

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4期 (決算日 2023年9月11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、2023年9月11日に第4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。 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番3号

<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 (分配落)	価 額			投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金 期 騰 落 中 率		
(設定日) 2020年6月19日	円 10,000			円 —	% —	百万円 0.1
1期(2020年9月10日)	10,337			0	96.4	3,408
2期(2021年9月10日)	12,015			0	96.8	6,392
3期(2022年9月12日)	13,068			0	97.3	8,335
4期(2023年9月11日)	12,323			0	96.7	6,685

(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

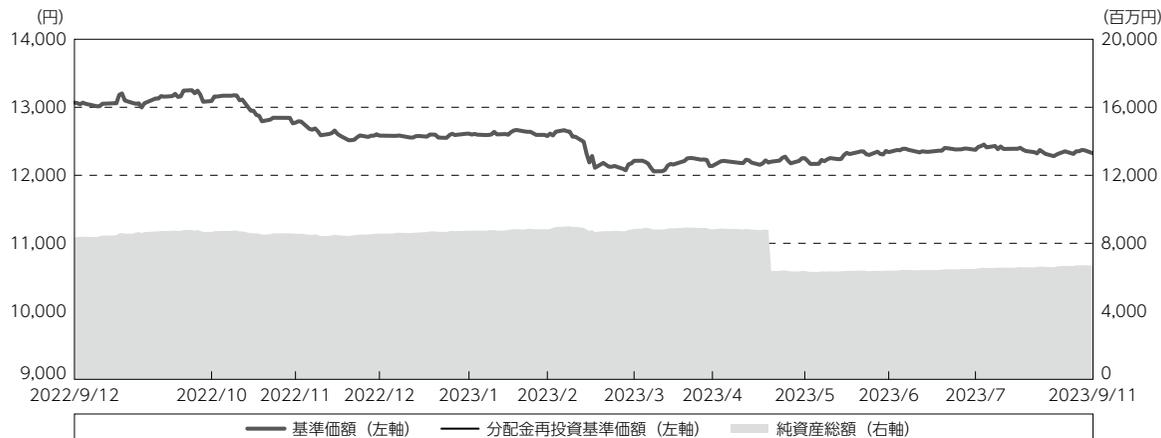
年 月 日	基 準	価 額		投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首) 2022年9月12日	円 13,068		% —	% 97.3
9月末	13,100		0.2	96.0
10月末	13,092		0.2	96.7
11月末	12,774		△2.2	96.3
12月末	12,583		△3.7	97.0
2023年1月末	12,612		△3.5	96.5
2月末	12,577		△3.8	96.7
3月末	12,213		△6.5	96.3
4月末	12,138		△7.1	97.4
5月末	12,251		△6.3	97.5
6月末	12,340		△5.6	98.0
7月末	12,374		△5.3	96.8
8月末	12,337		△5.6	97.2
(期 末) 2023年9月11日	12,323		△5.7	96.7

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2022年9月13日～2023年9月11日）

期中の基準価額等の推移



期 首：13,068円

期 末：12,323円(既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 5.7%(分配金再投資ベース)

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

(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（2022年9月12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（2022年9月13日～2023年9月11日）-5.70%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下落したため、当ファンドにマイナスの寄与となりました。

投資環境

2022年は市場環境に大きなレジーム・シフトが起き、その変化はインフレ率の上昇、金融緩和、財政支出、地政学的混乱に顕著に表れました。MSCIワールド・インデックスは約18%下落し、ブルームバーグ・グローバル総合債券インデックスは約16%下落しました。FRB（米国連邦準備制度理事会）は金利を引き上げ、2年物国債利回りを約0.7%から4.0%台に押し上げました。市場ではインフレヘッジとして、金や不動産といった伝統的な資産のほか、国債や特定の通貨のショート・ポジションなども注目されました。

2023年初頭のコンセンサス・ビューでは、インフレはピークに達し、中央銀行は今後数四半期内に利下げを開始するだろうというものでした。しかし、政府支出、脱グローバルイゼーション、地政学的緊張、社会不安など、不確実性は依然として残存しました。市場では、FRBの利上げをめぐる議論のほか、シリコンバレー銀行の破綻やクレディ・スイスの経営不振など想定外の出来事が注目され、中央銀行は緊急支援でそうした金融システム危機に対処しました。足元までに市場は銀行危機、米国債懸念、株式市場の乱高下など、一連の経済的課題に見舞われ、ヘッジファンドを含む多くの投資家にとって困難な時期となりました。マクロ経済の動向を見極め、その後の市場の反応を正しく予測することの複雑さが明らかになり、さまざまな戦略の結果はまちまちでした。総じて、投資におけるリスク管理と長期的視野の重要性を再認識する期間となりました。

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になります。

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）

当期ヘッジファンド・ポートフォリオはドルベースで約+4.2%のリターンとなりました。

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・バリュー、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。

2022年から2023年にかけて、当ポートフォリオはバリュー偏重の保守的なスタンスを維持し、過去のポジショニングと比較して株式のアンダーウエイトを維持しました。当戦略は、主に米ドルのロングポジションを通じたインフレヘッジを採用し、リスクを軽減しました。2022年には、上半期の株式リスクの削減とインフレヘッジにより、良好なパフォーマンスを達成しました。2023年には、より割安でバリュー志向の市場を選好する保守的なポジショニングを継続しました。2023年の当ポートフォリオの利益は、主に株式への配分によるものでしたが、保守的なアプローチとバリュー・バイアスにより、MSCIワールド・インデックスと比較したパフォーマンスは限定的となりました。2023年第3四半期、当ポートフォリオは単一銘柄を避け、指数先物のみを利用するという構造的な決定によってMSCIワールド・インデックス対比で良好なパフォーマンスを達成しました。当社の分散アプローチは幅広い株式の上昇と米国30年債のヘッジを通じた金利上昇から恩恵を受けました。

CTAポートフォリオ（DBiポートフォリオの約40%を構成）

当期CTAポートフォリオはドルベースで約-6.6%のリターンとなりました。

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。

2022年、ポートフォリオは主に日本円と米国債のショート・ポジションから利益を得ました。株式のエクスポージャーは年間を通じて厳しいものでした。商品ポジションは、原油の利益が金の損失を相殺し、プラス寄与となりました。当ポートフォリオは「暴落抑制」モードを維持し、株式のショート・ポジション、対円での米ドル・ショート・ポジション、対ユーロでのロングポジション（ただしポジションは削減）、金のショート・ポジション、原油のフラット・ポジション、米国債のショート・ポジションを維持しました。2023年には、市場はインフレ懸念と先行きへの自信の間で揺れ動き、投資環境は変化の激しいものとなりました。3月の金融システム危機で相場が急反転し、CTAポートフォリオも下落に転じました。第3四半期においては、金利のショート・ポジションと金のポジションで収益を上げましたが、株式とユーロのポジションで一部相殺されました。当ポートフォリオの現在のポジションは、金利上昇、米国株の世界市場に対するアウトパフォーマンス、円に対するユーロ高の予想を反映したものとなっています。

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4期
	2022年9月13日～ 2023年9月11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	2,323

（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

（2022年 9 月13日～2023年 9 月11日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	82	0.658	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(76)	(0.603)	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	8	0.062	(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)	(0.052)	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	90	0.720	
期中の平均基準価額は、12,532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。

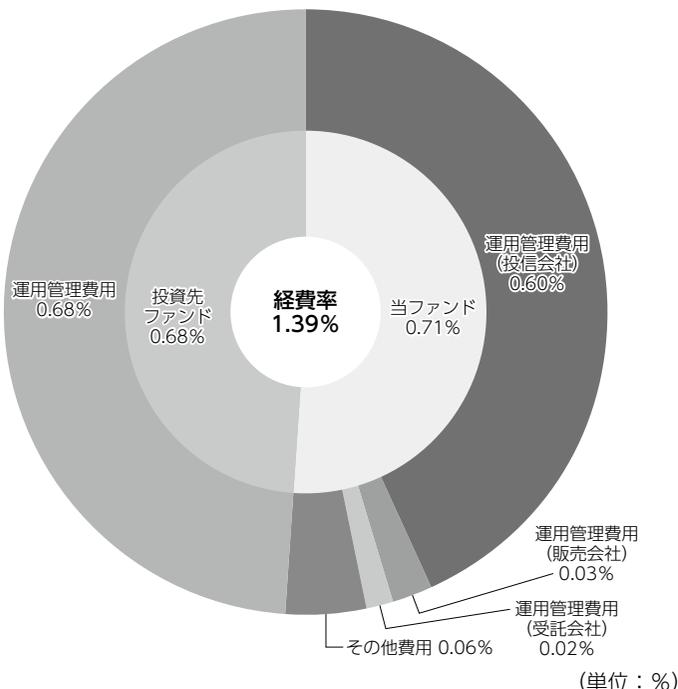
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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、項目ごとに小数点以下第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1.39%です。



