

ファンドラップ（ウエルス・スクエア） 債券・安定型

運用報告書(全体版)

第 1 期（決算日2017年 3 月29日）

作成対象期間（2016年10月20日～2017年 3 月29日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

商 品 分 類	追加型投信／内外／債券
信 託 期 間	2016年10月20日以降、無期限とします。
運 用 方 針	主として、世界の債券（主として、投資適格格付が付与されているもしくは同等の信用度を有すると判断される世界の公社債など）を、実質的な投資対象とする投資信託証券に投資し、安定した収益の確保と中長期的な信託財産の成長を目標に運用を行うことを基本とします。 投資する投資信託証券については、実質的な外貨建て資産については為替ヘッジを行うことを基本とするもの、もしくはこれらに類するものに限定することを基本とします。ただし、外貨建て投資信託証券に投資する場合は、当該投資信託証券に対して為替変動リスクを回避する目的で外国為替予約取引を用いる場合があります。 投資信託証券への投資にあたっては、株式会社ウエルス・スクエアによる各投資信託証券の期待リターンやリスク水準等の定量分析および投資環境等の定性判断等に基づく投資配分比率に関する助言をもとに各投資信託証券への配分比率を決定します。なお、組入投資信託証券については適宜見直しを行います。
主 な 投 資 対 象	主として有価証券に投資する投資信託証券を主要投資対象とします。なお、コマーシャル・ペーパー等の短期有価証券ならびに短期金融商品等に直接投資する場合があります。
主 な 投 資 制 限	投資信託証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。
分 配 方 針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等から、基準価額水準等を勘案して分配します。留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1



サポートダイヤル 0120-753104

〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金 騰 落 中 率			
(設定日) 2016年10月20日	円 10,000		円 —	% —	% —	% —	百万円 1
1 期 (2017年 3 月29日)	9,755		0	△2.5	94.2	—	586

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

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

*当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準	価 額		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰	落 率		
(設定日) 2016年10月20日	円 10,000		% —	% —	% —
10月末	9,951		△0.5	97.6	—
11月末	9,814		△1.9	93.9	—
12月末	9,789		△2.1	98.3	—
2017年 1 月末	9,719		△2.8	97.3	—
2 月末	9,768		△2.3	97.9	—
(期 末) 2017年 3 月29日	9,755		△2.5	94.2	—

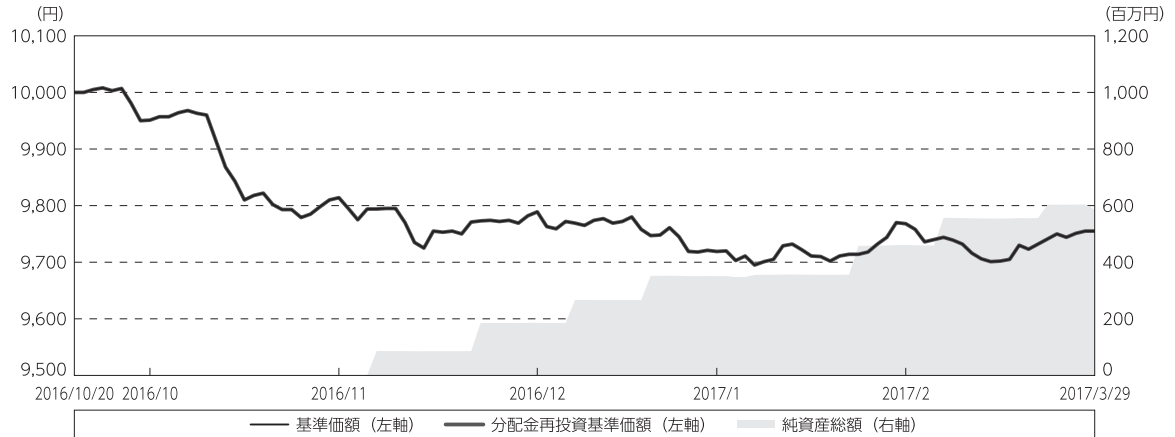
*騰落率は設定日比です。

*当ファンドはマザーファンドを組み入れますので、「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



設定日：10,000円

期 末：9,755円（既払分配金（税込み）：0円）

騰落率：△ 2.5%（分配金再投資ベース）

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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、設定時10,000円から期末9,755円となりました。

（下落要因）

- ・ 外国債券為替ヘッジ型マザーファンドが値下がりしたこと
- ・ 国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンドが値下がりしたこと

○投資環境

＜世界債券市場＞

好調な米経済指標を受けてFRB（米連邦準備制度理事会）による2016年内の利上げ観測が高まったことや、11月にトランプ氏が米国大統領選挙で勝利し同氏の掲げる政策によりインフレ率上昇への警戒感が高まったことなどから、設定時より軟調に推移しました。その後も、原油価格の上昇などを背景に世界的に金利が上昇したことや、12月にFOMC（米連邦公開市場委員会）で利上げが決定され、更に2017年以降の利上げペースの加速が意識されたことなどから軟調に推移し、当作成期間では値下がりとなりました。

○当ファンドのポートフォリオ

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

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

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

・投資信託証券組入比率

投資方針に基づいて、当作成期を通じて高位の組入れを維持しました。

・指定投資信託証券の見直し

ウエルス・スクエアからの助言に基づき、当期において投資対象ファンドの見直しは行いませんでした。

・指定投資信託証券の組入れ比率推移

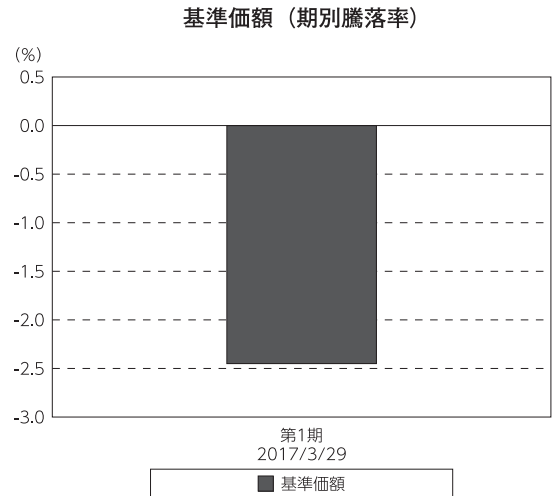
ファンド名	期首	11月末	12月末	1月末	2月末	期末
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	44.7%	47.0%	69.2%	69.4%	69.2%	73.4%
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	54.3%	45.8%	29.8%	29.6%	29.8%	21.6%

※ファンドは平成28年10月20日の当初設定後、順次投資信託証券の組み入れを行いました。上図の期首の数値は、平成28年10月31日時点の投資比率です。

○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドでは、値動きを表す適切な指数が存在しないため、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

◎分配金

収益分配金については、基準価額水準等を勘案して決定しました。

留保益の運用については、特に制限を設けず、元本部分と同一の運用を行います。

○分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり・税込み)

項 目	第 1 期
	2016年10月20日～ 2017年 3 月29日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	21

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

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

◎今後の運用方針

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

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

組入投資信託証券については適宜見直しを行います。

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

(2016年10月20日～2017年3月29日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 13	% 0.133	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(9)	(0.095)	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)	(2)	(0.024)	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)	(1)	(0.014)	ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.000	(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
(先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	(0)	(0.000)	
(c) そ の 他 費 用	1	0.007	(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)	(1)	(0.006)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	14	0.140	
期中の平均基準価額は、9,808円です。			

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

* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

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

○売買及び取引の状況

(2016年10月20日～2017年3月29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
	千口	千円	千口	千円
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	332,232	432,127	1,579	2,048
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	160,606	179,664	47,534	53,202

*単位未満は切り捨て。

○利害関係人との取引状況等

(2016年10月20日～2017年3月29日)

利害関係人との取引状況

<ファンドラップ（ウエルス・スクエア）債券・安定型>
該当事項はございません。

<国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド>

区 分	買付額等 A	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 70,188	百万円 405	% 0.6	百万円 48,217	百万円 —	% —

平均保有割合 0.0%

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

<外国債券為替ヘッジ型マザーファンド>
該当事項はございません。

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

○自社による当ファンドの設定、解約状況

(2016年10月20日～2017年3月29日)

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

○組入資産の明細

(2017年 3 月29日現在)

親投資信託残高

銘	柄	当 期 末	
		口 数	評 価 額
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド		千口 330, 653	千円 430, 212
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド		113, 072	126, 674

*口数・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2017年 3 月29日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド	千円 430, 212	% 71. 2
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド	126, 674	21. 0
コール・ローン等、その他	47, 279	7. 8
投資信託財産総額	604, 165	100. 0

- *金額の単位未満は切り捨て。
- *外国債券為替ヘッジ型マザーファンドにおいて、当期末における外貨建て純資産（14,862,295千円）の投資信託財産総額（15,132,156千円）に対する比率は98.2%です。
- *外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝111.05円、1カナダドル＝82.96円、1英ポンド＝137.84円、1スイスフラン＝111.95円、1スウェーデンクローナ＝12.57円、1ノルウェークローネ＝13.04円、1デンマーククローネ＝16.15円、1ユーロ＝120.12円、1ズロチ＝28.34円、1シンガポールドル＝79.50円、1豪ドル＝84.91円、1メキシコペソ＝5.84円、1ランド＝8.57円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年3月29日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	604,165,168
コール・ローン等	7,109,485
国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド(評価額)	430,212,862
外国債券為替ヘッジ型マザーファンド(評価額)	126,674,897
未収入金	40,167,924
(B) 負債	17,858,876
未払解約金	17,541,166
未払信託報酬	315,458
未払利息	9
その他未払費用	2,243
(C) 純資産総額(A－B)	586,306,292
元本	601,006,668
次期繰越損益金	△ 14,700,376
(D) 受益権総口数	601,006,668口
1万口当たり基準価額(C／D)	9,755円

(注) 期首元本額は1,000,000円、期中追加設定元本額は621,499,157円、期中一部解約元本額は21,492,489円、1口当たり純資産額は0.9755円です。

○損益の状況（2016年10月20日～2017年3月29日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,352
支払利息	△ 1,352
(B) 有価証券売買損益	382,201
売買益	417,127
売買損	△ 34,926
(C) 信託報酬等	△ 317,701
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	63,148
(E) 追加信託差損益金	△14,763,524
(配当等相当額)	(△ 2,271)
(売買損益相当額)	(△14,761,253)
(F) 計(D＋E)	△14,700,376
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F＋G)	△14,700,376
追加信託差損益金	△14,763,524
(配当等相当額)	(516,912)
(売買損益相当額)	(△15,280,436)
分配準備積立金	769,890
繰越損益金	△ 706,742

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

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

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

(注) 分配金の計算過程（2016年10月20日～2017年3月29日）は以下の通りです。

項 目	当 期
	2016年10月20日～ 2017年3月29日
a. 配当等収益(経費控除後)	769,890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	516,912円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	0円
e. 分配対象収益(a＋b＋c＋d)	1,286,802円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	21円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金（税込み）	0円
-----------------	----

※分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合

分配金は全額普通分配金となります。

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

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

※分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合

分配金は全額元本払戻金（特別分配金）となります。

○お知らせ

該当事項はございません。

国内債券NOMURA-BPI総合 マザーファンド

運用報告書

第14期（決算日2016年3月31日）

作成対象期間（2015年4月1日～2016年3月31日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1

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

○最近５期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰	中 落 率	NOMURA-BPI 総 合	期 騰 落 中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
10期(2012年４月２日)	11,591	2.8	337.688	2.8	98.9	—	233,348
11期(2013年４月１日)	12,027	3.8	350.376	3.8	99.3	—	260,210
12期(2014年３月31日)	12,109	0.7	352.801	0.7	99.0	—	290,791
13期(2015年３月31日)	12,467	3.0	363.279	3.0	99.6	—	510,034
14期(2016年３月31日)	13,141	5.4	382.913	5.4	99.5	—	656,174

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

○当期中の基準価額と市況等の推移

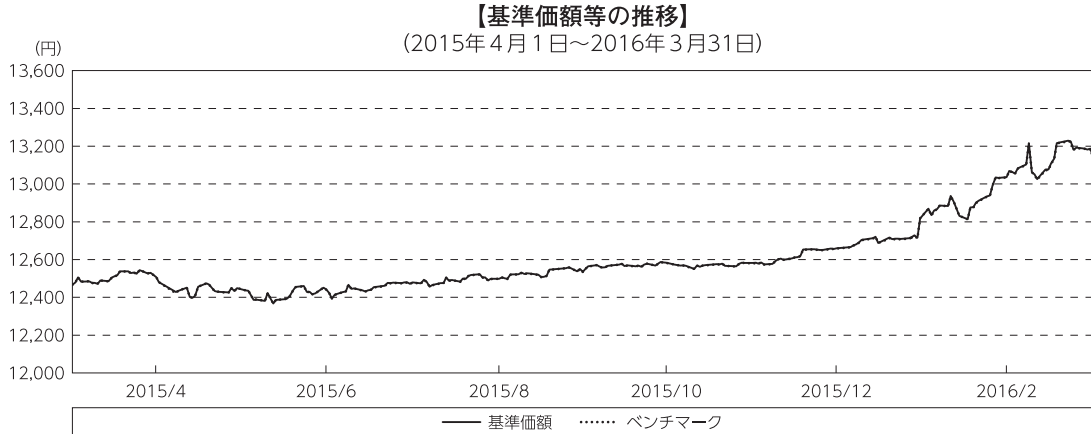
年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	期 騰	中 落 率	NOMURA-BPI 総 合	期 騰 落 中 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2015年３月31日	12,467	—	363.279	—	99.6	—
４月末	12,507	0.3	364.501	0.3	99.6	—
５月末	12,449	△0.1	362.770	△0.1	99.4	—
６月末	12,443	△0.2	362.542	△0.2	99.2	—
７月末	12,479	0.1	363.584	0.1	99.6	—
８月末	12,499	0.3	364.201	0.3	98.1	—
９月末	12,535	0.5	365.235	0.5	99.3	—
10月末	12,583	0.9	366.655	0.9	99.4	—
11月末	12,582	0.9	366.578	0.9	99.2	—
12月末	12,660	1.5	368.877	1.5	99.2	—
2016年１月末	12,818	2.8	373.520	2.8	98.3	—
２月末	13,036	4.6	379.830	4.6	98.5	—
(期 末)						
2016年３月31日	13,141	5.4	382.913	5.4	99.5	—

*騰落率は期首比です。

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

◎運用経過

○期中の基準価額等の推移



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

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首12,467円から期末13,141円に674円の値上がりとなりました。

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

○投資環境

期首から2015年6月中旬にかけては、円安の進行や2015年1-3月期実質GDP（国内総生産）成長率が景気の拡大を示したことを受けて国内株式市場が上昇したことなどから、国内債券市場は軟調となりました。その後は8月中旬から9月下旬や2016年1月から2月中旬にかけては、世界的な株価下落に伴い世界経済の先行きに不透明感が高まりました。日銀が国債買い入れの平均残存年限長期化を発表したことや、マイナス金利政策の導入を決定したことなどを背景に、国内債券市場は堅調となり国内債券利回りは低下（価格は上昇）しました。

