

本邦企業の強固な財務基盤に加えて、日銀の金融緩和政策の継続により国内社債市場の安定推移を見込んだ結果、事業債のオーバーウェイト（ベンチマーク対比で多めの組み入れ）を維持しました。

<格付別構成>

主に短中期年限の事業債保有により、期を通じてA~BBB格セクターのオーバーウェイトポジションを維持しました。

○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+1.62%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の騰落率+0.54%を1.08%上回りました。

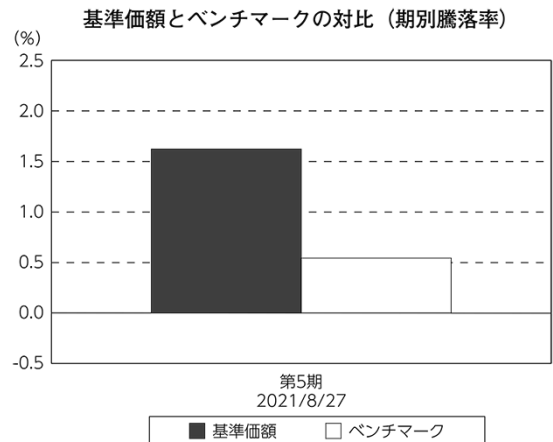
【主な差異要因】

(プラス要因)

- ・主にA~BBB格社債の保有を通じたインカム収益の獲得
- ・クレジットスプレッド(国債利回りに対する、社債利回りの上乘せ部分)の縮小による個別銘柄効果のプラス
- ・保有銘柄の売却等によるトレーディング収益の獲得

(マイナス要因)

- ・CDS(クレジット・デフォルト・スワップ)インデックスを活用したリスクヘッジ取引に伴うマイナス



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

◎今後の運用方針

本邦社債発行企業の財務・資金調達基盤は総じて強固であり、企業信用力は底堅く推移するものと見込んでおります。また、日銀による金融・信用緩和政策が下支えとなることで、クレジットスプレッドも安定的に推移するものと予想します。尤も、新型コロナウイルスの感染拡大に収束の兆しが見えない中、グローバル経済に与える影響は、依然として不確実性が高い状況が続くことが見込まれます。仮に景気の先行きに対する警戒ムードが強まる結果、急速な円高が進むような状況においては、その影響を受けやすい外需関連業種を中心に、事業・財務基盤の弱い企業の信用リスクが高まる可能性も想定される為、動向を注視してまいります。

引き続き、A～BBB格セクターのオーバーウェイトを基本ポジションとして維持しつつ、インカム収益の安定的な獲得を図ります。また、外部環境の変化に応じてポートフォリオのポジション調整や銘柄の入れ替えを行うことで、超過収益の積み上げを図ってまいります。

今後とも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

(2020年8月28日～2021年8月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円	%	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	0	0.000	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,427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

(2020年8月28日～2021年8月27日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	10,252,714	6,339,513
内	社債券（投資法人債券を含む）	4,931,562	2,551,172 (200,000)

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

スワップ及び先渡取引状況

種 類	当 期
	取引契約金額
その他のスワップ	百万円 100

*単位未満は切り捨て。

*当期末の想定元本額です。

○利害関係人との取引状況等

(2020年8月28日～2021年8月27日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	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	百万円 15,184	百万円 454	% 3.0	百万円 8,890	百万円 130	% 1.5

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。

○組入資産の明細

(2021年8月27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	5,800,000	5,955,033	55.0	—	42.9	8.4	3.7
普通社債券 (含む投資法人債券)	4,700,000 (4,700,000)	4,743,433 (4,743,433)	43.8 (43.8)	— (—)	32.7 (32.7)	6.5 (6.5)	4.6 (4.6)
合 計	10,500,000 (4,700,000)	10,698,467 (4,743,433)	98.8 (43.8)	— (—)	75.6 (32.7)	14.9 (6.5)	8.3 (4.6)

