

野村為替ヘッジ付き世界債券ファンド (野村SMA・EW向け)

運用報告書(全体版)

第5期(決算日2025年12月8日)

作成対象期間(2024年12月7日～2025年12月8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 | 2022年2月22日以降、無期限とします。 |
| 運用方針 | 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いません。主として世界各国の公社債に実質的に投資する投資信託証券(投資信託の受益証券(投資法人の投資証券を含みます。))に投資します。投資する投資信託証券については、わが国の公社債およびわが国の公社債に代替しうる債券に実質的に投資する投資信託証券が中心となるように、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、もしくはこれに類するものを基本とします。なお、市場環境、利回り水準、為替ヘッジコスト等を勘案し、実質的な外貨建資産について、為替ヘッジを行なわないことを基本とする投資信託証券に投資する場合があります。投資信託証券への投資は、高位を維持することを基本とします。また、ファンドは投資信託証券への投資を通じて、実質的な世界各国の公社債(当該投資信託証券が実質的に保有する債券を勘案します。)の組入れが高位となることを目途として、投資信託証券への投資を行なうことを基本とします。投資信託証券への投資にあたっては、別に定める投資信託証券の中から、定性評価、定量評価等を勘案して選択した投資信託証券に投資を行なうことを基本とします。なお、組入投資信託証券については適宜見直しを行いません。 |
| 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 | 株式への直接投資は行いません。外貨建資産への直接投資は行いません。 |
| 分配方針 | 毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子、配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行いません。 |

野村アセットマネジメント株式会社

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

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

○設定以来の運用実績

| 決算期 | 基準 (分配落) | 価額 | | | 債 組 入 比 | 券 率 | 債 先 物 比 | 券 率 | 投 資 組 入 比 | 信 託 組 入 比 | 純 資 産 額 |
|---------------------|-------------|--------|--------|--------|------------------|--------|------------------|--------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | | 税 分 | 込 配 | み 金 | | | | | | | |
| (設定日) 2022年2月22日 | 円 10,000 | | 円 - | | % - | % - | % - | % - | % - | % - | 百万円 1 |
| 1期(2022年6月6日) | 9,593 | | 0 | | △4.1 | - | - | 89.3 | | | 384 |
| 2期(2022年12月6日) | 9,286 | | 0 | | △3.2 | - | - | 93.8 | | | 6,214 |
| 3期(2023年12月6日) | 8,805 | | 0 | | △5.2 | - | - | 98.6 | | | 37,363 |
| 4期(2024年12月6日) | 8,631 | | 0 | | △2.0 | - | - | 98.2 | | | 65,238 |
| 5期(2025年12月8日) | 8,221 | | 0 | | △4.8 | - | - | 98.5 | | | 89,952 |

*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。

*値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークなどはありません。

○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 | 券 率 | 債 先 物 比 | 券 率 | 投 資 組 入 比 | 信 託 組 入 比 | 純 資 産 額 |
|--------------------|------------|--------|--------|------------------|--------|------------------|--------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | | 騰 落 | 率 | | | | | | | |
| (期首) 2024年12月6日 | 円 8,631 | | % - | | % - | | % - | | % - | 98.2 |
| 12月末 | 8,608 | | △0.3 | | - | | - | | | 98.6 |
| 2025年1月末 | 8,594 | | △0.4 | | - | | - | | | 98.6 |
| 2月末 | 8,480 | | △1.7 | | - | | - | | | 98.7 |
| 3月末 | 8,420 | | △2.4 | | - | | - | | | 98.6 |
| 4月末 | 8,485 | | △1.7 | | - | | - | | | 98.2 |
| 5月末 | 8,373 | | △3.0 | | - | | - | | | 98.7 |
| 6月末 | 8,427 | | △2.4 | | - | | - | | | 98.4 |
| 7月末 | 8,347 | | △3.3 | | - | | - | | | 98.9 |
| 8月末 | 8,327 | | △3.5 | | - | | - | | | 98.9 |
| 9月末 | 8,334 | | △3.4 | | - | | - | | | 98.1 |
| 10月末 | 8,348 | | △3.3 | | - | | - | | | 98.7 |
| 11月末 | 8,282 | | △4.0 | | - | | - | | | 98.8 |
| (期末) 2025年12月8日 | 8,221 | | △4.8 | | - | | - | | | 98.5 |

*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：8,631円

期 末：8,221円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 4.8% (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(2024年12月6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。

○基準価額の変動要因

(下落要因)

FRB(米連邦準備制度理事会)およびECB(欧州中央銀行)が利下げを行なった一方で、日銀が利上げを行なったことや、為替のヘッジコストなどがマイナスに影響しました。

○投資環境

<外国債券市場>

FRB（米連邦準備制度理事会）およびECB（欧州中央銀行）が利下げを行なったものの、為替のヘッジコストなどがマイナスに影響し、当作成期間で先進国国債はほぼ変わらずとなりました。

<日本債券市場>

日銀が利上げを行なったことなどから値下がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・投資信託証券組入比率

投資方針に基づいて、当作成期間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

当作成期間において「ピムコ日本債券コア・ファンドVF」を指定投資信託証券に追加しました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマークなどはありません。

◎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ないます。

○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり・税込み）

| 項 目 | 第5期 |
|-----------|---------------------------|
| | 2024年12月7日～ 2025年12月8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 | 169 |

（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

引き続き、以下のように、定性的に高く評価したファンドを中心に、リスク分散を考慮して投資することで、多くの運用者の資産運用スキルを効率よく活用し、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ってまいります。

- (1) 各投資対象ファンドについて「ファンドの運用目標を中長期的に安定して達成する可能性」を定性的に評価します。
- (2) 各投資対象ファンドの「リスク特性」（値動きに影響を与える特徴的な要因）を定量的に分析します。
- (3) 定性的に高く評価したファンドを中心に、「リスク特性」の状況などにも配慮しつつ、組入ファンドの投資比率の調整を行ないます。

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

（2024年12月7日～2025年12月8日）

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|----------------------|-------|---------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 円 | % | (a) 信託報酬＝期中の信託報酬額÷期中の平均受益権口数 |
| （ 投 信 会 社 ） | (17) | (0.204) | 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 ） | (3) | (0.033) | 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 ） | (2) | (0.022) | 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 | 1 | 0.017 | (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 ） | (1) | (0.017) | |
| (c) そ の 他 費 用 | 0 | 0.002 | (c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| （ 監 査 費 用 ） | (0) | (0.002) | 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 |
| 合 計 | 23 | 0.277 | |
| 期中の平均基準価額は、8,418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。

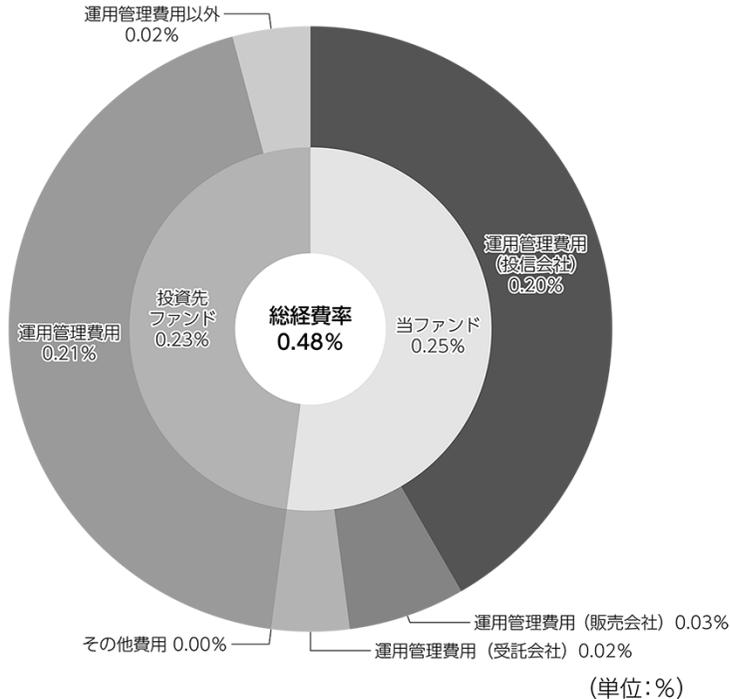
* 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

* 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）

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.48%です。



| 総経費率(①+②+③) | 0.48 |
|----------------------|------|
| ①当ファンドの費用の比率 | 0.25 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.21 |
| ③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率 | 0.02 |

(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) 当ファンドの費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注) 投資先ファンドの費用は、投資先ファンドの開示基準に基づき算出したものです。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券等（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) 当ファンドのその他費用には、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用が含まれます。

(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) 投資先ファンドの純資産総額等によっては、投資先ファンドの運用管理費用以外の比率が高まる場合があります。

(注) 投資先ファンドの費用は、交付運用報告書作成時点において、委託会社所知りうる情報をもとに作成しています。

(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

（2024年12月7日～2025年12月8日）

投資信託証券

| 銘柄 | | 買付 | | 売付 | |
|-----|---|----------------|------------|------------|------------|
| | | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 国内 | ノムラ日本債券オープンF | 227,732 | 2,837,520 | 368,000 | 4,491,448 |
| | NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信 | 21,658,700 | 18,842,553 | 20,352,000 | 17,895,170 |
| | NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジあり）連動型上場投信 | 31,551,700 | 24,095,090 | 13,837,000 | 10,482,389 |
| | ニッセイ国内債券オープンF | 506,060 | 4,633,151 | 589,000 | 5,302,187 |
| | マニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・ファンド | 444,702 | 4,111,060 | — | — |
| | ピムコ日本債券コア・ファンドVF | 12,888,849,367 | 12,307,060 | — | — |
| 合 計 | 12,943,238,261 | 66,826,437 | 35,146,000 | 38,171,194 | |

*金額は受け渡し代金。

*金額の単位未満は切り捨て。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○利害関係人との取引状況等

（2024年12月7日～2025年12月8日）

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | | | 売付額等 C | | |
|--------|-----------------|---------------|-----------|-----------------|---------------|-----------|
| | うち利害関係人との取引状況 B | $\frac{B}{A}$ | | うち利害関係人との取引状況 D | $\frac{D}{C}$ | |
| 投資信託証券 | 百万円 66,826 | 百万円 24,512 | % 36.7 | 百万円 38,171 | 百万円 16,155 | % 42.3 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|----------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 13,313千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 137千円 |
| (B) / (A) | 1.0% |

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証券株式会社、野村信託銀行です。

○組入資産の明細

(2025年12月8日現在)

ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---|------------|----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 比 率 |
| | 口 | 口 | 千円 % |
| ノムラ日本債券オープンF | 689,116 | 548,848 | 6,612,520 7.4 |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信 | 30,294,670 | 31,601,370 | 26,614,673 29.6 |
| NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス(除く日本・為替ヘッジあり)連動型上場投信 | 6,020,300 | 23,735,000 | 17,851,093 19.8 |
| ニッセイ国内債券オープンF | 1,450,053 | 1,367,113 | 12,126,292 13.5 |
| マニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・ファンドF | 1,015,671 | 1,460,373 | 13,225,137 14.7 |
| ビムコ日本債券コア・ファンドVF | — | 12,888,849,367 | 12,143,873 13.5 |
| 合 計 | 39,469,810 | 12,947,562,071 | 88,573,592 98.5 |

*比率は、純資産総額に対する評価額の比率。

*評価額の単位未満は切り捨て。

*銘柄コード等の変更があった銘柄は、別銘柄として掲載しております。

○投資信託財産の構成

(2025年12月8日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 投資信託受益証券 | 88,573,592 | 97.8 |
| コール・ローン等、その他 | 1,996,513 | 2.2 |
| 投資信託財産総額 | 90,570,105 | 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（2025年12月8日現在）

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 90,570,105,013 |
| コール・ローン等 | 1,996,486,150 |
| 投資信託受益証券(評価額) | 88,573,592,089 |
| 未収利息 | 26,774 |
| (B) 負債 | 617,444,740 |
| 未払金 | 405,678,409 |
| 未払解約金 | 105,235,620 |
| 未払信託報酬 | 105,529,590 |
| その他未払費用 | 1,001,121 |
| (C) 純資産総額(A－B) | 89,952,660,273 |
| 元本 | 109,423,766,816 |
| 次期繰越損益金 | △ 19,471,106,543 |
| (D) 受益権総口数 | 109,423,766,816口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 8,221円 |

(注) 期首元本額は75,587,457,121円、期中追加設定元本額は46,050,651,684円、期中一部解約元本額は12,214,341,989円、1口当たり純資産額は0.8221円です。

○損益の状況（2024年12月7日～2025年12月8日）

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|-------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 594,164,857 |
| 受取配当金 | 587,400,601 |
| 受取利息 | 6,764,256 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 3,911,275,935 |
| 売買益 | 206,058,994 |
| 売買損 | △ 4,117,334,929 |
| (C) 信託報酬等 | △ 200,978,163 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 3,518,089,241 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 1,357,839,545 |
| (F) 追加信託差損益金 | △14,595,177,757 |
| (配当等相当額) | (1,307,389,499) |
| (売買損益相当額) | (△15,902,567,256) |
| (G) 計(D+E+F) | △19,471,106,543 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | △19,471,106,543 |
| 追加信託差損益金 | △14,595,177,757 |
| (配当等相当額) | (1,307,389,499) |
| (売買損益相当額) | (△15,902,567,256) |
| 分配準備積立金 | 545,803,868 |
| 繰越損益金 | △ 5,421,732,654 |

*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（2024年12月7日～2025年12月8日）は以下の通りです。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------------------|---------------------------|
| | 2024年12月7日～ 2025年12月8日 |
| a. 配当等収益(経費控除後) | 393,186,694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 | 1,307,389,499円 |
| d. 信託約款に定める分配準備積立金 | 152,617,174円 |
| e. 分配対象収益(a+b+c+d) | 1,853,193,367円 |
| f. 分配対象収益(1万口当たり) | 169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

「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正に伴い、運用報告書の電子交付に関する条文を変更する所要の約款変更を行ないました。 <変更適用日：2025年4月1日>

《指定投資信託証券の運用内容》

野村為替ヘッジ付き世界債券ファンド（野村SMA・EW向け）に組み入れている各投資信託証券については、次頁以降にそれぞれ直前の作成期における運用内容を掲載しております。

| 指定投資信託証券 | ページ |
|---|-------|
| ノムラ日本債券オープンF | P 12 |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信 | P 31 |
| NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス（除く日本・為替ヘッジあり）連動型上場投信 | P 73 |
| ニッセイ国内債券オープンF | P 93 |
| ピムコ日本債券コア・ファンドVF | ※ |
| マニュライフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・ファンドF | P 108 |

*当作成期末において組み入れているファンドについて運用内容の掲載をしております。

*※のファンドについては、当運用報告書作成時点において、開示できる情報はございません。

ノムラ日本債券オープンF（適格機関投資家専用）

第24期（2024年8月28日～2025年8月27日）

○当ファンドの仕組み

| | | |
|--------|---|-------------------------------------|
| 商品分類 | — | |
| 信託期間 | 2001年8月28日以降、無期限とします。 | |
| 運用方針 | 実質的な公社債への投資にあたっては、セクター分析や個別発行体の信用リスク分析等に基づき、デュレーション、公社債のセクター（種別・格付別等）配分、個別銘柄選定等をアクティブに決定・変更し、収益の獲得を目指します。先物取引等も適宜活用します。 | |
| 主な投資対象 | ノムラ日本債券オープンF | ノムラ日本債券オープン マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | ノムラ日本債券オープン マザーファンド | わが国の公社債を主要投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | ノムラ日本債券オープンF | 外貨建資産への投資は行ないません。 |
| | ノムラ日本債券オープン マザーファンド | 株主への投資は行ないません。外貨建資産への投資は行ないません。 |
| 分配方針 | 運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。 | |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 新株予約権付社債（転換社債）組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|--------------|------|--------|--------|--------------------|--------|
| | 期騰落 | 中率 | NOMURA-BPI総合 | 期騰落 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 20期(2021年8月27日) | 13,805 | 0.9 | 388.404 | 0.5 | 93.9 | 2.2 | — | 22,088 |
| 21期(2022年8月29日) | 13,396 | △3.0 | 376.960 | △2.9 | 97.0 | 1.2 | — | 18,293 |
| 22期(2023年8月28日) | 13,120 | △2.1 | 367.538 | △2.5 | 96.9 | — | — | 40,182 |
| 23期(2024年8月27日) | 12,913 | △1.6 | 361.811 | △1.6 | 94.0 | — | — | 60,296 |
| 24期(2025年8月27日) | 12,216 | △5.4 | 343.012 | △5.2 | 97.1 | 3.4 | — | 23,441 |

*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」、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」は実質比率を記載しております。

*債券組入比率には、信託受益権を含みます。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

※NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、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いません。

○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 券 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 新株予約権付社債 (転換社債) 組 入 比 率 |
|---------------------|-------------|--------|-------------------------|--------|-------------|-----------|-------------------------------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | | |
| (期 首) 2024年8月27日 | 円 12,913 | % — | NOMURA-BPI総合 361,811 | % — | % 94.0 | % — | % — |
| 8月末 | 12,892 | △0.2 | 361,325 | △0.1 | 95.7 | — | — |
| 9月末 | 12,930 | 0.1 | 362,344 | 0.1 | 95.8 | — | — |
| 10月末 | 12,876 | △0.3 | 360,511 | △0.4 | 95.6 | — | — |
| 11月末 | 12,798 | △0.9 | 357,991 | △1.1 | 96.9 | — | — |
| 12月末 | 12,785 | △1.0 | 357,613 | △1.2 | 98.1 | — | — |
| 2025年1月末 | 12,695 | △1.7 | 354,971 | △1.9 | 98.3 | 0.6 | — |
| 2月末 | 12,606 | △2.4 | 352,609 | △2.5 | 97.3 | 0.6 | — |
| 3月末 | 12,477 | △3.4 | 349,164 | △3.5 | 98.0 | 0.6 | — |
| 4月末 | 12,522 | △3.0 | 351,194 | △2.9 | 96.9 | 0.7 | — |
| 5月末 | 12,352 | △4.3 | 346,678 | △4.2 | 97.3 | 3.5 | — |
| 6月末 | 12,424 | △3.8 | 348,511 | △3.7 | 97.2 | 3.5 | — |
| 7月末 | 12,286 | △4.9 | 344,963 | △4.7 | 98.2 | 3.5 | — |
| (期 末) 2025年8月27日 | 12,216 | △5.4 | 343,012 | △5.2 | 97.1 | 3.4 | — |

*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」、「新株予約権付社債（転換社債）組入比率」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。

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【基準価額の推移】

基準価額は、期首12,913円から期末12,216円に697円下落しました。国内の財政拡張の可能性が高まったことや、日銀が政策金利を0.5%に引き上げたことなどから、国内金利は上昇しました。その結果、期中の騰落率は－5.4%となり、ベンチマークの－5.2%を0.2ポイント下回りました。

【運用経過】

主要投資対象である<ノムラ日本債券オープン マザーファンド>を、期を通じて高位に組み入れました。

【今後の運用方針】

主要投資対象である<ノムラ日本債券オープン マザーファンド>の組み入れを高位に維持し、基準価額の向上に努めます。

<ノムラ日本債券オープン マザーファンド>においては、ファンダメンタルズ（経済の基礎的諸条件）分析およびマーケット分析などを行なうと共に、セクター分析や個別発行体の信用リスク分析などに基づき、デュレーション、公社債のセクター（種別・格付別など）配分、個別銘柄選定などをアクティブに決定・変更し、収益の獲得を目指します。

○1口当たりの費用明細

(2024年8月28日～2025年8月27日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|-----------------------------------|---|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 会 社) | 円 43 (35) (3) (6) | % 0.341 (0.275) (0.022) (0.044) | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 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 口座内でのファンドの管理および事務手続き等 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 (先 物 ・ オ プ シ ョ ン) | 0 (0) | 0.000 (0.000) | (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 |
| (c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (監 査 費 用) | 0 (0) (0) | 0.002 (0.000) (0.002) | (c) 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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用 |
| 合 計 | 43 | 0.343 | |
| 期中の平均基準価額は、12,636円です。 | | | |

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

* 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1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

(2024年8月28日～2025年8月27日)

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------|-----------------|-----------------|------------------|------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| ノムラ日本債券オープン マザーファンド | 千口 2,020,263 | 千円 2,713,400 | 千口 27,695,762 | 千円 37,592,500 |

* 単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

（2024年8月28日～2025年8月27日）

利害関係人との取引状況

<ノムラ日本債券オープンF（適格機関投資家専用）>

該当事項はございません。

<ノムラ日本債券オープン マザーファンド>

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|--------|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 公社債 | 百万円 281,187 | 百万円 5,512 | % 2.0 | 百万円 289,679 | 百万円 7,731 | % 2.7 |
| 債券先物取引 | 11,304 | 11,304 | 100.0 | 6,115 | 6,115 | 100.0 |

平均保有割合 23.7%

※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。

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 25千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 25千円 |
| (B) / (A) | 100.0% |

*売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

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

○組入資産の明細

（2025年8月27日現在）

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| ノムラ日本債券オープン マザーファンド | 千口 43,495,799 | 千口 17,820,300 | 千円 23,394,489 |

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2025年8月27日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| ノムラ日本債券オープン マザーファンド | 23,394,489 | 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 97,068 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 23,491,557 | 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

ノムラ日本債券オープン マザーファンドにおいて投資信託及び投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、対象期間中（2024年8月6日～2025年8月4日）に該当はありませんでした。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年8月27日現在)

○損益の状況 (2024年8月28日～2025年8月27日)

| 項 目 | 当 期 末 |
|--------------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 23,491,557,463 |
| コール・ローン等 | 96,766,313 |
| ノムラ日本債券オープン マザーファンド(評価額) | 23,394,489,857 |
| 未収入金 | 300,000 |
| 未収利息 | 1,293 |
| (B) 負債 | 50,296,960 |
| 未払信託報酬 | 49,974,603 |
| その他未払費用 | 322,357 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 23,441,260,503 |
| 元本 | 19,188,440,000 |
| 次期繰越損益金 | 4,252,820,503 |
| (D) 受益権総口数 | 1,918,844口 |
| 1口当たり基準価額(C/D) | 12,216円 |

(注) 期首元本額は46,696,020,000円、期中追加設定元本額は2,577,180,000円、期中一部解約元本額は30,084,760,000円、1口当たり純資産額は12,216円です。

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 422,874 |
| 受取利息 | 422,874 |
| (B) 有価証券売買損益 | △1,148,203,251 |
| 売買益 | 523,411,385 |
| 売買損 | △1,671,614,636 |
| (C) 信託報酬等 | △ 132,238,980 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △1,280,019,357 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 323,066,841 |
| (F) 追加信託差損益金 | 5,855,906,701 |
| (配当等相当額) | (8,157,392,737) |
| (売買損益相当額) | (△2,301,486,036) |
| (G) 計(D+E+F) | 4,252,820,503 |
| 次期繰越損益金(G) | 4,252,820,503 |
| 追加信託差損益金 | 5,855,906,701 |
| (配当等相当額) | (8,159,291,525) |
| (売買損益相当額) | (△2,303,384,824) |
| 分配準備積立金 | 537,639,663 |
| 繰越損益金 | △2,140,725,861 |

*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。

○お知らせ

- ①設定解約の申込受付締め時間の規定を変更する所要の約款変更を行ないました。
＜変更適用日：2024年11月5日＞

- ②「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正に伴い、運用報告書の電子交付に関する
条文を変更する所要の約款変更を行ないました。 ＜変更適用日：2025年4月1日＞

ノムラ日本債券オープン マザーファンド

運用報告書

第24期（決算日2025年8月27日）

作成対象期間（2024年8月28日～2025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 | 公社債への投資にあたっては、マクロ経済分析、投資環境等のファンダメンタルズ分析およびマーケット分析等を行なうと共に、セクター分析や個別発行体の信用リスク分析等に基づき、デューレーション、公社債のセクター（種別・格付別等）配分、個別銘柄選定等をアクティブに決定・変更し、収益の獲得を目指します。先物取引等も適宜活用します。 |
| 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。 外貨建資産への投資は行いません。 デリバティブの使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株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<https://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 | 新株予約権付社債(転換社債)組入比率 | 純資産額 |
|-----------------|--------|------|--------------|------|-------|--------|--------------------|---------|
| | 騰落 | 中率 | NOMURA-BPI総合 | 騰落中率 | | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 20期(2021年8月27日) | 14,689 | 1.1 | 388,404 | 0.5 | 94.1 | 2.2 | — | 110,684 |
| 21期(2022年8月29日) | 14,281 | △2.8 | 376,960 | △2.9 | 97.2 | 1.2 | — | 124,805 |
| 22期(2023年8月28日) | 14,000 | △2.0 | 367,538 | △2.5 | 97.0 | — | — | 145,577 |
| 23期(2024年8月27日) | 13,835 | △1.2 | 361,811 | △1.6 | 94.2 | — | — | 180,800 |
| 24期(2025年8月27日) | 13,128 | △5.1 | 343,012 | △5.2 | 97.3 | 3.4 | — | 149,919 |

*債券組入比率には、信託受益権を含みます。

*債券先物比率は買い建て比率-売り建て比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年月日 | 基準価額 | | ベンチマーク | | 債組入比率 | 債券先物比率 | 新株予約権付社債(転換社債)組入比率 |
|------------|--------|------|--------------|------|-------|--------|--------------------|
| | 騰落 | 騰落率 | NOMURA-BPI総合 | 騰落率 | | | |
| (期首) | 円 | % | | % | % | % | % |
| 2024年8月27日 | 13,835 | — | 361,811 | — | 94.2 | — | — |
| 8月末 | 13,813 | △0.2 | 361,325 | △0.1 | 95.8 | — | — |
| 9月末 | 13,858 | 0.2 | 362,344 | 0.1 | 95.8 | — | — |
| 10月末 | 13,801 | △0.2 | 360,511 | △0.4 | 95.8 | — | — |
| 11月末 | 13,722 | △0.8 | 357,991 | △1.1 | 97.1 | — | — |
| 12月末 | 13,712 | △0.9 | 357,613 | △1.2 | 98.3 | — | — |
| 2025年1月末 | 13,619 | △1.6 | 354,971 | △1.9 | 98.5 | 0.6 | — |
| 2月末 | 13,527 | △2.2 | 352,609 | △2.5 | 97.5 | 0.6 | — |
| 3月末 | 13,392 | △3.2 | 349,164 | △3.5 | 98.2 | 0.6 | — |
| 4月末 | 13,444 | △2.8 | 351,194 | △2.9 | 97.1 | 0.7 | — |
| 5月末 | 13,266 | △4.1 | 346,678 | △4.2 | 97.5 | 3.5 | — |
| 6月末 | 13,347 | △3.5 | 348,511 | △3.7 | 97.4 | 3.5 | — |
| 7月末 | 13,202 | △4.6 | 344,963 | △4.7 | 98.0 | 3.5 | — |
| (期末) | | | | | | | |
| 2025年8月27日 | 13,128 | △5.1 | 343,012 | △5.2 | 97.3 | 3.4 | — |

*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。

NOMURA-BPI総合は、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が公表する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。

※NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、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いません。

◎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13,835円から期末には13,128円に707円の値下がりとなりました。

上昇要因：・保有する債券から金利収入を得たこと

下落要因：・2024年10月から2025年3月にかけて、国内の財政拡張の可能性が高まったことや、日銀が政策金利を0.5%に引き上げたことなどから、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したこと

○投資環境

今期の10年国債利回りは0.88%でスタートしました。2024年10月下旬の衆院選で与党の獲得議席が過半数を割り込み、野党の政策を反映して財政運営が拡張的になる可能性が意識されたことから、10年国債利回りは1.0%を上回る水準まで上昇しました。その後も、2025年1月に日銀が政策金利の0.5%への引き上げを決定したことなどから、利回りは一時1.5%を上回る水準まで上昇しました。4月上旬には米国が相互関税を課すことを発表したことで、株式市場が急落するなどリスク回避的な姿勢が強まり、利回りは一時1.1%近傍まで低下（価格は上昇）しましたが、相互関税の90日間停止が発表されたことや、超長期国債の入札が相次いで低調な結果となったことを受け、利回りは1.6%近くまで上昇しました。その後は、6月中旬の金融政策決定会合で、2026年4月以降の国債買入れの減額ペースを緩める方針を決定したことや、6月下旬に財務省が国債発行計画を修正し、超長期国債の発行を減額する方針を示したことか

ら、利回りは一時1.4%を下回る水準まで低下しましたが、7月中旬の参院選で与党の獲得議席が過半数を割り込んだことや、7月下旬に日米関税交渉で合意したことから、再度上昇に転じました。その結果、期末の10年国債利回りは1.63%となりました。

○当ファンドのポートフォリオ

・デュレーション

期首はベンチマーク対比でデュレーション※を短期化としていました。期中、日銀の追加利上げを見込むものの、市場価格に一定程度反映されたと判断し、金利が上昇したタイミングで、デュレーションを長期化戦略へと転換しました。期末時点ではベンチマーク対比で長期化としております。

※デュレーションとは、債券の利回り変化に対する価格変化の感応度を表し、数値が大きいほど利回り変化に対する価格変化が大きくなります。

・現物債券ポートフォリオの推移

<残存年数別構成>

期首はベンチマーク対比で超長期債の組み入れを多めとしていました。期中、イールドカーブの割安割高分析に基づいて、長期・超長期債のウェイトを機動的に調整しました。期末にはベンチマーク対比で超長期債の組み入れを多めとしたポートフォリオとしています。

<種別構成>

信用市場の安定推移を見込み、事業債・円建て外債をオーバーウェイト（ベンチマーク対比で多めの組み入れ）としました。期中、信用力の安定が見込まれる事業債の組み入れを行いません。

○当ファンドのベンチマークとの差異

今期の基準価額の騰落率は-5.1%となり、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の騰落率-5.2%を0.1ポイント上回りました。

【主な差異要因】

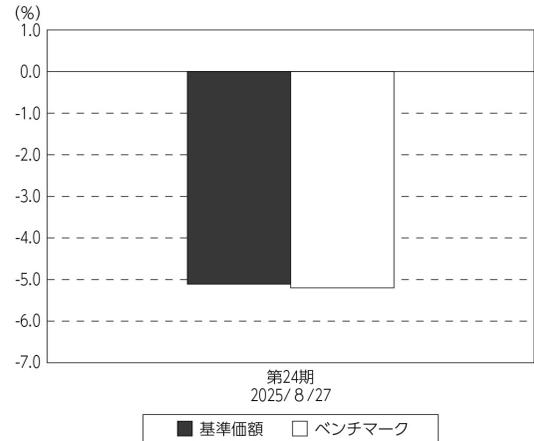
(プラス要因)

- ・ スプレッド（国債に対する上乗せ金利）が厚い事業債をベンチマーク対比で多めに保有したこと
- ・ 国債の銘柄選択効果が奏功したこと

(マイナス要因)

- ・ 金利が上昇したなか、ファンドのデュレーションをベンチマーク対比で長めとしたこと
- ・ 金利上昇幅が相対的に大きかった超長期債をベンチマーク対比で多めに保有したこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

◎今後の運用方針

- ・ 国内景気は、賃上げによる所得環境の改善を通じて、個人消費を中心に緩やかな改善が続くと考えています。国内金利については、海外経済の先行き不透明感が残るなか日銀は追加利上げを緩やかに進めると見込むため、金利上昇余地は限られると考えています。
- ・ 引き続き信託財産の成長を目標とし積極的な運用を行ないます。公社債への投資にあたっては、マクロ経済分析、投資環境等のファンダメンタルズ分析およびマーケット分析を行なうと共に、セクター分析や個別発行体の信用リスク分析等に基づき、デュレーション、公社債のセクター（種別・格付別）配分、個別銘柄選択等をアクティブに決定・変更し、収益の獲得を目指します。

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

(2024年8月28日～2025年8月27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) | 0 (0) | 0.000 (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 |
| 合 計 | 0 | 0.000 | |
| 期中の平均基準価額は、13,558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

(2024年8月28日～2025年8月27日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|---|----------------|-------------------|---------------------------|
| 国 | 国債証券 | 千円 267,096,842 | 千円 286,773,273 |
| | 特殊債券 | 94,228 | 200,110 (44,672) |
| 内 | 社債券（投資法人債券を含む） | 13,996,560 | 2,705,736 (6,200,000) |

*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。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|---------------|--------------|----------|----------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 | 債券先物取引 | 百万円 11,304 | 百万円 6,115 | 百万円 - | 百万円 - |

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2024年8月28日～2025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 281,187 | 百万円 5,512 | % 2.0 | 百万円 289,679 | 百万円 7,731 | % 2.7 |
| 債券先物取引 | 11,304 | 11,304 | 100.0 | 6,115 | 6,115 | 100.0 |

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|--------|
| 売買委託手数料総額 (A) | 137千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 137千円 |
| (B) / (A) | 100.0% |

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

○組入資産の明細

(2025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 | 105,880,000 (1,000,000) | 93,674,480 (995,505) | 62.5 (0.7) | — (—) | 55.3 (—) | 1.4 (—) | 5.8 (0.7) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 1,062,950 (1,062,950) | 871,743 (871,743) | 0.6 (0.6) | — (—) | 0.4 (0.4) | — (—) | 0.1 (0.1) |
| 金融債券 | 700,000 (700,000) | 690,245 (690,245) | 0.5 (0.5) | — (—) | — (—) | 0.1 (0.1) | 0.3 (0.3) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 51,500,000 (51,500,000) | 50,624,268 (50,624,268) | 33.8 (33.8) | — (—) | 23.4 (23.4) | 5.5 (5.5) | 4.8 (4.8) |
| 合 計 | 159,142,950 (54,262,950) | 145,860,737 (53,181,762) | 97.3 (35.5) | — (—) | 79.2 (23.9) | 7.0 (5.6) | 11.1 (6.0) |

* ()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。

* S&Pグローバル・レーティング、ムーディーズ・レーティングス、格付投資情報センター (R&I)、日本格付研究所 (JCR) による格付けを採用しています。

(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 | |
| 国庫短期証券 第1313回 | | — | 1,000,000 | 995,505 | 2026/6/22 |
| 国庫債券 利付 (2年) 第463回 | | 0.4 | 4,800,000 | 4,788,792 | 2026/8/1 |
| 国庫債券 利付 (2年) 第471回 | | 0.9 | 800,000 | 800,936 | 2027/4/1 |
| 国庫債券 利付 (5年) 第148回 | | 0.005 | 2,100,000 | 2,090,985 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 利付 (5年) 第154回 | | 0.1 | 600,000 | 590,634 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 利付 (5年) 第163回 | | 0.4 | 1,500,000 | 1,474,560 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第365回 | | 0.1 | 1,500,000 | 1,393,770 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第366回 | | 0.2 | 3,900,000 | 3,633,045 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第367回 | | 0.2 | 9,190,000 | 8,525,471 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第368回 | | 0.2 | 100,000 | 92,346 | 2032/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第369回 | | 0.5 | 8,000,000 | 7,519,840 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第370回 | | 0.5 | 2,600,000 | 2,434,224 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第371回 | | 0.4 | 2,500,000 | 2,313,375 | 2033/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第372回 | | 0.8 | 4,000,000 | 3,806,800 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第373回 | | 0.6 | 1,600,000 | 1,492,464 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第374回 | | 0.8 | 1,200,000 | 1,133,700 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第376回 | | 0.9 | 800,000 | 756,568 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第379回 | | 1.5 | 600,000 | 593,652 | 2035/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第69回 | | 0.7 | 500,000 | 295,250 | 2050/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第77回 | | 1.6 | 6,100,000 | 4,404,688 | 2052/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第80回 | | 1.8 | 400,000 | 300,748 | 2053/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第83回 | | 2.2 | 5,230,000 | 4,291,581 | 2054/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第85回 | | 2.3 | 3,400,000 | 2,848,826 | 2054/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第86回 | | 2.4 | 200,000 | 171,526 | 2055/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第162回 | | 0.6 | 2,000,000 | 1,723,680 | 2037/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第163回 | | 0.6 | 400,000 | 342,472 | 2037/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第164回 | | 0.5 | 800,000 | 671,456 | 2038/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第166回 | | 0.7 | 5,000,000 | 4,251,900 | 2038/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第167回 | | 0.5 | 600,000 | 492,942 | 2038/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第169回 | | 0.3 | 6,500,000 | 5,105,295 | 2039/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第170回 | | 0.3 | 2,380,000 | 1,854,472 | 2039/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第171回 | | 0.3 | 5,120,000 | 3,957,708 | 2039/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第172回 | | 0.4 | 1,350,000 | 1,051,879 | 2040/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第174回 | | 0.4 | 500,000 | 383,425 | 2040/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第175回 | | 0.5 | 800,000 | 618,712 | 2040/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第189回 | | 1.9 | 5,700,000 | 5,143,965 | 2044/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第190回 | | 1.8 | 1,400,000 | 1,237,530 | 2044/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第191回 | | 2.0 | 4,810,000 | 4,379,793 | 2044/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第192回 | | 2.4 | 5,900,000 | 5,709,961 | 2045/3/20 |
| 小 | 計 | | 105,880,000 | 93,674,480 | |
| 特殊債券 (除く金融債) | | | | | |
| 地方公共団体金融機構債券 F504回 | | 0.544 | 200,000 | 96,326 | 2053/10/31 |
| 成田国際空港 第18回 | | 0.556 | 200,000 | 200,034 | 2025/10/30 |
| 貸付債権担保第132回住宅金融支援機構債券 | | 0.4 | 193,407 | 168,515 | 2053/5/10 |
| 貸付債権担保第139回住宅金融支援機構債券 | | 0.46 | 201,603 | 175,438 | 2053/12/10 |

| 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 | |
| 貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券 | | 0.38 | 267,940 | 231,427 | 2054/1/10 |
| 小 計 | | | 1,062,950 | 871,743 | |
| 金融債券 | | | | | |
| 商工債券 利付第856回い号 | | 0.09 | 500,000 | 494,905 | 2026/9/25 |
| 商工債券 利付第883回い号 | | 0.63 | 200,000 | 195,340 | 2028/12/27 |
| 小 計 | | | 700,000 | 690,245 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | | |
| 中部電力 第524回 | | 0.39 | 500,000 | 493,790 | 2027/5/25 |
| 関西電力 第1回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | | 0.896 | 700,000 | 693,070 | 2082/3/20 |
| 関西電力 第508回 | | 0.455 | 400,000 | 395,688 | 2027/4/23 |
| 関西電力 第513回 | | 0.46 | 300,000 | 294,906 | 2027/12/20 |
| 中国電力 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 0.84 | 100,000 | 89,400 | 2061/12/23 |
| 東北電力 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 1.545 | 1,500,000 | 1,496,415 | 2057/9/14 |
| 東北電力 第3回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 2.099 | 500,000 | 482,805 | 2062/9/15 |
| 東北電力 第494回 | | 0.425 | 400,000 | 394,736 | 2027/6/25 |
| 東北電力 第531回 | | 0.31 | 400,000 | 370,740 | 2031/5/23 |
| 九州電力 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 0.99 | 200,000 | 200,024 | 2080/10/15 |
| 九州電力 第3回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 1.3 | 300,000 | 286,200 | 2080/10/15 |
| 九州電力 第491回 | | 0.34 | 400,000 | 371,812 | 2031/4/25 |
| 沖縄電力 第1回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | | 1.779 | 100,000 | 99,459 | 2052/12/25 |
| 東京電力パワーグリッド 第16回 | | 0.57 | 500,000 | 499,969 | 2025/9/12 |
| 東京電力パワーグリッド 第33回 | | 0.68 | 100,000 | 99,189 | 2027/1/27 |
| 東京電力パワーグリッド 第35回 | | 1.2 | 100,000 | 97,391 | 2030/4/23 |
| 東京電力パワーグリッド 第39回 | | 1.08 | 500,000 | 483,115 | 2030/7/16 |
| 東京電力パワーグリッド 第43回 | | 1.42 | 100,000 | 78,221 | 2041/1/21 |
| 東京電力パワーグリッド 第50回 | | 0.94 | 200,000 | 185,726 | 2032/4/26 |
| 東京電力パワーグリッド 第53回 | | 0.9 | 100,000 | 99,161 | 2027/7/21 |
| 東京電力パワーグリッド 第63回 | | 0.98 | 100,000 | 98,753 | 2028/4/19 |
| 東京電力パワーグリッド 第65回 | | 0.74 | 100,000 | 97,903 | 2028/7/13 |
| 東京電力パワーグリッド 第71回 | | 0.996 | 100,000 | 97,817 | 2029/4/18 |
| 東京電力パワーグリッド 第80回 | | 1.757 | 100,000 | 97,077 | 2033/1/21 |
| 東京電力パワーグリッド 第82回 | | 1.76 | 100,000 | 99,421 | 2030/5/28 |
| 東京電力パワーグリッド 第83回 | | 2.616 | 200,000 | 199,476 | 2035/5/28 |
| 朝日生命 第1回利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | | 1.5 | 100,000 | 99,151 | 2057/2/10 |
| 大和ハウス工業 第4回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約 | | 1.27 | 300,000 | 291,600 | 2059/9/25 |
| 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 | 1,500,000 | 1,500,300 | 2080/10/15 |
| キリンホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付 | | 2.075 | 100,000 | 99,921 | 2035/5/29 |
| サントリーホールディングス 第3回利払繰延条項・期限(劣後) | | 0.5 | 500,000 | 494,405 | 2081/12/26 |
| 不二製油グループ本社第2回利払繰延条項期限前償還劣後特約付 | | 1.571 | 100,000 | 98,290 | 2054/4/25 |
| 日鉄興和不動産 第9回社債間限定同順位特約付 | | 1.847 | 300,000 | 299,142 | 2030/7/25 |
| 中央日本土地建物グループ 第4回社債間限定同順位特約付 | | 0.41 | 700,000 | 689,752 | 2027/2/17 |
| 中央日本土地建物グループ 第6回社債間限定同順位特約付 | | 1.0 | 200,000 | 196,934 | 2028/2/16 |
| 中央日本土地建物グループ 第7回社債間限定同順位特約付 | | 0.909 | 200,000 | 195,280 | 2028/8/15 |
| 中央日本土地建物グループ 第10回社債間限定同順位特約付 | | 1.65 | 100,000 | 98,880 | 2030/2/14 |
| 中央日本土地建物グループ 第11回社債間限定同順位特約付 | | 1.826 | 100,000 | 99,491 | 2030/8/15 |
| ヒューリック 第7回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 2.102 | 100,000 | 99,592 | 2060/3/6 |
| 森ビル 第3回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 1.36 | 100,000 | 98,945 | 2057/10/11 |
| 森急不動産ホールディングス 第3回期限前償還条項付劣後特約付 | | 2.208 | 100,000 | 100,340 | 2060/3/12 |

| 銘柄 | 当 期 末 | 評 価 額 | | | 償 還 年 月 日 |
|----------------------------------|-------|-----------|-----------|------------|-----------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | % | 千円 | 千円 | | |
| 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 | 400,000 | 383,852 | 2051/7/21 | |
| レゾナックホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付 | 1.409 | 100,000 | 98,241 | 2029/12/10 | |
| 住友化学 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 1.3 | 200,000 | 189,470 | 2079/12/13 | |
| 住友化学 第3回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 3.3 | 1,500,000 | 1,561,800 | 2059/9/12 | |
| 日本酸素ホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.599 | 200,000 | 195,734 | 2028/8/31 | |
| 武田薬品工業 第2回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 1.934 | 1,200,000 | 1,186,848 | 2084/6/25 | |
| 武田薬品工業 第17回社債間限定同順位特約付 | 1.599 | 500,000 | 498,140 | 2030/6/12 | |
| 武田薬品工業 第19回社債間限定同順位特約付 | 2.292 | 800,000 | 794,736 | 2035/6/12 | |
| Zホールディングス 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.46 | 100,000 | 96,431 | 2028/7/28 | |
| ENEOS 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 0.7 | 500,000 | 495,660 | 2081/6/15 | |
| ENEOS 第4回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 1.328 | 300,000 | 294,348 | 2083/9/20 | |
| 東海カーボン第3回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | 2.118 | 100,000 | 100,050 | 2059/7/3 | |
| 日本製鉄 第4回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | 1.534 | 300,000 | 291,720 | 2059/6/13 | |
| 日本製鉄 第5回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | 1.882 | 200,000 | 191,000 | 2061/6/13 | |
| 日本製鉄 第6回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | 2.328 | 300,000 | 281,970 | 2064/6/13 | |
| 日本製鉄 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.564 | 100,000 | 98,072 | 2028/3/17 | |
| ジェイ エフ イー 第1回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付 | 0.68 | 100,000 | 97,533 | 2081/6/10 | |
| ちゅうぎんフィナンシャルグループ 第1回期限前償還条項付 | 1.93 | 100,000 | 98,460 | 2034/12/20 | |
| 日本生命第8回劣後ローン流動化利払繰延条項・期限前償還条項付 | 1.1 | 1,500,000 | 1,482,450 | 2052/9/28 | |
| 住友生命第3回劣後ローン流動化第1回利払繰延条項・期限前償還 | 1.67 | 800,000 | 791,640 | 2082/12/27 | |
| DMG森精機第5回利払繰延条項任意償還条項付無担保永久債劣後 | 2.954 | 100,000 | 99,346 | 2173/12/12 | |
| パナソニック 第24回社債間限定同順位特約付 | 0.709 | 400,000 | 391,792 | 2028/9/14 | |
| パナソニック 第25回社債間限定同順位特約付 | 1.051 | 300,000 | 290,634 | 2030/9/13 | |
| パナソニック第1回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付 | 0.74 | 900,000 | 893,007 | 2081/10/14 | |
| パナソニック第2回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付 | 0.885 | 600,000 | 582,120 | 2081/10/14 | |
| 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 | 98,725 | 2046/11/22 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ 第7回期限前償還条項 | 0.6 | 200,000 | 199,960 | 2030/9/3 | |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ 第8回期限前償還条項 | 1.786 | 500,000 | 492,790 | 2035/4/25 | |
| 明治安田生命 第3回A号劣後特約付 | 1.11 | 300,000 | 293,091 | 2047/11/6 | |
| マツダ 第31回社債間限定同順位特約付 | 0.867 | 100,000 | 96,871 | 2029/3/7 | |
| マツダ 第34回社債間限定同順位特約付 | 1.546 | 300,000 | 284,025 | 2031/12/3 | |
| 日本生命第1回劣後ローン流動化利払繰延条項・期限前償還条項付 | 1.05 | 100,000 | 98,240 | 2048/4/27 | |
| 日本生命第2回劣後ローン流動化利払繰延条項・期限前償還条項付 | 1.03 | 300,000 | 293,490 | 2048/9/18 | |
| 楽天カード 第11回社債間限定同順位特約付 | 1.68 | 100,000 | 99,981 | 2026/6/18 | |
| 日本生命第5回劣後ローン流動化利払繰延条項・期限前償還条項付 | 1.05 | 200,000 | 189,060 | 2050/9/23 | |
| 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 | 99,220 | 2051/7/2 | |
| 日本生命第7回劣後ローン流動化利払繰延条項・期限前償還条項付 | 1.03 | 400,000 | 367,672 | 2052/5/10 | |
| 明治安田生命第2回劣後ローン流動化第1回利払繰延条項・期限前 | 1.25 | 400,000 | 371,412 | 2052/8/3 | |
| 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 | 300,000 | 298,965 | 2081/3/4 | |
| 兼松 第7回無担保社債間限定同順位特約付 | 1.475 | 100,000 | 99,048 | 2030/2/28 | |
| 三菱商事 第7回利払繰延条項期限前償還劣後特約付 | 0.51 | 600,000 | 594,972 | 2081/9/13 | |
| 阪和興業 第35回社債間限定同順位特約付 | 0.54 | 100,000 | 97,505 | 2028/6/1 | |
| ニプロ 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 1.6 | 100,000 | 100,000 | 2055/9/28 | |
| ニプロ 第2回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 3.067 | 600,000 | 597,516 | 2060/7/25 | |
| 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 | 96,561 | 2029/3/15 | |
| イオン 第24回社債間限定同順位特約付 | 0.799 | 800,000 | 782,464 | 2028/8/17 | |
| イオン 第8回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 1.185 | 100,000 | 91,371 | 2051/9/8 | |
| イオン 第9回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 1.734 | 100,000 | 80,669 | 2056/9/8 | |