○当ファンドのポートフォリオ

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

○当ファンドのベンチマークとの差異

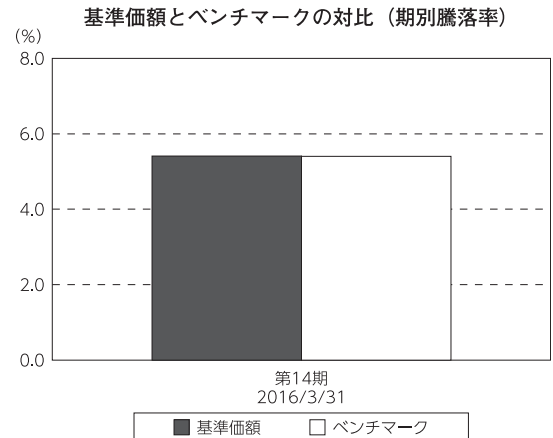
今期の基準価額の騰落率は+5.4%となり、ベンチマークの+5.4%とほぼ同程度となりました。主な差異要因は以下の通りです。

（マイナス要因）

資金流出入に伴う取引でコストが生じること。

（その他の要因）

ベンチマークとファンドで評価時価に違いがあること。



（注）ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。

◎今後の運用方針

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

○１万口当たりの費用明細

(2015年４月１日～2016年３月31日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2015年４月１日～2016年３月31日)

公社債

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

*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

*単位未満は切り捨て。

*（ ）内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

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

○利害関係人との取引状況等

(2015年４月１日～2016年３月31日)

利害関係人との取引状況

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

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

○組入資産の明細

(2016年3月31日現在)

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	455,315,000 (3,160,000)	513,500,283 (4,743,391)	78.3 (0.7)	— (—)	51.5 (0.7)	21.2 (0.0)	5.6 (0.0)
地方債証券	49,021,020 (49,021,020)	51,844,038 (51,844,038)	7.9 (7.9)	— (—)	3.4 (3.4)	3.4 (3.4)	1.1 (1.1)
特殊債券 (除く金融債)	48,158,183 (48,158,183)	51,196,816 (51,196,816)	7.8 (7.8)	— (—)	4.4 (4.4)	1.9 (1.9)	1.5 (1.5)
金融債券	6,150,000 (6,150,000)	6,191,268 (6,191,268)	0.9 (0.9)	— (—)	— (—)	0.3 (0.3)	0.6 (0.6)
普通社債券 (含む投資法人債券)	28,907,000 (28,907,000)	30,007,290 (30,007,290)	4.6 (4.6)	— (—)	2.0 (2.0)	1.8 (1.8)	0.8 (0.8)
合 計	587,551,203 (135,396,203)	652,739,697 (143,982,805)	99.5 (21.9)	— (—)	61.3 (10.4)	28.6 (7.4)	9.7 (4.1)

* () 内は非上場債で内書きです。

*組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

*金額の単位未満は切り捨て。

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

*残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

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

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (10年) 第301回	1.5	1,500,000	1,583,430	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第302回	1.4	700,000	736,666	2019/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第303回	1.4	3,300,000	3,485,328	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第304回	1.3	1,000,000	1,052,670	2019/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第305回	1.3	4,100,000	4,331,609	2019/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第306回	1.4	3,000,000	3,192,180	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第307回	1.3	1,700,000	1,802,102	2020/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第308回	1.3	1,700,000	1,808,290	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第309回	1.1	3,000,000	3,165,600	2020/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第310回	1.0	3,700,000	3,898,172	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第311回	0.8	1,800,000	1,880,208	2020/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第312回	1.2	4,950,000	5,277,145	2020/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第313回	1.3	3,200,000	3,437,824	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第314回	1.1	2,200,000	2,341,482	2021/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第315回	1.2	2,600,000	2,790,918	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第316回	1.1	1,400,000	1,495,438	2021/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第317回	1.1	1,800,000	1,928,700	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第318回	1.0	3,200,000	3,411,136	2021/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第319回	1.1	1,850,000	1,988,380	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第320回	1.0	3,500,000	3,741,605	2021/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第321回	1.0	3,200,000	3,430,528	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第322回	0.9	2,400,000	2,558,424	2022/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第323回	0.9	2,700,000	2,885,868	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第324回	0.8	3,200,000	3,400,160	2022/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第325回	0.8	4,900,000	5,217,373	2022/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第326回	0.7	2,100,000	2,226,315	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第327回	0.8	3,800,000	4,054,372	2022/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第328回	0.6	5,500,000	5,802,280	2023/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第329回	0.8	5,300,000	5,675,293	2023/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第330回	0.8	4,800,000	5,149,968	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第331回	0.6	1,900,000	2,009,820	2023/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第332回	0.6	6,400,000	6,777,152	2023/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第333回	0.6	5,500,000	5,829,890	2024/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第334回	0.6	4,100,000	4,350,182	2024/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第335回	0.5	4,700,000	4,951,215	2024/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第336回	0.5	2,700,000	2,846,124	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第337回	0.3	3,700,000	3,835,124	2024/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第338回	0.4	4,900,000	5,123,783	2025/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第339回	0.4	5,900,000	6,168,509	2025/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第340回	0.4	6,000,000	6,274,560	2025/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第341回	0.3	5,900,000	6,110,453	2025/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第342回	0.1	1,300,000	1,319,513	2026/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第1回	2.8	100,000	136,047	2029/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第2回	2.4	200,000	262,624	2030/2/20
国庫債券	利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	208,449	2030/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第4回	2.9	900,000	1,256,112	2030/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	195,046	2031/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第6回	2.4	700,000	935,529	2031/11/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第 7 回	2.3	600,000	796,212	2032/ 5 /20
国庫債券	利付 (30年) 第 8 回	1.8	100,000	124,955	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年) 第 9 回	1.4	65,000	76,991	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	283,877	2033/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	197,467	2033/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	286,662	2033/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	373,227	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	1,086,280	2034/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,239,750	2034/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,262,736	2034/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,636,332	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	1,500,000	2,021,835	2035/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	1,600,000	2,159,664	2035/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,900,000	2,637,143	2035/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	1,400,000	1,892,940	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	835,200	2036/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,170,943	2036/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	978,047	2036/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	680,410	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,175,329	2037/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	1,550,000	2,184,740	2037/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	700,000	990,731	2038/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	800,000	1,121,680	2038/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	900,000	1,249,065	2039/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,000,000	1,372,840	2039/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	1,900,000	2,663,059	2040/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,000,000	2,680,180	2040/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	2,300,000	3,199,553	2041/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	3,107,323	2041/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	1,800,000	2,442,816	2042/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,100,000	2,810,073	2042/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,400,000	1,845,522	2043/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,600,000	2,154,576	2043/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,100,000	1,455,850	2043/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,000,000	1,299,980	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,200,000	1,560,876	2044/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,694,056	2044/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,827,700	2044/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,900,000	2,383,018	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,300,000	1,632,969	2045/ 3 /20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,900,000	2,438,916	2045/ 6 /20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,400,000	1,723,554	2045/ 9 /20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	1,400,000	1,725,948	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	300,000	320,940	2046/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第36回	3.0	380,000	397,841	2017/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第37回	3.1	320,000	335,494	2017/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第38回	2.7	170,000	179,712	2018/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第39回	2.6	511,000	539,186	2018/ 3 /20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第40回	2.3	525,000	557,555	2018/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第41回	1.5	255,000	267,982	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第42回	2.6	683,000	740,030	2019/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第43回	2.9	400,000	443,240	2019/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第44回	2.5	150,000	166,095	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第45回	2.4	242,000	267,001	2020/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第46回	2.2	90,000	99,079	2020/6/22
国庫債券	利付 (20年) 第47回	2.2	1,230,000	1,362,089	2020/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第48回	2.5	200,000	225,488	2020/12/21
国庫債券	利付 (20年) 第49回	2.1	200,000	222,840	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第50回	1.9	183,000	202,066	2021/3/22
国庫債券	利付 (20年) 第51回	2.0	310,000	345,656	2021/6/21
国庫債券	利付 (20年) 第52回	2.1	100,000	112,616	2021/9/21
国庫債券	利付 (20年) 第53回	2.1	250,000	282,980	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第54回	2.2	250,000	284,422	2021/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第55回	2.0	231,000	261,425	2022/3/21
国庫債券	利付 (20年) 第56回	2.0	120,000	136,430	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第57回	1.9	210,000	237,434	2022/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第58回	1.9	180,000	204,415	2022/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第59回	1.7	230,000	259,377	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第60回	1.4	780,000	863,733	2022/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第61回	1.0	300,000	324,831	2023/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	471,156	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	343,020	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	462,236	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	527,777	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	345,645	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	360,898	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	344,615	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	660,956	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	653,383	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	238,674	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	670,000	797,166	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,600,000	1,896,960	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	1,300,000	1,552,044	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	718,998	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	1,074,036	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	832,510	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	947,424	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	1,026,461	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	900,000	1,082,556	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	430,988	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	989,502	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,659,083	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,441,488	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	485,832	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,400,000	1,728,412	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	612,290	2026/3/20

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,363,208	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	577,644	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,850,115	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	310,975	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	1,550,000	1,901,741	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	366,153	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	246,296	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	700,000	880,495	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	494,172	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	1,300,000	1,625,975	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	371,790	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	2,100,000	2,610,384	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	1,520,000	1,913,041	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	320,602	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	500,000	643,385	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	764,772	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	500,128	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,382,410	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	506,516	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	377,208	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,972,656	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,111,509	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,386,770	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	1,021,712	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,275,326	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	1,800,000	2,281,248	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	2,500,000	3,176,325	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	500,000	642,030	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,416,052	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	1,900,000	2,419,802	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	630,900	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	987,096	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	964,760	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	2,000,000	2,500,760	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	1,100,000	1,359,809	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	2,300,000	2,947,703	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,266,300	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	1,700,000	2,208,249	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	1,000,000	1,269,730	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	800,000	1,004,088	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	1,500,000	1,886,160	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	500,000	621,305	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	1,800,000	2,240,370	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	983,672	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,599,481	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,743,882	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	900,000	1,122,696	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	400,000	492,788	2032/3/20

銘		柄	当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券			%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第136回		1.6	700,000	850,899	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回		1.7	1,000,000	1,232,620	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回		1.5	800,000	960,280	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回		1.6	700,000	851,200	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回		1.7	2,300,000	2,836,291	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回		1.7	1,700,000	2,097,103	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回		1.8	1,250,000	1,562,062	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回		1.6	1,700,000	2,070,005	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回		1.5	1,500,000	1,802,100	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回		1.7	2,600,000	3,211,468	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回		1.7	2,400,000	2,964,912	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回		1.6	2,700,000	3,293,082	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回		1.5	2,500,000	3,006,100	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回		1.5	2,600,000	3,125,252	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回		1.4	2,930,000	3,469,530	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回		1.2	2,700,000	3,097,602	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回		1.2	3,400,000	3,899,936	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回		1.3	3,450,000	4,018,249	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回		1.2	3,500,000	4,009,215	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回		1.0	2,300,000	2,547,480	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回		0.4	1,000,000	992,660	2036/3/20
ポーランド共和国 第12回円貨債券 (2012)			1.05	100,000	101,104	2017/11/8
ポーランド共和国 第15回円貨債券 (2013)			0.91	100,000	101,292	2020/11/13
小 計				455,315,000	513,500,283	
地方債証券						
東京都	公募第648回		1.84	300,000	306,537	2017/6/20
東京都	公募第655回		1.42	100,000	102,686	2018/3/20
東京都	公募第659回		1.62	300,000	310,521	2018/6/20
東京都	公募第660回		1.58	100,000	103,418	2018/6/20
東京都	公募第664回		1.4	100,000	103,699	2018/12/20
東京都	公募第668回		1.54	200,000	208,864	2019/3/20
東京都	公募第671回		1.42	100,000	104,421	2019/6/20
東京都	公募第685回		1.13	100,000	104,546	2020/6/19
東京都	公募第690回		1.29	200,000	211,622	2020/12/18
東京都	公募第703回		0.99	100,000	105,356	2021/12/20
東京都	公募第707回		0.87	100,000	104,867	2022/3/18
東京都	公募第708回		0.89	100,000	105,239	2022/6/20
東京都	公募第710回		0.81	100,000	104,742	2022/6/20
東京都	公募第712回		0.77	100,000	104,571	2022/9/20
東京都	公募第715回		0.76	100,000	104,644	2022/12/20
東京都	公募第716回		0.77	200,000	209,422	2022/12/20
東京都	公募 (30年) 第7回		2.51	100,000	137,100	2038/9/17
東京都	公募第10回		2.31	200,000	268,402	2039/9/20
東京都	公募 (7年) 第1回		0.7	300,000	302,343	2017/6/20
東京都	公募 (7年) 第3回		0.58	100,000	101,370	2018/9/20
東京都	公募第1回		1.54	300,000	331,335	2023/6/20
東京都	公募第7回		2.16	100,000	119,523	2025/9/19
東京都	公募 (20年) 第16回		2.01	200,000	245,972	2028/12/20

銘		柄	当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券			%	千円	千円	
東京都	公募（20年）第17回		2.09	200,000	247,970	2028/12/20
東京都	公募第23回		2.12	100,000	126,553	2030/12/20
東京都	公募（20年）第26回		1.74	300,000	365,193	2032/6/18
北海道	公募平成19年度第2回		1.84	500,000	509,910	2017/5/31
北海道	公募平成19年度第4回		1.98	100,000	102,308	2017/6/29
北海道	公募平成20年度第7回		1.72	300,000	312,324	2018/9/25
北海道	公募平成21年度第6回		1.6	100,000	105,137	2019/8/28
北海道	公募平成21年度第10回		1.5	100,000	105,142	2019/11/27
北海道	公募平成24年度第6回		0.84	100,000	104,619	2022/8/31
北海道	公募平成24年度第9回		0.79	100,000	104,370	2022/10/31
北海道	公募平成25年度第1回		0.58	300,000	309,657	2023/4/26
北海道	公募（5年）平成25年度第8回		0.31	100,000	100,606	2018/9/25
北海道	公募（5年）平成26年度第8回		0.178	200,000	200,604	2019/9/25
北海道	公募（5年）平成26年度第10回		0.147	100,000	100,204	2019/11/28
宮城県	公募（5年）第9回1号		0.35	500,000	503,715	2018/7/26
神奈川県	公募第155回		1.61	100,000	103,462	2018/6/20
神奈川県	公募第156回		1.66	101,000	105,083	2018/9/20
神奈川県	公募第184回		1.02	100,000	105,070	2021/6/18
神奈川県	公募第188回		1.05	200,000	211,950	2022/3/18
神奈川県	公募第196回		0.678	100,000	104,216	2023/3/20
神奈川県	公募第200回		0.825	100,000	105,571	2023/9/20
神奈川県	公募第205回		0.664	100,000	104,573	2024/3/19
神奈川県	公募第206回		0.654	100,000	104,637	2024/6/20
神奈川県	公募第210回		0.451	200,000	206,224	2024/12/20
神奈川県	公募（30年）第3回		2.62	100,000	137,479	2037/3/19
神奈川県	公募第7回		2.22	300,000	368,364	2027/3/19
神奈川県	公募（5年）第56回		0.29	100,000	100,452	2018/3/20
大阪府	公募第303回		1.93	300,000	306,666	2017/6/28
大阪府	公募第304回		1.98	150,000	153,673	2017/7/28
大阪府	公募第320回		1.84	400,000	418,516	2018/11/27
大阪府	公募第337回		1.44	200,000	210,732	2020/4/28
大阪府	公募第346回		1.25	100,000	105,298	2021/1/28
大阪府	公募第356回		1.06	100,000	105,507	2021/12/27
大阪府	公募第378回		0.7	104,000	108,743	2023/11/28
大阪府	公募第384回		0.67	100,000	104,605	2024/5/29
大阪府	公募第387回		0.521	300,000	310,500	2024/8/28
大阪府	公募第5回		2.16	100,000	125,430	2030/5/28
大阪府	公募第8回		1.83	100,000	121,789	2031/12/22
大阪府	公募第98回		0.295	200,000	201,040	2018/9/27
大阪府	公募（5年）第99回		0.24	240,000	240,921	2018/10/30
大阪府	公募（5年）第101回		0.23	148,000	148,520	2018/12/26
大阪府	公募第102回		0.223	100,000	100,339	2019/1/30
京都府	公募平成19年度第1回		1.81	100,000	102,598	2017/9/26
京都府	公募平成20年度第3回		1.57	140,000	145,800	2018/12/19
京都府	公募平成24年度第2回		0.91	100,000	105,297	2022/6/20
京都府	公募平成24年度第6回		0.8	100,000	104,758	2022/10/21
京都府	公募平成26年度第5回		1.455	100,000	117,034	2034/8/10
京都府	公募平成26年度第7回		0.564	200,000	208,124	2024/9/19