経費率 (①+②)	1.39
①当ファンドの費用の比率	0.71
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

(2022年9月13日～2023年9月11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	10,051	1,300,000	19,612	2,460,000

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2022年9月13日～2023年9月11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

(2022年9月13日～2023年9月11日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2023年9月11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
NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI 総合連動型上場投信	30	30	27	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	60,421	50,860	6,467,403	96.7
合 計	60,451	50,890	6,467,430	96.7

(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

(2023年9月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	6,467,430	96.1
コール・ローン等、その他	264,459	3.9
投資信託財産総額	6,731,889	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（2023年9月11日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	6,731,889,272
コール・ローン等	264,458,265
投資信託受益証券(評価額)	6,467,430,917
未取配当金	90
(B) 負債	45,943,027
未払解約金	19,631,817
未払信託報酬	24,148,320
その他未払費用	2,162,890
(C) 純資産総額(A-B)	6,685,946,245
元本	5,425,549,505
次期繰越損益金	1,260,396,740
(D) 受益権総口数	5,425,549,505口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,323円

(注) 当ファンドの期首元本額は6,378,237,727円、期中追加設定元本額は2,027,451,287円、期中一部解約元本額は2,980,139,509円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,2323円です。

○損益の状況（2022年9月13日～2023年9月11日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	24,641
受取配当金	171
その他収益金	24,470
(B) 有価証券売買損益	△ 271,086,765
売買益	183,706,545
売買損	△ 454,793,310
(C) 信託報酬等	△ 57,575,682
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 328,637,806
(E) 前期繰越損益金	683,333,875
(F) 追加信託差損益金	905,700,671
(配当等相当額)	(529,600,572)
(売買損益相当額)	(376,100,099)
(G) 計(D+E+F)	1,260,396,740
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,260,396,740
追加信託差損益金	905,700,671
(配当等相当額)	(529,600,572)
(売買損益相当額)	(376,100,099)
分配準備積立金	683,333,875
繰越損益金	△ 328,637,806

(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(0円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(577,062,865円)および分配準備積立金(683,333,875円)より分配対象収益は1,260,396,740円(1万口当たり2,323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。

<DBi リキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッド> (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）の公表する区分に基づき、HFR、ユーリカヘッジ社を含む情報提供会社が提供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 原則として対円での為替ヘッジを行い、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	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。 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。
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

(2023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(%)			
		ロング/ショート	グロス	ネット	グロス	ネット	
通貨	Long		3,251,700.00	3,251,700.00	4.24%	4.24%	
	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	06/16/2023	Long	3,251,700.00	3,251,700.00	4.24%	4.24%
	小計			3,251,700.00	3,251,700.00	4.24%	4.24%
通貨			Short	4,616,412.50	(4,616,412.50)	6.02%	(6.02)%
	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(%)
	JAPANESE YEN CME	06/16/2023	Short	4,616,412.50	(4,616,412.50)	6.02%	(6.02)%
	小計			4,616,412.50	(4,616,412.50)	6.02%	(6.02)%
エネルギー			Short	1,137,000.00	(1,137,000.00)	1.48%	(1.48)%
	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	05/22/2023	Short	1,137,000.00	(1,137,000.00)	1.48%	(1.48)%
	小計			1,137,000.00	(1,137,000.00)	1.48%	(1.48)%
金融			Long	4,110,175.00	4,110,175.00	5.36%	5.36%
	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(%)
	THREE-MONTH SOFR	12/17/2024	Long	4,110,175.00	4,110,175.00	5.36%	5.36%
	小計			4,110,175.00	4,110,175.00	5.36%	5.36%
金融			Short	58,193,568.75	(58,193,568.75)	75.85%	(75.85)%
	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	06/30/2023	Short	15,277,531.25	(15,277,531.25)	19.91%	(19.91)%
	THREE-MONTH SOFR	12/17/2024	Short	15,473,600.00	(15,473,600.00)	20.17%	(20.17)%
	ULTRA T-BOND	06/21/2023	Short	5,362,750.00	(5,362,750.00)	6.99%	(6.99)%
	ULTRA T-NOTE	06/21/2023	Short	5,087,906.25	(5,087,906.25)	6.63%	(6.63)%
	US 10 YR NOTES	06/21/2023	Short	5,056,562.50	(5,056,562.50)	6.59%	(6.59)%
	US T. BOND	06/21/2023	Short	11,935,218.75	(11,935,218.75)	15.56%	(15.56)%
	小計			58,193,568.75	(58,193,568.75)	75.85%	(75.85)%
インデックス			Long	22,026,333.00	22,026,333.00	28.71%	28.71%
	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	06/30/2023	Long	2,350,278.00	2,350,278.00	3.06%	3.06%
	E MINI RUSSELL	06/16/2023	Long	2,176,200.00	2,176,200.00	2.84%	2.84%
	EMINI MSCI EAFE	06/16/2023	Long	10,587,325.00	10,587,325.00	13.80%	13.80%
	EMINI MSCI EM	06/16/2023	Long	2,040,775.00	2,040,775.00	2.66%	2.66%
	EMINI NASDAQ	06/16/2023	Long	1,330,175.00	1,330,175.00	1.73%	1.73%
	MINI MIDCA	06/16/2023	Long	3,541,580.00	3,541,580.00	4.62%	4.62%
	小計			22,026,333.00	22,026,333.00	28.71%	28.71%
インデックス			Short	4,507,850.00	(4,507,850.00)	5.88%	(5.88)%
	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 EM	06/16/2023	Short	2,438,975.00	(2,438,975.00)	3.18%	(3.18)%
	EMINI S&P	06/16/2023	Short	2,068,875.00	(2,068,875.00)	2.70%	(2.70)%
	小計			4,507,850.00	(4,507,850.00)	5.88%	(5.88)%
貴金属			Long	3,575,160.00	3,575,160.00	4.66%	4.66%
	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	06/28/2023	Long	3,575,160.00	3,575,160.00	4.66%	4.66%
	小計			3,575,160.00	3,575,160.00	4.66%	4.66%
総合計				101,418,199.25	(35,491,463.25)	132.19%	(46.26)%

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

(2023年3月31日現在)

資産

投資有価証券の公正価額（取得原価 \$ 61,625,451）	\$	62,540,923
デリバティブ契約の公正価額		2,648,893
現金及び現金相当		3,086,180
ブローカーからの未収金		9,719,398
その他資産		22,188

資産合計

78,017,582

負債

負債

デリバティブ契約の公正価額	\$	1,235,919
未払いマネジメントフィー		42,062
未払い費用		20,725

負債合計

1,298,706

純資産

\$ 76,718,876

◎損益計算書

2022年4月1日から2023年3月31日までの期間

投資収入

金利	\$ 882,725
----	------------

支出

マネジメントフィー	(468,193)
-----------	-----------

管理費用	(29,477)
------	----------

取締役報酬	(24,963)
-------	----------

利息	(14,060)
----	----------

プロフェッショナルフィー他	(220,990)
---------------	-----------

支出合計	(757,683)
------	-----------

投資マネージャーが負担する支出	111,473
-----------------	---------

純支出	(646,210)
-----	-----------

純投資収益

236,515

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 \$ 143,482を控除）	(9,396,979)
---------------------------------------	-------------

デリバティブ契約にかかる純含み変動額	1,773,713
--------------------	-----------

投資有価証券にかかる純含み変動額	915,472
------------------	---------

デリバティブ契約にかかる純損失

(6,707,794)

オペレーションの結果による純資産減少額

\$ (6,471,279)

<NEXT FUNDS 国内債券・NOMURA-BPI総合連動型上場投信>

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(2023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(2023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	46,859,889,341	59,324,619,905	
	小計	銘柄数:1 組入時価比率:99.9%	46,859,889,341	59,324,619,905 100.0%	
合計				59,324,619,905	