| 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UFJフィナンシャル・グループ 第17回劣後特約付 | | 0.535 | 200,000 | 194,242 | 2028/5/31 |
| 三菱UFJフィナンシャル 第2回期限前償還条項付劣後特約付 | | 0.25 | 200,000 | 197,982 | 2027/11/4 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ 第13回期限前償還条項付 | | 1.313 | 200,000 | 196,884 | 2031/4/11 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ 第14回期限前償還条項付 | | 1.881 | 300,000 | 291,756 | 2036/4/11 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ第17回任意償還条項付無担 | | 1.804 | 1,000,000 | 996,600 | 2172/1/15 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス 第5回劣後特約付 | | 0.62 | 100,000 | 98,960 | 2026/12/8 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス 第10回劣後特約付 | | 0.55 | 500,000 | 485,485 | 2028/6/14 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス第23回劣後特約付実質破綻 | | 1.475 | 1,800,000 | 1,778,580 | 2034/9/4 |
| 三井住友トラストグループ第9回任意償還条項付無担保永久社債 | | 2.274 | 100,000 | 100,200 | 2173/12/5 |
| 三井住友フィナンシャル 第1回期限前償還条項付担保提供制限等 | | 0.855 | 700,000 | 699,860 | 2027/1/27 |
| 三井住友フィナンシャル 第4回期限前償還条項付担保提供制限等 | | 0.55 | 300,000 | 298,830 | 2027/6/8 |
| 三井住友フィナンシャル 第6回期限前償還条項付担保提供制限等 | | 1.2 | 100,000 | 93,770 | 2034/6/8 |
| 三井住友フィナンシャル・グループ第13回任意償還条項付無担 | | 1.889 | 1,000,000 | 996,200 | 2171/12/5 |
| 三井住友フィナンシャル・グループ第15回任意償還条項付無担 | | 1.844 | 500,000 | 495,450 | 2172/6/5 |
| 群馬銀行第1回任意償還条項付無担保永久債劣後 | | 2.244 | 100,000 | 98,010 | 2172/6/15 |
| みずほフィナンシャルグループ 第10回劣後特約付 | | 0.65 | 100,000 | 98,983 | 2027/1/26 |
| みずほフィナンシャルグループ 第28回劣後特約付 | | 1.412 | 100,000 | 94,190 | 2033/7/13 |
| 芙蓉総合リース 第1回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約 | | 1.849 | 200,000 | 199,848 | 2057/12/14 |
| 芙蓉総合リース 第2回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約 | | 1.92 | 100,000 | 98,994 | 2059/9/18 |
| N T Tファイナンス 第17回日本電信電話保証付 | | 0.28 | 100,000 | 97,819 | 2027/12/20 |
| N T Tファイナンス 第18回日本電信電話保証付 | | 0.38 | 400,000 | 376,720 | 2030/9/20 |
| N T Tファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付 | | 0.838 | 200,000 | 184,332 | 2033/6/20 |
| N T Tファイナンス 第38回社債間限定同順位特約付 | | 1.398 | 1,600,000 | 1,510,560 | 2034/9/20 |
| 東京センチュリー 第4回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特 | | 1.929 | 100,000 | 99,687 | 2059/12/10 |
| アイフル 第67回特定社債間限定同順位特約付 | | 0.9 | 100,000 | 99,262 | 2027/1/26 |
| アイフル 第69回特定社債間限定同順位特約付 | | 1.123 | 100,000 | 99,320 | 2027/6/11 |
| アイフル 第70回特定社債間限定同順位特約付 | | 1.37 | 200,000 | 198,934 | 2028/1/24 |
| ジャックス 第32回社債間限定同順位特約付 | | 0.23 | 100,000 | 99,408 | 2026/6/8 |
| オリエントコーポレーション 第36回社債間限定同順位特約付 | | 0.63 | 200,000 | 195,306 | 2028/7/13 |
| オリックス 第5回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付 | | 2.011 | 200,000 | 199,100 | 2060/3/18 |
| オリックス 第6回利払繰延条項期限前償還条項付劣後特約付 | | 1.728 | 100,000 | 98,310 | 2060/3/31 |
| 三菱HCキャピタル 第1回利払繰延条項期限前償還劣後特約付 | | 0.63 | 1,000,000 | 991,590 | 2081/9/27 |
| 三菱HCキャピタル 第4回社債間限定同順位特約付 | | 0.33 | 300,000 | 289,485 | 2029/1/31 |
| S B I証券 第1回無担保社債(劣後特約付) | | 2.081 | 100,000 | 99,954 | 2028/3/24 |
| 第一生命HD第4回利払繰延条項任意償還条項付無担保永久債劣後 | | 0.9 | 300,000 | 274,224 | 2170/6/23 |
| 東京海上日動火災保険 第1回利払繰延条項 期限前償還条項劣後 | | 0.96 | 100,000 | 96,431 | 2079/12/24 |
| 三井住友海上火災保険 第7回社債間限定同順位特約付 | | 0.19 | 100,000 | 98,903 | 2026/11/13 |
| 三井住友海上火災保険第4回利払繰延・期限前償還条項劣後特約付 | | 1.17 | 300,000 | 296,520 | 2077/12/10 |
| 三井住友海上火災保険第5回利払繰延・期限前償還条項劣後特約付 | | 1.02 | 100,000 | 93,860 | 2081/2/7 |
| 損保ジャパン日本興亜第3回利払繰延・期限前償還条項劣後特約付 | | 1.06 | 200,000 | 198,178 | 2077/4/26 |
| 損保ジャパン日本興亜第4回利払繰延・期限前償還条項劣後特約付 | | 2.5 | 100,000 | 99,457 | 2083/2/13 |
| T&Dホールディングス第3回利払繰延・期限前償還条項劣後特約 | | 0.94 | 100,000 | 94,860 | 2050/2/4 |
| 三菱地所 第5回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | | 0.66 | 100,000 | 99,799 | 2081/2/3 |
| 東京建物 第4回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | | 2.663 | 300,000 | 299,142 | 2062/6/5 |
| イオンモール 第33回社債間限定同順位特約付 | | 0.72 | 100,000 | 96,045 | 2029/8/10 |
| 相鉄ホールディングス 第46回社債間限定同順位特約付 | | 1.99 | 100,000 | 98,425 | 2035/6/20 |
| 名古屋鉄道 第52回社債間限定同順位特約付 | | 0.75 | 200,000 | 171,856 | 2036/8/29 |
| 名古屋鉄道 第75回社債間限定同順位特約付 | | 1.89 | 100,000 | 98,332 | 2035/6/19 |

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | 償 還 年 月 日 |
|---------------------------------|-------|-------------|-------------|------------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 商船三井 第1回利払繰延条項 期限前償還条項付劣後特約付 | 1.6 | 100,000 | 100,040 | 2056/4/27 |
| 日本航空 第1回利払繰延条項任意償還条項付無担保永久債劣後 | 3.218 | 1,200,000 | 1,223,280 | 2173/10/16 |
| USEN-NEXT HOLDINGS 第1回無担保社債間限定 | 1.02 | 100,000 | 98,234 | 2027/9/24 |
| ソフトバンク 第21回社債間限定同順位特約付 | 0.82 | 200,000 | 195,658 | 2028/7/12 |
| 学研ホールディングス 第2回無担保社債間限定同順位特約付 | 1.83 | 100,000 | 100,013 | 2028/3/10 |
| JERA 第22回無担保社債間限定同順位特約付 | 0.5 | 700,000 | 693,476 | 2027/2/25 |
| JERA 第1回利払繰延条項・期限前償還条項付劣後特約付 | 2.144 | 500,000 | 504,640 | 2057/12/25 |
| イチネンホールディングス 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.53 | 200,000 | 197,952 | 2026/9/14 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第35回円貨社債 | 0.279 | 600,000 | 593,322 | 2026/10/21 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第38回円貨社債 | 0.802 | 100,000 | 100,005 | 2025/10/10 |
| ビー・ビー・シー・イー・エス・エー 第1回期限前償還条項付 | 1.422 | 300,000 | 296,460 | 2029/7/6 |
| ビー・ビー・シー・イー・エス・エー 第20回期限前償還条項付 | 1.657 | 300,000 | 285,669 | 2033/7/13 |
| ビー・ビー・シー・イー・エス・エー 第24回期限前償還条項付 | 1.613 | 300,000 | 299,220 | 2028/12/19 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第13回円貨社債(2023) | 1.042 | 500,000 | 498,700 | 2027/6/11 |
| ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第10回円貨社債 | 1.247 | 200,000 | 199,336 | 2028/5/26 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC | 0.783 | 300,000 | 299,971 | 2025/12/8 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC | 0.974 | 200,000 | 199,324 | 2027/4/23 |
| BNP PARIBAS SA | 0.557 | 300,000 | 297,330 | 2027/5/20 |
| AMERICAN INTERNATIONAL | 1.58 | 500,000 | 498,045 | 2028/2/22 |
| 小 計 | | 51,500,000 | 50,624,268 | |
| 合 計 | | 159,142,950 | 145,860,737 | |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当 期 末 | |
|----|----------|-------|-------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 債券先物取引 | 百万円 | 百万円 |
| | 10年国債標準物 | 5,081 | — |

*単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2025年8月27日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 | % |
| | 145,860,737 | 97.2 |
| コール・ローン等、その他 | 4,208,829 | 2.8 |
| 投資信託財産総額 | 150,069,566 | 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

投資信託及び投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、対象期間中（2024年8月6日～2025年8月4日）に該当はありませんでした。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2025年8月27日現在）

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 150,069,566,988 |
| コール・ローン等 | 3,493,811,960 |
| 公社債(評価額) | 145,860,737,375 |
| 未収入金 | 150,948,000 |
| 未収利息 | 352,549,495 |
| 前払費用 | 109,218,113 |
| 差入委託証拠金 | 102,302,045 |
| (B) 負債 | 149,938,700 |
| 未払金 | 135,338,700 |
| 未払解約金 | 14,600,000 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 149,919,628,288 |
| 元本 | 114,198,148,487 |
| 次期繰越損益金 | 35,721,479,801 |
| (D) 受益権総口数 | 114,198,148,487口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 13,128円 |

(注) 期首元本額は130,685,961,751円、期中追加設定元本額は17,840,249,196円、期中一部解約元本額は34,328,062,460円、1口当たり純資産額は1,3128円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

- ・ノムラ日本債券オープン（野村SMA・EW向け） 78,438,463,930円
- ・ノムラ日本債券オープンF（適格機関投資家専用） 17,820,300,013円
- ・ノムラ日本債券オープン（確定拠出年金向け） 10,608,930,345円
- ・ノムラ日本債券オープン（野村SMA向け） 5,609,755,936円
- ・ノムラ・グローバル・オールスターズ 1,674,566,818円
- ・ノムラ国内債券オープンVA（適格機関投資家専用） 46,131,445円

○損益の状況（2024年8月28日～2025年8月27日）

| 項目 | 当期 |
|--------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,493,351,110 |
| 受取利息 | 1,493,351,110 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 9,758,641,007 |
| 売買益 | 574,067,547 |
| 売買損 | △10,332,708,554 |
| (C) 先物取引等取引損益 | △ 107,107,500 |
| 取引益 | 5,234,600 |
| 取引損 | △ 112,342,100 |
| (D) 保管費用等 | △ 45,115 |
| (E) 当期損益金(A+B+C+D) | △ 8,372,442,512 |
| (F) 前期繰越損益金 | 50,114,509,049 |
| (G) 追加信託差損益金 | 6,229,450,804 |
| (H) 解約差損益金 | △12,250,037,540 |
| (I) 計(E+F+G+H) | 35,721,479,801 |
| 次期繰越損益金(I) | 35,721,479,801 |

* 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

「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正に伴い、運用報告書の電子交付に関する条文を変更する所要の約款変更を行ないました。 <変更適用日：2025年4月1日>

NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信

第16期 2025年9月7日決算

(計算期間:2025年3月8日～2025年9月7日)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

| | |
|-------------|--|
| 商 品 分 類 | 追加型投信／国内／債券／ETF／インデックス型 |
| 信 託 期 間 | 2017年12月7日以降、無期限とします。 |
| 運 用 方 針 | 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、わが国の公社債を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合(NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合)に連動する投資成果を目指します。 |
| 主 な 投 資 対 象 | マザーファンド受益証券およびわが国の公社債を主要投資対象とします。なお、対象指数の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、債券先物取引等のデリバティブ取引を利用することができます。 |
| 主 な 投 資 制 限 | 株式への直接投資は行ないません。株式への投資は、転換社債を転換したもの等に限り、株式への投資割合は信託財産の純資産総額の5%以内とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 |
| 分 配 方 針 | 信託財産から生ずる配当等収益から経費を控除後、全額分配することを原則とします。ただし、分配金がゼロとなる場合もあります。また、売買益が生じても、分配は行ないません。 |

○損益の状況

(2025年3月8日～2025年9月7日)

| 項 目 | 当 期 | 円 |
|------------------|-----------------|-------------|
| (A) 配当等収益 | | 420,719 |
| 受取利息 | | 420,719 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 1,973,559,016 | |
| 売買益 | | 109,792,845 |
| 売買損 | △ 2,083,351,861 | |
| (C) 信託報酬等 | △ 88,058,116 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △ 2,061,196,413 | |
| (E) 前期繰越損益金 | △27,051,269,753 | |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 2,135,408,900 | |
| (G) 解約差損益金 | 5,062,311,000 | |
| (H) 計(D+E+F+G) | △26,185,564,066 | |
| (I) 収益分配金 | △ 704,813,000 | |
| 次期繰越損益金(H+I) | △26,890,377,066 | |
| 分配準備積立金 | | 13,078,415 |
| 繰越損益金 | △26,903,455,481 | |

* 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。

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

○組入資産の明細

(2025年9月7日現在)

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 | 156,259,880 | 138,284,852 | 163,508,009 |

* 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

運用報告書

第23期（決算日2025年3月31日）

作成対象期間（2024年4月2日～2025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ないます。 |
| 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 | 株式への投資は行ないません。 |

野村アセットマネジメント株式会社

東京都江東区豊洲二丁目2番1号

<https://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 |
|-----------------|--------|------|------------------|------|-------|--------|-----------|
| | 騰落率 | 中率 | NOMURA-BPI 総合 | 騰落率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 19期(2021年3月31日) | 13,248 | △0.7 | 385.724 | △0.7 | 99.5 | — | 735,829 |
| 20期(2022年3月31日) | 13,090 | △1.2 | 381.037 | △1.2 | 99.8 | — | 833,820 |
| 21期(2023年3月31日) | 12,871 | △1.7 | 374.743 | △1.7 | 99.2 | — | 893,048 |
| 22期(2024年4月1日) | 12,577 | △2.3 | 365.945 | △2.3 | 99.6 | — | 1,140,881 |
| 23期(2025年3月31日) | 12,001 | △4.6 | 349.164 | △4.6 | 99.5 | — | 1,164,062 |

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属しています。また、同社は当該指数の正確性、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いません。

○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 | 中率 | NOMURA-BPI 総合 | 騰落率 | | |
| (期首) 2024年4月1日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 12,577 | — | 365.945 | — | 99.6 | — |
| 4月末 | 12,452 | △1.0 | 362.353 | △1.0 | 99.8 | — |
| 5月末 | 12,254 | △2.6 | 356.531 | △2.6 | 99.8 | — |
| 6月末 | 12,288 | △2.3 | 357.511 | △2.3 | 99.9 | — |
| 7月末 | 12,276 | △2.4 | 357.155 | △2.4 | 99.3 | — |
| 8月末 | 12,421 | △1.2 | 361.325 | △1.3 | 99.4 | — |
| 9月末 | 12,455 | △1.0 | 362.344 | △1.0 | 99.7 | — |
| 10月末 | 12,392 | △1.5 | 360.511 | △1.5 | 99.8 | — |
| 11月末 | 12,307 | △2.1 | 357.991 | △2.2 | 99.4 | — |
| 12月末 | 12,293 | △2.3 | 357.613 | △2.3 | 99.5 | — |
| 2025年1月末 | 12,203 | △3.0 | 354.971 | △3.0 | 99.4 | — |
| 2月末 | 12,121 | △3.6 | 352.609 | △3.6 | 98.8 | — |
| (期末) 2025年3月31日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 12,001 | △4.6 | 349.164 | △4.6 | 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

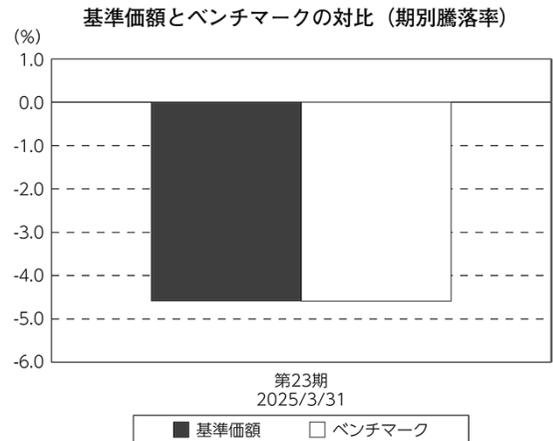
当運用期間では、国内債券利回りが上昇（価格は下落）したことから基準価額は下落しました。

○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ない、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）を行ないました。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-4.6%となり、ベンチマークの-4.6%と同程度となりました。



(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

(2024年4月2日～2025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

(2024年4月2日～2025年3月31日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|---|----------------|-------------|-------------|
| | | 千円 | 千円 |
| 国 | 国債証券 | 397,104,915 | 312,809,842 |
| | 地方債証券 | 8,716,486 | 7,163,122 |
| 内 | 特殊債券 | 11,740,089 | 13,476,578 |
| | 社債券(投資法人債券を含む) | 10,798,335 | (992,661) |
| | | | 7,966,820 |

*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

(2024年4月2日～2025年3月31日)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|-----|-----------|--------------------|-----|-----------|--------------------|-----|
| | | 百万円 | % | | 百万円 | % |
| 公社債 | 428,359 | 18,321 | 4.3 | 341,416 | 19,038 | 5.6 |

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

(2025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 | 1,053,220,000 | 975,270,557 | 83.8 | — | 51.5 | 24.2 | 8.1 |
| | (2,860,000) | (2,869,969) | (0.2) | (—) | (0.2) | (0.1) | (0.0) |
| 地方債証券 | 62,551,670 | 59,320,310 | 5.1 | — | 3.0 | 1.6 | 0.5 |
| | (62,551,670) | (59,320,310) | (5.1) | (—) | (3.0) | (1.6) | (0.5) |
| 特殊債券 (除く金融債) | 70,410,530 | 65,981,312 | 5.7 | — | 3.4 | 1.5 | 0.7 |
| | (70,410,530) | (65,981,312) | (5.7) | (—) | (3.4) | (1.5) | (0.7) |
| 金融債券 | 5,000,000 | 4,874,189 | 0.4 | — | 0.0 | 0.3 | 0.1 |
| | (5,000,000) | (4,874,189) | (0.4) | (—) | (0.0) | (0.3) | (0.1) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 56,030,000 | 52,246,483 | 4.5 | — | 2.1 | 1.7 | 0.6 |
| | (56,030,000) | (52,246,483) | (4.5) | (—) | (2.1) | (1.7) | (0.6) |
| 合 計 | 1,247,212,200 | 1,157,692,853 | 99.5 | — | 60.0 | 29.3 | 10.1 |
| | (196,852,200) | (185,292,265) | (15.9) | (—) | (8.8) | (5.1) | (2.0) |

* ()内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------|--------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | | | | | |
| 国庫債券 | 利付(2年)第460回 | 0.3 | 18,000,000 | 17,928,360 | 2026/5/1 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第461回 | 0.4 | 6,000,000 | 5,979,480 | 2026/6/1 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第462回 | 0.4 | 7,500,000 | 7,470,225 | 2026/7/1 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第463回 | 0.4 | 3,000,000 | 2,985,930 | 2026/8/1 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第468回 | 0.6 | 2,000,000 | 1,992,720 | 2027/1/1 |
| 国庫債券 | 利付(2年)第469回 | 0.7 | 4,000,000 | 3,991,280 | 2027/2/1 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第148回 | 0.005 | 11,500,000 | 11,402,595 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第149回 | 0.005 | 4,100,000 | 4,055,228 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第153回 | 0.005 | 9,000,000 | 8,836,200 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第154回 | 0.1 | 10,000,000 | 9,816,000 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第155回 | 0.3 | 6,000,000 | 5,909,880 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第156回 | 0.2 | 3,000,000 | 2,946,960 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第157回 | 0.2 | 19,000,000 | 18,620,950 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第158回 | 0.1 | 6,500,000 | 6,351,540 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第160回 | 0.2 | 2,500,000 | 2,443,325 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第161回 | 0.3 | 6,000,000 | 5,882,760 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第162回 | 0.3 | 14,500,000 | 14,178,390 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第163回 | 0.4 | 17,000,000 | 16,680,060 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第164回 | 0.2 | 5,000,000 | 4,857,350 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第165回 | 0.3 | 10,000,000 | 9,750,600 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第166回 | 0.4 | 4,000,000 | 3,914,600 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第167回 | 0.4 | 9,000,000 | 8,785,530 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第168回 | 0.6 | 12,500,000 | 12,299,750 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第169回 | 0.5 | 3,000,000 | 2,939,940 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第170回 | 0.6 | 2,500,000 | 2,454,050 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第172回 | 0.5 | 3,000,000 | 2,932,740 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第173回 | 0.6 | 9,000,000 | 8,815,680 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第174回 | 0.7 | 9,000,000 | 8,854,110 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第175回 | 0.9 | 6,500,000 | 6,441,630 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第177回 | 1.1 | 4,000,000 | 4,000,880 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 | C T利付(5年)第1回 | 0.3 | 1,500,000 | 1,461,540 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | C T利付(5年)第2回 | 0.5 | 6,000,000 | 5,857,200 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第1回 | 2.4 | 1,860,000 | 1,886,523 | 2048/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第2回 | 2.2 | 2,700,000 | 2,629,827 | 2049/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第3回 | 2.2 | 900,000 | 870,534 | 2050/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第4回 | 2.2 | 1,630,000 | 1,562,844 | 2051/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第5回 | 2.0 | 1,300,000 | 1,187,641 | 2052/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第6回 | 1.9 | 2,000,000 | 1,777,620 | 2053/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第7回 | 1.7 | 2,500,000 | 2,100,450 | 2054/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第8回 | 1.4 | 1,500,000 | 1,157,805 | 2055/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第9回 | 0.4 | 2,500,000 | 1,372,775 | 2056/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第10回 | 0.9 | 2,810,000 | 1,817,395 | 2057/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第11回 | 0.8 | 1,750,000 | 1,076,197 | 2058/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第12回 | 0.5 | 1,000,000 | 536,950 | 2059/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第13回 | 0.5 | 1,900,000 | 1,000,597 | 2060/3/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第14回 | 0.7 | 2,960,000 | 1,662,809 | 2061/3/20 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|----------------------|-------|------------|------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 国債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 国庫債券 利付 (40年) 第15回 | 1.0 | 4,000,000 | 2,484,480 | 2062/3/20 |
| 国庫債券 利付 (40年) 第16回 | 1.3 | 7,500,000 | 5,114,325 | 2063/3/20 |
| 国庫債券 利付 (40年) 第17回 | 2.2 | 6,500,000 | 5,778,565 | 2064/3/20 |
| 国庫債券 C T利付 (10年) 第1回 | 0.7 | 3,000,000 | 2,829,090 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 C T利付 (10年) 第2回 | 1.0 | 7,000,000 | 6,750,030 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第343回 | 0.1 | 13,000,000 | 12,904,840 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第344回 | 0.1 | 6,400,000 | 6,338,048 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第345回 | 0.1 | 5,500,000 | 5,434,605 | 2026/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第346回 | 0.1 | 4,000,000 | 3,944,240 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第347回 | 0.1 | 9,000,000 | 8,854,830 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第348回 | 0.1 | 10,000,000 | 9,816,000 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第349回 | 0.1 | 5,500,000 | 5,388,130 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第350回 | 0.1 | 11,650,000 | 11,385,545 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第351回 | 0.1 | 1,000,000 | 974,200 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第352回 | 0.1 | 1,000,000 | 970,940 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第353回 | 0.1 | 7,000,000 | 6,773,970 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第354回 | 0.1 | 8,000,000 | 7,717,840 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第355回 | 0.1 | 4,000,000 | 3,844,120 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第356回 | 0.1 | 14,000,000 | 13,406,120 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第357回 | 0.1 | 4,000,000 | 3,818,760 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第358回 | 0.1 | 6,000,000 | 5,710,680 | 2030/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第359回 | 0.1 | 3,500,000 | 3,321,500 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第360回 | 0.1 | 12,600,000 | 11,918,970 | 2030/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第361回 | 0.1 | 4,500,000 | 4,242,960 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第362回 | 0.1 | 3,000,000 | 2,820,150 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第363回 | 0.1 | 1,800,000 | 1,686,870 | 2031/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第364回 | 0.1 | 2,700,000 | 2,521,638 | 2031/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第365回 | 0.1 | 6,500,000 | 6,047,795 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第366回 | 0.2 | 3,200,000 | 2,987,520 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第367回 | 0.2 | 8,500,000 | 7,906,360 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第368回 | 0.2 | 8,000,000 | 7,408,240 | 2032/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第369回 | 0.5 | 11,000,000 | 10,386,200 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第370回 | 0.5 | 24,000,000 | 22,581,120 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第371回 | 0.4 | 25,000,000 | 23,234,250 | 2033/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第372回 | 0.8 | 13,000,000 | 12,446,980 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第373回 | 0.6 | 10,000,000 | 9,378,200 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第374回 | 0.8 | 10,000,000 | 9,506,800 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第375回 | 1.1 | 6,500,000 | 6,322,680 | 2034/6/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第376回 | 0.9 | 5,600,000 | 5,332,376 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (10年) 第377回 | 1.2 | 8,000,000 | 7,806,320 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第1回 | 2.8 | 2,000,000 | 2,150,840 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第2回 | 2.4 | 500,000 | 530,900 | 2030/2/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第3回 | 2.3 | 160,000 | 169,494 | 2030/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第4回 | 2.9 | 1,400,000 | 1,535,002 | 2030/11/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第5回 | 2.2 | 150,000 | 159,298 | 2031/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第6回 | 2.4 | 900,000 | 970,281 | 2031/11/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第7回 | 2.3 | 600,000 | 644,640 | 2032/5/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第8回 | 1.8 | 100,000 | 103,982 | 2032/11/22 |

| 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9回 | 1.4 | 265,000 | 267,703 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第10回 | 1.1 | 250,000 | 246,567 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第11回 | 1.7 | 660,000 | 680,103 | 2033/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第12回 | 2.1 | 720,000 | 764,244 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第13回 | 2.0 | 1,090,000 | 1,147,508 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第14回 | 2.4 | 800,000 | 868,224 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第15回 | 2.5 | 1,000,000 | 1,093,380 | 2034/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第16回 | 2.5 | 1,415,000 | 1,547,090 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第17回 | 2.4 | 1,500,000 | 1,626,255 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第18回 | 2.3 | 2,200,000 | 2,363,878 | 2035/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第19回 | 2.3 | 1,550,000 | 1,665,025 | 2035/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第20回 | 2.5 | 770,000 | 841,201 | 2035/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第21回 | 2.3 | 300,000 | 321,570 | 2035/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第22回 | 2.5 | 600,000 | 654,654 | 2036/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第23回 | 2.5 | 840,000 | 915,826 | 2036/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第24回 | 2.5 | 700,000 | 762,538 | 2036/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第25回 | 2.3 | 500,000 | 533,750 | 2036/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第26回 | 2.4 | 850,000 | 915,535 | 2037/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第27回 | 2.5 | 1,150,000 | 1,249,153 | 2037/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第28回 | 2.5 | 1,000,000 | 1,084,420 | 2038/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第29回 | 2.4 | 2,000,000 | 2,140,540 | 2038/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第30回 | 2.3 | 2,500,000 | 2,635,100 | 2039/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第31回 | 2.2 | 1,700,000 | 1,765,892 | 2039/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第32回 | 2.3 | 4,000,000 | 4,191,320 | 2040/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第33回 | 2.0 | 2,400,000 | 2,409,960 | 2040/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第34回 | 2.2 | 4,500,000 | 4,622,895 | 2041/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第35回 | 2.0 | 2,300,000 | 2,288,638 | 2041/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第36回 | 2.0 | 3,500,000 | 3,464,860 | 2042/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第37回 | 1.9 | 2,300,000 | 2,236,911 | 2042/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第38回 | 1.8 | 1,600,000 | 1,525,440 | 2043/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第39回 | 1.9 | 1,400,000 | 1,352,400 | 2043/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第40回 | 1.8 | 1,300,000 | 1,232,504 | 2043/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第41回 | 1.7 | 2,000,000 | 1,861,220 | 2043/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第42回 | 1.7 | 3,000,000 | 2,784,330 | 2044/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第43回 | 1.7 | 1,000,000 | 926,200 | 2044/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第44回 | 1.7 | 2,000,000 | 1,848,560 | 2044/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第45回 | 1.5 | 3,500,000 | 3,113,775 | 2044/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第46回 | 1.5 | 2,800,000 | 2,483,292 | 2045/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第47回 | 1.6 | 1,700,000 | 1,530,476 | 2045/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第48回 | 1.4 | 1,000,000 | 865,100 | 2045/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第49回 | 1.4 | 1,500,000 | 1,293,300 | 2045/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第50回 | 0.8 | 2,400,000 | 1,822,440 | 2046/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第53回 | 0.6 | 2,400,000 | 1,713,456 | 2046/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第54回 | 0.8 | 1,700,000 | 1,265,956 | 2047/3/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第55回 | 0.8 | 1,500,000 | 1,111,920 | 2047/6/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第56回 | 0.8 | 1,700,000 | 1,254,396 | 2047/9/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第57回 | 0.8 | 2,000,000 | 1,469,020 | 2047/12/20 |
| 国庫債券 利付 (30年) 第58回 | 0.8 | 3,000,000 | 2,193,480 | 2048/3/20 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------|----------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 国債証券 | | | | | |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第59回 | 0.7 | 3,000,000 | 2,130,000 | 2048/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第60回 | 0.9 | 1,650,000 | 1,225,950 | 2048/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第61回 | 0.7 | 2,000,000 | 1,407,360 | 2048/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第62回 | 0.5 | 2,900,000 | 1,925,397 | 2049/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第63回 | 0.4 | 3,300,000 | 2,118,732 | 2049/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第64回 | 0.4 | 3,900,000 | 2,490,150 | 2049/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第65回 | 0.4 | 3,800,000 | 2,411,290 | 2049/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第66回 | 0.4 | 3,600,000 | 2,270,340 | 2050/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第67回 | 0.6 | 3,500,000 | 2,325,715 | 2050/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第68回 | 0.6 | 3,450,000 | 2,279,173 | 2050/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第69回 | 0.7 | 2,700,000 | 1,824,903 | 2050/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第70回 | 0.7 | 2,610,000 | 1,751,675 | 2051/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第71回 | 0.7 | 2,700,000 | 1,800,522 | 2051/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第72回 | 0.7 | 2,500,000 | 1,660,200 | 2051/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第73回 | 0.7 | 3,500,000 | 2,312,905 | 2051/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第74回 | 1.0 | 4,000,000 | 2,867,240 | 2052/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第75回 | 1.3 | 3,000,000 | 2,321,010 | 2052/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第76回 | 1.4 | 3,000,000 | 2,375,490 | 2052/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第77回 | 1.6 | 3,000,000 | 2,490,600 | 2052/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第78回 | 1.4 | 2,800,000 | 2,205,896 | 2053/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第79回 | 1.2 | 1,700,000 | 1,267,231 | 2053/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第80回 | 1.8 | 3,500,000 | 3,027,045 | 2053/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第81回 | 1.6 | 5,600,000 | 4,603,480 | 2053/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第82回 | 1.8 | 3,500,000 | 3,012,450 | 2054/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第83回 | 2.2 | 8,900,000 | 8,385,402 | 2054/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第84回 | 2.1 | 4,500,000 | 4,145,310 | 2054/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第85回 | 2.3 | 3,000,000 | 2,887,830 | 2054/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第88回 | 2.3 | 1,100,000 | 1,121,274 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第89回 | 2.2 | 470,000 | 478,521 | 2026/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第90回 | 2.2 | 1,500,000 | 1,531,755 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第91回 | 2.3 | 250,000 | 255,675 | 2026/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第92回 | 2.1 | 650,000 | 664,449 | 2026/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第93回 | 2.0 | 2,300,000 | 2,352,992 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第94回 | 2.1 | 3,700,000 | 3,792,389 | 2027/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第95回 | 2.3 | 1,500,000 | 1,548,210 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第96回 | 2.1 | 1,500,000 | 1,541,670 | 2027/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第97回 | 2.2 | 1,500,000 | 1,549,200 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第98回 | 2.1 | 1,300,000 | 1,339,481 | 2027/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第99回 | 2.1 | 1,100,000 | 1,136,707 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第100回 | 2.2 | 820,000 | 851,660 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第101回 | 2.4 | 750,000 | 783,300 | 2028/3/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第102回 | 2.4 | 1,500,000 | 1,570,380 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第103回 | 2.3 | 600,000 | 626,274 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第104回 | 2.1 | 400,000 | 414,952 | 2028/6/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第105回 | 2.1 | 1,900,000 | 1,974,404 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第106回 | 2.2 | 400,000 | 417,012 | 2028/9/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第107回 | 2.1 | 800,000 | 832,608 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (20年) 第108回 | 1.9 | 1,000,000 | 1,033,390 | 2028/12/20 |

| 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109回 | 1.9 | 900,000 | 930,906 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第110回 | 2.1 | 2,600,000 | 2,709,642 | 2029/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第111回 | 2.2 | 500,000 | 523,760 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第112回 | 2.1 | 500,000 | 521,735 | 2029/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第113回 | 2.1 | 500,000 | 522,420 | 2029/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第115回 | 2.2 | 1,000,000 | 1,051,010 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第116回 | 2.2 | 1,100,000 | 1,158,344 | 2030/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第117回 | 2.1 | 1,400,000 | 1,467,662 | 2030/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第118回 | 2.0 | 1,100,000 | 1,149,709 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第119回 | 1.8 | 800,000 | 828,048 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第120回 | 1.6 | 800,000 | 819,944 | 2030/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第121回 | 1.9 | 1,900,000 | 1,978,432 | 2030/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第122回 | 1.8 | 900,000 | 932,265 | 2030/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第123回 | 2.1 | 2,000,000 | 2,107,060 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第124回 | 2.0 | 1,400,000 | 1,467,018 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第125回 | 2.2 | 1,800,000 | 1,909,800 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第126回 | 2.0 | 2,000,000 | 2,099,020 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第127回 | 1.9 | 1,200,000 | 1,252,344 | 2031/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第128回 | 1.9 | 2,800,000 | 2,926,112 | 2031/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第129回 | 1.8 | 1,300,000 | 1,350,609 | 2031/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第130回 | 1.8 | 2,200,000 | 2,287,494 | 2031/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第131回 | 1.7 | 800,000 | 826,744 | 2031/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第132回 | 1.7 | 1,300,000 | 1,343,342 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第133回 | 1.8 | 1,900,000 | 1,975,810 | 2031/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第134回 | 1.8 | 1,900,000 | 1,976,456 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第135回 | 1.7 | 700,000 | 723,429 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第136回 | 1.6 | 700,000 | 718,690 | 2032/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第137回 | 1.7 | 1,000,000 | 1,033,560 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第138回 | 1.5 | 800,000 | 815,672 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第139回 | 1.6 | 1,000,000 | 1,026,570 | 2032/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第140回 | 1.7 | 3,000,000 | 3,098,580 | 2032/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第141回 | 1.7 | 2,600,000 | 2,684,266 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第142回 | 1.8 | 950,000 | 987,829 | 2032/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第143回 | 1.6 | 2,300,000 | 2,355,752 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第144回 | 1.5 | 1,300,000 | 1,321,632 | 2033/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第145回 | 1.7 | 3,300,000 | 3,400,518 | 2033/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第146回 | 1.7 | 4,500,000 | 4,632,030 | 2033/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第147回 | 1.6 | 5,500,000 | 5,609,450 | 2033/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第148回 | 1.5 | 4,800,000 | 4,845,936 | 2034/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第149回 | 1.5 | 4,350,000 | 4,381,929 | 2034/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第150回 | 1.4 | 4,530,000 | 4,513,012 | 2034/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第151回 | 1.2 | 5,000,000 | 4,878,950 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第152回 | 1.2 | 4,150,000 | 4,038,531 | 2035/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第153回 | 1.3 | 7,800,000 | 7,641,426 | 2035/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第154回 | 1.2 | 4,820,000 | 4,661,711 | 2035/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第155回 | 1.0 | 3,950,000 | 3,729,708 | 2035/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第156回 | 0.4 | 4,900,000 | 4,313,127 | 2036/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第157回 | 0.2 | 1,500,000 | 1,282,560 | 2036/6/20 |

| 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158回 | 0.5 | 4,570,000 | 4,026,170 | 2036/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第159回 | 0.6 | 3,510,000 | 3,112,878 | 2036/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第160回 | 0.7 | 8,000,000 | 7,147,600 | 2037/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第161回 | 0.6 | 2,700,000 | 2,371,896 | 2037/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第162回 | 0.6 | 4,000,000 | 3,495,080 | 2037/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第163回 | 0.6 | 5,500,000 | 4,782,195 | 2037/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第164回 | 0.5 | 3,500,000 | 2,987,075 | 2038/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第165回 | 0.5 | 4,000,000 | 3,393,960 | 2038/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第166回 | 0.7 | 11,500,000 | 9,976,940 | 2038/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第167回 | 0.5 | 13,000,000 | 10,900,500 | 2038/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第168回 | 0.4 | 2,000,000 | 1,642,560 | 2039/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第169回 | 0.3 | 1,100,000 | 884,158 | 2039/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第170回 | 0.3 | 2,000,000 | 1,597,780 | 2039/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第171回 | 0.3 | 1,400,000 | 1,111,628 | 2039/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第173回 | 0.4 | 2,500,000 | 1,992,600 | 2040/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第174回 | 0.4 | 5,970,000 | 4,726,866 | 2040/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第175回 | 0.5 | 9,000,000 | 7,204,410 | 2040/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第176回 | 0.5 | 8,020,000 | 6,378,787 | 2041/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第177回 | 0.4 | 7,970,000 | 6,188,465 | 2041/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第178回 | 0.5 | 6,950,000 | 5,458,808 | 2041/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第179回 | 0.5 | 9,500,000 | 7,417,030 | 2041/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第180回 | 0.8 | 6,500,000 | 5,326,295 | 2042/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第181回 | 0.9 | 5,000,000 | 4,151,950 | 2042/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第182回 | 1.1 | 4,000,000 | 3,423,080 | 2042/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第183回 | 1.4 | 6,400,000 | 5,739,840 | 2042/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第184回 | 1.1 | 2,500,000 | 2,122,625 | 2043/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第185回 | 1.1 | 2,000,000 | 1,690,760 | 2043/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第186回 | 1.5 | 8,000,000 | 7,217,040 | 2043/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第187回 | 1.3 | 3,000,000 | 2,607,390 | 2043/12/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第188回 | 1.6 | 6,000,000 | 5,474,220 | 2044/3/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第189回 | 1.9 | 9,400,000 | 8,994,766 | 2044/6/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第190回 | 1.8 | 2,500,000 | 2,347,675 | 2044/9/20 |
| 国庫債券 利付 (20年) 第191回 | 2.0 | 1,500,000 | 1,453,740 | 2044/12/20 |
| 大韓民国円貨債券 (2023) 第2回 | 0.75 | 100,000 | 98,746 | 2028/9/14 |
| 大韓民国円貨債券 (2023) 第3回 | 1.032 | 100,000 | 98,574 | 2030/9/13 |
| メキシコ合衆国 第6回円貨社債 (2024) | 1.43 | 100,000 | 99,005 | 2027/8/27 |
| メキシコ合衆国 第7回円貨社債 (2024) | 1.72 | 200,000 | 196,026 | 2029/8/28 |
| ポーランド共和国 第16回円貨債券 (2023) | 0.93 | 100,000 | 99,221 | 2026/11/20 |
| ポーランド共和国 第17回円貨債券 (2023) | 1.75 | 100,000 | 97,137 | 2033/11/22 |
| ポーランド共和国 第19回円貨債券 (2024) | 1.29 | 100,000 | 99,401 | 2027/11/26 |
| ポーランド共和国 第21回円貨債券 (2024) | 1.96 | 100,000 | 97,719 | 2034/11/28 |
| ハンガリー円貨債券 (2020) 第1回 | 1.03 | 100,000 | 97,617 | 2027/9/17 |
| 小 計 | | 1,053,220,000 | 975,270,557 | |
| 地方債証券 | | | | |
| 東京都 公募第760回 | 0.045 | 100,000 | 98,733 | 2026/9/18 |
| 東京都 公募第761回 | 0.075 | 100,000 | 98,777 | 2026/9/18 |
| 東京都 公募第769回 | 0.21 | 500,000 | 491,585 | 2027/6/18 |
| 東京都 公募第778回 | 0.165 | 100,000 | 97,528 | 2028/3/17 |

| 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 | |
| 東京都 公募第784回 | 0.254 | 200,000 | 194,366 | 2028/9/20 |
| 東京都 公募第794回 | 0.05 | 100,000 | 95,360 | 2029/6/20 |
| 東京都 公募第800回 | 0.08 | 100,000 | 94,781 | 2029/12/20 |
| 東京都 公募第813回 | 0.179 | 200,000 | 188,002 | 2030/12/20 |
| 東京都 公募第822回 | 0.095 | 130,000 | 120,156 | 2031/9/19 |
| 東京都 公募第830回 | 0.275 | 400,000 | 370,152 | 2032/6/18 |
| 東京都 公募第843回 | 0.8 | 500,000 | 474,860 | 2033/6/20 |
| 東京都 公募第850回 | 0.942 | 100,000 | 95,105 | 2034/3/17 |
| 東京都 公募(30年)第7回 | 2.51 | 100,000 | 106,591 | 2038/9/17 |
| 東京都 公募第10回 | 2.31 | 200,000 | 207,050 | 2039/9/20 |
| 東京都 公募(30年)第13回 | 1.93 | 100,000 | 96,320 | 2042/3/19 |
| 東京都 公募(30年)第4回 | 0.688 | 250,000 | 163,480 | 2050/9/20 |
| 東京都 公募(30年)第5回 | 0.74 | 300,000 | 194,529 | 2051/9/20 |
| 東京都 公募(30年)第20回 | 0.722 | 100,000 | 64,493 | 2051/9/20 |
| 東京都 公募(20年)第11回 | 2.22 | 100,000 | 102,461 | 2027/3/19 |
| 東京都 公募(20年)第13回 | 2.15 | 100,000 | 103,084 | 2027/12/20 |
| 東京都 公募(20年)第15回 | 2.32 | 100,000 | 104,214 | 2028/9/20 |
| 東京都 公募(20年)第16回 | 2.01 | 200,000 | 206,422 | 2028/12/20 |
| 東京都 公募(20年)第17回 | 2.09 | 200,000 | 206,994 | 2028/12/20 |
| 東京都 公募(20年)第20回 | 2.09 | 280,000 | 290,670 | 2029/9/20 |
| 東京都 公募第23回 | 2.12 | 100,000 | 104,683 | 2030/12/20 |
| 東京都 公募(20年)第26回 | 1.74 | 100,000 | 102,578 | 2032/6/18 |
| 東京都 公募(20年)第28回 | 1.59 | 100,000 | 101,165 | 2033/3/18 |
| 東京都 公募(20年)第29回 | 1.57 | 200,000 | 201,494 | 2033/9/20 |
| 東京都 公募(20年)第30回 | 1.508 | 100,000 | 99,578 | 2034/6/20 |
| 東京都 公募(20年)第32回 | 1.293 | 100,000 | 96,592 | 2035/6/20 |
| 北海道 公募(20年)平成28年度第3回 | 0.363 | 100,000 | 85,717 | 2036/6/30 |
| 北海道 公募平成29年度第5回 | 0.18 | 200,000 | 196,434 | 2027/6/30 |
| 北海道 公募平成29年度第7回 | 0.21 | 100,000 | 98,130 | 2027/8/31 |
| 北海道 公募平成29年度第9回 | 0.205 | 100,000 | 97,992 | 2027/10/27 |
| 北海道 公募平成29年度第11回 | 0.635 | 100,000 | 85,890 | 2037/12/25 |
| 北海道 公募平成30年度第15回 | 0.291 | 207,840 | 189,949 | 2038/9/24 |
| 北海道 公募平成30年度第18回 | 0.146 | 200,000 | 192,396 | 2029/2/28 |
| 北海道 公募令和2年度第4回 | 0.165 | 300,000 | 283,650 | 2030/6/26 |
| 北海道 公募令和4年度第5回 | 0.3 | 100,000 | 92,363 | 2032/8/31 |
| 北海道 公募令和5年度第2回 | 0.245 | 100,000 | 97,519 | 2028/5/31 |
| 北海道 公募令和5年度第8回 | 0.895 | 100,000 | 95,257 | 2033/10/31 |
| 北海道 公募令和5年度第10回 | 0.861 | 300,000 | 284,310 | 2033/12/27 |
| 宮城県 公募第32回2号 | 0.105 | 100,000 | 98,793 | 2026/9/28 |
| 神奈川県 公募第231回 | 0.22 | 200,000 | 195,832 | 2027/12/20 |
| 神奈川県 公募第243回 | 0.075 | 200,000 | 189,518 | 2029/12/20 |
| 神奈川県 公募第247回 | 0.12 | 339,150 | 319,974 | 2030/6/20 |
| 神奈川県 公募第254回 | 0.12 | 180,000 | 166,636 | 2031/9/19 |
| 神奈川県 公募第258回 | 0.29 | 100,000 | 92,637 | 2032/6/18 |
| 神奈川県 公募(30年)第3回 | 2.62 | 100,000 | 108,495 | 2037/3/19 |
| 神奈川県 公募第7回 | 2.22 | 300,000 | 307,413 | 2027/3/19 |
| 神奈川県 公募(20年)第13回 | 2.21 | 100,000 | 104,525 | 2029/12/20 |
| 神奈川県 公募(20年)第14回 | 1.969 | 100,000 | 103,691 | 2030/7/19 |

