

# お金のデザイン・リキッド・ オルタナティブ・ファンド (円ヘッジあり)

## 運用報告書 (全体版)

第3期 (決算日 2022年9月12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。  
さて、「お金のデザイン・リキッド・オルタナティブ・ファンド (円ヘッジあり)」は、2022年9月12日に第3期の決算を行いました。  
ここに作成対象期間の運用経過等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引き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/資産複合  |
| 信託期間   | 原則として、無期限です。(設定日: 2020年6月19日)  |
| 運用方針   | 主として投資信託証券に投資し、リスクを最小限に抑えつつ、長期的に安定した収益の確保と投資信託財産の成長を目指して運用を行います。   |
| 主要運用対象 | ケイマン諸島籍の外国投資法人「DBi リキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド-JPY クラス A シェアーズ」円建て投資信託証券 (運用: ダイナミック・ベータ・インベストメンツ・エルエルシー) ならびに国内上場投信「NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI 総合運動型上場投信」を主要投資対象とします。 |
| 組入制限   | ①上場投資信託証券 (ETF) への投資割合には制限を設けません。<br>②外貨資産への投資割合には制限を設けません。  |
| 分配方針   | 毎年9月10日 (休業日の場合は翌営業日) に決算を行い、収益分配方針に基づき収益分配を行います。ただし、必ず分配を行うものではありません。   |



東京都千代田区紀尾井町1丁目3番

<照会先>

電話番号: 03-6629-7090

(受付時間: 委託会社の営業日の9:30~17:00)

ホームページ: <https://www.money-design.com/>

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

| 決 算 期               | 基 準<br>(分配落) | 価 額       |       |        | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|---------------------|--------------|-----------|-------|--------|----------------------|--------------|
|                     |              | 税 分 込 配 金 | 期 騰 落 | 中 率    |                      |              |
| (設定日)<br>2020年6月19日 | 円<br>10,000  | 円<br>—    |       | %<br>— | %<br>—               | 百万円<br>0.1   |
| 1期(2020年9月10日)      | 10,337       | 0         |       | 3.4    | 96.4                 | 3,408        |
| 2期(2021年9月10日)      | 12,015       | 0         |       | 16.2   | 96.8                 | 6,392        |
| 3期(2022年9月12日)      | 13,068       | 0         |       | 8.8    | 97.3                 | 8,335        |

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数がないため、ベンチマークならびに参考指数は表示しておりません。

○当期中の基準価額と市況等の推移

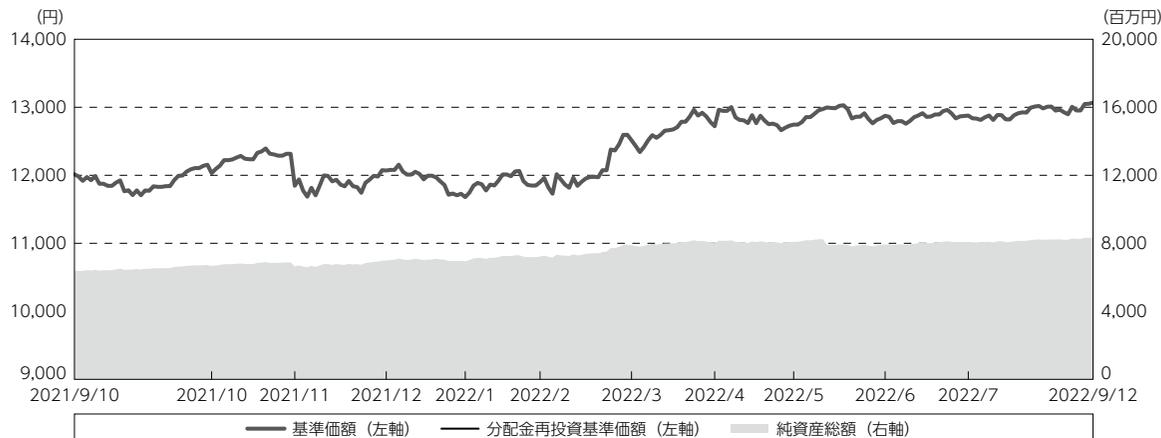
| 年 月 日               | 基 準         | 価 額 |        | 投 資 信 託<br>証 組 入 比 率 |
|---------------------|-------------|-----|--------|----------------------|
|                     |             | 騰 落 | 率      |                      |
| (期 首)<br>2021年9月10日 | 円<br>12,015 |     | %<br>— | %<br>96.8            |
| 9月末                 | 11,765      |     | △2.1   | 97.2                 |
| 10月末                | 12,032      |     | 0.1    | 97.0                 |
| 11月末                | 11,846      |     | △1.4   | 95.7                 |
| 12月末                | 12,070      |     | 0.5    | 96.5                 |
| 2022年1月末            | 11,679      |     | △2.8   | 97.4                 |
| 2月末                 | 11,899      |     | △1.0   | 97.0                 |
| 3月末                 | 12,515      |     | 4.2    | 96.5                 |
| 4月末                 | 12,721      |     | 5.9    | 97.7                 |
| 5月末                 | 12,745      |     | 6.1    | 96.9                 |
| 6月末                 | 12,875      |     | 7.2    | 96.2                 |
| 7月末                 | 12,878      |     | 7.2    | 96.5                 |
| 8月末                 | 12,966      |     | 7.9    | 96.6                 |
| (期 末)<br>2022年9月12日 | 13,068      |     | 8.8    | 97.3                 |

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2021年9月11日～2022年9月12日）

期中の基準価額等の推移



期 首：12,015円

期 末：13,068円(既払分配金(税込み)：0円)

騰落率： 8.8%(分配金再投資ベース)

(注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。

(注) 分配金再投資基準価額は、期首（2021年9月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。

(注) 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。

(注) 当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数がないため、ベンチマークならびに参考指数は表示していません。

○基準価額の主な変動要因

お金のデザイン・リキッド・オルタナティブ・ファンドは、当期（2021年9月11日～2022年9月12日）+8.76%のリターンとなりました。当ファンドに高位に組み入れている、DBiリキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド-JPYクラスAシェアーズのパフォーマンスが上昇したため、当ファンドにプラスの寄与となりました。

## 投資環境

2021年はヘッジファンドや多くのアクティブマネージャーにとって厳しい年でした。

投資家は市場で激しいボラティリティに直面しました。テクノロジー株、ミーム株、SPAC、および仮想通貨は一晩で乱高下し、ロング投資家とショート投資家の両者を不利な状況に追い込みました。新型コロナウイルス感染症の拡大は沈静化した後、再拡大し、その後変異株も現れ、バリュート投資家と成長株投資家を混乱させました。中国はテクノロジー業界に対する厳格な取り締まりを行い、一部の株式が数日間で80%も下落しました。FRB（米連邦準備制度理事会）は、長期的緩和から積極的引き締めへと急転し、政策ミスと暴走するインフレに賭けるマクロ投資家に打撃を与えました。その結果、ヘッジファンドがコロナショックからの回復とバリュートローテーションに両方で早い段階で取り組み、歴史的に好調だった2020年を経て、2021年は、「2歩前進して、1歩後退」のように特徴付けられます。

2022年の第1四半期は、株式と債券の両方が不安定なリターンで始まり、過去1年間に、インフレ、金融引き締め、そして現在も進行中のロシアによるウクライナ紛争という3つの主要なマクロ・レジームシフトが発生し、前四半期に勢いを増しました。「価格織り込み済み」のものではなく、すべてが初期段階にあるようです。この新しい世界では、市場参加者は、政策立案者、市場参加者、生産者、消費者の行動を同時に予測する必要があります。さらには、すべての二次効果と三次効果を予測する必要があります。2年物国債利回りは、2022年は約0.70%で始まり、3ヶ月で約2.4%に上昇しました。ブルームバーグ債券総合指数は-6.2%と、全体的に下落したものの、社債は金利上昇と信用スプレッドの拡大が重なり一層下落しました。ウクライナ紛争は、現在の商品供給不足問題を悪化させ、各国が競ってサプライチェーンの国内化を急ぎました。株式は大幅な下落に見舞われた後、弱気相場の上昇と皮肉られた印象的な回復を見せました。

2022年の第2四半期には、FRBの引き締めが本格化しました。2年物国債利回りは、四半期末で約3%でした。これは、前年の11倍です。株式は、2022年第1四半期には驚くほどの回復力を見せましたが、この期で真の弱気相場となり、そして市場でバブルの様相を見せていた領域—テクノロジー株、仮想通貨—が急落しました。ドルに対する日本円とユーロの驚異的な下落は、2010年代後半にはほとんど存在しなかったマクロ取引機会の記憶を再燃させました。

2022年の第3四半期には、FRBは、相応の経済的痛みを伴おうとも、進行中の金融引き締めを通じてインフレと戦う、というコミットメントを繰り返しました。株式と債券は約4%下落しましたが、米ドルは上昇を続けました。今後の景気後退の可能性が高まるにつれ、株式市場が企業収益の劣化を適切に織り込んでいるかどうか、また債券市場が借り換えとデフォルトリスクを考慮に入れているかどうか注目が集まっています。著名なバリュート投資家で懐疑論者であるジェレミー・グランサムは、過去10年間の「スーパーバブル」の崩壊はまだ終わっていないと大声で宣言しました。ヨーロッパの状況は、冬が近づくにつれて悪化の一端をたどっているように見え、新興市場は、ドル高と食品関連をはじめとするコモディティ価格の高騰による逆風に直面しています。ヘッジファンドは保守的なポジションを維持しており、7月の弱気相場の上昇を逃したことで批判されていますが、6月と8月の大部分のドローダウンを回避しています。

## 当ファンドのポートフォリオ

当ファンドは、主として外国投資信託、DBiリキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド-JPYクラスAシェアーズ（以下「DBiポートフォリオ」）に投資し、リスクを最小限に抑えつつ長期的に安定した収益の確保と信託財産の成長を目指して運用を行います。DBiポートフォリオの詳細は以下のとおりです。

ヘッジファンド・ポートフォリオ（DBiポートフォリオの約60%を構成）

ヘッジファンド・ポートフォリオは、当期ドルベースリターンは約+0.3%であり、MSCIワールドの約-13%を大きく上回っています。

ヘッジファンド・ポートフォリオに使用されるレプリケーション・モデルは、株式ロング/ショート、レティブ・バリュウ、およびイベント・ドリブンの上位50の最大手ヘッジファンドから構成されるターゲット・ファンドを対象に、株式、金利、通貨市場全体でのこれらのファンドのウェイトを利用し、コア・ファクターを抽出するように設計されています。

ヘッジファンド・ポートフォリオでは、資産配分に起因する超過収益を獲得するために、長期的な視点でポートフォリオのシフトを行う傾向があります。しかし、今期においてはマクロ環境の大きな変化に伴い、このポートフォリオは年間を通じていくつかの大きな調整を実施しました。当初初めは、インフレ懸念は始まったばかりで、FRB（米連邦準備制度理事会）の利上げへの姿勢は強硬なものではなく、したがって、ポートフォリオでは米ドルと米国債のヘッジは実施していませんでした。その後利上げが始まると、ポートフォリオは米国債のショートポジションと米ドルのロングポジションにシフトしました。これらの調整により、パフォーマンスは大幅に向上しました。また、全体的な株式リスクを半分に減少し、大型のグローバル株が大幅に下落する中で、中小型株のウェイトを高くしたことも損失回避に役立ちました。

CTAポートフォリオ（DBiポートフォリオの約40%を構成）

CTAポートフォリオは、当期ドルベースリターンは約+27%となりました。一方、SGCTAヘッジファンド・インデックスは約+21%でした。

CTAポートフォリオは上位20のマネージド・フューチャーズ・ファンドを複製することにより、単一ファンドのテールリスクを軽減しつつ、ファクターのアロケーションによりリターンの獲得を目指します。

ほぼすべての資産クラスがトレンドを形成し、マネージド・フューチャーズにとって躍動する期間でした。FRBが2022年を通じて急速に金利を引き上げる一方、日銀が金利を低く抑えることにコミットしたため、CTAポートフォリオは当期を通じて確信度の高い日本円ショートポジションを取りました。世界的な供給ショックに加えて、ウクライナ紛争により、石油が1バレル70ドル台から120ドル台まで上昇する中、期間中、原油をロングポジションとしていたため、パフォーマンスは大幅に向上し、原油史上最高値から下落し始めた段階で、ポートフォリオはポジションをすぐに調整した結果、リターンを維持できました。また、ドルに対するユーロのショートポジションとイールド・カーブ全体にわたる米国債の売りポジションも、パフォーマンス向上に貢献しました。一方で、株式ポジションからのリターンはパフォーマンスを低下させましたが、前述の調整等が損失を抑えたため、最終的なパフォーマンスはMSCIワールドを上回っています。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、運用方針に対して適切に比較できる指数がないため、ベンチマークならびに参考指数は設定しておりません。

## 分配金

当期の分配金は、長期的な投資信託財産の成長を追求する観点から無分配とさせていただきました。また、収益分配に充てなかった利益につきましては信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

## ○分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

| 項 目       | 第3期                       |
|-----------|---------------------------|
|           | 2021年9月11日～<br>2022年9月12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 | 3,067                     |

（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

---

主要投資ファンドであるDBiリキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド-JPYクラスAシェアーズ（以下「DBiポートフォリオ」）は、伝統的な60/40の株式と債券のポートフォリオと比較して、リターンを改善し、多様なリスク管理機能（戦略間の分散、単一マネージャー・リスクの排除、日々の流動性、総手数料の低さ、資産負債リスクの排除、カウンターパーティリスクの排除等）により、ボラティリティを低減し、ドローダウンを抑制する特性を有したポートフォリオと考えています。今後も、ヘッジファンドの多様なポートフォリオのリターンを忠実に提供し、テールリスクを抑えながらアルファを提供することを目指します。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2021年9月11日～2022年9月12日）

| 項 目                   | 当 期  |         | 項 目 の 概 要                                 |
|-----------------------|------|---------|---|
|                       | 金 額  | 比 率     |   |
| (a) 信 託 報 酬           | 82   | 0.664   | (a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率                  |
| （ 投 信 会 社 ）           | (75) | (0.608) | 委託した資金の運用の対価                              |
| （ 販 売 会 社 ）           | (4)  | (0.033) | 交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価 |
| （ 受 託 会 社 ）           | (3)  | (0.022) | 運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価                   |
| (b) そ の 他 費 用         | 9    | 0.072   | (b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数             |
| （ 監 査 費 用 ）           | (1)  | (0.010) | 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 ）             | (7)  | (0.062) | その他は、信託事務の処理等に要するその他の諸費用                  |
| 合 計                   | 91   | 0.736   |   |
| 期中の平均基準価額は、12,332円です。 |      |         |   |

(注) 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。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

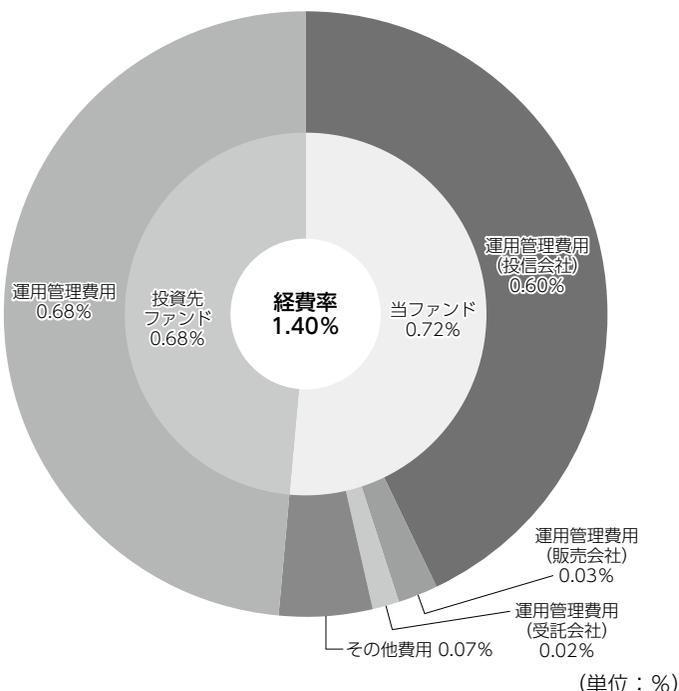
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