銘		柄	当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券			%	千円	千円	
兵庫県	公募平成19年度第2回		1.8	100,000	101,898	2017/5/24
兵庫県	公募平成20年度第3回		1.76	100,000	103,571	2018/5/22
兵庫県	公募平成20年度第12回		1.82	100,000	104,618	2018/11/27
兵庫県	公募平成20年度第16回		1.6	100,000	104,250	2019/1/23
兵庫県	公募平成21年度第13回		1.48	100,000	104,560	2019/7/17
兵庫県	公募平成21年度第25回		1.54	100,000	105,241	2019/11/20
兵庫県	公募平成22年度第1回		1.46	100,000	105,448	2020/4/16
兵庫県	公募(30年)第2回		2.36	100,000	134,323	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第1回		1.66	300,000	346,365	2026/7/29
兵庫県	公募(15年)第3回		1.35	100,000	113,054	2027/7/16
兵庫県	公募(12年)第3回		0.56	300,000	311,931	2025/4/16
兵庫県	公募第2回		2.37	100,000	124,747	2027/9/17
兵庫県	公募第9回		2.25	100,000	125,701	2029/11/19
静岡県	公募平成19年度第1回		1.77	100,000	101,979	2017/5/30
静岡県	公募平成19年度第4回		1.94	200,000	205,330	2017/8/28
静岡県	公募平成19年度第7回		1.81	100,000	102,906	2017/11/28
静岡県	公募平成21年度第2回		1.65	100,000	105,166	2019/6/25
静岡県	公募平成21年度第7回		1.54	100,000	105,453	2019/11/25
静岡県	公募(5年)平成24年度第8回		0.236	100,000	100,295	2017/10/18
静岡県	公募平成24年度第10回		0.678	100,000	104,219	2023/3/22
静岡県	公募平成26年度第3回		0.679	165,000	172,924	2024/5/27
静岡県	公募平成26年度第8回		0.564	100,000	104,026	2024/9/25
静岡県	公募平成26年度第9回		0.554	100,000	103,978	2024/10/24
静岡県	公募(20年)第11回		1.841	100,000	122,066	2030/10/18
静岡県	公募(20年)第14回		1.736	100,000	121,669	2032/6/18
愛知県	公募平成19年度第3回		1.89	111,000	113,818	2017/8/17
愛知県	公募平成19年度第4回		1.87	100,000	102,828	2017/10/18
愛知県	公募平成20年度第7回		1.39	210,000	217,982	2019/1/30
愛知県	公募平成20年度第8回		2.04	100,000	122,899	2028/12/20
愛知県	公募平成20年度第10回		1.48	100,000	104,297	2019/3/27
愛知県	公募平成21年度第3回		1.66	114,000	119,930	2019/6/26
愛知県	公募平成21年度第17回		1.41	100,000	105,284	2020/2/26
愛知県	公募平成22年度第3回		1.364	100,000	105,436	2020/5/28
愛知県	公募平成22年度第9回		1.153	100,000	104,906	2020/9/30
愛知県	公募平成23年度第19回		1.006	100,000	105,666	2022/2/28
愛知県	公募平成24年度第2回		0.982	100,000	105,672	2022/4/27
愛知県	公募(5年)平成24年度第6回		0.2	1,100,000	1,102,046	2017/7/13
愛知県	公募(15年)平成24年度第14回		1.314	400,000	453,476	2027/12/13
愛知県	公募平成24年度第17回		1.829	100,000	123,107	2033/2/8
愛知県	公募平成26年度第8回		1.814	100,000	126,975	2044/6/20
愛知県	公募平成26年度第13回		1.363	100,000	115,130	2034/11/14
広島県	公募平成20年度第3回		1.6	300,000	311,742	2018/9/25
広島県	公募平成22年度第6回		1.26	200,000	211,536	2021/1/25
広島県	公募平成24年度第4回		0.81	100,000	104,900	2022/11/28
広島県	公募平成25年度第3回		0.8	200,000	210,792	2023/9/25
広島県	公募(5年)平成25年度第6回		0.21	300,000	301,572	2019/2/25
広島県	公募平成26年度第5回		0.33	109,650	112,012	2025/1/27
埼玉県	公募平成19年度第7回		1.65	200,000	206,074	2018/2/27

銘		柄	当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券			%	千円	千円	
埼玉県	公募平成20年度第1回		1.55	100,000	103,085	2018/4/24
埼玉県	公募平成21年度第5回		1.41	100,000	104,751	2019/9/25
埼玉県	公募平成22年度第2回		1.37	200,000	210,908	2020/5/26
埼玉県	公募平成24年度第4回		0.84	100,000	104,924	2022/7/25
埼玉県	公募（5年）平成24年度第8回		0.21	200,000	200,484	2017/12/28
埼玉県	公募平成25年度第4回		0.921	100,000	106,112	2023/7/24
埼玉県	公募平成25年度第6回		0.806	148,000	156,057	2023/9/27
埼玉県	公募（5年）平成25年度第7回		0.261	100,000	100,578	2018/10/25
埼玉県	公募平成25年度第10回		0.67	100,000	104,672	2024/2/26
埼玉県	公募平成25年度第11回		0.655	100,000	104,513	2024/3/26
埼玉県	公募平成26年度第6回		0.554	200,000	207,886	2024/9/26
福岡県	公募平成19年度第6回		1.72	100,000	102,452	2017/9/20
福岡県	公募平成19年度第8回		1.62	100,000	102,702	2017/12/20
福岡県	公募平成20年度第3回		1.59	100,000	103,463	2018/6/20
福岡県	公募平成22年度第5回		0.94	100,000	104,008	2020/10/28
福岡県	公募平成23年度第5回		1.02	100,000	105,414	2021/10/25
福岡県	公募平成24年度第10回		0.18	100,000	100,246	2018/1/29
福岡県	公募平成26年度第4回		0.135	100,000	100,313	2019/9/26
福岡県	公募平成23年度第1回		1.491	100,000	114,534	2026/11/27
福岡県	公募（30年）平成19年度第1回		2.62	100,000	137,985	2037/9/18
福岡県	公募（30年）平成26年度第1回		1.827	100,000	127,284	2044/6/20
福岡県	公募（20年）平成20年度第2回		2.05	100,000	123,177	2028/12/20
福岡県	公募（20年）平成24年度第2回		1.635	100,000	119,990	2032/8/16
千葉県	公募平成20年度第1回		1.55	100,000	103,089	2018/4/25
千葉県	公募平成20年度第6回		1.64	200,000	208,238	2018/10/25
千葉県	公募平成21年度第1回		1.53	100,000	104,532	2019/4/25
千葉県	公募平成21年度第11回		1.42	180,000	189,397	2020/1/24
千葉県	公募平成24度第1回		1.05	100,000	106,079	2022/4/25
千葉県	公募平成24年度第2回		0.91	100,000	105,269	2022/5/25
千葉県	公募平成24年度第4回		0.22	100,000	100,238	2017/8/25
千葉県	公募平成24年度第8回		0.84	100,000	105,245	2023/1/25
千葉県	公募平成25年度第2回		0.26	900,000	904,050	2018/5/25
千葉県	公募平成25年度第3回		0.89	100,000	105,817	2023/6/23
千葉県	公募（20年）第8回		2.18	100,000	126,367	2030/4/19
千葉県	公募（20年）第17回		1.403	100,000	116,073	2034/10/13
新潟県	公募平成20年度第2回		1.52	200,000	208,670	2019/2/27
新潟県	公募平成21年度第2回		1.55	150,000	158,283	2019/11/27
長野県	公募平成25年度第1回		0.24	1,100,000	1,106,435	2018/12/25
群馬県	公募第8回		1.03	100,000	105,466	2021/11/25
群馬県	公募（5年）第4回		0.235	600,000	603,162	2018/11/22
岐阜県	公募平成19年度第1回		1.87	190,000	195,432	2017/10/26
岐阜県	公募平成26年度第1回		0.554	186,670	193,875	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第51回		1.9	100,000	102,281	2017/6/23
共同発行市場地方債	公募第56回		1.72	400,000	410,884	2017/11/24
共同発行市場地方債	公募第58回		1.59	270,500	278,003	2018/1/25
共同発行市場地方債	公募第62回		1.74	100,000	103,642	2018/5/25
共同発行市場地方債	公募第63回		1.88	100,000	104,110	2018/6/25
共同発行市場地方債	公募第64回		1.78	262,000	272,584	2018/7/25

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
共同発行市場地方債	公募第65回	1.62	700,000	726,768	2018/8/24
共同発行市場地方債	公募第66回	1.55	181,000	187,858	2018/9/25
共同発行市場地方債	公募第68回	1.69	900,000	939,375	2018/11/22
共同発行市場地方債	公募第70回	1.42	110,000	114,271	2019/1/25
共同発行市場地方債	公募第74回	1.57	500,000	523,960	2019/5/24
共同発行市場地方債	公募第75回	1.64	310,000	325,965	2019/6/25
共同発行市場地方債	公募第82回	1.42	300,000	315,600	2020/1/24
共同発行市場地方債	公募第84回	1.38	500,000	526,215	2020/3/25
共同発行市場地方債	公募第85回	1.44	100,000	105,630	2020/4/24
共同発行市場地方債	公募第88回	1.17	100,000	104,813	2020/7/24
共同発行市場地方債	公募第89回	1.04	100,000	104,331	2020/8/25
共同発行市場地方債	公募第92回	1.03	110,000	114,977	2020/11/25
共同発行市場地方債	公募第93回	1.25	300,000	316,935	2020/12/25
共同発行市場地方債	公募第94回	1.24	300,000	317,091	2021/1/25
共同発行市場地方債	公募第96回	1.29	100,000	106,135	2021/3/25
共同発行市場地方債	公募第101回	1.05	300,000	315,990	2021/8/25
共同発行市場地方債	公募第102回	1.03	150,000	157,962	2021/9/24
共同発行市場地方債	公募第103回	1.0	100,000	105,223	2021/10/25
共同発行市場地方債	公募第108回	1.01	200,000	211,302	2022/3/25
共同発行市場地方債	公募第110回	0.89	200,000	210,358	2022/5/25
共同発行市場地方債	公募第111回	0.89	200,000	210,492	2022/6/24
共同発行市場地方債	公募第113回	0.77	200,000	209,128	2022/8/25
共同発行市場地方債	公募第115回	0.8	100,000	104,835	2022/10/25
共同発行市場地方債	公募第116回	0.8	200,000	209,726	2022/11/25
共同発行市場地方債	公募第118回	0.84	100,000	105,209	2023/1/25
共同発行市場地方債	公募第119回	0.8	200,000	210,046	2023/2/24
共同発行市場地方債	公募第120回	0.68	300,000	312,708	2023/3/24
共同発行市場地方債	公募第121回	0.57	100,000	103,475	2023/4/25
共同発行市場地方債	公募第122回	0.62	100,000	103,907	2023/5/25
共同発行市場地方債	公募第124回	0.91	100,000	106,073	2023/7/25
共同発行市場地方債	公募第126回	0.81	100,000	105,510	2023/9/25
共同発行市場地方債	公募第128回	0.66	300,000	313,467	2023/11/24
共同発行市場地方債	公募第130回	0.76	100,000	105,324	2024/1/25
共同発行市場地方債	公募第132回	0.66	100,000	104,592	2024/3/25
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	208,670	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	200,000	208,088	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	161,105	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	557,479	2025/2/25
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	123,754	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	122,553	2044/9/20
島根県	公募平成22年度第1回	1.08	100,000	104,785	2020/11/26
島根県	公募平成25年度第3回	0.209	700,000	703,710	2019/3/25
福島県	公募平成24年度第2回	0.17	100,000	100,238	2018/2/26
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	206,940	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	104,341	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	146,927	2024/11/28
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	104,341	2023/11/29
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	244,773	2023/12/26

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
大阪市	公募平成20年度第 3 回	1. 82	110, 000	114, 495	2018/ 7 /23
大阪市	公募平成21年度第 6 回	1. 57	100, 000	105, 486	2019/11/25
大阪市	公募平成25年度第 1 回	0. 401	800, 000	805, 840	2018/ 5 /23
大阪市	公募平成25年度第 6 回	0. 694	100, 000	104, 585	2023/11/22
大阪市	公募（15年）第 1 回	1. 753	100, 000	116, 353	2026/ 7 /17
大阪市	公募（20年）第 5 回	2. 47	100, 000	127, 473	2028/ 9 /21
大阪市	公募（20年）第 6 回	2. 21	100, 000	124, 626	2028/12/20
大阪市	公募（20年）第17回	1. 721	100, 000	120, 692	2032/12/21
名古屋市	公募第460回	1. 74	200, 000	204, 964	2017/ 9 /20
名古屋市	公募第464回	1. 61	300, 000	311, 712	2018/ 9 /20
名古屋市	公募第469回	1. 34	100, 000	104, 792	2019/12/20
名古屋市	公募第478回	1. 063	100, 000	106, 021	2022/ 3 /18
名古屋市	公募第488回	0. 598	300, 000	313, 182	2024/ 9 /20
名古屋市	公募（6 年）第 1 回	0. 283	200, 000	201, 010	2018/ 6 /20
名古屋市	公募（12年）第 1 回	1. 033	200, 000	217, 242	2025/ 6 /20
名古屋市	公募（15年）第 2 回	0. 905	100, 000	108, 724	2029/11/16
京都市	公募平成19年度第 2 回	1. 74	300, 000	308, 661	2017/12/27
京都市	公募平成19年度第 4 回	1. 62	190, 000	195, 614	2018/ 2 /26
京都市	公募平成20年度第 4 回	1. 54	200, 000	208, 600	2019/ 2 /26
京都市	公募平成23年度第 4 回	1. 067	100, 000	105, 776	2021/12/22
京都市	公募平成25年度第 3 回	0. 312	100, 000	100, 675	2018/ 9 /27
京都市	公募（20年）第 2 回	2. 12	100, 000	119, 147	2025/ 9 /19
京都市	公募（20年）第13回	1. 359	100, 000	114, 482	2034/11/24
神戸市	公募平成21年度第 7 回	1. 69	100, 000	105, 257	2019/ 6 /20
横浜市	公募平成20年度第 3 回	1. 56	100, 000	103, 713	2018/ 9 / 7
横浜市	公募公債平成20年度 5 回	1. 58	200, 000	208, 320	2018/12/20
横浜市	公募平成21年度第 4 回	1. 35	200, 000	208, 976	2019/ 9 /20
横浜市	公募平成22年度第 5 回	1. 265	100, 000	105, 645	2020/12/11
横浜市	公募公債平成24年度 2 回	0. 815	200, 000	209, 628	2022/10/17
横浜市	公募公債平成25年度 1 回	0. 664	200, 000	208, 200	2023/ 5 /19
横浜市	公募公債平成25年度 5 回	0. 655	200, 000	208, 720	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度 5 回	0. 471	200, 000	206, 646	2024/12/13
横浜市	公募（20年）第30回	1. 376	100, 000	115, 421	2034/10/20
札幌市	公募平成19年度第 3 回	1. 77	100, 000	102, 533	2017/ 9 /20
札幌市	公募平成22年度第 4 回	1. 05	100, 000	104, 187	2020/ 6 /19
札幌市	公募（5 年）平成24年度第 8 回	0. 2	200, 000	200, 444	2017/12/20
札幌市	公募平成26年度第 4 回	0. 54	100, 000	103, 704	2024/ 6 /20
札幌市	公募平成26年度第 9 回	0. 43	200, 000	205, 860	2024/12/20
川崎市	公募第81回	1. 57	100, 000	104, 536	2019/ 3 /20
川崎市	公募第82回	1. 52	100, 000	105, 115	2019/ 9 /20
川崎市	公募第85回	0. 72	100, 000	104, 341	2022/12/20
川崎市	公募（20年）第17回	1. 527	100, 000	118, 312	2033/ 5 / 9
川崎市	公募第32回	0. 22	150, 000	150, 301	2017/ 6 /20
北九州市	公募（5 年）平成25年度第 2 回	0. 312	100, 000	100, 707	2018/ 9 /27
北九州市	公募（20年）第14回	1. 732	100, 000	121, 210	2032/11/12
福岡市	公募平成20年度第 3 回	1. 52	100, 000	103, 308	2018/ 6 /20
福岡市	公募平成24年度第 5 回	0. 19	100, 000	100, 241	2017/12/26
福岡市	公募（5 年）平成25年度第 2 回	0. 35	300, 000	302, 226	2018/ 7 /25