| 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 | |
| 神奈川県 公募 (20年) 第17回 | 1.975 | 200,000 | 208,034 | 2031/7/11 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第20回 | 1.706 | 100,000 | 102,321 | 2032/6/18 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第21回 | 1.732 | 200,000 | 204,796 | 2032/9/17 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第26回 | 1.477 | 200,000 | 198,578 | 2034/6/20 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第27回 | 1.398 | 100,000 | 98,371 | 2034/9/20 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第32回 | 0.18 | 100,000 | 83,942 | 2036/6/20 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第43回 | 0.43 | 100,000 | 78,566 | 2040/6/20 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第46回 | 0.4 | 100,000 | 76,214 | 2041/6/20 |
| 神奈川県 公募 (20年) 第48回 | 0.529 | 100,000 | 77,450 | 2041/9/20 |
| 大阪府 公募第417回 | 0.248 | 102,000 | 100,651 | 2027/2/26 |
| 大阪府 公募第423回 | 0.185 | 100,000 | 98,073 | 2027/8/30 |
| 大阪府 公募第429回 | 0.197 | 179,000 | 174,834 | 2028/2/25 |
| 大阪府 公募第451回 | 0.063 | 130,000 | 123,093 | 2029/12/26 |
| 大阪府 公募第452回 | 0.062 | 100,000 | 94,529 | 2030/1/30 |
| 大阪府 公募第458回 | 0.1 | 140,000 | 131,724 | 2030/7/30 |
| 大阪府 公募第467回 | 0.164 | 140,000 | 130,726 | 2031/4/28 |
| 大阪府 公募第469回 | 0.128 | 150,000 | 139,447 | 2031/6/27 |
| 大阪府 公募第479回 | 0.29 | 200,000 | 185,440 | 2032/5/28 |
| 大阪府 公募第481回 | 0.4 | 100,000 | 92,933 | 2032/9/29 |
| 大阪府 公募第489回 | 0.68 | 176,000 | 165,042 | 2033/8/30 |
| 大阪府 公募第492回 | 0.968 | 156,000 | 149,349 | 2033/11/29 |
| 大阪府 公募 (20年) 第1回 | 2.19 | 100,000 | 104,221 | 2029/9/14 |
| 大阪府 公募 (20年) 第2回 | 2.23 | 100,000 | 104,542 | 2029/11/16 |
| 大阪府 公募第5回 | 2.16 | 100,000 | 104,568 | 2030/5/28 |
| 大阪府 公募第8回 | 1.83 | 100,000 | 103,168 | 2031/12/22 |
| 大阪府 公募 (20年) 第12回 | 1.453 | 230,000 | 227,288 | 2034/9/26 |
| 大阪府 公募 (20年) 第19回 | 0.464 | 100,000 | 78,447 | 2040/9/28 |
| 大阪府 公募 (20年) 第20回 | 0.425 | 200,000 | 154,804 | 2040/12/25 |
| 大阪府 公募 (5年) 第184回 | 0.001 | 400,000 | 395,752 | 2026/6/29 |
| 大阪府 公募 (5年) 第187回 | 0.001 | 144,000 | 142,038 | 2026/9/29 |
| 大阪府 公募 (5年) 第190回 | 0.001 | 200,000 | 196,788 | 2026/12/25 |
| 京都府 公募 (20年) 平成20年度第2回 | 2.26 | 200,000 | 207,998 | 2028/9/21 |
| 京都府 公募平成26年度第5回 | 1.455 | 100,000 | 98,975 | 2034/8/10 |
| 京都府 公募 (20年) 平成27年度第5回 | 1.23 | 200,000 | 191,552 | 2035/8/17 |
| 京都府 公募 (15年) 平成27年度第8回 | 0.78 | 100,000 | 97,438 | 2030/10/11 |
| 京都府 公募 (15年) 平成28年度第2回 | 0.21 | 200,000 | 187,350 | 2031/4/22 |
| 京都府 公募 (20年) 平成28年度第5回 | 0.327 | 200,000 | 170,274 | 2036/8/15 |
| 京都府 公募平成29年度第4回 | 0.19 | 100,000 | 98,268 | 2027/6/21 |
| 京都府 公募令和元年度第5回 | 0.2 | 100,000 | 77,357 | 2039/8/19 |
| 京都府 公募令和3年度第5回 | 0.405 | 100,000 | 75,926 | 2041/8/16 |
| 兵庫県 公募平成29年度第22回 | 0.19 | 100,000 | 97,748 | 2028/1/21 |
| 兵庫県 公募令和3年度第5回 | 0.09 | 100,000 | 92,660 | 2031/7/18 |
| 兵庫県 公募 (10年) 令和5年度第2回 | 0.701 | 100,000 | 94,294 | 2033/5/30 |
| 兵庫県 公募 (30年) 第2回 | 2.36 | 200,000 | 207,672 | 2040/3/19 |
| 兵庫県 公募 (15年) 第1回 | 1.66 | 300,000 | 303,084 | 2026/7/29 |
| 兵庫県 公募 (15年) 第3回 | 1.35 | 200,000 | 201,662 | 2027/7/16 |
| 兵庫県 公募 (15年) 第8回 | 1.09 | 500,000 | 498,700 | 2029/4/16 |
| 兵庫県 公募 (15年) 第11回 | 0.718 | 100,000 | 97,430 | 2030/5/10 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|-------|-------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 兵庫県 | 公募第2回 | 2.37 | 100,000 | 103,330 | 2027/9/17 |
| 兵庫県 | 公募第9回 | 2.25 | 100,000 | 104,639 | 2029/11/19 |
| 兵庫県 | 公募(20年)第11回 | 1.84 | 200,000 | 206,080 | 2030/8/16 |
| 兵庫県 | 公募(20年)第14回 | 1.72 | 100,000 | 102,459 | 2032/5/24 |
| 兵庫県 | 公募(20年)第19回 | 1.57 | 100,000 | 100,565 | 2033/12/9 |
| 兵庫県 | 公募(20年)第21回 | 1.54 | 100,000 | 99,931 | 2034/5/9 |
| 兵庫県 | 公募(20年)第22回 | 1.4 | 100,000 | 98,393 | 2034/9/8 |
| 兵庫県 | 公募(20年)第41回 | 0.454 | 100,000 | 78,186 | 2040/10/19 |
| 兵庫県 | 公募(20年)第43回 | 0.791 | 100,000 | 79,923 | 2042/6/20 |
| 静岡県 | 公募平成29年度第3回 | 0.17 | 100,000 | 98,475 | 2027/3/19 |
| 静岡県 | 公募(31年)第1回 | 0.095 | 174,000 | 166,909 | 2029/3/19 |
| 静岡県 | 公募(5年)令和3年度第5回 | 0.005 | 300,000 | 296,919 | 2026/6/19 |
| 静岡県 | 公募(15年)第2回 | 1.406 | 300,000 | 302,823 | 2027/6/25 |
| 静岡県 | 公募(15年)第5回 | 1.087 | 200,000 | 199,830 | 2028/11/20 |
| 静岡県 | 公募(15年)第9回 | 0.739 | 100,000 | 97,255 | 2030/9/20 |
| 静岡県 | 公募(30年)第15回 | 0.731 | 100,000 | 64,668 | 2051/9/20 |
| 静岡県 | 公募(20年)第11回 | 1.841 | 100,000 | 103,081 | 2030/10/18 |
| 静岡県 | 公募(20年)第14回 | 1.736 | 200,000 | 205,036 | 2032/6/18 |
| 静岡県 | 公募(20年)第18回 | 1.473 | 200,000 | 198,422 | 2034/7/10 |
| 静岡県 | 公募(20年)第23回 | 0.626 | 100,000 | 86,776 | 2037/6/19 |
| 静岡県 | 公募(20年)第29回 | 0.444 | 200,000 | 157,534 | 2040/6/20 |
| 静岡県 | 公募(20年)第30回 | 0.449 | 200,000 | 156,598 | 2040/9/20 |
| 愛知県 | 公募(20年)平成19年度第2回 | 2.41 | 100,000 | 103,133 | 2027/6/18 |
| 愛知県 | 公募(20年)平成20年度第2回 | 2.46 | 100,000 | 104,435 | 2028/6/20 |
| 愛知県 | 公募平成20年度第8回 | 2.04 | 100,000 | 103,337 | 2028/12/20 |
| 愛知県 | 公募(20年)平成22年度第8回 | 1.891 | 200,000 | 206,628 | 2030/9/13 |
| 愛知県 | 公募(15年)平成23年度第13回 | 1.529 | 100,000 | 100,959 | 2026/11/13 |
| 愛知県 | 公募(20年)平成24年度第4回 | 1.687 | 100,000 | 102,191 | 2032/6/11 |
| 愛知県 | 公募(15年)平成24年度第14回 | 1.314 | 400,000 | 403,384 | 2027/12/13 |
| 愛知県 | 公募平成24年度第17回 | 1.829 | 100,000 | 102,981 | 2033/2/8 |
| 愛知県 | 公募(30年)平成25年度第8回 | 2.024 | 120,000 | 115,852 | 2043/6/19 |
| 愛知県 | 公募(20年)平成25年度第17回 | 1.608 | 400,000 | 403,432 | 2033/12/20 |
| 愛知県 | 公募(20年)平成26年度第4回 | 1.542 | 100,000 | 99,945 | 2034/5/15 |
| 愛知県 | 公募平成26年度第8回 | 1.814 | 100,000 | 92,419 | 2044/6/20 |
| 愛知県 | 公募平成26年度第13回 | 1.363 | 200,000 | 195,790 | 2034/11/14 |
| 愛知県 | 公募(15年)平成27年度第2回 | 0.74 | 300,000 | 292,650 | 2030/4/26 |
| 愛知県 | 公募(30年)平成27年度第8回 | 1.579 | 100,000 | 87,749 | 2045/6/20 |
| 愛知県 | 公募平成29年度第8回 | 0.2 | 100,000 | 98,106 | 2027/8/31 |
| 愛知県 | 公募平成29年度第9回 | 0.15 | 100,000 | 97,945 | 2027/9/15 |
| 愛知県 | 公募平成30年度第7回 | 0.18 | 200,000 | 194,202 | 2028/7/31 |
| 愛知県 | 公募令和2年度第13回 | 0.454 | 200,000 | 156,006 | 2040/11/22 |
| 愛知県 | 公募令和3年度第10回 | 0.001 | 200,000 | 197,192 | 2026/10/15 |
| 広島県 | 公募平成29年度第3回 | 0.15 | 100,000 | 97,922 | 2027/9/27 |
| 広島県 | 公募平成29年度第4回 | 0.22 | 211,300 | 207,012 | 2027/11/24 |
| 広島県 | 公募令和2年度第2回 | 0.165 | 100,000 | 94,457 | 2030/7/22 |
| 広島県 | 公募令和2年度第7回 | 0.214 | 300,000 | 281,568 | 2031/3/19 |
| 広島県 | 公募令和5年度第4回 | 0.977 | 140,000 | 134,136 | 2033/11/24 |
| 広島県 | 公募(20年)令和2年度第1回 | 0.315 | 100,000 | 77,437 | 2040/4/17 |

| 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 | |
| 広島県 | 公募 (20年) 令和2年度第2回 | 0.464 | 100,000 | 78,466 | 2040/9/21 |
| 広島県 | 公募 (20年) 令和3年度第2回 | 0.434 | 100,000 | 76,160 | 2041/9/20 |
| 埼玉県 | 公募平成28年度第5回 | 0.05 | 100,000 | 98,909 | 2026/7/28 |
| 埼玉県 | 公募平成30年度第4回 | 0.205 | 200,000 | 194,612 | 2028/6/26 |
| 埼玉県 | 公募令和元年度第4回 | 0.055 | 100,000 | 95,381 | 2029/6/20 |
| 埼玉県 | 公募令和2年度第4回 | 0.145 | 300,000 | 283,428 | 2030/6/17 |
| 埼玉県 | 公募令和3年度第3回 | 0.145 | 100,000 | 93,172 | 2031/5/26 |
| 埼玉県 | 公募令和5年度第4回 | 0.767 | 100,000 | 94,345 | 2033/9/27 |
| 埼玉県 | 公募 (15年) 第1回 | 0.941 | 200,000 | 197,552 | 2029/10/19 |
| 埼玉県 | 公募 (15年) 第2回 | 0.869 | 200,000 | 196,294 | 2030/5/22 |
| 埼玉県 | 公募 (15年) 第3回 | 0.43 | 100,000 | 94,038 | 2032/1/30 |
| 埼玉県 | 公募 (25年) 第2回 | 0.781 | 200,000 | 158,614 | 2042/9/19 |
| 埼玉県 | 公募 (30年) 第9回 | 0.845 | 200,000 | 143,368 | 2048/3/19 |
| 埼玉県 | 公募 (30年) 第11回 | 0.451 | 100,000 | 63,333 | 2049/3/19 |
| 埼玉県 | 公募 (15年) 第7回 | 0.34 | 200,000 | 174,674 | 2035/8/17 |
| 埼玉県 | 公募 (15年) 第8回 | 0.367 | 200,000 | 172,404 | 2036/4/18 |
| 埼玉県 | 公募 (20年) 第6回 | 2.26 | 100,000 | 103,999 | 2028/9/21 |
| 埼玉県 | 公募 (20年) 第13回 | 1.599 | 100,000 | 101,186 | 2033/5/20 |
| 埼玉県 | 公募 (20年) 第16回 | 1.216 | 200,000 | 191,312 | 2035/8/14 |
| 埼玉県 | 公募 (20年) 第19回 | 0.536 | 200,000 | 173,406 | 2036/12/12 |
| 埼玉県 | 公募 (20年) 第20回 | 0.626 | 100,000 | 86,944 | 2037/5/15 |
| 埼玉県 | 公募 (20年) 第26回 | 0.377 | 100,000 | 78,064 | 2040/5/21 |
| 埼玉県 | 公募 (20年) 第27回 | 0.44 | 200,000 | 155,406 | 2040/12/11 |
| 福岡県 | 公募平成29年度第1回 | 0.2 | 100,000 | 98,286 | 2027/6/23 |
| 福岡県 | 公募平成23年度第1回 | 1.491 | 100,000 | 100,916 | 2026/11/27 |
| 福岡県 | 公募 (15年) 平成27年度第1回 | 0.784 | 200,000 | 194,756 | 2030/11/25 |
| 福岡県 | 公募 (15年) 令和元年度第1回 | 0.254 | 300,000 | 266,607 | 2034/6/14 |
| 福岡県 | 公募 (15年) 令和元年度第2回 | 0.269 | 200,000 | 175,982 | 2034/12/13 |
| 福岡県 | 公募 (30年) 平成19年度第1回 | 2.62 | 100,000 | 108,391 | 2037/9/18 |
| 福岡県 | 公募 (30年) 平成26年度第1回 | 1.827 | 100,000 | 92,651 | 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 | 73,610 | 2047/12/20 |
| 福岡県 | 公募 (30年・定時償還) 令和元年度第3回 | 0.432 | 100,000 | 62,584 | 2049/6/18 |
| 福岡県 | 公募 (20年) 平成20年度第1回 | 2.26 | 300,000 | 311,787 | 2028/8/18 |
| 福岡県 | 公募 (20年) 平成20年度第2回 | 2.05 | 100,000 | 103,372 | 2028/12/20 |
| 福岡県 | 公募 (20年) 平成22年度第1回 | 1.77 | 300,000 | 308,073 | 2030/8/19 |
| 福岡県 | 公募 (20年) 平成22年度第2回 | 2.116 | 300,000 | 314,268 | 2031/2/21 |
| 福岡県 | 公募 (20年) 平成24年度第2回 | 1.635 | 100,000 | 101,758 | 2032/8/16 |
| 福岡県 | 公募 (20年) 平成26年度第1回 | 1.542 | 100,000 | 99,901 | 2034/5/26 |
| 福岡県 | 公募 (20年) 平成29年度第1回 | 0.626 | 100,000 | 86,911 | 2037/5/29 |
| 福岡県 | 公募 (20年・定時償還) 令和3年度第1回 | 0.449 | 200,000 | 152,670 | 2041/9/20 |
| 千葉県 | 公募平成28年度第4回 | 0.085 | 200,000 | 197,554 | 2026/9/25 |
| 千葉県 | 公募平成29年度第4回 | 0.15 | 100,000 | 97,927 | 2027/9/24 |
| 千葉県 | 公募平成29年度第8回 | 0.2 | 100,000 | 97,613 | 2028/3/24 |
| 千葉県 | 公募令和元年度第6回 | 0.135 | 300,000 | 284,694 | 2030/1/25 |
| 千葉県 | 公募令和3年度第2回 | 0.01 | 200,000 | 198,124 | 2026/5/25 |
| 千葉県 | 公募令和4年度第4回 | 0.374 | 100,000 | 92,770 | 2032/9/24 |
| 千葉県 | 公募令和5年度第9回 | 0.778 | 200,000 | 188,204 | 2033/12/23 |
| 千葉県 | 公募令和6年度第4回 | 1.17 | 172,010 | 166,082 | 2034/7/25 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|-------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 千葉県 公募 (20年) 第8回 | 2.18 | 100,000 | 104,588 | 2030/4/19 |
| 千葉県 公募 (20年) 第13回 | 1.701 | 200,000 | 204,348 | 2032/10/15 |
| 千葉県 公募 (20年) 第16回 | 1.555 | 300,000 | 300,414 | 2034/4/14 |
| 千葉県 公募 (20年) 第17回 | 1.403 | 100,000 | 98,322 | 2034/10/13 |
| 千葉県 公募 (20年) 第20回 | 0.42 | 100,000 | 86,734 | 2036/4/15 |
| 千葉県 公募 (20年) 第25回 | 0.701 | 100,000 | 85,151 | 2038/10/15 |
| 千葉県 公募 (20年) 第28回 | 0.315 | 300,000 | 232,350 | 2040/4/13 |
| 新潟県 公募平成30年度第2回 | 0.264 | 200,000 | 193,896 | 2028/11/30 |
| 新潟県 公募令和2年度第1回 | 0.435 | 100,000 | 78,298 | 2040/8/17 |
| 新潟県 公募令和2年度第2回 | 0.135 | 120,000 | 112,591 | 2030/11/29 |
| 長野県 公募令和3年度第1回 | 0.19 | 300,000 | 280,734 | 2031/4/16 |
| 長野県 公募令和3年度第5回 | 0.001 | 100,000 | 98,394 | 2026/12/25 |
| 茨城県 公募令和3年度第3回 | 0.005 | 200,000 | 197,510 | 2026/8/25 |
| 茨城県 公募令和5年度第1回 | 0.681 | 100,000 | 94,017 | 2033/6/30 |
| 茨城県 公募令和5年度第2回 | 0.354 | 200,000 | 195,202 | 2028/8/24 |
| 群馬県 公募第22回 | 0.135 | 100,000 | 94,185 | 2030/8/19 |
| 群馬県 公募 (5年) 第13回 | 0.005 | 300,000 | 296,337 | 2026/8/18 |
| 群馬県 公募 (20年) 第3回 | 1.687 | 100,000 | 102,202 | 2032/6/25 |
| 群馬県 公募 (20年) 第11回 | 0.416 | 100,000 | 78,433 | 2040/6/12 |
| 大分県 公募令和5年度第1回 | 0.895 | 100,000 | 95,257 | 2033/10/31 |
| 共同発行市場地方債 公募第161回 | 0.06 | 300,000 | 296,496 | 2026/8/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第172回 | 0.225 | 600,000 | 589,572 | 2027/7/23 |
| 共同発行市場地方債 公募第184回 | 0.175 | 100,000 | 97,115 | 2028/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第186回 | 0.25 | 400,000 | 388,636 | 2028/9/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第188回 | 0.264 | 300,000 | 290,934 | 2028/11/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第190回 | 0.16 | 610,000 | 587,820 | 2029/1/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第191回 | 0.14 | 100,000 | 96,190 | 2029/2/22 |
| 共同発行市場地方債 公募第194回 | 0.11 | 300,000 | 287,145 | 2029/5/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第196回 | 0.06 | 400,000 | 380,968 | 2029/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第197回 | 0.06 | 400,000 | 380,460 | 2029/8/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第198回 | 0.05 | 110,000 | 104,434 | 2029/9/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第199回 | 0.05 | 150,000 | 142,258 | 2029/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第200回 | 0.07 | 100,000 | 94,831 | 2029/11/22 |
| 共同発行市場地方債 公募第204回 | 0.05 | 200,000 | 188,520 | 2030/3/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第205回 | 0.135 | 600,000 | 567,486 | 2030/4/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第206回 | 0.131 | 300,000 | 283,470 | 2030/5/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第213回 | 0.125 | 300,000 | 281,103 | 2030/12/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第215回 | 0.145 | 400,000 | 374,424 | 2031/2/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第227回 | 0.244 | 300,000 | 278,169 | 2032/2/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第228回 | 0.199 | 300,000 | 276,912 | 2032/3/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第229回 | 0.299 | 250,000 | 232,312 | 2032/4/23 |
| 共同発行市場地方債 公募第231回 | 0.309 | 200,000 | 185,486 | 2032/6/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第233回 | 0.315 | 119,000 | 110,085 | 2032/8/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第234回 | 0.369 | 300,000 | 278,208 | 2032/9/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第239回 | 0.74 | 100,000 | 94,863 | 2033/2/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第248回 | 0.948 | 100,000 | 95,590 | 2033/11/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第256回 | 1.165 | 500,000 | 482,570 | 2034/7/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第257回 | 0.963 | 500,000 | 473,215 | 2034/8/25 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 地方債証券 | % | 千円 | 千円 | |
| 共同発行市場地方債 公募第258回 | 1.028 | 200,000 | 190,188 | 2034/9/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第259回 | 1.029 | 215,400 | 204,601 | 2034/10/25 |
| 堺市 公募平成22年度第1回 | 1.97 | 100,000 | 103,831 | 2030/11/19 |
| 堺市 公募平成26年度第1回 | 1.664 | 100,000 | 89,945 | 2044/9/20 |
| 堺市 公募第3回 | 0.125 | 100,000 | 92,224 | 2031/12/22 |
| 堺市 公募令和5年度第2回 | 0.841 | 200,000 | 189,962 | 2033/9/20 |
| 長崎県 公募令和元年度第3回 | 0.05 | 100,000 | 95,360 | 2029/6/20 |
| 長崎県 公募令和4年度第3回 | 0.364 | 100,000 | 93,150 | 2032/6/18 |
| 島根県 公募(30年)平成29年度第1回 | 0.919 | 100,000 | 73,986 | 2047/6/20 |
| 佐賀県 公募平成28年度第1回 | 0.08 | 100,000 | 98,595 | 2026/11/30 |
| 福島県 公募令和3年度第2回 | 0.046 | 300,000 | 294,885 | 2027/2/24 |
| 熊本県 公募平成28年度第2回 | 0.06 | 132,000 | 130,220 | 2026/10/28 |
| 熊本市 公募平成29年度第1回 | 0.19 | 100,000 | 97,884 | 2027/11/30 |
| 熊本市 公募令和2年度第1回 | 0.135 | 200,000 | 187,664 | 2030/11/27 |
| 新潟市 公募平成29年度第1回 | 0.21 | 100,000 | 97,882 | 2027/12/24 |
| 新潟市 公募令和5年度第1回 | 0.861 | 200,000 | 189,552 | 2033/12/23 |
| 奈良県 公募令和3年度第2回 | 0.482 | 100,000 | 77,571 | 2041/4/30 |
| 静岡市 公募令和5年度第1回 | 0.977 | 100,000 | 95,812 | 2033/11/24 |
| 大阪市 公募令和2年度第2回 | 0.131 | 300,000 | 283,485 | 2030/5/22 |
| 大阪市 公募令和3年度第2回 | 0.16 | 300,000 | 279,888 | 2031/5/21 |
| 大阪市 公募(15年)第1回 | 1.753 | 100,000 | 101,142 | 2026/7/17 |
| 大阪市 公募(15年)第2回 | 1.531 | 200,000 | 202,162 | 2027/2/19 |
| 大阪市 公募(20年)第1回 | 2.3 | 300,000 | 310,122 | 2027/11/15 |
| 大阪市 公募(20年)第5回 | 2.47 | 100,000 | 104,720 | 2028/9/21 |
| 大阪市 公募(20年)第6回 | 2.21 | 100,000 | 103,944 | 2028/12/20 |
| 大阪市 公募(20年)第17回 | 1.721 | 200,000 | 204,510 | 2032/12/21 |
| 大阪市 公募(20年)第19回 | 1.138 | 100,000 | 95,299 | 2035/4/24 |
| 大阪市 公募(20年)第26回 | 0.635 | 100,000 | 86,214 | 2037/10/23 |
| 名古屋市 公募第501回 | 0.175 | 200,000 | 195,958 | 2027/9/29 |
| 名古屋市 公募第503回 | 0.205 | 100,000 | 97,628 | 2028/3/24 |
| 名古屋市 公募第504回 | 0.205 | 200,000 | 194,638 | 2028/6/20 |
| 名古屋市 公募第511回 | 0.075 | 200,000 | 188,788 | 2030/3/27 |
| 名古屋市 公募第512回 | 0.15 | 300,000 | 283,479 | 2030/6/20 |
| 名古屋市 公募(15年)第2回 | 0.905 | 100,000 | 98,584 | 2029/11/16 |
| 名古屋市 公募(5年)第30回 | 0.001 | 200,000 | 196,820 | 2026/12/18 |
| 名古屋市 公募(30年)第13回 | 0.977 | 100,000 | 74,638 | 2047/9/20 |
| 名古屋市 公募(20年)第15回 | 1.712 | 100,000 | 101,883 | 2033/9/9 |
| 名古屋市 公募(20年)第17回 | 1.203 | 200,000 | 191,574 | 2035/5/28 |
| 名古屋市 公募(20年)第18回 | 1.139 | 100,000 | 94,564 | 2035/11/20 |
| 名古屋市 公募(20年)第19回 | 0.323 | 100,000 | 85,692 | 2036/4/28 |
| 名古屋市 公募(20年)第21回 | 0.568 | 100,000 | 84,367 | 2038/5/18 |
| 京都市 公募平成29年度第1回 | 0.21 | 100,000 | 98,142 | 2027/8/25 |
| 京都市 公募平成29年度第4回 | 0.235 | 101,280 | 99,105 | 2028/1/31 |
| 京都市 公募平成30年度第1回 | 0.249 | 101,090 | 98,308 | 2028/8/28 |
| 京都市 公募(20年)第5回 | 2.36 | 200,000 | 204,830 | 2026/12/18 |
| 京都市 公募(20年)第6回 | 2.38 | 100,000 | 103,355 | 2027/9/17 |
| 京都市 公募(20年)第13回 | 1.359 | 100,000 | 97,816 | 2034/11/24 |
| 京都市 公募(20年)第15回 | 0.487 | 200,000 | 172,466 | 2036/11/28 |

| 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 | |
| 京都市 公募 (20年) 第19回 | 0.445 | 100,000 | 77,846 | 2040/11/26 |
| 神戸市 公募 (20年) 平成20年度第24回 | 2.08 | 100,000 | 103,479 | 2028/12/20 |
| 神戸市 公募 (20年) 平成25年度第3回 | 1.817 | 100,000 | 102,772 | 2033/7/19 |
| 神戸市 公募平成25年度第12回 | 1.52 | 100,000 | 99,989 | 2034/2/17 |
| 神戸市 公募 (20年) 平成26年度第3回 | 1.482 | 200,000 | 198,564 | 2034/7/14 |
| 神戸市 公募平成30年度第2回 | 0.845 | 200,000 | 143,368 | 2048/3/19 |
| 神戸市 公募令和元年度第6回 | 0.2 | 100,000 | 77,170 | 2039/9/20 |
| 神戸市 公募令和3年度第6回 | 0.713 | 100,000 | 64,594 | 2051/6/20 |
| 横浜市 公募平成28年度第5回 | 0.23 | 300,000 | 295,968 | 2027/2/19 |
| 横浜市 公募平成29年度第3回 | 0.22 | 100,000 | 98,200 | 2027/8/13 |
| 横浜市 公募2019年度第3回 | 0.05 | 200,000 | 189,726 | 2029/10/16 |
| 横浜市 公募 (30年) 第2回 | 2.49 | 200,000 | 215,614 | 2035/3/20 |
| 横浜市 公募 (20年) 第11回 | 2.2 | 100,000 | 102,144 | 2026/12/18 |
| 横浜市 公募 (20年) 第18回 | 2.21 | 100,000 | 104,197 | 2029/5/25 |
| 横浜市 公募 (20年) 第26回 | 1.776 | 100,000 | 102,598 | 2033/1/28 |
| 横浜市 公募 (20年) 第30回 | 1.376 | 100,000 | 98,096 | 2034/10/20 |
| 横浜市 公募 (20年) 第32回 | 1.138 | 100,000 | 94,680 | 2035/10/19 |
| 横浜市 公募 (20年) 第35回 | 0.443 | 100,000 | 85,940 | 2036/10/28 |
| 横浜市 公募 (20年) 第40回 | 0.559 | 200,000 | 168,972 | 2038/4/16 |
| 横浜市 公募 (5年) 第64回 | 0.477 | 300,000 | 291,975 | 2029/4/12 |
| 札幌市 公募 (20年) 平成23年度第3回 | 1.944 | 100,000 | 103,836 | 2031/7/29 |
| 札幌市 公募 (15年) 平成23年度第9回 | 1.493 | 200,000 | 202,016 | 2027/2/12 |
| 札幌市 公募 (20年) 平成24年度第1回 | 1.79 | 100,000 | 102,949 | 2032/4/23 |
| 札幌市 公募 (20年) 平成24年度第11回 | 1.794 | 200,000 | 205,430 | 2033/2/28 |
| 札幌市 公募 (20年) 平成28年度第4回 | 0.414 | 100,000 | 85,854 | 2036/9/19 |
| 札幌市 公募 (30年) 令和元年度第9回 | 0.474 | 100,000 | 62,597 | 2049/12/20 |
| 札幌市 公募 (20年) 令和2年度第5回 | 0.445 | 100,000 | 78,104 | 2040/10/12 |
| 札幌市 公募 (5年) 令和3年度第8回 | 0.155 | 100,000 | 92,417 | 2031/12/19 |
| 札幌市 公募 (5年) 令和4年度第4回 | 0.444 | 100,000 | 93,320 | 2032/9/17 |
| 札幌市 公募 (20年) 第6回 | 2.24 | 200,000 | 208,718 | 2029/6/20 |
| 川崎市 公募第95回 | 0.539 | 160,000 | 150,384 | 2032/9/17 |
| 川崎市 公募 (20年) 第14回 | 1.79 | 200,000 | 205,758 | 2032/7/19 |
| 川崎市 公募 (20年) 第17回 | 1.527 | 100,000 | 100,666 | 2033/5/9 |
| 川崎市 公募 (20年) 第18回 | 1.541 | 100,000 | 100,115 | 2034/3/17 |
| 川崎市 公募 (20年) 第19回 | 1.362 | 100,000 | 98,035 | 2034/9/20 |
| 川崎市 公募 (20年) 第20回 | 1.133 | 100,000 | 95,372 | 2035/3/20 |
| 川崎市 公募 (20年) 第22回 | 0.377 | 100,000 | 86,282 | 2036/4/22 |
| 川崎市 公募 (20年) 第24回 | 0.683 | 100,000 | 87,692 | 2037/4/17 |
| 川崎市 公募 (30年) 第11回 | 0.817 | 100,000 | 71,201 | 2048/3/19 |
| 川崎市 公募 (5年) 第62回 | 0.005 | 200,000 | 197,690 | 2026/7/30 |
| 川崎市 公募 (5年) 第66回 | 0.14 | 230,000 | 225,209 | 2027/9/17 |
| 川崎市 公募 (5年) 第67回 | 0.309 | 100,000 | 97,942 | 2028/3/17 |
| 北九州市 公募 (10年) 令和2年度第2回 | 0.125 | 200,000 | 187,408 | 2030/12/24 |
| 北九州市 公募 (10年) 令和5年度第2回 | 0.861 | 200,000 | 189,554 | 2033/12/22 |
| 北九州市 公募 (20年) 第3回 | 2.33 | 200,000 | 206,472 | 2027/9/21 |
| 北九州市 公募 (20年) 第14回 | 1.732 | 100,000 | 102,372 | 2032/11/12 |
| 北九州市 公募 (20年) 第17回 | 1.529 | 100,000 | 99,747 | 2034/6/20 |
| 福岡市 公募 (20年) 平成21年度第3回 | 2.14 | 200,000 | 208,036 | 2029/9/18 |

| 銘 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|--------------------|-------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 地方債証券 | | % | 千円 | 千円 | |
| 福岡市 | 公募(20年)平成23年度第4回 | 1.89 | 100,000 | 103,522 | 2031/8/19 |
| 福岡市 | 公募平成26年度第2回 | 1.49 | 100,000 | 99,393 | 2034/6/20 |
| 福岡市 | 公募(5年)2019年度第11回 | 0.407 | 100,000 | 61,375 | 2049/12/20 |
| 福岡市 | 公募(20年)2020年度第7回 | 0.454 | 200,000 | 156,372 | 2040/10/19 |
| 福岡市 | 公募(20年)2021年度第4回 | 0.4 | 200,000 | 151,930 | 2041/7/29 |
| 福岡市 | 公募(20年)2021年度第6回 | 0.482 | 100,000 | 76,644 | 2041/10/18 |
| 広島市 | 公募(10年)平成30年度第6回 | 0.146 | 241,000 | 231,870 | 2029/2/22 |
| 広島市 | 公募(10年)令和3年度第6回 | 0.244 | 100,000 | 92,723 | 2032/2/25 |
| 広島市 | 公募(10年)令和5年度第5回 | 0.861 | 100,000 | 94,776 | 2033/12/23 |
| さいたま市 | 公募第21回 | 0.861 | 320,100 | 303,377 | 2033/12/23 |
| 相模原市 | 公募令和2年度第1回 | 0.13 | 100,000 | 94,047 | 2030/9/20 |
| 相模原市 | 公募令和5年度第1回 | 0.89 | 100,000 | 95,349 | 2033/9/20 |
| 三重県 | 公募平成28年度第1回 | 0.165 | 155,000 | 152,946 | 2026/12/25 |
| 三重県 | 公募令和5年度第3回 | 0.861 | 200,000 | 189,552 | 2033/12/23 |
| 福井県 | 公募令和元年度第3回 | 0.05 | 200,000 | 189,616 | 2029/10/29 |
| 福井県 | 公募令和4年度第5回 | 0.374 | 100,000 | 92,758 | 2032/9/29 |
| 徳島県 | 公募平成29年度第2回 | 0.19 | 200,000 | 195,768 | 2027/11/30 |
| 徳島県 | 公募平成30年度第2回 | 0.264 | 300,000 | 290,856 | 2028/11/28 |
| 山梨県 | 公募令和元年度第1回 | 0.05 | 100,000 | 94,805 | 2029/10/30 |
| 岡山県 | 公募平成28年度第2回 | 0.205 | 168,900 | 166,383 | 2027/3/31 |
| 岡山県 | 公募令和2年度第3回 | 0.224 | 300,000 | 281,649 | 2031/3/31 |
| 岡山県 | 公募令和3年度第1回 | 0.189 | 100,000 | 92,479 | 2032/1/30 |
| 秋田県 | 公募令和3年度第1回 | 0.234 | 116,600 | 107,919 | 2032/3/25 |
| 神奈川県 | 住宅供給公社債券 第4回 | 0.325 | 100,000 | 97,407 | 2028/4/24 |
| 広島県 | ・広島市折半保証広島高速道路債券 第19回 | 0.32 | 100,000 | 76,473 | 2040/2/24 |
| 広島県 | ・広島市折半保証広島高速道路債券 第22回 | 0.491 | 100,000 | 76,569 | 2041/2/19 |
| 広島県 | ・広島市折半保証広島高速道路債券 第27回 | 1.181 | 100,000 | 83,143 | 2042/12/22 |
| 愛知県 | ・名古屋折半保証名古屋高速道路債券 第96回 | 2.34 | 100,000 | 103,926 | 2028/12/20 |
| 愛知県 | ・名古屋折半保証名古屋高速道路債券 第102回 | 2.298 | 300,000 | 312,939 | 2029/12/20 |
| 愛知県 | ・名古屋折半保証名古屋高速道路債券 第128回 | 0.425 | 100,000 | 94,606 | 2030/12/20 |
| 愛知県 | ・名古屋折半保証名古屋高速道路債券 第148回 | 0.15 | 100,000 | 86,339 | 2034/9/15 |
| 福岡北九州 | 高速道路債券 第117回 | 2.26 | 100,000 | 103,642 | 2028/12/20 |
| 福岡北九州 | 高速道路債券 第136回 | 0.833 | 100,000 | 97,431 | 2030/3/19 |
| 福岡北九州 | 高速道路債券 第145回 | 0.56 | 100,000 | 85,580 | 2036/12/16 |
| 東京都 | 住宅供給公社債券 第19回 | 1.43 | 300,000 | 302,127 | 2028/9/15 |
| 東京都 | 住宅供給公社債券 第23回 | 1.303 | 100,000 | 94,967 | 2035/9/14 |
| 小 計 | | | 62,551,670 | 59,320,310 | |
| 特殊債券(除く金融債) | | | | | |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第85回 | 0.01 | 100,000 | 99,041 | 2026/6/15 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第91回 | 0.085 | 300,000 | 295,902 | 2026/12/14 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第95回 | 0.14 | 137,000 | 134,832 | 2027/4/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第97回 | 0.13 | 300,000 | 294,711 | 2027/6/14 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第98回 | 0.16 | 122,000 | 119,839 | 2027/7/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第100回 | 0.09 | 108,000 | 105,722 | 2027/9/17 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第108回 | 0.145 | 157,000 | 152,856 | 2028/5/19 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第110回 | 0.13 | 100,000 | 97,111 | 2028/7/18 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第113回 | 0.219 | 110,000 | 106,818 | 2028/10/16 |
| 政保 | 地方公共団体金融機構債券 第119回 | 0.04 | 116,000 | 111,093 | 2029/4/13 |

| 銘柄 | 当 期 末 | 利 率 | | | |
|------------------------------|-------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| 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120回 | | 0.001 | 103,000 | 98,067 | 2029/7/13 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第121回 | | 0.001 | 100,000 | 94,818 | 2029/10/15 |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第47回 | | 0.09 | 100,000 | 97,877 | 2027/9/24 |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第55回 | | 0.085 | 108,000 | 103,845 | 2029/2/19 |
| 日本政策金融公庫債券 政府保証第63回 | | 0.11 | 270,000 | 252,771 | 2031/2/25 |
| 住宅金融支援機構債券 政府保証第27回 | | 1.384 | 200,000 | 185,412 | 2039/5/30 |
| 住宅金融支援機構債券 政府保証第29回 | | 1.76 | 200,000 | 183,780 | 2044/6/20 |
| 新関西国際空港債券 政府保証第5回 | | 0.145 | 117,000 | 115,211 | 2027/3/30 |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第37回 | | 0.085 | 400,000 | 394,536 | 2026/12/14 |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第55回 | | 0.105 | 300,000 | 288,378 | 2029/3/19 |
| 日本政策投資銀行社債 政府保証第62回 | | 0.001 | 200,000 | 188,498 | 2030/3/18 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第90回 | | 2.1 | 100,000 | 104,051 | 2029/9/28 |
| 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 | 208,228 | 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 | 208,426 | 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 | 209,480 | 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 | 208,868 | 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111回 | | 2.0 | 100,000 | 104,036 | 2030/6/28 |
| 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 | 207,098 | 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 | 100,170 | 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127回 | | 2.0 | 300,000 | 312,906 | 2031/1/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第146回 | | 1.8 | 100,000 | 103,353 | 2031/9/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第164回 | | 1.675 | 100,000 | 102,472 | 2032/5/31 |
| 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 | 95,062 | 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167回 | | 1.67 | 100,000 | 102,431 | 2032/6/30 |
| 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 | 300,000 | 306,444 | 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172回 | | 1.919 | 300,000 | 288,255 | 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176回 | | 1.645 | 200,000 | 204,230 | 2032/10/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第181回 | | 1.66 | 100,000 | 102,155 | 2032/12/28 |
| 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 | 102,609 | 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214回 | | 1.475 | 100,000 | 99,866 | 2034/3/31 |
| 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 | 99,839 | 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 | 91,320 | 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224回 | | 1.72 | 100,000 | 91,122 | 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226回 | | 1.39 | 100,000 | 98,718 | 2034/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第228回 | | 1.396 | 100,000 | 98,675 | 2034/9/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第233回 | | 1.315 | 100,000 | 97,772 | 2034/11/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第237回 | | 0.97 | 100,000 | 94,408 | 2035/1/31 |
| 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 | 480,145 | 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245回 | | 1.079 | 500,000 | 475,580 | 2035/4/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第246回 | | 1.178 | 200,000 | 191,882 | 2035/5/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第255回 | | 1.22 | 100,000 | 96,011 | 2035/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第259回 | | 1.119 | 100,000 | 94,790 | 2035/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第278回 | | 0.237 | 100,000 | 85,000 | 2036/5/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第296回 | | 0.522 | 200,000 | 173,952 | 2036/11/28 |
| 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 | 110,000 | 108,458 | 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 | 396,830 | 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314回 | | 0.59 | 300,000 | 260,439 | 2037/5/29 |
| 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 | 98,194 | 2027/6/30 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | |
|--------------------|------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第321回 | 0.155 | 600,000 | 588,558 | 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 | 97,865 | 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 | 72,612 | 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 | 488,860 | 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 | 127,773 | 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350回 | 0.777 | 100,000 | 70,922 | 2048/5/29 |
| 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 | 97,215 | 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 | 194,130 | 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 | 97,222 | 2028/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第358回 | 0.625 | 300,000 | 254,388 | 2038/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第377回 | 0.716 | 200,000 | 113,958 | 2059/2/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第386回 | 0.464 | 300,000 | 152,607 | 2059/6/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第388回 | 0.363 | 100,000 | 61,870 | 2049/7/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第391回 | 0.001 | 113,000 | 107,220 | 2029/9/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第398回 | 0.422 | 100,000 | 62,334 | 2049/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第402回 | 0.432 | 200,000 | 98,600 | 2060/2/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第403回 | 0.001 | 202,000 | 190,320 | 2030/3/29 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第415回 | 0.429 | 300,000 | 230,751 | 2041/5/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第435回 | 1.325 | 100,000 | 86,848 | 2043/2/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第436回 | 1.259 | 500,000 | 428,735 | 2043/3/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第449回 | 0.284 | 500,000 | 487,425 | 2028/8/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第453回 | 0.477 | 200,000 | 192,088 | 2030/9/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第463回 | 1.532 | 500,000 | 444,450 | 2043/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第473回 | 0.502 | 200,000 | 191,394 | 2031/4/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 政府保証債第475回 | 1.684 | 200,000 | 181,574 | 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479回 | 1.497 | 500,000 | 470,080 | 2039/6/30 |
| 民間都市開発推進機構 | 政府保証第20回 | 0.145 | 113,600 | 110,806 | 2028/3/29 |
| 民間都市開発推進機構 | 政府保証第22回 | 0.245 | 200,000 | 154,302 | 2040/2/28 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第6回 | 1.445 | 300,000 | 302,880 | 2028/9/15 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第9回 | 1.231 | 100,000 | 100,089 | 2028/12/20 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第12回 | 1.067 | 100,000 | 98,967 | 2029/9/20 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第14回 | 1.318 | 100,000 | 96,411 | 2034/12/20 |
| 新関西国際空港社債 | 財投機関債第28回 | 0.205 | 100,000 | 93,366 | 2031/3/20 |
| 第2回国立大学法人東京大学 | | 0.853 | 100,000 | 53,687 | 2061/3/18 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第47回 | 1.027 | 100,000 | 98,923 | 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 | 196,834 | 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 | 98,283 | 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 | 293,907 | 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 | 194,108 | 2028/7/12 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第101回 | 0.309 | 300,000 | 291,378 | 2028/10/12 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第109回 | 0.81 | 200,000 | 109,580 | 2059/3/19 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第138回 | 0.145 | 400,000 | 373,620 | 2031/1/15 |
| 日本政策投資銀行社債 | 財投機関債第157回 | 1.197 | 200,000 | 120,846 | 2062/3/17 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第1回 | 2.99 | 400,000 | 433,412 | 2045/9/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第4回 | 2.59 | 100,000 | 107,985 | 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17回 | 2.35 | 100,000 | 102,073 | 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 | 500,000 | 515,365 | 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26回 | 2.67 | 100,000 | 108,131 | 2037/9/18 |