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

（参考情報）

○経費率（投資先ファンドの運用管理費用以外の費用を除く。）

期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した経費率（年率）は1.40%です。



|                    |      |
|--------------------|------|
| 経費率 (①+②)          | 1.40 |
| ①当ファンドの費用の比率       | 0.72 |
| ②投資先ファンドの運用管理費用の比率 | 0.68 |

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

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

(注) 各比率は、年率換算した値です。

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

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

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

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

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

## ○売買及び取引の状況

（2021年9月11日～2022年9月12日）

### 投資信託証券

| 銘柄 |   | 買付     |           | 売付    |         |
|----|---|--------|-----------|-------|---------|
|    |   | 口数     | 金額        | 口数    | 金額      |
| 国内 | DBi リキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド-JPY クラス A シェアーズ | 12,068 | 1,500,000 | 2,332 | 310,000 |

（注）金額は受け渡し代金。

## ○利害関係人との取引状況等

（2021年9月11日～2022年9月12日）

該当事項はございません。

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

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

（2021年9月11日～2022年9月12日）

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

（2022年9月12日現在）

### ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

| 銘柄  |  | 期首(前期末) | 当 期 末  |           |      |
|---|--|---------|--------|-----------|------|
|   |  | 口数      | 口数     | 評価額       | 比率   |
| NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI 総合連動型上場投信        |  | 30      | 30     | 28        | 0.0  |
| DBi リキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド-JPY クラス A シェアーズ |  | 50,684  | 60,421 | 8,107,213 | 97.3 |
| 合 計   |  | 50,714  | 60,451 | 8,107,242 | 97.3 |

（注）比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

## ○投資信託財産の構成

（2022年9月12日現在）

| 項 目          | 当 期 末     |       |
|--------------|-----------|-------|
|              | 評価額       | 比率    |
| 投資信託受益証券     | 8,107,242 | 96.7  |
| コール・ローン等、その他 | 277,307   | 3.3   |
| 投資信託財産総額     | 8,384,549 | 100.0 |

（注）比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年9月12日現在）

| 項 目             | 当 期 末          |
|-----------------|----------------|
|                 | 円              |
| (A) 資産          | 8,384,549,319  |
| コール・ローン等        | 277,307,241    |
| 投資信託受益証券（評価額）   | 8,107,242,000  |
| 未取配当金           | 78             |
| (B) 負債          | 49,471,637     |
| 未払解約金           | 20,403,618     |
| 未払信託報酬          | 26,889,612     |
| その他未払費用         | 2,178,407      |
| (C) 純資産総額（A－B）  | 8,335,077,682  |
| 元本              | 6,378,237,727  |
| 次期繰越損益金         | 1,956,839,955  |
| (D) 受益権総口数      | 6,378,237,727口 |
| 1万口当たり基準価額（C/D） | 13,068円        |

(注) 当ファンドの期首元本額は5,320,796,220円、期中追加設定元本額は2,209,506,146円、期中一部解約元本額は1,152,064,639円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.3068円です。

○損益の状況（2021年9月11日～2022年9月12日）

| 項 目              | 当 期            |
|------------------|----------------|
|                  | 円              |
| (A) 配当等収益        | 1,920          |
| 受取配当金            | 152            |
| その他収益金           | 1,768          |
| (B) 有価証券売買損益     | 663,420,974    |
| 売買益              | 730,580,059    |
| 売買損              | △ 67,159,085   |
| (C) 信託報酬等        | △ 54,625,611   |
| (D) 当期損益金（A＋B＋C） | 608,797,283    |
| (E) 前期繰越損益金      | 496,579,002    |
| (F) 追加信託差損益金     | 851,463,670    |
| （配当等相当額）         | （ 320,542,837） |
| （売買損益相当額）        | （ 530,920,833） |
| (G) 計（D＋E＋F）     | 1,956,839,955  |
| (H) 収益分配金        | 0              |
| 次期繰越損益金（G＋H）     | 1,956,839,955  |
| 追加信託差損益金         | 851,463,670    |
| （配当等相当額）         | （ 320,542,837） |
| （売買損益相当額）        | （ 530,920,833） |
| 分配準備積立金          | 1,105,376,285  |

(注) 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。

(注) 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。

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

(注) 計算期間末における費用控除後の配当等収益（1,920円）、費用控除後の有価証券等損益額（608,795,363円）、信託約款に規定する収益調整金（851,463,670円）および分配準備積立金（496,579,002円）より分配対象収益は1,956,839,955円（1万口当たり3,067円）ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

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

○お知らせ

該当事項はございません。

## &lt;DBi リキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド&gt; (ケイマン諸島籍円建外国投資法人)

| 運用の基本方針   |  |
|-----------|--|
| 基本方針      | 主として米国・欧州の上場先物市場と ETF (上場投資信託証券) に実質的な投資を行い、ヘッジファンド・ポートフォリオのパフォーマンスと CTA (商品投資顧問業者) ポートフォリオのパフォーマンスを組み合わせたパフォーマンスの複製を目指した運用を行います。  |
| 主な投資対象    | 米国・欧州の上場先物市場と ETF (上場投資信託証券) を主要な投資対象とします。   |
| 投資方針      | <p>① 主として米国・欧州の上場先物市場と ETF (上場投資信託証券) に実質的な投資を行い、ヘッジファンド・ポートフォリオのパフォーマンスと CTA (商品投資顧問業者) ポートフォリオのパフォーマンスを組み合わせたパフォーマンスの複製を目指した運用を行います。</p> <p>A) ヘッジファンド・ポートフォリオはヘッジ・ファンド・リサーチ社 (HFR) が公表する預かり資産上位 50 社で構成されます。</p> <p>B) CTA ポートフォリオは仏ソシエテ・ジェネラル社 (SG) が管理・公表する SG CTA インデックスに採用される預かり資産上位 20 社で構成されます。</p> <p>② ヘッジファンド・ポートフォリオ約 60%、CTA ポートフォリオ約 40% で構成されるポートフォリオ運用を行うことにより、リスクを最小限に抑えつつ、安定した収益の確保を目指します。</p> <p>③ 原則として対円で為替ヘッジを行い、為替変動リスクの低減を図ることを基本とします。</p> <p>④ 資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p> |
| 主な投資制限    | ファンドの運用に関しては投資制限を設けません。  |
| 収益分配      | 収益分配は行いません。  |
| ファンドに係る費用 |  |
| 運用管理報酬    | 純資産価額 (費用等控除前のグロスベース) が 100 億円までの部分につき年率 0.70%、これを超える部分につき年率 0.65% の管理報酬がファンドから運用会社に支払われます。  |
| 申込手数料     | ありません。   |
| 信託財産留保額   | ありません。   |
| その他の費用など  | <p>投資運用に関連して発生する費用 (ブローカー手数料、取引税を含む証券売買費用、ファンドが任命するカストディアンまたは預託機関への支払い費用、その他の投資運用に関連したサービス提供者への支払い費用、租税公課並びに登録料等) はファンドから支払われます。</p> <p>ファンドの事務管理会社、基準価額算出機関、ファンドの設立及び当初募集費用、ファンドへの助言者・コンサルタントへの支払い費用、法務、事務管理、会計、税務、監査、保険に関連する各費用、投資家向けの通信、総会運営、財務諸表や目論見書その他の文書作成の費用、ファンド役員報酬、目論見書の改訂費用は運用会社が運用管理報酬のうちから支払います。</p>   |
| その他       |  |
| 運用会社      | ダイナミック・ベータ・インベストメンツ・エルエルシー   |
| 信託期間      | 無期限 (2020 年 2 月 18 日設定)  |
| 決算日       | 毎年 3 月末日   |

## ◎組入資産の明細

(2022年3月31日現在)

## DBi リキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド

| セクター   | ロング/ショート         | エクスポージャー(USD) |                 | エクスポージャー(%)    |                  |                 |                 |
|--------|------------------|---------------|-----------------|----------------|------------------|-----------------|-----------------|
|        |                  | グロス           | ネット             | グロス            | ネット              |                 |                 |
| 通貨     | Short            | 35,531,925.00 | (35,531,925.00) | 47.24%         | (47.24)%         |                 |                 |
|        | 銘柄名              | 限月            | ロング/ショート        | グロス・エクスポージャー   | ネット・エクスポージャー     | グロス・エクスポージャー(%) | ネット・エクスポージャー(%) |
|        | EUR/USD CME      | 06/13/2022    | Short           | 10,236,975.00  | (10,236,975.00)  | 13.61%          | (13.61)%        |
|        | JAPANESE YEN CME | 06/13/2022    | Short           | 25,294,950.00  | (25,294,950.00)  | 33.63%          | (33.63)%        |
|        | 小計               |               |                 | 35,531,925.00  | (35,531,925.00)  | 47.24%          | (47.24)%        |
| エネルギー  |                  |               | Long            | 4,728,960.00   | 4,728,960.00     | 6.29%           | 6.29%           |
|        | 銘柄名              | 限月            | ロング/ショート        | グロス・エクスポージャー   | ネット・エクスポージャー     | グロス・エクスポージャー(%) | ネット・エクスポージャー(%) |
|        | CRUDE OIL        | 05/20/2022    | Long            | 4,728,960.00   | 4,728,960.00     | 6.29%           | 6.29%           |
|        | 小計               |               |                 | 4,728,960.00   | 4,728,960.00     | 6.29%           | 6.29%           |
| 金融     |                  |               | Short           | 118,979,795.74 | (118,979,795.74) | 158.18%         | (158.18)%       |
|        | 銘柄名              | 限月            | ロング/ショート        | グロス・エクスポージャー   | ネット・エクスポージャー     | グロス・エクスポージャー(%) | ネット・エクスポージャー(%) |
|        | 2 YR T-NOTE      | 06/30/2022    | Short           | 14,198,765.63  | (14,198,765.63)  | 18.88%          | (18.88)%        |
|        | 30 DAY RATE      | 07/29/2022    | Short           | 9,465,736.37   | (9,465,736.37)   | 12.58%          | (12.58)%        |
|        | EURODOLLARS      | 09/18/2023    | Short           | 59,581,200.00  | (59,581,200.00)  | 79.21%          | (79.21)%        |
|        | ULTRA T-BOND     | 06/21/2022    | Short           | 708,500.00     | (708,500.00)     | 0.94%           | (0.94)%         |
|        | ULTRA T-NOTE     | 06/21/2022    | Short           | 9,889,218.75   | (9,889,218.75)   | 13.15%          | (13.15)%        |
|        | US 10 YR NOTES   | 06/21/2022    | Short           | 9,830,000.00   | (9,830,000.00)   | 13.07%          | (13.07)%        |
|        | US T. BOND       | 06/21/2022    | Short           | 15,306,375.00  | (15,306,375.00)  | 20.35%          | (20.35)%        |
|        | 小計               |               |                 | 118,979,795.74 | (118,979,795.74) | 158.18%         | (158.18)%       |
| インデックス |                  |               | Long            | 43,894,630.00  | 43,894,630.00    | 58.36%          | 58.36%          |
|        | 銘柄名              | 限月            | ロング/ショート        | グロス・エクスポージャー   | ネット・エクスポージャー     | グロス・エクスポージャー(%) | ネット・エクスポージャー(%) |
|        | DOLLAR INDEX     | 06/13/2022    | Long            | 20,852,320.00  | 20,852,320.00    | 27.72%          | 27.72%          |
|        | E MINI RUSSELL   | 06/17/2022    | Long            | 1,653,120.00   | 1,653,120.00     | 2.20%           | 2.20%           |
|        | EMINI MSCI EAFE  | 06/17/2022    | Long            | 7,076,520.00   | 7,076,520.00     | 9.41%           | 9.41%           |
|        | EMINI NASDAQ     | 06/17/2022    | Long            | 5,055,375.00   | 5,055,375.00     | 6.72%           | 6.72%           |
|        | EMINI S&P        | 06/17/2022    | Long            | 2,265,375.00   | 2,265,375.00     | 3.01%           | 3.01%           |
|        | MINI MIDCA       | 06/17/2022    | Long            | 6,991,920.00   | 6,991,920.00     | 9.30%           | 9.30%           |
|        | 小計               |               |                 | 43,894,630.00  | 43,894,630.00    | 58.36%          | 58.36%          |
| インデックス |                  |               | Short           | 7,507,135.00   | (7,507,135.00)   | 9.98%           | (9.98)%         |
|        | 銘柄名              | 限月            | ロング/ショート        | グロス・エクスポージャー   | ネット・エクスポージャー     | グロス・エクスポージャー(%) | ネット・エクスポージャー(%) |
|        | EMINI MSCI EAFE  | 06/17/2022    | Short           | 4,074,360.00   | (4,074,360.00)   | 5.42%           | (5.42)%         |
|        | EMINI MSCI EM    | 06/17/2022    | Short           | 3,432,775.00   | (3,432,775.00)   | 4.56%           | (4.56)%         |
|        | 小計               |               |                 | 7,507,135.00   | (7,507,135.00)   | 9.98%           | (9.98)%         |
| 貴金属    |                  |               | Long            | 6,057,400.00   | 6,057,400.00     | 8.05%           | 8.05%           |
|        | 銘柄名              | 限月            | ロング/ショート        | グロス・エクスポージャー   | ネット・エクスポージャー     | グロス・エクスポージャー(%) | ネット・エクスポージャー(%) |
|        | GOLD CMX         | 06/28/2022    | Long            | 6,057,400.00   | 6,057,400.00     | 8.05%           | 8.05%           |
|        | 小計               |               |                 | 6,057,400.00   | 6,057,400.00     | 8.05%           | 8.05%           |
| 総合計    |                  |               |                 | 216,699,845.74 | (107,337,865.74) | 288.09%         | (142.70)%       |

注) グロス・エクスポージャーは、ロング・エクスポージャーとショート・エクスポージャーの絶対値を合計したものです。ネットエクスポージャーは、ロング・エクスポージャーとショート・エクスポージャーの単純合計となります。それぞれの比率は、ファンドの純資産総額に対する割合となり、総合計が100%とならない場合があります。円クラスの為替ヘッジ分のエクスポージャーを除いています。

## ◎貸借対照表

(2022年3月31日現在)

## 資産

|               |    |                   |
|---------------|----|-------------------|
| デリバティブ契約の公正価額 | \$ | 3,942,588         |
| 現金及び現金相当      |    | 64,702,583        |
| ブローカーからの未収金   |    | 10,917,062        |
| その他資産         |    | 29,449            |
| 資産合計          |    | <u>79,591,682</u> |

## 負債

## 負債

|               |    |                  |
|---------------|----|------------------|
| デリバティブ契約の公正価額 | \$ | 4,303,327        |
| 未払いマネジメントフィー  |    | 40,929           |
| 未払い費用         |    | 27,987           |
| 負債合計          |    | <u>4,372,243</u> |

## 純資産

|  |    |                   |
|--|----|-------------------|
|  | \$ | <u>75,219,439</u> |
|--|----|-------------------|

## ◎損益計算書

運用開始した2020年6月23日から2022年3月31日までの期間

## 投資収入

|    |           |
|----|-----------|
| 金利 | \$ 22,046 |
|----|-----------|

## 支出

|           |         |
|-----------|---------|
| マネジメントフィー | 426,621 |
|-----------|---------|

|      |        |
|------|--------|
| 管理費用 | 28,377 |
|------|--------|

|       |        |
|-------|--------|
| 取締役報酬 | 24,225 |
|-------|--------|

|    |     |
|----|-----|
| 利息 | 776 |
|----|-----|

|               |        |
|---------------|--------|
| プロフェッショナルフィー他 | 88,262 |
|---------------|--------|

|      |         |
|------|---------|
| 支出合計 | 568,261 |
|------|---------|

|                 |           |
|-----------------|-----------|
| 投資マネージャーが負担する支出 | (118,198) |
|-----------------|-----------|

|     |         |
|-----|---------|
| 純支出 | 450,063 |
|-----|---------|

## 純投資損失

|  |           |
|--|-----------|
|  | (428,017) |
|--|-----------|

## デリバティブ契約にかかる実現損益および含み損益

|                                       |             |
|---------------------------------------|-------------|
| デリバティブ契約にかかる純実現損（手数料支出 \$ 103,140を控除） | (3,390,766) |
|---------------------------------------|-------------|

|                    |         |
|--------------------|---------|
| デリバティブ契約にかかる純含み変動額 | 712,169 |
|--------------------|---------|