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	117,306	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	103,855	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	165,414	2025/3/25
広島市	公募平成21年度第3回	1.34	100,000	104,838	2019/12/25
仙台市	公募平成25年度第1回	0.24	600,000	603,174	2019/1/29
千葉市	公募平成24年度第1回	1.05	100,000	105,967	2022/4/25
鹿児島県	公募（5年）平成25年度第1回	0.24	100,000	100,546	2018/10/31
福井県	公募平成24年度第4回	0.46	100,000	102,738	2023/4/26
徳島県	公募平成22年度第1回	1.05	400,000	418,724	2020/11/30
山梨県	公募平成19年度第1回	1.86	200,000	205,742	2017/10/30
山梨県	公募平成21年度第1回	1.37	100,000	104,755	2019/10/30
岡山県	公募平成21年度第2回	1.39	100,000	105,408	2020/3/31
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回		2.34	100,000	126,003	2028/12/20
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回		2.298	300,000	379,977	2029/12/20
福岡北九州高速道路債券 第117回		2.26	100,000	124,395	2028/12/20
東京都住宅供給公社債券 第5回		2.02	200,000	205,484	2017/9/20
小 計			49,021,020	51,844,038	
特殊債券(除く金融債)					
日本高速道路保有・債務返済機構承継 政府保証第344回		1.6	200,000	213,258	2020/7/15
公営企業債券 政府保証第875回		1.7	100,000	101,904	2017/5/22
公営企業債券 政府保証第880回		1.7	131,000	134,557	2017/11/17
公営企業債券 政府保証第881回		1.5	200,000	205,316	2018/1/23
公営企業債券 政府保証第886回		1.8	203,000	210,967	2018/6/19
公営企業債券 政府保証15年第1回		1.6	300,000	319,611	2020/6/22
政保 地方公営企業等金融機構債券 第2回		1.6	400,000	416,552	2018/11/16
地方公共団体金融機構債券 政府保証第5回		1.2	200,000	208,184	2019/10/18
地方公共団体金融機構債券 政府保証第16回		1.0	100,000	104,202	2020/9/14
政保 地方公共団体金融機構債券（6年）第1回		0.4	100,000	100,544	2017/9/27
政保 地方公共団体金融機構債券（6年）第4回		0.4	500,000	503,620	2018/3/26
政保 地方公共団体金融機構債券 第39回		0.801	100,000	104,713	2022/8/15
政保 地方公共団体金融機構債券 第45回		0.815	100,000	105,151	2023/2/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第50回		0.911	100,000	106,132	2023/7/14
政保 地方公共団体金融機構債券（6年）第10回		0.385	300,000	303,399	2019/7/24
政保 地方公共団体金融機構債券（4年）第6回		0.205	400,000	400,960	2017/8/29
政保 地方公共団体金融機構債券 第59回		0.669	116,000	121,590	2024/4/12
政保 地方公共団体金融機構債券（6年）第14回		0.199	300,000	301,869	2020/6/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回		0.544	100,000	104,062	2024/9/13
政保 地方公共団体金融機構債券 第65回		0.539	400,000	416,248	2024/10/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第69回		0.414	300,000	309,456	2025/2/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回		0.509	189,000	196,792	2025/5/23
日本政策金融公庫債券 政府保証第22回		0.243	2,000,000	2,011,160	2018/10/26
新関西国際空港債券 政府保証第1回		0.801	151,000	158,151	2022/8/29
原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第2回		0.151	200,000	200,376	2017/11/17
原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第3回		0.117	2,100,000	2,103,675	2018/5/23
原子力損害賠償支援機構債券 政府保証第5回		0.059	3,590,000	3,591,328	2017/11/2
日本政策投資銀行債券 政府保証第18回		1.9	100,000	102,569	2017/8/16
日本政策投資銀行債券 政府保証第22回		2.2	100,000	115,351	2023/6/19
日本政策投資銀行社債 政府保証第5回		1.4	100,000	104,129	2019/4/15

銘	柄	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	
日本政策投資銀行社債	政府保証第9回	1.0	141,000	146,924	2020/9/14
日本政策投資銀行社債	政府保証第10回	0.5	100,000	100,571	2017/6/23
日本政策投資銀行社債	政府保証第16回	0.819	102,000	106,984	2022/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第6回	1.9	100,000	109,007	2021/2/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第9回	1.9	100,000	109,175	2021/3/26
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第42回	1.8	100,000	102,798	2017/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第56回	1.4	205,000	210,746	2018/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第58回	1.7	136,000	140,897	2018/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第60回	1.8	283,000	294,243	2018/6/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第62回	1.7	100,000	103,895	2018/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第67回	1.6	341,000	354,875	2018/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第69回	1.6	100,000	104,190	2018/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第71回	1.4	100,000	103,745	2018/12/25
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第92回	2.1	200,000	250,242	2029/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第97回	2.1	200,000	250,478	2029/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第98回	1.3	300,000	314,421	2020/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第99回	2.2	200,000	253,508	2030/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第100回	1.4	400,000	421,176	2020/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第106回	2.1	200,000	251,352	2030/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第114回	1.9	200,000	246,338	2030/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第123回	2.1	100,000	133,216	2040/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第137回	1.2	440,000	466,479	2021/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第149回	1.0	140,000	147,512	2021/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第155回	0.9	100,000	104,944	2022/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第157回	0.9	140,000	147,012	2022/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第165回	1.83	100,000	128,360	2042/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第168回	0.839	100,000	104,925	2022/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第169回	1.634	100,000	120,116	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第170回	0.801	218,000	228,331	2022/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第171回	1.56	100,000	118,861	2032/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第172回	1.919	300,000	391,917	2042/8/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第173回	0.819	200,000	209,816	2022/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第175回	0.791	200,000	209,576	2022/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第180回	0.734	200,000	209,034	2022/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第182回	0.834	400,000	421,004	2023/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第183回	1.726	100,000	121,626	2033/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第189回	0.541	196,000	202,562	2023/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第190回	0.605	400,000	415,380	2023/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第193回	0.882	200,000	211,780	2023/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第197回	0.835	272,000	287,455	2023/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第207回	0.693	300,000	314,517	2023/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第211回	0.66	137,000	143,412	2024/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第213回	0.645	145,000	151,675	2024/3/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第216回	1.483	100,000	117,753	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第219回	1.478	100,000	117,651	2034/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第220回	0.644	100,000	104,782	2024/6/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第225回	0.556	190,000	197,873	2024/8/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第234回	0.466	100,000	103,524	2024/12/27

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
首都高速道路債券	政府保証第8回	1.3	100,000	104,769	2020/1/20
阪神高速道路債券	政府保証第5回	1.3	100,000	104,965	2020/3/18
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	120,000	125,718	2023/10/20
中部国際空港債券	政府保証第18回	0.668	264,000	275,051	2023/3/22
預金保険機構債券	政府保証第194回	0.1	300,000	300,327	2017/12/15
中日本高速道路債券	政府保証第13回	1.7	138,000	140,608	2017/5/19
中日本高速道路債券	政府保証第14回	1.9	100,000	102,258	2017/6/16
西日本高速道路債券	政府保証第8回	1.7	100,000	101,890	2017/5/19
銀行等保有株式取得機構債券	政府保証第28回	0.1	400,000	400,304	2017/5/19
新関西国際空港社債	財投機関債第10回	0.161	100,000	100,156	2017/9/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	109,100	2029/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第25回	0.425	100,000	100,470	2017/6/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第26回	0.573	100,000	101,696	2019/6/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	109,149	2029/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第4回	2.59	100,000	135,746	2035/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第8回	2.45	200,000	244,300	2026/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第23回	2.39	200,000	247,872	2027/7/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第33回	2.91	200,000	306,542	2048/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第38回	1.87	100,000	104,062	2018/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第39回	2.37	100,000	125,406	2028/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第47回	2.41	100,000	126,739	2029/4/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第86回	0.934	200,000	210,506	2022/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第89回	1.711	100,000	119,343	2032/6/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第102回	0.666	100,000	104,024	2023/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第103回	1.69	350,000	416,703	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第105回	1.853	100,000	121,719	2033/3/18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第127回	0.184	300,000	301,332	2019/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第130回	0.56	200,000	206,972	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第134回	0.529	200,000	206,468	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第145回	1.523	300,000	351,783	2044/12/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第149回	1.604	100,000	119,436	2045/3/17
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第33回	2.91	100,000	140,059	2034/6/20
公営企業債券	30年第4回財投機関債	2.95	100,000	141,050	2034/3/24
地方公営企業等金融機構債券	第1回	1.77	200,000	208,674	2018/9/25
地方公営企業等金融機構債券	(20年) 第1回	2.07	100,000	122,054	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券	第1回	1.648	100,000	105,189	2019/6/28
地方公共団体金融機構債券	第2回	1.406	100,000	104,504	2019/7/26
地方公共団体金融機構債券	20年第4回	2.12	100,000	123,680	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券	20年第6回	2.242	300,000	376,671	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券	F24回	1.681	100,000	111,056	2023/3/17
地方公共団体金融機構債券	第13回	1.278	200,000	210,292	2020/6/26
地方公共団体金融機構債券	第16回	1.164	100,000	104,925	2020/9/28
地方公共団体金融機構債券	第27回	1.034	300,000	315,912	2021/8/27
地方公共団体金融機構債券	F104回	1.314	100,000	110,262	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券	F106回	1.259	100,000	108,987	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券	第37回	0.852	300,000	314,856	2022/6/28
地方公共団体金融機構債券	第41回	0.801	600,000	628,674	2022/10/28
地方公共団体金融機構債券	F142回	1.016	100,000	107,447	2024/11/28

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
地方公共団体金融機構債券	F 144回	0.562	200,000	204,530	2020/10/28
地方公共団体金融機構債券	F 145回	1.059	200,000	215,996	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券	第42回	0.801	100,000	104,806	2022/11/28
地方公共団体金融機構債券	第44回	0.791	100,000	104,844	2023/1/27
地方公共団体金融機構債券	F 160回	1.052	100,000	109,232	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券	第51回	0.841	300,000	316,341	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券	第52回	0.801	300,000	316,383	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券	(15年) 第2回	1.161	200,000	221,468	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	115,870	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	103,631	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	114,757	2034/9/28
公営企業債券 (20年) 第2回財投機関債		1.45	100,000	109,196	2022/12/20
公営企業債券 (20年) 第25回財投機関債		2.5	100,000	126,615	2028/6/20
公営企業債券 第29回財投機関債		1.77	500,000	514,845	2017/12/20
首都高速道路社債 第12回		0.293	100,000	100,686	2018/12/20
阪神高速道路 第13回		0.18	100,000	100,447	2019/9/20
中小企業債券 第6回財投機関債		0.79	100,000	101,446	2018/3/20
都市再生債券 財投機関債第21回		1.72	300,000	312,567	2018/9/20
都市再生債券 財投機関債第55回		1.074	100,000	105,578	2021/9/17
都市再生債券 財投機関債第97回		1.017	100,000	109,019	2029/9/20
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回		2.26	100,000	119,044	2025/6/20
東京交通債券 第342回		2.4	200,000	228,750	2022/6/21
東京交通債券 第347回		2.05	157,000	180,625	2024/3/8
関西国際空港社債 財投機関債第26回		1.156	300,000	314,580	2020/9/18
福祉医療機構債券 第31回財投機関債		0.93	100,000	105,422	2022/6/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回		2.26	200,000	243,792	2027/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第14回		1.86	200,000	207,186	2018/3/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第18回		2.15	100,000	115,221	2023/9/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第25回		1.67	300,000	313,299	2018/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第41回		1.5	100,000	105,387	2019/12/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第42回		1.94	100,000	115,855	2025/3/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第59回		1.95	100,000	121,896	2030/10/22
住宅金融支援機構債券 財投機関債第73回		1.256	100,000	106,272	2021/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第75回		2.066	100,000	124,305	2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回		1.751	300,000	346,365	2026/6/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第78回		2.056	100,000	124,189	2031/7/11
住宅金融支援機構債券 財投機関債第79回		1.069	100,000	105,551	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第86回		1.046	200,000	210,850	2021/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第90回		1.595	200,000	228,880	2026/12/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第128回		2.273	100,000	133,305	2042/9/19
成田国際空港 第17回		0.489	200,000	205,906	2025/2/20
私学振興債券 財投機関債第7回		1.7	300,000	307,335	2017/9/25
沖縄振興開発金融公庫債券 財投機関債第17回		1.208	100,000	106,022	2021/6/18
国際協力機構債券 第6回財投機関債		2.098	100,000	124,607	2030/12/13
東日本高速道路 第21回		0.58	100,000	101,187	2018/6/20
東日本高速道路 第26回		0.305	100,000	100,833	2019/6/20
東日本高速道路 第27回		0.248	100,000	100,650	2019/6/20
中日本高速道路債券 財投機関債第3回		1.92	100,000	102,777	2017/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
中日本高速道路社債 第32回		0.64	200,000	203,036	2018/9/20
中日本高速道路社債 第44回		0.536	100,000	101,682	2019/9/20
中日本高速道路社債 第46回		0.351	1,500,000	1,506,975	2017/9/20
中日本高速道路社債 第47回		0.277	100,000	100,476	2018/3/20
中日本高速道路社債 第53回		0.222	100,000	100,222	2017/6/20
西日本高速道路 第20回		0.759	200,000	209,770	2023/9/20
西日本高速道路 第23回		0.602	100,000	103,829	2024/6/20
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第35回		1.165	200,000	209,800	2020/9/18
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第69回		1.441	100,000	114,922	2034/8/4
貸付債権担保第6回住宅金融公庫債券		1.94	15,355	15,963	2037/6/10
貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券		1.69	54,378	56,541	2038/9/10
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	100,360	105,135	2039/6/10
貸付債権担保第10回住宅金融公庫債券		1.43	98,118	101,019	2038/2/10
貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券		1.76	61,605	65,027	2036/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	82,758	89,743	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	21,586	23,230	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	54,444	57,753	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	59,696	63,872	2041/3/10
貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券		1.69	58,590	61,214	2039/2/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	120,880	127,600	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	104,645	110,881	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	104,128	112,995	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	59,582	63,696	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	29,714	31,885	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	40,277	44,039	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	137,841	149,150	2044/9/10
貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券		1.64	34,882	36,419	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	144,444	153,611	2045/11/10
貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券		1.71	71,678	75,042	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	205,452	221,795	2046/2/10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	147,586	157,614	2046/9/10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	79,442	86,968	2044/5/10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	200,343	217,031	2046/5/10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	202,719	214,093	2045/9/10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	241,647	254,618	2047/7/10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	237,912	252,450	2047/5/10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	157,888	166,773	2047/6/10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	71,226	76,438	2046/8/10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	145,356	155,895	2045/12/10
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券		1.07	86,121	90,260	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	175,622	184,194	2049/2/10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	83,400	87,398	2048/5/10
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券		1.87	42,962	45,233	2039/9/10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	249,375	263,716	2048/3/10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	51,197	55,027	2045/2/10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	52,833	56,767	2045/3/10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	56,282	60,360	2045/4/10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	68,858	74,543	2046/3/10