(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10期	第11期
	自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 7日	自 2022年 9月 8日 至 2023年 3月 7日
営業収益		
有価証券売買等損益	△1,106,069,872	△972,817,271
営業収益合計	△1,106,069,872	△972,817,271
営業費用		
支払利息	1,908	10,323
受託者報酬	5,890,810	6,365,723
委託者報酬	14,726,951	15,914,251
その他費用	5,663,980	6,986,542
営業費用合計	26,283,649	29,276,839
営業利益又は営業損失(△)	△1,132,353,521	△1,002,094,110
経常利益又は経常損失(△)	△1,132,353,521	△1,002,094,110
当期純利益又は当期純損失(△)	△1,132,353,521	△1,002,094,110
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(△)	△862,200,186	△2,616,772,507
剰余金増加額又は欠損金減少額	17,548,900	1,083,014,400
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	17,548,900	1,083,014,400
剰余金減少額又は欠損金増加額	479,867,700	1,297,195,100
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	479,867,700	1,297,195,100
分配金	159,900,000	171,072,000
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△2,616,772,507	△4,004,119,317

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第10期 自 2022年 3月 8日 至 2022年 9月 7日			第11期 自 2022年 9月 8日 至 2023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	△1,908 円	当期配当等収益額	A	△10,323 円
親ファンドの配当等収益額	B	187,366,220 円	親ファンドの配当等収益額	B	204,763,336 円
分配準備積立金	C	88,107 円	分配準備積立金	C	1,270,678 円
配当等収益合計額	D=A+B+C	187,452,419 円	配当等収益合計額	D=A+B+C	206,023,691 円
経費	E	26,281,741 円	経費	E	29,266,516 円
収益分配可能額	F=D-E	161,170,678 円	収益分配可能額	F=D-E	176,757,175 円
収益分配金	G	159,900,000 円	収益分配金	G	171,072,000 円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,270,678 円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	5,685,175 円
口数	I	61,500,000 口	口数	I	63,360,000 口
100 口当たり分配金	J=G/I×100	260 円	100 口当たり分配金	J=G/I×100	270 円
2. その他費用			2. その他費用		
その他費用のうち 2,118,079 円は上場に係る費用、 2,956,837 円は対象指数についての商標使用料であります。			その他費用のうち 3,167,171 円は上場に係る費用、 3,182,806 円は対象指数についての商標使用料であります。		