## デリバティブ契約にかかる純損失

|  |             |
|--|-------------|
|  | (2,678,597) |
|--|-------------|

## オペレーションの結果による純資産減少額

|  |                |
|--|----------------|
|  | \$ (3,106,614) |
|--|----------------|

## &lt;NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信&gt;

| 基本情報     |  |
|----------|--|
| 基本方針     | わが国の公社債を実質的な主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合（NOMURA-ボンド・パフォーマンス・インデックス総合）（対象指数）に連動する投資成果を目指します。 |
| 運用会社     | 野村アセットマネジメント株式会社   |
| 信託報酬     | 0.07%（税込0.077%）  |
| 分配支払い基準日 | 毎年3月7日、9月7日（年2回）   |
| 上場日      | 2017年12月11日  |
| 上場市場     | 東京証券取引所  |

## ◎組入資産の明細

## NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2022年3月7日現在)

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券(2022年3月7日現在)

(単位:円)

| 種類        | 通貨  | 銘柄                      | 券面総額           | 評価額                      | 備考 |
|-----------|-----|-------------------------|----------------|--------------------------|----|
| 親投資信託受益証券 | 日本円 | 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド | 34,346,766,182 | 45,258,733,798           |    |
|           | 小計  | 銘柄数:1<br>組入時価比率:100.0%  | 34,346,766,182 | 45,258,733,798<br>100.0% |    |
| 合計        |     |                         |                | 45,258,733,798           |    |

(注1) 投資信託受益証券、投資証券及び親投資信託受益証券における券面総額の数値は、証券数を表示しております。

(注2) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び各小計欄の合計金額に対する比率であります。

## ◎損益及び剰余金計算書

## NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信

(単位:円)

|   | 第8期           |               | 第9期           |               |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|
|   | 自 2021年 3月 8日 | 至 2021年 9月 7日 | 自 2021年 9月 8日 | 至 2022年 3月 7日 |
| 営業収益                                      |               |               |               |               |
| 有価証券売買等損益                                 |               | 106,598,406   |               | △448,121,542  |
| 営業収益合計                                    |               | 106,598,406   |               | △448,121,542  |
| 営業費用                                      |               |               |               |               |
| 支払利息                                      |               | 1,066         |               | 2,763         |
| 受託者報酬                                     |               | 2,130,252     |               | 4,476,327     |
| 委託者報酬                                     |               | 5,325,572     |               | 11,190,759    |
| その他費用                                     |               | 1,748,555     |               | 8,291,275     |
| 営業費用合計                                    |               | 9,205,445     |               | 23,961,124    |
| 営業利益又は営業損失(△)                             |               | 97,392,961    |               | △472,082,666  |
| 経常利益又は経常損失(△)                             |               | 97,392,961    |               | △472,082,666  |
| 当期純利益又は当期純損失(△)                           |               | 97,392,961    |               | △472,082,666  |
| 一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額(△) |               | -             |               | -             |
| 期首剰余金又は期首欠損金(△)                           |               | △62,977,881   |               | △145,989,320  |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額                            |               | 10,607,700    |               | 44,000,000    |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額                   |               | 10,607,700    |               | 44,000,000    |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額                            |               | 122,196,100   |               | 168,190,200   |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額                   |               | 122,196,100   |               | 168,190,200   |
| 分配金                                       |               | 68,816,000    |               | 119,938,000   |
| 期末剰余金又は期末欠損金(△)                           |               | △145,989,320  |               | △862,200,186  |

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第8期<br>自 2021年 3月 8日<br>至 2021年 9月 7日                              |           |              | 第9期<br>自 2021年 9月 8日<br>至 2022年 3月 7日                                |           |               |
|--|-----------|--------------|--|-----------|---------------|
| 1. 分配金の計算過程  |           |              | 1. 分配金の計算過程  |           |               |
| 項目   |           |              | 項目   |           |               |
| 当期配当等収益額   | A         | △1,066 円     | 当期配当等収益額   | A         | △2,763 円      |
| 親ファンドの配当等収益額   | B         | 77,465,726 円 | 親ファンドの配当等収益額   | B         | 143,881,109 円 |
| 分配準備積立金  | C         | 661,841 円    | 分配準備積立金  | C         | 106,122 円     |
| 配当等収益合計額   | D=A+B+C   | 78,126,501 円 | 配当等収益合計額   | D=A+B+C   | 143,984,468 円 |
| 経費   | E         | 9,204,379 円  | 経費   | E         | 23,958,361 円  |
| 収益分配可能額  | F=D-E     | 68,922,122 円 | 収益分配可能額  | F=D-E     | 120,026,107 円 |
| 収益分配金  | G         | 68,816,000 円 | 収益分配金  | G         | 119,938,000 円 |
| 次期繰越金(分配準備積立金)   | H=F-G     | 106,122 円    | 次期繰越金(分配準備積立金)   | H=F-G     | 88,107 円      |
| 口数   | I         | 31,280,000 口 | 口数   | I         | 46,130,000 口  |
| 100 口当たり分配金  | J=G/I×100 | 220 円        | 100 口当たり分配金  | J=G/I×100 | 260 円         |
| 2. その他費用   |           |              | 2. その他費用   |           |               |
| <p>その他費用のうち 468,556 円は上場に係る費用、1,067,011 円は対象指数についての商標使用料であります。</p> |           |              | <p>その他費用のうち 5,605,549 円は上場に係る費用、2,238,108 円は対象指数についての商標使用料であります。</p> |           |               |

## ◎組入資産の明細

(2021年3月31日現在)

## 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

| 銘柄   | 柄            | 当 期 末 |           |           |            |
|------|--------------|-------|-----------|-----------|------------|
|      |              | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券 |              | %     | 千円        | 千円        |            |
| 国庫債券 | 利付(2年)第415回  | 0.1   | 3,700,000 | 3,711,359 | 2022/8/1   |
| 国庫債券 | 利付(2年)第416回  | 0.1   | 3,000,000 | 3,009,810 | 2022/9/1   |
| 国庫債券 | 利付(2年)第417回  | 0.1   | 3,200,000 | 3,211,296 | 2022/10/1  |
| 国庫債券 | 利付(2年)第418回  | 0.1   | 4,400,000 | 4,416,412 | 2022/11/1  |
| 国庫債券 | 利付(2年)第420回  | 0.1   | 500,000   | 502,065   | 2023/1/1   |
| 国庫債券 | 利付(2年)第421回  | 0.1   | 3,500,000 | 3,515,470 | 2023/2/1   |
| 国庫債券 | 利付(2年)第422回  | 0.1   | 600,000   | 602,880   | 2023/3/1   |
| 国庫債券 | 利付(5年)第132回  | 0.1   | 3,000,000 | 3,008,220 | 2022/6/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第133回  | 0.1   | 6,200,000 | 6,220,522 | 2022/9/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第134回  | 0.1   | 2,500,000 | 2,509,900 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第135回  | 0.1   | 8,500,000 | 8,539,355 | 2023/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第136回  | 0.1   | 3,300,000 | 3,317,622 | 2023/6/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第137回  | 0.1   | 4,000,000 | 4,023,800 | 2023/9/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第138回  | 0.1   | 5,500,000 | 5,536,795 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(5年)第139回  | 0.1   | 5,600,000 | 5,639,200 | 2024/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第140回  | 0.1   | 3,900,000 | 3,929,601 | 2024/6/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第141回  | 0.1   | 4,500,000 | 4,536,090 | 2024/9/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第143回  | 0.1   | 5,570,000 | 5,618,793 | 2025/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第144回  | 0.1   | 4,500,000 | 4,540,995 | 2025/6/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第145回  | 0.1   | 4,900,000 | 4,946,207 | 2025/9/20  |
| 国庫債券 | 利付(5年)第146回  | 0.1   | 2,100,000 | 2,119,404 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(40年)第1回   | 2.4   | 2,360,000 | 3,401,279 | 2048/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第2回   | 2.2   | 900,000   | 1,259,937 | 2049/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第3回   | 2.2   | 900,000   | 1,266,300 | 2050/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第4回   | 2.2   | 1,130,000 | 1,597,345 | 2051/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第5回   | 2.0   | 1,200,000 | 1,643,016 | 2052/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第6回   | 1.9   | 1,300,000 | 1,755,650 | 2053/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第7回   | 1.7   | 1,400,000 | 1,821,344 | 2054/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第8回   | 1.4   | 1,500,000 | 1,825,710 | 2055/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第9回   | 0.4   | 2,050,000 | 1,871,978 | 2056/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第10回  | 0.9   | 2,010,000 | 2,147,082 | 2057/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第11回  | 0.8   | 1,750,000 | 1,814,715 | 2058/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第12回  | 0.5   | 2,070,000 | 1,939,983 | 2059/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(40年)第13回  | 0.5   | 5,020,000 | 4,698,218 | 2060/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第323回 | 0.9   | 1,700,000 | 1,721,267 | 2022/6/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第324回 | 0.8   | 3,200,000 | 3,236,128 | 2022/6/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第325回 | 0.8   | 4,400,000 | 4,459,972 | 2022/9/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第326回 | 0.7   | 2,100,000 | 2,129,862 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第327回 | 0.8   | 3,100,000 | 3,149,414 | 2022/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第328回 | 0.6   | 5,250,000 | 5,325,547 | 2023/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第329回 | 0.8   | 6,000,000 | 6,124,860 | 2023/6/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第330回 | 0.8   | 3,800,000 | 3,888,084 | 2023/9/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第331回 | 0.6   | 1,900,000 | 1,934,618 | 2023/9/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第332回 | 0.6   | 5,900,000 | 6,019,180 | 2023/12/20 |
| 国庫債券 | 利付(10年)第333回 | 0.6   | 3,600,000 | 3,678,804 | 2024/3/20  |
| 国庫債券 | 利付(10年)第334回 | 0.6   | 6,600,000 | 6,756,816 | 2024/6/20  |

| 銘    | 柄              | 当 期 末 |           |           |            |
|------|----------------|-------|-----------|-----------|------------|
|      |                | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 国債証券 |                | %     | 千円        | 千円        |            |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第335回 | 0.5   | 4,600,000 | 4,700,188 | 2024/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第336回 | 0.5   | 2,750,000 | 2,813,717 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第337回 | 0.3   | 3,000,000 | 3,047,070 | 2024/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第338回 | 0.4   | 5,000,000 | 5,103,600 | 2025/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第339回 | 0.4   | 5,000,000 | 5,109,150 | 2025/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第340回 | 0.4   | 4,200,000 | 4,296,222 | 2025/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第341回 | 0.3   | 7,300,000 | 7,438,481 | 2025/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第342回 | 0.1   | 8,350,000 | 8,429,074 | 2026/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第343回 | 0.1   | 5,900,000 | 5,957,171 | 2026/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第344回 | 0.1   | 5,800,000 | 5,855,738 | 2026/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第345回 | 0.1   | 5,000,000 | 5,048,800 | 2026/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第346回 | 0.1   | 4,900,000 | 4,946,942 | 2027/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第347回 | 0.1   | 5,400,000 | 5,452,218 | 2027/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第348回 | 0.1   | 6,800,000 | 6,863,988 | 2027/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第349回 | 0.1   | 2,800,000 | 2,826,404 | 2027/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第350回 | 0.1   | 6,150,000 | 6,207,933 | 2028/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第351回 | 0.1   | 7,700,000 | 7,766,759 | 2028/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第352回 | 0.1   | 6,600,000 | 6,654,252 | 2028/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第353回 | 0.1   | 5,100,000 | 5,139,372 | 2028/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第354回 | 0.1   | 4,350,000 | 4,379,406 | 2029/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第355回 | 0.1   | 5,100,000 | 5,131,365 | 2029/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第356回 | 0.1   | 4,800,000 | 4,826,352 | 2029/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第357回 | 0.1   | 1,900,000 | 1,909,063 | 2029/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第358回 | 0.1   | 5,470,000 | 5,491,934 | 2030/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第359回 | 0.1   | 5,600,000 | 5,617,920 | 2030/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第360回 | 0.1   | 7,900,000 | 7,914,852 | 2030/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (10年) 第361回 | 0.1   | 6,900,000 | 6,906,624 | 2030/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第1回   | 2.8   | 500,000   | 616,505   | 2029/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第2回   | 2.4   | 500,000   | 604,265   | 2030/2/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第3回   | 2.3   | 160,000   | 192,644   | 2030/5/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第4回   | 2.9   | 900,000   | 1,143,288 | 2030/11/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第5回   | 2.2   | 150,000   | 181,602   | 2031/5/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第6回   | 2.4   | 600,000   | 743,694   | 2031/11/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第7回   | 2.3   | 600,000   | 742,080   | 2032/5/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第8回   | 1.8   | 100,000   | 118,746   | 2032/11/22 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第9回   | 1.4   | 265,000   | 302,630   | 2032/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第10回  | 1.1   | 250,000   | 277,105   | 2033/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第11回  | 1.7   | 160,000   | 188,963   | 2033/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第12回  | 2.1   | 220,000   | 271,189   | 2033/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第13回  | 2.0   | 290,000   | 354,751   | 2033/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第14回  | 2.4   | 800,000   | 1,021,800 | 2034/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第15回  | 2.5   | 900,000   | 1,164,339 | 2034/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第16回  | 2.5   | 915,000   | 1,187,944 | 2034/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第17回  | 2.4   | 1,200,000 | 1,546,344 | 2034/12/20 |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第18回  | 2.3   | 2,200,000 | 2,812,458 | 2035/3/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第19回  | 2.3   | 2,050,000 | 2,627,034 | 2035/6/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第20回  | 2.5   | 1,270,000 | 1,667,903 | 2035/9/20  |
| 国庫債券 | 利付 (30年) 第21回  | 2.3   | 300,000   | 386,493   | 2035/12/20 |