銘	柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	157,790	168,041	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	232,569	247,751	2047/1/10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	78,089	83,259	2047/2/10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	164,612	173,769	2048/9/10
貸付債権担保 S 種第 3 回住宅金融公庫債券		1.82	20,001	21,141	2036/5/10
貸付債権担保 S 種第14回住宅金融支援機構債券		1.7	162,515	169,373	2032/5/10
貸付債権担保 S 種第15回住宅金融支援機構債券		1.65	65,500	68,137	2032/5/10
貸付債権担保第 1 回住宅金融公庫債券		1.75	26,764	27,495	2036/3/10
貸付債権担保第 7 回住宅金融公庫債券		1.82	56,040	57,728	2037/8/10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券		1.52	319,935	338,891	2045/8/10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券		1.4	157,388	167,548	2047/3/10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券		1.16	248,352	261,089	2047/9/10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券		1.3	171,884	182,692	2048/6/10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券		1.26	163,626	173,232	2048/8/10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券		0.93	92,847	96,612	2049/9/10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券		0.95	93,619	97,569	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券		0.87	93,649	97,107	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券		0.74	189,946	195,243	2050/1/10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券		0.6	190,318	193,730	2050/2/10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券		0.8	95,846	98,973	2050/3/10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券		0.74	96,232	98,992	2050/5/10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券		0.83	289,587	299,763	2050/6/10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券		0.9	292,029	303,832	2050/7/10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券		0.88	195,246	202,839	2050/8/10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券		0.84	97,617	101,113	2050/9/10
フランス預金供託公庫 第 4 回円貨債券 (2014)		0.725	100,000	103,095	2024/7/30
韓国産業銀行 第45回円貨社債 (2014)		0.69	100,000	100,521	2019/1/29
小	計		48,158,183	51,196,816	
金融債券					
商工債券	利付第753回い号	0.25	100,000	100,391	2018/2/27
農林債券	利付第745回い号	0.35	100,000	100,347	2017/6/27
農林債券	利付第751回い号	0.3	200,000	200,848	2017/12/27
農林債券	利付第752回い号	0.3	100,000	100,454	2018/1/26
農林債券	利付第756回い号	0.3	100,000	100,547	2018/5/25
農林債券	利付第759回い号	0.4	100,000	100,864	2018/8/27
農林債券	利付第760回い号	0.4	100,000	100,906	2018/9/27
農林債券	利付第761回い号	0.3	100,000	100,666	2018/10/26
農林債券	利付第764回い号	0.35	100,000	100,837	2019/1/25
農林債券	利付第765回い号	0.3	300,000	302,139	2019/2/27
農林債券	利付第767回い号	0.3	300,000	302,151	2019/4/26
農林債券	利付第773回い号	0.24	300,000	301,803	2019/10/25
農林債券	利付第777回い号	0.25	300,000	301,977	2020/2/27
しんきん中金債券	利付第271回	0.35	350,000	351,256	2017/6/27
しんきん中金債券	利付第277回	0.25	100,000	100,355	2017/12/27
しんきん中金債券	利付第284回	0.4	100,000	100,846	2018/7/27
しんきん中金債券	利付第286回	0.35	100,000	100,807	2018/9/27
しんきん中金債券	利付第287回	0.3	100,000	100,692	2018/10/26
しんきん中金債券	利付第290回	0.3	100,000	100,725	2019/1/25

銘		柄	当 期 末			
			利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券			%	千円	千円	
しんきん中金債券 利付第302回			0.2	100,000	100,511	2020/1/27
商工債券 利付（3年）第172回			0.2	200,000	200,326	2017/5/26
商工債券 利付（3年）第174回			0.15	200,000	200,236	2017/7/27
商工債券 利付（3年）第178回			0.15	1,000,000	1,001,640	2017/11/27
商工債券 利付（3年）第181回			0.15	500,000	501,000	2018/2/27
商工債券 利付（3年）第182回			0.14	100,000	100,188	2018/3/27
商工債券 利付（10年）第5回			1.8	600,000	618,120	2017/12/20
あおぞら債券 利付（3年）第71回			0.19	400,000	400,636	2017/12/8
小 計				6,150,000	6,191,268	
普通社債券(含む投資法人債券)						
東京電力 第455回			2.075	200,000	208,500	2018/10/23
東京電力 第459回			2.7	100,000	106,256	2019/1/29
東京電力 第542回			1.602	100,000	102,413	2018/4/25
東京電力 第544回			1.976	100,000	103,457	2018/6/25
東京電力 第547回			1.948	100,000	105,972	2020/7/24
東京電力 第548回			2.347	100,000	111,369	2028/9/29
東京電力 第559回			1.377	100,000	102,991	2019/10/29
東京電力 第560回			2.114	100,000	108,684	2029/12/10
東京電力 第565回			1.313	300,000	309,645	2020/6/24
中部電力 第482回			2.17	200,000	213,176	2019/6/25
中部電力 第500回			0.875	200,000	209,038	2024/5/24
関西電力 第448回			2.16	200,000	208,808	2018/6/20
関西電力 第469回			1.7	100,000	103,926	2018/10/25
関西電力 第482回			1.189	100,000	103,931	2020/7/24
関西電力 第484回			0.976	100,000	103,157	2020/10/23
関西電力 第496回			0.908	100,000	103,499	2025/2/25
関西電力 第497回			1.002	200,000	208,538	2025/6/20
関西電力 第498回			0.416	200,000	201,236	2020/9/18
中国電力 第314回			2.875	100,000	105,772	2018/4/25
中国電力 第330回			2.1	100,000	109,375	2021/3/25
中国電力 第377回			1.121	200,000	212,110	2023/8/25
中国電力 第378回			1.004	100,000	105,284	2023/10/25
北陸電力 第301回			1.158	100,000	106,084	2023/3/24
北陸電力 第304回			0.989	100,000	105,173	2023/10/25
北陸電力 第307回			1.055	100,000	105,825	2026/6/25
北陸電力 第308回			0.769	100,000	103,695	2024/9/25
東北電力 第431回			2.05	400,000	415,072	2018/3/23
東北電力 第473回			0.597	100,000	101,753	2021/4/23
東北電力 第475回			0.809	100,000	103,554	2024/9/25
東北電力 第481回			0.803	200,000	206,930	2025/7/25
四国電力 第281回			1.111	200,000	212,102	2023/9/25
九州電力 第400回			1.777	100,000	106,115	2020/4/24
九州電力 第409回			1.483	100,000	104,350	2019/8/23
九州電力 第420回			0.82	300,000	304,206	2018/4/25
九州電力 第424回			1.233	200,000	211,890	2023/11/24
北海道電力 第296回			2.027	100,000	104,158	2018/6/25
北海道電力 第316回			1.164	207,000	214,965	2020/6/25
北海道電力 第323回			1.337	100,000	107,836	2030/3/25

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
新日本製鐵	第30回社債間限定同順位特約付	3.175	100,000	104,503	2017/9/11
新日本製鐵	第67回社債間限定同順位特約付	1.293	100,000	105,472	2021/3/19
成田国際空港	第13回一般担保付	0.802	200,000	209,806	2023/2/8
清水建設	第18回社債間限定同順位特約付	0.947	100,000	102,597	2019/3/6
大和ハウス工業	第5回特定社債間限定同順位特約付	0.443	100,000	101,976	2021/6/18
森永乳業	第13回社債間限定同順位特約付	0.884	100,000	103,828	2024/5/8
アサヒグループホールディングス	第7回特定社債間限定同順位特約付	0.237	100,000	100,643	2020/5/28
アサヒグループホールディングス	第8回特定社債間限定同順位特約付	0.348	100,000	101,591	2022/5/27
キリンホールディングス	第10回社債間限定同順位特約付	0.603	200,000	206,444	2025/2/28
トヨタ紡織	第2回社債間限定同順位特約付	0.714	100,000	103,984	2023/9/20
野村不動産ホールディングス	第5回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	102,944	2025/5/30
森ビル	第13回社債間限定同順位特約付	0.466	100,000	101,125	2020/5/19
東急不動産ホールディングス	第2回社債間限定同順位特約付	0.856	100,000	103,032	2024/7/29
セブン&アイ・ホールディングス	第3回社債間限定同順位特約付	1.94	100,000	104,222	2018/6/20
レンゴー	第18回特定社債間限定同順位特約付	0.451	100,000	101,324	2021/9/3
住友化学	第43回社債間限定同順位特約付	1.58	100,000	105,899	2020/4/23
クレハ	第5回社債間限定同順位特約付	0.302	100,000	100,769	2020/3/6
エア・ウォーター	第2回社債間限定同順位特約付	0.271	100,000	100,782	2020/9/3
三菱ケミカルホールディングス	第14回社債間限定同順位特約付	0.482	200,000	203,508	2021/6/17
宇部興産	第10回社債間限定同順位特約付	0.334	100,000	100,610	2019/6/4
花王	第4回特定社債間限定同順位特約付	0.624	100,000	102,321	2020/6/19
武田薬品工業	第15回社債間限定同順位特約付	0.704	100,000	102,616	2020/7/17
第一三共	第4回社債間限定同順位特約付	0.846	100,000	104,680	2023/9/15
JXホールディングス	第9回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	102,417	2024/6/4
横浜ゴム	第10回社債間限定同順位特約付	0.355	100,000	101,218	2021/10/29
ブリヂストン	第8回社債間限定同順位特約付	0.249	200,000	201,156	2019/9/26
住友ゴム工業	第24回社債間限定同順位特約付	0.755	100,000	104,272	2024/6/25
住友大阪セメント	第14回社債間限定同順位特約付	0.332	100,000	100,924	2020/3/3
神戸製鋼所	第62回社債間限定同順位特約付	0.579	100,000	99,032	2022/5/20
神戸製鋼所	第63回社債間限定同順位特約付	0.924	100,000	99,391	2025/5/21
ジェイ エフ イー ホールディングス	第16回(JFEス保証)	0.858	100,000	100,844	2017/5/26
ジェイ エフ イー ホールディングス	第22回(JFEス保証)	0.703	100,000	101,334	2024/9/19
豊田自動織機	第25回社債間限定同順位特約付	0.234	100,000	100,530	2019/9/20
小松製作所	第10回社債間限定同順位特約付	0.275	100,000	100,478	2019/6/20
日立製作所	第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	220,318	2028/12/13
三菱電機	第45回社債間限定同順位特約付	0.428	100,000	101,727	2021/6/4
日本電産	第3回社債間限定同順位特約付	0.956	100,000	104,969	2022/9/20
富士通	第34回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	101,881	2020/10/16
パナソニック	第8回社債間限定同順位特約付	2.05	100,000	105,712	2019/3/20
パナソニック	第12回社債間限定同順位特約付	0.387	200,000	201,902	2020/3/19
ソニー	第26回	2.068	100,000	105,572	2019/6/20
三菱重工業	第26回社債間限定同順位特約付	0.877	100,000	104,605	2023/9/4
川崎重工業	第32回社債間限定同順位特約付	1.062	100,000	101,189	2017/6/21
明治安田生命2014基金特定目的会社	第1回特定社債	0.51	300,000	303,024	2019/8/7
日産自動車	第55回特定社債間限定同順位特約付	0.415	200,000	201,372	2018/3/20
トヨタ自動車	第14回社債間限定同等特約付	0.963	100,000	105,499	2023/3/20
アイシン精機	第15回社債間限定同順位特約付	0.562	100,000	103,042	2025/2/26
ニコン	第20回特定社債間限定同順位特約付	0.652	100,000	103,286	2022/3/14