| 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33回 | 2.91 | 200,000 | 211,836 | 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 | 300,000 | 312,621 | 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43回 | 0.5 | 300,000 | 246,564 | 2038/9/17 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第46回 | 2.7 | 400,000 | 409,060 | 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47回 | 2.41 | 100,000 | 104,704 | 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55回 | 2.22 | 100,000 | 104,347 | 2030/2/8 |
| 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 | 102,020 | 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95回 | 1.773 | 200,000 | 204,660 | 2032/9/17 |
| 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 | 355,309 | 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 | 600,000 | 616,494 | 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126回 | 1.023 | 100,000 | 99,289 | 2029/3/19 |
| 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 | 258,945 | 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 | 87,374 | 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151回 | 1.215 | 100,000 | 95,583 | 2035/3/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第152回 | 1.626 | 100,000 | 87,722 | 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155回 | 1.3 | 100,000 | 96,110 | 2035/6/20 |
| 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 | 97,758 | 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160回 | 1.284 | 200,000 | 191,254 | 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163回 | 1.197 | 100,000 | 94,778 | 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164回 | 1.149 | 100,000 | 94,314 | 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 | 200,000 | 109,850 | 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 | 85,453 | 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198回 | 1.082 | 100,000 | 62,684 | 2057/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第204回 | 1.044 | 200,000 | 121,956 | 2058/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第230回 | 0.626 | 100,000 | 51,137 | 2059/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第233回 | 0.443 | 100,000 | 53,989 | 2054/3/19 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 財投機関債第234回 | 0.285 | 200,000 | 117,216 | 2049/6/18 |
| 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 | 126,258 | 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9回 | 2.9 | 100,000 | 110,232 | 2032/5/20 |
| 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 | 500,000 | 552,385 | 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 | 111,122 | 2034/6/20 |
| 公営企業債券 30年第4回財投機関債 | | 2.95 | 500,000 | 557,170 | 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 | 103,296 | 2028/12/20 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第1回 | | 2.266 | 300,000 | 312,888 | 2029/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第4回 | | 2.12 | 100,000 | 103,929 | 2029/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 F16回 | | 2.042 | 100,000 | 101,923 | 2027/1/7 |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第6回 | | 2.242 | 300,000 | 313,950 | 2030/3/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 20年第7回 | | 2.202 | 400,000 | 418,048 | 2030/4/26 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第10回 | | 1.752 | 300,000 | 307,134 | 2030/8/28 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第12回 | | 2.092 | 100,000 | 104,327 | 2030/12/27 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第13回 | | 2.132 | 100,000 | 104,587 | 2031/1/28 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第19回 | | 1.84 | 200,000 | 206,024 | 2031/12/26 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第20回 | | 1.8 | 100,000 | 102,765 | 2032/1/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 F96回 | | 1.546 | 300,000 | 303,240 | 2027/1/29 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第21回 | | 1.812 | 100,000 | 102,798 | 2032/4/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 F122回 | | 1.412 | 100,000 | 100,880 | 2027/6/18 |
| 地方公共団体金融機構債券 F124回 | | 1.418 | 100,000 | 100,887 | 2027/6/4 |
| 地方公共団体金融機構債券(20年) 第24回 | | 1.702 | 200,000 | 203,786 | 2032/9/28 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|-----------------------|------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | | % | 千円 | 千円 | |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 143回 | 1.351 | 300,000 | 302,313 | 2027/8/25 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 147回 | 1.291 | 100,000 | 100,600 | 2027/3/19 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 160回 | 1.052 | 100,000 | 99,900 | 2028/5/26 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第29回 | 1.725 | 100,000 | 101,702 | 2033/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第32回 | 1.624 | 100,000 | 100,704 | 2033/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (15年) 第2回 | 1.161 | 200,000 | 199,966 | 2028/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第37回 | 1.535 | 200,000 | 198,708 | 2034/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第38回 | 1.487 | 300,000 | 296,517 | 2034/7/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 240回 | 1.069 | 300,000 | 297,069 | 2030/2/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 243回 | 1.285 | 300,000 | 297,285 | 2032/7/21 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 248回 | 1.512 | 100,000 | 96,853 | 2036/7/25 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第39回 | 1.425 | 200,000 | 196,294 | 2034/9/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第40回 | 1.381 | 100,000 | 97,650 | 2034/10/27 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第43回 | 1.171 | 100,000 | 95,131 | 2035/4/27 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第44回 | 1.298 | 200,000 | 192,254 | 2035/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | F 308回 | 1.192 | 200,000 | 185,366 | 2037/3/19 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第84回 | 0.09 | 100,000 | 99,142 | 2026/5/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第52回 | 0.288 | 100,000 | 84,527 | 2036/6/27 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第53回 | 0.18 | 200,000 | 166,492 | 2036/7/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (20年) 第58回 | 0.721 | 100,000 | 87,599 | 2037/3/27 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第95回 | 0.2 | 200,000 | 196,732 | 2027/4/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第101回 | 0.235 | 400,000 | 391,968 | 2027/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第6回 | 0.85 | 200,000 | 140,606 | 2048/4/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第67回 | 0.564 | 100,000 | 83,443 | 2038/6/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (30年) 第7回 | 1.029 | 100,000 | 72,828 | 2048/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第1回 | 0.882 | 200,000 | 113,980 | 2059/2/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (30年) 第9回 | 0.446 | 200,000 | 122,050 | 2049/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 2回 | 0.646 | 100,000 | 50,874 | 2060/1/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第12回 | 0.716 | 200,000 | 128,380 | 2050/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第139回 | 0.125 | 300,000 | 280,416 | 2030/12/27 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第89回 | 0.554 | 100,000 | 77,908 | 2041/3/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | (30年) 第13回 | 0.737 | 100,000 | 63,818 | 2051/4/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第92回 | 0.448 | 500,000 | 379,145 | 2041/7/26 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第14回 | 0.736 | 100,000 | 63,020 | 2051/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第152回 | 0.204 | 100,000 | 92,406 | 2032/1/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第101回 | 1.114 | 200,000 | 166,066 | 2042/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第166回 | 0.75 | 200,000 | 189,090 | 2033/3/28 |
| 地方公共団体金融機構債券 | 第171回 | 0.788 | 100,000 | 94,234 | 2033/8/26 |
| 公営企業債券(20年) 第19回財投機関債 | | 2.37 | 100,000 | 102,414 | 2026/12/18 |
| 公営企業債券(20年) 第20回財投機関債 | | 2.25 | 100,000 | 102,477 | 2027/3/24 |
| 公営企業債券(20年) 第23回財投機関債 | | 2.29 | 200,000 | 206,178 | 2027/9/24 |
| 公営企業債券(20年) 第24回財投機関債 | | 2.29 | 200,000 | 207,350 | 2028/4/25 |
| 公営企業債券(20年) 第25回財投機関債 | | 2.5 | 100,000 | 104,430 | 2028/6/20 |
| 首都高速道路 第28回 | | 0.04 | 200,000 | 197,338 | 2026/9/18 |
| 首都高速道路 第33回 | | 0.523 | 300,000 | 292,809 | 2028/12/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第93回 | | 1.102 | 100,000 | 99,443 | 2029/6/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第97回 | | 1.017 | 100,000 | 98,881 | 2029/9/20 |
| 都市再生債券 財投機関債第101回 | | 0.935 | 100,000 | 98,455 | 2029/11/20 |

| 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 | |
| 都市再生債券 | 財投機関債第109回 | 0.918 | 100,000 | 98,056 | 2030/6/20 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第113回 | 0.851 | 300,000 | 292,584 | 2030/9/20 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第121回 | 0.482 | 200,000 | 190,398 | 2031/2/20 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第127回 | 0.075 | 200,000 | 197,524 | 2026/9/18 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第141回 | 0.63 | 100,000 | 84,837 | 2038/2/19 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第155回 | 0.804 | 100,000 | 55,888 | 2058/3/19 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第166回 | 0.806 | 100,000 | 53,812 | 2060/3/19 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第169回 | 0.862 | 100,000 | 54,996 | 2060/3/19 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第170回 | 0.491 | 100,000 | 76,472 | 2041/6/20 |
| 都市再生債券 | 財投機関債第191回 | 1.907 | 100,000 | 75,456 | 2063/3/19 |
| 福祉医療機構債券 | 第50回財投機関債 | 0.215 | 300,000 | 294,666 | 2027/6/18 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第3回 | 2.26 | 400,000 | 410,036 | 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 | 206,258 | 2027/6/18 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第49回 | 2.11 | 100,000 | 104,071 | 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 | 103,358 | 2030/10/22 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第75回 | 2.066 | 180,000 | 187,707 | 2031/6/13 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第77回 | 1.751 | 900,000 | 909,711 | 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 | 104,246 | 2031/7/11 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第81回 | 1.926 | 100,000 | 103,494 | 2031/9/12 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第85回 | 1.841 | 200,000 | 205,940 | 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 | 202,208 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第94回 | 1.882 | 100,000 | 103,230 | 2032/2/13 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第111回 | 1.404 | 100,000 | 100,819 | 2027/6/18 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第112回 | 1.738 | 100,000 | 102,140 | 2032/8/16 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第115回 | 1.811 | 100,000 | 102,617 | 2032/9/14 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第119回 | 1.428 | 100,000 | 100,918 | 2027/9/17 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第120回 | 1.836 | 100,000 | 102,735 | 2032/11/12 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第123回 | 1.801 | 300,000 | 307,554 | 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 | 99,692 | 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 | 200,152 | 2028/3/17 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第134回 | 1.306 | 100,000 | 100,656 | 2028/5/19 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第137回 | 1.31 | 200,000 | 201,298 | 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 | 100,156 | 2028/10/20 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第162回 | 1.299 | 100,000 | 96,102 | 2035/6/20 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第188回 | 0.09 | 300,000 | 297,471 | 2026/5/20 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第195回 | 0.448 | 100,000 | 85,446 | 2036/10/20 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第198回 | 0.155 | 300,000 | 295,962 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第203回 | 0.24 | 100,000 | 98,572 | 2027/3/19 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第208回 | 0.215 | 200,000 | 196,604 | 2027/5/20 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第213回 | 0.26 | 100,000 | 98,236 | 2027/7/20 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第222回 | 0.21 | 200,000 | 195,656 | 2027/11/19 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第223回 | 0.403 | 100,000 | 92,425 | 2032/11/19 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第227回 | 0.26 | 100,000 | 97,808 | 2028/1/20 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第244回 | 0.274 | 130,000 | 126,349 | 2028/8/18 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第277回 | 0.547 | 400,000 | 251,424 | 2049/9/17 |
| 住宅金融支援機構債券 | 財投機関債第306回 | 0.334 | 200,000 | 172,408 | 2035/11/20 |
| 成田国際空港 | 第39回 | 0.409 | 300,000 | 259,905 | 2035/10/26 |
| 沖縄振興開発金融公庫債券 | 財投機関債第30回 | 0.12 | 100,000 | 91,949 | 2031/12/19 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|------------------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 国際協力機構債券 第6回財投機関債 | 2.098 | 200,000 | 208,440 | 2030/12/13 |
| 国際協力機構債券 第15回財投機関債 | 1.724 | 100,000 | 102,000 | 2032/9/17 |
| 国際協力機構債券 第25回財投機関債 | 1.52 | 100,000 | 99,157 | 2034/6/20 |
| 国際協力機構債券 第32回財投機関債 | 1.212 | 100,000 | 94,951 | 2035/9/20 |
| 国際協力機構債券 第35回財投機関債 | 0.08 | 100,000 | 99,051 | 2026/6/19 |
| 国際協力機構債券 第40回財投機関債 | 0.22 | 100,000 | 98,232 | 2027/6/18 |
| 国際協力機構債券 第51回財投機関債 | 0.538 | 100,000 | 62,362 | 2049/12/20 |
| 国際協力機構債券 第54回財投機関債 | 0.445 | 100,000 | 77,801 | 2040/6/26 |
| 国際協力機構債券 第68回財投機関債 | 0.399 | 100,000 | 93,045 | 2032/6/18 |
| 東日本高速道路 第57回 | 0.11 | 100,000 | 99,052 | 2026/6/19 |
| 東日本高速道路 第61回 | 0.14 | 200,000 | 190,558 | 2029/7/31 |
| 東日本高速道路 第64回 | 0.14 | 100,000 | 94,808 | 2029/11/29 |
| 東日本高速道路 第69回 | 0.225 | 100,000 | 94,696 | 2030/4/24 |
| 東日本高速道路 第83回 | 0.05 | 200,000 | 197,958 | 2026/6/19 |
| 東日本高速道路 第86回 | 0.04 | 400,000 | 393,636 | 2026/12/18 |
| 東日本高速道路 第89回 | 0.04 | 130,000 | 127,931 | 2026/12/18 |
| 東日本高速道路 第95回 | 0.23 | 850,000 | 834,980 | 2027/6/18 |
| 中日本高速道路 第89回 | 0.05 | 100,000 | 99,042 | 2026/6/1 |
| 中日本高速道路 第90回 | 0.05 | 300,000 | 296,577 | 2026/7/27 |
| 中日本高速道路 第91回 | 0.04 | 200,000 | 197,342 | 2026/9/17 |
| 中日本高速道路 第93回 | 0.125 | 200,000 | 196,628 | 2027/3/18 |
| 中日本高速道路 第96回 | 0.439 | 200,000 | 196,698 | 2027/12/13 |
| 中日本高速道路 第97回 | 0.628 | 200,000 | 197,592 | 2028/1/21 |
| 中日本高速道路 第98回 | 0.514 | 300,000 | 295,257 | 2028/2/21 |
| 中日本高速道路 第101回 | 0.439 | 500,000 | 488,580 | 2028/8/17 |
| 西日本高速道路 第30回 | 0.17 | 300,000 | 297,630 | 2026/5/22 |
| 西日本高速道路 第34回 | 0.335 | 300,000 | 296,349 | 2027/2/16 |
| 西日本高速道路 第61回 | 0.04 | 300,000 | 296,901 | 2026/6/19 |
| 西日本高速道路 第62回 | 0.04 | 1,100,000 | 1,085,359 | 2026/9/18 |
| 西日本高速道路 第64回 | 0.04 | 200,000 | 197,338 | 2026/9/18 |
| 西日本高速道路 第69回 | 0.225 | 200,000 | 196,444 | 2027/6/18 |
| 西日本高速道路 第77回 | 0.39 | 200,000 | 195,592 | 2028/5/25 |
| 西日本高速道路 第88回 | 0.858 | 100,000 | 97,054 | 2031/5/23 |
| 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 | 200,000 | 196,690 | 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90回 | 0.2 | 300,000 | 279,789 | 2031/5/30 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第135回 | 0.11 | 300,000 | 283,137 | 2030/2/27 |
| 貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券 | 2.28 | 13,103 | 13,356 | 2044/6/10 |
| 貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券 | 1.98 | 45,846 | 46,624 | 2044/9/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券 | 1.43 | 40,892 | 41,038 | 2045/11/10 |
| 貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券 | 1.79 | 47,802 | 48,585 | 2046/2/10 |
| 貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券 | 1.51 | 35,198 | 35,467 | 2046/9/10 |
| 貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券 | 2.34 | 23,318 | 23,655 | 2044/5/10 |
| 貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券 | 1.89 | 44,049 | 44,859 | 2046/5/10 |
| 貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券 | 1.36 | 51,417 | 51,588 | 2045/9/10 |
| 貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 77,931 | 77,009 | 2047/7/10 |
| 貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券 | 1.34 | 68,031 | 67,860 | 2047/5/10 |
| 貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 45,790 | 45,493 | 2047/6/10 |
| 貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券 | 1.64 | 16,412 | 16,610 | 2046/8/10 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|-----------------------|------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券 | 1.6 | 40,072 | 40,475 | 2045/12/10 |
| 貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 26,865 | 26,314 | 2048/12/10 |
| 貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 59,482 | 58,114 | 2049/2/10 |
| 貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券 | 1.08 | 127,710 | 125,402 | 2048/5/10 |
| 貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券 | 1.25 | 80,337 | 79,481 | 2048/3/10 |
| 貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券 | 1.88 | 16,630 | 16,899 | 2045/2/10 |
| 貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券 | 1.86 | 17,187 | 17,447 | 2045/3/10 |
| 貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券 | 1.87 | 16,267 | 16,566 | 2045/4/10 |
| 貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券 | 1.85 | 15,435 | 15,712 | 2046/3/10 |
| 貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券 | 1.41 | 43,884 | 43,968 | 2046/12/10 |
| 貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券 | 1.42 | 62,922 | 63,090 | 2047/1/10 |
| 貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券 | 1.44 | 21,012 | 21,086 | 2047/2/10 |
| 貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券 | 1.21 | 50,542 | 49,960 | 2048/9/10 |
| 貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券 | 2.25 | 48,296 | 49,042 | 2044/4/10 |
| 貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券 | 1.82 | 47,583 | 48,205 | 2045/1/10 |
| 貸付債権担保第38回住宅金融支援機構債券 | 1.61 | 52,881 | 53,427 | 2045/7/10 |
| 貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券 | 1.52 | 84,830 | 85,535 | 2045/8/10 |
| 貸付債権担保第50回住宅金融支援機構債券 | 1.67 | 155,010 | 157,042 | 2046/7/10 |
| 貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券 | 1.4 | 47,096 | 47,104 | 2047/3/10 |
| 貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券 | 1.16 | 84,459 | 83,144 | 2047/9/10 |
| 貸付債権担保第67回住宅金融支援機構債券 | 1.09 | 295,930 | 289,037 | 2047/12/10 |
| 貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券 | 1.07 | 76,083 | 74,682 | 2048/4/10 |
| 貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券 | 1.3 | 60,904 | 60,108 | 2048/6/10 |
| 貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券 | 1.26 | 50,068 | 49,604 | 2048/8/10 |
| 貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券 | 1.04 | 128,308 | 124,687 | 2049/4/10 |
| 貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券 | 1.01 | 218,169 | 211,964 | 2049/5/10 |
| 貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券 | 0.93 | 34,117 | 32,837 | 2049/9/10 |
| 貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券 | 0.95 | 34,826 | 33,539 | 2049/10/10 |
| 貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券 | 0.87 | 36,112 | 34,566 | 2049/11/10 |
| 貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 76,668 | 72,520 | 2050/1/10 |
| 貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券 | 0.6 | 82,592 | 77,117 | 2050/2/10 |
| 貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券 | 0.8 | 43,670 | 41,313 | 2050/3/10 |
| 貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 46,340 | 43,548 | 2050/5/10 |
| 貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券 | 0.83 | 136,665 | 129,156 | 2050/6/10 |
| 貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券 | 0.9 | 143,979 | 136,219 | 2050/7/10 |
| 貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券 | 0.88 | 97,178 | 91,660 | 2050/8/10 |
| 貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券 | 0.84 | 47,409 | 44,598 | 2050/9/10 |
| 貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券 | 0.89 | 48,217 | 45,523 | 2050/10/10 |
| 貸付債権担保第107回住宅金融支援機構債券 | 0.48 | 222,172 | 201,836 | 2051/4/10 |
| 貸付債権担保第108回住宅金融支援機構債券 | 0.34 | 286,045 | 257,775 | 2051/5/10 |
| 貸付債権担保第112回住宅金融支援機構債券 | 0.33 | 250,916 | 225,801 | 2051/9/10 |
| 貸付債権担保第113回住宅金融支援機構債券 | 0.37 | 312,440 | 282,033 | 2051/10/10 |
| 貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券 | 0.41 | 186,975 | 168,520 | 2051/12/10 |
| 貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券 | 0.48 | 125,516 | 113,603 | 2052/1/10 |
| 貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 126,222 | 113,842 | 2052/2/10 |
| 貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券 | 0.47 | 62,598 | 56,564 | 2052/3/10 |
| 貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 126,182 | 113,862 | 2052/4/10 |
| 貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券 | 0.4 | 63,156 | 56,626 | 2052/5/10 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | | |
|-------------------------|-------|------------|------------|------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 特殊債券(除く金融債) | % | 千円 | 千円 | |
| 貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券 | 0.43 | 63,880 | 57,398 | 2052/6/10 |
| 貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 65,269 | 58,663 | 2052/8/10 |
| 貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 257,972 | 231,031 | 2052/10/10 |
| 貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券 | 0.43 | 196,515 | 175,873 | 2052/11/10 |
| 貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券 | 0.42 | 130,662 | 116,851 | 2053/1/10 |
| 貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 134,786 | 120,607 | 2053/2/10 |
| 貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券 | 0.39 | 136,766 | 121,389 | 2053/7/10 |
| 貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券 | 0.39 | 67,938 | 60,274 | 2053/8/10 |
| 貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券 | 0.44 | 69,100 | 61,510 | 2053/9/10 |
| 貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券 | 0.38 | 68,790 | 60,849 | 2054/1/10 |
| 貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券 | 0.32 | 213,864 | 188,029 | 2054/3/10 |
| 貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券 | 0.33 | 212,028 | 186,359 | 2054/5/10 |
| 貸付債権担保第145回住宅金融支援機構債券 | 0.31 | 217,092 | 190,207 | 2054/6/10 |
| 貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券 | 0.21 | 378,040 | 327,654 | 2054/11/10 |
| 貸付債権担保第151回住宅金融支援機構債券 | 0.26 | 231,312 | 201,010 | 2054/12/10 |
| 貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券 | 0.33 | 153,152 | 133,974 | 2055/1/10 |
| 貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券 | 0.3 | 154,904 | 134,902 | 2055/3/10 |
| 貸付債権担保第158回住宅金融支援機構債券 | 0.36 | 155,248 | 135,618 | 2055/7/10 |
| 貸付債権担保第162回住宅金融支援機構債券 | 0.35 | 240,078 | 209,194 | 2055/11/10 |
| 貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券 | 0.33 | 245,241 | 212,854 | 2056/1/10 |
| 貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券 | 0.36 | 162,256 | 141,363 | 2056/2/10 |
| 貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券 | 0.41 | 244,365 | 213,873 | 2056/3/10 |
| 貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券 | 0.41 | 162,452 | 142,013 | 2056/4/10 |
| 貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券 | 0.4 | 162,394 | 141,752 | 2056/5/10 |
| 貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券 | 0.39 | 249,225 | 217,137 | 2056/6/10 |
| 貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券 | 0.36 | 411,180 | 357,952 | 2056/7/10 |
| 貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券 | 0.38 | 254,334 | 221,583 | 2056/11/10 |
| 貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券 | 0.36 | 256,896 | 223,191 | 2056/12/10 |
| 貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券 | 0.32 | 256,569 | 221,724 | 2057/1/10 |
| 貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券 | 0.4 | 171,056 | 148,912 | 2057/2/10 |
| 貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券 | 0.48 | 255,426 | 224,343 | 2057/3/10 |
| 貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券 | 0.46 | 257,292 | 225,482 | 2057/4/10 |
| 貸付債権担保第180回住宅金融支援機構債券 | 0.5 | 171,622 | 151,111 | 2057/5/10 |
| 貸付債権担保第183回住宅金融支援機構債券 | 0.53 | 521,616 | 458,855 | 2057/8/10 |
| 貸付債権担保第185回住宅金融支援機構債券 | 0.58 | 265,512 | 234,500 | 2057/10/10 |
| 貸付債権担保第186回住宅金融支援機構債券 | 0.74 | 178,844 | 160,351 | 2057/11/10 |
| 貸付債権担保第195回住宅金融支援機構債券 | 0.93 | 184,924 | 167,901 | 2058/8/10 |
| 貸付債権担保第197回住宅金融支援機構債券 | 1.08 | 281,409 | 259,020 | 2058/10/10 |
| 貸付債権担保第198回住宅金融支援機構債券 | 1.18 | 185,854 | 173,201 | 2058/11/10 |
| 貸付債権担保第199回住宅金融支援機構債券 | 1.11 | 372,876 | 346,055 | 2058/12/10 |
| 貸付債権担保第200回住宅金融支援機構債券 | 1.05 | 470,235 | 433,664 | 2059/1/10 |
| 貸付債権担保第202回住宅金融支援機構債券 | 1.08 | 285,015 | 264,382 | 2059/3/10 |
| 貸付債権担保第203回住宅金融支援機構債券 | 1.14 | 477,065 | 444,004 | 2059/4/10 |
| 貸付債権担保第205回住宅金融支援機構債券 | 1.3 | 191,130 | 181,976 | 2059/6/10 |
| アソテス開発公社 第21回円貨社債(2023) | 0.96 | 100,000 | 98,095 | 2028/12/7 |
| 小 計 | | 70,410,530 | 65,981,312 | |
| 金融債券 | | | | |
| 商工債券 利付第852回い号 | 0.09 | 100,000 | 99,081 | 2026/5/27 |

| 銘柄 | 利 | 当期末 | | |
|------------------|-------|-----------|-----------|------------|
| | | 率 | 額面金額 | 評価額 |
| 金融債券 | % | 千円 | 千円 | |
| 商工債券 利付第854回い号 | 0.08 | 400,000 | 395,284 | 2026/7/27 |
| 商工債券 利付第856回い号 | 0.09 | 200,000 | 197,264 | 2026/9/25 |
| 商工債券 利付第862回い号 | 0.18 | 100,000 | 98,241 | 2027/3/26 |
| 商工債券 利付第868回い号 | 0.24 | 100,000 | 97,843 | 2027/9/27 |
| 商工債券 利付第871回い号 | 0.35 | 100,000 | 97,872 | 2027/12/27 |
| 商工債券 利付第872回い号 | 0.45 | 100,000 | 97,967 | 2028/1/27 |
| 商工債券 利付第876回い号 | 0.45 | 400,000 | 390,480 | 2028/5/26 |
| 商工債券 利付第878回い号 | 0.43 | 200,000 | 194,702 | 2028/7/27 |
| 商工債券 利付第879回い号 | 0.48 | 400,000 | 389,748 | 2028/8/25 |
| 商工債券 利付第883回い号 | 0.63 | 200,000 | 195,078 | 2028/12/27 |
| 商工債券 利付第885回い号 | 0.65 | 300,000 | 292,344 | 2029/2/27 |
| 商工債券 利付第895回い号 | 1.03 | 100,000 | 98,305 | 2029/12/27 |
| しんきん中金債券 利付第379回 | 0.04 | 400,000 | 395,876 | 2026/6/26 |
| しんきん中金債券 利付第380回 | 0.03 | 100,000 | 98,859 | 2026/7/27 |
| しんきん中金債券 利付第387回 | 0.09 | 100,000 | 98,318 | 2027/2/26 |
| しんきん中金債券 利付第400回 | 0.38 | 100,000 | 98,043 | 2028/3/27 |
| しんきん中金債券 利付第401回 | 0.36 | 300,000 | 293,640 | 2028/4/27 |
| しんきん中金債券 利付第402回 | 0.3 | 100,000 | 97,609 | 2028/5/26 |
| しんきん中金債券 利付第403回 | 0.26 | 100,000 | 97,369 | 2028/6/27 |
| しんきん中金債券 利付第407回 | 0.46 | 300,000 | 292,986 | 2028/10/27 |
| しんきん中金債券 利付第412回 | 0.51 | 100,000 | 97,389 | 2029/3/27 |
| しんきん中金債券 利付第421回 | 0.88 | 100,000 | 98,293 | 2029/12/27 |
| 商工債券 利付(3年)第289回 | 0.41 | 100,000 | 98,751 | 2027/2/26 |
| 商工債券 利付(10年)第36回 | 0.25 | 100,000 | 93,020 | 2030/12/20 |
| 商工債券 利付(10年)第41回 | 0.4 | 300,000 | 276,498 | 2032/3/19 |
| 商工債券 利付(10年)第46回 | 0.85 | 100,000 | 93,329 | 2033/6/20 |
| 小計 | | 5,000,000 | 4,874,189 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | | |
| 東京電力 第548回 | 2.347 | 100,000 | 101,016 | 2028/9/29 |
| 東京電力 第560回 | 2.114 | 100,000 | 99,481 | 2029/12/10 |
| 中部電力 第524回 | 0.39 | 100,000 | 98,556 | 2027/5/25 |
| 中部電力 第530回 | 0.274 | 200,000 | 191,304 | 2029/6/25 |
| 中部電力 第559回 | 0.85 | 100,000 | 84,146 | 2038/6/25 |
| 中部電力 第560回 | 1.2 | 100,000 | 81,862 | 2042/7/25 |
| 関西電力 第509回 | 0.47 | 100,000 | 98,683 | 2027/5/25 |
| 関西電力 第511回 | 0.41 | 300,000 | 294,777 | 2027/9/17 |
| 関西電力 第520回 | 0.73 | 100,000 | 81,943 | 2038/7/16 |
| 関西電力 第522回 | 0.47 | 200,000 | 194,770 | 2028/9/20 |
| 関西電力 第536回 | 0.44 | 100,000 | 94,164 | 2030/12/20 |
| 関西電力 第556回 | 0.9 | 100,000 | 93,225 | 2033/7/25 |
| 関西電力 第557回 | 1.45 | 100,000 | 83,338 | 2043/7/24 |
| 関西電力 第562回 | 1.128 | 100,000 | 94,282 | 2034/1/25 |
| 中国電力 第394回 | 0.712 | 100,000 | 84,958 | 2036/11/25 |
| 中国電力 第400回 | 0.34 | 100,000 | 98,079 | 2027/9/24 |
| 中国電力 第406回 | 0.752 | 100,000 | 82,395 | 2038/5/25 |
| 中国電力 第416回 | 0.355 | 100,000 | 96,039 | 2029/5/25 |
| 中国電力 第422回 | 0.35 | 600,000 | 567,288 | 2030/4/25 |
| 中国電力 第425回 | 0.37 | 100,000 | 94,402 | 2030/6/25 |

| 銘柄 | 当期末 | | | |
|------------------|-------|---------|---------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 中国電力 第448回 | 0.92 | 100,000 | 93,623 | 2033/5/25 |
| 中国電力 第452回 | 1.41 | 100,000 | 82,608 | 2043/7/24 |
| 北陸電力 第307回 | 1.055 | 100,000 | 100,132 | 2026/6/25 |
| 北陸電力 第312回 | 1.086 | 100,000 | 97,874 | 2030/9/25 |
| 北陸電力 第322回 | 0.38 | 100,000 | 98,396 | 2027/6/25 |
| 北陸電力 第326回 | 0.719 | 200,000 | 164,640 | 2038/4/23 |
| 北陸電力 第330回 | 0.34 | 100,000 | 95,980 | 2029/5/25 |
| 北陸電力 第339回 | 0.5 | 100,000 | 85,580 | 2035/8/24 |
| 東北電力 第484回 | 0.758 | 100,000 | 86,481 | 2036/5/23 |
| 東北電力 第491回 | 0.42 | 100,000 | 98,780 | 2027/2/25 |
| 東北電力 第508回 | 0.465 | 100,000 | 96,580 | 2029/4/25 |
| 東北電力 第521回 | 0.45 | 300,000 | 284,997 | 2030/5/24 |
| 東北電力 第534回 | 0.51 | 100,000 | 79,566 | 2038/6/25 |
| 東北電力 第560回 | 0.87 | 200,000 | 185,952 | 2033/7/25 |
| 東北電力 第563回 | 1.161 | 200,000 | 188,198 | 2034/4/25 |
| 東北電力 第566回 | 1.605 | 100,000 | 97,400 | 2034/7/25 |
| 四国電力 第293回 | 0.84 | 100,000 | 85,750 | 2037/5/25 |
| 四国電力 第321回 | 1.15 | 100,000 | 67,092 | 2052/4/25 |
| 四国電力 第328回 | 1.022 | 100,000 | 94,151 | 2033/9/22 |
| 四国電力 第332回 | 1.245 | 100,000 | 98,085 | 2032/1/23 |
| 九州電力 第449回 | 0.43 | 200,000 | 197,344 | 2027/4/23 |
| 九州電力 第451回 | 0.45 | 100,000 | 98,641 | 2027/5/25 |
| 九州電力 第476回 | 0.43 | 100,000 | 96,333 | 2029/5/25 |
| 九州電力 第478回 | 0.606 | 100,000 | 82,712 | 2037/6/25 |
| 九州電力 第481回 | 0.324 | 300,000 | 286,857 | 2029/7/25 |
| 九州電力 第484回 | 0.375 | 200,000 | 190,750 | 2029/11/22 |
| 九州電力 第493回 | 0.1 | 300,000 | 297,189 | 2026/5/25 |
| 九州電力 第527回 | 1.425 | 100,000 | 96,092 | 2034/5/25 |
| 北海道電力 第323回 | 1.337 | 300,000 | 298,410 | 2030/3/25 |
| 北海道電力 第325回 | 1.264 | 130,000 | 128,219 | 2030/10/25 |
| 北海道電力 第338回 | 0.84 | 100,000 | 86,203 | 2036/11/25 |
| 北海道電力 第341回 | 0.968 | 100,000 | 86,893 | 2037/3/25 |
| 北海道電力 第350回 | 0.754 | 100,000 | 82,702 | 2038/3/25 |
| 北海道電力 第385回 | 1.03 | 100,000 | 94,369 | 2033/5/25 |
| 東京電力パワーグリッド 第6回 | 0.85 | 100,000 | 99,005 | 2027/8/31 |
| 東京電力パワーグリッド 第11回 | 0.79 | 300,000 | 295,398 | 2028/1/25 |
| 東京電力パワーグリッド 第15回 | 0.89 | 300,000 | 287,565 | 2030/7/24 |
| 東京電力パワーグリッド 第28回 | 1.01 | 100,000 | 97,734 | 2029/7/10 |
| 東京電力パワーグリッド 第32回 | 1.28 | 300,000 | 275,406 | 2034/10/6 |
| 東京電力パワーグリッド 第35回 | 1.2 | 100,000 | 97,679 | 2030/4/23 |
| 東京電力パワーグリッド 第36回 | 1.45 | 100,000 | 92,505 | 2035/4/23 |
| 東京電力パワーグリッド 第40回 | 1.37 | 400,000 | 365,636 | 2035/7/13 |
| 東京電力パワーグリッド 第45回 | 0.8 | 300,000 | 282,588 | 2031/4/22 |
| 東京電力パワーグリッド 第48回 | 0.88 | 300,000 | 253,659 | 2036/8/29 |
| 東京電力パワーグリッド 第50回 | 0.94 | 100,000 | 93,403 | 2032/4/26 |
| 東京電力パワーグリッド 第51回 | 1.1 | 200,000 | 170,832 | 2037/4/24 |
| 東京電力パワーグリッド 第54回 | 1.2 | 100,000 | 94,746 | 2032/7/21 |
| 東京電力パワーグリッド 第72回 | 1.568 | 100,000 | 94,987 | 2034/4/18 |

| 銘柄 | 柄 | 当期末 | | | |
|-----------------|--------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | % | 千円 | 千円 | |
| 東京電力パワーグリッド | 第73回 | 2.093 | 100,000 | 93,168 | 2039/4/18 |
| 東京電力パワーグリッド | 第76回 | 2.477 | 200,000 | 194,798 | 2039/7/11 |
| 東京電力リニューアブルパワー | 第5回社債間限定同順位特約付グリ | 1.431 | 400,000 | 375,852 | 2034/2/28 |
| 清水建設 | 第34回社債間限定同順位特約付 | 1.302 | 100,000 | 95,305 | 2033/11/28 |
| 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 | 189,020 | 2030/7/12 |
| 鹿島建設 | 第48回社債間限定同順位特約付 | 0.554 | 100,000 | 98,230 | 2028/3/16 |
| 戸田建設 | 第5回社債間限定同順位特約付 | 0.34 | 100,000 | 94,413 | 2029/12/6 |
| 五洋建設 | 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.14 | 100,000 | 98,584 | 2026/9/25 |
| 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 | 85,958 | 2036/11/28 |
| 大和ハウス工業 | 第14回特定社債間限定同順位特約付 | 0.771 | 100,000 | 85,836 | 2037/6/1 |
| 大和ハウス工業 | 第25回特定社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 300,000 | 278,277 | 2031/6/3 |
| 大和ハウス工業 | 第26回特定社債間限定同順位特約付 | 0.67 | 100,000 | 76,708 | 2041/6/3 |
| 積水ハウス | 第24回社債間限定同順位特約付 | 1.21 | 100,000 | 99,477 | 2030/2/14 |
| 森永乳業 | 第20回社債間限定同順位特約付 | 1.43 | 100,000 | 96,930 | 2034/6/5 |
| 日本ハム | 第17回社債間限定同順位特約付 | 1.561 | 100,000 | 97,600 | 2035/1/19 |
| 博報堂DYホールディング | 第2回社債間限定同順位特約付 | 0.77 | 100,000 | 97,442 | 2029/10/10 |
| アサヒグループホールディングス | 第23回特定社債間限定同順位 | 1.033 | 100,000 | 94,797 | 2033/9/7 |
| コカ・コーラボトラーズジャパン | 第2回社債間限定同順位特約付 | 0.2 | 100,000 | 98,767 | 2026/9/18 |
| コカ・コーラボトラーズジャパン | 第3回社債間限定同順位特約付 | 0.27 | 100,000 | 94,908 | 2029/9/19 |
| 味の素 | 第32回特定社債間限定同順位特約付 | 1.204 | 100,000 | 95,026 | 2034/9/20 |
| 味の素 | 第33回特定社債間限定同順位特約付 | 2.073 | 100,000 | 93,617 | 2044/9/20 |
| 日本たばこ産業 | 第13回 | 0.355 | 100,000 | 97,062 | 2028/9/8 |
| ヒューリック | 第14回社債間限定同順位特約付 | 0.806 | 100,000 | 97,624 | 2029/4/18 |
| 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 | 98,099 | 2027/8/31 |
| 東洋紡 | 第44回社債間限定同順位特約付 | 0.634 | 100,000 | 98,217 | 2028/3/9 |
| 野村不動産ホールディングス | 第15回 | 0.39 | 100,000 | 93,035 | 2031/2/26 |
| 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 | 0.34 | 200,000 | 197,672 | 2026/8/28 |
| 森ビル | 第23回社債間限定同順位特約付 | 0.97 | 100,000 | 83,162 | 2038/5/17 |
| 東急不動産ホールディングス | 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.37 | 100,000 | 95,379 | 2029/7/11 |
| 東急不動産ホールディングス | 第21回社債間限定同順位特約付 | 0.88 | 100,000 | 80,668 | 2039/7/11 |
| 東急不動産ホールディングス | 第29回社債間限定同順位特約付 | 0.45 | 100,000 | 97,452 | 2028/6/1 |
| 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 | 0.28 | 200,000 | 194,200 | 2027/12/20 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 第17回社債間限定同順位特約 | 0.687 | 100,000 | 97,183 | 2028/11/2 |
| 東レ | 第30回社債間限定同順位特約付 | 0.375 | 100,000 | 98,314 | 2027/7/16 |
| 東レ | 第33回社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 97,227 | 2028/7/18 |
| 旭化成 | 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.21 | 100,000 | 94,831 | 2029/9/6 |
| 旭化成 | 第25回社債間限定同順位特約付 | 1.232 | 100,000 | 95,775 | 2033/12/5 |
| 日本土地建物 | 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.734 | 200,000 | 193,310 | 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 | 97,791 | 2028/1/26 |
| 日本製紙 | 第15回社債間限定同順位特約付 | 0.35 | 100,000 | 88,268 | 2031/9/10 |
| レゾナックホールディングス | 第3回社債間限定同順位特約付 | 1.5 | 100,000 | 93,868 | 2033/6/15 |
| レゾナックホールディングス | 第35回社債間限定同順位特約付 | 0.55 | 100,000 | 90,010 | 2031/12/2 |
| 住友化学 | 第52回社債間限定同順位特約付 | 0.85 | 100,000 | 81,575 | 2036/9/1 |
| 住友化学 | 第56回社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 97,514 | 2027/9/13 |
| 住友化学 | 第60回社債間限定同順位特約付 | 0.9 | 100,000 | 75,487 | 2039/4/15 |
| 住友化学 | 第61回社債間限定同順位特約付 | 0.4 | 100,000 | 95,240 | 2029/4/16 |
| 住友化学 | 第65回社債間限定同順位特約付 | 0.68 | 100,000 | 67,304 | 2041/10/11 |
| イビデン | 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.11 | 100,000 | 98,651 | 2026/9/9 |

| 銘柄 | 柄 | 当 期 末 | | | |
|------------------|----------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 | 償 還 年 月 日 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | % | 千円 | 千円 | |
| 日本酸素ホールディングス | 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.599 | 100,000 | 97,721 | 2028/8/31 |
| 日本酸素ホールディングス | 第5回社債間限定同順位特約付 | 1.052 | 100,000 | 94,120 | 2033/8/31 |
| 三菱瓦斯化学 | 第24回社債間限定同順位特約付 | 0.608 | 100,000 | 97,720 | 2028/10/18 |
| 三井化学 | 第48回社債間限定同順位特約付 | 0.39 | 100,000 | 97,305 | 2028/6/19 |
| 三井化学 | 第58回社債間限定同順位特約付 | 0.662 | 100,000 | 97,432 | 2029/3/1 |
| J S R | 第9回社債間限定同順位特約付 | 0.29 | 100,000 | 97,690 | 2027/5/28 |
| 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 | 95,393 | 2029/5/30 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 第33回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 200,000 | 187,908 | 2030/2/28 |
| 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 | 77,438 | 2040/6/11 |
| ダイセル | 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.5 | 100,000 | 94,022 | 2030/12/13 |
| UBE株式会社 | 第21回社債間限定同順位特約付 | 1.611 | 100,000 | 96,070 | 2033/11/24 |
| 日本化薬 | 第5回社債間限定同順位特約付 | 1.24 | 100,000 | 100,144 | 2028/3/14 |
| 電通 | 第3回社債間限定同順位特約付 | 0.424 | 100,000 | 96,948 | 2028/10/25 |
| 電通 | 第6回社債間限定同順位特約付 | 0.49 | 300,000 | 285,168 | 2030/7/8 |
| 武田薬品工業 | 第16回社債間限定同順位特約付 | 0.4 | 300,000 | 276,228 | 2031/10/14 |
| アステラス製薬 | 第3回無担保社債間限定 | 0.32 | 100,000 | 99,078 | 2026/8/31 |
| アステラス製薬 | 第4回無担保社債間限定 | 0.519 | 100,000 | 97,651 | 2028/8/31 |
| テルモ | 第10回社債間限定同順位特約付 | 0.519 | 100,000 | 98,941 | 2027/4/23 |
| 大塚ホールディングス | 第4回特定社債間限定同順位特約付 | 0.911 | 100,000 | 96,315 | 2031/9/19 |
| D I C | 第48回社債間限定同順位特約付 | 0.23 | 100,000 | 96,251 | 2028/9/21 |
| オリエンタルランド | 第18回社債間限定同順位特約付 | 0.29 | 200,000 | 187,428 | 2030/9/17 |
| オリエンタルランド | 第24回社債間限定同順位特約付 | 1.258 | 100,000 | 95,410 | 2034/8/28 |
| ヤフー | 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.37 | 200,000 | 197,470 | 2026/7/31 |
| L I N Eヤフー | 第25回社債間限定同順位特約付 | 1.35 | 100,000 | 97,583 | 2029/9/12 |
| 楽天 | 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.45 | 100,000 | 88,111 | 2029/6/25 |
| 富士フイルムホールディングス | 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.633 | 100,000 | 98,921 | 2027/7/16 |
| 富士フイルムホールディングス | 第22回社債間限定同順位特約付 | 1.039 | 100,000 | 97,306 | 2031/7/18 |
| 富士フイルムホールディングス | 第23回社債間限定同順位特約付 | 1.386 | 100,000 | 96,739 | 2034/7/19 |
| コニカミノルタホールディングス | 第9回社債間限定同順位特約付 | 1.023 | 100,000 | 97,588 | 2029/3/6 |
| 出光興産 | 第14回社債間限定同順位特約付 | 0.34 | 100,000 | 92,268 | 2031/7/15 |
| J Xホールディングス | 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.3 | 100,000 | 99,032 | 2026/7/28 |
| コスモエネルギーホールディングス | 第1回社債間限定同順位特約付 | 0.54 | 100,000 | 97,538 | 2028/5/8 |
| TOYO TIRE | 第4回社債間限定同順位特約付 | 1.212 | 100,000 | 94,214 | 2033/9/6 |
| ブリヂストン | 第11回社債間限定同順位特約付 | 0.295 | 100,000 | 98,334 | 2027/4/21 |
| 住友理工 | 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.35 | 100,000 | 98,925 | 2026/9/4 |
| A G C | 第2回社債間限定同順位特約付 | 0.79 | 100,000 | 93,362 | 2033/6/8 |
| A G C | 第4回社債間限定同順位特約付 | 1.292 | 100,000 | 95,561 | 2034/9/5 |
| 太平洋セメント | 第27回社債間限定同順位特約付 | 0.564 | 100,000 | 96,816 | 2028/10/25 |
| 日本碍子 | 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.18 | 100,000 | 95,670 | 2028/12/21 |
| 新日鐵住金 | 第9回社債間限定同順位特約付 | 0.385 | 300,000 | 291,186 | 2028/6/20 |
| 神戸製鋼所 | 第68回社債間限定同順位特約付 | 0.545 | 100,000 | 97,475 | 2028/6/8 |
| 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 | 0.26 | 100,000 | 99,196 | 2026/5/27 |
| 三井金属鉱業 | 第24回特定社債間限定同順位特約付 | 1.113 | 100,000 | 98,401 | 2029/11/28 |
| 三菱マテリアル | 第36回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 100,000 | 96,757 | 2028/6/7 |
| 住友金属鉱山 | 第33回社債間限定同順位特約付 | 0.09 | 200,000 | 197,230 | 2026/9/15 |
| 住友金属鉱山 | 第35回社債間限定同順位特約付 | 0.394 | 100,000 | 97,145 | 2028/7/19 |
| 住友電気工業 | 第26回社債間限定同順位特約付 | 0.3 | 200,000 | 196,884 | 2027/3/1 |
| L I X I Lグループ | 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.35 | 100,000 | 93,824 | 2030/7/16 |

| 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 | |
| LIXILグループ 第16回社債間限定同順位特約付 | 0.704 | 100,000 | 92,654 | 2032/8/27 |
| YKK 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.355 | 100,000 | 97,386 | 2028/6/15 |
| 小松製作所 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.608 | 100,000 | 98,967 | 2027/7/16 |
| 住友重機械工業 第8回社債間限定同順位特約付 | 0.414 | 100,000 | 97,440 | 2028/7/19 |
| 日立建機 第20回社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 92,473 | 2031/3/18 |
| 荏原製作所 第13回社債間限定同順位特約付 | 1.468 | 100,000 | 95,352 | 2034/9/19 |
| ダイキン工業 第30回社債間限定同順位特約付 | 0.459 | 100,000 | 96,182 | 2029/7/27 |
| ダイキン工業 第32回社債間限定同順位特約付 | 1.005 | 100,000 | 97,214 | 2031/7/25 |
| タダノ 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 100,000 | 93,817 | 2029/12/13 |
| セガサミーホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 94,296 | 2029/10/10 |
| 日本精工 第59回社債間限定同順位特約付 | 1.527 | 100,000 | 95,606 | 2034/9/6 |
| ジェイテクト 第11回社債間限定同順位特約付 | 1.008 | 100,000 | 94,310 | 2033/9/2 |
| 日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付 | 1.371 | 200,000 | 200,636 | 2028/12/13 |
| 日立製作所 第23回社債間限定同順位特約付 | 1.184 | 100,000 | 95,154 | 2033/12/14 |
| 富士電機 第32回特定社債間限定同順位特約付 | 0.892 | 100,000 | 97,988 | 2029/6/6 |
| オムロン 第2回社債間限定同順位特約付 | 1.096 | 100,000 | 98,964 | 2030/1/28 |
| 日本電気 第63回社債間限定同順位特約付 | 0.84 | 100,000 | 92,160 | 2033/7/11 |
| セイコーエプソン 第15回社債間限定同順位特約付 | 0.34 | 100,000 | 98,926 | 2026/9/18 |
| パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 200,000 | 198,170 | 2026/9/18 |
| パナソニック 第22回社債間限定同順位特約付 | 0.29 | 200,000 | 194,872 | 2027/12/24 |
| パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付 | 0.39 | 200,000 | 186,592 | 2030/12/24 |
| パナソニック 第24回社債間限定同順位特約付 | 0.709 | 100,000 | 97,931 | 2028/9/14 |
| パナソニック 第26回社債間限定同順位特約付 | 1.342 | 100,000 | 96,107 | 2033/9/14 |
| パナソニック 第30回社債間限定同順位特約付 | 1.455 | 100,000 | 99,822 | 2030/2/28 |
| ソニー 第39回 | 0.35 | 100,000 | 98,701 | 2027/3/5 |
| ソニー 第40回 | 0.627 | 100,000 | 97,605 | 2029/3/7 |
| ソニー 第41回 | 1.001 | 100,000 | 94,111 | 2034/3/7 |
| TDK 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.43 | 100,000 | 94,301 | 2030/7/26 |
| 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 | 98,018 | 2027/6/7 |
| 三菱重工業 第35回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 100,000 | 98,143 | 2027/8/27 |
| 三菱重工業 第38回社債間限定同順位特約付(第2回グリーンボ) | 0.09 | 300,000 | 296,052 | 2026/9/1 |
| IHI 第50回社債間限定同順位特約付 | 0.62 | 100,000 | 91,369 | 2032/6/4 |
| JA三井リース 第14回社債間限定同順位特約付 | 0.3 | 100,000 | 95,011 | 2029/9/6 |
| JA三井リース 第31回社債間限定同順位特約付 | 0.89 | 100,000 | 97,555 | 2029/8/29 |
| いすゞ自動車 第31回社債間限定同順位特約付 | 0.27 | 100,000 | 97,387 | 2028/2/4 |
| いすゞ自動車 第32回社債間限定同順位特約付 | 0.11 | 100,000 | 98,588 | 2026/9/29 |
| トヨタ自動車 第27回社債間限定同順位特約付 | 0.219 | 300,000 | 279,732 | 2031/3/18 |
| SUBARU 第8回社債間限定同順位特約付 | 1.059 | 100,000 | 96,676 | 2030/11/29 |
| 楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付 | 0.42 | 100,000 | 96,026 | 2026/12/11 |
| 良品計画 第1回社債間限定同順位特約 | 0.75 | 100,000 | 97,885 | 2029/4/27 |
| トプコン 第6回特定社債間限定同順位特約付 | 0.485 | 100,000 | 93,237 | 2028/6/8 |
| オリンパス 第27回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 100,000 | 94,469 | 2030/7/19 |
| 凸版印刷 第9回社債間限定同順位特約付 | 0.73 | 100,000 | 86,979 | 2036/9/5 |
| 大日本印刷 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 100,000 | 95,455 | 2029/7/19 |
| 大日本印刷 第5回社債間限定同順位特約付 | 0.27 | 100,000 | 94,466 | 2030/3/8 |
| アシックス 第7回特定社債間限定同順位特約付 | 0.792 | 100,000 | 97,828 | 2028/12/14 |
| 伊藤忠商事 第80回社債間限定同順位特約付 | 1.088 | 100,000 | 94,941 | 2034/4/18 |
| 丸紅 第113回社債間限定同順位特約付 | 0.36 | 100,000 | 93,283 | 2031/4/18 |