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

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

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

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

| 銘柄                     | 柄 | 当 期 末 |         |         | 償還年月日      |
|------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
|                        |   | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   |            |
| 地方債証券                  |   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 東京都 公募 (20年) 第26回      |   | 1.74  | 100,000 | 116,509 | 2032/6/18  |
| 東京都 公募 (20年) 第29回      |   | 1.57  | 200,000 | 231,230 | 2033/9/20  |
| 北海道 公募平成24年度第6回        |   | 0.84  | 100,000 | 101,157 | 2022/8/31  |
| 北海道 公募平成24年度第9回        |   | 0.79  | 100,000 | 101,214 | 2022/10/31 |
| 北海道 公募平成25年度第1回        |   | 0.58  | 300,000 | 303,447 | 2023/4/26  |
| 北海道 公募平成26年度第13回       |   | 0.461 | 100,000 | 101,610 | 2024/12/26 |
| 北海道 公募平成27年度第7回        |   | 0.529 | 100,000 | 102,193 | 2025/8/28  |
| 北海道 公募平成29年度第5回        |   | 0.18  | 200,000 | 201,180 | 2027/6/30  |
| 北海道 公募平成29年度第6回        |   | 0.01  | 700,000 | 699,860 | 2022/7/28  |
| 北海道 公募平成29年度第7回        |   | 0.21  | 100,000 | 100,798 | 2027/8/31  |
| 北海道 公募平成29年度第9回        |   | 0.205 | 100,000 | 100,784 | 2027/10/27 |
| 北海道 公募平成30年度第15回       |   | 0.291 | 269,280 | 269,772 | 2038/9/24  |
| 宮城県 公募第32回2号           |   | 0.105 | 100,000 | 100,328 | 2026/9/28  |
| 神奈川県 公募第196回           |   | 0.678 | 100,000 | 101,305 | 2023/3/20  |
| 神奈川県 公募第200回           |   | 0.825 | 100,000 | 102,004 | 2023/9/20  |
| 神奈川県 公募第205回           |   | 0.664 | 100,000 | 101,913 | 2024/3/19  |
| 神奈川県 公募第206回           |   | 0.654 | 100,000 | 102,041 | 2024/6/20  |
| 神奈川県 公募第210回           |   | 0.451 | 200,000 | 203,206 | 2024/12/20 |
| 神奈川県 公募第212回           |   | 0.42  | 100,000 | 101,585 | 2025/3/19  |
| 神奈川県 公募第231回           |   | 0.22  | 200,000 | 201,940 | 2027/12/20 |
| 神奈川県 公募第247回           |   | 0.12  | 200,000 | 199,090 | 2030/6/20  |
| 神奈川県 公募 (30年) 第3回      |   | 2.62  | 100,000 | 133,750 | 2037/3/19  |
| 神奈川県 公募第7回             |   | 2.22  | 300,000 | 338,433 | 2027/3/19  |
| 神奈川県 公募 (20年) 第14回     |   | 1.969 | 100,000 | 116,586 | 2030/7/19  |
| 神奈川県 公募 (20年) 第17回     |   | 1.975 | 200,000 | 235,998 | 2031/7/11  |
| 神奈川県 公募 (20年) 第26回     |   | 1.477 | 100,000 | 114,891 | 2034/6/20  |
| 大阪府 公募第378回            |   | 0.7   | 104,000 | 105,857 | 2023/11/28 |
| 大阪府 公募第381回            |   | 0.683 | 100,000 | 101,902 | 2024/2/27  |
| 大阪府 公募第382回            |   | 0.674 | 100,000 | 101,927 | 2024/3/28  |
| 大阪府 公募第383回            |   | 0.695 | 100,000 | 102,042 | 2024/4/26  |
| 大阪府 公募第384回            |   | 0.67  | 100,000 | 102,022 | 2024/5/29  |
| 大阪府 公募第387回            |   | 0.521 | 300,000 | 305,010 | 2024/8/28  |
| 大阪府 公募第389回            |   | 0.53  | 100,000 | 101,787 | 2024/10/30 |
| 大阪府 公募第396回            |   | 0.554 | 200,000 | 204,346 | 2025/5/28  |
| 大阪府 公募第417回            |   | 0.248 | 102,000 | 103,037 | 2027/2/26  |
| 大阪府 公募第423回            |   | 0.185 | 100,000 | 100,638 | 2027/8/30  |
| 大阪府 公募第429回            |   | 0.197 | 179,000 | 180,313 | 2028/2/25  |
| 大阪府 公募第452回            |   | 0.062 | 100,000 | 99,102  | 2030/1/30  |
| 大阪府 公募第5回              |   | 2.16  | 100,000 | 117,900 | 2030/5/28  |
| 大阪府 公募第8回              |   | 1.83  | 100,000 | 116,869 | 2031/12/22 |
| 大阪府 公募 (5年) 第141回      |   | 0.001 | 230,000 | 229,921 | 2022/8/30  |
| 大阪府 公募 (5年) 第178回      |   | 0.001 | 400,000 | 399,448 | 2025/12/25 |
| 京都府 公募平成24年度第2回        |   | 0.91  | 100,000 | 101,093 | 2022/6/20  |
| 京都府 公募平成24年度第6回        |   | 0.8   | 100,000 | 101,224 | 2022/10/21 |
| 京都府 公募平成25年度第15回       |   | 0.66  | 200,000 | 203,800 | 2024/3/19  |
| 京都府 公募平成26年度第5回        |   | 1.455 | 100,000 | 114,694 | 2034/8/10  |
| 京都府 公募平成26年度第7回        |   | 0.564 | 200,000 | 203,766 | 2024/9/19  |
| 京都府 公募 (20年) 平成27年度第5回 |   | 1.23  | 200,000 | 224,254 | 2035/8/17  |

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

| 銘柄                        | 柄 | 当期末   |         |         |            |
|---------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
|                           |   | 利率    | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| 地方債証券                     |   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 広島県 公募平成29年度第3回           |   | 0.15  | 100,000 | 100,484 | 2027/9/27  |
| 広島県 公募平成29年度第4回           |   | 0.22  | 211,300 | 213,326 | 2027/11/24 |
| 広島県 公募令和2年度第2回            |   | 0.165 | 100,000 | 99,907  | 2030/7/22  |
| 埼玉県 公募平成24年度第4回           |   | 0.84  | 300,000 | 303,261 | 2022/7/25  |
| 埼玉県 公募平成25年度第4回           |   | 0.921 | 100,000 | 102,098 | 2023/7/24  |
| 埼玉県 公募平成25年度第6回           |   | 0.806 | 148,000 | 150,917 | 2023/9/27  |
| 埼玉県 公募平成25年度第10回          |   | 0.67  | 100,000 | 101,892 | 2024/2/26  |
| 埼玉県 公募平成25年度第11回          |   | 0.655 | 100,000 | 101,898 | 2024/3/26  |
| 埼玉県 公募平成26年度第3回           |   | 0.67  | 100,000 | 102,038 | 2024/5/20  |
| 埼玉県 公募平成26年度第6回           |   | 0.554 | 200,000 | 203,718 | 2024/9/26  |
| 埼玉県 公募平成26年度第7回           |   | 0.476 | 400,000 | 406,812 | 2024/12/25 |
| 埼玉県 公募平成26年度第9回           |   | 0.429 | 100,000 | 101,596 | 2025/2/25  |
| 埼玉県 公募平成27年度第9回           |   | 0.235 | 100,000 | 101,054 | 2026/2/25  |
| 埼玉県 公募平成28年度第5回           |   | 0.05  | 100,000 | 100,026 | 2026/7/28  |
| 埼玉県 公募平成30年度第4回           |   | 0.205 | 200,000 | 201,580 | 2028/6/26  |
| 埼玉県 公募平成30年度第7回           |   | 0.02  | 200,000 | 200,016 | 2023/10/26 |
| 埼玉県 公募(15年)第1回            |   | 0.941 | 100,000 | 106,817 | 2029/10/19 |
| 埼玉県 公募(15年)第2回            |   | 0.869 | 200,000 | 212,780 | 2030/5/22  |
| 埼玉県 公募(15年)第3回            |   | 0.43  | 100,000 | 102,078 | 2032/1/30  |
| 埼玉県 公募(25年)第2回            |   | 0.781 | 200,000 | 207,964 | 2042/9/19  |
| 埼玉県 公募(20年)第6回            |   | 2.26  | 100,000 | 116,075 | 2028/9/21  |
| 埼玉県 公募(20年)第16回           |   | 1.216 | 100,000 | 111,928 | 2035/8/14  |
| 埼玉県 公募(20年)第20回           |   | 0.626 | 100,000 | 103,185 | 2037/5/15  |
| 福岡県 公募平成26年度第1回           |   | 0.654 | 100,000 | 102,051 | 2024/6/26  |
| 福岡県 公募平成27年度第1回           |   | 0.578 | 300,000 | 307,074 | 2025/6/26  |
| 福岡県 公募平成29年度第1回           |   | 0.2   | 100,000 | 100,775 | 2027/6/23  |
| 福岡県 公募平成23年度第1回           |   | 1.491 | 100,000 | 108,043 | 2026/11/27 |
| 福岡県 公募(15年)平成27年度第1回      |   | 0.784 | 200,000 | 211,638 | 2030/11/25 |
| 福岡県 公募(15年)令和元年度第1回       |   | 0.254 | 100,000 | 99,083  | 2034/6/14  |
| 福岡県 公募(30年)平成19年度第1回      |   | 2.62  | 100,000 | 134,435 | 2037/9/18  |
| 福岡県 公募(30年)平成26年度第1回      |   | 1.827 | 100,000 | 125,772 | 2044/6/20  |
| 福岡県 公募(30年・定時償還)平成29年度第2回 |   | 0.937 | 100,000 | 105,934 | 2047/12/20 |
| 福岡県 公募(20年)平成20年度第2回      |   | 2.05  | 100,000 | 114,911 | 2028/12/20 |
| 福岡県 公募(20年)平成22年度第2回      |   | 2.116 | 300,000 | 357,174 | 2031/2/21  |
| 福岡県 公募(20年)平成24年度第2回      |   | 1.635 | 100,000 | 115,448 | 2032/8/16  |
| 千葉県 公募平成24年度第2回           |   | 0.91  | 100,000 | 101,299 | 2022/5/25  |
| 千葉県 公募平成24年度第7回           |   | 0.74  | 100,000 | 101,253 | 2022/12/22 |
| 千葉県 公募平成24年度第8回           |   | 0.84  | 100,000 | 101,503 | 2023/1/25  |
| 千葉県 公募平成25年度第3回           |   | 0.89  | 100,000 | 101,953 | 2023/6/23  |
| 千葉県 公募平成25年度第4回           |   | 0.92  | 100,000 | 102,099 | 2023/7/25  |
| 千葉県 公募平成26年度第1回           |   | 0.679 | 100,000 | 102,023 | 2024/4/25  |
| 千葉県 公募平成26年度第3回           |   | 0.611 | 200,000 | 203,916 | 2024/7/25  |
| 千葉県 公募平成27年度第6回           |   | 0.469 | 200,000 | 204,250 | 2025/12/25 |
| 千葉県 公募平成28年度第4回           |   | 0.085 | 200,000 | 200,436 | 2026/9/25  |
| 千葉県 公募平成29年度第4回           |   | 0.15  | 100,000 | 100,483 | 2027/9/24  |
| 千葉県 公募平成29年度第8回           |   | 0.2   | 100,000 | 100,798 | 2028/3/24  |
| 千葉県 公募(20年)第1回            |   | 2.06  | 400,000 | 438,484 | 2025/12/19 |
| 千葉県 公募(20年)第8回            |   | 2.18  | 100,000 | 118,136 | 2030/4/19  |

| 銘                      | 柄 | 当 期 末 |           |           |            |
|------------------------|---|-------|-----------|-----------|------------|
|                        |   | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| 地方債証券                  |   | %     | 千円        | 千円        |            |
| 千葉県 公募 (20年) 第16回      |   | 1.555 | 200,000   | 231,632   | 2034/4/14  |
| 千葉県 公募 (20年) 第17回      |   | 1.403 | 100,000   | 114,131   | 2034/10/13 |
| 群馬県 公募第12回             |   | 0.519 | 100,000   | 102,177   | 2025/8/15  |
| 群馬県 公募 (20年) 第3回       |   | 1.687 | 100,000   | 115,892   | 2032/6/25  |
| 岐阜県 公募平成26年度第1回        |   | 0.554 | 186,670   | 190,151   | 2024/9/30  |
| 共同発行市場地方債 公募第110回      |   | 0.89  | 200,000   | 202,012   | 2022/5/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第111回      |   | 0.89  | 200,000   | 202,156   | 2022/6/24  |
| 共同発行市場地方債 公募第112回      |   | 0.84  | 100,000   | 101,087   | 2022/7/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第113回      |   | 0.77  | 800,000   | 808,472   | 2022/8/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第114回      |   | 0.82  | 243,700   | 246,604   | 2022/9/22  |
| 共同発行市場地方債 公募第115回      |   | 0.8   | 100,000   | 101,233   | 2022/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第116回      |   | 0.8   | 200,000   | 202,598   | 2022/11/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第118回      |   | 0.84  | 100,000   | 101,503   | 2023/1/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第119回      |   | 0.8   | 200,000   | 202,988   | 2023/2/24  |
| 共同発行市場地方債 公募第120回      |   | 0.68  | 300,000   | 303,948   | 2023/3/24  |
| 共同発行市場地方債 公募第121回      |   | 0.57  | 100,000   | 101,148   | 2023/4/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第122回      |   | 0.62  | 400,000   | 405,208   | 2023/5/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第124回      |   | 0.91  | 300,000   | 306,225   | 2023/7/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第126回      |   | 0.81  | 100,000   | 101,977   | 2023/9/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第128回      |   | 0.66  | 700,000   | 711,900   | 2023/11/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第129回      |   | 0.71  | 100,000   | 101,887   | 2023/12/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第130回      |   | 0.76  | 100,000   | 102,088   | 2024/1/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第132回      |   | 0.66  | 100,000   | 101,911   | 2024/3/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第136回      |   | 0.611 | 200,000   | 203,916   | 2024/7/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第137回      |   | 0.566 | 500,000   | 509,255   | 2024/8/23  |
| 共同発行市場地方債 公募第139回      |   | 0.544 | 155,000   | 157,893   | 2024/10/25 |
| 共同発行市場地方債 公募第143回      |   | 0.448 | 540,000   | 549,018   | 2025/2/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第145回      |   | 0.406 | 1,000,000 | 1,015,670 | 2025/4/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第154回      |   | 0.405 | 300,000   | 305,556   | 2026/1/23  |
| 共同発行市場地方債 公募第156回      |   | 0.1   | 200,000   | 200,796   | 2026/3/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第157回      |   | 0.08  | 300,000   | 300,528   | 2026/4/24  |
| 共同発行市場地方債 公募第161回      |   | 0.06  | 300,000   | 300,240   | 2026/8/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第172回      |   | 0.225 | 600,000   | 605,652   | 2027/7/23  |
| 共同発行市場地方債 公募第184回      |   | 0.175 | 100,000   | 100,581   | 2028/7/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第186回      |   | 0.25  | 400,000   | 404,308   | 2028/9/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第188回      |   | 0.264 | 300,000   | 303,522   | 2028/11/24 |
| 共同発行市場地方債 公募第190回      |   | 0.16  | 610,000   | 612,055   | 2029/1/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第191回      |   | 0.14  | 100,000   | 100,130   | 2029/2/22  |
| 共同発行市場地方債 公募第200回      |   | 0.07  | 100,000   | 99,358    | 2029/11/22 |
| 共同発行市場地方債 公募第213回      |   | 0.125 | 300,000   | 298,419   | 2030/12/25 |
| 堺市 公募平成22年度第1回         |   | 1.97  | 100,000   | 117,055   | 2030/11/19 |
| 堺市 公募平成26年度第1回         |   | 1.664 | 100,000   | 122,133   | 2044/9/20  |
| 島根県 公募 (30年) 平成29年度第1回 |   | 0.919 | 100,000   | 105,531   | 2047/6/20  |
| 佐賀県 公募平成28年度第1回        |   | 0.08  | 100,000   | 100,084   | 2026/11/30 |
| 福島県 公募平成26年度第1回        |   | 0.495 | 200,000   | 203,474   | 2024/11/28 |
| 滋賀県 公募平成25年度第1回        |   | 0.65  | 100,000   | 101,682   | 2023/11/29 |
| 滋賀県 公募平成26年度第1回        |   | 0.495 | 142,000   | 144,466   | 2024/11/28 |
| 栃木県 公募平成24年度第1回        |   | 0.79  | 100,000   | 101,293   | 2022/11/30 |