* () 内は非上場債で内書きです。

* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

* 金額の単位未満は切り捨て。

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

* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付(2年)第427回	0.005	400,000	401,076	2023/8/1
国庫債券	利付(5年)第141回	0.1	30,000	30,211	2024/9/20
国庫債券	利付(5年)第148回	0.005	200,000	201,158	2026/6/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	20,000	26,026	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第13回	0.5	100,000	93,080	2060/3/20
国庫債券	利付(10年)第333回	0.6	200,000	203,740	2024/3/20
国庫債券	利付(10年)第341回	0.3	470,000	478,648	2025/12/20
国庫債券	利付(10年)第346回	0.1	240,000	242,882	2027/3/20
国庫債券	利付(10年)第349回	0.1	120,000	121,599	2027/12/20
国庫債券	利付(10年)第350回	0.1	230,000	233,109	2028/3/20
国庫債券	利付(10年)第352回	0.1	210,000	213,059	2028/9/20
国庫債券	利付(10年)第362回	0.1	320,000	322,902	2031/3/20
国庫債券	利付(10年)第363回	0.1	200,000	201,564	2031/6/20
国庫債券	利付(30年)第44回	1.7	60,000	75,984	2044/9/20
国庫債券	利付(30年)第49回	1.4	60,000	72,251	2045/12/20
国庫債券	利付(30年)第56回	0.8	30,000	31,781	2047/9/20
国庫債券	利付(30年)第58回	0.8	30,000	31,737	2048/3/20
国庫債券	利付(30年)第62回	0.5	20,000	19,550	2049/3/20
国庫債券	利付(30年)第63回	0.4	10,000	9,500	2049/6/20
国庫債券	利付(30年)第65回	0.4	220,000	208,093	2049/12/20
国庫債券	利付(30年)第67回	0.6	130,000	129,205	2050/6/20
国庫債券	利付(30年)第69回	0.7	260,000	264,828	2050/12/20
国庫債券	利付(30年)第71回	0.7	60,000	60,900	2051/6/20
国庫債券	利付(20年)第150回	1.4	120,000	139,388	2034/9/20
国庫債券	利付(20年)第151回	1.2	270,000	306,984	2034/12/20
国庫債券	利付(20年)第156回	0.4	230,000	236,336	2036/3/20
国庫債券	利付(20年)第161回	0.6	330,000	347,559	2037/6/20
国庫債券	利付(20年)第162回	0.6	240,000	252,576	2037/9/20
国庫債券	利付(20年)第165回	0.5	40,000	41,346	2038/6/20
国庫債券	利付(20年)第166回	0.7	40,000	42,630	2038/9/20
国庫債券	利付(20年)第170回	0.3	20,000	19,847	2039/9/20
国庫債券	利付(20年)第171回	0.3	280,000	277,351	2039/12/20
国庫債券	利付(20年)第173回	0.4	40,000	40,210	2040/6/20
国庫債券	利付(20年)第174回	0.4	100,000	100,355	2040/9/20
国庫債券	利付(20年)第176回	0.5	400,000	407,620	2041/3/20
国庫債券	利付(20年)第177回	0.4	70,000	69,935	2041/6/20
小計			5,800,000	5,955,033	
普通社債券(含む投資法人債券)					
中国電力	第384回	1.029	100,000	106,487	2030/4/25
中国電力	第420回	0.23	100,000	99,919	2029/10/25
東北電力	第501回	0.385	100,000	101,109	2028/6/23
東北電力	第513回	0.31	100,000	100,559	2029/10/25
東北電力	第527回	0.32	100,000	100,091	2031/2/25
九州電力	第2回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	1.09	100,000	102,596	2080/10/15
九州電力	第489回	0.44	100,000	101,438	2030/5/24
東京電力パワーグリッド	第39回	1.08	100,000	104,389	2030/7/16