| 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 | |
| 丸紅 第118回社債間限定同順位特約付 | 1.127 | 100,000 | 94,426 | 2034/4/25 |
| 丸紅 第119回社債間限定同順位特約付 | 0.93 | 100,000 | 97,307 | 2030/7/19 |
| 豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付 | 0.954 | 200,000 | 199,918 | 2026/7/10 |
| 三井物産 第64回社債間限定同順位特約付 | 2.36 | 100,000 | 102,714 | 2027/5/21 |
| 三井物産 第71回社債間限定同順位特約付 | 1.187 | 100,000 | 99,537 | 2029/7/13 |
| 三井物産 第73回社債間限定同順位特約付 | 0.29 | 100,000 | 95,828 | 2029/7/11 |
| 日本紙バルブ商事 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 100,000 | 94,003 | 2029/12/12 |
| 住友商事 第49回社債間限定同順位特約付 | 1.286 | 100,000 | 99,955 | 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 | 98,191 | 2027/7/26 |
| 住友商事 第61回社債間限定同順位特約付 | 0.644 | 100,000 | 98,465 | 2028/3/1 |
| 三菱商事 第80回担保提供制限等財務上特約無 | 1.485 | 100,000 | 100,989 | 2028/9/8 |
| 三菱商事 第83回担保提供制限等財務上特約無 | 1.054 | 100,000 | 94,459 | 2034/3/21 |
| 丸井グループ 第43回社債間限定同順位特約付 | 0.4 | 100,000 | 98,612 | 2027/1/22 |
| 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 | 98,118 | 2027/7/30 |
| クレディセゾン 第76回社債間限定同順位特約付 | 0.3 | 100,000 | 95,040 | 2029/7/31 |
| クレディセゾン 第99回社債間限定同順位特約付 | 0.629 | 100,000 | 97,094 | 2029/1/31 |
| クレディセゾン 第102回社債間限定同順位特約付 | 0.855 | 100,000 | 97,724 | 2029/4/27 |
| クレディセゾン 第103回社債間限定同順位特約付 | 1.006 | 100,000 | 97,384 | 2030/5/31 |
| イオン 第24回社債間限定同順位特約付 | 0.799 | 100,000 | 97,587 | 2028/8/17 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ 第7回劣後特約付 | 1.393 | 100,000 | 97,628 | 2030/6/18 |
| 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 | 102,864 | 2027/7/27 |
| 三菱東京UFJ銀行 第23回劣後特約付 | 2.91 | 100,000 | 104,836 | 2029/10/16 |
| 三菱東京UFJ銀行 第24回劣後特約付 | 2.27 | 100,000 | 101,810 | 2030/9/27 |
| 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 | 97,323 | 2030/5/29 |
| 三井住友信託銀行 第31回社債間限定同順位特約付 | 0.85 | 100,000 | 97,657 | 2029/10/11 |
| セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.39 | 300,000 | 293,349 | 2027/9/17 |
| みずほ銀行 第7回劣後特約付 | 2.87 | 100,000 | 102,295 | 2026/11/6 |
| 芙蓉総合リース 第30回社債間限定同順位特約付 | 0.36 | 100,000 | 92,618 | 2031/6/18 |
| 芙蓉総合リース 第40回社債間限定同順位特約付 | 0.707 | 100,000 | 97,420 | 2029/2/28 |
| 芙蓉総合リース 第41回社債間限定同順位特約付 | 0.831 | 100,000 | 97,746 | 2029/4/26 |
| みずほリース 第24回社債間限定同順位特約付 | 0.914 | 100,000 | 96,256 | 2031/2/28 |
| みずほリース 第25回社債間限定同順位特約付 | 0.893 | 100,000 | 97,981 | 2029/5/30 |
| みずほリース 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 200,000 | 195,090 | 2028/1/20 |
| みずほリース 第9回社債間限定同順位特約付 | 0.23 | 100,000 | 96,432 | 2028/9/1 |
| 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 | 98,619 | 2026/12/18 |
| NTTファイナンス 第17回日本電信電話保証付 | 0.28 | 200,000 | 195,248 | 2027/12/20 |
| NTTファイナンス 第18回日本電信電話保証付 | 0.38 | 800,000 | 754,600 | 2030/9/20 |
| NTTファイナンス 第25回社債間限定同順位特約付 | 0.648 | 300,000 | 288,006 | 2030/6/20 |
| NTTファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付 | 0.838 | 100,000 | 93,146 | 2033/6/20 |
| NTTファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付 | 1.213 | 100,000 | 95,717 | 2033/9/20 |
| NTTファイナンス 第32回社債間限定同順位特約付 | 0.967 | 100,000 | 98,387 | 2029/6/20 |
| NTTファイナンス 第33回社債間限定同順位特約付 | 1.112 | 100,000 | 97,667 | 2031/6/20 |
| NTTファイナンス 第34回社債間限定同順位特約付 | 1.476 | 100,000 | 194,468 | 2034/3/17 |
| 日産フィナンシャルサービス 第56回社債間限定同順位特約付 | 0.52 | 200,000 | 194,242 | 2026/6/19 |
| 東京センチュリー 第28回社債間限定同順位特約付 | 0.44 | 100,000 | 93,972 | 2030/10/22 |
| 東京センチュリー 第33回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 100,000 | 97,080 | 2028/4/27 |
| 東京センチュリー 第34回社債間限定同順位特約付 | 0.22 | 100,000 | 96,590 | 2028/7/21 |
| ホンダファイナンス 第69回社債間限定同順位特約付 | 0.09 | 200,000 | 197,766 | 2026/6/19 |

| 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 | |
| ホンダファイナンス | 第83回社債間限定同順位特約付 | 0.509 | 100,000 | 97,130 | 2028/9/20 |
| ホンダファイナンス | 第87回社債間限定同順位特約付 | 0.813 | 100,000 | 97,522 | 2029/6/6 |
| ホンダファイナンス | 第88回社債間限定同順位特約付 | 0.688 | 100,000 | 98,624 | 2027/9/17 |
| SBIホールディングス | 第26回社債間限定同順位特約付 | 0.8 | 200,000 | 198,104 | 2026/7/24 |
| SBIホールディングス | 第37回社債間限定同順位特約付 | 1.0 | 200,000 | 197,608 | 2027/3/5 |
| 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 | 97,833 | 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 | 98,060 | 2027/7/20 |
| イオンフィナンシャルサービス | 第17回社債間限定同順位特約付 | 0.34 | 100,000 | 98,818 | 2026/7/31 |
| イオンフィナンシャルサービス | 第21回社債間限定同順位特約付 | 0.8 | 200,000 | 196,196 | 2028/2/24 |
| アコム | 第78回特定社債間限定同順位特約付 | 0.38 | 100,000 | 98,919 | 2026/8/28 |
| オリエントコーポレーション | 第30回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 100,000 | 91,826 | 2031/7/18 |
| オリエントコーポレーション | 第32回社債間限定同順位特約付 | 0.55 | 200,000 | 182,788 | 2032/1/20 |
| 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 | 99,136 | 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 | 94,845 | 2029/10/19 |
| オリックス | 第189回社債間限定同順位特約付 | 0.445 | 100,000 | 98,738 | 2027/2/26 |
| オリックス | 第202回社債間限定同順位特約付 | 0.35 | 100,000 | 92,556 | 2031/4/21 |
| オリックス | 第220回社債間限定同順位特約付 | 0.723 | 100,000 | 97,814 | 2028/11/29 |
| 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 | 98,720 | 2026/10/16 |
| 三井住友ファイナンス&リース | 第42回社債間限定同順位特約付 | 0.564 | 100,000 | 98,878 | 2027/4/19 |
| 三井住友ファイナンス&リース | 第44回社債間限定同順位特約付 | 1.248 | 100,000 | 94,423 | 2034/4/19 |
| 三菱UFJリース | 第52回社債間限定同順位特約付 | 0.375 | 400,000 | 392,656 | 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 | 97,888 | 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 | 284,733 | 2030/1/23 |
| 大和証券グループ本社 | 第36回社債間限定同順位特約付 | 0.23 | 100,000 | 99,035 | 2026/6/2 |
| 大和証券グループ本社 | 第39回社債間限定同順位特約付 | 0.794 | 100,000 | 98,382 | 2028/2/24 |
| 三井住友海上火災保険 | 第7回社債間限定同順位特約付 | 0.19 | 100,000 | 98,510 | 2026/11/13 |
| NECキャピタルソリューション | 第19回社債間限定同順位特約付 | 0.18 | 100,000 | 98,794 | 2026/7/16 |
| 三井不動産 | 第60回社債間限定同順位特約付 | 0.305 | 100,000 | 97,228 | 2028/5/2 |
| 三井不動産 | 第71回社債間限定同順位特約付 | 0.31 | 200,000 | 188,864 | 2030/4/16 |
| 三井不動産 | 第77回社債間限定同順位特約付 | 0.48 | 100,000 | 95,227 | 2030/4/26 |
| 三井不動産 | 第83回社債間限定同順位特約付 | 0.81 | 300,000 | 279,618 | 2033/6/6 |
| 三井不動産 | 第84回社債間限定同順位特約付 | 1.057 | 100,000 | 94,653 | 2033/9/12 |
| 三菱地所 | 第93回担保提供制限等財務上特約無 | 2.555 | 200,000 | 208,354 | 2028/7/28 |
| 三菱地所 | 第120回担保提供制限等財務上特約無 | 0.24 | 100,000 | 98,094 | 2027/6/18 |
| 三菱地所 | 第128回社債間限定同順位特約付 | 1.132 | 100,000 | 50,010 | 2069/4/18 |
| 三菱地所 | 第129回担保提供制限等財務上特約無 | 0.17 | 100,000 | 98,903 | 2026/8/5 |
| 三菱地所 | 第135回担保提供制限等財務上特約無 | 0.26 | 100,000 | 92,570 | 2031/6/20 |
| 東京建物 | 第25回社債間限定同順位特約付 | 0.52 | 100,000 | 98,591 | 2027/3/19 |
| 東京建物 | 第34回社債間限定同順位特約付 | 0.88 | 100,000 | 91,998 | 2033/7/6 |
| ダイビル | 第19回特定社債間限定同順位特約付 | 0.96 | 100,000 | 80,196 | 2039/7/19 |
| 京阪神ビルディング | 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.86 | 100,000 | 86,080 | 2035/11/27 |
| 住友不動産 | 第109回社債間限定同順位特約付 | 0.31 | 200,000 | 185,740 | 2031/5/9 |
| イオンモール | 第22回社債間限定同順位特約付 | 0.4 | 100,000 | 94,614 | 2029/7/3 |
| イオンモール | 第23回社債間限定同順位特約付 | 0.9 | 100,000 | 77,738 | 2039/7/1 |
| イオンモール | 第29回社債間限定同順位特約付 | 0.47 | 100,000 | 90,483 | 2031/11/26 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 第15回社債間限定同順位特約付 | 1.25 | 100,000 | 100,016 | 2028/9/20 |
| 日本ビルファンド投資法人 | 第17回 | 0.888 | 100,000 | 82,122 | 2038/5/21 |
| 日本プライムリアルティ投資法人 | 第27回特定投資法人債間限定 | 0.42 | 100,000 | 91,144 | 2031/12/5 |

| 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 | |
| グローバル・ワン不動産投資法人 第9回 | 0.47 | 100,000 | 98,673 | 2026/10/16 |
| 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 | 2.9 | 100,000 | 104,373 | 2028/3/17 |
| 東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付 | 1.307 | 100,000 | 97,137 | 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 | 188,262 | 2031/4/22 |
| 東京急行電鉄 第85回社債間限定同順位特約付 | 0.761 | 100,000 | 86,814 | 2036/9/26 |
| 小田急電鉄 第68回社債間限定同順位特約付 | 1.098 | 200,000 | 196,756 | 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 | 85,579 | 2037/5/29 |
| 京王電鉄 第38回社債間限定同順位特約付 | 0.295 | 100,000 | 97,824 | 2027/11/29 |
| 京成電鉄 第63回社債間限定同順位特約付 | 0.798 | 100,000 | 92,798 | 2033/7/20 |
| 東日本旅客鉄道 第47回社債間限定同順位特約付 | 2.46 | 100,000 | 102,151 | 2026/9/18 |
| 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 | 208,320 | 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 | 102,775 | 2030/9/27 |
| 東日本旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付 | 2.098 | 100,000 | 103,874 | 2030/12/20 |
| 東日本旅客鉄道 第86回社債間限定同順位特約付 | 1.732 | 100,000 | 101,580 | 2032/7/23 |
| 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 | 92,974 | 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 | 83,533 | 2045/1/27 |
| 東日本旅客鉄道 第119回社債間限定同順位特約付 | 0.2 | 100,000 | 98,509 | 2027/1/27 |
| 東日本旅客鉄道 第132回社債間限定同順位特約付 | 1.011 | 100,000 | 70,042 | 2048/9/25 |
| 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 | 62,747 | 2058/9/27 |
| 東日本旅客鉄道 第139回社債間限定同順位特約付 | 0.997 | 100,000 | 57,101 | 2059/3/19 |
| 東日本旅客鉄道 第142回社債間限定同順位特約付 | 0.809 | 200,000 | 83,222 | 2069/7/23 |
| 東日本旅客鉄道 第144回社債間限定同順位特約付 | 0.606 | 200,000 | 121,926 | 2049/12/23 |
| 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 | 102,948 | 2059/12/23 |
| 東日本旅客鉄道 第147回社債間限定同順位特約付 | 0.265 | 100,000 | 94,712 | 2030/4/22 |
| 東日本旅客鉄道 第151回社債間限定同順位特約付 | 0.992 | 100,000 | 45,416 | 2070/4/22 |
| 東日本旅客鉄道 第153回社債間限定同順位特約付 | 0.23 | 100,000 | 94,205 | 2030/7/19 |
| 東日本旅客鉄道 第164回社債間限定同順位特約付 | 0.245 | 100,000 | 93,341 | 2031/4/15 |
| 東日本旅客鉄道 第165回社債間限定同順位特約付 | 0.596 | 100,000 | 77,194 | 2041/4/15 |
| 東日本旅客鉄道 第167回社債間限定同順位特約付 | 0.978 | 200,000 | 109,290 | 2061/4/15 |
| 東日本旅客鉄道 第192回社債間限定同順位特約付 | 1.816 | 100,000 | 70,895 | 2063/7/13 |
| 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 | 102,450 | 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 | 309,429 | 2027/12/20 |
| 西日本旅客鉄道 第53回社債間限定同順位特約付 | 1.263 | 100,000 | 63,318 | 2058/8/30 |
| 西日本旅客鉄道 第60回社債間限定同順位特約付 | 0.255 | 200,000 | 189,052 | 2030/5/21 |
| 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 | 188,198 | 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 | 157,882 | 2040/8/27 |
| 西日本旅客鉄道 第77回社債間限定同順位特約付 | 0.961 | 100,000 | 54,270 | 2061/4/22 |
| 東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付 | 2.212 | 200,000 | 208,312 | 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 | 98,406 | 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 | 279,528 | 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 | 87,477 | 2045/3/6 |
| 東京地下鉄 第22回 | 0.215 | 100,000 | 98,151 | 2027/6/21 |
| 東京地下鉄 第23回 | 0.661 | 100,000 | 85,569 | 2037/6/19 |
| 東京地下鉄 第24回 | 1.035 | 100,000 | 72,790 | 2047/6/21 |
| 東京地下鉄 第27回 | 1.065 | 100,000 | 72,543 | 2047/12/13 |
| 東京地下鉄 第34回 | 1.104 | 100,000 | 59,491 | 2059/1/31 |
| 東京地下鉄 第44回 | 1.087 | 100,000 | 47,547 | 2070/6/12 |
| 東京地下鉄 第49回 | 0.574 | 100,000 | 77,377 | 2041/1/22 |

| 銘柄 | 利 率 | 当 期 末 | | 償 還 年 月 日 |
|-----------------------------|-------|---------|---------|------------|
| | | 額 面 金 額 | 評 価 額 | |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | % | 千円 | 千円 | |
| 東京地下鉄 第56回 | 1.066 | 100,000 | 66,746 | 2052/2/28 |
| 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 | 186,468 | 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 | 95,469 | 2031/3/4 |
| 阪急阪神ホールディングス 第47回 | 1.202 | 400,000 | 397,656 | 2029/7/18 |
| 阪急阪神ホールディングス 第49回 | 0.817 | 100,000 | 86,970 | 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 | 99,539 | 2027/4/30 |
| 名古屋鉄道 第56回社債間限定同順位特約付 | 0.748 | 100,000 | 83,079 | 2038/5/25 |
| 日本通運 第11回社債間限定同順位特約付 | 0.2 | 100,000 | 99,032 | 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 | 86,453 | 2036/7/14 |
| 日立物流 第4回社債間限定同順位特約付 | 0.33 | 100,000 | 98,566 | 2026/9/28 |
| 日本郵船 第32回社債間限定同順位特約付 | 2.13 | 100,000 | 102,417 | 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 | 98,642 | 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 | 134,456 | 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 | 78,160 | 2039/12/9 |
| 日本航空 第12回社債間限定同順位特約付 | 1.2 | 100,000 | 93,700 | 2033/6/17 |
| 日本航空 第13回社債間限定同順位特約付 | 1.634 | 100,000 | 95,480 | 2034/5/23 |
| 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 | 83,754 | 2036/6/9 |
| KDDI 第25回社債間限定同順位特約付 | 0.395 | 100,000 | 96,770 | 2028/11/22 |
| KDDI 第32回社債間限定同順位特約付 | 0.648 | 100,000 | 98,973 | 2027/7/9 |
| KDDI 第33回社債間限定同順位特約付 | 0.893 | 100,000 | 98,147 | 2029/7/11 |
| KDDI 第36回社債間限定同順位特約付 | 0.768 | 200,000 | 199,202 | 2026/12/4 |
| KDDI 第39回社債間限定同順位特約付 | 1.397 | 100,000 | 96,360 | 2034/12/5 |
| ソフトバンク 第11回社債間限定同順位特約付 | 0.3 | 100,000 | 99,022 | 2026/6/3 |
| ソフトバンク 第12回社債間限定同順位特約付 | 0.42 | 200,000 | 192,956 | 2028/6/2 |
| ソフトバンク 第14回社債間限定同順位特約付 | 0.24 | 100,000 | 98,470 | 2026/10/9 |
| ソフトバンク 第16回社債間限定同順位特約付 | 0.52 | 100,000 | 90,542 | 2031/10/10 |
| ソフトバンク 第23回社債間限定同順位特約付 | 1.3 | 100,000 | 92,922 | 2033/7/12 |
| 電源開発 第50回社債間限定同順位特約付 | 0.415 | 100,000 | 98,416 | 2027/7/20 |
| 電源開発 第52回社債間限定同順位特約付 | 0.748 | 100,000 | 83,718 | 2037/9/18 |
| 電源開発 第55回社債間限定同順位特約付 | 0.375 | 100,000 | 97,474 | 2028/5/19 |
| 電源開発 第59回社債間限定同順位特約付 | 0.414 | 100,000 | 97,185 | 2028/9/20 |
| 電源開発 第60回社債間限定同順位特約付 | 0.804 | 100,000 | 82,505 | 2038/9/17 |
| 電源開発 第68回社債間限定同順位特約付 | 0.48 | 100,000 | 76,754 | 2039/9/20 |
| 電源開発 第73回社債間限定同順位特約付 | 0.31 | 200,000 | 185,624 | 2031/5/20 |
| 電源開発 第86回社債間限定同順位特約付 | 0.93 | 100,000 | 93,726 | 2033/5/20 |
| JERA 第3回無担保社債間限定同順位特約付 | 0.15 | 100,000 | 98,504 | 2026/11/25 |
| JERA 第17回無担保社債間限定同順位特約付 | 0.9 | 200,000 | 193,956 | 2030/4/25 |
| 東京瓦斯 第28回社債間限定同順位特約付 | 2.29 | 200,000 | 205,368 | 2027/6/15 |
| 東京瓦斯 第37回社債間限定同順位特約付 | 1.764 | 100,000 | 101,182 | 2033/9/26 |
| 東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付 | 1.984 | 100,000 | 93,352 | 2043/12/17 |
| 東京瓦斯 第54回社債間限定同順位特約付 | 0.53 | 100,000 | 46,770 | 2059/9/12 |
| 東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付 | 0.28 | 100,000 | 76,490 | 2039/9/13 |
| 東京瓦斯 第57回社債間限定同順位特約付 | 0.693 | 100,000 | 52,072 | 2057/12/25 |
| 東京瓦斯 第64回社債間限定同順位特約付 | 0.805 | 100,000 | 63,995 | 2050/9/9 |
| 大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付 | 0.642 | 100,000 | 63,120 | 2049/6/4 |
| 大阪瓦斯 第43回社債間限定同順位特約付 | 0.851 | 200,000 | 127,304 | 2051/6/2 |
| 大阪瓦斯 第51回社債間限定同順位特約付 | 0.785 | 100,000 | 93,876 | 2033/6/2 |
| 大阪瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付 | 2.371 | 100,000 | 89,884 | 2054/5/29 |

| 銘柄 | 当 期 末 | | |
|---------------------------------|-------|---------------|---------------|
| | 利 率 | 額 面 金 額 | 評 価 額 |
| | % | 千円 | 千円 |
| 普通社債券(含む投資法人債券) | | | |
| 東邦瓦斯 第44回社債間限定同順位特約付 | 0.835 | 100,000 | 77,538 |
| 北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付 | 0.51 | 100,000 | 87,422 |
| 広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付 | 0.405 | 100,000 | 96,834 |
| 西部ガスホールディングス 第21回社債間限定同順位特約付 | 1.215 | 100,000 | 95,494 |
| 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 | 97,633 |
| ファーストリテイリング 第8回特定社債間限定同順位特約付 | 0.88 | 100,000 | 84,698 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第31回円貨社債 | 0.423 | 100,000 | 94,655 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第41回円貨社債 | 0.82 | 100,000 | 99,271 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第42回円貨社債 | 1.203 | 300,000 | 296,595 |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第46回円貨社債 | 1.563 | 100,000 | 95,612 |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債 | 0.45 | 100,000 | 99,046 |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第25回非上位円貨社債 | 0.302 | 200,000 | 196,548 |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第36回円貨社債 | 0.895 | 100,000 | 99,284 |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第37回円貨社債 | 1.214 | 100,000 | 98,525 |
| 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 | 96,770 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第18回円貨社債(2022) | 0.979 | 100,000 | 98,752 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第22回円貨社債(2024) | 0.724 | 200,000 | 197,982 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第26回円貨社債(2024) | 1.049 | 100,000 | 97,687 |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第27回円貨社債(2025) | 1.202 | 100,000 | 99,455 |
| ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング 第4回円貨社債 | 0.808 | 100,000 | 99,299 |
| エイチエスビーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円 | 1.207 | 100,000 | 99,731 |
| 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 | 97,065 |
| 韓国輸出入銀行保証 大韓航空 第4回円貨社債(2025) | 1.16 | 100,000 | 99,527 |
| フランス電力 第4回円貨社債(2017) | 1.088 | 200,000 | 198,574 |
| フランス電力 第11回円貨社債(2024) | 1.423 | 100,000 | 98,157 |
| ビー・エヌ・ビー・パリバ 第8回円貨社債 | 1.01 | 200,000 | 196,186 |
| オーストラリア・ニュージーランド銀行 第12回円貨社債 | 0.793 | 200,000 | 198,398 |
| 小 計 | | 56,030,000 | 52,246,483 |
| 合 計 | | 1,247,212,200 | 1,157,692,853 |

*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2025年3月31日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|---------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| 公社債 | 1,157,692,853 | 98.9 |
| コール・ローン等、その他 | 13,418,468 | 1.1 |
| 投資信託財産総額 | 1,171,111,321 | 100.0 |

*金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年3月31日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 1,171,111,321,535 |
| コール・ローン等 | 5,920,974,586 |
| 公社債(評価額) | 1,157,692,853,301 |
| 未収入金 | 6,015,270,940 |
| 未収利息 | 1,402,997,901 |
| 前払費用 | 79,224,807 |
| (B) 負債 | 7,048,810,651 |
| 未払金 | 6,219,285,000 |
| 未払解約金 | 829,525,651 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,164,062,510,884 |
| 元本 | 969,940,740,128 |
| 次期繰越損益金 | 194,121,770,756 |
| (D) 受益権総口数 | 969,940,740,128口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 12,001円 |

(注) 期首元本額は907,131,616,808円、期中追加設定元本額は258,609,451,896円、期中一部解約元本額は195,800,328,576円、1口当たり純資産額は1,2001円です。

○損益の状況 (2024年4月2日～2025年3月31日)

| 項 目 | 当 期 |
|----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 9,285,357,170 |
| 受取利息 | 9,285,357,170 |
| (B) 有価証券売買損益 | △ 64,020,421,488 |
| 売買益 | 128,388,894 |
| 売買損 | △ 64,148,810,382 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △ 54,735,064,318 |
| (D) 前期繰越損益金 | 233,749,896,208 |
| (E) 追加信託差損益金 | 59,820,138,808 |
| (F) 解約差損益金 | △ 44,713,199,942 |
| (G) 計(C+D+E+F) | 194,121,770,756 |
| 次期繰越損益金(G) | 194,121,770,756 |

*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 |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信 | 155,709,760,940 |
| 野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け) | 124,621,153,427 |
| のむらっぴ・ファンド(普通型) | 109,374,348,823 |
| マイバランス50(確定拠出年金向け) | 74,958,681,472 |
| 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) | 49,959,753,015 |
| マイ・ロード | 49,258,408,502 |
| マイバランス30(確定拠出年金向け) | 47,785,818,518 |
| 野村世界6資産分散投信(安定コース) | 44,418,069,496 |
| マイバランス70(確定拠出年金向け) | 35,343,288,162 |
| のむらっぴ・ファンド(保守型) | 28,004,119,182 |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA・EW向け) | 27,214,752,411 |
| 野村世界6資産分散投信(分配コース) | 22,342,180,072 |
| マイバランスDC30 | 22,169,646,878 |
| マイバランスDC50 | 20,641,980,726 |
| のむらっぴ・ファンド(積極型) | 14,588,339,687 |
| 野村6資産均等バランス | 14,498,919,534 |
| マイターゲット2030(確定拠出年金向け) | 13,176,652,794 |
| 野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合 | 13,099,512,443 |
| ファンドラップ(ウェルス・スクエア)債券・安定型 | 11,211,353,333 |
| 野村世界6資産分散投信(成長コース) | 9,523,135,267 |
| マイバランスDC70 | 8,826,547,466 |
| 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) | 8,595,159,007 |
| みらいバランス・株式10(富士通企業年金基金DC向け) | 7,675,693,615 |

| ファンド名 | 当期末 元本額 |
|------------------------------------|---------------|
| | 円 |
| マイターゲット2040(確定拠出年金向け) | 6,144,108,254 |
| のむらっぴ・ファンド(やや保守型) | 5,850,063,120 |
| マイターゲット2035(確定拠出年金向け) | 5,619,602,775 |
| マイターゲット2050(確定拠出年金向け) | 4,447,219,091 |
| のむらっぴ・ファンド(やや積極型) | 4,364,679,468 |
| 野村日本債券インデックス(野村SMA向け) | 4,255,649,938 |
| 野村インデックス・バランス60VA(適格機関投資家専用) | 3,033,411,643 |
| マイターゲット2045(確定拠出年金向け) | 2,570,264,111 |
| 野村インデックスファンド・国内債券 | 2,204,743,284 |
| 野村世界6資産分散投信(配分変更コース) | 2,136,027,350 |
| マイターゲット2060(確定拠出年金向け) | 1,434,864,303 |
| 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 | 1,397,870,135 |
| マイターゲット2055(確定拠出年金向け) | 1,249,245,672 |
| 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) | 1,119,831,405 |
| 野村グローバル・インデックス・バランス75VA(適格機関投資家専用) | 1,119,632,345 |
| 多資産分散投資ファンド(バランス10)(確定拠出年金向け) | 995,317,370 |
| 野村DCバランスファンド(年金運用戦略タイプ) | 587,303,400 |
| マイターゲット2065(確定拠出年金向け) | 583,412,249 |
| 野村世界6資産分散投信(DC)安定コース | 578,961,662 |
| ノムラRIF用インデックスファンド・国内債券(適格機関投資家専用) | 563,779,609 |
| 野村日本債券インデックスファンド | 516,059,600 |
| 野村資産設計ファンド2025 | 448,095,998 |
| 野村資産設計ファンド(DC・つみたてNISA)2030 | 423,673,787 |

| ファンド名 | 当期末 |
|-------------------------------------|-------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2030 | 423,178,642 |
| 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) | 416,163,216 |
| 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) | 392,881,681 |
| 野村円債投資インデックスファンド | 380,130,252 |
| 野村資産設計ファンド2020 | 352,927,025 |
| 野村資産設計ファンド2015 | 324,288,167 |
| 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) | 318,090,137 |
| 野村資産設計ファンド2040 | 313,315,253 |
| 野村国内債券インデックスファンド | 293,090,853 |
| 野村資産設計ファンド2035 | 268,728,589 |
| 世界6資産分散ファンド | 259,638,773 |
| 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) | 257,874,826 |
| 野村オルタナティブ・マルチオープン投信 (適格機関投資家転売制限付) | 218,018,596 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2040 | 187,747,623 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) 成長コース | 144,582,871 |
| 野村世界6資産分散投信 (DC) インカムコース | 98,775,363 |
| 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) | 92,033,407 |
| 野村世界バランス25VA (適格機関投資家専用) | 78,226,249 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2050 | 65,753,316 |
| インデックス・ブレンド (タイプIII) | 53,847,018 |

| ファンド名 | 当期末 |
|---|------------|
| | 元本額 |
| | 円 |
| 野村資産設計ファンド2045 | 52,411,221 |
| 野村資産設計ファンド (DC・つみたてNISA) 2060 | 39,862,772 |
| 野村資産設計ファンド2050 | 36,763,774 |
| 野村世界インデックス・バランス40VA (適格機関投資家専用) | 35,711,637 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2026-2028年目標型 | 27,514,565 |
| インデックス・ブレンド (タイプI) | 27,411,380 |
| 野村資産設計ファンド2060 | 23,329,518 |
| マイターゲット2070 (確定拠出年金向け) | 19,874,409 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2029-2031年目標型 | 17,315,362 |
| インデックス・ブレンド (タイプII) | 11,668,880 |
| 野村PPIs用・ターゲット・リターン・資産バランス (2%コース向け) (適格機関投資家専用) | 11,168,102 |
| インデックス・ブレンド (タイプIV) | 11,077,934 |
| インデックス・ブレンド (タイプV) | 9,074,576 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2032-2034年目標型 | 8,571,538 |
| 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) | 8,153,955 |
| 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) | 7,293,504 |
| 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) | 7,185,996 |
| 野村ターゲットデットファンド2016 2035-2037年目標型 | 5,516,954 |
| 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) | 450,855 |

〇お知らせ

投資信託約款に規定している委託者が行なう公告を掲載する当社ホームページのアドレスを「<http://www.nomura-am.co.jp/>」から「<https://www.nomura-am.co.jp/>」に変更する所要の約款変更を行ないました。

＜変更適用日：2024年7月4日＞

NEXT FUNDS 外国債券・FTSE世界国債インデックス (除く日本・為替ヘッジあり)連動型上場投信

第16期 2025年9月7日決算
(計算期間:2025年3月8日～2025年9月7日)

■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／海外／債券／ETF／インデックス型 |
| 信 託 期 間 | 2017年12月7日以降、無期限とします。 |
| 運 用 方 針 | 外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券への投資を通じて、外国の公社債を実質的な主要投資対象とし、FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ヘッジ・円ベース)に連動する投資成果を目指します。 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。 |
| 主 な 投 資 対 象 | マザーファンド受益証券および外国の公社債を主要投資対象とします。なお、対象指数の動きに効率的に連動する投資成果を目指すため、債券先物取引等のデリバティブ取引および外国為替予約取引を利用することができます。 |
| 主 な 投 資 制 限 | 株式への直接投資は行ないません。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5%以内とします。 外貨建資産への投資は行ないません。 |
| 分 配 方 針 | 信託財産から生ずる配当等収益から経費を控除後、全額分配することを原則とします。ただし、分配金がゼロとなる場合もあります。また、売買益が生じても、分配は行ないません。 |

○損益の状況

(2025年3月8日～2025年9月7日)

| 項 | 目 | 当 | 期 |
|-----|--------------|-----------------|---|
| | | | 円 |
| (A) | 配当等収益 | 2,679,737,069 | |
| | 受取利息 | 2,670,612,079 | |
| | その他収益金 | 9,124,990 | |
| (B) | 有価証券売買損益 | △ 1,694,095,544 | |
| | 売買益 | 14,860,380,072 | |
| | 売買損 | △16,554,475,616 | |
| (C) | 信託報酬等 | △ 145,368,084 | |
| (D) | 当期損益金(A+B+C) | 840,273,441 | |
| (E) | 前期繰越損益金 | △50,801,542,718 | |
| (F) | 追加信託差損益金 | △12,297,538,200 | |
| (G) | 解約差損益金 | 2,473,486,400 | |
| (H) | 計(D+E+F+G) | △59,785,321,077 | |
| (I) | 収益分配金 | △ 2,518,536,000 | |
| | 次期繰越損益金(H+I) | △62,303,857,077 | |
| | 分配準備積立金 | 20,987,903 | |
| | 繰越損益金 | △62,324,844,980 | |

* 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。

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

○組入資産の明細

(2025年9月7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 | 608,300 | 575,011 | 85,245,456 | 45.6 | — | 21.5 | 16.2 | 7.9 | |
| カナダ | 千カナダドル 36,550 | 千カナダドル 35,069 | 3,762,957 | 2.0 | — | 1.2 | 0.6 | 0.2 | |
| イギリス | 千英ポンド 62,470 | 千英ポンド 52,445 | 10,453,381 | 5.6 | — | 4.3 | 0.8 | 0.5 | |
| スウェーデン | 千スウェーデンクローナ 17,900 | 千スウェーデンクローナ 17,448 | 273,592 | 0.1 | — | 0.1 | 0.0 | 0.0 | |
| ノルウェー | 千ノルウェークローネ 21,200 | 千ノルウェークローネ 19,781 | 290,984 | 0.2 | — | 0.1 | 0.1 | 0.0 | |
| デンマーク | 千デンマーククローネ 20,700 | 千デンマーククローネ 19,706 | 456,009 | 0.2 | — | 0.2 | 0.1 | 0.0 | |
| ユーロ | 千ユーロ | 千ユーロ | | | | | | | |
| ドイツ | 62,020 | 58,254 | 10,061,124 | 5.4 | — | 2.9 | 1.8 | 0.7 | |
| イタリア | 74,200 | 75,104 | 12,971,373 | 6.9 | — | 4.2 | 2.2 | 0.5 | |
| フランス | 87,340 | 81,276 | 14,037,204 | 7.5 | — | 4.3 | 3.2 | — | |
| オランダ | 14,750 | 13,561 | 2,342,147 | 1.3 | — | 0.8 | 0.4 | 0.1 | |
| スペイン | 49,570 | 48,503 | 8,377,034 | 4.5 | — | 2.6 | 1.8 | 0.1 | |
| ベルギー | 17,800 | 16,470 | 2,844,636 | 1.5 | — | 1.1 | 0.4 | — | |
| オーストリア | 14,280 | 12,399 | 2,141,575 | 1.1 | — | 0.6 | 0.3 | 0.2 | |
| フィンランド | 6,680 | 5,809 | 1,003,438 | 0.5 | — | 0.3 | 0.2 | — | |
| アイルランド | 5,420 | 4,782 | 825,940 | 0.4 | — | 0.2 | 0.2 | 0.0 | |
| ポルトガル | 6,500 | 6,430 | 1,110,682 | 0.6 | — | 0.4 | 0.2 | 0.1 | |
| ポーランド | 千ズロチ 32,400 | 千ズロチ 30,860 | 1,254,770 | 0.7 | — | 0.2 | 0.4 | 0.1 | |
| シンガポール | 千シンガポールドル 14,800 | 千シンガポールドル 15,513 | 1,784,407 | 1.0 | — | 0.7 | 0.2 | 0.1 | |
| 中国 | 千人民元 1,023,300 | 千人民元 1,052,611 | 21,845,899 | 11.7 | — | 4.9 | 4.6 | 2.2 | |
| オーストラリア | 千豪ドル 28,370 | 千豪ドル 25,647 | 2,480,597 | 1.3 | — | 0.9 | 0.3 | 0.1 | |
| ニュージーランド | 千ニュージーランドドル 6,400 | 千ニュージーランドドル 5,866 | 509,138 | 0.3 | — | 0.2 | 0.1 | — | |
| イスラエル | 千新シェケル 17,600 | 千新シェケル 15,907 | 703,258 | 0.4 | — | 0.2 | 0.1 | 0.1 | |
| メキシコ | 千メキシコペソ 212,200 | 千メキシコペソ 200,975 | 1,591,241 | 0.9 | — | 0.5 | 0.2 | 0.2 | |
| 合 計 | — | — | 186,366,853 | 99.6 | — | 52.4 | 34.2 | 13.1 | |

* 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 | | |
| アメリカ | | % | 千米ドル | 千米ドル | 千円 | | |
| | 国債証券 | US TREASURY BOND | 6.125 | 6,630 | 6,990 | 1,036,342 | 2027/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 5.25 | 19,500 | 20,481 | 3,036,322 | 2028/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 4.375 | 600 | 602 | 89,252 | 2038/2/15 |
| | | US TREASURY BOND | 2.875 | 1,900 | 1,464 | 217,109 | 2043/5/15 |
| | | US TREASURY BOND | 3.75 | 3,400 | 2,966 | 439,822 | 2043/11/15 |
| | | US TREASURY BOND | 4.75 | 900 | 898 | 133,148 | 2043/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.75 | 8,000 | 7,995 | 1,185,335 | 2026/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.5 | 9,600 | 9,570 | 1,418,848 | 2026/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 4.625 | 12,200 | 12,310 | 1,825,040 | 2026/10/15 |
| | | US TREASURY N/B | 1.625 | 9,500 | 9,271 | 1,374,430 | 2026/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 1.125 | 5,800 | 5,626 | 834,188 | 2026/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.125 | 5,900 | 5,922 | 877,955 | 2026/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.625 | 2,800 | 2,827 | 419,169 | 2026/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.25 | 2,000 | 2,011 | 298,208 | 2026/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 1.875 | 800 | 779 | 115,514 | 2027/2/28 |
| | | US TREASURY N/B | 4.25 | 2,000 | 2,016 | 298,995 | 2027/3/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 1,000 | 1,003 | 148,698 | 2027/3/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.5 | 2,400 | 2,431 | 360,407 | 2027/4/15 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 2,300 | 2,267 | 336,086 | 2027/4/30 |
| | | US TREASURY N/B | 2.375 | 2,700 | 2,644 | 392,066 | 2027/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.5 | 6,400 | 6,487 | 961,827 | 2027/5/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.5 | 1,200 | 1,137 | 168,650 | 2027/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.625 | 2,000 | 1,966 | 291,467 | 2027/5/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.625 | 1,900 | 1,932 | 286,455 | 2027/6/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.5 | 3,200 | 3,026 | 448,660 | 2027/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.25 | 2,500 | 2,483 | 368,250 | 2027/6/30 |
| | | US TREASURY N/B | 4.375 | 3,500 | 3,547 | 525,867 | 2027/7/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.375 | 2,400 | 2,259 | 334,903 | 2027/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.75 | 1,900 | 1,870 | 277,235 | 2027/7/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,650 | 1,608 | 238,458 | 2027/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 3.75 | 3,600 | 3,609 | 535,159 | 2027/8/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.5 | 1,100 | 1,035 | 153,497 | 2027/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.125 | 2,300 | 2,279 | 337,924 | 2027/8/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.375 | 1,800 | 1,792 | 265,802 | 2027/9/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.375 | 2,500 | 2,341 | 347,135 | 2027/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 4.125 | 1,300 | 1,313 | 194,776 | 2027/9/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 1,600 | 1,609 | 238,580 | 2027/10/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.5 | 600 | 562 | 83,322 | 2027/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 4.125 | 1,500 | 1,516 | 224,846 | 2027/10/31 |
| | | US TREASURY N/B | 2.25 | 2,800 | 2,722 | 403,571 | 2027/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 4.125 | 1,500 | 1,517 | 224,915 | 2027/11/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 3,000 | 2,812 | 416,927 | 2027/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 2,800 | 2,817 | 417,751 | 2027/11/30 |
| | | US TREASURY N/B | 4.0 | 1,300 | 1,312 | 194,565 | 2027/12/15 |
| | | US TREASURY N/B | 0.625 | 1,300 | 1,215 | 180,209 | 2027/12/31 |
| | | US TREASURY N/B | 3.875 | 2,200 | 2,214 | 328,373 | 2027/12/31 |

| 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 | 4.25 | 1,400 | 1,421 | 210,707 | 2028/1/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.75 | 2,300 | 2,152 | 319,058 | 2028/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 2,400 | 2,396 | 355,278 | 2028/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 3,710 | 3,640 | 539,662 | 2028/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 1,100 | 1,117 | 165,664 | 2028/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 2,100 | 2,121 | 314,578 | 2028/2/29 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 1,800 | 1,698 | 251,876 | 2028/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 4,000 | 3,769 | 558,763 | 2028/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 1,500 | 1,497 | 222,070 | 2028/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 5,100 | 5,011 | 742,902 | 2028/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 600 | 564 | 83,646 | 2028/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 3,300 | 3,305 | 490,094 | 2028/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 2,400 | 2,252 | 334,000 | 2028/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.0 | 100 | 93 | 13,790 | 2028/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 4,000 | 4,062 | 602,288 | 2028/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 5,230 | 5,131 | 760,749 | 2028/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 3,400 | 3,478 | 515,715 | 2028/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 2,500 | 2,333 | 345,948 | 2028/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 3,200 | 3,299 | 489,076 | 2028/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 3,200 | 2,993 | 443,777 | 2028/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.875 | 1,600 | 1,662 | 246,414 | 2028/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 4,200 | 4,144 | 614,477 | 2028/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 3,500 | 3,281 | 486,465 | 2028/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 400 | 409 | 60,754 | 2028/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 400 | 372 | 55,285 | 2028/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 1,400 | 1,407 | 208,733 | 2028/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 1,000 | 942 | 139,693 | 2029/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 2,000 | 2,027 | 300,576 | 2029/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 2,000 | 1,939 | 287,523 | 2029/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 2,100 | 1,984 | 294,183 | 2029/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 2,500 | 2,555 | 378,855 | 2029/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 4,300 | 4,128 | 612,063 | 2029/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 2,100 | 2,138 | 317,052 | 2029/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 3,000 | 2,928 | 434,100 | 2029/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 4,900 | 5,074 | 752,261 | 2029/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 4,000 | 3,835 | 568,538 | 2029/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 2,800 | 2,719 | 403,100 | 2029/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 3,800 | 3,920 | 581,218 | 2029/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.25 | 3,700 | 3,655 | 541,936 | 2029/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 3,000 | 3,070 | 455,130 | 2029/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 2.625 | 3,300 | 3,184 | 472,169 | 2029/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 1,700 | 1,725 | 255,751 | 2029/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 4,170 | 4,098 | 607,540 | 2029/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 4,400 | 4,405 | 653,077 | 2029/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 3,000 | 3,031 | 449,414 | 2029/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 300 | 298 | 44,312 | 2029/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 2,000 | 2,030 | 301,045 | 2029/10/31 |

| 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 | 4.125 | 400 | 407 | 60,479 | 2029/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 800 | 816 | 120,985 | 2029/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 1,800 | 1,818 | 269,627 | 2029/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 2,500 | 2,575 | 381,816 | 2029/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 1,800 | 1,845 | 273,641 | 2030/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.5 | 700 | 640 | 94,891 | 2030/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 4,000 | 4,063 | 602,427 | 2030/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 6.25 | 1,700 | 1,890 | 280,220 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 3,200 | 2,788 | 413,330 | 2030/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 4,800 | 4,823 | 715,074 | 2030/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 1,400 | 1,406 | 208,535 | 2030/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 2,800 | 2,843 | 421,545 | 2030/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.625 | 3,000 | 2,592 | 384,361 | 2030/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 1,200 | 1,225 | 181,656 | 2030/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 5,000 | 5,219 | 773,838 | 2030/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.875 | 2,500 | 2,640 | 391,400 | 2030/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 0.875 | 4,600 | 3,999 | 592,883 | 2030/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 4,200 | 4,337 | 643,056 | 2030/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 200 | 200 | 29,736 | 2030/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 200 | 202 | 30,087 | 2031/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 5.375 | 6,600 | 7,140 | 1,058,637 | 2031/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 2,500 | 2,567 | 380,607 | 2031/2/28 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 3,600 | 3,674 | 544,780 | 2031/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 2,600 | 2,718 | 403,028 | 2031/4/30 |
| | US TREASURY N/B | 1.625 | 4,100 | 3,661 | 542,816 | 2031/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 7,200 | 7,528 | 1,116,120 | 2031/5/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 2,300 | 2,360 | 349,918 | 2031/6/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 800 | 815 | 120,914 | 2031/7/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.25 | 4,400 | 3,816 | 565,793 | 2031/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.75 | 3,700 | 3,697 | 548,128 | 2031/8/31 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 700 | 694 | 102,950 | 2031/9/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 1,600 | 1,629 | 241,619 | 2031/10/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 6,200 | 5,377 | 797,272 | 2031/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 3,700 | 3,767 | 558,574 | 2031/11/30 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 1,900 | 1,973 | 292,606 | 2031/12/31 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 400 | 412 | 61,177 | 2032/1/31 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 6,600 | 5,870 | 870,247 | 2032/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 8,300 | 8,444 | 1,251,912 | 2032/2/29 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 800 | 813 | 120,622 | 2032/3/31 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 10,300 | 9,711 | 1,439,680 | 2032/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 4,400 | 4,101 | 608,014 | 2032/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 3,100 | 3,146 | 466,450 | 2032/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 4,200 | 4,087 | 605,940 | 2033/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 4,500 | 4,332 | 642,290 | 2033/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 4,800 | 4,771 | 707,374 | 2033/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 4,800 | 4,971 | 737,089 | 2033/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 4,500 | 4,495 | 666,447 | 2034/2/15 |