| 銘柄                    | 柄 | 当期末   |         |         |            |
|-----------------------|---|-------|---------|---------|------------|
|                       |   | 利率    | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| 地方債証券                 |   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 栃木県 公募平成25年度第1回       |   | 0.65  | 100,000 | 101,682 | 2023/11/29 |
| 熊本市 公募平成29年度第1回       |   | 0.19  | 100,000 | 100,763 | 2027/11/30 |
| 新潟市 公募平成25年度第1回       |   | 0.72  | 233,200 | 237,670 | 2023/12/26 |
| 新潟市 公募平成29年度第1回       |   | 0.21  | 100,000 | 100,904 | 2027/12/24 |
| 浜松市 公募平成26年度第1回       |   | 0.335 | 100,000 | 101,201 | 2025/1/23  |
| 大阪市 公募平成25年度第6回       |   | 0.694 | 100,000 | 101,787 | 2023/11/22 |
| 大阪市 公募平成26年度第5回       |   | 0.593 | 100,000 | 101,997 | 2024/9/27  |
| 大阪市 公募(15年)第1回        |   | 1.753 | 100,000 | 109,025 | 2026/7/17  |
| 大阪市 公募(20年)第1回        |   | 2.3   | 300,000 | 344,025 | 2027/11/15 |
| 大阪市 公募(20年)第5回        |   | 2.47  | 100,000 | 117,635 | 2028/9/21  |
| 大阪市 公募(20年)第6回        |   | 2.21  | 100,000 | 116,137 | 2028/12/20 |
| 大阪市 公募(20年)第17回       |   | 1.721 | 100,000 | 116,690 | 2032/12/21 |
| 大阪市 公募(20年)第26回       |   | 0.635 | 100,000 | 103,086 | 2037/10/23 |
| 名古屋市 公募第481回          |   | 0.744 | 100,000 | 101,256 | 2022/12/20 |
| 名古屋市 公募第488回          |   | 0.598 | 300,000 | 306,009 | 2024/9/20  |
| 名古屋市 公募第489回          |   | 0.461 | 100,000 | 101,640 | 2024/12/20 |
| 名古屋市 公募第501回          |   | 0.175 | 200,000 | 201,292 | 2027/9/29  |
| 名古屋市 公募第503回          |   | 0.205 | 100,000 | 100,832 | 2028/3/24  |
| 名古屋市 公募第504回          |   | 0.205 | 200,000 | 201,650 | 2028/6/20  |
| 名古屋市 公募第512回          |   | 0.15  | 300,000 | 299,451 | 2030/6/20  |
| 名古屋市 公募(12年)第1回       |   | 1.033 | 200,000 | 208,538 | 2025/6/20  |
| 名古屋市 公募(15年)第2回       |   | 0.905 | 100,000 | 106,525 | 2029/11/16 |
| 京都市 公募平成29年度第1回       |   | 0.21  | 100,000 | 100,860 | 2027/8/25  |
| 京都市 公募平成29年度第4回       |   | 0.235 | 101,280 | 102,347 | 2028/1/31  |
| 京都市 公募(20年)第2回        |   | 2.12  | 100,000 | 109,377 | 2025/9/19  |
| 京都市 公募(20年)第5回        |   | 2.36  | 200,000 | 226,150 | 2026/12/18 |
| 京都市 公募(20年)第6回        |   | 2.38  | 100,000 | 114,833 | 2027/9/17  |
| 京都市 公募(20年)第13回       |   | 1.359 | 100,000 | 113,589 | 2034/11/24 |
| 京都市 公募(20年)第15回       |   | 0.487 | 200,000 | 202,256 | 2036/11/28 |
| 神戸市 公募平成26年度第17回      |   | 0.28  | 300,000 | 302,982 | 2025/1/27  |
| 神戸市 公募平成28年度第1回       |   | 0.08  | 200,000 | 200,352 | 2026/4/17  |
| 神戸市 公募平成30年度第2回       |   | 0.845 | 200,000 | 207,040 | 2048/3/19  |
| 横浜市 公募公債平成24年度2回      |   | 0.815 | 200,000 | 202,478 | 2022/10/17 |
| 横浜市 公募公債平成25年度1回      |   | 0.664 | 200,000 | 202,772 | 2023/5/19  |
| 横浜市 公募公債平成25年度5回      |   | 0.655 | 200,000 | 203,352 | 2023/11/17 |
| 横浜市 公募公債平成26年度5回      |   | 0.471 | 200,000 | 203,338 | 2024/12/13 |
| 横浜市 公募平成28年度第5回       |   | 0.23  | 300,000 | 302,904 | 2027/2/19  |
| 横浜市 公募平成29年度第3回       |   | 0.22  | 100,000 | 100,919 | 2027/8/13  |
| 横浜市 公募(30年)第2回        |   | 2.49  | 200,000 | 258,222 | 2035/3/20  |
| 横浜市 公募(20年)第18回       |   | 2.21  | 100,000 | 116,923 | 2029/5/25  |
| 横浜市 公募(20年)第26回       |   | 1.776 | 100,000 | 117,466 | 2033/1/28  |
| 横浜市 公募(20年)第30回       |   | 1.376 | 100,000 | 113,798 | 2034/10/20 |
| 札幌市 公募(15年)平成23年度第9回  |   | 1.493 | 200,000 | 216,706 | 2027/2/12  |
| 札幌市 公募(20年)平成24年度第1回  |   | 1.79  | 100,000 | 116,892 | 2032/4/23  |
| 札幌市 公募(20年)平成24年度第11回 |   | 1.794 | 100,000 | 117,727 | 2033/2/28  |
| 札幌市 公募平成26年度第4回       |   | 0.54  | 100,000 | 101,674 | 2024/6/20  |
| 札幌市 公募平成26年度第9回       |   | 0.43  | 200,000 | 203,050 | 2024/12/20 |
| 川崎市 公募第85回            |   | 0.72  | 100,000 | 101,214 | 2022/12/20 |

| 銘柄                          | 柄 | 当 期 末 |            |            |            |
|-----------------------------|---|-------|------------|------------|------------|
|                             |   | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日  |
| <b>地方債証券</b>                |   | %     | 千円         | 千円         |            |
| 川崎市 公募 (20年) 第17回           |   | 1.527 | 100,000    | 114,868    | 2033/5/9   |
| 川崎市 公募 (20年) 第19回           |   | 1.362 | 100,000    | 113,541    | 2034/9/20  |
| 川崎市 公募 (30年) 第11回           |   | 0.817 | 100,000    | 102,882    | 2048/3/19  |
| 北九州市 公募 (10年) 令和2年度第2回      |   | 0.125 | 200,000    | 198,756    | 2030/12/24 |
| 北九州市 公募 (20年) 第3回           |   | 2.33  | 200,000    | 228,924    | 2027/9/21  |
| 北九州市 公募 (20年) 第14回          |   | 1.732 | 100,000    | 116,666    | 2032/11/12 |
| 福岡市 公募 (20年) 平成21年度第3回      |   | 2.14  | 200,000    | 233,684    | 2029/9/18  |
| 福岡市 公募 (20年) 平成23年度第4回      |   | 1.89  | 100,000    | 117,197    | 2031/8/19  |
| 福岡市 公募平成26年度第2回             |   | 1.49  | 100,000    | 115,056    | 2034/6/20  |
| 福岡市 公募平成26年度第5回             |   | 0.539 | 100,000    | 101,853    | 2024/10/28 |
| 福岡市 公募平成26年度第8回             |   | 0.465 | 160,000    | 162,833    | 2025/3/25  |
| 広島市 公募平成26年度第2回             |   | 0.456 | 100,000    | 101,628    | 2024/12/25 |
| 広島市 公募平成27年度第2回             |   | 0.464 | 500,000    | 510,505    | 2025/12/25 |
| 広島市 公募 (10年) 平成30年度第6回      |   | 0.146 | 241,000    | 241,426    | 2029/2/22  |
| 千葉市 公募平成26年度第2回             |   | 0.505 | 200,000    | 203,546    | 2024/11/27 |
| 三重県 公募平成24年度第1回             |   | 0.801 | 140,660    | 142,395    | 2022/10/25 |
| 三重県 公募平成28年度第1回             |   | 0.165 | 155,000    | 155,885    | 2026/12/25 |
| 福井県 公募平成24年度第4回             |   | 0.46  | 100,000    | 100,922    | 2023/4/26  |
| 福井県 公募平成27年度第4回             |   | 0.085 | 200,000    | 200,404    | 2026/4/27  |
| 山梨県 公募平成24年度第1回             |   | 0.8   | 200,000    | 202,478    | 2022/10/28 |
| 岡山県 公募平成28年度第2回             |   | 0.205 | 168,900    | 170,312    | 2027/3/31  |
| 愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回  |   | 2.34  | 100,000    | 115,540    | 2028/12/20 |
| 愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回 |   | 2.298 | 300,000    | 351,120    | 2029/12/20 |
| 福岡北九州高速道路債券 第117回           |   | 2.26  | 100,000    | 115,022    | 2028/12/20 |
| 福岡北九州高速道路債券 第136回           |   | 0.833 | 100,000    | 104,655    | 2030/3/19  |
| 小 計                         |   |       | 48,556,100 | 50,873,297 |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>          |   |       |            |            |            |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第37回        |   | 0.895 | 604,000    | 610,662    | 2022/6/17  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第38回        |   | 0.839 | 194,000    | 196,135    | 2022/7/15  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第39回        |   | 0.801 | 100,000    | 101,123    | 2022/8/15  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第40回        |   | 0.819 | 101,000    | 102,233    | 2022/9/16  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第41回        |   | 0.791 | 102,000    | 103,276    | 2022/10/18 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第42回        |   | 0.805 | 108,000    | 109,438    | 2022/11/14 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第43回        |   | 0.734 | 202,000    | 204,589    | 2022/12/16 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第44回        |   | 0.834 | 145,000    | 147,225    | 2023/1/20  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第45回        |   | 0.815 | 223,000    | 226,487    | 2023/2/17  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第48回        |   | 0.605 | 500,000    | 506,390    | 2023/5/16  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第49回        |   | 0.882 | 13,000     | 13,252     | 2023/6/16  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第50回        |   | 0.911 | 100,000    | 102,076    | 2023/7/14  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第56回        |   | 0.747 | 591,000    | 603,221    | 2024/1/19  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第59回        |   | 0.669 | 116,000    | 118,302    | 2024/4/12  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第64回        |   | 0.544 | 100,000    | 101,823    | 2024/9/13  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第65回        |   | 0.539 | 400,000    | 407,416    | 2024/10/16 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第69回        |   | 0.414 | 320,000    | 324,956    | 2025/2/17  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第72回        |   | 0.509 | 189,000    | 192,861    | 2025/5/23  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第78回        |   | 0.381 | 509,000    | 517,622    | 2025/11/18 |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 (8年) 第5回    |   | 0.173 | 500,000    | 502,310    | 2024/1/29  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券 第83回        |   | 0.02  | 116,000    | 115,998    | 2026/4/17  |

| 銘柄                 | 柄          | 当 期 末 |           |           | 償還年月日      |
|--------------------|------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                    |            | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b> |            |       |           | 千円        |            |
| 政保 地方公共団体金融機構債券    | 第108回      | 0.145 | 157,000   | 157,891   | 2028/5/19  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券    | 第110回      | 0.13  | 100,000   | 100,399   | 2028/7/18  |
| 政保 地方公共団体金融機構債券    | 第113回      | 0.219 | 110,000   | 111,106   | 2028/10/16 |
| 新聞西国際空港債券          | 政府保証第1回    | 0.801 | 151,000   | 152,742   | 2022/8/29  |
| 新聞西国際空港債券          | 政府保証第2回    | 0.882 | 191,000   | 194,760   | 2023/6/27  |
| 新聞西国際空港債券          | 政府保証第5回    | 0.145 | 117,000   | 117,699   | 2027/3/30  |
| 原子力損害賠償・廃炉等支援機構債券  | 政府保証第16回   | 0.001 | 300,000   | 299,937   | 2023/11/27 |
| 日本政策投資銀行債券         | 政府保証第22回   | 2.2   | 100,000   | 104,875   | 2023/6/19  |
| 日本政策投資銀行社債         | 政府保証第16回   | 0.819 | 102,000   | 103,254   | 2022/9/20  |
| 日本政策投資銀行社債         | 政府保証第19回   | 0.668 | 159,000   | 161,124   | 2023/3/15  |
| 日本政策投資銀行社債         | 政府保証第38回   | 0.001 | 1,500,000 | 1,500,450 | 2023/2/17  |
| 日本政策投資銀行社債         | 政府保証第42回   | 0.155 | 300,000   | 302,004   | 2027/12/15 |
| 日本政策投資銀行社債         | 政府保証第55回   | 0.105 | 300,000   | 300,000   | 2029/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第92回  | 2.1   | 200,000   | 233,766   | 2029/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第97回  | 2.1   | 200,000   | 234,284   | 2029/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第99回  | 2.2   | 200,000   | 236,292   | 2030/1/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第106回 | 2.1   | 200,000   | 235,380   | 2030/4/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第114回 | 1.9   | 200,000   | 232,444   | 2030/7/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第123回 | 2.1   | 100,000   | 129,153   | 2040/11/30 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第163回 | 0.901 | 1,000,000 | 1,010,680 | 2022/5/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第165回 | 1.83  | 100,000   | 124,971   | 2042/5/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第168回 | 0.839 | 100,000   | 101,134   | 2022/7/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第169回 | 1.634 | 100,000   | 115,503   | 2032/7/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第170回 | 0.801 | 218,000   | 220,524   | 2022/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第171回 | 1.56  | 100,000   | 114,732   | 2032/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第172回 | 1.919 | 300,000   | 380,460   | 2042/8/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第173回 | 0.819 | 200,000   | 202,506   | 2022/9/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第175回 | 0.791 | 200,000   | 202,558   | 2022/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第180回 | 0.734 | 200,000   | 202,614   | 2022/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第182回 | 0.834 | 900,000   | 914,040   | 2023/1/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第183回 | 1.726 | 100,000   | 116,970   | 2033/1/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第189回 | 0.541 | 196,000   | 198,181   | 2023/4/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第190回 | 0.605 | 400,000   | 405,208   | 2023/5/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第193回 | 0.882 | 1,000,000 | 1,019,740 | 2023/6/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第197回 | 0.835 | 272,000   | 277,464   | 2023/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第207回 | 0.693 | 300,000   | 305,625   | 2023/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第211回 | 0.66  | 137,000   | 139,597   | 2024/2/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第213回 | 0.645 | 145,000   | 147,759   | 2024/3/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第216回 | 1.483 | 100,000   | 115,027   | 2034/4/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第217回 | 1.72  | 100,000   | 123,621   | 2044/5/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第219回 | 1.478 | 100,000   | 115,063   | 2034/5/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第220回 | 0.644 | 300,000   | 306,117   | 2024/6/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第224回 | 1.72  | 100,000   | 123,752   | 2044/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第225回 | 0.556 | 190,000   | 193,503   | 2024/8/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第229回 | 0.539 | 630,000   | 641,818   | 2024/10/31 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第234回 | 0.466 | 100,000   | 101,686   | 2024/12/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第239回 | 1.16  | 500,000   | 555,540   | 2035/2/28  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第241回 | 0.45  | 200,000   | 203,476   | 2025/3/31  |

| 銘柄                 | 柄          | 当期末   |         |         | 償還年月日      |
|--------------------|------------|-------|---------|---------|------------|
|                    |            | 利率    | 額面金額    | 評価額     |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b> |            |       |         |         |            |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第261回 | 0.381 | 401,000 | 407,833 | 2025/11/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第271回 | 0.02  | 151,000 | 151,036 | 2026/3/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第297回 | 0.085 | 100,000 | 100,286 | 2026/12/28 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第306回 | 0.145 | 403,000 | 405,409 | 2027/3/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第315回 | 0.13  | 100,000 | 100,498 | 2027/6/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第321回 | 0.155 | 600,000 | 604,026 | 2027/8/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第324回 | 0.09  | 100,000 | 100,226 | 2027/9/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第335回 | 0.84  | 100,000 | 103,735 | 2047/12/27 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第339回 | 0.195 | 500,000 | 504,645 | 2028/2/29  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第342回 | 0.145 | 131,000 | 131,729 | 2028/3/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第351回 | 0.145 | 100,000 | 100,504 | 2028/6/30  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第354回 | 0.13  | 200,000 | 200,802 | 2028/7/31  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 政府保証債第357回 | 0.209 | 100,000 | 100,951 | 2028/8/31  |
| 民間都市開発推進機構         | 政府保証第16回   | 0.699 | 360,000 | 366,372 | 2023/10/20 |
| 関西国際空港債券           | 政府保証第54回   | 2.4   | 300,000 | 350,292 | 2028/6/23  |
| 中部国際空港債券           | 政府保証第18回   | 0.668 | 368,000 | 372,964 | 2023/3/22  |
| 中部国際空港債券           | 政府保証第22回   | 0.001 | 300,000 | 299,925 | 2024/3/1   |
| 預金保険機構債券           | 政府保証第230回  | 0.1   | 300,000 | 300,846 | 2024/8/6   |
| 預金保険機構債券           | 政府保証第231回  | 0.1   | 300,000 | 300,885 | 2024/10/4  |
| 新関西国際空港社債          | 財投機関債第6回   | 1.445 | 300,000 | 328,422 | 2028/9/15  |
| 新関西国際空港社債          | 財投機関債第9回   | 1.231 | 100,000 | 108,097 | 2028/12/20 |
| 新関西国際空港社債          | 財投機関債第12回  | 1.067 | 100,000 | 107,181 | 2029/9/20  |
| 新関西国際空港社債          | 財投機関債第22回  | 0.05  | 200,000 | 199,972 | 2023/12/20 |
| 日本政策投資銀行社債         | 財投機関債第31回  | 0.781 | 300,000 | 303,414 | 2022/9/20  |
| 日本政策投資銀行社債         | 財投機関債第47回  | 1.027 | 100,000 | 107,027 | 2029/9/20  |
| 日本政策投資銀行社債         | 財投機関債第78回  | 0.225 | 200,000 | 201,378 | 2027/4/13  |
| 日本政策投資銀行社債         | 財投機関債第82回  | 0.27  | 100,000 | 100,935 | 2027/7/13  |
| 日本政策投資銀行社債         | 財投機関債第86回  | 0.235 | 300,000 | 302,334 | 2027/10/13 |
| 日本政策投資銀行社債         | 財投機関債第96回  | 0.195 | 200,000 | 200,720 | 2028/7/12  |
| 道路債券               | 財投機関債第17回  | 1.54  | 300,000 | 307,911 | 2022/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第4回   | 2.59  | 100,000 | 130,731 | 2035/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第8回   | 2.45  | 200,000 | 223,840 | 2026/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第17回  | 2.35  | 100,000 | 112,269 | 2026/9/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第23回  | 2.39  | 300,000 | 342,612 | 2027/7/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第33回  | 2.91  | 200,000 | 304,988 | 2048/3/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第39回  | 2.37  | 200,000 | 232,906 | 2028/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第47回  | 2.41  | 100,000 | 117,852 | 2029/4/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第89回  | 1.711 | 100,000 | 115,622 | 2032/6/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第100回 | 0.784 | 200,000 | 202,666 | 2022/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第102回 | 0.666 | 100,000 | 101,291 | 2023/3/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第103回 | 1.69  | 350,000 | 405,944 | 2033/3/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第105回 | 1.853 | 100,000 | 117,936 | 2033/3/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第107回 | 0.935 | 100,000 | 102,034 | 2023/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第116回 | 0.722 | 400,000 | 406,948 | 2023/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第122回 | 0.704 | 100,000 | 102,016 | 2024/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第123回 | 0.69  | 100,000 | 101,974 | 2024/3/19  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第130回 | 0.56  | 200,000 | 203,378 | 2024/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第134回 | 0.529 | 200,000 | 203,180 | 2024/6/20  |