銘	柄	期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
大日本印刷 第3回社債間限定同順位特約付		1.358	100,000	105,983	2020/12/18
伊藤忠商事 第59回社債間限定同順位特約付		1.378	200,000	212,212	2021/6/4
丸紅 第101回社債間限定同順位特約付		0.436	100,000	100,533	2021/7/23
豊田通商 第18回社債間限定同順位特約付		1.014	100,000	105,512	2025/12/5
豊田通商 第19回社債間限定同順位特約付		0.954	200,000	209,118	2026/7/10
三井物産 第71回社債間限定同順位特約付		1.187	100,000	108,707	2029/7/13
住友商事 第45回社債間限定同順位特約付		1.117	100,000	104,719	2022/4/20
三菱商事 第66回担保提供制限等財務上特約無		2.08	100,000	102,676	2017/7/28
三菱商事 第74回担保提供制限等財務上特約無		1.657	100,000	105,299	2019/7/29
高島屋 第11回社債間限定同順位特約付		0.451	200,000	203,900	2021/7/30
丸井グループ 第25回社債間限定同順位特約付		0.344	100,000	100,546	2019/6/4
丸井グループ 第28回社債間限定同順位特約付		0.543	200,000	202,412	2022/6/3
クレディセゾン 第50回社債間限定同順位特約付		0.904	100,000	102,601	2024/4/24
クレディセゾン 第51回社債間限定同順位特約付		0.884	100,000	102,446	2024/6/18
イオン 第16回社債間限定同順位特約付		1.01	100,000	102,273	2018/11/21
三菱UFJフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付		0.94	100,000	103,959	2024/6/26
三井住友トラスト・ホールディングス 第2回劣後特約付		0.915	200,000	206,372	2025/6/5
みずほコーポレート銀行 第8回特定社債間限定同順位特約付		2.54	100,000	123,239	2027/7/27
みずほコーポレート銀行 第31回特定社債間限定同順位特約付		0.33	2,000,000	2,008,440	2017/10/25
みずほコーポレート銀行 第32回特定社債間限定同順位特約付		0.27	300,000	301,194	2018/1/24
みずほコーポレート銀行 第7回劣後特約付		2.5	100,000	107,271	2019/6/3
三菱東京UFJ銀行 第9回特定社債間限定同順位特約付		2.69	100,000	110,245	2020/2/27
東京三菱銀行 第57回特定社債間限定同順位特約付		2.22	100,000	113,666	2022/10/27
三菱東京UFJ銀行 第93回特定社債間限定同順位特約付		1.985	100,000	102,977	2017/10/17
三菱東京UFJ銀行 第119回特定社債間限定同順位特約付		1.035	100,000	104,344	2020/10/15
三菱東京UFJ銀行 第140回特定社債間限定同順位特約付		0.24	500,000	501,715	2018/1/23
三菱東京UFJ銀行 第12回(劣後特約付)		2.16	300,000	307,980	2017/7/28
三井住友フィナンシャルグループ 第1回劣後特約付		0.849	300,000	308,415	2024/9/12
三井住友フィナンシャルグループ 第3回劣後特約付		0.884	100,000	102,999	2025/5/29
三井住友フィナンシャルグループ 第4回劣後特約付		1.328	100,000	106,895	2030/5/29
りそな銀行 第4回社債間限定同順位特約付		2.766	100,000	108,194	2019/6/20
りそな銀行 第6回劣後特約付		2.084	300,000	321,513	2020/3/4
三菱UFJ信託銀行 第9回劣後特約付		1.68	100,000	107,428	2021/4/28
三井住友信託銀行 第1回劣後特約付		1.389	300,000	321,579	2022/9/20
三井住友信託銀行 第7回社債間限定同順位特約付		0.269	100,000	100,670	2019/4/26
セブン銀行 第10回社債間限定同順位特約付		0.803	100,000	104,380	2023/3/20
セブン銀行 第11回社債間限定同順位特約付		0.536	100,000	102,498	2024/12/20
みずほフィナンシャルグループ 第1回劣後特約付		0.95	200,000	206,470	2024/7/16
三井住友銀行 第57回社債間限定同順位特約付		0.28	100,000	100,372	2017/10/20
三井住友銀行 第24回劣後特約付		1.6	100,000	107,288	2021/6/1
みずほ銀行 第35回特定社債間限定同順位特約付		0.285	100,000	100,638	2019/1/25
興銀リース 第4回社債間限定同順位特約付		0.36	100,000	100,781	2019/5/23
NTTファイナンス 第45回社債間限定同順位特約付		0.15	100,000	100,110	2017/6/20
NTTファイナンス 第46回社債間限定同順位特約付		0.25	100,000	100,671	2019/6/20
ホンダファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付		0.315	100,000	100,728	2018/9/20
ホンダファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付		0.26	100,000	100,541	2019/6/20
ジャックス 第12回社債間限定同順位特約付		0.545	100,000	100,912	2021/12/3
オリエントコーポレーション 第2回社債間限定同順位特約付		0.45	200,000	201,170	2020/1/22

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
日立キャピタル	第52回社債間限定同順位特約付	0.508	100,000	101,784	2021/6/18
日立キャピタル	第56回社債間限定同順位特約付	0.197	100,000	100,381	2019/12/20
日立キャピタル	第57回社債間限定同順位特約付	0.616	100,000	102,480	2024/12/20
オリックス	第144回社債間限定同順位特約付	1.51	100,000	102,352	2017/12/22
オリックス	第164回社債間限定同順位特約付	1.146	100,000	103,282	2019/8/7
三井住友ファイナンス&リース	第7回社債間限定同順位特約付	0.442	100,000	100,922	2018/8/6
三井住友ファイナンス&リース	第13回社債間限定同順位特約付	0.257	100,000	100,600	2020/5/28
三菱ＵＦＪリース	第19回社債間限定同順位特約付	0.487	100,000	100,461	2017/5/29
三菱ＵＦＪリース	第30回社債間限定同順位特約付	0.426	100,000	101,458	2021/8/27
大和証券グループ本社	第17回社債間限定同順位特約付	0.398	100,000	100,799	2019/8/28
大和証券グループ本社	第22回社債間限定同順位特約付	0.397	100,000	100,795	2020/8/12
大和証券グループ本社	第23回社債間限定同順位特約付	0.909	100,000	103,373	2025/8/12
野村ホールディングス	第21回	1.86	100,000	106,733	2020/3/17
野村ホールディングス	第41回	0.783	200,000	202,992	2018/6/20
第1回財政融資マスタートラスト特定目会社	第1回特定社債	1.83	100,000	103,040	2018/2/20
三井不動産	第34回社債間限定同順位特約付	2.085	100,000	105,847	2019/3/20
三菱地所	第56回担保提供制限等財務上特約無	2.42	100,000	113,838	2022/6/20
三菱地所	第98回担保提供制限等財務上特約無	1.165	100,000	104,334	2020/6/19
三菱地所	第110回担保提供制限等財務上特約無	0.571	100,000	101,682	2019/9/13
三菱地所	第111回担保提供制限等財務上特約無	0.929	100,000	104,718	2022/9/14
東京建物	第17回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	103,997	2020/3/18
住友不動産	第95回社債間限定同順位特約付	0.987	100,000	103,467	2024/1/26
住友不動産	第97回社債間限定同順位特約付	0.904	200,000	205,524	2024/4/26
住友不動産	第100回社債間限定同順位特約付	0.809	100,000	101,982	2024/9/9
エヌ・ティ・ティ都市開発	第10回社債間限定同順位特約付	1.03	100,000	104,028	2020/9/18
日本ビルファンド投資法人	第13回特定投資法人債間限定同順位	1.168	100,000	105,639	2023/6/26
オリックス不動産投資法人	第5回特定投資法人債間限定同順位特	0.76	100,000	101,384	2018/2/8
積水ハウス・ＳＩレジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	102,890	2024/8/30
東武鉄道	第102回社債間限定同順位特約付	1.36	200,000	216,776	2025/10/23
東京急行電鉄	第75回社債間限定同順位特約付	0.982	100,000	105,307	2022/6/7
東京急行電鉄	第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	109,692	2033/6/3
小田急電鉄	第68回社債間限定同順位特約付	1.098	200,000	215,830	2030/6/12
東日本旅客鉄道	第15回	2.65	100,000	111,212	2020/8/25
東日本旅客鉄道	第19回社債間限定同順位特約付	2.36	200,000	226,884	2022/2/25
東日本旅客鉄道	第58回社債間限定同順位特約付	1.58	200,000	208,946	2019/3/20
東日本旅客鉄道	第71回社債間限定同順位特約付	1.905	100,000	120,925	2030/9/27
東日本旅客鉄道	第107回社債間限定同順位特約付	1.415	100,000	113,159	2045/1/27
西日本旅客鉄道	第15回社債間限定同順位特約付	2.26	100,000	122,680	2027/12/20
西日本旅客鉄道	第31回社債間限定同順位特約付	1.408	100,000	106,414	2021/2/26
東海旅客鉄道	第16回社債間限定同順位特約付	1.875	100,000	106,217	2019/9/20
東海旅客鉄道	第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	249,552	2030/4/23
東海旅客鉄道	第70回社債間限定同順位特約付	1.309	100,000	112,194	2032/9/30
東海旅客鉄道	第74回社債間限定同順位特約付	1.685	100,000	120,055	2045/3/6
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	103,924	2027/4/30
三菱倉庫	第14回	0.442	100,000	101,601	2021/3/12
住友倉庫	第1回社債間限定同順位特約付	0.279	200,000	201,234	2019/3/14
日本電信電話	第60回	1.31	100,000	105,706	2020/12/18
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	104,548	2023/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
N T T ドコモ	第15回社債間限定同順位特約付	1.96	100,000	104,290	2018/6/20
電源開発	第31回社債間限定同順位特約付	1.155	100,000	104,491	2020/9/18
電源開発	第37回社債間限定同順位特約付	1.035	100,000	104,612	2021/7/20
電源開発	第39回社債間限定同順位特約付	0.929	100,000	104,563	2024/2/20
電源開発	第40回社債間限定同順位特約付	0.889	100,000	104,293	2024/6/20
電源開発	第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	103,416	2024/8/20
東京瓦斯	第17回社債間限定同順位特約付	2.625	100,000	105,594	2018/6/11
東京瓦斯	第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	126,797	2043/12/17
大阪瓦斯	第9回社債間限定同順位特約付	2.9	100,000	105,149	2018/1/30
東邦瓦斯	第31回社債間限定同順位特約付	2.06	100,000	111,656	2022/3/18
東京都競馬	第2回社債間限定同順位特約付	0.572	200,000	202,360	2018/7/11
ファーストリテイリング	第3回特定社債間限定同順位特約付	0.491	100,000	101,987	2022/12/16
ノルデア・バンク	第6回円貨社債(2014)	0.288	100,000	100,108	2017/5/26
新韓銀行	第5回円貨社債(2014)	0.39	200,000	199,336	2017/11/13
クレディ・アグリコル・エス・エー	第6回円貨社債(2014)	0.865	100,000	102,281	2024/11/28
ザ・ホンコン・アンド・シャンハイ・バンキング	第2回円貨社債	0.345	200,000	200,708	2019/6/27
マラヤン・バンキング・ベルハッド	第2回円貨社債(2015)	0.509	200,000	193,356	2020/4/30
スタンダード・チャータード	第2回円貨社債(2015)	0.453	100,000	97,283	2020/6/5
スタンダード・チャータード	第3回円貨社債(2015)	1.043	100,000	91,853	2025/6/5
エイチエスピーシー・ファイナンス・コーポレーション	第12回	2.54	100,000	108,046	2021/2/16
パークレイズ・バンク・ピーエルシー	第7回円貨社債	0.478	100,000	99,963	2019/6/24
ナショナル・オーストラリア銀行	第11回円貨社債(2015)	0.284	200,000	200,656	2020/1/16
ラボバンク・ネダーランド	第16回円貨社債(2012)(コー	1.142	100,000	101,177	2017/5/25
ラボバンク・ネダーランド	第18回円貨社債(2012)(コー	0.778	100,000	101,014	2017/11/2
ラボバンク・ネダーランド	第25回円貨社債(2014)(コー	0.434	100,000	100,695	2019/5/22
ソシエテ ジェネラル	第6回円貨社債(2014)	0.552	200,000	202,162	2019/6/13
小	計		28,907,000	30,007,290	
合	計		587,551,203	652,739,697	

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年3月31日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 652,739,697	% 98.7
コール・ローン等、その他	8,642,073	1.3
投資信託財産総額	661,381,770	100.0

* 金額の単位未満は切り捨て。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年3月31日現在)

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

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

○損益の状況 (2015年4月1日～2016年3月31日)

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

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

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

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

○当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

ファンド名	当期末 元本額
	百万円
野村国内債券インデックスファンド	377
野村世界6資産分散投信(安定コース)	17,103
野村世界6資産分散投信(分配コース)	20,341
野村世界6資産分散投信(成長コース)	2,467
野村資産設計ファンド2015	576
野村資産設計ファンド2020	300
野村資産設計ファンド2025	218
野村資産設計ファンド2030	133
野村資産設計ファンド2035	68
野村資産設計ファンド2040	144
野村日本債券インデックスファンド	1,533
野村日本債券インデックス(野村投資一任口座向け)	257,355
のむラップ・ファンド(保守型)	8,061
のむラップ・ファンド(普通型)	3,815
のむラップ・ファンド(積極型)	652
野村日本債券インデックス(野村SMA向け)	19,402
野村資産設計ファンド2045	10
野村円債投資インデックスファンド	2,165
野村インデックスファンド・国内債券	1,029
マイ・ロード	31,707
野村インデックスファンド・内外7資産バランス・為替ヘッジ型	199
野村ターゲットプライス「日経225」(国内債券運用移行型)	69
野村時間分散投資「日経225・国内債券」(限定追加型)	57

ファンド名	当期末
	元本額
野村日本債券インデックス（野村SMA・EW向け）	百万円 5,160
野村世界6資産分散投信（配分変更コース）	1,213
野村資産設計ファンド2050	4
グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,088
グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	267
グローバル・インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	12,002
グローバル・インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	1,759
ワールド・インデックス・ファンドVA安定型（適格機関投資家専用）	50
ワールド・インデックス・ファンドVAバランス型（適格機関投資家専用）	40
ワールド・インデックス・ファンドVA積極型（適格機関投資家専用）	7
野村インデックス・バランス60VA（適格機関投資家専用）	7,122
野村ワールド・インデックス・バランス35VA（適格機関投資家専用）	385
野村ワールド・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	2,100
野村世界インデックス・バランス40VA（適格機関投資家専用）	930
野村グローバル・インデックス・バランス25VA（適格機関投資家専用）	200
野村グローバル・インデックス・バランス50VA（適格機関投資家専用）	390
野村グローバル・インデックス・バランス75VA（適格機関投資家専用）	864
野村世界バランス25VA（適格機関投資家専用）	1,865
ノムラ日本債券インデックスファンドVA（適格機関投資家専用）	703
ノムラFOFs用インデックスファンド・国内債券（適格機関投資家専用）	591
マイバランス30（確定拠出年金向け）	11,247
マイバランス50（確定拠出年金向け）	16,227
マイバランス70（確定拠出年金向け）	7,198
野村国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合（確定拠出年金向け）	40,965
マイバランスDC30	6,155
マイバランスDC50	3,888
マイバランスDC70	1,171
野村DC国内債券インデックスファンド・NOMURA-BPI総合	7,890
マイターゲット2050（確定拠出年金向け）	36
マイターゲット2030（確定拠出年金向け）	0
マイターゲット2040（確定拠出年金向け）	0

*単位未満は切り捨て。

〇お知らせ

該当事項はございません。

外国債券為替ヘッジ型マザーファンド

運用報告書

第3期（決算日2016年9月6日）

作成対象期間（2015年9月8日～2016年9月6日）

受益者のみなさまへ

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

●当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。外貨建て資産については、原則として為替ヘッジを行います。
主な投資対象	外国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	株式への投資は行いません。外貨建て資産への投資割合には制限を設けません。デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。

野村アセットマネジメント

東京都中央区日本橋1-12-1

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

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率	純 資 産 額
	期 騰	中 落 率	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	期 騰 落 率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2013年9月12日	10,000	—	100.00	—	—	—	299
1期(2014年9月8日)	10,758	7.6	107.83	7.8	98.1	—	543
2期(2015年9月7日)	11,088	3.1	111.34	3.3	96.0	—	1,354
3期(2016年9月6日)	11,711	5.6	117.74	5.7	99.2	—	4,324

*債券先物比率は買い建て比率－売り建て比率。

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

*シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、数値の公表、利用など指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。