| 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 | 4.375 | 5,300 | 5,428 | 804,769 | 2034/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 5,000 | 4,925 | 730,232 | 2034/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 7,400 | 7,484 | 1,109,627 | 2034/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 4,500 | 4,676 | 693,236 | 2035/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 3,200 | 3,226 | 478,328 | 2035/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.5 | 800 | 726 | 107,698 | 2039/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 1,400 | 1,368 | 202,928 | 2039/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 200 | 199 | 29,637 | 2039/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 1,800 | 1,130 | 167,651 | 2040/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.125 | 300 | 186 | 27,636 | 2040/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.375 | 2,530 | 1,626 | 241,108 | 2040/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 100 | 101 | 15,057 | 2041/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 3,500 | 2,424 | 359,483 | 2041/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 3,400 | 2,483 | 368,251 | 2041/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.75 | 2,700 | 1,803 | 267,433 | 2041/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 1,000 | 821 | 121,767 | 2041/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 2,300 | 1,590 | 235,825 | 2041/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 800 | 653 | 96,918 | 2042/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 3,100 | 2,262 | 335,364 | 2042/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 1,450 | 1,158 | 171,760 | 2042/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.25 | 1,100 | 911 | 135,151 | 2042/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 1,500 | 1,148 | 170,290 | 2042/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 1,000 | 840 | 124,596 | 2042/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 2,600 | 1,980 | 293,619 | 2042/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 900 | 821 | 121,734 | 2042/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 2,500 | 2,008 | 297,802 | 2043/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 700 | 626 | 92,874 | 2043/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.875 | 1,400 | 1,250 | 185,372 | 2043/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 5,100 | 4,383 | 649,811 | 2043/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.375 | 1,100 | 1,048 | 155,373 | 2043/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 7,000 | 5,983 | 887,114 | 2044/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 1,000 | 965 | 143,182 | 2044/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 2,200 | 1,807 | 267,939 | 2044/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 1,200 | 1,175 | 174,321 | 2044/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 1,500 | 1,181 | 175,189 | 2044/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 1,900 | 1,739 | 257,875 | 2044/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 2,730 | 2,099 | 311,272 | 2044/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 2,000 | 1,955 | 289,863 | 2044/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 2,500 | 1,757 | 260,508 | 2045/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 900 | 893 | 132,445 | 2045/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 3,400 | 2,599 | 385,440 | 2045/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,400 | 1,044 | 154,851 | 2045/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 600 | 456 | 67,638 | 2045/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.5 | 750 | 518 | 76,940 | 2046/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 800 | 599 | 88,857 | 2047/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 1,420 | 1,060 | 157,277 | 2047/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.75 | 2,030 | 1,443 | 213,931 | 2047/8/15 |

| 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 | 3.0 | 740 | 548 | 81,284 | 2048/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.125 | 2,600 | 1,966 | 291,586 | 2048/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 600 | 442 | 65,590 | 2048/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.375 | 1,000 | 788 | 116,897 | 2048/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 2,600 | 1,907 | 282,854 | 2049/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 1,320 | 943 | 139,903 | 2049/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,340 | 836 | 123,965 | 2049/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 2,400 | 1,535 | 227,670 | 2049/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 1,500 | 875 | 129,854 | 2050/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,800 | 1,002 | 148,659 | 2051/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.375 | 2,700 | 1,697 | 251,657 | 2051/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.0 | 2,800 | 1,599 | 237,109 | 2051/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 1.875 | 1,700 | 936 | 138,869 | 2051/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.25 | 1,400 | 847 | 125,579 | 2052/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 2.875 | 2,800 | 1,952 | 289,524 | 2052/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.0 | 2,300 | 1,644 | 243,810 | 2052/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.0 | 1,300 | 1,127 | 167,128 | 2052/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 2,000 | 1,618 | 239,956 | 2053/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 3.625 | 3,000 | 2,425 | 359,535 | 2053/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.125 | 3,100 | 2,744 | 406,894 | 2053/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 1,900 | 1,866 | 276,679 | 2053/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 3,500 | 3,165 | 469,237 | 2054/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 4,200 | 4,042 | 599,373 | 2054/5/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.25 | 3,600 | 3,254 | 482,498 | 2054/8/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.5 | 5,900 | 5,565 | 825,064 | 2054/11/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.625 | 7,300 | 7,030 | 1,042,317 | 2055/2/15 |
| | US TREASURY N/B | 4.75 | 2,800 | 2,751 | 407,933 | 2055/5/15 |
| 小計 | | | | | 85,245,456 | |
| カナダ | | | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 1,500 | 1,510 | 162,126 | 2026/11/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.0 | 600 | 603 | 64,728 | 2027/2/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 1,000 | 980 | 105,174 | 2027/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.0 | 500 | 486 | 52,190 | 2027/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 700 | 701 | 75,295 | 2027/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 500 | 491 | 52,723 | 2028/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 1,400 | 1,421 | 152,532 | 2028/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 1,700 | 1,770 | 189,999 | 2029/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 600 | 663 | 71,167 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.25 | 1,100 | 1,081 | 115,998 | 2029/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 600 | 615 | 66,093 | 2029/9/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 2,300 | 2,291 | 245,831 | 2030/3/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.25 | 1,650 | 1,532 | 164,421 | 2030/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 0.5 | 1,500 | 1,324 | 142,124 | 2030/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 3,600 | 3,319 | 356,225 | 2031/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.5 | 1,600 | 1,460 | 156,743 | 2031/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 1,200 | 1,120 | 120,252 | 2032/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.5 | 620 | 594 | 63,800 | 2032/12/1 |

| 銘柄 | 当期末 | | | | | 償還年月日 |
|------|---------------------|-------|--------|--------|-----------|------------|
| | 利率 | 額面金額 | 評価額 | | 千円 | |
| | | | 外貨建金額 | 邦貨換算金額 | | |
| カナダ | | % | 千カナダドル | 千カナダドル | | |
| 国債証券 | CANADIAN GOVERNMENT | 5.75 | 2,770 | 3,251 | 348,899 | 2033/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 1,400 | 1,402 | 150,521 | 2033/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.0 | 1,700 | 1,665 | 178,721 | 2034/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 400 | 398 | 42,710 | 2034/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.25 | 1,000 | 992 | 106,451 | 2035/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 5.0 | 100 | 114 | 12,312 | 2037/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 4.0 | 500 | 523 | 56,194 | 2041/6/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 3.5 | 1,430 | 1,390 | 149,205 | 2045/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 880 | 743 | 79,764 | 2048/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.0 | 800 | 561 | 60,243 | 2051/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 1.75 | 1,800 | 1,162 | 124,738 | 2053/12/1 |
| | CANADIAN GOVERNMENT | 2.75 | 1,100 | 892 | 95,768 | 2055/12/1 |
| 小計 | | | | | 3,762,957 | |
| イギリス | | | 千英ポンド | 千英ポンド | | |
| 国債証券 | UK TREASURY | 6.0 | 100 | 106 | 21,244 | 2028/12/7 |
| | UK TREASURY | 0.5 | 500 | 446 | 89,023 | 2029/1/31 |
| | UK TREASURY | 0.875 | 200 | 177 | 35,284 | 2029/10/22 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 1,400 | 1,444 | 287,904 | 2030/12/7 |
| | UK TREASURY | 0.25 | 1,200 | 959 | 191,186 | 2031/7/31 |
| | UK TREASURY | 1.0 | 2,000 | 1,635 | 325,904 | 2032/1/31 |
| | UK TREASURY | 3.25 | 4,800 | 4,434 | 883,890 | 2033/1/31 |
| | UK TREASURY | 0.875 | 3,000 | 2,281 | 454,726 | 2033/7/31 |
| | UK TREASURY | 0.625 | 300 | 203 | 40,514 | 2035/7/31 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 800 | 762 | 151,965 | 2036/3/7 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 350 | 249 | 49,803 | 2037/9/7 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 1,030 | 909 | 181,300 | 2038/1/29 |
| | UK TREASURY | 4.75 | 400 | 389 | 77,543 | 2038/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.125 | 700 | 435 | 86,889 | 2039/1/31 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 1,000 | 913 | 182,138 | 2039/9/7 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 1,320 | 1,185 | 236,280 | 2040/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.25 | 800 | 456 | 90,957 | 2041/10/22 |
| | UK TREASURY | 4.5 | 1,400 | 1,269 | 253,104 | 2042/12/7 |
| | UK TREASURY | 3.5 | 400 | 307 | 61,254 | 2045/1/22 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 520 | 439 | 87,633 | 2046/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.5 | 540 | 267 | 53,321 | 2047/7/22 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 500 | 254 | 50,732 | 2049/1/22 |
| | UK TREASURY | 4.25 | 1,510 | 1,253 | 249,858 | 2049/12/7 |
| | UK TREASURY | 1.25 | 2,000 | 824 | 164,249 | 2051/7/31 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 1,000 | 748 | 149,245 | 2052/7/22 |
| | UK TREASURY | 1.5 | 1,400 | 599 | 119,394 | 2053/7/31 |
| | UK TREASURY | 3.75 | 600 | 444 | 88,580 | 2053/10/22 |
| | UK TREASURY | 1.625 | 450 | 196 | 39,178 | 2054/10/22 |
| | UK TREASURY | 1.75 | 700 | 306 | 61,027 | 2057/7/22 |
| | UK TREASURY | 4.0 | 500 | 381 | 76,010 | 2060/1/22 |
| | UK TREASURY | 4.0 | 1,200 | 905 | 180,555 | 2063/10/22 |
| | UK TREASURY | 2.5 | 700 | 365 | 72,790 | 2065/7/22 |
| | UK TREASURY | 3.5 | 500 | 338 | 67,549 | 2068/7/22 |

| 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 | | |
| イギリス | | % | 千英ポンド | 千英ポンド | 千円 | |
| 国債証券 | UK TSY 0 1/2% 2061 | 0.5 | 500 | 122 | 24,366 | 2061/10/22 |
| | UK TSY 0 5/8% 2050 | 0.625 | 900 | 311 | 62,078 | 2050/10/22 |
| | UK TSY 3 1/4% 2044 | 3.25 | 700 | 523 | 104,433 | 2044/1/22 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.125 | 3,100 | 3,106 | 619,279 | 2027/1/29 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 3.75 | 1,800 | 1,794 | 357,732 | 2027/3/7 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.375 | 2,200 | 2,220 | 442,491 | 2028/3/7 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.5 | 1,300 | 1,317 | 262,680 | 2028/6/7 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.125 | 2,200 | 2,205 | 439,688 | 2029/7/22 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.375 | 600 | 606 | 120,832 | 2030/3/7 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.0 | 4,400 | 4,329 | 862,965 | 2031/10/22 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.625 | 1,200 | 1,202 | 239,692 | 2034/1/31 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.25 | 700 | 679 | 135,413 | 2034/7/31 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.5 | 500 | 491 | 97,901 | 2035/3/7 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.375 | 2,300 | 2,114 | 421,440 | 2040/1/31 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.75 | 3,900 | 3,603 | 718,312 | 2043/10/22 |
| | UNITED KINGDOM GILT | 4.375 | 1,200 | 992 | 197,817 | 2054/7/31 |
| | UNITED KINGDOM (GOVERNMENT) | 4.25 | 1,150 | 929 | 185,208 | 2055/12/7 |
| 小計 | | | | | 10,453,381 | |
| 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 | 1.0 | 2,100 | 2,078 | 32,595 | 2026/11/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 2,800 | 2,720 | 42,660 | 2028/5/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.75 | 2,200 | 2,092 | 32,812 | 2029/11/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 0.125 | 2,000 | 1,787 | 28,031 | 2031/5/12 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.25 | 1,500 | 1,501 | 23,542 | 2032/6/1 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 1.75 | 4,200 | 3,999 | 62,714 | 2033/11/11 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 2.25 | 1,000 | 977 | 15,322 | 2035/5/11 |
| | SWEDISH GOVERNMENT | 3.5 | 2,100 | 2,290 | 35,912 | 2039/3/30 |
| 小計 | | | | | 273,592 | |
| 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 | 1.75 | 1,500 | 1,460 | 21,484 | 2027/2/17 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 2.0 | 3,000 | 2,876 | 42,312 | 2028/4/26 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.75 | 5,800 | 5,377 | 79,105 | 2029/9/6 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.375 | 700 | 625 | 9,196 | 2030/8/19 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 1.25 | 2,000 | 1,727 | 25,408 | 2031/9/17 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.0 | 4,200 | 3,945 | 58,045 | 2033/8/15 |
| | NORWEGIAN GOVERNMENT | 3.5 | 4,000 | 3,768 | 55,431 | 2042/10/6 |
| 小計 | | | | | 290,984 | |
| 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 | DENMARK GOVT BOND | 2.25 | 2,000 | 1,937 | 44,831 | 2035/11/15 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 2.25 | 2,500 | 2,519 | 58,297 | 2026/11/15 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 2,100 | 2,047 | 47,379 | 2027/11/15 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.5 | 3,000 | 2,821 | 65,289 | 2029/11/15 |
| | KINGDOM OF DENMARK | — | 1,600 | 1,399 | 32,395 | 2031/11/15 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 2.25 | 2,100 | 2,080 | 48,153 | 2033/11/15 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 4.5 | 4,500 | 5,436 | 125,795 | 2039/11/15 |
| | KINGDOM OF DENMARK | 0.25 | 2,900 | 1,463 | 33,867 | 2052/11/15 |
| 小計 | | | | | 456,009 | |

| 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 | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESobligation | — | 200 | 193 | 33,497 | 2027/4/16 |
| | | BUNDESobligation | 1.3 | 100 | 98 | 17,052 | 2027/10/15 |
| | | BUNDESobligation | 2.2 | 1,000 | 1,005 | 173,694 | 2028/4/13 |
| | | BUNDESobligation | 2.1 | 3,200 | 3,198 | 552,478 | 2029/4/12 |
| | | BUNDESobligation | 2.1 | 100 | 99 | 17,268 | 2029/4/12 |
| | | BUNDESobligation | 2.5 | 900 | 911 | 157,434 | 2029/10/11 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.5 | 3,500 | 3,782 | 653,194 | 2027/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 500 | 479 | 82,814 | 2027/11/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.625 | 900 | 974 | 168,223 | 2028/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.5 | 1,500 | 1,449 | 250,308 | 2028/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 1,000 | 1,074 | 185,575 | 2028/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25 | 800 | 760 | 131,325 | 2028/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,800 | 1,689 | 291,709 | 2028/11/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 0.25 | 1,100 | 1,034 | 178,709 | 2029/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,100 | 1,013 | 174,982 | 2029/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.1 | 900 | 897 | 154,947 | 2029/11/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 6.25 | 700 | 816 | 141,013 | 2030/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,300 | 1,181 | 204,053 | 2030/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,700 | 1,526 | 263,582 | 2030/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 950 | 852 | 147,317 | 2030/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.4 | 1,000 | 1,005 | 173,720 | 2030/11/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 5.5 | 1,000 | 1,158 | 200,084 | 2031/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 300 | 265 | 45,867 | 2031/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 100 | 87 | 15,071 | 2031/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 400 | 343 | 59,345 | 2032/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.7 | 2,200 | 2,098 | 362,460 | 2032/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.3 | 500 | 493 | 85,192 | 2033/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6 | 2,700 | 2,709 | 468,019 | 2033/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.2 | 1,000 | 970 | 167,535 | 2034/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 1,000 | 1,168 | 201,782 | 2034/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6 | 1,000 | 996 | 172,181 | 2034/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 2,000 | 1,970 | 340,266 | 2035/2/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 1,000 | 770 | 133,081 | 2035/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6 | 400 | 395 | 68,333 | 2035/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 2,400 | 1,780 | 307,553 | 2036/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.0 | 2,350 | 2,615 | 451,737 | 2037/1/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.0 | 1,300 | 1,031 | 178,221 | 2038/5/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.25 | 1,100 | 1,256 | 216,924 | 2039/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 4.75 | 500 | 601 | 103,848 | 2040/7/4 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.6 | 400 | 374 | 64,735 | 2041/5/15 |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 3.25 | 400 | 406 | 70,212 | 2042/7/4 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 1,670 | 1,511 | 260,969 | 2044/7/4 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 2,100 | 1,871 | 323,150 | 2046/8/15 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.25 | 500 | 338 | 58,495 | 2048/8/15 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 700 | 311 | 53,833 | 2050/8/15 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | — | 900 | 375 | 64,891 | 2052/8/15 | | |
| BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.8 | 3,350 | 2,433 | 420,244 | 2053/8/15 | | |

| 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 | |
| ドイツ | 国債証券 | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 1.8 | 1,200 | 873 | 150,854 | 2053/8/15 |
| | | BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND | 2.5 | 2,000 | 1,696 | 292,978 | 2054/8/15 |
| | | BUNDESSCHATZANWEISUNGEN | 2.0 | 3,300 | 3,302 | 570,347 | 2026/12/10 |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95 | 3,400 | 3,439 | 593,966 | 2027/2/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.1 | 100 | 98 | 17,000 | 2027/4/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45 | 1,700 | 1,738 | 300,330 | 2027/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7 | 900 | 908 | 156,977 | 2027/10/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.5 | 800 | 872 | 150,658 | 2027/11/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.65 | 700 | 706 | 122,045 | 2027/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.25 | 1,500 | 1,428 | 246,681 | 2028/3/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.4 | 1,000 | 1,022 | 176,613 | 2028/4/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.5 | 500 | 475 | 82,132 | 2028/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 400 | 427 | 73,850 | 2028/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8 | 160 | 162 | 28,039 | 2028/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.1 | 4,800 | 5,055 | 873,111 | 2029/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.45 | 1,300 | 1,216 | 210,030 | 2029/2/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.8 | 1,100 | 1,111 | 192,032 | 2029/6/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.35 | 2,100 | 2,160 | 373,209 | 2029/7/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.0 | 780 | 794 | 137,259 | 2029/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.0 | 4,600 | 4,671 | 806,780 | 2029/10/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 900 | 944 | 163,102 | 2029/12/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.35 | 600 | 567 | 97,999 | 2030/4/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.7 | 1,000 | 1,043 | 180,136 | 2030/6/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95 | 400 | 403 | 69,719 | 2030/7/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95 | 200 | 184 | 31,785 | 2030/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 800 | 845 | 146,029 | 2030/11/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65 | 900 | 850 | 146,905 | 2030/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.5 | 2,900 | 2,992 | 516,786 | 2031/2/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 6.0 | 300 | 349 | 60,362 | 2031/5/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45 | 2,500 | 2,568 | 443,519 | 2031/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 1,200 | 1,272 | 219,749 | 2031/10/30 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.15 | 1,700 | 1,714 | 296,073 | 2031/11/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95 | 500 | 442 | 76,467 | 2031/12/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.65 | 1,200 | 1,104 | 190,837 | 2032/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 1,500 | 1,511 | 261,085 | 2032/7/15 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.5 | 600 | 575 | 99,366 | 2032/12/1 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.75 | 3,300 | 3,854 | 665,693 | 2033/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.4 | 600 | 647 | 111,874 | 2033/5/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.35 | 1,400 | 1,504 | 259,759 | 2033/11/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.2 | 1,000 | 1,062 | 183,469 | 2034/3/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 1,000 | 1,034 | 178,633 | 2034/7/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 1,400 | 1,573 | 271,703 | 2034/8/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 500 | 514 | 88,928 | 2035/2/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.35 | 1,050 | 1,042 | 180,021 | 2035/3/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 300 | 314 | 54,310 | 2035/4/30 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.65 | 100 | 100 | 17,422 | 2035/8/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.6 | 1,000 | 1,001 | 173,038 | 2035/10/1 | | |

| 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 | | |
| イタリア | 国債証券 | BUONI POLIENNALI DEL TES | 1.45 | 700 | 569 | 98,373 | 2036/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.25 | 1,060 | 928 | 160,426 | 2036/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.0 | 480 | 495 | 85,537 | 2037/2/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 0.95 | 1,100 | 818 | 141,440 | 2037/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.05 | 600 | 617 | 106,672 | 2037/10/30 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 2,300 | 2,173 | 375,385 | 2038/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.95 | 300 | 270 | 46,756 | 2038/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 720 | 805 | 139,161 | 2039/8/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.15 | 1,000 | 1,023 | 176,699 | 2039/10/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.1 | 1,000 | 907 | 156,665 | 2040/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 5.0 | 800 | 893 | 154,292 | 2040/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.45 | 1,500 | 1,552 | 268,132 | 2043/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.75 | 2,100 | 2,261 | 390,618 | 2044/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.1 | 1,100 | 1,083 | 187,207 | 2046/4/30 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.25 | 570 | 490 | 84,800 | 2046/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.7 | 180 | 140 | 24,347 | 2047/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.45 | 900 | 780 | 134,765 | 2048/3/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 3.85 | 500 | 464 | 80,215 | 2049/9/1 |
| | | BUONI POLIENNALI DEL TES | 2.45 | 300 | 213 | 36,839 | 2050/9/1 |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.5 | 2,200 | 2,205 | 380,873 | 2053/10/1 | | |
| BUONI POLIENNALI DEL TES | 4.3 | 100 | 96 | 16,659 | 2054/10/1 | | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 4,900 | 4,936 | 852,541 | 2027/9/24 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 2,400 | 2,316 | 400,162 | 2028/2/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 1,700 | 1,633 | 282,068 | 2028/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.4 | 300 | 300 | 51,890 | 2028/9/24 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 4,400 | 4,160 | 718,584 | 2028/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.75 | 6,500 | 6,563 | 1,133,504 | 2029/2/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 3,000 | 2,789 | 481,757 | 2029/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 100 | 90 | 15,550 | 2029/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.75 | 3,200 | 3,213 | 554,937 | 2030/2/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 3,100 | 3,092 | 534,169 | 2030/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 1,400 | 1,213 | 209,562 | 2030/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 1,300 | 1,086 | 187,701 | 2031/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | — | 900 | 735 | 127,079 | 2032/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.0 | 2,100 | 1,945 | 336,033 | 2032/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 3.0 | 6,900 | 6,788 | 1,172,512 | 2033/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 3.5 | 6,600 | 6,684 | 1,154,476 | 2033/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 3,900 | 3,284 | 567,254 | 2034/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 3.0 | 500 | 482 | 83,246 | 2034/11/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 3.2 | 1,500 | 1,460 | 252,173 | 2035/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 1,300 | 1,028 | 177,665 | 2036/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.25 | 600 | 446 | 77,087 | 2038/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 1.75 | 600 | 465 | 80,393 | 2039/6/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.5 | 1,400 | 866 | 149,573 | 2040/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 2.5 | 1,200 | 960 | 165,884 | 2043/5/25 |
| FRANCE (GOVT OF) | 2.0 | 1,200 | 811 | 140,123 | 2048/5/25 | | |
| FRANCE (GOVT OF) | 1.5 | 1,100 | 634 | 109,638 | 2050/5/25 | | |

| 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 | |
| フランス | 国債証券 | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 1,100 | 482 | 83,382 | 2052/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 0.75 | 800 | 340 | 58,776 | 2053/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 3.0 | 3,400 | 2,642 | 456,317 | 2054/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 3.25 | 700 | 564 | 97,455 | 2055/5/25 |
| | | FRANCE (GOVT OF) | 3.75 | 300 | 268 | 46,408 | 2056/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 2.75 | 2,900 | 2,935 | 507,044 | 2027/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.5 | 2,000 | 2,220 | 383,519 | 2029/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 1.5 | 2,200 | 2,045 | 353,353 | 2031/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 5.75 | 740 | 864 | 149,359 | 2032/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.75 | 2,500 | 2,762 | 477,029 | 2035/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 1,000 | 1,022 | 176,544 | 2038/10/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.5 | 1,800 | 1,907 | 329,375 | 2041/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 3.25 | 3,600 | 3,181 | 549,488 | 2045/5/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 2,000 | 1,864 | 321,965 | 2055/4/25 |
| | | FRANCE GOVERNMENT O.A.T | 4.0 | 200 | 183 | 31,612 | 2060/4/25 |
| オランダ | 国債証券 | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 1,200 | 1,176 | 203,272 | 2027/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 5.5 | 850 | 915 | 158,166 | 2028/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.75 | 800 | 770 | 133,007 | 2028/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 800 | 744 | 128,648 | 2029/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.25 | 800 | 742 | 128,153 | 2029/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 500 | 501 | 86,691 | 2030/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 600 | 535 | 92,515 | 2030/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 200 | 173 | 29,915 | 2031/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 600 | 521 | 90,120 | 2032/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 1,000 | 990 | 171,119 | 2033/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 800 | 788 | 136,095 | 2033/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.5 | 1,300 | 1,268 | 219,111 | 2034/7/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 4.0 | 600 | 656 | 113,338 | 2037/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 300 | 204 | 35,310 | 2038/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 0.5 | 300 | 207 | 35,866 | 2040/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.75 | 950 | 1,006 | 173,892 | 2042/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 3.25 | 300 | 297 | 51,294 | 2044/1/15 |
| | | NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.75 | 750 | 678 | 117,146 | 2047/1/15 |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | — | 500 | 204 | 35,372 | 2052/1/15 | | |
| NETHERLANDS GOVERNMENT | 2.0 | 1,600 | 1,176 | 203,106 | 2054/1/15 | | |
| スペイン | 国債証券 | BONOS Y OBLIG DE | 0.5 | 1,100 | 961 | 165,997 | 2031/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8 | 900 | 878 | 151,753 | 2027/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45 | 1,500 | 1,481 | 255,787 | 2027/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 1,000 | 980 | 169,411 | 2028/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.4 | 700 | 702 | 121,332 | 2028/5/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.4 | 2,000 | 1,952 | 337,233 | 2028/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 3,200 | 3,476 | 600,339 | 2028/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.45 | 1,200 | 1,162 | 200,813 | 2029/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.5 | 3,300 | 3,429 | 592,333 | 2029/5/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.8 | 2,600 | 2,440 | 421,497 | 2029/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.6 | 900 | 835 | 144,267 | 2029/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.5 | 1,250 | 1,140 | 196,982 | 2030/4/30 |

| 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 | 1.95 | 300 | 291 | 50,397 | 2030/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.25 | 1,000 | 933 | 161,285 | 2030/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.1 | 100 | 86 | 14,944 | 2031/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.55 | 800 | 781 | 134,997 | 2032/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.15 | 2,800 | 2,829 | 488,665 | 2033/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.35 | 1,700 | 1,621 | 280,109 | 2033/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.55 | 700 | 724 | 125,069 | 2033/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.25 | 5,000 | 5,042 | 870,832 | 2034/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45 | 300 | 306 | 52,849 | 2034/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.15 | 300 | 297 | 51,379 | 2035/4/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.85 | 200 | 176 | 30,484 | 2035/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 0.85 | 500 | 371 | 64,207 | 2037/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.9 | 1,600 | 1,638 | 282,937 | 2039/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.9 | 400 | 452 | 78,236 | 2040/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.2 | 500 | 353 | 61,101 | 2040/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.7 | 610 | 676 | 116,787 | 2041/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0 | 200 | 130 | 22,483 | 2042/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 3.45 | 1,000 | 941 | 162,619 | 2043/7/30 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 5.15 | 570 | 664 | 114,801 | 2044/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.9 | 600 | 509 | 88,061 | 2046/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 2.7 | 1,050 | 844 | 145,820 | 2048/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.0 | 1,000 | 525 | 90,702 | 2050/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 1.9 | 1,100 | 704 | 121,639 | 2052/10/31 |
| | | BONOS Y OBLIG DEL ESTADO | 4.0 | 1,400 | 1,351 | 233,424 | 2054/10/31 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 6.0 | 1,040 | 1,164 | 201,202 | 2029/1/31 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 5.75 | 1,150 | 1,356 | 234,248 | 2032/7/30 |
| | | SPANISH GOVERNMENT | 4.2 | 4,000 | 4,284 | 739,993 | 2037/1/31 |
| ベルギー | 国債証券 | BELGIUM KINGDOM | — | 200 | 191 | 33,101 | 2027/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.9 | 2,500 | 2,367 | 408,804 | 2029/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.1 | 400 | 356 | 61,540 | 2030/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.0 | 100 | 90 | 15,709 | 2031/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | — | 400 | 339 | 58,707 | 2031/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.0 | 500 | 534 | 92,261 | 2032/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.35 | 700 | 591 | 102,206 | 2032/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.25 | 450 | 398 | 68,797 | 2033/4/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.0 | 1,500 | 1,498 | 258,805 | 2033/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.0 | 1,000 | 989 | 170,810 | 2034/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.85 | 500 | 485 | 83,911 | 2034/10/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.45 | 800 | 642 | 110,907 | 2037/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.9 | 800 | 662 | 114,347 | 2038/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 0.4 | 200 | 126 | 21,778 | 2040/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 4.25 | 1,600 | 1,684 | 290,981 | 2041/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.45 | 300 | 283 | 48,952 | 2042/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.75 | 900 | 873 | 150,917 | 2045/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.6 | 100 | 64 | 11,172 | 2047/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.7 | 1,000 | 623 | 107,598 | 2050/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 1.4 | 700 | 379 | 65,598 | 2053/6/22 |

| 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 | 3.3 | 100 | 84 | 14,578 | 2054/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 3.5 | 300 | 260 | 45,056 | 2055/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM | 2.25 | 200 | 129 | 22,386 | 2057/6/22 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.5 | 1,700 | 1,837 | 317,418 | 2028/3/28 |
| | | BELGIUM KINGDOM GOVT | 5.0 | 850 | 974 | 168,283 | 2035/3/28 |
| オーストリア | 国債証券 | REPUBLIC OF AUSTRIA | 6.25 | 2,000 | 2,152 | 371,698 | 2027/7/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 600 | 580 | 100,330 | 2028/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.5 | 1,100 | 1,036 | 179,038 | 2029/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9 | 700 | 715 | 123,593 | 2029/5/23 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.5 | 300 | 301 | 52,129 | 2029/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 700 | 629 | 108,722 | 2030/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.45 | 200 | 209 | 36,124 | 2030/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 300 | 261 | 45,155 | 2031/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.9 | 600 | 537 | 92,817 | 2032/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9 | 1,000 | 1,006 | 173,884 | 2033/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.9 | 500 | 499 | 86,285 | 2034/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.4 | 1,030 | 988 | 170,757 | 2034/5/23 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.25 | 1,000 | 727 | 125,715 | 2036/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 4.15 | 400 | 436 | 75,377 | 2037/3/15 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | — | 200 | 119 | 20,583 | 2040/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 700 | 662 | 114,430 | 2044/6/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5 | 250 | 170 | 29,524 | 2047/2/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.75 | 1,500 | 779 | 134,610 | 2051/3/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.15 | 150 | 133 | 23,064 | 2053/10/20 |
| | | REPUBLIC OF AUSTRIA | 3.8 | 50 | 50 | 8,636 | 2062/1/26 |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.7 | 500 | 171 | 29,542 | 2071/4/20 | | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 1.5 | 300 | 140 | 24,279 | 2086/11/2 | | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 2.1 | 100 | 58 | 10,049 | 2117/9/20 | | |
| REPUBLIC OF AUSTRIA | 0.85 | 100 | 30 | 5,224 | 2120/6/30 | | |
| フィンランド | 国債証券 | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 400 | 387 | 66,997 | 2027/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.75 | 260 | 264 | 45,706 | 2028/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 700 | 665 | 114,924 | 2028/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.875 | 400 | 408 | 70,488 | 2029/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 800 | 744 | 128,497 | 2029/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.75 | 200 | 181 | 31,305 | 2031/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.125 | 600 | 516 | 89,244 | 2031/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.5 | 400 | 367 | 63,502 | 2032/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 3.0 | 600 | 604 | 104,432 | 2033/9/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.125 | 200 | 172 | 29,749 | 2034/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.125 | 700 | 508 | 87,828 | 2036/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 2.625 | 300 | 266 | 46,067 | 2042/7/4 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.5 | 200 | 120 | 20,794 | 2043/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 1.375 | 220 | 145 | 25,125 | 2047/4/15 |
| | | FINNISH GOVERNMENT | 0.125 | 300 | 120 | 20,846 | 2052/4/15 |
| FINNISH GOVERNMENT | 2.95 | 400 | 335 | 57,926 | 2055/4/15 | | |
| アイルランド | 国債証券 | IRELAND GOVERNMENT BOND | 0.2 | 400 | 388 | 67,084 | 2027/5/15 |
| | | IRELAND GOVERNMENT BOND | 2.6 | 300 | 291 | 50,333 | 2034/10/18 |

| 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 | |
| アイルランド | 国債証券 | IRELAND GOVERNMENT BOND | 3.15 | 100 | 89 | 15,415 | 2055/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 0.9 | 340 | 329 | 56,984 | 2028/5/15 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 0.35 | 400 | 339 | 58,642 | 2032/10/18 |
| | | IRISH GOVERNMENT | 0.55 | 100 | 65 | 11,337 | 2041/4/22 |
| | | IRISH TSY 0.2% 2030 | 0.2 | 200 | 178 | 30,842 | 2030/10/18 |
| | | IRISH TSY 0.4% 2035 | 0.4 | 300 | 234 | 40,484 | 2035/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.10% 2029 | 1.1 | 1,000 | 960 | 165,859 | 2029/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.3% 2033 | 1.3 | 200 | 180 | 31,130 | 2033/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.35% 2031 | 1.35 | 300 | 283 | 48,924 | 2031/3/18 |
| | | IRISH TSY 1.5% 2050 | 1.5 | 650 | 428 | 73,936 | 2050/5/15 |
| | | IRISH TSY 1.7% 2037 | 1.7 | 230 | 197 | 34,060 | 2037/5/15 |
| | | IRISH TSY 2% 2045 | 2.0 | 400 | 315 | 54,446 | 2045/2/18 |
| | | IRISH TSY 2.4% 2030 | 2.4 | 500 | 500 | 86,455 | 2030/5/15 |
| ポルトガル | 国債証券 | OBRIGACOES DO TESOURO | 4.125 | 700 | 723 | 124,983 | 2027/4/14 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 0.7 | 200 | 194 | 33,647 | 2027/10/15 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 2.125 | 1,000 | 1,000 | 172,830 | 2028/10/17 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 1.95 | 200 | 198 | 34,206 | 2029/6/15 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 3.875 | 400 | 423 | 73,194 | 2030/2/15 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 1.65 | 600 | 558 | 96,434 | 2032/7/16 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 2.25 | 300 | 282 | 48,833 | 2034/4/18 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 2.875 | 500 | 492 | 84,990 | 2034/10/20 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 3.0 | 1,000 | 980 | 169,273 | 2035/6/15 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 0.9 | 200 | 160 | 27,744 | 2035/10/12 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 4.1 | 600 | 644 | 111,305 | 2037/4/15 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 4.1 | 300 | 310 | 53,662 | 2045/2/15 |
| | | OBRIGACOES DO TESOURO | 3.625 | 500 | 460 | 79,576 | 2054/6/12 |
| 小 計 | | | | | | 55,715,158 | |
| ポーランド | | | | 千ズロチ | 千ズロチ | | |
| | 国債証券 | POLAND GOVERNMENT BOND | 0.25 | 1,000 | 960 | 39,063 | 2026/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.5 | 1,900 | 1,839 | 74,813 | 2027/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 6,500 | 6,245 | 253,930 | 2028/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 7.5 | 5,000 | 5,399 | 219,552 | 2028/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 4.75 | 2,000 | 2,005 | 81,523 | 2029/7/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 2.75 | 5,000 | 4,642 | 188,751 | 2029/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.25 | 1,000 | 838 | 34,089 | 2030/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 1.75 | 5,000 | 4,078 | 165,834 | 2032/4/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.0 | 3,000 | 2,918 | 118,666 | 2034/10/25 |
| | | POLAND GOVERNMENT BOND | 5.0 | 2,000 | 1,931 | 78,544 | 2035/10/25 |
| | | 小 計 | | | | | |
| 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 | 1.25 | 500 | 499 | 57,429 | 2026/11/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.5 | 500 | 515 | 59,268 | 2027/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.625 | 600 | 618 | 71,116 | 2028/5/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 1,400 | 1,470 | 169,079 | 2029/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.875 | 1,100 | 1,170 | 134,602 | 2030/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.625 | 3,600 | 3,591 | 413,078 | 2031/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.625 | 1,900 | 2,014 | 231,700 | 2032/8/1 |

| 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 | | |
| 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 | 3.375 | 800 | 896 | 103,149 | 2033/9/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.375 | 800 | 900 | 103,610 | 2034/5/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.25 | 200 | 207 | 23,809 | 2036/8/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.375 | 800 | 839 | 96,570 | 2039/7/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 100 | 110 | 12,755 | 2042/4/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 2.75 | 600 | 679 | 78,176 | 2046/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.875 | 300 | 293 | 33,781 | 2050/3/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 1.875 | 1,000 | 970 | 111,569 | 2051/10/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.25 | 200 | 252 | 29,062 | 2054/6/1 |
| | | SINGAPORE GOVERNMENT | 3.0 | 400 | 483 | 55,646 | 2072/8/1 |
| 小計 | | | | | | 1,784,407 | |
| 中国 | | | 千人民元 | 千人民元 | | | |
| | 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.35 | 11,000 | 10,993 | 228,164 | 2026/9/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.06 | 61,000 | 60,750 | 1,260,818 | 2026/12/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.37 | 19,000 | 19,254 | 399,598 | 2027/1/20 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.04 | 27,000 | 27,252 | 565,603 | 2027/2/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.59 | 13,000 | 13,038 | 270,594 | 2027/3/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.48 | 3,000 | 3,052 | 63,342 | 2027/4/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.85 | 27,000 | 27,200 | 564,514 | 2027/5/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.38 | 8,000 | 7,997 | 165,973 | 2027/6/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.5 | 7,000 | 7,130 | 147,984 | 2027/7/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.62 | 23,000 | 23,100 | 479,433 | 2027/8/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.44 | 7,000 | 7,142 | 148,233 | 2027/10/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.42 | 56,000 | 56,001 | 1,162,259 | 2027/11/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.64 | 18,200 | 18,718 | 388,493 | 2028/1/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.45 | 43,000 | 43,052 | 893,509 | 2028/2/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.62 | 4,900 | 5,050 | 104,820 | 2028/4/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.46 | 45,000 | 45,054 | 935,051 | 2028/5/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.4 | 11,000 | 11,303 | 234,597 | 2028/7/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.91 | 9,000 | 9,409 | 195,289 | 2028/10/14 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.55 | 10,000 | 10,334 | 214,477 | 2028/10/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.37 | 22,000 | 22,640 | 469,871 | 2029/1/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8 | 7,000 | 7,319 | 151,900 | 2029/3/24 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.05 | 14,000 | 14,260 | 295,952 | 2029/4/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.75 | 16,000 | 16,733 | 347,291 | 2029/6/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.91 | 13,000 | 13,178 | 273,505 | 2029/7/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.62 | 3,000 | 3,127 | 64,900 | 2029/9/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.74 | 5,000 | 5,037 | 104,544 | 2029/10/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.79 | 5,000 | 5,257 | 109,108 | 2029/12/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.43 | 80,000 | 79,523 | 1,650,420 | 2030/1/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.8 | 6,500 | 6,854 | 142,256 | 2030/3/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.62 | 15,000 | 15,705 | 325,948 | 2030/6/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 1.55 | 15,000 | 14,966 | 310,610 | 2030/7/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.6 | 29,000 | 30,375 | 630,405 | 2030/9/15 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.28 | 24,000 | 24,800 | 514,703 | 2031/3/25 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 3.02 | 3,000 | 3,241 | 67,268 | 2031/5/27 |
| | | CHINA GOVERNMENT BOND | 2.12 | 14,000 | 14,344 | 297,707 | 2031/6/25 |

| 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 | | | |
| 中国 | | | % | 千人民元 | 千人民元 | 千円 | |
| 国債証券 | CHINA GOVERNMENT BOND | | 1.87 | 16,000 | 16,175 | 335,705 | 2031/9/15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.89 | 3,000 | 3,225 | 66,942 | 2031/11/18 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 1.49 | 17,000 | 16,803 | 348,747 | 2031/12/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.75 | 4,000 | 4,267 | 88,560 | 2032/2/17 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 1.79 | 18,000 | 18,122 | 376,119 | 2032/3/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.69 | 6,000 | 6,330 | 131,372 | 2032/8/15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.8 | 6,000 | 6,455 | 133,980 | 2032/11/15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.88 | 7,200 | 7,813 | 162,162 | 2033/2/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.67 | 5,000 | 5,343 | 110,903 | 2033/5/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.52 | 10,000 | 10,572 | 219,414 | 2033/8/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.67 | 8,000 | 8,562 | 177,709 | 2033/11/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.35 | 23,000 | 24,033 | 498,785 | 2034/2/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.27 | 10,000 | 10,396 | 215,760 | 2034/5/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.11 | 15,000 | 15,406 | 319,743 | 2034/8/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 2.04 | 48,000 | 49,014 | 1,017,251 | 2034/11/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 1.61 | 30,000 | 29,541 | 613,113 | 2035/2/15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 1.67 | 38,000 | 37,697 | 782,363 | 2035/5/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 3.72 | 2,000 | 2,650 | 54,998 | 2051/4/12 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 3.53 | 2,000 | 2,574 | 53,425 | 2051/10/18 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 3.32 | 12,600 | 15,751 | 326,901 | 2052/4/15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 3.12 | 9,900 | 12,009 | 249,235 | 2052/10/25 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 3.19 | 6,000 | 7,394 | 153,464 | 2053/4/15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 3.0 | 38,000 | 45,724 | 948,970 | 2053/10/15 |
| | CHINA GOVERNMENT BOND | | 1.92 | 14,000 | 13,544 | 281,108 | 2055/1/15 |
| 小計 | | | | | | 21,845,899 | |
| オーストラリア | | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | |
| 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 0.5 | 400 | 386 | 37,419 | 2026/9/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 4.75 | 1,100 | 1,123 | 108,642 | 2027/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 2.75 | 3,100 | 3,057 | 295,691 | 2027/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 2.25 | 1,000 | 968 | 93,697 | 2028/5/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 2.75 | 200 | 195 | 18,922 | 2028/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 3.25 | 700 | 693 | 67,089 | 2029/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 2.75 | 850 | 821 | 79,466 | 2029/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 2.5 | 550 | 523 | 50,610 | 2030/5/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 1.0 | 600 | 522 | 50,520 | 2030/12/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 1.5 | 3,900 | 3,438 | 332,603 | 2031/6/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 1.0 | 2,700 | 2,276 | 220,196 | 2031/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 1.25 | 1,300 | 1,094 | 105,854 | 2032/5/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 1.75 | 2,600 | 2,231 | 215,798 | 2032/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 4.5 | 1,070 | 1,099 | 106,360 | 2033/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 3.0 | 2,600 | 2,390 | 231,178 | 2033/11/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 3.5 | 900 | 845 | 81,792 | 2034/12/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 2.75 | 1,200 | 1,047 | 101,357 | 2035/6/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 3.75 | 1,000 | 935 | 90,444 | 2037/4/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 3.25 | 400 | 343 | 33,225 | 2039/6/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 2.75 | 300 | 234 | 22,698 | 2041/5/21 |
| | AUSTRALIAN GOVERNMENT | | 3.0 | 600 | 442 | 42,798 | 2047/3/21 |

| 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 | | |
| オーストラリア | 国債証券 | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 1.75 | 600 | 311 | 30,147 | 2051/6/21 |
| | | AUSTRALIAN GOVERNMENT | 4.75 | 700 | 662 | 64,081 | 2054/6/21 |
| 小 計 | | | | | | 2,480,597 | |
| ニュージーランド | | | | 千豪ドル | 千豪ドル | | |
| ニュージーランド | 国債証券 | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 0.25 | 1,000 | 923 | 80,185 | 2028/5/15 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3.0 | 1,200 | 1,181 | 102,533 | 2029/4/20 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.5 | 250 | 258 | 22,433 | 2030/5/15 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1.5 | 900 | 792 | 68,814 | 2031/5/15 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 3.5 | 1,500 | 1,433 | 124,404 | 2033/4/14 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 4.5 | 250 | 251 | 21,808 | 2035/5/15 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 1.75 | 400 | 259 | 22,523 | 2041/5/15 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 2.75 | 300 | 193 | 16,788 | 2051/5/15 |
| | | NEW ZEALAND GOVERNMENT | 5.0 | 600 | 572 | 49,647 | 2054/5/15 |
| 小 計 | | | | | | 509,138 | |
| イスラエル | | | | 千新シェケル | 千新シェケル | | |
| イスラエル | 国債証券 | ISRAEL FIXED BOND | 6.25 | 1,500 | 1,538 | 68,012 | 2026/10/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 2.0 | 1,400 | 1,359 | 60,120 | 2027/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 2,500 | 2,490 | 110,113 | 2027/9/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 2.25 | 1,200 | 1,143 | 50,534 | 2028/9/28 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 1,500 | 1,490 | 65,916 | 2029/2/28 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.0 | 1,000 | 879 | 38,868 | 2030/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.3 | 1,900 | 1,601 | 70,790 | 2032/4/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 4.0 | 1,000 | 990 | 43,785 | 2035/3/30 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 1.5 | 2,000 | 1,499 | 66,295 | 2037/5/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 5.5 | 400 | 451 | 19,974 | 2042/1/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 3.75 | 1,000 | 893 | 39,496 | 2047/3/31 |
| | | ISRAEL FIXED BOND | 2.8 | 2,200 | 1,568 | 69,350 | 2052/11/29 |
| | | 小 計 | | | | | |
| メキシコ | | | | 千メキシコペソ | 千メキシコペソ | | |
| メキシコ | 国債証券 | MEX BONOS DESARR FIX RT | 5.5 | 20,000 | 19,378 | 153,430 | 2027/3/4 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 23,300 | 23,193 | 183,639 | 2027/6/3 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 23,000 | 23,245 | 184,049 | 2028/3/2 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 8,200 | 8,273 | 65,505 | 2029/3/1 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 14,800 | 14,932 | 118,230 | 2029/5/31 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 15,000 | 14,550 | 115,204 | 2031/5/29 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.5 | 7,000 | 6,540 | 51,783 | 2033/5/26 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 14,500 | 13,554 | 107,319 | 2034/11/23 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 4,000 | 3,774 | 29,888 | 2035/5/24 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 10.0 | 3,300 | 3,551 | 28,123 | 2036/11/20 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.5 | 30,500 | 28,923 | 229,001 | 2038/11/18 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 7.75 | 14,400 | 12,337 | 97,680 | 2042/11/13 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 7,700 | 6,641 | 52,588 | 2047/11/7 |
| | | MEX BONOS DESARR FIX RT | 8.0 | 26,500 | 22,077 | 174,798 | 2053/7/31 |
| 小 計 | | | | | | 1,591,241 | |
| 合 計 | | | | | | 186,366,853 | |