| 銘柄                 | 柄               | 当 期 末 |           |           |            |
|--------------------|-----------------|-------|-----------|-----------|------------|
|                    |                 | 利 率   | 額 面 金 額   | 評 価 額     | 償 還 年 月 日  |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b> |                 | %     | 千円        | 千円        |            |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第136回      | 0.583 | 200,000   | 203,796   | 2024/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第145回      | 1.523 | 300,000   | 351,960   | 2044/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第149回      | 1.604 | 100,000   | 119,043   | 2045/3/17  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第157回      | 0.857 | 100,000   | 105,902   | 2030/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第164回      | 1.149 | 100,000   | 110,176   | 2035/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第173回      | 0.652 | 100,000   | 92,372    | 2056/3/17  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第188回      | 0.614 | 100,000   | 102,117   | 2037/9/18  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券  | 財投機関債第260回      | 0.651 | 200,000   | 195,200   | 2050/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継  | 財投機関債第13回       | 2.28  | 130,000   | 134,353   | 2022/9/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継  | 財投機関債第28回       | 2.83  | 400,000   | 523,100   | 2033/12/20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継  | 財投機関債第33回       | 2.91  | 100,000   | 132,697   | 2034/6/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構承継  | 財投機関債第38回       | 2.26  | 1,000,000 | 1,077,170 | 2024/9/20  |
| 公営企業債券             | 30年第4回財投機関債     | 2.95  | 100,000   | 132,788   | 2034/3/24  |
| 地方公営企業等金融機構債券      | (20年) 第1回       | 2.07  | 100,000   | 114,713   | 2028/12/20 |
| 地方公共団体金融機構債券       | 20年第4回          | 2.12  | 100,000   | 116,708   | 2029/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券       | F16回            | 2.042 | 100,000   | 111,179   | 2027/1/7   |
| 地方公共団体金融機構債券       | 20年第6回          | 2.242 | 300,000   | 354,600   | 2030/3/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F24回            | 1.681 | 100,000   | 103,278   | 2023/3/17  |
| 地方公共団体金融機構債券       | (20年) 第10回      | 1.752 | 300,000   | 342,864   | 2030/8/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F104回           | 1.314 | 100,000   | 105,046   | 2025/3/7   |
| 地方公共団体金融機構債券       | F106回           | 1.259 | 100,000   | 103,662   | 2024/3/19  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F122回           | 1.412 | 100,000   | 108,039   | 2027/6/18  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F124回           | 1.418 | 100,000   | 108,027   | 2027/6/4   |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第37回            | 0.852 | 400,000   | 404,184   | 2022/6/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F132回           | 1.09  | 500,000   | 522,905   | 2025/7/30  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第41回            | 0.801 | 600,000   | 607,494   | 2022/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券       | F142回           | 1.016 | 100,000   | 103,626   | 2024/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券       | F145回           | 1.059 | 200,000   | 208,154   | 2025/3/19  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F147回           | 1.291 | 100,000   | 107,065   | 2027/3/19  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第42回            | 0.801 | 100,000   | 101,316   | 2022/11/28 |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第44回            | 0.791 | 100,000   | 101,427   | 2023/1/27  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F160回           | 1.052 | 100,000   | 106,497   | 2028/5/26  |
| 地方公共団体金融機構債券       | (20年) 第29回      | 1.725 | 100,000   | 116,689   | 2033/6/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第51回            | 0.841 | 600,000   | 611,880   | 2023/8/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第52回            | 0.801 | 300,000   | 305,880   | 2023/9/15  |
| 地方公共団体金融機構債券       | (15年) 第2回       | 1.161 | 200,000   | 215,490   | 2028/12/28 |
| 地方公共団体金融機構債券       | (20年) 第38回      | 1.487 | 100,000   | 114,404   | 2034/7/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | F240回           | 1.069 | 300,000   | 322,983   | 2030/2/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第64回            | 0.574 | 100,000   | 101,913   | 2024/9/27  |
| 地方公共団体金融機構債券       | (20年) 第39回      | 1.425 | 100,000   | 113,714   | 2034/9/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第74回            | 0.519 | 300,000   | 306,324   | 2025/7/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第77回            | 0.491 | 100,000   | 102,105   | 2025/10/28 |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第79回            | 0.484 | 400,000   | 408,592   | 2025/12/26 |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第95回            | 0.2   | 200,000   | 201,208   | 2027/4/28  |
| 地方公共団体金融機構債券       | 第101回           | 0.235 | 400,000   | 403,396   | 2027/10/28 |
| 公営企業債券             | (20年) 第2回財投機関債  | 1.45  | 100,000   | 102,482   | 2022/12/20 |
| 公営企業債券             | (20年) 第5回財投機関債  | 2.11  | 200,000   | 210,338   | 2023/9/20  |
| 公営企業債券             | (20年) 第19回財投機関債 | 2.37  | 100,000   | 112,939   | 2026/12/18 |

| 銘柄           | 柄          | 当期末   |         |         |            |
|--------------|------------|-------|---------|---------|------------|
|              |            | 利率    | 額面金額    | 評価額     | 償還年月日      |
| 特殊債券(除く金融債)  |            |       | 千円      | 千円      |            |
| 公営企業債券 (20年) | 第20回財投機関債  | 2.25  | 100,000 | 112,784 | 2027/3/24  |
| 公営企業債券 (20年) | 第24回財投機関債  | 2.29  | 100,000 | 115,171 | 2028/4/25  |
| 公営企業債券 (20年) | 第25回財投機関債  | 2.5   | 100,000 | 117,001 | 2028/6/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第96回  | 0.599 | 200,000 | 203,906 | 2024/9/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第97回  | 1.017 | 100,000 | 106,943 | 2029/9/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第101回 | 0.935 | 100,000 | 106,290 | 2029/11/20 |
| 都市再生債券       | 財投機関債第109回 | 0.918 | 100,000 | 106,455 | 2030/6/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第113回 | 0.851 | 300,000 | 317,718 | 2030/9/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第121回 | 0.482 | 200,000 | 205,072 | 2031/2/20  |
| 都市再生債券       | 財投機関債第127回 | 0.075 | 100,000 | 99,891  | 2026/9/18  |
| 本州四国連絡橋債券    | 財投機関債第7回   | 2.26  | 100,000 | 109,238 | 2025/6/20  |
| 東京交通債券       | 第342回      | 2.4   | 200,000 | 205,826 | 2022/6/21  |
| 東京交通債券       | 第347回      | 2.05  | 157,000 | 166,261 | 2024/3/8   |
| 福祉医療機構債券     | 第31回財投機関債  | 0.93  | 100,000 | 101,123 | 2022/6/20  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第3回   | 2.26  | 400,000 | 450,988 | 2027/3/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第6回   | 2.46  | 200,000 | 228,880 | 2027/6/18  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第18回  | 2.15  | 100,000 | 105,268 | 2023/9/20  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第42回  | 1.94  | 100,000 | 107,547 | 2025/3/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第49回  | 2.11  | 100,000 | 117,291 | 2030/6/18  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第59回  | 1.95  | 100,000 | 116,334 | 2030/10/22 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第75回  | 2.066 | 100,000 | 118,368 | 2031/6/13  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第77回  | 1.751 | 300,000 | 325,971 | 2026/6/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第78回  | 2.056 | 100,000 | 118,338 | 2031/7/11  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第85回  | 1.841 | 200,000 | 232,938 | 2031/10/17 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第90回  | 1.595 | 200,000 | 216,938 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第120回 | 1.836 | 100,000 | 117,376 | 2032/11/12 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第123回 | 1.801 | 100,000 | 116,830 | 2032/9/17  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第128回 | 2.273 | 100,000 | 131,936 | 2042/9/19  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第132回 | 1.092 | 200,000 | 213,202 | 2028/3/17  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第137回 | 1.31  | 100,000 | 108,366 | 2028/6/20  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第143回 | 1.192 | 100,000 | 107,789 | 2028/10/20 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第177回 | 0.484 | 250,000 | 255,170 | 2025/12/19 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第198回 | 0.155 | 300,000 | 300,852 | 2026/12/18 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第223回 | 0.403 | 100,000 | 101,031 | 2032/11/19 |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第244回 | 0.274 | 130,000 | 131,176 | 2028/8/18  |
| 住宅金融支援機構債券   | 財投機関債第301回 | 0.04  | 300,000 | 299,928 | 2025/12/19 |
| 成田国際空港       | 第13回一般担保付  | 0.802 | 200,000 | 202,908 | 2023/2/8   |
| 成田国際空港       | 第17回       | 0.489 | 400,000 | 406,584 | 2025/2/20  |
| 沖縄振興開発金融公庫債券 | 財投機関債第6回   | 2.04  | 200,000 | 216,806 | 2025/6/20  |
| 国際協力機構債券     | 第6回財投機関債   | 2.098 | 200,000 | 236,022 | 2030/12/13 |
| 東日本高速道路      | 第61回       | 0.14  | 200,000 | 198,932 | 2029/7/31  |
| 中日本高速道路      | 第63回       | 0.576 | 100,000 | 102,353 | 2025/11/13 |
| 中日本高速道路      | 第79回       | 0.04  | 300,000 | 299,940 | 2024/8/19  |
| 西日本高速道路      | 第20回       | 0.759 | 200,000 | 203,606 | 2023/9/20  |
| 西日本高速道路      | 第22回       | 0.744 | 400,000 | 408,296 | 2024/3/19  |
| 西日本高速道路      | 第23回       | 0.602 | 100,000 | 101,792 | 2024/6/20  |
| 西日本高速道路      | 第30回       | 0.17  | 300,000 | 301,149 | 2026/5/22  |
| 西日本高速道路      | 第50回       | 0.04  | 200,000 | 199,966 | 2024/6/20  |

| 銘柄                     | 柄         | 当期末   |         |         | 償還年月日      |
|------------------------|-----------|-------|---------|---------|------------|
|                        |           | 利率    | 額面金額    | 評価額     |            |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>     |           | %     | 千円      | 千円      |            |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第57回 | 0.835 | 300,000 | 305,436 | 2023/6/20  |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第62回 | 0.714 | 100,000 | 101,875 | 2023/12/20 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第68回 | 0.586 | 200,000 | 203,682 | 2024/8/5   |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第69回 | 1.441 | 100,000 | 113,838 | 2034/8/4   |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第71回 | 0.525 | 500,000 | 508,950 | 2024/11/27 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券      | 財投機関債第90回 | 0.2   | 300,000 | 298,827 | 2031/5/30  |
| 貸付債権担保第12回住宅金融公庫債券     |           | 1.69  | 28,431  | 28,443  | 2038/9/10  |
| 貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券     |           | 1.8   | 53,635  | 54,249  | 2039/6/10  |
| 貸付債権担保第5回S種住宅金融公庫債券    |           | 1.76  | 32,019  | 32,288  | 2036/11/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券     |           | 2.34  | 35,682  | 36,687  | 2041/5/10  |
| 貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券    |           | 2.25  | 11,122  | 11,308  | 2037/5/10  |
| 貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券     |           | 1.84  | 24,136  | 24,688  | 2041/2/10  |
| 貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券     |           | 1.93  | 27,768  | 28,921  | 2041/3/10  |
| 貸付債権担保第15回住宅金融公庫債券     |           | 1.69  | 30,945  | 31,126  | 2039/2/10  |
| 貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券     |           | 1.69  | 49,964  | 51,152  | 2040/7/10  |
| 貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券     |           | 2.12  | 53,820  | 54,582  | 2039/7/10  |
| 貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券     |           | 2.3   | 47,976  | 49,247  | 2041/7/10  |
| 貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券    |           | 1.99  | 77,898  | 80,140  | 2042/12/10 |
| 貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券    |           | 2.14  | 13,391  | 13,884  | 2042/11/10 |
| 貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券   |           | 2.28  | 20,661  | 22,122  | 2044/6/10  |
| 貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券   |           | 1.98  | 66,873  | 71,174  | 2044/9/10  |
| 貸付債権担保S種第16回住宅金融支援機構債券 |           | 1.64  | 11,720  | 11,842  | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券   |           | 1.43  | 64,656  | 68,016  | 2045/11/10 |
| 貸付債権担保S種第17回住宅金融支援機構債券 |           | 1.71  | 23,604  | 23,869  | 2032/11/10 |
| 貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券   |           | 1.79  | 79,515  | 84,157  | 2046/2/10  |
| 貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券   |           | 1.51  | 64,354  | 67,856  | 2046/9/10  |
| 貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券   |           | 2.34  | 36,752  | 39,169  | 2044/5/10  |
| 貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券   |           | 1.89  | 78,813  | 83,495  | 2046/5/10  |
| 貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券   |           | 1.36  | 81,531  | 85,186  | 2045/9/10  |
| 貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券   |           | 1.21  | 124,833 | 130,606 | 2047/7/10  |
| 貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券   |           | 1.34  | 120,600 | 126,920 | 2047/5/10  |
| 貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券   |           | 1.26  | 78,046  | 81,821  | 2047/6/10  |
| 貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券   |           | 1.64  | 29,434  | 31,082  | 2046/8/10  |
| 貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券   |           | 1.6   | 64,030  | 67,835  | 2045/12/10 |
| 貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券   |           | 1.07  | 40,357  | 41,973  | 2048/12/10 |
| 貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券   |           | 1.07  | 87,898  | 91,508  | 2049/2/10  |
| 貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券   |           | 1.08  | 39,108  | 40,682  | 2048/5/10  |
| 貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券     |           | 1.87  | 22,170  | 22,479  | 2039/9/10  |
| 貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券   |           | 1.25  | 117,561 | 123,175 | 2048/3/10  |
| 貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券   |           | 1.88  | 25,110  | 26,769  | 2045/2/10  |
| 貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券   |           | 1.86  | 27,170  | 28,993  | 2045/3/10  |
| 貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券   |           | 1.87  | 25,312  | 26,907  | 2045/4/10  |
| 貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券   |           | 1.85  | 27,323  | 29,006  | 2046/3/10  |
| 貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券   |           | 1.41  | 78,558  | 82,932  | 2046/12/10 |
| 貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券   |           | 1.42  | 111,222 | 117,232 | 2047/1/10  |
| 貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券   |           | 1.44  | 37,127  | 39,157  | 2047/2/10  |
| 貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券   |           | 1.21  | 76,806  | 80,291  | 2048/9/10  |
| 貸付債権担保S種第3回住宅金融公庫債券    |           | 1.82  | 10,265  | 10,336  | 2036/5/10  |