◎組入資産の明細

(2022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
		%	千 円	千 円	
国債証券					
国庫債券	利付(2年)第424回	0.005	2,600,000	2,602,106	2023/5/1
国庫債券	利付(2年)第426回	0.005	1,500,000	1,501,395	2023/7/1
国庫債券	利付(2年)第427回	0.005	6,800,000	6,806,324	2023/8/1
国庫債券	利付(2年)第428回	0.005	2,400,000	2,402,208	2023/9/1
国庫債券	利付(2年)第429回	0.005	1,500,000	1,501,455	2023/10/1
国庫債券	利付(2年)第431回	0.005	3,000,000	3,003,000	2023/12/1
国庫債券	利付(2年)第433回	0.005	3,500,000	3,503,185	2024/2/1
国庫債券	利付(5年)第136回	0.1	4,300,000	4,308,901	2023/6/20
国庫債券	利付(5年)第137回	0.1	6,600,000	6,615,510	2023/9/20
国庫債券	利付(5年)第138回	0.1	7,100,000	7,118,318	2023/12/20
国庫債券	利付(5年)第139回	0.1	6,700,000	6,718,425	2024/3/20
国庫債券	利付(5年)第140回	0.1	5,100,000	5,115,810	2024/6/20
国庫債券	利付(5年)第141回	0.1	9,600,000	9,631,968	2024/9/20
国庫債券	利付(5年)第142回	0.1	1,200,000	1,204,404	2024/12/20
国庫債券	利付(5年)第143回	0.1	6,070,000	6,094,280	2025/3/20
国庫債券	利付(5年)第144回	0.1	4,400,000	4,418,392	2025/6/20
国庫債券	利付(5年)第145回	0.1	3,900,000	3,916,224	2025/9/20
国庫債券	利付(5年)第146回	0.1	2,100,000	2,108,988	2025/12/20
国庫債券	利付(5年)第147回	0.005	5,600,000	5,602,184	2026/3/20
国庫債券	利付(5年)第148回	0.005	7,300,000	7,300,000	2026/6/20
国庫債券	利付(5年)第149回	0.005	7,100,000	7,096,805	2026/9/20
国庫債券	利付(5年)第150回	0.005	4,000,000	3,996,200	2026/12/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	2,860,000	3,894,090	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	900,000	1,183,419	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	900,000	1,190,673	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,630,000	2,169,204	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	1,200,000	1,542,480	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	1,300,000	1,646,723	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	1,400,000	1,705,550	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	1,500,000	1,705,845	2055/3/20
国庫債券	利付(40年)第9回	0.4	3,550,000	3,013,737	2056/3/20
国庫債券	利付(40年)第10回	0.9	2,010,000	1,996,713	2057/3/20
国庫債券	利付(40年)第11回	0.8	1,750,000	1,684,130	2058/3/20
国庫債券	利付(40年)第12回	0.5	2,070,000	1,793,075	2059/3/20
国庫債券	利付(40年)第13回	0.5	7,020,000	6,054,048	2060/3/20
国庫債券	利付(40年)第14回	0.7	4,460,000	4,113,636	2061/3/20
国庫債券	利付(10年)第329回	0.8	6,000,000	6,063,660	2023/6/20
国庫債券	利付(10年)第330回	0.8	3,800,000	3,848,108	2023/9/20
国庫債券	利付(10年)第331回	0.6	1,900,000	1,918,449	2023/9/20
国庫債券	利付(10年)第332回	0.6	5,900,000	5,966,021	2023/12/20
国庫債券	利付(10年)第333回	0.6	3,600,000	3,645,324	2024/3/20
国庫債券	利付(10年)第334回	0.6	6,600,000	6,693,786	2024/6/20
国庫債券	利付(10年)第335回	0.5	4,600,000	4,660,858	2024/9/20
国庫債券	利付(10年)第336回	0.5	2,750,000	2,790,040	2024/12/20
国庫債券	利付(10年)第337回	0.3	3,000,000	3,027,360	2024/12/20
国庫債券	利付(10年)第338回	0.4	9,000,000	9,116,280	2025/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (10年) 第339回	0.4	5,000,000	5,069,250	2025/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第340回	0.4	2,700,000	2,739,366	2025/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第341回	0.3	5,800,000	5,867,976	2025/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第342回	0.1	6,550,000	6,577,248	2026/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第343回	0.1	9,500,000	9,538,000	2026/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第344回	0.1	6,400,000	6,424,256	2026/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第345回	0.1	7,000,000	7,024,710	2026/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第346回	0.1	5,100,000	5,117,697	2027/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第347回	0.1	5,400,000	5,416,848	2027/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第348回	0.1	5,800,000	5,817,400	2027/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第349回	0.1	2,800,000	2,807,168	2027/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第350回	0.1	10,150,000	10,171,112	2028/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第351回	0.1	6,000,000	6,009,240	2028/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第352回	0.1	6,400,000	6,406,144	2028/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第353回	0.1	1,200,000	1,200,396	2028/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第354回	0.1	1,850,000	1,850,000	2029/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第355回	0.1	2,600,000	2,597,192	2029/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第356回	0.1	4,800,000	4,791,072	2029/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第357回	0.1	1,900,000	1,894,908	2029/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第358回	0.1	5,470,000	5,450,581	2030/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第359回	0.1	10,600,000	10,552,618	2030/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第360回	0.1	10,900,000	10,840,704	2030/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第361回	0.1	7,400,000	7,352,270	2030/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第362回	0.1	8,500,000	8,436,250	2031/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第363回	0.1	10,450,000	10,360,025	2031/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第364回	0.1	8,650,000	8,565,576	2031/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第365回	0.1	7,500,000	7,421,400	2031/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第1回	2.8	500,000	599,445	2029/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第2回	2.4	500,000	588,645	2030/2/20
国庫債券	利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	187,795	2030/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第4回	2.9	1,400,000	1,727,572	2030/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	177,307	2031/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第6回	2.4	600,000	725,502	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	724,794	2032/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	116,311	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年) 第9回	1.4	265,000	297,125	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	272,682	2033/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第11回	1.7	160,000	185,216	2033/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第12回	2.1	220,000	265,089	2033/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	290,000	346,799	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	996,376	2034/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	900,000	1,135,386	2034/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	915,000	1,156,990	2034/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,200,000	1,506,924	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	2,200,000	2,740,628	2035/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	2,050,000	2,558,297	2035/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,270,000	1,622,310	2035/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	300,000	376,092	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	770,238	2036/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	1,080,231	2036/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	902,321	2036/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	631,625	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,088,527	2037/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	3,550,000	4,612,621	2037/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	1,200,000	1,565,292	2038/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	1,500,000	1,939,605	2038/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	1,700,000	2,175,184	2039/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,200,000	1,519,224	2039/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	1,200,000	1,542,108	2040/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,400,000	2,963,640	2040/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	3,300,000	4,199,118	2041/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	2,851,425	2041/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	2,000,000	2,485,960	2042/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,821,962	2042/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,600,000	1,935,936	2043/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,400,000	1,723,106	2043/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,300,000	1,575,743	2043/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,500,000	1,789,545	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,600,000	1,910,080	2044/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,552,954	2044/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,673,462	2044/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,700,000	1,960,831	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,800,000	2,076,696	2045/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,700,000	1,997,602	2045/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,900,000	2,150,762	2045/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	2,900,000	3,282,887	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	1,900,000	1,901,900	2046/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第51回	0.3	2,650,000	2,357,254	2046/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第52回	0.5	1,900,000	1,770,667	2046/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第53回	0.6	1,700,000	1,619,794	2046/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第54回	0.8	1,700,000	1,692,945	2047/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第55回	0.8	1,500,000	1,492,170	2047/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第56回	0.8	1,900,000	1,886,016	2047/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第57回	0.8	1,600,000	1,584,784	2047/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第58回	0.8	2,100,000	2,077,656	2048/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第59回	0.7	1,600,000	1,541,920	2048/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第60回	0.9	1,150,000	1,159,913	2048/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第61回	0.7	1,500,000	1,438,470	2048/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第62回	0.5	1,500,000	1,362,405	2049/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第63回	0.4	1,400,000	1,233,470	2049/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第64回	0.4	1,500,000	1,318,830	2049/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第65回	0.4	2,200,000	1,932,370	2049/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第66回	0.4	2,600,000	2,283,996	2050/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第67回	0.6	1,800,000	1,665,360	2050/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第68回	0.6	1,950,000	1,803,106	2050/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第69回	0.7	2,200,000	2,090,044	2050/12/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (30年) 第70回	0.7	1,610,000	1,527,229	2051/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第71回	0.7	2,400,000	2,275,776	2051/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第72回	0.7	1,300,000	1,230,827	2051/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第73回	0.7	500,000	473,220	2051/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第62回	0.8	440,000	444,668	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第63回	1.8	300,000	306,843	2023/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第64回	1.9	400,000	411,544	2023/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第65回	1.9	455,000	470,274	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第66回	1.8	300,000	309,555	2023/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第67回	1.9	310,000	321,838	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第68回	2.2	290,000	302,786	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第69回	2.1	560,000	583,587	2024/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	569,197	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	209,926	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	1,470,000	1,547,616	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,200,000	1,266,492	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	800,000	846,504	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	638,046	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	962,297	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	742,308	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	849,752	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	916,252	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	1,400,000	1,496,082	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	385,257	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	880,384	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,477,860	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,290,012	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	433,408	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,700,000	1,855,482	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	543,745	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,206,480	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	513,517	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,646,445	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	275,522	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	650,000	713,589	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	300,000	329,310	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第94回	2.1	200,000	220,532	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	100,000	111,770	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	400,000	442,916	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	300,000	335,283	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	300,000	333,645	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	1,100,000	1,228,623	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	820,000	924,336	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	284,782	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	1,500,000	1,716,405	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	682,848	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	450,280	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,147,076	2028/9/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	454,592	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	300,000	340,281	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,793,456	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	1,012,428	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	1,100,000	1,252,647	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	919,752	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,056,536	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	2,000,000	2,294,080	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第114回	2.1	1,700,000	1,956,734	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	1,000,000	1,158,670	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,279,047	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	1,400,000	1,616,832	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	575,335	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	907,536	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	894,544	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	1,200,000	1,375,080	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	900,000	1,023,786	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	500,000	583,170	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,157,750	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	1,400,000	1,651,006	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	1,200,000	1,393,956	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	500,000	576,400	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	800,000	924,784	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	1,300,000	1,490,983	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	1,700,000	1,954,643	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	912,384	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,486,641	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,614,354	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	1,400,000	1,618,106	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	700,000	802,214	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	795,375	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,148,490	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	902,792	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	1,000,000	1,138,490	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	2,300,000	2,647,047	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	2,600,000	2,998,294	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	950,000	1,105,467	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	1,300,000	1,488,123	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	1,300,000	1,474,239	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	2,300,000	2,662,480	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	2,400,000	2,783,400	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	4,000,000	4,599,160	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	2,100,000	2,393,874	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	3,850,000	4,394,544	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	3,330,000	3,763,532	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	2,500,000	2,765,525	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	2,650,000	2,931,218	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	1,600,000	1,790,912	2035/6/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	2,120,000	2,345,780	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	5,350,000	5,778,749	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	4,650,000	4,643,815	2036/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	5,540,000	5,369,257	2036/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	3,470,000	3,500,674	2036/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第159回	0.6	4,810,000	4,912,982	2036/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	3,000,000	3,105,150	2037/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第161回	0.6	2,100,000	2,138,766	2037/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第162回	0.6	1,700,000	1,728,135	2037/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第163回	0.6	2,600,000	2,639,806	2037/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第164回	0.5	2,600,000	2,594,228	2038/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第165回	0.5	2,200,000	2,191,772	2038/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第166回	0.7	2,300,000	2,359,225	2038/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第167回	0.5	2,600,000	2,578,108	2038/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第168回	0.4	2,700,000	2,626,938	2039/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第169回	0.3	3,030,000	2,890,377	2039/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第170回	0.3	2,800,000	2,662,940	2039/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第171回	0.3	2,500,000	2,370,375	2039/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第172回	0.4	3,840,000	3,694,464	2040/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第173回	0.4	3,250,000	3,117,627	2040/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第174回	0.4	3,970,000	3,796,908	2040/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第175回	0.5	5,500,000	5,344,460	2040/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第176回	0.5	6,020,000	5,837,895	2041/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第177回	0.4	5,070,000	4,820,505	2041/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第178回	0.5	3,750,000	3,624,562	2041/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第179回	0.5	3,000,000	2,896,020	2041/12/20
メキシコ合衆国	第19回円貨社債 (2014)	1.44	100,000	101,814	2024/7/24
小 計			642,295,000	667,251,907	
地方債証券					
東京都	公募第731回	0.635	100,000	101,189	2024/3/19
東京都	公募第736回	0.505	100,000	101,136	2024/9/20
東京都	公募第745回	0.533	300,000	304,758	2025/6/20
東京都	公募第760回	0.045	100,000	99,799	2026/9/18
東京都	公募第761回	0.075	100,000	99,933	2026/9/18
東京都	公募第769回	0.21	500,000	502,335	2027/6/18
東京都	公募第778回	0.165	100,000	100,029	2028/3/17
東京都	公募第784回	0.254	200,000	201,012	2028/9/20
東京都	公募第813回	0.179	200,000	198,452	2030/12/20
東京都	公募第822回	0.095	130,000	127,722	2031/9/19
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	129,764	2038/9/17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	254,348	2039/9/20
東京都	公募第1回	1.54	300,000	305,607	2023/6/20
東京都	公募 (20年) 第3回	2.26	200,000	208,768	2024/3/19
東京都	公募第7回	2.16	100,000	107,310	2025/9/19
東京都	公募 (20年) 第13回	2.15	100,000	111,376	2027/12/20
東京都	公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	224,228	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第17回	2.09	200,000	225,290	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第20回	2.09	180,000	204,798	2029/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
東京都 公募第23回	2.12	100,000	115,857	2030/12/20
東京都 公募(20年)第26回	1.74	100,000	114,440	2032/6/18
東京都 公募(20年)第29回	1.57	200,000	227,310	2033/9/20
東京都 公募(5年)第31回	0.005	300,000	299,760	2024/6/20
東京都 公募(5年)第32回	0.02	300,000	299,757	2025/6/20
北海道 公募平成26年度第13回	0.461	100,000	101,168	2024/12/26
北海道 公募平成27年度第7回	0.529	100,000	101,647	2025/8/28
北海道 公募平成29年度第5回	0.18	200,000	200,572	2027/6/30
北海道 公募平成29年度第7回	0.21	100,000	100,322	2027/8/31
北海道 公募平成29年度第9回	0.205	100,000	100,304	2027/10/27
北海道 公募平成30年度第15回	0.291	253,920	252,970	2038/9/24
北海道 公募平成30年度第18回	0.146	200,000	199,186	2029/2/28
北海道 公募令和2年度第4回	0.165	300,000	297,705	2030/6/26
宮城県 公募第31回1号	0.515	300,000	304,815	2025/9/29
宮城県 公募第32回2号	0.105	100,000	100,067	2026/9/28
神奈川県 公募第200回	0.825	100,000	101,184	2023/9/20
神奈川県 公募第205回	0.664	100,000	101,246	2024/3/19
神奈川県 公募第206回	0.654	100,000	101,360	2024/6/20
神奈川県 公募第208回	0.551	100,000	101,132	2024/6/20
神奈川県 公募第210回	0.451	200,000	202,238	2024/12/20
神奈川県 公募第212回	0.42	100,000	101,140	2025/3/19
神奈川県 公募第231回	0.22	200,000	200,736	2027/12/20
神奈川県 公募第243回	0.075	200,000	197,650	2029/12/20
神奈川県 公募第247回	0.12	200,000	197,908	2030/6/20
神奈川県 公募(30年)第3回	2.62	100,000	129,973	2037/3/19
神奈川県 公募第7回	2.22	300,000	331,584	2027/3/19
神奈川県 公募(20年)第14回	1.969	100,000	114,019	2030/7/19
神奈川県 公募(20年)第17回	1.975	200,000	231,072	2031/7/11
神奈川県 公募(20年)第26回	1.477	100,000	112,954	2034/6/20
大阪府 公募第378回	0.7	104,000	105,182	2023/11/28
大阪府 公募第381回	0.683	100,000	101,260	2024/2/27
大阪府 公募第382回	0.674	100,000	101,281	2024/3/28
大阪府 公募第383回	0.695	100,000	101,375	2024/4/26
大阪府 公募第384回	0.67	100,000	101,380	2024/5/29
大阪府 公募第387回	0.521	300,000	303,510	2024/8/28
大阪府 公募第389回	0.53	100,000	101,270	2024/10/30
大阪府 公募第396回	0.554	200,000	203,274	2025/5/28
大阪府 公募第417回	0.248	102,000	102,781	2027/2/26
大阪府 公募第423回	0.185	100,000	100,188	2027/8/30
大阪府 公募第429回	0.197	179,000	179,282	2028/2/25
大阪府 公募第452回	0.062	100,000	98,557	2030/1/30
大阪府 公募第467回	0.164	140,000	138,475	2031/4/28
大阪府 公募第469回	0.128	150,000	147,747	2031/6/27
大阪府 公募第5回	2.16	100,000	115,310	2030/5/28
大阪府 公募第8回	1.83	100,000	114,676	2031/12/22
大阪府 公募(5年)第173回	0.001	200,000	199,740	2025/7/30
大阪府 公募(5年)第174回	0.001	200,000	199,700	2025/8/28
大阪府 公募(5年)第178回	0.001	400,000	399,176	2025/12/25