* 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。

ニッセイ国内債券オープンF（適格機関投資家専用）

第7期（2024年7月23日～2025年7月22日）

○当ファンドの仕組み

| | | |
|--------|---|--|
| 商品分類 | 追加型投信／国内／債券 | |
| 信託期間 | 無期限 | |
| 運用方針 | ニッセイ国内債券オープンマザーファンド受益証券への投資を通じて、実質的に国内の公社債等に投資を行い、NOMURA-BPI総合を中長期的に上回ることをめざして運用を行います。なお直接、公社債等に投資を行う場合があります。 | |
| 主な投資対象 | ニッセイ国内債券オープンF（適格機関投資家専用） | ニッセイ国内債券オープンマザーファンド受益証券 |
| | ニッセイ国内債券オープンマザーファンド | 国内の公社債 |
| 主な投資制限 | ニッセイ国内債券オープンF（適格機関投資家専用） | <ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。 デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 |
| | ニッセイ国内債券オープンマザーファンド | <ul style="list-style-type: none"> 株式への投資は転換社債の転換および新株予約権の行使による取得に限るものとし、投資割合は信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。 デリバティブ取引等の利用はヘッジ目的に限定しません。 |
| 分配方針 | 運用による収益は、期中に分配を行わず、信託終了時まで信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。 | |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | （ご参考） 基準価額+ 累計分配金 | ベンチマーク | | 債券 組入比率 | 債券 先物比率 | 純資産 総額 |
|----------------|-------------|------------|-----------|-------------------------|-----------|----------|------------|------------|---------------|
| | （分配落） | 税引前 分配金 | 期中 騰落率 | | 期中 騰落率 | | | | |
| 3期（2021年7月20日） | 円 10,101 | 円 0 | % 1.3 | 円 10,101 | 9,993 | % 0.6 | % 94.8 | % △2.0 | 百万円 22,724 |
| 4期（2022年7月20日） | 9,795 | 0 | △3.0 | 9,795 | 9,659 | △3.3 | 97.7 | △5.7 | 21,047 |
| 5期（2023年7月20日） | 9,795 | 0 | 0.0 | 9,795 | 9,608 | △0.5 | 93.7 | △6.5 | 18,174 |
| 6期（2024年7月22日） | 9,394 | 0 | △4.1 | 9,394 | 9,187 | △4.4 | 91.6 | △0.3 | 43,866 |
| 7期（2025年7月22日） | 9,070 | 0 | △3.4 | 9,070 | 8,884 | △3.3 | 98.6 | △3.8 | 43,338 |

（注1）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

（注2）「基準価額+累計分配金」は、当該決算期の基準価額（分配落）に当該決算期以前の税引前分配金の累計額を加えたものです。

（注3）ベンチマークはNOMURA-BPI総合で、設定時を10,000として指数化しています。NOMURA-BPI総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。以下同じです。

（注4）先物比率は買建比率-売建比率です。以下同じです。

（注5）当ファンドはマザーファンドを組み入れるため、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しています。以下同じです。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基準 価 額 | | ベンチ マ ー ク | | 債 券 組 入 比 率 | 債 券 先 物 比 率 |
|----------------------|------------|--------|-----------|--------|----------------|----------------|
| | 騰 落 | 率 | 騰 落 | 率 | | |
| (期 首) 2024年 7月22日 | 円 9,394 | % — | 9,187 | % — | % 91.6 | % △0.3 |
| 7月末 | 9,385 | △0.1 | 9,178 | △0.1 | 91.2 | △6.5 |
| 8月末 | 9,474 | 0.9 | 9,285 | 1.1 | 93.3 | △2.3 |
| 9月末 | 9,501 | 1.1 | 9,311 | 1.3 | 93.0 | △4.7 |
| 10月末 | 9,455 | 0.6 | 9,264 | 0.8 | 93.3 | △2.0 |
| 11月末 | 9,399 | 0.1 | 9,199 | 0.1 | 92.7 | △3.6 |
| 12月末 | 9,384 | △0.1 | 9,190 | 0.0 | 92.4 | △2.5 |
| 2025年 1月末 | 9,326 | △0.7 | 9,122 | △0.7 | 92.4 | △2.3 |
| 2月末 | 9,268 | △1.3 | 9,061 | △1.4 | 92.3 | △1.6 |
| 3月末 | 9,176 | △2.3 | 8,973 | △2.3 | 91.9 | △2.2 |
| 4月末 | 9,218 | △1.9 | 9,025 | △1.8 | 98.0 | △8.0 |
| 5月末 | 9,095 | △3.2 | 8,909 | △3.0 | 98.3 | △5.7 |
| 6月末 | 9,144 | △2.7 | 8,956 | △2.5 | 98.8 | △7.0 |
| (期 末) 2025年 7月22日 | 9,070 | △3.4 | 8,884 | △3.3 | 98.6 | △3.8 |

(注) 期末基準価額は分配金（税引前）込み、騰落率は期首比です。

○当期中の運用経過と今後の運用方針

〔基準価額の推移〕

当期の基準価額は9,070円となり、期首より下落しました。当期の国内長期金利は1.06%でスタートした後、2024年7月末の日銀金融政策決定会合で、市場の想定よりも早く追加利上げが決定され、その直後に急激な円高や株式市場の下落が進行する中、8月上旬には0.8%を下回る水準まで急低下しました。その後9月末までもみ合いで推移しましたが、10月以降は衆院選で与党が過半数を割り、財政拡大が意識されたことに加えて、米大統領選でトランプ元大統領が勝利したこと、上下院での共和党の勝利を受けて財政拡大やインフレ観測等から米金利が上昇したことを背景に金利は再び上昇基調となりました。年明け以降も日銀正副総裁の金融引き締めに前向きな発言や堅調な経済指標を背景に政策金利の到達点が高まるとの警戒感や、ドイツの国防費増額報道を受け欧州金利が大きく上昇し、国内の防衛費拡大観測が台頭したことから一段と上昇基調を強め、2025年3月下旬には1.5%台後半まで上昇しました。しかし4月上旬にかけては、米関税政策を巡るリスク回避の流れから株価の大幅下落を受けて、金利は1.1%台前半まで急低下した後、米関税政策の過度なリスク回避の後退から反転上昇しました。5月に入るとトランプ米大統領が各国と関税交渉を進め、イギリスとの貿易協定や中国との相互関税率引き下げに合意したことを受けて、再び1.5%台まで上昇しました。その後、財務省による国債発行減額観測の高まりや中東情勢緊迫化により金利は低下しましたが、7月に入ると参院選で与党の苦戦が報じられる中、財政拡大懸念が高まったことから金利は上昇し、結局、長期金利は1.52%で当期末を迎えました。このような環境下、当期の基準価額騰落率は-3.4%となり、ベンチマーク騰落率（-3.3%）を下回りました。

〔運用経過〕

期を通じて主要投資対象であるニッセイ国内債券オープンマザーファンド受益証券を高位に組み入れました。

〔今後の運用方針について〕

■当ファンド

マザーファンド受益証券の組み入れを高位に維持し、基準価額の向上に努めます。

■マザーファンド

引き続き、経済情勢や債券市場動向分析を踏まえた適切な戦略執行により、ベンチマーク（NOMURA-BPI総合）を中長期的に上回る収益の獲得をめざします。

○1口当たりの費用明細

(2024年7月23日～2025年7月22日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-------------------|------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 信 託 報 酬 | 32 | 0.341 | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× $\frac{\text{期中の日数}}{\text{年間の日数}}$ |
| （投 信 会 社） | (28) | (0.297) | ファンドの運用、法定書類等の作成、基準価額の算出等の対価 |
| （販 売 会 社） | (2) | (0.022) | 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の対価 |
| （受 託 会 社） | (2) | (0.022) | 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の対価 |
| (b) 売 買 委 託 手 数 料 | 0 | 0.002 | (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 |
| （先 物 ・ オ プ シ ョ ン） | (0) | (0.002) | 売買委託手数料：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| (c) そ の 他 費 用 | 0 | 0.003 | (c) その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数 |
| （監 査 費 用） | (0) | (0.003) | 監査にかかる監査法人等に支払う費用 |
| 合 計 | 32 | 0.345 | |

期中の平均基準価額は9,306円です。

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1口当たりのそれぞれの費用金額」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います。

○売買および取引の状況

(2024年7月23日～2025年7月22日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------|------------------|------------------|------------------|------------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| ニッセイ国内債券オープンマザーファンド | 千口 26,262,570 | 千円 25,093,838 | 千口 25,350,328 | 千円 23,751,645 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2024年7月23日～2025年7月22日)

当期における利害関係人との取引はありません。

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

○組入資産の明細

(2025年7月22日現在)

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 |
| ニッセイ国内債券オープンマザーファンド | | 46,175,954 | 47,088,197 | 43,339,976 |

(注1) 単位未満は切り捨てています。

(注2) 当期末におけるニッセイ国内債券オープンマザーファンド全体の口数は47,088,197千口です。

○投資信託財産の構成

(2025年7月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|---------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| ニッセイ国内債券オープンマザーファンド | 43,339,976 | 99.8 |
| コール・ローン等、その他 | 89,270 | 0.2 |
| 投資信託財産総額 | 43,429,247 | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

○資産、負債、元本および基準価額の状況（2025年7月22日現在）

| 項目 | 当 期 末 |
|------------------------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 43,429,247,176 |
| コール・ローン等 | 88,004,622 |
| ニッセイ国内債券オープン マザーファンド(評価額) | 43,339,976,757 |
| 未収入金 | 1,265,797 |
| (B) 負債 | 90,900,091 |
| 未払解約金 | 453,250 |
| 未払信託報酬 | 89,744,969 |
| その他未払費用 | 701,872 |
| (C) 純資産総額(A－B) | 43,338,347,085 |
| 元本 | 47,780,840,000 |
| 次期繰越損益金 | △ 4,442,492,915 |
| (D) 受益権総口数 | 4,778,084口 |
| 1口当たり基準価額(C/D) | 9,070円 |

(注1) 期首元本額 46,695,540,000円
 期中追加設定元本額 26,570,690,000円
 期中一部解約元本額 25,485,390,000円

(注2) 元本の欠損
 純資産総額は元本額を下回っており、その差額は
 4,442,492,915円です。

○損益の状況（2024年7月23日～2025年7月22日）

| 項目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 153,784 |
| 受取利息 | 153,784 |
| (B) 有価証券売買損益 | △1,427,846,040 |
| 売買益 | 369,134,903 |
| 売買損 | △1,796,980,943 |
| (C) 信託報酬等 | △ 195,179,307 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △1,622,871,563 |
| (E) 前期繰越損益金 | △1,148,547,024 |
| (分配準備積立金) | (74,090,074) |
| (繰越欠損金) | (△1,222,637,098) |
| (F) 追加信託差損益金* | △1,671,074,328 |
| (配当等相当額) | (338,946,729) |
| (売買損益相当額) | (△2,010,021,057) |
| (G) 合計(D+E+F) | △4,442,492,915 |
| 次期繰越損益金(G) | △4,442,492,915 |
| 追加信託差損益金 | △1,671,074,328 |
| (配当等相当額) | (338,946,729) |
| (売買損益相当額) | (△2,010,021,057) |
| 分配準備積立金 | 74,090,074 |
| 繰越欠損金 | △2,845,508,661 |

(注1) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (C)信託報酬等は、信託報酬に対する消費税等相当額を含みます。

(注3) (E)前期繰越損益金とは、分配準備積立金と繰越欠損金の合計で、前期末の金額に、期中一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

(注4) (F)追加信託差損益金*とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、配当等相当額と売買損益相当額に区分します。前期末の金額に、期中追加設定および一部解約により変動した金額を調整して算出しています。

○分配金の計算過程

| 項目 | 当 期 |
|---------------------|--------------|
| (a) 経費控除後の配当等収益 | 0円 |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益 | 0円 |
| (c) 信託約款に定める収益調整金 | 338,946,729円 |
| (d) 信託約款に定める分配準備積立金 | 74,090,074円 |
| (e) 分配対象額(a+b+c+d) | 413,036,803円 |
| (f) 分配対象額(1口当たり) | 86.44円 |
| (g) 分配金 | 0円 |
| (h) 分配金(1口当たり) | 0円 |

○お知らせ

■運用報告書の電子交付について

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更され、書面交付またはデジタル交付いずれかを選択できるようになりました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献につながるものととらえています。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供も進めていきます。

(2025年4月1日)

■約款変更

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1日)

ニッセイ国内債券オープンマザーファンド

第7期（計算期間：2024年7月23日～2025年7月22日）

○当期中の運用経過と今後の運用方針

【運用経過】

当マザーファンドは主に国内の公社債等に投資を行い、ベンチマークを中長期的に上回ることをめざして運用を行いました。当期のデュレーションについては、2024年7月末の日銀金融政策決定会合での追加利上げ実施に伴い、急激な円高や株式市場の下落により市場に大きな混乱が生じた後は、長期金利のみみ合い推移を見込み、9月まで短期化、長期化を機動的に調整しました。10月は欧米の利下げ局面入りや日銀の早期追加利上げへの慎重なスタンスを見込んで、長期化でスタートしました。しかし、堅調な米雇用統計の結果を受けて長期金利が急上昇したため、その後は中立から短期化を基本に調整しました。11月は中旬まで中立近辺を維持しつつ、中旬以降は長期金利が高水準に達したことや追加利上げもおおむね織り込んだと見込み、長期化を徐々に拡大しました。12月は長期金利のみみ合いを想定し小幅長期化で調整した後、月末は金利上昇圧力が強まったため短期化で調整しました。1月上旬は米金利上昇圧力の高まり等から中立から小幅短期化で調整しました。中旬には米消費者物価指数（CPI）の軟化を受けた米金利低下や堅調な20年国債入札等を受けて、長期化に切り替えて調整しました。2月は日銀の金融引き締めに積極的な姿勢などから金利上昇が先行すると見込まれ、中立近辺でスタートしました。その後、相互関税などトランプ米政権の政策に関して先行きの不透明感が高まったことや米景気指標の悪化などから、需給良好な超長期ゾーンを中心に小幅長期化で調整しました。3月は前半に金利上昇圧力が先行すると想定して、小幅な短期化で調整しましたが、懸念された20年国債入札の通過後に小幅長期化に切り替えて調整しました。月末にかけては物価指標の上振れ等から長期金利上昇が止まらず再度短期化を拡大しましたが、トランプ米大統領による関税の発動を鑑み、株価が大きく下落する中で好調となった40年国債入札で長期化に切り替えて調整しました。4月は月初に発表された米関税政策が市場の想定よりも厳しい内容となったことから、投資家のリスク回避姿勢の高まりに伴い長期金利の低下圧力が高まったため長期化で調整しました。その後、相互関税の緩和策が公表され、長期金利が反発に転じたため中立から小幅短期化で調整しました。5月の中旬以降には堅調な米雇用統計や関税政策に対する懸念の緩和等から米金利が大きく反発したことから短期化で調整しました。その後、超長期債の需給不安から懸念された30年国債入札が大きな問題もなく終了したことや中立から長期化を基本に機動的に調整しました。6月は国債入札への不透明感から短期化でスタートしましたが、月初の国債入札等が大きな問題もなく終了したことを受けて長期化に切り替えて調整しました。その後、最終的な発行計画が発表され20年国債の減額拡大が決定されたこと等から長期化拡大を維持しましたが、月末には材料が出尽くしたことを受けてから金利上昇に転じたため、ほぼ中立として月末を迎えました。7月は参院選における与党の苦戦が報じられ財政拡大懸念が高まる中、中立から短期化で調整しました。その後の利回り上昇により与党の過半数割れをおおむね織り込んだとの見方から、長期化から中立で機動的に調整しました。当期は対ベンチマークで相対的に利回りの高い事業債の組入比率を高位に保ちました。

上記運用の結果、当期の基準価額は9,204円となり、期首より296円下落しました。また、基準価額騰落率は-3.1%となり、ベンチマーク騰落率（-3.3%）を上回りました。

（注1）ベンチマークはNOMURA-BPI総合です。NOMURA-BPI総合は、日本国内で発行される公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社によって計算、公表されている投資収益指数であり、その知的財産は同社に帰属します。なお、同社は、当マザーファンドの運用成果等に関し、一切の責任を負うものではありません。以下同じです。

（注2）デュレーションとは、債券投資におけるリスク度合いを表す主要な指標の一つで、金利変動に対する債券価格の反応の大きさ（リスクの大きさ）を表します。デュレーションが長いほど、金利変動に対する債券価格の反応は大きくなります。以下同じです。

【今後の運用方針について】

国内長期金利は、参院選での与党過半数割れにより財政拡大圧力の高まりが想定されることや、米関税交渉合意等が先行き不透明感の緩和に繋がり日銀の利上げ再開観測がくすぶりやすいこと等が金利上昇圧力になると想定しています。一方で、これらを織り込みながら大きく金利上昇してきたことや、トランプ米政権の関税発動による景気減速が徐々に顕在化すると見込まれる中、米連邦準備制度理事会（FRB）の利下げ観測が高まると想定されること等が金利低下圧力となり、7月後半にかけての金利上昇後はみみ合いを想定しています。このような環境下、市場環境に応じた機動的なデュレーション調整やポートフォリオ全体の利回りを高める戦略を中心に経済情勢や債券市場動向分析を踏まえた適切な戦略執行により、ベンチマークを中長期的に上回る収益の獲得をめざします。

○お知らせ

■約款変更

運用報告書に関する記載の変更を行うため関連条項に所要の変更を行いました。

(2025年4月1日)

○1万口当たりの費用明細

(2024年7月23日～2025年7月22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) | % 0.002 (0.002) | (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：有価証券等の売買・取引の際に仲介人に支払う手数料 |
| 合 計 | 0 | 0.002 | |
| 期中の平均基準価額は9,427円です。 | | | |

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満は四捨五入しています。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」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います。

○売買および取引の状況

(2024年7月23日～2025年7月22日)

公社債

| | | 買付額 | 売付額 |
|----|------|-------------------|------------------------------|
| 国内 | 国債証券 | 千円 226,329,359 | 千円 222,984,060 (8,000) |
| | 特殊債券 | — | — (29,687) |
| | 社債券 | 15,079,883 | 13,200,621 (200,000) |

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれていません）。

(注2) () 内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

(注3) 金額の単位未満は切り捨てています。ただし、金額が単位未満の場合は、小数で記載しています。

先物取引の種類別取引状況

| 種類別 | 買建 | | 売建 | |
|----------|----------|----------|----------------|----------------|
| | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| 国内債券先物取引 | 百万円 — | 百万円 — | 百万円 137,088 | 百万円 135,532 |

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てています。

○組入有価証券明細表

(2025年7月22日現在)

国内（邦貨建）公社債

| 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 | | |
| 国債証券 | 千円 33,080,900 (25,800,700) | 千円 29,748,755 (23,752,446) | % 68.6 (54.8) | % — | % 54.7 (40.9) | % 9.0 (9.0) | % 4.9 (4.9) | | |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 494,570 (494,570) | 435,848 (435,848) | 1.0 (1.0) | — | 1.0 (1.0) | — | — | | |
| 社債券 | 12,800,000 (12,800,000) | 12,545,011 (12,545,011) | 28.9 (28.9) | — | 12.4 (12.4) | 13.3 (13.3) | 3.2 (3.2) | | |
| 合計 | 46,375,470 (39,095,270) | 42,729,615 (36,733,307) | 98.6 (84.8) | — | 68.2 (54.3) | 22.3 (22.3) | 8.1 (8.1) | | |

(注1) 評価については、原則として証券会社、価格情報会社等よりデータを入手しています。ただし、残存期間1年以内の公社債については、償却原価法により評価しています。以下同じです。

(注2) () 内は非上場債であり、上段の数字の内訳です。

(注3) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注4) 額面金額および評価額の単位未満は切り捨てています。ただし、額面金額および評価額が単位未満の場合は、小数で記載しています。以下同じです。

（国内公社債の内訳）

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|-----------------|-----------------|------------|------------|-----------|-----------|
| 国債証券 | | % | | 千円 | 千円 |
| | 第465回 利付国債（2年） | 0.4000 | 2026/10/1 | 8,200 | 8,178 |
| | 第466回 利付国債（2年） | 0.5000 | 2026/11/1 | 762,700 | 761,395 |
| | 第467回 利付国債（2年） | 0.6000 | 2026/12/1 | 64,900 | 64,855 |
| | 第469回 利付国債（2年） | 0.7000 | 2027/2/1 | 27,100 | 27,108 |
| | 第471回 利付国債（2年） | 0.9000 | 2027/4/1 | 44,300 | 44,447 |
| | 第472回 利付国債（2年） | 0.7000 | 2027/5/1 | 1,114,100 | 1,113,698 |
| | 第166回 利付国債（5年） | 0.4000 | 2028/12/20 | 14,100 | 13,882 |
| | 第172回 利付国債（5年） | 0.5000 | 2029/6/20 | 100,000 | 98,414 |
| | 第174回 利付国債（5年） | 0.7000 | 2029/9/20 | 400,000 | 396,072 |
| | 第175回 利付国債（5年） | 0.9000 | 2029/12/20 | 376,200 | 375,082 |
| | 第176回 利付国債（5年） | 1.0000 | 2029/12/20 | 183,200 | 183,430 |
| | 第177回 利付国債（5年） | 1.1000 | 2029/12/20 | 344,300 | 346,265 |
| | 第178回 利付国債（5年） | 1.0000 | 2030/3/20 | 927,700 | 927,904 |
| | 第179回 利付国債（5年） | 1.0000 | 2030/6/20 | 1,107,700 | 1,106,658 |
| | 第7回 利付国債（40年） | 1.7000 | 2054/3/20 | 33,000 | 24,731 |
| | 第9回 利付国債（40年） | 0.4000 | 2056/3/20 | 115,000 | 54,926 |
| | 第10回 利付国債（40年） | 0.9000 | 2057/3/20 | 59,000 | 33,427 |
| | 第11回 利付国債（40年） | 0.8000 | 2058/3/20 | 30,700 | 16,439 |
| | 第12回 利付国債（40年） | 0.5000 | 2059/3/20 | 27,400 | 12,653 |
| | 第13回 利付国債（40年） | 0.5000 | 2060/3/20 | 11,700 | 5,263 |
| | 第14回 利付国債（40年） | 0.7000 | 2061/3/20 | 78,400 | 37,588 |
| | 第15回 利付国債（40年） | 1.0000 | 2062/3/20 | 52,500 | 27,808 |
| | 第16回 利付国債（40年） | 1.3000 | 2063/3/20 | 97,100 | 56,352 |
| | 第17回 利付国債（40年） | 2.2000 | 2064/3/20 | 250,800 | 191,415 |
| | 第18回 利付国債（40年） | 3.1000 | 2065/3/20 | 310,800 | 296,304 |
| | 第354回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2029/3/20 | 256,000 | 248,791 |
| | 第360回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2030/9/20 | 271,000 | 258,330 |
| | 第361回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2030/12/20 | 186,900 | 177,626 |
| | 第362回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2031/3/20 | 393,100 | 372,360 |
| | 第363回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2031/6/20 | 68,500 | 64,644 |
| | 第364回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2031/9/20 | 210,000 | 197,425 |
| | 第365回 利付国債（10年） | 0.1000 | 2031/12/20 | 573,700 | 537,247 |
| | 第366回 利付国債（10年） | 0.2000 | 2032/3/20 | 61,100 | 57,385 |
| | 第367回 利付国債（10年） | 0.2000 | 2032/6/20 | 1,028,300 | 962,067 |
| | 第368回 利付国債（10年） | 0.2000 | 2032/9/20 | 332,500 | 309,753 |
| | 第369回 利付国債（10年） | 0.5000 | 2032/12/20 | 422,100 | 400,488 |
| 第370回 利付国債（10年） | 0.5000 | 2033/3/20 | 2,726,800 | 2,577,562 | |
| 第371回 利付国債（10年） | 0.4000 | 2033/6/20 | 292,600 | 273,320 | |
| 第374回 利付国債（10年） | 0.8000 | 2034/3/20 | 897,000 | 856,096 | |
| 第375回 利付国債（10年） | 1.1000 | 2034/6/20 | 1,290,800 | 1,259,614 | |
| 第376回 利付国債（10年） | 0.9000 | 2034/9/20 | 432,600 | 413,353 | |
| 第377回 利付国債（10年） | 1.2000 | 2034/12/20 | 265,500 | 259,680 | |

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------------------|------------------|------------|------------|---------------|---------------|
| 国債証券 | 第378回 利付国債 (10年) | % | 2035/3/20 | 千円 605,900 | 千円 601,804 |
| | 第379回 利付国債 (10年) | 1.5000 | 2035/6/20 | 667,200 | 667,200 |
| | 第16回 利付国債 (30年) | 2.5000 | 2034/9/20 | 47,800 | 52,217 |
| | 第32回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2040/3/20 | 22,200 | 22,799 |
| | 第34回 利付国債 (30年) | 2.2000 | 2041/3/20 | 25,600 | 25,614 |
| | 第40回 利付国債 (30年) | 1.8000 | 2043/9/20 | 90,600 | 82,574 |
| | 第42回 利付国債 (30年) | 1.7000 | 2044/3/20 | 73,800 | 65,578 |
| | 第44回 利付国債 (30年) | 1.7000 | 2044/9/20 | 75,700 | 66,729 |
| | 第45回 利付国債 (30年) | 1.5000 | 2044/12/20 | 30,100 | 25,499 |
| | 第46回 利付国債 (30年) | 1.5000 | 2045/3/20 | 25,300 | 21,346 |
| | 第47回 利付国債 (30年) | 1.6000 | 2045/6/20 | 60,000 | 51,354 |
| | 第48回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2045/9/20 | 210,000 | 172,334 |
| | 第49回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2045/12/20 | 90,500 | 73,899 |
| | 第50回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2046/3/20 | 21,000 | 15,059 |
| | 第51回 利付国債 (30年) | 0.3000 | 2046/6/20 | 95,000 | 60,035 |
| | 第52回 利付国債 (30年) | 0.5000 | 2046/9/20 | 143,400 | 94,546 |
| | 第53回 利付国債 (30年) | 0.6000 | 2046/12/20 | 184,700 | 123,920 |
| | 第54回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/3/20 | 345,000 | 241,241 |
| | 第55回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/6/20 | 128,700 | 89,377 |
| | 第57回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2047/12/20 | 131,900 | 90,348 |
| | 第58回 利付国債 (30年) | 0.8000 | 2048/3/20 | 276,900 | 188,375 |
| | 第59回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2048/6/20 | 285,900 | 188,305 |
| | 第60回 利付国債 (30年) | 0.9000 | 2048/9/20 | 239,100 | 164,522 |
| | 第61回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2048/12/20 | 128,700 | 83,566 |
| | 第62回 利付国債 (30年) | 0.5000 | 2049/3/20 | 19,500 | 11,898 |
| | 第68回 利付国債 (30年) | 0.6000 | 2050/9/20 | 196,500 | 117,200 |
| | 第69回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2050/12/20 | 28,300 | 17,225 |
| | 第70回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2051/3/20 | 111,100 | 67,097 |
| | 第71回 利付国債 (30年) | 0.7000 | 2051/6/20 | 92,100 | 55,184 |
| | 第74回 利付国債 (30年) | 1.0000 | 2052/3/20 | 29,400 | 18,860 |
| | 第75回 利付国債 (30年) | 1.3000 | 2052/6/20 | 7,500 | 5,202 |
| | 第76回 利付国債 (30年) | 1.4000 | 2052/9/20 | 42,300 | 29,993 |
| | 第79回 利付国債 (30年) | 1.2000 | 2053/6/20 | 5,800 | 3,843 |
| 第80回 利付国債 (30年) | 1.8000 | 2053/9/20 | 35,300 | 27,272 | |
| 第81回 利付国債 (30年) | 1.6000 | 2053/12/20 | 5,000 | 3,659 | |
| 第83回 利付国債 (30年) | 2.2000 | 2054/6/20 | 172,600 | 145,368 | |
| 第84回 利付国債 (30年) | 2.1000 | 2054/9/20 | 18,200 | 14,954 | |
| 第85回 利付国債 (30年) | 2.3000 | 2054/12/20 | 764,200 | 656,508 | |
| 第86回 利付国債 (30年) | 2.4000 | 2055/3/20 | 552,300 | 485,062 | |
| 第87回 利付国債 (30年) | 2.8000 | 2055/6/20 | 473,300 | 452,664 | |
| 第152回 利付国債 (20年) | 1.2000 | 2035/3/20 | 650,000 | 634,081 | |
| 第154回 利付国債 (20年) | 1.2000 | 2035/9/20 | 451,900 | 437,818 | |
| 第155回 利付国債 (20年) | 1.0000 | 2035/12/20 | 308,000 | 291,377 | |

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|-------------------|--------------------------------------|------------|------------|---------|------------|
| 国債証券 | 第156回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2036/3/20 | 15,900 | 14,047 |
| | 第157回 利付国債 (20年) | 0.2000 | 2036/6/20 | 143,000 | 122,751 |
| | 第158回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2036/9/20 | 5,600 | 4,944 |
| | 第159回 利付国債 (20年) | 0.6000 | 2036/12/20 | 288,400 | 256,001 |
| | 第160回 利付国債 (20年) | 0.7000 | 2037/3/20 | 439,300 | 392,167 |
| | 第161回 利付国債 (20年) | 0.6000 | 2037/6/20 | 279,700 | 245,218 |
| | 第162回 利付国債 (20年) | 0.6000 | 2037/9/20 | 232,800 | 202,801 |
| | 第165回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2038/6/20 | 862,300 | 726,229 |
| | 第166回 利付国債 (20年) | 0.7000 | 2038/9/20 | 474,800 | 408,147 |
| | 第167回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2038/12/20 | 158,900 | 131,950 |
| | 第168回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2039/3/20 | 171,100 | 138,974 |
| | 第169回 利付国債 (20年) | 0.3000 | 2039/6/20 | 201,600 | 160,036 |
| | 第170回 利付国債 (20年) | 0.3000 | 2039/9/20 | 21,300 | 16,776 |
| | 第172回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2040/3/20 | 448,300 | 353,184 |
| | 第173回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2040/6/20 | 306,900 | 239,894 |
| | 第174回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2040/9/20 | 14,100 | 10,934 |
| | 第175回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2040/12/20 | 397,500 | 310,956 |
| | 第176回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2041/3/20 | 81,600 | 63,342 |
| | 第177回 利付国債 (20年) | 0.4000 | 2041/6/20 | 486,600 | 368,399 |
| | 第178回 利付国債 (20年) | 0.5000 | 2041/9/20 | 794,700 | 607,897 |
| | 第180回 利付国債 (20年) | 0.8000 | 2042/3/20 | 62,400 | 49,632 |
| | 第181回 利付国債 (20年) | 0.9000 | 2042/6/20 | 131,900 | 106,060 |
| | 第182回 利付国債 (20年) | 1.1000 | 2042/9/20 | 428,200 | 354,288 |
| | 第183回 利付国債 (20年) | 1.4000 | 2042/12/20 | 482,600 | 417,695 |
| | 第185回 利付国債 (20年) | 1.1000 | 2043/6/20 | 20,900 | 17,006 |
| | 第188回 利付国債 (20年) | 1.6000 | 2044/3/20 | 397,500 | 347,339 |
| | 第189回 利付国債 (20年) | 1.9000 | 2044/6/20 | 238,700 | 218,348 |
| | 第190回 利付国債 (20年) | 1.8000 | 2044/9/20 | 241,300 | 216,332 |
| | 第191回 利付国債 (20年) | 2.0000 | 2044/12/20 | 46,300 | 42,771 |
| | 第192回 利付国債 (20年) | 2.4000 | 2045/3/20 | 354,800 | 348,743 |
| 第193回 利付国債 (20年) | 2.5000 | 2045/6/20 | 351,200 | 349,802 | |
| 第24回 物価連動国債 (10年) | 0.1000 | 2029/3/10 | 183,000 | 212,818 | |
| 第16回 ポーランド共和国国債 | 0.9300 | 2026/11/20 | 100,000 | 99,677 | |
| | 小計 | — | — | — | 29,748,755 |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 第154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.3000 | 2055/3/10 | 228,267 | 197,633 |
| | 第180回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 0.5000 | 2057/5/10 | 84,135 | 73,205 |
| | 第196回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.0200 | 2058/9/10 | 90,536 | 81,889 |
| | 第197回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 1.0800 | 2058/10/10 | 91,632 | 83,119 |
| | 小計 | — | — | — | 435,848 |
| 社債券 | 第41回 フランス相互信用連合銀行 (BFCM) 円貨社債 (2023) | 0.8200 | 2026/10/16 | 300,000 | 298,896 |
| | 第36回 ビー・ビー・シー・イー・エス・エー | 0.8950 | 2026/12/14 | 100,000 | 99,544 |
| | 第22回 クレディ・アグリコル・エス・エー | 0.7240 | 2027/1/26 | 200,000 | 198,908 |
| | 第15回 クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付 | 1.1140 | 2028/1/26 | 200,000 | 199,113 |

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|-----------------|--------------------------------------|------------|------------|---------------|--------------|
| 社債券 | 第4回 香港上海銀行 | % | 2027/6/25 | 千円 100,000 | 千円 99,465 |
| | 第12回 ロイズ・バンキング・グループ・ビーエルシー | 0.3770 | 2027/12/1 | 200,000 | 200,026 |
| | 第12回 オーストラリア・ニュージーランド銀行 | 0.7930 | 2027/9/17 | 300,000 | 298,095 |
| | 第114回 中日本高速道路 | 1.2590 | 2030/7/17 | 100,000 | 100,093 |
| | 第2回 積水ハウス劣後特約付 | 1.7130 | 2059/7/8 | 100,000 | 99,505 |
| | 第1回 アサヒグループホールディングス劣後特約付 | 0.9700 | 2080/10/15 | 100,000 | 99,980 |
| | 第1回 あらた | 0.7890 | 2028/9/6 | 100,000 | 98,037 |
| | 第6回 日鉄興和不動産 | 0.8300 | 2028/7/27 | 100,000 | 97,957 |
| | 第9回 日鉄興和不動産(グリーンボンド) | 1.8470 | 2030/7/25 | 100,000 | 100,128 |
| | 第7回 中央日本土地建物グループ(グリーンボンド) | 0.9090 | 2028/8/15 | 100,000 | 97,986 |
| | 第9回 中央日本土地建物グループ | 1.2360 | 2029/8/16 | 200,000 | 196,103 |
| | 第7回 ヒューリック劣後特約付 | 2.1020 | 2060/3/6 | 100,000 | 99,922 |
| | 第1回 東洋紡劣後特約付 | 2.8850 | 2061/9/12 | 100,000 | 98,300 |
| | 第2回 森ビル(グリーンボンド)劣後特約付 | 1.1700 | 2056/10/19 | 100,000 | 99,582 |
| | 第28回 東急不動産ホールディングス(グリーンボンド) | 0.6940 | 2028/3/1 | 100,000 | 98,740 |
| | 第63回 住友化学 | 0.3600 | 2030/10/22 | 100,000 | 93,392 |
| | 第3回 住友化学劣後特約付 | 3.3000 | 2059/9/12 | 100,000 | 103,789 |
| | 第22回 UBE | 1.0910 | 2027/12/3 | 300,000 | 298,910 |
| | 第17回 武田薬品工業 | 1.5990 | 2030/6/12 | 100,000 | 99,927 |
| | 第2回 武田薬品工業劣後特約付 | 1.9340 | 2084/6/25 | 400,000 | 397,908 |
| | 第25回 LINEヤフー | 1.3500 | 2029/9/12 | 200,000 | 196,986 |
| | 第4回 ENEOSホールディングス劣後特約付 | 1.3280 | 2083/9/20 | 100,000 | 98,445 |
| | 第1回 日本ビラー工業(グリーンボンド) | 1.0620 | 2028/12/14 | 100,000 | 98,368 |
| | 第4回 アイシン劣後特約付 | 1.4620 | 2054/12/19 | 200,000 | 197,500 |
| | 第8回 SUBARU(グリーンボンド) | 1.0590 | 2030/11/29 | 100,000 | 96,870 |
| | 第10回 SUBARU(グリーンボンド) | 1.5570 | 2034/9/4 | 300,000 | 283,623 |
| | 第3回 シークス | 1.2620 | 2029/6/6 | 200,000 | 197,162 |
| | 第10回 長瀬産業 | 1.6900 | 2034/11/28 | 100,000 | 96,335 |
| | 第7回 三菱商事劣後特約付 | 0.5100 | 2081/9/13 | 100,000 | 99,069 |
| | 第13回 ニプロ(ソーシャルボンド) | 1.0880 | 2028/10/13 | 100,000 | 98,225 |
| | 第2回 ニプロ(ソーシャルボンド)劣後特約付 | 3.0670 | 2060/7/25 | 100,000 | 100,000 |
| | 第8回 岩谷産業 | 1.4980 | 2034/9/12 | 100,000 | 95,011 |
| | 第3回 稲畑産業 | 1.1410 | 2029/6/5 | 100,000 | 98,640 |
| | 第27回 三菱UFJフィナンシャル・グループ劣後特約付 | 2.2370 | 2030/7/15 | 400,000 | 403,854 |
| | 第28回 三菱UFJフィナンシャル・グループ劣後特約付 | 2.7730 | 2035/7/15 | 100,000 | 101,060 |
| | 第23回 みずほフィナンシャルグループ劣後特約付 | 2.2730 | — | 100,000 | 100,000 |
| | 第2回 芙蓉総合リース劣後特約付 (サステナビリティリンクボンド) | 1.9200 | 2059/9/18 | 300,000 | 296,246 |
| | 第34回 SBIホールディングス | 0.9500 | 2026/6/5 | 100,000 | 99,720 |
| | 第37回 SBIホールディングス | 1.0000 | 2027/3/5 | 100,000 | 99,355 |
| | 第39回 SBIホールディングス | 1.3460 | 2028/10/30 | 200,000 | 197,597 |
| 第86回 アコム | 0.7880 | 2027/9/10 | 200,000 | 198,229 | |
| 第6回 オリックス劣後特約付 | 1.7280 | 2060/3/31 | 200,000 | 196,941 | |
| 第40回 大和証券グループ本社 | 0.5750 | 2026/11/27 | 100,000 | 99,358 | |

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 償還年月日 | 額面金額 | 評価額 |
|------------------|---------------------------------|------------|------------|------------|---------|
| 社債券 | 第3回 大和証券グループ本社劣後特約付 | % | 2029/12/5 | 千円 | 千円 |
| | 第1回 SBI証券劣後特約付 | 2.1990 | 2029/12/5 | 100,000 | 99,800 |
| | 第1回 東京海上日動火災保険劣後特約付 | 2.0810 | 2028/3/24 | 100,000 | 100,276 |
| | 第11回 東京海上日動火災保険劣後特約付 | 0.9600 | 2028/3/24 | 100,000 | 97,070 |
| | 第11回 三井住友海上火災保険 | 2.0660 | 2029/12/24 | 100,000 | 100,199 |
| | 第4回 損害保険ジャパン劣後特約付 | 2.5000 | 2035/7/25 | 100,000 | 100,907 |
| | 第28回 NECキャピタルソリューション | 2.0660 | 2083/2/13 | 200,000 | 200,907 |
| | 第4回 東京建物(サステナビリティボンド)劣後特約付 | 1.0760 | 2027/12/10 | 100,000 | 99,666 |
| | 第17回 東急 | 2.6630 | 2027/12/10 | 100,000 | 100,187 |
| | 第70回 西日本旅客鉄道 | 2.4770 | 2062/6/5 | 100,000 | 100,187 |
| | 第124回 近鉄グループホールディングス | 2.4770 | 2045/3/10 | 100,000 | 93,990 |
| | 第126回 近鉄グループホールディングス | 0.7980 | 2049/12/24 | 200,000 | 118,080 |
| | 第12回 センコーグループホールディングス | 0.6690 | 2028/7/21 | 100,000 | 97,967 |
| | 第6回 神奈川中央交通 | 1.0640 | 2029/7/25 | 100,000 | 98,329 |
| | 第1回 商船三井劣後特約付 | 1.3070 | 2028/7/25 | 100,000 | 100,054 |
| | 第1回 日本航空劣後特約付 | 1.3430 | 2029/11/29 | 100,000 | 99,074 |
| | 第1回 日本航空清算型倒産手続時劣後特約付 | 1.6000 | 2056/4/27 | 300,000 | 300,237 |
| | 第2回 日本航空清算型倒産手続時劣後特約付 | 1.6000 | 2058/10/11 | 100,000 | 98,023 |
| | 第1回 TREホールディングス(サステナビリティリンクボンド) | 3.2180 | 2030/4/16 | 300,000 | 305,227 |
| | 第2回 KPPグループホールディングス | 4.1240 | 2035/4/16 | 100,000 | 104,130 |
| | 第4回 ヤマトネ | 1.5000 | 2028/9/6 | 200,000 | 196,174 |
| | 第21回 ソフトバンク | 1.1670 | 2029/3/12 | 100,000 | 98,052 |
| | 第46回 光通信 | 0.5000 | 2025/12/12 | 300,000 | 299,270 |
| | 第49回 光通信 | 0.8200 | 2028/7/12 | 100,000 | 97,836 |
| | 第562回 関西電力 | 1.2720 | 2029/3/14 | 100,000 | 98,351 |
| | 第3回 関西電力劣後特約付 | 1.0730 | 2027/9/10 | 300,000 | 297,550 |
| | 第1回 東北電力劣後特約付 | 1.1280 | 2034/1/25 | 100,000 | 94,150 |
| | 第569回 東北電力 | 1.2590 | 2082/3/20 | 100,000 | 93,399 |
| | 第1回 沖縄電力劣後特約付 | 1.5450 | 2057/9/14 | 100,000 | 99,961 |
| | 第2回 沖縄電力劣後特約付 | 1.4420 | 2033/11/25 | 100,000 | 96,694 |
| | 第63回 東京電力パワーグリッド | 1.7790 | 2052/12/25 | 100,000 | 99,483 |
| | 第71回 東京電力パワーグリッド | 2.0490 | 2052/12/25 | 100,000 | 98,758 |
| | 第72回 東京電力パワーグリッド | 0.9800 | 2028/4/19 | 100,000 | 99,160 |
| | 第74回 東京電力パワーグリッド | 0.9960 | 2029/4/18 | 100,000 | 98,313 |
| | 第82回 東京電力パワーグリッド | 1.5680 | 2034/4/18 | 100,000 | 94,556 |
| | 第83回 東京電力パワーグリッド | 1.0880 | 2029/7/11 | 100,000 | 98,419 |
| | 第84回 東京電力パワーグリッド | 1.7600 | 2029/7/11 | 100,000 | 98,419 |
| | 第6回 東京電力リニューアブルパワー(グリーンボンド) | 1.7600 | 2030/5/28 | 100,000 | 100,559 |
| | 第47回 東京瓦斯 | 2.6160 | 2035/5/28 | 100,000 | 101,550 |
| | 第8回 イチネンホールディングス | 3.3300 | 2040/5/28 | 100,000 | 102,693 |
| 第9回 イチネンホールディングス | 1.5720 | 2031/12/12 | 300,000 | 293,434 | |
| 第10回 SCSK | 1.2510 | 2058/11/29 | 100,000 | 53,893 | |
| 小計 | 1.2510 | 2026/12/4 | 100,000 | 99,625 | |
| 合計 | 1.5000 | 2029/9/12 | 200,000 | 196,603 | |
| | 1.2740 | 2028/3/10 | 100,000 | 100,375 | |
| | — | — | — | 12,545,011 | |
| | — | — | — | 42,729,615 | |

(注) 償還年月日が「—」となっている銘柄は、永久債です。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当期 | | 期末 |
|------|-----|---|-------|
| | 買 | 建 | 額 |
| 国内 | 百万円 | | 百万円 |
| 長期国債 | - | | 1,663 |

(注) 単位未満は切り捨てています。

○投資信託財産の構成

(2025年7月22日現在)

| 項目 | 当期 | | 期末 |
|--------------|------------|---|-------|
| | 評 | 価 | 率 |
| | 千円 | | % |
| 公社債 | 42,729,615 | | 94.4 |
| コール・ローン等、その他 | 2,518,852 | | 5.6 |
| 投資信託財産総額 | 45,248,467 | | 100.0 |

(注) 評価額の単位未満は切り捨てています。

○資産、負債、元本および基準価額の状況 (2025年7月22日現在)

| 項目 | 当 | 期 | 末 |
|-----------------|-----------------|---|---|
| | 円 | | |
| (A) 資産 | 45,248,467,672 | | |
| コール・ローン等 | 497,592,845 | | |
| 公社債(評価額) | 42,729,615,261 | | |
| 未収入金 | 1,893,583,081 | | |
| 未収利息 | 85,956,700 | | |
| 前払費用 | 29,068,251 | | |
| 差入委託託拠金 | 12,651,534 | | |
| (B) 負債 | 1,907,039,055 | | |
| 未払金 | 1,905,773,258 | | |
| 未払解約金 | 1,265,797 | | |
| (C) 純資産総額(A-B) | 43,341,428,617 | | |
| 元本 | 47,088,197,259 | | |
| 次期繰越損益金 | △ 3,746,768,642 | | |
| (D) 受益権総口数 | 47,088,197,259口 | | |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9,204円 | | |

(注1) 期首元本額 46,175,954,949円

期中追加設定元本額 26,262,570,554円

期中一部解約元本額 25,350,328,244円

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

ニッセイ国内債券オープンF（適格機関投資家専用） 47,088,197,259円

(注3) 元本の欠損

純資産総額は元本額を下回っており、その差額は3,746,768,642円です。

○損益の状況 (2024年7月23日～2025年7月22日)

| 項目 | 当 | 期 |
|------------------|----------------|---|
| | 円 | |
| (A) 配当等収益 | 539,517,261 | |
| 受取利息 | 539,517,261 | |
| (B) 有価証券売買損益 | △2,442,964,460 | |
| 売買益 | 494,319,467 | |
| 売買損 | △2,937,283,927 | |
| (C) 先物取引等損益 | 35,319,050 | |
| 取引益 | 192,916,300 | |
| 取引損 | △ 157,597,250 | |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | △1,868,128,149 | |
| (E) 前期繰越損益金 | △2,308,590,940 | |
| (F) 追加信託差損益金 | △1,168,732,270 | |
| (G) 解約差損益金 | 1,598,682,717 | |
| (H) 合計(D+E+F+G) | △3,746,768,642 | |
| 次期繰越損益金(H) | △3,746,768,642 | |

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は、期末の評価換えによる損益を含みます。

(注2) (F)追加信託差損益金とは、追加設定をした価額と元本との差額をいい、元本を上回る場合は利益として、下回る場合は損失として処理されます。

(注3) (G)解約差損益金とは、一部解約をした価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

マニュアルフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・ファンドF（適格機関投資家専用）

第6期(2024年3月6日～2025年3月5日)