| 銘柄                     | 利 率  | 当 期 末   |         |            |
|------------------------|------|---------|---------|------------|
|                        |      | 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S種第14回住宅金融支援機構債券 | 1.7  | 46,550  | 46,574  | 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 | 18,996  | 19,006  | 2032/5/10  |
| 貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券   | 2.25 | 72,192  | 76,534  | 2044/4/10  |
| 貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券   | 1.82 | 73,071  | 77,611  | 2045/1/10  |
| 貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券   | 1.52 | 134,480 | 141,182 | 2045/8/10  |
| 貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券   | 1.4  | 80,366  | 84,800  | 2047/3/10  |
| 貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券   | 1.16 | 131,952 | 137,893 | 2047/9/10  |
| 貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券   | 1.07 | 115,059 | 119,602 | 2048/4/10  |
| 貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券   | 1.3  | 89,550  | 94,263  | 2048/6/10  |
| 貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券   | 1.26 | 75,868  | 79,505  | 2048/8/10  |
| 貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券   | 1.04 | 184,444 | 191,871 | 2049/4/10  |
| 貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券   | 1.01 | 319,753 | 332,140 | 2049/5/10  |
| 貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券   | 0.93 | 48,694  | 50,402  | 2049/9/10  |
| 貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券   | 0.95 | 50,684  | 52,524  | 2049/10/10 |
| 貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券   | 0.87 | 51,924  | 53,598  | 2049/11/10 |
| 貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券   | 0.74 | 109,014 | 111,802 | 2050/1/10  |
| 貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券   | 0.6  | 114,502 | 116,558 | 2050/2/10  |
| 貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券   | 0.8  | 60,519  | 62,267  | 2050/3/10  |
| 貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券   | 0.74 | 64,313  | 65,976  | 2050/5/10  |
| 貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券   | 0.83 | 191,736 | 197,662 | 2050/6/10  |
| 貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券   | 0.9  | 197,769 | 204,684 | 2050/7/10  |
| 貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券   | 0.88 | 132,800 | 137,297 | 2050/8/10  |
| 貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券  | 0.84 | 64,768  | 66,841  | 2050/9/10  |
| 貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券  | 0.89 | 65,349  | 67,627  | 2050/10/10 |
| 貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券  | 0.41 | 242,898 | 244,250 | 2051/12/10 |
| 貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券  | 0.48 | 162,800 | 164,528 | 2052/1/10  |
| 貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券  | 0.46 | 164,048 | 165,542 | 2052/2/10  |
| 貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券  | 0.47 | 81,986  | 82,793  | 2052/3/10  |
| 貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券  | 0.46 | 163,854 | 165,351 | 2052/4/10  |
| 貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券  | 0.4  | 82,632  | 83,069  | 2052/5/10  |
| 貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券  | 0.43 | 83,037  | 83,628  | 2052/6/10  |
| 貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券  | 0.46 | 84,470  | 85,219  | 2052/8/10  |
| 貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券  | 0.42 | 337,656 | 339,708 | 2052/10/10 |
| 貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券  | 0.43 | 254,952 | 256,637 | 2052/11/10 |
| 貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券  | 0.42 | 170,066 | 171,074 | 2053/1/10  |
| 貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券  | 0.46 | 173,062 | 174,513 | 2053/2/10  |
| 貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券  | 0.39 | 176,570 | 177,163 | 2053/7/10  |
| 貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券  | 0.39 | 88,301  | 88,590  | 2053/8/10  |
| 貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券  | 0.44 | 89,084  | 89,745  | 2053/9/10  |
| 貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券  | 0.38 | 89,671  | 89,933  | 2054/1/10  |
| 貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券  | 0.32 | 273,804 | 273,324 | 2054/3/10  |
| 貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券  | 0.33 | 275,004 | 274,629 | 2054/5/10  |
| 貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券  | 0.21 | 471,440 | 465,938 | 2054/11/10 |
| 貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券  | 0.33 | 190,682 | 190,338 | 2055/1/10  |
| 貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券  | 0.3  | 192,240 | 191,378 | 2055/3/10  |
| 貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券  | 0.33 | 298,476 | 297,744 | 2056/1/10  |
| 貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券  | 0.36 | 199,644 | 199,747 | 2056/2/10  |
| 貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券  | 0.41 | 300,000 | 301,416 | 2056/3/10  |

| 銘柄                     |                           | 当 期 末 |            |            |            |
|------------------------|---------------------------|-------|------------|------------|------------|
|                        |                           | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日  |
| <b>特殊債券(除く金融債)</b>     |                           |       |            |            |            |
|                        |                           | %     | 千円         | 千円         |            |
|                        | 貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券     | 0.41  | 200,000    | 200,904    | 2056/4/10  |
|                        | フランス預金供託公庫 第4回円貨債券 (2014) | 0.725 | 100,000    | 101,818    | 2024/7/30  |
|                        | 小 計                       |       | 58,137,926 | 60,862,888 |            |
| <b>金融債券</b>            |                           |       |            |            |            |
|                        | 商工債券 利付第806回い号            | 0.1   | 300,000    | 300,258    | 2022/7/27  |
|                        | 商工債券 利付第811回い号            | 0.17  | 300,000    | 300,705    | 2022/12/27 |
|                        | 商工債券 利付第815回い号            | 0.17  | 100,000    | 100,270    | 2023/4/27  |
|                        | 商工債券 利付第818回い号            | 0.17  | 100,000    | 100,291    | 2023/7/27  |
|                        | 商工債券 利付第819回い号            | 0.18  | 300,000    | 300,975    | 2023/8/25  |
|                        | 商工債券 利付第829回い号            | 0.13  | 200,000    | 200,354    | 2024/6/27  |
|                        | 商工債券 利付第831回い号            | 0.08  | 200,000    | 200,028    | 2024/8/27  |
|                        | 商工債券 利付第833回い号            | 0.05  | 100,000    | 99,855     | 2024/10/25 |
|                        | しんきん中金債券 利付第335回          | 0.1   | 200,000    | 200,222    | 2022/10/27 |
|                        | 商工債券 利付(3年)第236回          | 0.02  | 500,000    | 499,890    | 2022/9/27  |
|                        | 商工債券 利付(10年)第15回          | 0.48  | 200,000    | 203,374    | 2025/9/19  |
|                        | 小 計                       |       | 2,500,000  | 2,506,222  |            |
| <b>普通社債券(含む投資法人債券)</b> |                           |       |            |            |            |
|                        | 東京電力 第548回                | 2.347 | 100,000    | 111,181    | 2028/9/29  |
|                        | 東京電力 第560回                | 2.114 | 100,000    | 110,191    | 2029/12/10 |
|                        | 中部電力 第500回                | 0.875 | 200,000    | 205,122    | 2024/5/24  |
|                        | 中部電力 第524回                | 0.39  | 100,000    | 101,154    | 2027/5/25  |
|                        | 中部電力 第530回                | 0.274 | 200,000    | 199,660    | 2029/6/25  |
|                        | 関西電力 第509回                | 0.47  | 100,000    | 101,424    | 2027/5/25  |
|                        | 関西電力 第511回                | 0.41  | 100,000    | 100,985    | 2027/9/17  |
|                        | 関西電力 第527回                | 0.28  | 200,000    | 201,228    | 2024/4/25  |
|                        | 関西電力 第535回                | 0.18  | 200,000    | 200,374    | 2025/12/19 |
|                        | 中国電力 第377回                | 1.121 | 100,000    | 102,584    | 2023/8/25  |
|                        | 中国電力 第378回                | 1.004 | 100,000    | 102,444    | 2023/10/25 |
|                        | 中国電力 第400回                | 0.34  | 100,000    | 100,767    | 2027/9/24  |
|                        | 中国電力 第402回                | 0.25  | 100,000    | 100,602    | 2024/10/25 |
|                        | 北陸電力 第301回                | 1.158 | 100,000    | 102,202    | 2023/3/24  |
|                        | 北陸電力 第307回                | 1.055 | 100,000    | 104,674    | 2026/6/25  |
|                        | 北陸電力 第308回                | 0.769 | 100,000    | 102,375    | 2024/9/25  |
|                        | 北陸電力 第326回                | 0.719 | 100,000    | 101,127    | 2038/4/23  |
|                        | 東北電力 第475回                | 0.809 | 100,000    | 102,514    | 2024/9/25  |
|                        | 東北電力 第481回                | 0.803 | 200,000    | 205,814    | 2025/7/25  |
|                        | 東北電力 第484回                | 0.758 | 100,000    | 102,187    | 2036/5/23  |
|                        | 東北電力 第491回                | 0.42  | 100,000    | 101,254    | 2027/2/25  |
|                        | 東北電力 第521回                | 0.45  | 100,000    | 100,975    | 2030/5/24  |
|                        | 四国電力 第281回                | 1.111 | 100,000    | 102,624    | 2023/9/25  |
|                        | 九州電力 第424回                | 1.233 | 100,000    | 103,110    | 2023/11/24 |
|                        | 九州電力 第428回                | 0.936 | 105,000    | 107,972    | 2024/7/25  |
|                        | 九州電力 第449回                | 0.43  | 200,000    | 202,572    | 2027/4/23  |
|                        | 九州電力 第451回                | 0.45  | 100,000    | 101,395    | 2027/5/25  |
|                        | 九州電力 第476回                | 0.43  | 100,000    | 100,873    | 2029/5/25  |
|                        | 九州電力 第484回                | 0.375 | 200,000    | 200,670    | 2029/11/22 |
|                        | 北海道電力 第321回               | 0.886 | 100,000    | 102,888    | 2024/12/25 |
|                        | 北海道電力 第323回               | 1.337 | 100,000    | 108,456    | 2030/3/25  |

| 銘柄                                 | 柄 | 当 期 末 |         |         | 償還年月日      |
|------------------------------------|---|-------|---------|---------|------------|
|                                    |   | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   |            |
| 普通社債券(含む投資法人債券)                    |   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 北海道電力 第338回                        |   | 0.84  | 100,000 | 102,912 | 2036/11/25 |
| 北海道電力 第345回                        |   | 0.27  | 300,000 | 301,761 | 2024/9/25  |
| 東京電力パワーグリッド 第6回                    |   | 0.85  | 100,000 | 101,869 | 2027/8/31  |
| 東京電力パワーグリッド 第11回                   |   | 0.79  | 300,000 | 303,741 | 2028/1/25  |
| 東京電力パワーグリッド 第14回                   |   | 0.43  | 100,000 | 100,677 | 2023/7/24  |
| 東京電力パワーグリッド 第28回                   |   | 1.01  | 100,000 | 102,167 | 2029/7/10  |
| 東京電力パワーグリッド 第35回                   |   | 1.2   | 100,000 | 103,655 | 2030/4/23  |
| 東京電力パワーグリッド 第38回                   |   | 0.58  | 200,000 | 202,422 | 2025/7/16  |
| 東京電力パワーグリッド 第40回                   |   | 1.37  | 400,000 | 418,808 | 2035/7/13  |
| 長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付        |   | 0.47  | 200,000 | 199,572 | 2030/7/12  |
| 大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付             |   | 0.69  | 100,000 | 99,996  | 2036/11/28 |
| 日揮ホールディングス 第6回特定社債間限定同順位特約付        |   | 0.03  | 200,000 | 199,786 | 2023/7/14  |
| 味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付              |   | 0.19  | 100,000 | 100,280 | 2024/3/8   |
| 日本たばこ産業 第13回                       |   | 0.355 | 100,000 | 100,254 | 2028/9/8   |
| 三越伊勢丹ホールディングス 第6回社債間限定同順位特約付       |   | 0.41  | 100,000 | 98,833  | 2027/8/31  |
| トヨタ紡織 第2回社債間限定同順位特約付               |   | 0.714 | 100,000 | 101,297 | 2023/9/20  |
| 森ヒルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付   |   | 0.34  | 200,000 | 197,676 | 2026/8/28  |
| 森ビル 第23回社債間限定同順位特約付                |   | 0.97  | 100,000 | 98,811  | 2038/5/17  |
| セブン&アイ・ホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付    |   | 0.06  | 100,000 | 100,034 | 2023/12/20 |
| セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約付    |   | 0.28  | 200,000 | 200,736 | 2027/12/20 |
| 東レ 第30回社債間限定同順位特約付                 |   | 0.375 | 100,000 | 100,153 | 2027/7/16  |
| 東レ 第33回社債間限定同順位特約付                 |   | 0.38  | 100,000 | 99,822  | 2028/7/18  |
| 日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付              |   | 0.734 | 200,000 | 198,262 | 2028/10/25 |
| 王子ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付         |   | 0.425 | 100,000 | 100,737 | 2028/1/26  |
| 住友化学 第56回社債間限定同順位特約付               |   | 0.38  | 100,000 | 100,039 | 2027/9/13  |
| 三井化学 第48回社債間限定同順位特約付               |   | 0.39  | 100,000 | 99,821  | 2028/6/19  |
| 三菱ケミカルホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付     |   | 0.33  | 100,000 | 99,469  | 2029/5/30  |
| 三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付     |   | 0.83  | 100,000 | 99,456  | 2040/6/11  |
| 電通 第3回社債間限定同順位特約付                  |   | 0.424 | 100,000 | 100,095 | 2028/10/25 |
| ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付                 |   | 0.23  | 100,000 | 100,084 | 2024/5/31  |
| オリエンタルランド 第16回社債間限定同順位特約付          |   | 0.15  | 100,000 | 100,091 | 2025/9/17  |
| ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付                 |   | 0.35  | 100,000 | 99,282  | 2024/12/6  |
| ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付                |   | 0.37  | 100,000 | 98,781  | 2026/7/31  |
| 楽天 第13回社債間限定同順位特約付                 |   | 0.45  | 100,000 | 97,389  | 2029/6/25  |
| ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付             |   | 0.295 | 100,000 | 100,222 | 2027/4/21  |
| 新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付               |   | 0.385 | 300,000 | 298,416 | 2028/6/20  |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付 |   | 0.26  | 100,000 | 99,315  | 2026/5/27  |
| ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付 |   | 0.25  | 100,000 | 100,045 | 2025/7/14  |
| 住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付             |   | 0.3   | 200,000 | 199,624 | 2027/3/1   |
| LIXILグループ 第11回社債間限定同順位特約付          |   | 0.01  | 300,000 | 299,679 | 2023/7/18  |
| 荏原製作所 第10回社債間限定同順位特約付              |   | 0.19  | 100,000 | 99,889  | 2025/10/22 |
| 日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付              |   | 1.371 | 200,000 | 215,658 | 2028/12/13 |
| 日本電気 第48回社債間限定同順位特約付               |   | 0.658 | 100,000 | 100,673 | 2022/7/15  |
| パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付             |   | 0.47  | 200,000 | 202,196 | 2026/9/18  |
| パナソニック 第20回社債間限定同順位特約付             |   | 0.08  | 100,000 | 100,006 | 2023/12/22 |
| パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付             |   | 0.19  | 100,000 | 100,048 | 2025/12/24 |
| ソニー 第32回                           |   | 0.28  | 100,000 | 100,383 | 2023/9/20  |
| 東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付           |   | 0.34  | 100,000 | 99,379  | 2027/6/7   |