(出所) Citigroup Index LLC

○当期中の基準価額と市況等の推移

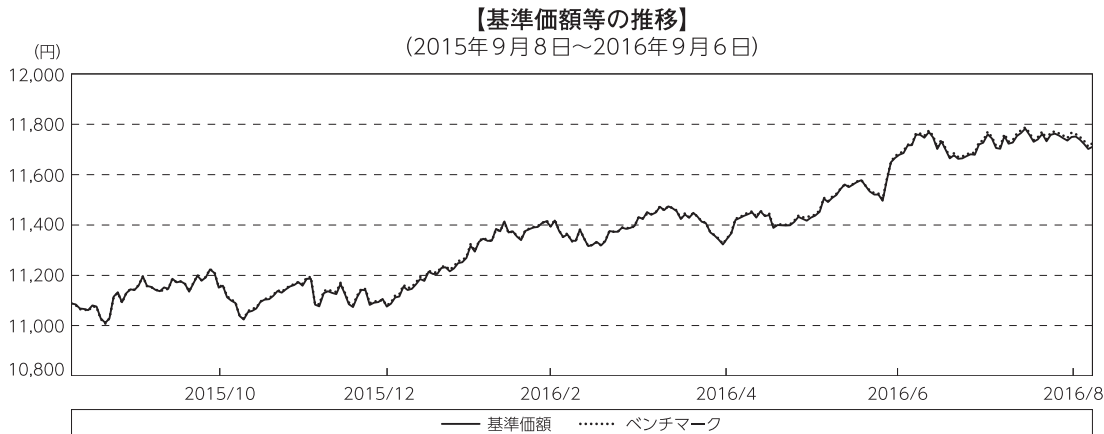
年 月 日	基 準 価 額		ベ ン チ マ ー ク		債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落	率	シティ世界国債インデックス (除く日本、円ヘッジ・円ベース)	騰 落 率		
(期 首)	円	%		%	%	%
2015年9月7日	11,088	—	111.34	—	96.0	—
9月末	11,144	0.5	111.91	0.5	97.4	—
10月末	11,151	0.6	112.00	0.6	98.2	—
11月末	11,173	0.8	112.20	0.8	97.5	—
12月末	11,076	△0.1	111.26	△0.1	97.0	—
2016年1月末	11,269	1.6	113.19	1.7	97.9	—
2月末	11,393	2.8	114.42	2.8	92.6	—
3月末	11,424	3.0	114.74	3.1	100.3	—
4月末	11,345	2.3	113.94	2.3	96.6	—
5月末	11,417	3.0	114.79	3.1	100.8	—
6月末	11,679	5.3	117.32	5.4	91.4	—
7月末	11,727	5.8	117.84	5.8	99.9	—
8月末	11,752	6.0	118.09	6.1	99.4	—
(期 末)						
2016年9月6日	11,711	5.6	117.74	5.7	99.2	—

*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、シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）です。作成期首の値が基準価額と同一となるように計算しております。

○基準価額の主な変動要因

基準価額は、期首11,088円から期末11,711円へと上昇し、値上がり額は623円となりました。

外国債券利回りが長期債を中心に低下（価格は上昇）したことがプラスに寄与し、基準価額は上昇しました。

○当ファンドのポートフォリオ

シティ世界国債インデックス（除く日本、円ヘッジ・円ベース）の動きに連動する投資成果を目指すため、地域構成、満期構成、デュレーション（金利感応度）、流動性などを考慮して選択した指数構成国の国債に分散投資しました。毎月末における指数構成銘柄の変更に対応し、ファンドの特性値（地域構成や平均デュレーションなど）を指数に合わせるようにポートフォリオのリバランス（投資比率の再調整）を行いました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。なお、外貨建て資産については概ねベンチマークと同様に為替ヘッジを行いました。

○当ファンドのベンチマークとの差異

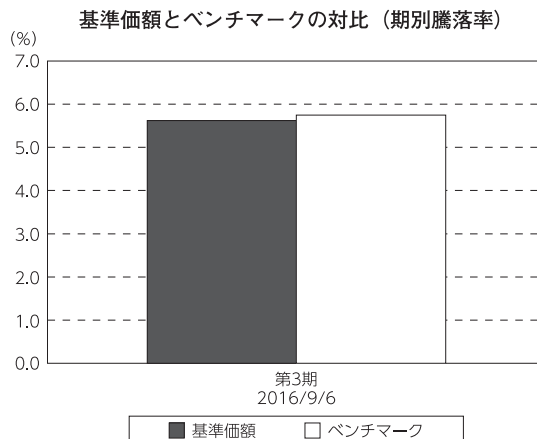
今期の基準価額の騰落率は+5.6%となり、ベンチマークの+5.7%を0.1ポイント下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

(マイナス要因)

コスト負担（債券に係る保管費用などのコスト）が生じること

(その他の要因)

ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なること



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

◎今後の運用方針

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

○1万口当たりの費用明細

(2015年9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用	円 6	% 0.050	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 保 管 費 用 ）	(5)	(0.048)	保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用
（ そ の 他 ）	(0)	(0.002)	信託事務の処理に要するその他の諸費用
合 計	6	0.050	
期中の平均基準価額は、11,379円です。			

*各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

○売買及び取引の状況

(2015年9月8日～2016年9月6日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外	アメリカ	国債証券	千米ドル 16,947	千米ドル 3,887
	カナダ	国債証券	千カナダドル 761	千カナダドル 31
	イギリス	国債証券	千英ポンド 2,053	千英ポンド 513
	スイス	国債証券	千スイスフラン 91	千スイスフラン －
	スウェーデン	国債証券	千スウェーデンクローナ 1,068	千スウェーデンクローナ －
	ノルウェー	国債証券	千ノルウェークローネ 543	千ノルウェークローネ －
	デンマーク	国債証券	千デンマーククローネ 1,205	千デンマーククローネ 112
	ユーロ		千ユーロ	千ユーロ
	ドイツ	国債証券	2,087	507
	イタリア	国債証券	4,697	1,262
	フランス	国債証券	2,767	407
	オランダ	国債証券	533	47
	スペイン	国債証券	2,554	535
	ベルギー	国債証券	693	105
	オーストリア	国債証券	312	112
	フィンランド	国債証券	75	－
	アイルランド	国債証券	184	－
国	ポーランド	国債証券	千ズロチ 596	千ズロチ －
	シンガポール	国債証券	千シンガポールドル 189	千シンガポールドル －
	オーストラリア	国債証券	千豪ドル 823	千豪ドル 22
	メキシコ	国債証券	千メキシコペソ 3,844	千メキシコペソ －
	南アフリカ	国債証券	千ランド 2,722	千ランド 717

*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。

○利害関係人との取引状況等

(2015年9月8日～2016年9月6日)

利害関係人との取引状況

区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
為替先物取引	33,285	512	1.5	36,739	566	1.5
為替直物取引	4,010	60	1.5	729	—	—
預金	2,603	2,603	100.0	2,603	2,603	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信託銀行です。

○組入資産の明細

(2016年9月6日現在)

外国公社債

(A)外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千米ドル	千米ドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	16,950	18,065	1,871,546	43.3	—	16.9	17.6	8.8
カナダ	千カナダドル 890	千カナダドル 1,035	82,943	1.9	—	0.9	0.8	0.2
イギリス	千英ポンド 1,880	千英ポンド 2,553	351,970	8.1	—	6.0	1.8	0.3
スイス	千スイスフラン 80	千スイスフラン 90	9,592	0.2	—	—	0.2	—
スウェーデン	千スウェーデンクローナ 900	千スウェーデンクローナ 1,120	13,541	0.3	—	0.3	—	—
ノルウェー	千ノルウェークローネ 500	千ノルウェークローネ 544	6,809	0.2	—	0.1	0.1	—
デンマーク	千デンマーククローネ 1,040	千デンマーククローネ 1,463	22,703	0.5	—	0.5	—	—
ユーロ	千ユーロ	千ユーロ						
ドイツ	1,540	2,025	233,825	5.4	—	4.6	0.9	—
イタリア	3,930	4,660	537,990	12.4	—	5.8	4.7	1.9
フランス	2,590	3,239	373,914	8.6	—	6.7	1.9	—
オランダ	590	742	85,754	2.0	—	1.3	0.7	—
スペイン	2,270	2,739	316,186	7.3	—	3.7	2.1	1.6
ベルギー	560	807	93,223	2.2	—	1.8	0.3	—
オーストリア	260	360	41,621	1.0	—	0.8	0.2	—
フィンランド	130	147	17,065	0.4	—	0.3	0.1	—
アイルランド	220	275	31,811	0.7	—	0.5	0.2	—
ポーランド	千ズロチ 760	千ズロチ 805	21,427	0.5	—	0.2	0.3	—
シンガポール	千シンガポールドル 380	千シンガポールドル 404	30,863	0.7	—	0.3	0.3	0.1
オーストラリア	千豪ドル 910	千豪ドル 1,020	80,375	1.9	—	1.2	0.6	—
メキシコ	千メキシコペソ 6,400	千メキシコペソ 7,132	39,801	0.9	—	0.5	0.3	0.2
南アフリカ	千ランド 4,150	千ランド 3,637	26,190	0.6	—	0.4	0.1	0.1
合 計	—	—	4,289,160	99.2	—	52.9	33.1	13.2

* 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			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. 25	70	92	9, 576	2023/ 8 /15	
	US TREASURY BOND	2. 375	240	255	26, 431	2024/ 8 /15	
	US TREASURY BOND	6. 0	210	291	30, 251	2026/ 2 /15	
	US TREASURY BOND	6. 5	80	117	12, 121	2026/11/15	
	US TREASURY BOND	5. 5	80	112	11, 693	2028/ 8 /15	
	US TREASURY BOND	5. 25	20	27	2, 880	2028/11/15	
	US TREASURY BOND	5. 25	40	55	5, 781	2029/ 2 /15	
	US TREASURY BOND	2. 875	330	371	38, 512	2043/ 5 /15	
	US TREASURY BOND	3. 75	100	131	13, 640	2043/11/15	
	US TREASURY N/B	0. 625	150	149	15, 533	2017/ 8 /31	
	US TREASURY N/B	0. 625	410	409	42, 446	2017/ 9 /30	
	US TREASURY N/B	0. 75	700	700	72, 553	2017/10/31	
	US TREASURY N/B	4. 25	80	83	8, 633	2017/11/15	
	US TREASURY N/B	2. 75	100	102	10, 631	2017/12/31	
	US TREASURY N/B	2. 625	300	307	31, 889	2018/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	0. 75	340	339	35, 218	2018/ 2 /28	
	US TREASURY N/B	0. 75	280	279	29, 004	2018/ 3 /31	
	US TREASURY N/B	0. 75	300	299	31, 070	2018/ 4 /15	
	US TREASURY N/B	1. 0	200	200	20, 797	2018/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	0. 875	360	360	37, 352	2018/ 7 /15	
	US TREASURY N/B	4. 0	170	180	18, 721	2018/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	1. 375	250	252	26, 194	2018/ 9 /30	
	US TREASURY N/B	1. 25	100	100	10, 452	2018/11/30	
	US TREASURY N/B	1. 375	200	202	20, 968	2018/12/31	
	US TREASURY N/B	1. 125	250	251	26, 058	2019/ 1 /15	
	US TREASURY N/B	1. 25	190	191	19, 867	2019/ 1 /31	
	US TREASURY N/B	1. 375	250	253	26, 226	2019/ 2 /28	
	US TREASURY N/B	0. 875	300	299	31, 076	2019/ 4 /15	
	US TREASURY N/B	1. 5	230	233	24, 219	2019/ 5 /31	
	US TREASURY N/B	1. 625	200	204	21, 136	2019/ 6 /30	
	US TREASURY N/B	0. 875	200	199	20, 703	2019/ 7 /31	
	US TREASURY N/B	3. 625	70	75	7, 819	2019/ 8 /15	
	US TREASURY N/B	1. 75	100	102	10, 612	2019/ 9 /30	
	US TREASURY N/B	1. 25	150	151	15, 680	2019/10/31	
	US TREASURY N/B	1. 5	100	101	10, 533	2019/10/31	
	US TREASURY N/B	3. 375	330	354	36, 765	2019/11/15	
	US TREASURY N/B	1. 0	20	20	2, 073	2019/11/30	
	US TREASURY N/B	3. 625	140	152	15, 778	2020/ 2 /15	
	US TREASURY N/B	1. 375	100	101	10, 483	2020/ 2 /29	
	US TREASURY N/B	1. 125	130	130	13, 507	2020/ 4 /30	
US TREASURY N/B	1. 375	100	101	10, 482	2020/ 4 /30		
US TREASURY N/B	3. 5	80	87	9, 016	2020/ 5 /15		
US TREASURY N/B	1. 5	150	152	15, 787	2020/ 5 /31		
US TREASURY N/B	1. 625	150	153	15, 856	2020/ 6 /30		
US TREASURY N/B	2. 625	140	148	15, 350	2020/ 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	
アメリカ	国債証券	%	千米ドル	千米ドル	千円	
		2.625	440	466	48,333	2020/11/15
		2.375	500	525	54,454	2020/12/31
		2.125	300	312	32,347	2021/1/31
		3.625	200	221	22,911	2021/2/15
		2.0	180	186	19,318	2021/2/28
		2.25	350	366	37,973	2021/3/31
		3.125	350	380	39,432	2021/5/15
		2.0	130	134	13,962	2021/5/31
		2.125	350	365	37,818	2021/6/30
		2.125	350	364	37,809	2021/8/15
		2.0	100	103	10,745	2021/11/15
		1.75	100	102	10,602	2022/2/28
		1.75	120	122	12,717	2022/5/15
		1.875	100	102	10,659	2022/8/31
		1.625	50	50	5,250	2022/11/15
		2.125	260	271	28,095	2022/12/31
		1.75	250	255	26,428	2023/1/31
		2.0	210	217	22,544	2023/2/15
		1.5	350	351	36,427	2023/2/28
		1.5	120	120	12,481	2023/3/31
		1.75	230	234	24,300	2023/5/15
		2.5	150	160	16,621	2023/8/15
		2.75	100	108	11,272	2023/11/15
		2.75	100	108	11,286	2024/2/15
		2.5	150	160	16,663	2024/5/15
		2.25	150	158	16,377	2024/11/15
		2.125	230	240	24,889	2025/5/15
		2.0	180	186	19,274	2025/8/15
		2.25	140	147	15,300	2025/11/15
		1.625	120	120	12,444	2026/2/15
		5.0	200	302	31,384	2037/5/15
		4.5	60	86	8,918	2038/5/15
		4.625	100	145	15,111	2040/2/15
		3.875	60	79	8,200	2040/8/15
		2.75	60	66	6,852	2042/8/15
		2.75	120	132	13,688	2042/11/15
		3.125	70	82	8,548	2043/2/15
		3.625	90	115	12,007	2043/8/15
		3.625	180	231	24,018	2044/2/15
		3.375	30	37	3,836	2044/5/15
		3.125	60	70	7,338	2044/8/15
		3.0	80	92	9,562	2044/11/15
		2.5	190	198	20,595	2045/2/15
		3.0	140	161	16,733	2045/5/15
		2.875	410	461	47,861	2045/8/15
		2.875	250	258	26,746	2018/3/31
小	計				1,871,546	