○当ファンドの仕組み

| | | |
|--------|--|---|
| 商品分類 | 追加型投信／内外／債券 | |
| 信託期間 | 2019年4月4日から無期限です。 | |
| 運用方針 | マザーファンド受益証券への投資を通じて主としてわが国の公社債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を目指して運用を行います。 | |
| 主な投資対象 | ベビーファンド | 主としてマニュアルフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券に投資します。 |
| | マザーファンド | 主としてユーロ円債を含む円建て公社債を投資対象とします。 |
| 主な投資制限 | ベビーファンド | ①債券への実質投資割合には制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③有価証券先物取引等の直接利用は行いません。 ④投資信託証券（マザーファンド受益証券を除く）への投資は行いません。 |
| | マザーファンド | ①債券への投資割合は、制限を設けません。 ②外貨建資産への投資は行いません。 ③投資信託証券への投資は行いません。 ④デリバティブの利用は、ヘッジ目的に限定しません。 |
| 分配方針 | 毎決算時（原則毎年3月5日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。第1期決算日は2020年3月5日。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。 ③留保益（収益分配に充てず信託財産に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。 | |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 参考指数 | | 債券組入比率 | 債券先物比率 | 純資産総額 |
|---------------|-------------|--------|-----------|-------|-----------|-----------|----------|---------------|
| | (分配落) | 税引前金 | 期騰落率 | 期騰落率 | 中率 | | | |
| 2期(2021年3月5日) | 円 10,076 | 円 0 | % △1.2 | 9,936 | % △1.8 | % 99.0 | % 2.7 | 百万円 36,255 |
| 3期(2022年3月7日) | 10,141 | 0 | 0.6 | 9,879 | △0.6 | 99.1 | △11.2 | 7,807 |
| 4期(2023年3月6日) | 9,668 | 0 | △4.7 | 9,492 | △3.9 | 98.1 | △2.4 | 6,381 |
| 5期(2024年3月5日) | 9,649 | 0 | △0.2 | 9,456 | △0.4 | 82.7 | 3.2 | 16,854 |
| 6期(2025年3月5日) | 9,311 | 0 | △3.5 | 9,035 | △4.5 | 99.4 | 8.6 | 43,682 |

(注1) 基準価額は1口当たり、騰落率は分配金込みで表示しています。

(注2) 当ファンドの参考指数は、NOMURA-BPI総合です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」および「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注4) 債券先物比率は「買建比率」－「売建比率」で算出しています。

※参考指数に関して

NOMURA-BPI総合とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の債券市場全体の動向を反映する投資収益指数（パフォーマンス）で、一定の組入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。NOMURA-BPI総合は、同社の知的財産であり、同指数に関する一切の権利は同社に帰属します。同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、当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 | | 参 考 指 数 | 債 券 債 券 | | |
|----------------------|------------|--------|---------|---------|-----------|----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | 組 入 比 率 | 先 物 比 率 | |
| (期 首) 2024年 3月 5日 | 円 9,649 | % — | 9,456 | % — | % 82.7 | % 3.2 |
| 3月末 | 9,647 | △0.0 | 9,439 | △0.2 | 80.0 | — |
| 4月末 | 9,550 | △1.0 | 9,332 | △1.3 | 99.2 | 3.6 |
| 5月末 | 9,421 | △2.4 | 9,182 | △2.9 | 99.6 | 1.5 |
| 6月末 | 9,452 | △2.0 | 9,207 | △2.6 | 87.8 | 5.9 |
| 7月末 | 9,449 | △2.1 | 9,198 | △2.7 | 98.8 | 6.5 |
| 8月末 | 9,554 | △1.0 | 9,306 | △1.6 | 83.1 | 20.5 |
| 9月末 | 9,578 | △0.7 | 9,332 | △1.3 | 99.0 | 21.2 |
| 10月末 | 9,537 | △1.2 | 9,285 | △1.8 | 97.1 | 21.9 |
| 11月末 | 9,472 | △1.8 | 9,220 | △2.5 | 98.5 | 11.6 |
| 12月末 | 9,466 | △1.9 | 9,210 | △2.6 | 97.5 | 8.1 |
| 2025年 1月末 | 9,417 | △2.4 | 9,142 | △3.3 | 99.5 | 9.9 |
| 2月末 | 9,357 | △3.0 | 9,081 | △4.0 | 99.5 | 8.6 |
| (期 末) 2025年 3月 5日 | 9,311 | △3.5 | 9,035 | △4.5 | 99.4 | 8.6 |

(注1) 騰落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

(注2) 基準価額は1口当たりです。

(注3) 当ファンドの参考指数は、NOMURA-BPI総合です。当参考指数は、ファンドの設定日の前営業日を10,000として委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「債券組入比率」および「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注5) 債券先物比率は「買建比率」－「売建比率」で算出しています。

○当期中の運用経過と今後の運用方針

■基準価額の主な変動要因

- ・非国債の対国債スプレッドが若干縮小したことがプラスに寄与しました。
- ・10年国債利回りが上昇したことがマイナスに寄与しました。

■投資環境

- ・日銀は2024年3月の金融政策決定会合においてマイナス金利政策の解除やイールドカーブ・コントロール政策の撤廃を決定しました。その後、追加利上げや国債買入れの減額など日銀の政策修正観測が高まる中、10年国債利回りは5月にかけて上昇しました。8月から9月にかけては米国の雇用統計悪化やFRB（連邦準備制度理事会）の大幅利下げ決定などを受けて米金利が低下する中、10年国債利回りも低下しました。その後は、米大統領選トランプ氏勝利を受けたインフレや財政拡大懸念の高まり、日銀の追加利上げ継続観測などを受けて、上昇しました。
- ・事業債の対国債スプレッドは、大きな変化はなく、期首からは若干の縮小となりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

当ファンド

主要投資対象とする「マニュアル・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。

マニュアル・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド

当該マザーファンドを通じて、わが国の公社債（ユーロ円債を含む）に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を図ることをめざして運用を行いました。

■当該投資信託のベンチマークとの差異

- ・当期間における、当ファンドの基準価額の騰落率は-3.50%となり、同期間における参考指数（NOMURA-BPI総合）の騰落率の-4.45%を上回りました。
- ・金利戦略については、金利変化に応じて機動的にデュレーションを変更し、2024年3月から中立、5月から短期化、7月は中立、8月は短期化、9月から中立、11月から長期化としました。物価連動国債は概ねオーバーウェイトを継続しました。金利戦略は、プラス寄与となりました。
- ・クレジット戦略については、事業債のオーバーウェイト幅を縮小しました。銘柄選択については、個別要因により信用力が安定しないしは改善基調にある銘柄を中心に保有して、分散効果の向上を図りました。その結果、種別選択・銘柄選択ともにプラス寄与となりました。

■収益分配金について

当作成期間については、基準価額等の水準を考慮し、収益分配金のお支払いを見送らせていただきました。留保益の運用については、元本部分と同一の運用を行います。

■今後の運用方針

当ファンド

主要投資対象とする「マニュアル・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に保ち、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行う方針です。

マニュアル・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド

- ・金利戦略については、日本国債利回りは日銀追加利上げが金利上昇圧力になりやすいものの、長期金利に関しては米金利と一定の連動性をもって変動する展開と想定しています。イールドカーブは短期から長期以降にかけてフラット化しやすいと想定しています。デュレーション・イールドカーブ戦略は機動的に調整する方針です。物価連動国債はオーバーウェイトとする方針です。
- ・クレジット戦略については、スプレッド水準に応じた保守的から中程度の事業債のオーバーウェイトとする方針です。事業債の対国債スプレッドは拡大リスクがやや優勢と見ています。設備投資は資本ストックの蓄積を背景に減速局面にあり、経済成長率の低下要因になりやすいと考えます。一方で、市場金利の上昇が潜在成長率の向上を背景としている場合、経済成長のトレンドが長く続く傾向があります。地方債・政府保証債はアンダーウェイトを維持します。銘柄選択については、個別要因により信用力が安定しないしは改善基調にある銘柄を中心に保有して、分散効果の向上を図る方針です。業種別には、景気循環型や、ノンバンク等の低流動性銘柄は保守的に対応し、銀行・保険やディフェンシブ銘柄を重視します。資本構造別には、スプレッドの安定性の高さからハイブリッド債を重視しつつ、分散の観点からシニア債とのバランスも考慮します。

○1口当たりの費用明細

（2024年3月6日～2025年3月5日）

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--|------------------------|--|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 平均基準価額 | 9,491円 | — | 期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。 |
| (a) 信託報酬 （投信会社） （販売会社） （受託会社） | 29円 (25) (2) | 0.308% (0.264) (0.022) | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 ・委託した資金の運用の対価 ・交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 ・運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価 |
| (b) 募集手数料 | — | — | |
| (c) 売買委託手数料 （先物・オプション） | 0 (0) | 0.001 (0.001) | (c) 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 |
| (d) 有価証券取引税 | — | — | (d) 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 |
| (e) その他費用 （保管費用） （監査費用） （その他） | 0 (0) (0) (0) | 0.005 (0.001) (0.004) (0.001) | (e) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・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 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 29 | 0.314 | |

* 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。

* 各項目毎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、このファンドに対応するものを含みます。

* 各比率は1口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買および取引の状況

（2024年3月6日～2025年3月5日）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘 柄 | 設 定 | | 解 約 | |
|----------------------------------|------------------|------------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| マニュアルフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド | 千口 31,427,312 | 千円 30,402,541 | 千口 2,527,825 | 千円 2,434,689 |

（注）単位未満は切り捨てております。

○利害関係人との取引状況等

（2024年3月6日～2025年3月5日）

当期中における利害関係人との取引等はありません。

利害関係人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。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2024年3月6日～2025年3月5日）

該当事項はありません。

○組入資産の明細

（2025年3月5日現在）

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 |
| マニュアルフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド | | 17,227,985 | 46,127,472 | 43,682,716 |

（注1）マザーファンドの2025年3月5日現在の受益権総口数は153,553,107千口です。

（注2）口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

○有価証券の貸付及び借入の状況

（2025年3月5日現在）

該当事項はありません。

○投資信託財産の構成

（2025年3月5日現在）

| 項 目 | 当 期 末 | |
|----------------------------------|------------|-------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| | 千円 | % |
| マニュアルフ・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド | 43,682,716 | 99.9 |
| コール・ローン等、その他 | 63,242 | 0.1 |
| 投資信託財産総額 | 43,745,958 | 100.0 |

（注）金額の単位未満は切り捨てております。

○資産、負債、元本および基準価額の状況（2025年3月5日現在）

| 項目 | 当 期 末 |
|---|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 43,745,958,478 |
| マニュアルフ・日本債券ストラテジック・ アクティブ・マザーファンド(評価額) | 43,682,716,602 |
| 未収入金 | 63,241,876 |
| (B) 負債 | 63,241,876 |
| 未払解約金 | 4,161,671 |
| 未払信託報酬 | 57,958,195 |
| その他未払費用 | 1,122,010 |
| (C) 純資産総額(A－B) | 43,682,716,602 |
| 元本 | 46,916,920,000 |
| 次期繰越損益金 | △ 3,234,203,398 |
| (D) 受益権総口数 | 4,691,692口 |
| 1口当たり基準価額(C/D) | 9,311円 |

(注1) 当ファンドの期首元本額は17,468,110,000円、期中追加設定元本額は31,924,880,000円、期中一部解約元本額は2,476,070,000円です。

(注2) 1口当たり純資産額は9,311円です。

(注3) 貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は3,234,203,398円です。

○損益の状況（2024年3月6日～2025年3月5日）

| 項目 | 当 期 |
|----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 有価証券売買損益 | △1,109,739,720 |
| 売買益 | 24,414,767 |
| 売買損 | △1,134,154,487 |
| (B) 信託報酬等 | △ 85,972,302 |
| (C) 当期損益金(A+B) | △1,195,712,022 |
| (D) 前期繰越損益金 | △ 270,823,289 |
| (E) 追加信託差損益金 | △1,767,668,087 |
| (配当等相当額) | (1,755,931,954) |
| (売買損益相当額) | (△3,523,600,041) |
| (F) 計(C+D+E) | △3,234,203,398 |
| (G) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(F+G) | △3,234,203,398 |
| 追加信託差損益金 | △1,767,668,087 |
| (配当等相当額) | (1,784,333,198) |
| (売買損益相当額) | (△3,552,001,285) |
| 分配準備積立金 | 516,302,301 |
| 繰越損益金 | △1,982,837,612 |

(注1) 損益の状況の中で(A)有価証券売買損益は各期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) 損益の状況の中で(B)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。

(注3) 損益の状況の中で(E)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。
 計算期間末における費用控除後の配当等収益(257,083,188円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(1,784,333,198円)および分配準備積立金(259,219,113円)より分配対象収益は2,300,635,499円(1口当たり490円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○お知らせ

◆約款変更
 該当事項はありません。

◆運用体制の変更
 該当事項はありません。

マニュアル・日本債券ストラテジック・アクティブ・マザーファンド

第6期（計算期間：2024年3月6日～2025年3月5日）

○当期中の運用経過と今後の運用方針

■基準価額の主な変動要因

- ・非国債の対国債スプレッドが若干縮小したことがプラスに寄与しました。
- ・10年国債利回りが上昇したことがマイナスに寄与しました。

■投資環境

- ・日銀は2024年3月の金融政策決定会合においてマイナス金利政策の解除やイールドカーブ・コントロール政策の撤廃を決定しました。その後、追加利上げや国債買入れの減額など日銀の政策修正観測が高まる中、10年国債利回りは5月にかけて上昇しました。8月から9月にかけては米国の雇用統計悪化やFRB（連邦準備制度理事会）の大幅利下げ決定などを受けて米金利が低下する中、10年国債利回りも低下しました。その後は、米大統領選トランプ氏勝利を受けたインフレや財政拡大懸念の高まり、日銀の追加利上げ継続観測などを受けて、上昇しました。
- ・事業債の対国債スプレッドは、大きな変化はなく、期首からは若干の縮小となりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

わが国の公社債（ユーロ円債を含む）に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長を図ることをめざして運用を行いました。

■当該投資信託とベンチマークの差異

- ・当期間における、当ファンドの基準価額の騰落率は-3.20%となり、同期間におけるベンチマーク（NOMURA-BPI総合）の騰落率の-4.45%を上回りました。
- ・金利戦略については、金利変化に応じて機動的にデュレーションを変更し、2024年3月から中立、5月から短期化、7月は中立、8月は短期化、9月から中立、11月から長期化としました。物価連動国債は概ねオーバーウェイトを継続しました。金利戦略は、プラス寄与となりました。
- ・クレジット戦略については、事業債のオーバーウェイト幅を縮小しました。銘柄選択については、個別要因により信用力が安定ないしは改善基調にある銘柄を中心に保有して、分散効果の向上を図りました。その結果、種別選択・銘柄選択ともにプラス寄与となりました。

■今後の運用方針

- ・金利戦略については、日本国債利回りは日銀追加利上げが金利上昇圧力になりやすいものの、長期金利に関しては米金利と一定の連動性をもって変動する展開と想定しています。イールドカーブは短期から長期以降にかけてフラット化しやすいと想定しています。デュレーション・イールドカーブ戦略は機動的に調整する方針です。物価連動国債はオーバーウェイトとする方針です。
- ・クレジット戦略については、スプレッド水準に応じた保守的から中程度の事業債のオーバーウェイトとする方針です。事業債の対国債スプレッドは拡大リスクがやや優勢と見えています。設備投資は資本ストックの蓄積を背景に減速局面にあり、経済成長率の低下要因になりやすいと考えます。一方で、市場金利の上昇が潜在成長率の向上を背景としている場合、経済成長のトレンドが長く続く傾向があります。地方債・政府保証債はアンダーウェイトを維持します。銘柄選択については、個別要因により信用力が安定ないしは改善基調にある銘柄を中心に保有して、分散効果の向上を図る方針です。業種別には、景気循環型や、ノンバンク等の低流動性銘柄は保守的に対応し、銀行・保険やディフェンシブ銘柄を重視します。資本構造別には、スプレッドの安定性の高さからハイブリッド債を重視しつつ、分散の観点からシニア債とのバランスも考慮します。

○1万口当たりの費用明細

(2024年3月6日～2025年3月5日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|--------------------------------------|-------------------------|-------------------------------------|--|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 平均基準価額 | 9,639円 | — | 期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。 |
| (a) 売買委託手数料 （先物・オプション） | 0円 (0) | 0.001% (0.001) | (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） | 0 (0) (0) | 0.001 (0.001) (0.001) | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他費用 ・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 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等 |
| 合 計 | 0 | 0.002 | |

*期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって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。

*各項目毎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を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○売買および取引の状況

(2024年3月6日～2025年3月5日)

公社債

| | | 買 付 額 | 売 付 額 |
|----|----------------|-------------------|-------------------|
| 国内 | 国債証券 | 千円 264,310,081 | 千円 219,611,118 |
| | 社債券（投資法人債券を含む） | 46,504,069 | 18,727,268 |

(注1) 金額は受け渡し代金です。（経過利子分は含まれておりません。）

(注2) 単位未満は切り捨てております。

(注3) 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。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | 買 建 | | 売 建 | |
|--------------|----------------|----------------|--------------|--------------|
| | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国内 債券先物取引 | 百万円 174,255 | 百万円 164,194 | 百万円 3,335 | 百万円 3,338 |

(注) 単位未満は切り捨てております。

オプションの種類別取引状況

| 種 類 別 | コール・ プット別 | 買 | | 建 | | 売 | | 建 | |
|----------------------|--------------|------------|------------|----------|----------|-----------|----------------|-----------|----------|
| | | 新規 買付額 | 決済額 | 権利 行使 | 権利 放棄 | 新規 売付額 | 決済額 | 権利 被行使 | 義務 消滅 |
| 国内 債券オプション 取 引 | コール | 百万円 458 | 百万円 164 | 百万円 — | 百万円 3 | 百万円 18 | 百万円 0.46311 | 百万円 — | 百万円 1 |
| | プット | 19 | 28 | — | — | 508 | 758 | — | — |

(注) 単位未満は切り捨てております。

スワップ及び先渡し取引状況

| 種 類 | 当 期 |
|-------------|----------------|
| | 取 引 契 約 金 額 |
| 金 利 ス ワ ッ プ | 百万円 359,020 |

○組入有価証券明細表

(2025年3月5日現在)

国内（邦貨建）公社債

A 債券種類別開示

| 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 |
| 国債証券 | 千円 74,693,000 (1,120,000) | 千円 64,891,270 (1,245,178) | % 44.6 (0.9) | % — (—) | % 36.2 (0.9) | % 0.8 (—) | % 7.7 (—) |
| 普通社債券 (含む投資法人債券) | 81,170,000 (81,170,000) | 79,594,806 (79,594,806) | 54.7 (54.7) | — (—) | 48.6 (48.6) | 5.1 (5.1) | 1.0 (1.0) |
| 合 計 | 155,863,000 (82,290,000) | 144,486,076 (80,839,984) | 99.4 (55.6) | — (—) | 84.8 (49.5) | 5.9 (5.1) | 8.7 (1.0) |

(注1) ()内は非上場債で内書きです。

(注2) 組入比率は、当期末の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注3) 額面金額・評価額の単位未満は切り捨てております。

(注4) 一印は組入れがありません。

(注5) 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。

(注6) 残存期間が1年以内の公社債は原則としてアキュムレーションまたはアモチゼーションにより評価しています。

B 個別銘柄開示

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
|---------------|----------------|-----------|-----------|------------|------------|
| 国債証券 | 第465回利付国債（2年） | % | 千円 | 千円 | |
| | | 0.4 | 4,180,000 | 4,155,296 | 2026/10/1 |
| | 第466回利付国債（2年） | 0.5 | 6,300,000 | 6,270,075 | 2026/11/1 |
| | 第468回利付国債（2年） | 0.6 | 750,000 | 747,165 | 2027/1/1 |
| | 第170回利付国債（5年） | 0.6 | 20,000 | 19,642 | 2029/6/20 |
| | 第171回利付国債（5年） | 0.4 | 50,000 | 48,685 | 2029/6/20 |
| | 第172回利付国債（5年） | 0.5 | 490,000 | 479,131 | 2029/6/20 |
| | 第175回利付国債（5年） | 0.9 | 590,000 | 585,557 | 2029/12/20 |
| | 第8回利付国債（40年） | 1.4 | 4,000 | 3,153 | 2055/3/20 |
| | 第9回利付国債（40年） | 0.4 | 2,000 | 1,125 | 2056/3/20 |
| | 第10回利付国債（40年） | 0.9 | 1,463,000 | 966,618 | 2057/3/20 |
| | 第11回利付国債（40年） | 0.8 | 1,000 | 627 | 2058/3/20 |
| | 第12回利付国債（40年） | 0.5 | 700,000 | 383,943 | 2059/3/20 |
| | 第13回利付国債（40年） | 0.5 | 16,000 | 8,594 | 2060/3/20 |
| | 第14回利付国債（40年） | 0.7 | 3,000 | 1,714 | 2061/3/20 |
| | 第16回利付国債（40年） | 1.3 | 1,690,000 | 1,165,102 | 2063/3/20 |
| | 第361回利付国債（10年） | 0.1 | 130,000 | 122,787 | 2030/12/20 |
| | 第365回利付国債（10年） | 0.1 | 660,000 | 615,370 | 2031/12/20 |
| | 第373回利付国債（10年） | 0.6 | 3,380,000 | 3,176,997 | 2033/12/20 |
| | 第374回利付国債（10年） | 0.8 | 1,690,000 | 1,611,229 | 2034/3/20 |
| | 第375回利付国債（10年） | 1.1 | 1,150,000 | 1,122,549 | 2034/6/20 |
| | 第376回利付国債（10年） | 0.9 | 690,000 | 659,288 | 2034/9/20 |
| | 第377回利付国債（10年） | 1.2 | 1,830,000 | 1,792,302 | 2034/12/20 |
| | 第31回利付国債（30年） | 2.2 | 523,000 | 548,689 | 2039/9/20 |
| | 第34回利付国債（30年） | 2.2 | 480,000 | 498,926 | 2041/3/20 |
| | 第48回利付国債（30年） | 1.4 | 7,000 | 6,164 | 2045/9/20 |
| | 第49回利付国債（30年） | 1.4 | 54,000 | 47,397 | 2045/12/20 |
| | 第52回利付国債（30年） | 0.5 | 1,010,000 | 722,604 | 2046/9/20 |
| | 第53回利付国債（30年） | 0.6 | 521,000 | 379,751 | 2046/12/20 |
| | 第55回利付国債（30年） | 0.8 | 590,000 | 446,429 | 2047/6/20 |
| | 第63回利付国債（30年） | 0.4 | 6,000 | 3,940 | 2049/6/20 |
| | 第64回利付国債（30年） | 0.4 | 34,000 | 22,194 | 2049/9/20 |
| | 第65回利付国債（30年） | 0.4 | 2,270,000 | 1,472,753 | 2049/12/20 |
| | 第66回利付国債（30年） | 0.4 | 4,890,000 | 3,153,267 | 2050/3/20 |
| | 第67回利付国債（30年） | 0.6 | 21,000 | 14,254 | 2050/6/20 |
| 第68回利付国債（30年） | 0.6 | 1,000 | 674 | 2050/9/20 | |
| 第69回利付国債（30年） | 0.7 | 189,000 | 130,534 | 2050/12/20 | |
| 第71回利付国債（30年） | 0.7 | 2,150,000 | 1,469,611 | 2051/6/20 | |
| 第72回利付国債（30年） | 0.7 | 27,000 | 18,366 | 2051/9/20 | |
| 第76回利付国債（30年） | 1.4 | 10,000 | 8,087 | 2052/9/20 | |
| 第77回利付国債（30年） | 1.6 | 374,000 | 316,725 | 2052/12/20 | |

| 債券種別 | 銘柄名 | 利率 | 額面金額 | 評価額 | 償還年月日 |
|---------------------|---------------------------------------|------------|------------|-----------|------------|
| 国債証券 | 第78回利付国債（30年） | 1.4 | 5,000 | 4,020 | 2053/3/20 |
| | 第80回利付国債（30年） | 1.8 | 10,000 | 8,826 | 2053/9/20 |
| | 第81回利付国債（30年） | 1.6 | 110,000 | 92,419 | 2053/12/20 |
| | 第84回利付国債（30年） | 2.1 | 1,290,000 | 1,213,657 | 2054/9/20 |
| | 第85回利付国債（30年） | 2.3 | 2,930,000 | 2,876,586 | 2054/12/20 |
| | 第160回利付国債（20年） | 0.7 | 19,000 | 17,084 | 2037/3/20 |
| | 第162回利付国債（20年） | 0.6 | 1,310,000 | 1,152,682 | 2037/9/20 |
| | 第163回利付国債（20年） | 0.6 | 4,980,000 | 4,360,886 | 2037/12/20 |
| | 第165回利付国債（20年） | 0.5 | 1,880,000 | 1,607,531 | 2038/6/20 |
| | 第166回利付国債（20年） | 0.7 | 190,000 | 166,156 | 2038/9/20 |
| | 第167回利付国債（20年） | 0.5 | 180,000 | 152,294 | 2038/12/20 |
| | 第169回利付国債（20年） | 0.3 | 1,310,000 | 1,064,257 | 2039/6/20 |
| | 第170回利付国債（20年） | 0.3 | 12,000 | 9,690 | 2039/9/20 |
| | 第171回利付国債（20年） | 0.3 | 2,828,000 | 2,270,148 | 2039/12/20 |
| | 第172回利付国債（20年） | 0.4 | 140,000 | 113,512 | 2040/3/20 |
| | 第173回利付国債（20年） | 0.4 | 1,790,000 | 1,442,811 | 2040/6/20 |
| | 第174回利付国債（20年） | 0.4 | 11,000 | 8,813 | 2040/9/20 |
| | 第175回利付国債（20年） | 0.5 | 4,670,000 | 3,783,867 | 2040/12/20 |
| | 第177回利付国債（20年） | 0.4 | 170,000 | 133,864 | 2041/6/20 |
| | 第178回利付国債（20年） | 0.5 | 5,000 | 3,983 | 2041/9/20 |
| | 第180回利付国債（20年） | 0.8 | 63,000 | 52,393 | 2042/3/20 |
| | 第181回利付国債（20年） | 0.9 | 122,000 | 102,777 | 2042/6/20 |
| | 第182回利付国債（20年） | 1.1 | 26,000 | 22,579 | 2042/9/20 |
| | 第183回利付国債（20年） | 1.4 | 26,000 | 23,657 | 2042/12/20 |
| | 第187回利付国債（20年） | 1.3 | 440,000 | 389,158 | 2043/12/20 |
| | 第188回利付国債（20年） | 1.6 | 9,600,000 | 8,910,720 | 2044/3/20 |
| 第189回利付国債（20年） | 1.9 | 980,000 | 953,745 | 2044/6/20 | |
| 第190回利付国債（20年） | 1.8 | 10,000 | 9,557 | 2044/9/20 | |
| 第26回利付国債（物価連動・10年） | 0.005 | 640,000 | 746,251 | 2031/3/10 | |
| 小計 | — | 74,693,000 | 64,891,270 | — | |
| 普通社債券 （含む投資法人債券） | 第1回関西電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.896 | 800,000 | 787,712 | 2082/3/20 |
| | 第2回関西電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.965 | 200,000 | 192,720 | 2082/3/20 |
| | 第1回中国電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.84 | 500,000 | 453,635 | 2061/12/23 |
| | 第2回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.09 | 100,000 | 98,422 | 2080/10/15 |
| | 日本生命第4回A号利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.91 | 600,000 | 591,060 | 2046/11/22 |
| | 日本生命第6回A号利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.05 | 400,000 | 393,000 | 2047/4/19 |
| | 第1回A号明治安田生命保険 | 1.08 | 1,600,000 | 1,572,592 | 2046/12/15 |
| | 第5回A号富国生命保険相互会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.07 | 300,000 | 275,784 | 2080/12/16 |
| | 第3回A号明治安田生命保険相互会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.11 | 1,300,000 | 1,269,892 | 2047/11/6 |

| 債券種別 | 銘柄名 | 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) | 第2回アフラック生命保険株式会社期限前償還条項付無担保社債 | 1.958 | 300,000 | 292,860 | 2053/12/5 |
| | 第1回住友生命第4回劣後ローン流動化株式会社社利払繰延条項・任意償還条項付無担保永久社債 | 1.884 | 1,650,000 | 1,627,362 | — |
| | 第3回大和ハウス工業株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.8 | 200,000 | 191,180 | 2059/9/25 |
| | 第4回大和ハウス工業株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.27 | 700,000 | 686,623 | 2059/9/25 |
| | 第2回徳水ハウス株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.713 | 2,400,000 | 2,377,080 | 2059/7/8 |
| | 第1回日本生命第9回劣後ローン流動化株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.824 | 1,100,000 | 1,091,079 | 2054/8/2 |
| | 第1回アサヒグループホールディングス株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.97 | 200,000 | 199,860 | 2080/10/15 |
| | 第4回サントリーホールディングス株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.174 | 100,000 | 99,045 | 2083/3/22 |
| | 第2回不二製油グループ本社株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.571 | 800,000 | 785,152 | 2054/4/25 |
| | 第3回ヒューリック株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.4 | 900,000 | 888,957 | 2057/7/2 |
| | 第7回ヒューリック株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 2.102 | 1,300,000 | 1,297,582 | 2060/3/6 |
| | 第2回森ビル株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.17 | 700,000 | 693,350 | 2056/10/19 |
| | 第1回東急不動産ホールディングス株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.06 | 300,000 | 298,818 | 2055/12/17 |
| | 第3回住友化学株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 3.3 | 600,000 | 614,658 | 2059/9/12 |
| | 第2回武田薬品工業株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.934 | 5,900,000 | 5,829,141 | 2084/6/25 |
| | 第13回ヤフー株式会社無担保社債 | 0.46 | 100,000 | 93,925 | 2029/7/31 |
| | 第17回Zホールディングス株式会社無担保社債 | 0.79 | 100,000 | 98,343 | 2027/6/11 |
| | 第18回Zホールディングス株式会社無担保社債 | 0.9 | 100,000 | 94,400 | 2030/6/11 |
| | 第20回Zホールディングス株式会社無担保社債 | 0.46 | 100,000 | 95,695 | 2028/7/28 |
| | 第21回Zホールディングス株式会社無担保社債 | 0.63 | 100,000 | 91,343 | 2031/7/28 |
| | 第23回Zホールディングス株式会社無担保社債 | 0.76 | 100,000 | 97,755 | 2027/9/28 |
| | 第24回Zホールディングス株式会社無担保社債 | 0.993 | 300,000 | 296,403 | 2027/9/10 |
| | 第25回Zホールディングス株式会社無担保社債 | 1.35 | 500,000 | 488,080 | 2029/9/12 |
| | 第3回楽天株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 3.0 | 100,000 | 95,332 | 2058/12/13 |
| | 第9回楽天株式会社無担保社債 | 0.42 | 100,000 | 94,116 | 2027/6/25 |
| | 第12回楽天株式会社無担保社債 | 0.35 | 100,000 | 97,117 | 2026/6/25 |
| | 第16回楽天グループ株式会社無担保社債 | 0.6 | 100,000 | 96,316 | 2026/12/2 |
| | 第17回楽天グループ株式会社無担保社債 | 0.8 | 100,000 | 90,866 | 2028/12/1 |
| | 第5回楽天株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 2.48 | 100,000 | 96,980 | 2057/11/4 |
| | 第6回楽天株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 3.0 | 100,000 | 93,810 | 2060/11/4 |
| | 第1回E N E O Sホールディングス株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.7 | 200,000 | 197,556 | 2081/6/15 |
| | 第2回E N E O Sホールディングス株式会社社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.97 | 100,000 | 92,021 | 2081/6/15 |

| 債券種別 | 銘柄名 | 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) | 第4回ENEOSホールディングス株式会社 利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.328 | 600,000 | 590,190 | 2083/9/20 |
| | 第2回日本製鉄株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.93 | 400,000 | 395,016 | 2079/9/12 |
| | 第3回日本製鉄株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.24 | 200,000 | 192,422 | 2079/9/12 |
| | 第5回日本製鉄株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.882 | 100,000 | 98,190 | 2061/6/13 |
| | 第4回日本製鉄株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.534 | 1,600,000 | 1,576,496 | 2059/6/13 |
| | 第1回日本生命第8回劣後ローン流動化株式会 社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.1 | 700,000 | 690,284 | 2052/9/28 |
| | 第3回DMG森精機株式会社利払繰延 条項・任意償還条項付無担保永久社債 | 2.4 | 100,000 | 98,076 | — |
| | 第1回パナソニック株式会社利払繰延 条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.74 | 800,000 | 790,240 | 2081/10/14 |
| | 第2回パナソニック株式会社利払繰延 条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.885 | 700,000 | 672,280 | 2081/10/14 |
| | 第3回パナソニック株式会社利払繰延 条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.0 | 100,000 | 91,052 | 2081/10/14 |
| | 第1回株式会社かんぼ生命保険利払繰 延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.0 | 400,000 | 386,200 | 2049/1/29 |
| | 第2回株式会社かんぼ生命保険利払繰 延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.05 | 1,000,000 | 941,300 | 2051/1/28 |
| | 第2回アイシン精機株式会社利払繰延 条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.41 | 100,000 | 97,735 | 2080/2/28 |
| | 第1回日本生命第1回劣後ローン流動化株式会 社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.05 | 860,000 | 840,744 | 2048/4/27 |
| | 第1回日本生命第2回劣後ローン流動化株式会 社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.03 | 900,000 | 874,494 | 2048/9/18 |
| | 第1回日本生命第3回劣後ローン流動化株式会 社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.95 | 110,000 | 105,650 | 2049/4/22 |
| | 第1回日本生命第4回劣後ローン流動化株式会 社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.85 | 100,000 | 94,730 | 2049/11/21 |
| | 第6回楽天カード株式会社無担保社債 | 0.62 | 100,000 | 96,169 | 2026/12/17 |
| | 第1回日本生命第5回劣後ローン流動化株式会 社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.05 | 350,000 | 330,260 | 2050/9/23 |
| | 第1回日本生命第6回劣後ローン流動化株式会 社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.97 | 550,000 | 511,868 | 2051/5/11 |
| | 第1回明治安田生命第1回劣後ローン流動化株式会社利払繰延条項 | 0.88 | 450,000 | 414,823 | 2051/8/2 |
| | 第1回全共連第1回劣後ローン流動化株式会社 利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.87 | 50,000 | 45,660 | 2051/10/25 |
| | 第1回丸紅株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.82 | 700,000 | 694,869 | 2081/3/4 |
| | 第6回三菱商事株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.85 | 100,000 | 99,120 | 2076/9/13 |
| | 第7回三菱商事株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.51 | 200,000 | 196,942 | 2081/9/13 |
| | 第1回エプロ株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.6 | 200,000 | 200,000 | 2055/9/28 |
| 第7回イオン株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.74 | 700,000 | 669,305 | 2050/12/2 | |
| 第15回株式会社三菱UFJフィナンシャル・ グループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.069 | 600,000 | 587,658 | — | |

| 債券種別 | 銘柄名 | 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) | 第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.804 | 900,000 | 897,102 | — |
| | 第19回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.963 | 1,200,000 | 1,198,332 | — |
| | 第21回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.912 | 700,000 | 695,093 | — |
| | 第23回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ任意償還条項付無担保永久社債 | 2.006 | 1,000,000 | 993,090 | — |
| | 第25回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ任意償還条項付無担保永久社債 | 2.08 | 300,000 | 298,938 | — |
| | 第5回三井住友トラスト・ホールディングス株式会社任意償還条項付無担保永久社債 | 1.28 | 100,000 | 98,160 | — |
| | 第7回三井住友トラストグループ株式会社任意償還条項付無担保永久社債 | 2.056 | 300,000 | 297,990 | — |
| | 第4回株式会社三井住友フィナンシャルグループ期限前償還条項付無担保永久社債 | 1.39 | 400,000 | 397,536 | — |
| | 第11回株式会社三井住友フィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.879 | 300,000 | 299,460 | — |
| | 第13回株式会社三井住友フィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.889 | 1,000,000 | 995,000 | — |
| | 第15回株式会社三井住友フィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.844 | 200,000 | 197,980 | — |
| | 第17回株式会社三井住友フィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 2.045 | 400,000 | 398,320 | — |
| | 第5回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.44 | 1,300,000 | 1,274,858 | — |
| | 第10回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.232 | 300,000 | 299,823 | — |
| | 第12回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 0.937 | 600,000 | 596,046 | — |
| | 第13回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.156 | 300,000 | 272,124 | — |
| | 第15回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.785 | 1,100,000 | 1,086,316 | — |
| | 第17回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 1.966 | 1,300,000 | 1,288,924 | — |
| | 第19回株式会社みずほフィナンシャルグループ任意償還条項付無担保永久社債 | 2.036 | 400,000 | 396,824 | — |
| | 第3回東京センチュリー株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.66 | 1,100,000 | 1,043,856 | 2080/7/30 |
| | 第4回東京センチュリー株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.929 | 1,200,000 | 1,184,376 | 2059/12/10 |
| | 第26回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 0.8 | 200,000 | 197,998 | 2026/7/24 |
| | 第32回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 1.1 | 100,000 | 99,810 | 2025/12/5 |
| | 第34回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 0.95 | 600,000 | 595,830 | 2026/6/5 |
| | 第35回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 1.15 | 100,000 | 97,988 | 2028/6/6 |
| | 第36回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 1.28 | 350,000 | 346,136 | 2027/9/22 |
| | 第37回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 1.0 | 500,000 | 493,945 | 2027/3/5 |

| 債券種別 | 銘柄名 | 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) | 第40回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 1.346 | 200,000 | 196,762 | 2028/10/23 |
| | 第41回SBIホールディングス株式会社無担保社債 | 1.45 | 600,000 | 597,144 | 2028/1/21 |
| | 第24回イオンフィナンシャルサービス株式会社 | 1.47 | 100,000 | 100,005 | 2028/2/25 |
| | 第2回オリックス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.91 | 900,000 | 846,360 | 2080/3/13 |
| | 第5回オリックス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 2.011 | 100,000 | 99,007 | 2060/3/18 |
| | 第6回オリックス株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.728 | 100,000 | 97,890 | 2060/3/31 |
| | 第1回三菱HCキャピタル株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.63 | 1,000,000 | 983,140 | 2081/9/27 |
| | 第3回株式会社大和証券グループ本社任意償還条項付無担保永久社債 | 2.199 | 1,000,000 | 993,000 | — |
| | 第3回野村ホールディングス株式会社任意償還条項付無担保永久社債 | 1.3 | 700,000 | 696,899 | — |
| | 第2回MS&ADインシュアランスグループホールディングス | 1.24 | 200,000 | 198,900 | 2076/12/25 |
| | 第2回第一生命ホールディングス株式会社利払繰延条項・任意償還条項付無担保永久社債 | 1.0 | 100,000 | 94,950 | — |
| | 第3回第一生命ホールディングス株式会社利払繰延条項・任意償還条項付無担保永久社債 | 1.124 | 300,000 | 279,885 | — |
| | 第1回東京海上日動火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.96 | 100,000 | 96,011 | 2079/12/24 |
| | 第2回三井住友海上火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.39 | 2,000,000 | 2,002,600 | 2076/2/10 |
| | 第4回三井住友海上火災保険株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.17 | 300,000 | 295,830 | 2077/12/10 |
| | 第1回損害保険ジャパン日本興亜株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.84 | 1,430,000 | 1,415,843 | 2046/8/8 |
| | 第2回損害保険ジャパン日本興亜株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.84 | 800,000 | 792,080 | 2076/8/8 |
| | 第3回損害保険ジャパン日本興亜株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.06 | 300,000 | 296,340 | 2077/4/26 |
| | 第3回株式会社T&Dホールディングス利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 0.94 | 200,000 | 188,906 | 2050/2/4 |
| | 第4回三菱地所株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.48 | 600,000 | 597,360 | 2076/2/3 |
| | 第1回日本航空株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.6 | 600,000 | 588,660 | 2058/10/11 |
| | 第4回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 0.5 | 100,000 | 93,548 | 2030/3/18 |
| | 第7回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 0.58 | 200,000 | 186,254 | 2030/7/29 |
| | 第10回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 0.57 | 100,000 | 92,604 | 2030/12/3 |
| | 第13回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 0.52 | 100,000 | 91,321 | 2031/6/3 |
| | 第16回ソフトバンク株式会社無担保社債（社債間限定同順位特約付） | 0.52 | 300,000 | 272,262 | 2031/10/10 |
| | 第19回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 0.98 | 700,000 | 688,443 | 2028/3/10 |
| | 第21回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 0.82 | 100,000 | 97,534 | 2028/7/12 |
| | 第24回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 1.24 | 200,000 | 192,170 | 2031/1/31 |
| | 第26回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 1.189 | 600,000 | 588,444 | 2029/5/25 |
| | 第27回ソフトバンク株式会社無担保社債 | 1.81 | 400,000 | 394,132 | 2032/2/4 |
| 第28回株式会社光通信無担保社債 | 1.2 | 100,000 | 94,512 | 2030/7/12 | |
| 第30回株式会社光通信無担保社債 | 0.98 | 100,000 | 92,054 | 2031/1/31 | |
| 第31回株式会社光通信無担保社債 | 1.38 | 500,000 | 405,740 | 2036/2/1 | |

| 債券種別 | 銘柄名 | 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) | 第33回株式会社光通信無担保社債 | 0.85 | 100,000 | 90,277 | 2031/6/16 |
| | 第1回東北電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.545 | 900,000 | 897,516 | 2057/9/14 |
| | 第2回東北電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.754 | 200,000 | 198,098 | 2059/9/12 |
| | 第3回九州電力株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 1.3 | 1,800,000 | 1,720,512 | 2080/10/15 |
| | 第39回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 1.08 | 400,000 | 387,820 | 2030/7/16 |
| | 第47回東京電力パワーグリッド株式会社社債 | 0.68 | 200,000 | 186,060 | 2031/8/29 |
| | 第2回株式会社レノバ無担保社債 | 1.39 | 200,000 | 193,700 | 2027/9/3 |
| | 第1回株式会社JERA利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 2.144 | 1,100,000 | 1,110,560 | 2057/12/25 |
| | 第3回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債 | 2.4 | 450,000 | 437,197 | 2028/9/29 |
| | 第5回ソフトバンクグループ株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 2.75 | 1,070,000 | 1,067,678 | 2056/6/21 |
| | 第5回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債 | 2.48 | 550,000 | 532,763 | 2029/2/2 |
| | 第6回ソフトバンクグループ株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 4.75 | 1,000,000 | 1,009,890 | 2058/4/26 |
| | 第58回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債 | 2.84 | 200,000 | 197,684 | 2029/12/14 |
| | 第61回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債 | 2.441 | 800,000 | 785,488 | 2029/4/25 |
| | 第4回ソフトバンクグループ株式会社利払繰延条項・期限前償還条項付無担保社債 | 3.0 | 1,600,000 | 1,602,240 | 2056/2/4 |
| | 第4回ソフトバンクグループ株式会社無担保社債 | 2.4 | 100,000 | 97,198 | 2028/9/15 |
| | 第21回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー期限前償還条項付非上位円貨社債 | 1.365 | 200,000 | 199,120 | 2027/12/14 |
| | 第36回ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 | 0.895 | 300,000 | 297,825 | 2026/12/14 |
| | 第15回クレディ・アグリコル・エス・エー期限前償還条項付非上位円貨社債 | 1.114 | 400,000 | 396,128 | 2028/1/26 |
| | アフラック | 2.108 | 100,000 | 99,209 | 2047/10/23 |
| 小計 | — | 81,170,000 | 79,594,806 | — | |
| 合計 | — | 155,863,000 | 144,486,076 | — | |

(注) 額面金額・評価額の単位未満は切り捨てております。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄別 | 当期末 | |
|--------------|---------------|----------|
| | 買建額 | 売建額 |
| 国内 債券先物取引 | 百万円 12,528 | 百万円 — |

(注1) 単位未満は切り捨てております。

(注2) —印は組み入れなしです。

オプションの銘柄別期末残高

| 銘柄別 | | | コール・ プット別 | 当 期 | |
|-----|-----------|------|--------------|-----------|----------|
| | | | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 債券オプション取引 | 債券店頭 | コール | 百万円 24 | 百万円 - |
| | | | プット | - | 43 |

(注1) 単位未満は切り捨てております。

(注2) -印は組み入れなしです。

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 |
| 金 利 ス ワ ッ プ | 110,500百万円 |
| 合 計 | 110,500百万円 |

○有価証券の貸付及び借入の状況

(2025年3月5日現在)

該当事項はありません。

○特定資産の価格等に関する調査

当ファンドにおいて行った取引のうち、投資信託及び投資法人に関する法律により価格等の調査が必要とされた資産の取引については、PwC Japan有限責任監査法人へその調査を依頼しました。

対象期間中（2024年3月6日から2025年3月5日まで）に該当した取引は、金利スワップ取引の新規契約59件、解約54件、債券店頭オプション取引の買38件、売38件があり、当該取引については、取引の相手方の名称、銘柄、約定数値、想定元本その他の当該取引の内容に関することについて、当該監査法人からの調査報告書を受領しております。

○投資信託財産の構成

(2025年3月5日現在)

| 項 目 | 当 期 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 公社債 | 千円 144,486,076 | % 97.5 |
| コール・ローン等、その他 | 3,772,045 | 2.5 |
| 投資信託財産総額 | 148,258,121 | 100.0 |

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

○資産、負債、元本および基準価額の状況（2025年3月5日現在）

| 項目 | 当 期 末 |
|-----------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 147,680,909,811 |
| コール・ローン等 | 1,692,389,203 |
| 公社債（評価額） | 144,486,076,783 |
| コール・オプション（買） | 24,938,200 |
| 未収入金 | 299,711,000 |
| 未収利息 | 597,794,603 |
| 前払費用 | 103,609,127 |
| 差入委託証拠金 | 476,390,895 |
| (B) 負債 | 2,265,060,112 |
| プット・オプション（売） | 43,879,000 |
| 未払金 | 1,828,418,955 |
| 未払解約金 | 210,066,430 |
| 未払利息 | 182,695,727 |
| (C) 純資産総額（A－B） | 145,415,849,699 |
| 元本 | 153,553,107,848 |
| 次期繰越損益金 | △ 8,137,258,149 |
| (D) 受益権総口数 | 153,553,107,848口 |
| 1万口当たり基準価額（C／D） | 9,470円 |

（注1）当親ファンドの期首元本額は93,819,433,867円、期中追加設定元本額は67,978,057,128円、期中一部解約元本額は8,244,383,147円です。

（注2）当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は以下の通りです。

| | |
|---|------------------|
| マニュアルF・日本債券ストラテジック・アクティブ・ファンドF（適格機関投資家専用） | 46,127,472,653円 |
| マニュアルF OF s用日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用） | 102,990,519,562円 |
| マニュアルF 日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用） | 4,435,012,943円 |
| マニュアルF W用 日本債券ストラテジックファンド（適格機関投資家専用） | 102,690円 |

（注3）1口当たり純資産額は0.9470円です。

（注4）貸借対照表上の純資産総額が元本総額を下回っており、その差額は8,137,258,149円です。

○損益の状況（2024年3月6日～2025年3月5日）

| 項目 | 当 期 |
|--------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 1,404,636,669 |
| 受取利息 | 1,726,242,083 |
| 支払利息 | △ 321,605,414 |
| (B) 有価証券売買損益 | △3,906,296,279 |
| 売買益 | 766,214,481 |
| 売買損 | △4,672,510,760 |
| (C) 先物取引等取引損益 | △1,670,923,177 |
| 取引益 | 1,554,120,873 |
| 取引損 | △3,225,044,050 |
| (D) 信託報酬等 | △ 1,616,845 |
| (E) 当期損益金（A＋B＋C＋D） | △4,174,199,632 |
| (F) 前期繰越損益金 | △2,034,544,468 |
| (G) 追加信託差損益金 | △2,219,864,235 |
| (H) 解約差損益金 | 291,350,186 |
| (I) 計（E＋F＋G＋H） | △8,137,258,149 |
| 次期繰越損益金（I） | △8,137,258,149 |

（注1）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。

（注2）損益の状況の中で（D）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。

（注3）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。

（注4）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

◆約款変更
該当事項はありません。

◆運用体制の変更
該当事項はありません。