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
大阪府 公募 (5年) 第184回	0.001	400,000	398,744	2026/6/29
大阪府 公募 (5年) 第190回	0.001	200,000	199,116	2026/12/25
京都府 公募平成25年度第15回	0.66	200,000	202,476	2024/3/19
京都府 公募平成26年度第5回	1.455	100,000	112,696	2034/8/10
京都府 公募平成26年度第7回	0.564	200,000	202,586	2024/9/19
京都府 公募 (20年) 平成27年度第5回	1.23	200,000	220,254	2035/8/17
京都府 公募 (15年) 平成27年度第8回	0.78	100,000	104,295	2030/10/11
京都府 公募 (15年) 平成28年度第2回	0.21	200,000	198,820	2031/4/22
京都府 公募 (20年) 平成28年度第5回	0.327	100,000	97,623	2036/8/15
京都府 公募平成29年度第4回	0.19	100,000	100,337	2027/6/21
兵庫県 公募平成26年度第17回	0.46	100,000	101,231	2025/2/26
兵庫県 公募平成29年度第22回	0.19	100,000	100,201	2028/1/21
兵庫県 公募 (30年) 第2回	2.36	200,000	256,522	2040/3/19
兵庫県 公募 (15年) 第1回	1.66	300,000	320,442	2026/7/29
兵庫県 公募 (15年) 第3回	1.35	200,000	212,878	2027/7/16
兵庫県 公募 (12年) 第3回	0.56	300,000	304,740	2025/4/16
兵庫県 公募 (15年) 第8回	1.09	100,000	106,172	2029/4/16
兵庫県 公募 (15年) 第11回	0.718	100,000	103,801	2030/5/10
兵庫県 公募第2回	2.37	100,000	112,092	2027/9/17
兵庫県 公募第9回	2.25	100,000	115,239	2029/11/19
兵庫県 公募 (20年) 第11回	1.84	200,000	226,082	2030/8/16
兵庫県 公募 (20年) 第14回	1.72	100,000	114,135	2032/5/24
兵庫県 公募 (20年) 第22回	1.4	100,000	112,051	2034/9/8
静岡県 公募平成25年度第5回	0.926	101,000	102,214	2023/7/25
静岡県 公募平成26年度第3回	0.679	165,000	167,285	2024/5/27
静岡県 公募平成26年度第8回	0.564	100,000	101,290	2024/9/25
静岡県 公募平成26年度第9回	0.554	200,000	202,620	2024/10/24
静岡県 公募平成27年度第11回	0.11	115,400	115,600	2026/3/19
静岡県 公募平成28年度第2回	0.08	300,000	300,105	2026/3/19
静岡県 公募平成29年度第3回	0.17	100,000	100,370	2027/3/19
静岡県 公募 (31年) 第1回	0.095	174,000	172,792	2029/3/19
静岡県 公募 (5年) 令和3年度第2回	0.01	100,000	99,758	2026/3/19
静岡県 公募 (5年) 令和3年度第5回	0.005	300,000	299,052	2026/6/19
静岡県 公募 (15年) 第2回	1.406	200,000	213,322	2027/6/25
静岡県 公募 (15年) 第5回	1.087	200,000	211,830	2028/11/20
静岡県 公募 (15年) 第9回	0.739	100,000	103,970	2030/9/20
静岡県 公募 (20年) 第11回	1.841	100,000	113,265	2030/10/18
静岡県 公募 (20年) 第14回	1.736	200,000	228,688	2032/6/18
静岡県 公募 (20年) 第18回	1.473	100,000	112,894	2034/7/10
静岡県 公募 (20年) 第30回	0.449	200,000	191,326	2040/9/20
愛知県 公募平成20年度第8回	2.04	100,000	112,350	2028/12/20
愛知県 公募 (20年) 平成22年度第8回	1.891	200,000	227,160	2030/9/13
愛知県 公募 (20年) 平成24年度第4回	1.687	100,000	113,885	2032/6/11
愛知県 公募 (15年) 平成24年度第14回	1.314	400,000	426,444	2027/12/13
愛知県 公募平成24年度第17回	1.829	100,000	115,933	2033/2/8
愛知県 公募 (30年) 平成25年度第8回	2.024	120,000	148,669	2043/6/19
愛知県 公募平成26年度第8回	1.814	100,000	120,045	2044/6/20
愛知県 公募平成26年度第13回	1.363	100,000	111,640	2034/11/14