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	
カナダ			%	千カナダドル	千カナダドル	千円	
	国債証券	CANADIAN GOVERNMENT	0.25	70	69	5,577	2018/5/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.25	60	60	4,871	2018/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.75	150	154	12,370	2019/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	1.5	110	113	9,089	2020/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	120	120	9,652	2021/3/1
		CANADIAN GOVERNMENT	0.75	30	30	2,410	2021/9/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.5	40	44	3,590	2024/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	2.25	70	77	6,206	2025/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	8.0	40	67	5,415	2027/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.75	30	48	3,899	2033/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	5.0	20	31	2,545	2037/6/1
		CANADIAN GOVERNMENT	4.0	50	73	5,891	2041/6/1
CANADIAN GOVERNMENT	3.5	100	142	11,423	2045/12/1		
小 計						82,943	
イギリス				千英ポンド	千英ポンド		
	国債証券	UK TREASURY	1.0	90	90	12,515	2017/9/7
		UK TREASURY	4.5	100	111	15,317	2019/3/7
		UK TREASURY	3.75	140	155	21,427	2019/9/7
		UK TREASURY	3.75	210	240	33,108	2020/9/7
		UK TREASURY	8.0	50	68	9,426	2021/6/7
		UK TREASURY	4.0	100	120	16,597	2022/3/7
		UK TREASURY	1.75	60	65	8,971	2022/9/7
		UK TREASURY	2.25	100	112	15,532	2023/9/7
		UK TREASURY	2.0	120	134	18,560	2025/9/7
		UK TREASURY	6.0	90	143	19,813	2028/12/7
		UK TREASURY	4.75	50	75	10,381	2030/12/7
		UK TREASURY	4.25	30	43	6,055	2032/6/7
		UK TREASURY	4.5	40	61	8,523	2034/9/7
		UK TREASURY	4.25	20	30	4,220	2036/3/7
		UK TREASURY	4.75	100	167	23,139	2038/12/7
		UK TREASURY	3.5	160	242	33,467	2045/1/22
		UK TREASURY	4.25	30	52	7,174	2046/12/7
		UK TREASURY	4.0	80	157	21,735	2060/1/22
		UK TSY 3 1/4% 2044	3.25	250	360	49,756	2044/1/22
UNITED KINGDOM(GOVERNMENT)	4.25	60	117	16,244	2055/12/7		
小 計						351,970	
スイス				千スイスフラン	千スイスフラン		
	国債証券	SWITZERLAND GOVERNMENT	2.0	80	90	9,592	2021/4/28
小 計						9,592	
スウェーデン				千スウェーデンクローナ	千スウェーデンクローナ		
	国債証券	SWEDISH GOVERNMENT	1.5	400	449	5,438	2023/11/13
		SWEDISH GOVERNMENT	2.5	300	366	4,434	2025/5/12
		SWEDISH GOVERNMENT	3.5	200	303	3,668	2039/3/30
小 計						13,541	
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	3.75	200	227	2,843	2021/5/25

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	
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	千円	
	国債証券	NORWEGIAN GOVERNMENT	1.75	300	317	3,966	2025/3/13
小 計						6,809	
デンマーク				千デンマーククローネ	千デンマーククローネ		
	国債証券	KINGDOM OF DENMARK	1.5	350	393	6,096	2023/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	1.75	300	346	5,378	2025/11/15
		KINGDOM OF DENMARK	4.5	390	723	11,228	2039/11/15
小 計						22,703	
ユーロ				千ユーロ	千ユーロ		
ドイツ	国債証券	BUNDESOBLIGATION	—	200	204	23,618	2020/4/17
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.0	100	114	13,163	2020/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	250	284	32,782	2022/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.5	80	90	10,446	2023/5/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.0	100	117	13,514	2023/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.75	10	11	1,338	2024/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	1.0	190	210	24,249	2024/8/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	0.5	90	95	11,001	2026/2/15
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	130	203	23,514	2028/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	5.5	60	106	12,235	2031/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	50	89	10,341	2034/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.0	50	86	9,955	2037/1/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	4.75	100	198	22,929	2040/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	3.25	100	167	19,379	2042/7/4
		BUNDESREPUB. DEUTSCHLAND	2.5	30	46	5,355	2046/8/15
イタリア	国債証券	BUONI POLIENNALI DEL TES	0.75	200	202	23,365	2018/1/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	240	255	29,498	2018/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.25	140	140	16,253	2018/5/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	100	108	12,542	2018/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	150	161	18,691	2018/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	550	606	70,012	2019/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	160	178	20,550	2019/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	100	104	12,043	2019/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.25	170	194	22,480	2020/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	90	103	12,001	2020/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	30	34	4,014	2021/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.75	110	127	14,751	2021/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	210	256	29,597	2021/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.35	230	241	27,900	2022/4/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	0.95	100	102	11,801	2023/3/15
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	100	125	14,477	2023/5/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	50	63	7,382	2023/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	9.0	80	126	14,561	2023/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	120	152	17,572	2024/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	2.5	50	56	6,493	2024/12/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	90	119	13,806	2025/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.5	30	31	3,611	2025/6/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.5	50	65	7,541	2026/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	210	289	33,432	2028/9/1

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	5.25	90	131	15,162	2029/11/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.5	60	75	8,692	2030/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	1.65	50	51	5,886	2032/3/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	110	165	19,114	2034/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.0	40	54	6,313	2037/2/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	30	46	5,389	2039/8/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	5.0	110	171	19,824	2040/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	4.75	50	77	8,940	2044/9/1
		BUONI POLIENNALI DEL TES	3.25	30	37	4,282	2046/9/1
フランス	国債証券	FRANCE (GOVT OF)	1.0	200	208	24,069	2019/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	150	155	17,897	2019/11/25
		FRANCE (GOVT OF)	—	160	163	18,818	2020/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	1.75	50	56	6,548	2023/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.25	160	189	21,887	2024/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	0.5	150	156	18,026	2025/5/25
		FRANCE (GOVT OF)	2.5	110	140	16,173	2030/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	70	80	9,270	2020/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.75	90	107	12,420	2021/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	150	178	20,579	2021/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.0	120	142	16,495	2022/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.25	160	185	21,393	2022/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.75	180	206	23,849	2024/11/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	6.0	70	108	12,488	2025/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.5	100	132	15,278	2026/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	2.75	60	76	8,811	2027/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	5.5	120	196	22,716	2029/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	1.5	140	159	18,368	2031/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	150	246	28,407	2038/10/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.5	70	125	14,512	2041/4/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	3.25	60	93	10,769	2045/5/25
		FRANCE GOVERNMENT O. A. T	4.0	70	131	15,131	2055/4/25
オランダ	国債証券	NETHERLANDS GOVERNMENT	4.0	100	113	13,080	2019/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.5	100	115	13,382	2020/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.25	20	23	2,732	2021/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	30	37	4,385	2023/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.0	70	82	9,498	2024/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.25	40	41	4,747	2025/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	0.5	80	83	9,632	2026/7/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	2.5	50	67	7,790	2033/1/15
		NETHERLANDS GOVERNMENT	3.75	100	177	20,504	2042/1/15
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.5	330	351	40,578	2018/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.1	230	248	28,693	2018/7/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.25	200	201	23,266	2019/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	130	139	16,119	2019/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.4	170	178	20,557	2020/1/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.0	50	57	6,608	2020/4/30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.85	30	35	4,154	2020/10/31

銘柄			当 期 末				
			利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日
					外貨建金額	邦貨換算金額	
ユーロ			%	千ユーロ	千ユーロ	千円	
スペイン	国債証券	BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.5	100	125	14,436	2021/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	0.75	30	30	3,566	2021/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.85	190	247	28,553	2022/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.4	100	131	15,169	2023/ 1 /31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.4	120	152	17,558	2023/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	2.75	20	23	2,665	2024/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.65	110	145	16,775	2025/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	1.95	70	76	8,789	2026/ 4 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.9	60	87	10,091	2026/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	60	85	9,906	2028/10/31
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	4.7	80	123	14,236	2041/ 7 /30
		BONOS Y OBLIG DEL ESTADO	5.15	50	82	9,571	2044/10/31
		SPANISH GOVERNMENT	6.0	60	92	10,695	2029/ 1 /31
		SPANISH GOVERNMENT	5.75	50	80	9,280	2032/ 7 /30
		SPANISH GOVERNMENT	4.2	30	42	4,913	2037/ 1 /31
ベルギー	国債証券	BELGIUM KINGDOM	3.75	110	129	14,929	2020/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	30	38	4,447	2022/ 9 /28
		BELGIUM KINGDOM	2.6	130	157	18,217	2024/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM	4.0	20	30	3,508	2032/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	4.25	60	104	12,094	2041/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM	3.75	50	84	9,763	2045/ 6 /22
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.5	120	191	22,141	2028/ 3 /28
		BELGIUM KINGDOM GOVT	5.0	40	70	8,122	2035/ 3 /28
オーストリア	国債証券	REPUBLIC OF AUSTRIA	1.95	20	21	2,471	2019/ 6 /18
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.9	30	35	4,055	2020/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	1.75	50	57	6,623	2023/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	0.75	30	31	3,676	2026/10/20
		REPUBLIC OF AUSTRIA	6.25	50	83	9,648	2027/ 7 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	4.15	40	67	7,793	2037/ 3 /15
		REPUBLIC OF AUSTRIA	3.15	40	63	7,352	2044/ 6 /20
フィンランド	国債証券	FINNISH GOVERNMENT	3.375	20	22	2,636	2020/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	2.0	80	93	10,770	2024/ 4 /15
		FINNISH GOVERNMENT	0.75	30	31	3,659	2031/ 4 /15
アイルランド	国債証券	IRELAND(REPUBLIC OF) 4.4	4.4	70	79	9,170	2019/ 6 /18
		IRISH GOVERNMENT	5.4	60	85	9,874	2025/ 3 /13
		IRISH TSY 2.4% 2030	2.4	60	72	8,414	2030/ 5 /15
		REPUBLIC OF IRELAND	3.9	30	37	4,352	2023/ 3 /20
小 計						1,731,394	
ポーランド			千ズロチ	千ズロチ			
	国債証券	POLAND GOVERNMENT BOND	5.5	250	277	7,387	2019/10/25
POLAND GOVERNMENT BOND		2.0	180	178	4,753	2021/ 4 /25	
POLAND GOVERNMENT BOND		4.0	240	261	6,963	2023/10/25	
POLAND GOVERNMENT BOND		2.5	90	87	2,322	2026/ 7 /25	
小 計						21,427	
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	0.5	40	39	3,042	2018/ 4 / 1
SINGAPORE GOVERNMENT		2.25	160	167	12,770	2021/ 6 / 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	
シンガポール			%	千シンガポールドル	千シンガポールドル	千円	
	国債証券	SINGAPORE GOVERNMENT	2.375	50	52	4,011	2025/6/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.875	80	88	6,736	2030/9/1
		SINGAPORE GOVERNMENT	2.75	50	56	4,303	2042/4/1
小 計						30,863	
オーストラリア				千豪ドル	千豪ドル		
	国債証券	AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.25	140	153	12,061	2019/3/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	70	77	6,102	2020/4/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	1.75	120	121	9,544	2020/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	5.75	80	98	7,731	2022/7/15
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	110	117	9,237	2024/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	90	99	7,876	2025/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.25	150	180	14,252	2026/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	2.75	30	32	2,543	2027/11/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	50	56	4,439	2029/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	4.5	30	39	3,083	2033/4/21
		AUSTRALIAN GOVERNMENT	3.25	40	44	3,503	2039/6/21
小 計						80,375	
メキシコ				千メキシコペソ	千メキシコペソ		
	国債証券	MEX BONOS DESARR FIX RT	4.75	1,200	1,192	6,652	2018/6/14
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.0	1,000	1,086	6,063	2020/6/11
		MEX BONOS DESARR FIX RT	6.5	1,200	1,246	6,956	2021/6/10
		MEX BONOS DESARR FIX RT	8.5	1,000	1,220	6,813	2029/5/31
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	200	232	1,297	2034/11/23
		MEX BONOS DESARR FIX RT	10.0	300	427	2,383	2036/11/20
		MEX BONOS DESARR FIX RT	7.75	500	589	3,287	2042/11/13
		MEXICAN FIXED RATE BONDS	8.0	1,000	1,137	6,346	2023/12/7
小 計						39,801	
南アフリカ				千ランド	千ランド		
	国債証券	REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.25	800	804	5,793	2017/9/15
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.75	700	659	4,745	2021/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.75	250	240	1,729	2023/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	8.0	650	589	4,246	2030/1/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	7.0	800	657	4,734	2031/2/28
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.25	700	506	3,644	2036/3/31
		REPUBLIC OF SOUTH AFRICA	6.5	250	180	1,296	2041/2/28
小 計						26,190	
合 計						4,289,160	

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

* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

○投資信託財産の構成

(2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	4,289,160	97.4
コール・ローン等、その他	116,575	2.6
投資信託財産総額	4,405,735	100.0

*金額の単位未満は切り捨て。
*当期末における外貨建て純資産（4,358,844千円）の投資信託財産総額（4,405,735千円）に対する比率は98.9%です。
*外貨建て資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。1米ドル＝103.60円、1カナダドル＝80.12円、1英ポンド＝137.85円、1スイスフラン＝105.66円、1スウェーデンクローナ＝12.09円、1ノルウェークローネ＝12.50円、1デンマーククローネ＝15.51円、1ユーロ＝115.43円、1ズロチ＝26.60円、1シンガポールドル＝76.33円、1豪ドル＝78.78円、1メキシコペソ＝5.58円、1ランド＝7.20円。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2016年9月6日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,753,376,095
コール・ローン等	24,339,744
公社債(評価額)	4,289,160,325
未収入金	4,410,463,535
未収利息	24,181,193
前払費用	5,231,298
(B) 負債	4,428,861,347
未払金	4,428,731,730
未払解約金	4,795
未払利息	22
その他未払費用	124,800
(C) 純資産総額(A－B)	4,324,514,748
元本	3,692,547,438
次期繰越損益金	631,967,310
(D) 受益権総口数	3,692,547,438口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,711円

(注) 期首元本額は1,221,501,342円、期中追加設定元本額は3,189,269,688円、期中一部解約元本額は718,223,592円、1口当たり純資産額は1.1711円です。

(注) 当マザーファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額

- ・野村国内マルチアセット (6資産) ファンド (適格機関投資家専用) 2,706,225,451円
- ・野村インデックスファンド・外国債券・為替ヘッジ型 710,779,048円
- ・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 264,470,021円
- ・野村ターゲットデイトファンド2016 2026-2028年目標型 7,514,509円
- ・野村ターゲットデイトファンド2016 2029-2031年目標型 1,211,454円
- ・野村外国債券インデックス Aコース (野村SMA・EW向け) 850,522円
- ・野村ターゲットデイトファンド2016 2032-2034年目標型 763,065円
- ・野村ターゲットデイトファンド2016 2035-2037年目標型 733,368円

○損益の状況 (2015年9月8日～2016年9月6日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	63,253,122
受取利息	63,263,736
支払利息	△ 10,614
(B) 有価証券売買損益	98,512,089
売買益	794,804,580
売買損	△696,292,491
(C) 保管費用等	△ 1,385,628
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	160,379,583
(E) 前期繰越損益金	132,956,867
(F) 追加信託差損益金	441,687,672
(G) 解約差損益金	△103,056,812
(H) 計(D＋E＋F＋G)	631,967,310
次期繰越損益金(H)	631,967,310

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

○お知らせ

該当事項はございません。

＜お申し込み時の留意点＞

販売会社の営業日であってもお申し込みの受付ができない日（以下「申込不可日」といいます。）があります。

お申し込みの際には、これらの申込不可日に該当する日をご確認のうえ、お申し込みいただきますようよろしくお願いいたします。

（2017年3月29日現在）

年 月	日
2017年 3 月	－
4 月	13、14、17、28
5 月	1、26、29
6 月	－
7 月	3、4
8 月	25、28
9 月	1、4
10 月	－
11 月	－
12 月	22、25、26

※ 2017年12月までに該当する「申込不可日」を現時点で認識しうる情報をもとに作成しておりますが、諸事情等により突然変更される場合があります。

したがって、お申し込みにあたってはその点についても十分ご留意下さい。また、諸事情等による申込不可日の変更は、販売会社に連絡いたしますので、お問い合わせ下さい。

なお、弊社ホームページ（<http://www.nomura-am.co.jp/>）にも掲載いたしております。