| 銘柄                    | 柄                 | 当 期 末 |         |         | 償還年月日      |
|-----------------------|-------------------|-------|---------|---------|------------|
|                       |                   | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   |            |
| 普通社債券(含む投資法人債券)       |                   | %     | 千円      | 千円      |            |
| 三菱重工業                 | 第35回社債間限定同順位特約付   | 0.33  | 100,000 | 99,936  | 2027/8/27  |
| J A 三井リース             | 第8回社債間限定同順位特約付    | 0.31  | 100,000 | 100,468 | 2024/9/13  |
| 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス | 第2回社債間限定          | 0.25  | 100,000 | 100,181 | 2022/10/31 |
| トヨタ自動車                | 第14回社債間限定同等特約付    | 0.963 | 100,000 | 101,806 | 2023/3/20  |
| 楽天カード                 | 第3回社債間限定同順位特約付    | 0.42  | 100,000 | 99,299  | 2026/12/11 |
| ドンキホーテホールディングス        | 第12回社債間限定同順位特約付   | 0.39  | 100,000 | 100,493 | 2024/3/21  |
| ニコン                   | 第22回特定社債間限定同順位特約付 | 0.15  | 100,000 | 99,816  | 2025/12/2  |
| 豊田通商                  | 第18回社債間限定同順位特約付   | 1.014 | 100,000 | 103,826 | 2025/12/5  |
| 豊田通商                  | 第19回社債間限定同順位特約付   | 0.954 | 200,000 | 207,542 | 2026/7/10  |
| 三井物産                  | 第71回社債間限定同順位特約付   | 1.187 | 100,000 | 107,172 | 2029/7/13  |
| 住友商事                  | 第49回社債間限定同順位特約付   | 1.286 | 100,000 | 106,882 | 2029/1/29  |
| 住友商事                  | 第53回社債間限定同順位特約付   | 0.33  | 100,000 | 100,165 | 2027/7/26  |
| 丸井グループ                | 第28回社債間限定同順位特約付   | 0.543 | 200,000 | 200,908 | 2022/6/3   |
| クレディセゾン               | 第50回社債間限定同順位特約付   | 0.904 | 100,000 | 102,385 | 2024/4/24  |
| クレディセゾン               | 第65回社債間限定同順位特約付   | 0.38  | 100,000 | 100,476 | 2027/7/30  |
| イオン                   | 第20回社債間限定同順位特約付   | 0.82  | 100,000 | 102,086 | 2024/6/28  |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ     | 第1回劣後特約付          | 0.94  | 100,000 | 101,715 | 2024/6/26  |
| りそなホールディングス           | 第20回社債間限定同順位特約付   | 0.27  | 100,000 | 100,152 | 2025/7/23  |
| 三井住友トラスト・ホールディングス     | 第2回劣後特約付          | 0.915 | 200,000 | 203,280 | 2025/6/5   |
| みずほコーポレート銀行           | 第8回特定社債間限定同順位特約付  | 2.54  | 100,000 | 114,270 | 2027/7/27  |
| 東京三菱銀行                | 第57回特定社債間限定同順位特約付 | 2.22  | 100,000 | 103,384 | 2022/10/27 |
| 三井住友フィナンシャルグループ       | 第1回劣後特約付          | 0.849 | 300,000 | 304,341 | 2024/9/12  |
| 三井住友フィナンシャルグループ       | 第3回劣後特約付          | 0.884 | 100,000 | 101,714 | 2025/5/29  |
| 三井住友フィナンシャルグループ       | 第4回劣後特約付          | 1.328 | 100,000 | 105,283 | 2030/5/29  |
| 三井住友信託銀行              | 第1回劣後特約付          | 1.389 | 300,000 | 305,148 | 2022/9/20  |
| 三井住友信託銀行              | 第18回社債間限定同順位特約付   | 0.16  | 200,000 | 199,954 | 2026/1/27  |
| セブン銀行                 | 第10回社債間限定同順位特約付   | 0.803 | 100,000 | 101,380 | 2023/3/20  |
| セブン銀行                 | 第11回社債間限定同順位特約付   | 0.536 | 100,000 | 101,415 | 2024/12/20 |
| セブン銀行                 | 第12回社債間限定同順位特約付   | 0.39  | 300,000 | 303,276 | 2027/9/17  |
| みずほフィナンシャルグループ        | 第1回劣後特約付          | 0.95  | 200,000 | 202,958 | 2024/7/16  |
| みずほ銀行                 | 第7回劣後特約付          | 2.87  | 100,000 | 112,571 | 2026/11/6  |
| 芙蓉総合リース               | 第26回社債間限定同順位特約付   | 0.03  | 200,000 | 199,378 | 2023/10/20 |
| みずほリース                | 第3回社債間限定同順位特約付    | 0.24  | 300,000 | 300,645 | 2025/7/15  |
| みずほリース                | 第7回社債間限定同順位特約付    | 0.33  | 200,000 | 199,872 | 2028/1/20  |
| N T Tファイナンス           | 第2回社債間限定同順位特約付    | 0.26  | 100,000 | 100,471 | 2026/12/18 |
| N T Tファイナンス           | 第18回日本電信電話保証付     | 0.38  | 200,000 | 201,210 | 2030/9/20  |
| トヨタファイナンス             | 第81回社債間限定同順位特約付   | 0.265 | 100,000 | 99,806  | 2027/10/22 |
| リコーリース                | 第28回社債間限定同順位特約付   | 0.345 | 100,000 | 99,948  | 2027/7/20  |
| アコム                   | 第77回特定社債間限定同順位特約付 | 0.274 | 100,000 | 100,017 | 2023/8/30  |
| ジャックス                 | 第19回社債間限定同順位特約付   | 0.25  | 100,000 | 100,205 | 2023/6/15  |
| 日立キャピタル               | 第61回社債間限定同順位特約付   | 0.31  | 100,000 | 100,513 | 2026/6/19  |
| 日立キャピタル               | 第80回社債間限定同順位特約付   | 0.28  | 100,000 | 99,025  | 2029/10/19 |
| 三井住友ファイナンス&リース        | 第27回社債間限定同順位特約付   | 0.22  | 100,000 | 99,965  | 2026/10/16 |
| 三菱UFJリース              | 第52回社債間限定同順位特約付   | 0.375 | 100,000 | 100,597 | 2027/7/13  |
| 三菱UFJリース              | 第56回社債間限定同順位特約付   | 0.455 | 100,000 | 101,137 | 2028/1/18  |
| 三菱UFJリース              | 第76回社債間限定同順位特約付   | 0.37  | 300,000 | 299,280 | 2030/1/23  |
| 大和証券グループ本社            | 第23回社債間限定同順位特約付   | 0.909 | 100,000 | 102,100 | 2025/8/12  |
| 三井不動産                 | 第71回社債間限定同順位特約付   | 0.31  | 200,000 | 197,246 | 2030/4/16  |

| 銘                   | 柄                  | 当 期 末 |         |         | 償 還 年 月 日  |
|---------------------|--------------------|-------|---------|---------|------------|
|                     |                    | 利 率   | 額 面 金 額 | 評 価 額   |            |
| 普通社債券(含む投資法人債券)     |                    | %     | 千円      | 千円      |            |
| 三菱地所                | 第120回担保提供制限等財務上特約無 | 0.24  | 100,000 | 99,706  | 2027/6/18  |
| 東京建物                | 第25回社債間限定同順位特約付    | 0.52  | 100,000 | 100,334 | 2027/3/19  |
| ダイビル                | 第19回特定社債間限定同順位特約付  | 0.96  | 100,000 | 96,424  | 2039/7/19  |
| 住友不動産               | 第95回社債間限定同順位特約付    | 0.987 | 100,000 | 102,289 | 2024/1/26  |
| 日本ビルファンド投資法人        | 第13回特定投資法人債間限定同順位  | 1.168 | 100,000 | 102,005 | 2023/6/26  |
| 野村不動産オフィスファンド投資法人   | 第7回特定投資法人債間限       | 2.9   | 100,000 | 115,181 | 2028/3/17  |
| 積水ハウス・S1レジデンシャル投資法人 | 第5回特定投資法人債         | 0.871 | 100,000 | 101,695 | 2024/8/30  |
| 東武鉄道                | 第124回社債間限定同順位特約付   | 0.001 | 100,000 | 99,704  | 2023/11/27 |
| 相鉄ホールディングス          | 第32回相模鉄道株式会社保証付    | 0.58  | 200,000 | 202,782 | 2025/1/28  |
| 東京急行電鉄              | 第82回社債間限定同順位特約付    | 1.307 | 100,000 | 109,243 | 2033/6/3   |
| 東京急行電鉄              | 第83回社債間限定同順位特約付    | 0.459 | 200,000 | 202,214 | 2031/4/22  |
| 小田急電鉄               | 第68回社債間限定同順位特約付    | 1.098 | 200,000 | 214,224 | 2030/6/12  |
| 小田急電鉄               | 第74回社債間限定同順位特約付    | 0.756 | 100,000 | 101,619 | 2037/5/29  |
| 東日本旅客鉄道             | 第57回社債間限定同順位特約付    | 2.376 | 200,000 | 232,586 | 2028/12/12 |
| 東日本旅客鉄道             | 第71回社債間限定同順位特約付    | 1.905 | 100,000 | 115,196 | 2030/9/27  |
| 東日本旅客鉄道             | 第106回社債間限定同順位特約付   | 0.981 | 100,000 | 106,415 | 2035/1/29  |
| 東日本旅客鉄道             | 第107回社債間限定同順位特約付   | 1.415 | 100,000 | 113,425 | 2045/1/27  |
| 東日本旅客鉄道             | 第133回社債間限定同順位特約付   | 1.246 | 100,000 | 108,180 | 2058/9/27  |
| 東日本旅客鉄道             | 第145回社債間限定同順位特約付   | 0.771 | 200,000 | 186,832 | 2059/12/23 |
| 西日本旅客鉄道             | 第13回社債間限定同順位特約付    | 2.34  | 100,000 | 112,689 | 2027/2/19  |
| 西日本旅客鉄道             | 第15回社債間限定同順位特約付    | 2.26  | 300,000 | 341,229 | 2027/12/20 |
| 西日本旅客鉄道             | 第65回社債間限定同順位特約付    | 0.24  | 200,000 | 199,630 | 2030/8/27  |
| 西日本旅客鉄道             | 第66回社債間限定同順位特約付    | 0.629 | 200,000 | 200,138 | 2040/8/27  |
| 東海旅客鉄道              | 第17回社債間限定同順位特約付    | 2.21  | 200,000 | 214,864 | 2024/9/20  |
| 東海旅客鉄道              | 第51回社債間限定同順位特約付    | 2.212 | 200,000 | 234,580 | 2030/4/23  |
| 東海旅客鉄道              | 第70回社債間限定同順位特約付    | 1.309 | 100,000 | 110,048 | 2032/9/30  |
| 東海旅客鉄道              | 第73回社債間限定同順位特約付    | 1.014 | 300,000 | 320,313 | 2035/1/26  |
| 東海旅客鉄道              | 第74回社債間限定同順位特約付    | 1.685 | 100,000 | 118,970 | 2045/3/6   |
| 東京地下鉄               | 第22回               | 0.215 | 100,000 | 100,246 | 2027/6/21  |
| 東京地下鉄               | 第23回               | 0.661 | 100,000 | 101,343 | 2037/6/19  |
| 東京地下鉄               | 第24回               | 1.035 | 100,000 | 104,952 | 2047/6/21  |
| 西武ホールディングス          | 第1回社債間限定同順位特約付     | 0.758 | 200,000 | 199,832 | 2032/3/17  |
| 西日本鉄道               | 第45回社債間限定同順位特約付    | 0.717 | 100,000 | 102,733 | 2031/3/4   |
| 阪急阪神ホールディングス        | 第47回               | 1.202 | 400,000 | 429,672 | 2029/7/18  |
| 阪急阪神ホールディングス        | 第49回               | 0.817 | 100,000 | 102,600 | 2036/12/15 |
| 名古屋鉄道               | 第50回社債間限定同順位特約付    | 0.857 | 100,000 | 103,558 | 2027/4/30  |
| 日本通運                | 第11回社債間限定同順位特約付    | 0.2   | 100,000 | 99,683  | 2026/7/14  |
| 日本通運                | 第12回社債間限定同順位特約付    | 0.7   | 100,000 | 99,040  | 2036/7/14  |
| 日本郵船                | 第32回社債間限定同順位特約付    | 2.13  | 100,000 | 105,775 | 2031/9/9   |
| 横浜高速鉄道              | 第2回社債間限定同順位特約付     | 0.455 | 100,000 | 100,535 | 2027/2/23  |
| 九州旅客鉄道              | 第2回社債間限定同順位特約付     | 0.929 | 200,000 | 200,880 | 2049/3/5   |
| 九州旅客鉄道              | 第4回社債間限定同順位特約付     | 0.51  | 100,000 | 96,896  | 2039/12/9  |
| ANAホールディングス         | 第32回社債間限定同順位特約付    | 0.99  | 100,000 | 91,129  | 2036/6/9   |
| 滋賀倉庫                | 第8回社債間限定同順位特約付     | 0.22  | 100,000 | 99,462  | 2023/6/14  |
| KDDI                | 第20回社債間限定同順位特約付    | 0.803 | 100,000 | 101,805 | 2023/12/20 |
| KDDI                | 第25回社債間限定同順位特約付    | 0.395 | 100,000 | 99,991  | 2028/11/22 |
| 電源開発                | 第39回社債間限定同順位特約付    | 0.929 | 100,000 | 102,486 | 2024/2/20  |
| 電源開発                | 第40回社債間限定同順位特約付    | 0.889 | 100,000 | 102,622 | 2024/6/20  |

| 銘柄                              | 利     | 当期          |             |            | 償還年月日 |
|---------------------------------|-------|-------------|-------------|------------|-------|
|                                 |       | 率           | 額面金額        | 評価額        |       |
| 普通社債券(含む投資法人債券)                 | %     | 千円          | 千円          |            |       |
| 電源開発 第41回社債間限定同順位特約付            | 0.782 | 100,000     | 102,361     | 2024/8/20  |       |
| 電源開発 第50回社債間限定同順位特約付            | 0.415 | 100,000     | 101,097     | 2027/7/20  |       |
| 電源開発 第59回社債間限定同順位特約付            | 0.414 | 100,000     | 100,827     | 2028/9/20  |       |
| 東京瓦斯 第38回社債間限定同順位特約付            | 1.984 | 100,000     | 124,669     | 2043/12/17 |       |
| 東京瓦斯 第55回社債間限定同順位特約付            | 0.28  | 100,000     | 94,282      | 2039/9/13  |       |
| 大阪瓦斯 第36回社債間限定同順位特約付            | 0.642 | 100,000     | 94,603      | 2049/6/4   |       |
| 北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付           | 0.25  | 100,000     | 100,344     | 2024/3/14  |       |
| 北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付           | 0.51  | 100,000     | 98,068      | 2034/12/12 |       |
| 広島ガス 第13回社債間限定同順位特約付            | 0.405 | 100,000     | 100,357     | 2028/9/13  |       |
| 東京都競馬 第3回社債間限定同順位特約付            | 0.18  | 100,000     | 99,895      | 2023/7/5   |       |
| ファーストリテイリング 第7回特定社債間限定同順位特約付    | 0.405 | 100,000     | 101,056     | 2028/6/6   |       |
| ソフトバンクグループ 第54回社債間限定同順位特約付      | 1.569 | 100,000     | 100,924     | 2024/6/12  |       |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第29回円貨社債     | 0.25  | 200,000     | 199,406     | 2024/10/10 |       |
| フランス相互信用連合銀行(BFCM) 第31回円貨社債     | 0.423 | 100,000     | 98,904      | 2029/10/10 |       |
| ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債      | 0.45  | 100,000     | 100,186     | 2026/6/17  |       |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債(2014)  | 0.865 | 100,000     | 102,127     | 2024/11/28 |       |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第15回円貨社債(2018) | 0.204 | 100,000     | 99,739      | 2023/6/8   |       |
| クレディ・アグリコル・エス・エー 第16回円貨社債(2018) | 0.509 | 100,000     | 99,453      | 2028/6/8   |       |
| スタンダード・チャータード 第3回円貨社債(2015)     | 1.043 | 100,000     | 100,595     | 2025/6/5   |       |
| エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第2回円  | 0.842 | 100,000     | 100,728     | 2023/9/26  |       |
| エイチエスピーシー・ホールディングス・ピーエルシー 第3回円  | 1.207 | 100,000     | 100,978     | 2026/9/25  |       |
| ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第6回円貨社債   | 0.65  | 100,000     | 100,381     | 2023/5/30  |       |
| ロイズ・バンキング・グループ・ピーエルシー 第7回円貨社債   | 0.968 | 100,000     | 99,262      | 2028/5/30  |       |
| サンタンデール銀行 第1回円貨社債               | 0.568 | 100,000     | 99,990      | 2023/1/11  |       |
| フランス電力 第4回円貨社債(2017)            | 1.088 | 100,000     | 102,314     | 2027/1/26  |       |
| 現代キャピタル・サービス・インク 第15回円貨社債       | 0.65  | 200,000     | 196,070     | 2023/8/2   |       |
| ビー・エヌ・ピー・パリバ 第1回円貨社債(2017)      | 0.967 | 100,000     | 100,823     | 2024/3/1   |       |
| ウエストバック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社  | 0.32  | 200,000     | 199,848     | 2023/7/6   |       |
| オーストラリア・ニュージーランド銀行 第10回円貨社債     | 0.293 | 200,000     | 200,264     | 2024/1/23  |       |
| ソシエテ・ジェネラル 第1回非上位円貨社債(2017)     | 0.448 | 100,000     | 99,983      | 2022/5/26  |       |
| 小計                              |       | 27,305,000  | 27,858,685  |            |       |
| 合計                              |       | 688,944,026 | 732,440,992 |            |       |

\*額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内債券NOMURA-BPI総合マザーファンド

## ○損益の状況 (2020年4月1日~2021年3月31日)

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

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

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

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