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	
愛知県 公募平成26年度第17回	0.463	300,000	303,720	2025/2/26
愛知県 公募(15年)平成27年度第2回	0.74	300,000	311,994	2030/4/26
愛知県 公募平成27年度第15回	0.471	100,000	101,516	2025/11/27
愛知県 公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,322	2027/8/31
愛知県 公募平成29年度第9回	0.15	100,000	100,054	2027/9/15
愛知県 公募平成30年度第7回	0.18	200,000	200,126	2028/7/31
愛知県 公募令和3年度第10回	0.001	200,000	199,194	2026/10/15
広島県 公募平成25年度第3回	0.8	200,000	202,318	2023/9/25
広島県 公募平成26年度第5回	0.33	109,650	110,539	2025/1/27
広島県 公募平成26年度第7回	0.46	200,000	202,502	2025/3/25
広島県 公募平成29年度第3回	0.15	100,000	100,027	2027/9/27
広島県 公募平成29年度第4回	0.22	211,300	212,128	2027/11/24
広島県 公募平成30年度第6回	0.02	300,000	299,952	2024/2/20
広島県 公募令和2年度第2回	0.165	100,000	99,309	2030/7/22
広島県 公募令和2年度第7回	0.214	300,000	298,272	2031/3/19
埼玉県 公募平成25年度第4回	0.921	100,000	101,193	2023/7/24
埼玉県 公募平成25年度第6回	0.806	148,000	149,734	2023/9/27
埼玉県 公募平成25年度第10回	0.67	100,000	101,224	2024/2/26
埼玉県 公募平成25年度第11回	0.655	100,000	101,230	2024/3/26
埼玉県 公募平成26年度第3回	0.67	100,000	101,354	2024/5/20
埼玉県 公募平成26年度第6回	0.554	200,000	202,534	2024/9/26
埼玉県 公募平成26年度第7回	0.476	400,000	404,772	2024/12/25
埼玉県 公募平成26年度第9回	0.429	100,000	101,140	2025/2/25
埼玉県 公募平成27年度第9回	0.235	100,000	100,658	2026/2/25
埼玉県 公募平成28年度第5回	0.05	100,000	99,870	2026/7/28
埼玉県 公募平成30年度第4回	0.205	200,000	200,432	2028/6/26
埼玉県 公募平成30年度第7回	0.02	200,000	200,004	2023/10/26
埼玉県 公募令和元年度第4回	0.055	100,000	98,891	2029/6/20
埼玉県 公募令和2年度第4回	0.145	300,000	297,468	2030/6/17
埼玉県 公募(15年)第1回	0.941	100,000	105,310	2029/10/19
埼玉県 公募(15年)第2回	0.869	200,000	210,042	2030/5/22
埼玉県 公募(15年)第3回	0.43	100,000	101,415	2032/1/30
埼玉県 公募(25年)第2回	0.781	200,000	200,442	2042/9/19
埼玉県 公募(30年)第9回	0.845	200,000	196,056	2048/3/19
埼玉県 公募(20年)第6回	2.26	100,000	113,347	2028/9/21
埼玉県 公募(20年)第16回	1.216	100,000	109,944	2035/8/14
埼玉県 公募(20年)第20回	0.626	100,000	101,414	2037/5/15
福岡県 公募平成26年度第1回	0.654	100,000	101,371	2024/6/26
福岡県 公募平成27年度第1回	0.578	300,000	305,169	2025/6/26
福岡県 公募平成29年度第1回	0.2	100,000	100,389	2027/6/23
福岡県 公募平成23年度第1回	1.491	100,000	106,475	2026/11/27
福岡県 公募(15年)平成27年度第1回	0.784	200,000	208,690	2030/11/25
福岡県 公募(15年)令和元年度第1回	0.254	100,000	98,393	2034/6/14
福岡県 公募(30年)平成19年度第1回	2.62	100,000	130,347	2037/9/18
福岡県 公募(30年)平成26年度第1回	1.827	100,000	120,291	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	100,344	2047/12/20
福岡県 公募(20年)平成20年度第1回	2.26	300,000	339,471	2028/8/18
福岡県 公募(20年)平成20年度第2回	2.05	100,000	112,417	2028/12/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
福岡県 公募(20年)平成22年度第1回	1.77	300,000	337,437	2030/8/19
福岡県 公募(20年)平成22年度第2回	2.116	300,000	348,285	2031/2/21
福岡県 公募(20年)平成24年度第2回	1.635	100,000	113,474	2032/8/16
千葉県 公募平成25年度第3回	0.89	100,000	101,082	2023/6/23
千葉県 公募平成25年度第4回	0.92	100,000	101,194	2023/7/25
千葉県 公募平成26年度第1回	0.679	100,000	101,330	2024/4/25
千葉県 公募平成26年度第3回	0.611	200,000	202,640	2024/7/25
千葉県 公募平成27年度第6回	0.469	200,000	203,040	2025/12/25
千葉県 公募平成28年度第4回	0.085	200,000	199,954	2026/9/25
千葉県 公募平成29年度第4回	0.15	100,000	100,027	2027/9/24
千葉県 公募平成29年度第8回	0.2	100,000	100,237	2028/3/24
千葉県 公募令和元年度第6回	0.135	300,000	297,813	2030/1/25
千葉県 公募(20年)第1回	2.06	400,000	429,756	2025/12/19
千葉県 公募(20年)第8回	2.18	100,000	115,363	2030/4/19
千葉県 公募(20年)第13回	1.701	200,000	228,558	2032/10/15
千葉県 公募(20年)第16回	1.555	200,000	227,574	2034/4/14
千葉県 公募(20年)第17回	1.403	100,000	112,107	2034/10/13
新潟県 公募平成30年度第2回	0.264	200,000	201,106	2028/11/30
新潟県 公募令和2年度第2回	0.135	120,000	118,680	2030/11/29
長野県 公募令和3年度第1回	0.19	300,000	297,714	2031/4/16
茨城県 公募令和3年度第3回	0.005	200,000	199,298	2026/8/25
群馬県 公募第12回	0.519	100,000	101,580	2025/8/15
群馬県 公募(5年)第13回	0.005	300,000	298,950	2026/8/18
群馬県 公募(20年)第3回	1.687	100,000	113,887	2032/6/25
岐阜県 公募平成26年度第1回	0.554	186,670	189,046	2024/9/30
共同発行市場地方債 公募第122回	0.62	400,000	402,808	2023/5/25
共同発行市場地方債 公募第124回	0.91	300,000	303,564	2023/7/25
共同発行市場地方債 公募第126回	0.81	100,000	101,174	2023/9/25
共同発行市場地方債 公募第128回	0.66	700,000	707,385	2023/11/24
共同発行市場地方債 公募第129回	0.71	100,000	101,190	2023/12/25
共同発行市場地方債 公募第130回	0.76	100,000	101,335	2024/1/25
共同発行市場地方債 公募第132回	0.66	100,000	101,238	2024/3/25
共同発行市場地方債 公募第136回	0.611	200,000	202,640	2024/7/25
共同発行市場地方債 公募第137回	0.566	500,000	506,295	2024/8/23
共同発行市場地方債 公募第139回	0.544	155,000	156,993	2024/10/25
共同発行市場地方債 公募第143回	0.448	540,000	546,453	2025/2/25
共同発行市場地方債 公募第145回	0.406	1,000,000	1,011,210	2025/4/25
共同発行市場地方債 公募第152回	0.496	400,000	406,420	2025/11/25
共同発行市場地方債 公募第154回	0.405	300,000	303,927	2026/1/23
共同発行市場地方債 公募第156回	0.1	200,000	200,230	2026/3/25
共同発行市場地方債 公募第157回	0.08	300,000	300,114	2026/4/24
共同発行市場地方債 公募第161回	0.06	300,000	299,670	2026/8/25
共同発行市場地方債 公募第172回	0.225	600,000	603,162	2027/7/23
共同発行市場地方債 公募第184回	0.175	100,000	100,031	2028/7/25
共同発行市場地方債 公募第186回	0.25	400,000	401,796	2028/9/25
共同発行市場地方債 公募第188回	0.264	300,000	301,656	2028/11/24
共同発行市場地方債 公募第190回	0.16	610,000	608,956	2029/1/25
共同発行市場地方債 公募第191回	0.14	100,000	99,655	2029/2/22