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
東京電力パワーグリッド 第45回	0.8	100,000	101,674	2031/4/22
東京電力パワーグリッド 第47回	0.68	100,000	100,271	2031/8/29
アサヒグループホールディングス第1回利払繰延期限前償還条項劣	0.97	200,000	203,720	2080/10/15
不二製油グループ本社第1回利払繰延条項期限前償還劣後特約付	0.78	100,000	100,782	2049/6/11
日鉄興和不動産 第5回社債間限定同順位特約付	0.65	100,000	100,561	2031/7/18
帝人 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	0.75	100,000	100,660	2051/7/21
大王製紙 第18回社債間限定同順位特約付	0.42	100,000	100,025	2022/3/22
イビデン 第9回社債間限定同順位特約付	0.03	100,000	99,817	2022/9/12
三菱ケミカルホールディングス 第40回社債間限定同順位特約付	0.09	100,000	100,147	2026/6/3
DMG森精機第2回利払繰延条項任意償還条項付無担保永久債劣後	1.0	100,000	100,220	2169/4/29
パナソニック 第19回社債間限定同順位特約付	0.37	100,000	101,115	2030/3/5
パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	100,988	2030/12/24
日本生命第4回A号利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	0.91	100,000	100,140	2046/11/22
コンコルディア・フィナンシャルグループ 第1回期限前償還条項	0.5	200,000	200,260	2027/3/19
トヨタ自動車 第26回社債間限定同順位特約付	0.05	100,000	100,136	2026/3/18
アイシン精機第1回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付	0.4	100,000	99,820	2080/2/28
住友生命第1回劣後ローン流動化第1回利払繰延条項・期限前償還	0.66	100,000	100,160	2079/6/26
大樹生命第1回利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債	0.74	100,000	99,940	2051/7/2
明治安田生命第1回劣後ローン流動化利払繰延条項・期限前償還条	0.88	100,000	99,846	2051/8/2
日本生命2021基金流動化 第1回無担保社債	0.28	100,000	99,980	2026/8/3
ドンキホーテ 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	1.49	200,000	204,260	2053/11/28
丸紅 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	0.82	100,000	101,751	2081/3/4
クレディセゾン 第73回社債間限定同順位特約付	0.48	100,000	101,502	2029/3/15
イオンフィナンシャルサービス 第14回社債間限定同順位特約付	0.29	100,000	100,139	2024/2/2
ジャックス 第29回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	100,066	2024/1/26
第一生命HD第3回利払繰延条項任意償還条項付無担保永久債劣後	1.124	100,000	102,285	2169/9/17
三井住友海上火災保険第3回利払繰延・期限前償還条項劣後特約付	0.85	200,000	201,020	2077/12/10
あいおいニッセイ同和損害保険第1回利払繰延・期限前償還条項劣	0.66	100,000	99,842	2079/9/10
T&Dホールディングス第1回利払繰延・期限前償還条項劣後特約	1.12	100,000	102,260	2048/9/23
西日本鉄道 第2回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付	0.67	100,000	100,000	2058/6/21
ヤマタネ 第4回無担保社債(社債間限定同順位特約付)	0.5	100,000	100,025	2025/12/12
ピー・ピー・シー・イー・エス・エー 第1回非上位円貨社債	0.64	200,000	200,427	2022/1/27
ピー・ピー・シー・イー・エス・エー 第3回非上位円貨社債	0.385	100,000	100,146	2023/1/25
クレディ・アグリコル・エス・エー 第7回円貨社債(2020)	1.248	100,000	102,860	2026/6/4
小 計		4,700,000	4,743,433	
合 計		10,500,000	10,698,467	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

スワップ及び先渡取引残高

種 類	取 引 契 約 残 高
	当期末想定元本額
その他のスワップ	百万円 100

* 単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2021年8月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 10,698,467	% 97.9
コール・ローン等、その他	226,588	2.1
投資信託財産総額	10,925,055	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。

○特定資産の価格等の調査

調査依頼を行った取引は2020年8月4日から2021年8月2日までの間でスワップ取引3件でした。これらのスワップ取引について、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）第11条第2項に基づいて比較可能な価格のほか、取引先、通貨の種類、銘柄名、想定元本金額、取引スプレッドその他の当該スワップ取引の内容に関して、EY新日本有限責任監査法人に調査を委託し、日本公認会計士協会が公表した専門業務実務指針4460「投資信託及び投資法人における特定資産の価格等の調査に係る合意された手続業務に関する実務指針」に基づく調査結果として合意された手続実施結果報告書を入手しています。

なお、本調査は財務諸表監査の一部ではなく、また、価格の妥当性や内部管理体制について保証を提供するものではありません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年8月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	10,925,055,486
コール・ローン等	109,180,641
公社債(評価額)	10,698,467,089
未収入金	101,680,480
未収利息	11,064,706
前払費用	4,662,570
(B) 負債	100,000,109
未払金	100,000,000
未払利息	109
(C) 純資産総額(A-B)	10,825,055,377
元本	10,276,291,559
次期繰越損益金	548,763,818
(D) 受益権総口数	10,276,291,559口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,534円

(注) 期首元本額は4,536,049,582円、期中追加設定元本額は7,733,352,150円、期中一部解約元本額は1,993,110,173円、1口当たり純資産額は1.0534円です。

(注) 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
 ・ファンドラップ(ウエルス・スクエア)債券・安定型 6,322,119,149円
 ・オールウェザー・ファクターアロケーションI(オープン投信(適格機関投資家専用)) 2,569,253,599円
 ・野村ターゲットインカムファンド(年3%目標分配型) 1,252,600,166円
 ・野村ターゲットインカムファンド(資産成長型) 106,437,796円
 ・野村ターゲットインカムファンド(年6%目標払出型) 25,880,849円

○損益の状況 (2020年8月28日～2021年8月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	34,680,760
受取利息	35,224,605
支払利息	△ 543,845
(B) 有価証券売買損益	61,256,989
売買益	72,536,800
売買損	△ 11,279,811
(C) 先物取引等取引損益	△ 5,326,429
取引損	△ 5,326,429
(D) 保管費用等	△ 9,052
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	90,602,268
(F) 前期繰越損益金	166,054,902
(G) 追加信託差損益金	386,256,209
(H) 解約差損益金	△ 94,149,561
(I) 計(E+F+G+H)	548,763,818
次期繰越損益金(I)	548,763,818

* 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(G)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(H)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。