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券		%	千円	千円	
共同発行市場地方債	公募第194回	0.11	200,000	198,648	2029/5/25
共同発行市場地方債	公募第196回	0.06	400,000	395,508	2029/7/25
共同発行市場地方債	公募第197回	0.06	300,000	296,595	2029/8/24
共同発行市場地方債	公募第200回	0.07	100,000	98,834	2029/11/22
共同発行市場地方債	公募第206回	0.131	300,000	297,270	2030/5/24
共同発行市場地方債	公募第213回	0.125	300,000	296,286	2030/12/25
共同発行市場地方債	公募第215回	0.145	400,000	395,528	2031/2/25
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	114,439	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	116,930	2044/9/20
長崎県	公募令和元年度第3回	0.05	100,000	98,855	2029/6/20
島根県	公募(30年)平成29年度第1回	0.919	100,000	100,195	2047/6/20
佐賀県	公募平成28年度第1回	0.08	100,000	99,930	2026/11/30
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	202,416	2024/11/28
滋賀県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,048	2023/11/29
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	143,715	2024/11/28
栃木県	公募平成25年度第1回	0.65	100,000	101,048	2023/11/29
熊本県	公募平成28年度第2回	0.06	132,000	131,819	2026/10/28
熊本市	公募平成29年度第1回	0.19	100,000	100,225	2027/11/30
新潟市	公募平成25年度第1回	0.72	233,200	236,019	2023/12/26
新潟市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,312	2027/12/24
浜松市	公募平成26年度第1回	0.335	100,000	100,821	2025/1/23
大阪市	公募平成25年度第6回	0.694	100,000	101,107	2023/11/22
大阪市	公募平成26年度第5回	0.593	100,000	101,365	2024/9/27
大阪市	公募平成27年度第6回	0.471	100,000	101,514	2025/11/25
大阪市	公募令和2年度第2回	0.131	300,000	297,273	2030/5/22
大阪市	公募令和3年度第2回	0.16	300,000	296,835	2031/5/21
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	107,183	2026/7/17
大阪市	公募(20年)第1回	2.3	300,000	336,072	2027/11/15
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	114,691	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	113,479	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	100,000	114,651	2032/12/21
大阪市	公募(20年)第26回	0.635	100,000	101,179	2037/10/23
名古屋市	公募第488回	0.598	300,000	304,137	2024/9/20
名古屋市	公募第489回	0.461	100,000	101,146	2024/12/20
名古屋市	公募第501回	0.175	200,000	200,326	2027/9/29
名古屋市	公募第503回	0.205	100,000	100,266	2028/3/24
名古屋市	公募第504回	0.205	200,000	200,430	2028/6/20
名古屋市	公募第511回	0.075	200,000	197,416	2030/3/27
名古屋市	公募第512回	0.15	300,000	297,585	2030/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	206,388	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	105,056	2029/11/16
京都市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,402	2027/8/25
京都市	公募平成29年度第4回	0.235	101,280	101,748	2028/1/31
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	107,153	2025/9/19
京都市	公募(20年)第5回	2.36	200,000	221,270	2026/12/18
京都市	公募(20年)第6回	2.38	100,000	112,146	2027/9/17
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	111,616	2034/11/24
京都市	公募(20年)第15回	0.487	200,000	199,256	2036/11/28

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券		%	千円	千円	
神戸市	公募平成26年度第17回	0.28	300,000	302,010	2025/1/27
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	200,074	2026/4/17
神戸市	公募平成30年度第2回	0.845	200,000	196,056	2048/3/19
横浜市	公募公債平成25年度1回	0.664	200,000	201,482	2023/5/19
横浜市	公募公債平成25年度5回	0.655	200,000	202,068	2023/11/17
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	202,328	2024/12/13
横浜市	公募平成28年度第5回	0.23	300,000	301,947	2027/2/19
横浜市	公募平成29年度第3回	0.22	100,000	100,453	2027/8/13
横浜市	公募2019年度第3回	0.05	200,000	197,468	2029/10/16
横浜市	公募(30年)第2回	2.49	200,000	251,640	2035/3/20
横浜市	公募(20年)第11回	2.2	100,000	109,883	2026/12/18
横浜市	公募(20年)第18回	2.21	100,000	114,156	2029/5/25
横浜市	公募(20年)第26回	1.776	100,000	115,328	2033/1/28
横浜市	公募(20年)第30回	1.376	100,000	111,802	2034/10/20
札幌市	公募(15年)平成23年度第9回	1.493	200,000	213,530	2027/2/12
札幌市	公募(20年)平成24年度第1回	1.79	100,000	114,800	2032/4/23
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	1.794	100,000	115,593	2033/2/28
札幌市	公募平成26年度第4回	0.54	100,000	101,107	2024/6/20
札幌市	公募平成26年度第9回	0.43	200,000	202,096	2024/12/20
川崎市	公募(20年)第14回	1.79	100,000	114,645	2032/3/19
川崎市	公募(20年)第17回	1.527	100,000	112,925	2033/5/9
川崎市	公募(20年)第19回	1.362	100,000	111,628	2034/9/20
川崎市	公募(30年)第11回	0.817	100,000	97,348	2048/3/19
北九州市	公募(10年)令和2年度第2回	0.125	200,000	197,356	2030/12/24
北九州市	公募(20年)第3回	2.33	200,000	223,736	2027/9/21
北九州市	公募(20年)第14回	1.732	100,000	114,598	2032/11/12
福岡市	公募(20年)平成21年度第3回	2.14	200,000	228,270	2029/9/18
福岡市	公募(20年)平成23年度第4回	1.89	100,000	114,827	2031/8/19
福岡市	公募平成26年度第2回	1.49	100,000	113,106	2034/6/20
福岡市	公募平成26年度第5回	0.539	100,000	101,278	2024/10/28
福岡市	公募平成26年度第8回	0.465	160,000	162,025	2025/3/25
福岡市	公募(5年)2020年度第9回	0.01	300,000	299,427	2025/12/25
広島市	公募平成26年度第2回	0.456	100,000	101,125	2024/12/25
広島市	公募平成27年度第2回	0.464	500,000	507,510	2025/12/25
広島市	公募(10年)平成30年度第6回	0.146	241,000	240,267	2029/2/22
千葉市	公募平成26年度第2回	0.505	200,000	202,466	2024/11/27
三重県	公募平成28年度第1回	0.165	155,000	155,475	2026/12/25
福井県	公募平成27年度第4回	0.085	200,000	200,116	2026/4/27
福井県	公募令和元年度第3回	0.05	200,000	197,384	2029/10/29
徳島県	公募平成29年度第2回	0.19	200,000	200,450	2027/11/30
徳島県	公募平成30年度第2回	0.264	300,000	301,659	2028/11/28
山梨県	公募令和元年度第1回	0.05	100,000	98,692	2029/10/30
岡山県	公募平成28年度第2回	0.205	168,900	169,776	2027/3/31
岡山県	公募令和2年度第3回	0.224	300,000	298,512	2031/3/31
愛知県・名古屋	折半保証名古屋高速道路債券 第96回	2.34	100,000	112,992	2028/12/20
愛知県・名古屋	折半保証名古屋高速道路債券 第102回	2.298	300,000	343,410	2029/12/20
福岡	北九州高速道路債券 第117回	2.26	100,000	112,504	2028/12/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券		%	千円	千円	
福岡北九州高速道路債券 第136回		0.833	100,000	103,502	2030/3/19
小計			55,428,320	57,337,944	
特殊債券(除く金融債)					
政保	地方公共団体金融機構債券 第48回	0.605	500,000	503,515	2023/5/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第49回	0.882	13,000	13,141	2023/6/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第50回	0.911	100,000	101,200	2023/7/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第56回	0.747	591,000	599,002	2024/1/19
政保	地方公共団体金融機構債券 第59回	0.669	116,000	117,566	2024/4/12
政保	地方公共団体金融機構債券 第64回	0.544	100,000	101,297	2024/9/13
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	405,348	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	420,000	424,935	2025/2/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	191,963	2025/5/23
政保	地方公共団体金融機構債券 第78回	0.381	509,000	515,566	2025/11/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第80回	0.32	300,000	303,294	2026/1/19
政保	地方公共団体金融機構債券(8年) 第5回	0.173	500,000	501,610	2024/1/29
政保	地方公共団体金融機構債券 第83回	0.02	116,000	115,856	2026/4/17
政保	地方公共団体金融機構債券 第91回	0.085	300,000	300,138	2026/12/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第108回	0.145	157,000	157,995	2028/5/19
政保	地方公共団体金融機構債券 第110回	0.13	100,000	99,937	2028/7/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第113回	0.219	110,000	110,491	2028/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第119回	0.04	116,000	114,983	2029/4/13
政保	地方公共団体金融機構債券 11回	0.001	500,000	499,885	2024/8/28
日本政策金融公庫債券	政府保証第63回	0.11	110,000	108,718	2031/2/25
新開西国際空港債券	政府保証第2回	0.882	191,000	193,137	2023/6/27
新開西国際空港債券	政府保証第5回	0.145	117,000	117,374	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	700,000	700,175	2023/11/27
日本政策投資銀行債券	政府保証第22回	2.2	100,000	102,706	2023/6/19
日本政策投資銀行社債	政府保証第37回	0.085	400,000	400,184	2026/12/14
日本政策投資銀行社債	政府保証第42回	0.155	300,000	300,594	2027/12/15
日本政策投資銀行社債	政府保証第52回	0.001	300,000	299,898	2025/1/24
日本政策投資銀行社債	政府保証第55回	0.105	300,000	298,740	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90回	2.1	100,000	114,186	2029/9/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第92回	2.1	200,000	228,630	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	229,142	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	230,942	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	230,116	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	227,578	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	124,308	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165回	1.83	100,000	119,931	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169回	1.634	100,000	113,621	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171回	1.56	100,000	112,893	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	364,989	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183回	1.726	100,000	114,998	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185回	1.757	200,000	230,770	2033/2/28
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	402,916	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	1,011,270	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	275,291	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	303,654	2023/12/28

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
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	138,731	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	745,000	754,506	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	113,195	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	118,118	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	113,104	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	304,260	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	118,182	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	192,504	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	638,574	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	101,238	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	546,690	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	202,638	2025/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第245回	1.079	300,000	325,128	2035/4/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第258回	0.386	400,000	405,164	2025/10/31
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	406,208	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	150,873	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296回	0.522	200,000	200,614	2036/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第297回	0.085	100,000	100,025	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	404,289	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	100,130	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	601,452	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	99,863	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	98,340	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	502,055	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	131,116	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	100,031	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	199,874	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	100,407	2028/8/31
民間都市開発推進機構	政府保証第16回	0.699	360,000	364,006	2023/10/20
民間都市開発推進機構	政府保証第17回	0.145	400,000	401,700	2026/2/26
関西国際空港債券	政府保証第54回	2.4	300,000	341,961	2028/6/23
中部国際空港債券	政府保証第22回	0.001	300,000	300,012	2024/3/1
預金保険機構債券	政府保証第230回	0.1	600,000	601,260	2024/8/6
預金保険機構債券	政府保証第231回	0.1	300,000	300,645	2024/10/4
新関西国際空港社債	財投機関債第6回	1.445	300,000	323,811	2028/9/15
新関西国際空港社債	財投機関債第9回	1.231	100,000	106,766	2028/12/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	105,945	2029/9/20
新関西国際空港社債	財投機関債第22回	0.05	200,000	200,054	2023/12/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	105,691	2029/9/20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第66回	0.09	400,000	400,308	2026/4/17
日本政策投資銀行社債	財投機関債第78回	0.225	200,000	201,138	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	100,761	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	301,482	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	200,000	2028/7/12
日本政策投資銀行社債	財投機関債第101回	0.309	300,000	302,010	2028/10/12
日本政策投資銀行社債	財投機関債第137回	0.03	400,000	399,348	2026/3/19
日本政策投資銀行社債	財投機関債第138回	0.145	400,000	394,984	2031/1/15
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第1回	2.99	200,000	285,690	2045/9/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
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	127,526	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	218,860	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	110,080	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	335,703	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	287,268	2048/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第39回	2.37	300,000	341,697	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	115,199	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	113,701	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103回	1.69	350,000	399,311	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	115,808	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	101,131	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	404,132	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	101,315	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	101,287	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	202,326	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	202,188	2024/6/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第136回	0.583	200,000	202,682	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	338,166	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	114,185	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	104,678	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	108,476	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	87,957	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	100,426	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	182,546	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28回	2.83	400,000	510,520	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	129,379	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	1,054,860	2024/9/20
公営企業債券 30年第4回財投機関債		2.95	100,000	129,714	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	112,400	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券(20年) 第1回		2.266	300,000	343,353	2029/6/28
地方公共団体金融機構債券 20年第4回		2.12	100,000	114,202	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券 F16回		2.042	100,000	109,252	2027/1/7
地方公共団体金融機構債券 20年第6回		2.242	300,000	346,530	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券 20年第7回		2.202	300,000	346,170	2030/4/26
地方公共団体金融機構債券(20年) 第10回		1.752	300,000	336,546	2030/8/28
地方公共団体金融機構債券 F104回		1.314	100,000	103,746	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券 F106回		1.259	100,000	102,416	2024/3/19
地方公共団体金融機構債券 F122回		1.412	100,000	106,696	2027/6/18
地方公共団体金融機構債券 F124回		1.418	100,000	106,682	2027/6/4
地方公共団体金融機構債券 F132回		1.09	500,000	517,375	2025/7/30
地方公共団体金融機構債券 F142回		1.016	100,000	102,593	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券 F145回		1.059	200,000	206,068	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券 F147回		1.291	100,000	105,910	2027/3/19
地方公共団体金融機構債券 F160回		1.052	100,000	105,241	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券(20年) 第29回		1.725	100,000	114,890	2033/6/28
地方公共団体金融機構債券 第51回		0.841	600,000	606,972	2023/8/28
地方公共団体金融機構債券 第52回		0.801	300,000	303,567	2023/9/15
地方公共団体金融機構債券(15年) 第2回		1.161	200,000	212,714	2028/12/28

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第38回	1.487	100,000	112,708	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券	F 240回	1.069	300,000	318,813	2030/2/28
地方公共団体金融機構債券	第64回	0.574	100,000	101,318	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第39回	1.425	100,000	111,998	2034/9/28
地方公共団体金融機構債券	(20年) 第43回	1.171	100,000	108,910	2035/4/27
地方公共団体金融機構債券	第74回	0.519	300,000	304,719	2025/7/28
地方公共団体金融機構債券	第77回	0.491	100,000	101,555	2025/10/28
地方公共団体金融機構債券	第79回	0.484	400,000	406,312	2025/12/26
地方公共団体金融機構債券	第95回	0.2	200,000	200,886	2027/4/28
地方公共団体金融機構債券	第101回	0.235	400,000	401,992	2027/10/28
公営企業債券	(20年) 第5回財投機関債	2.11	200,000	206,156	2023/9/20
公営企業債券	(20年) 第19回財投機関債	2.37	100,000	110,681	2026/12/18
公営企業債券	(20年) 第20回財投機関債	2.25	100,000	110,677	2027/3/24
公営企業債券	(20年) 第23回財投機関債	2.29	200,000	223,458	2027/9/24
公営企業債券	(20年) 第24回財投機関債	2.29	100,000	112,661	2028/4/25
公営企業債券	(20年) 第25回財投機関債	2.5	100,000	114,234	2028/6/20
首都高速道路	第28回	0.04	200,000	199,288	2026/9/18
阪神高速道路	第25回	0.03	100,000	99,719	2026/3/19
都市再生債券	財投機関債第96回	0.599	200,000	202,762	2024/9/20
都市再生債券	財投機関債第97回	1.017	100,000	105,617	2029/9/20
都市再生債券	財投機関債第101回	0.935	100,000	105,092	2029/11/20
都市再生債券	財投機関債第109回	0.918	100,000	105,168	2030/6/20
都市再生債券	財投機関債第113回	0.851	300,000	314,043	2030/9/20
都市再生債券	財投機関債第121回	0.482	200,000	203,268	2031/2/20
都市再生債券	財投機関債第127回	0.075	100,000	99,933	2026/9/18
本州四国連絡橋債券	財投機関債第7回	2.26	100,000	107,073	2025/6/20
東京交通債券	第347回	2.05	157,000	162,889	2024/3/8
住宅金融支援機構債券	財投機関債第3回	2.26	400,000	442,684	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	224,196	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	103,137	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	105,645	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	114,783	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	114,051	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	115,920	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	321,141	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	115,902	2031/7/11
住宅金融支援機構債券	財投機関債第81回	1.926	100,000	114,942	2031/9/12
住宅金融支援機構債券	財投機関債第85回	1.841	200,000	228,496	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	214,086	2026/12/18
住宅金融支援機構債券	財投機関債第115回	1.811	100,000	114,914	2032/9/14
住宅金融支援機構債券	財投機関債第120回	1.836	100,000	115,312	2032/11/12
住宅金融支援機構債券	財投機関債第123回	1.801	200,000	229,652	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	126,792	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	210,692	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	106,884	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	106,382	2028/10/20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第177回	0.484	450,000	457,146	2025/12/19
住宅金融支援機構債券	財投機関債第188回	0.09	300,000	300,180	2026/5/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
住宅金融支援機構債券	財投機関債第198回	0.155	300,000	300,843	2026/12/18
住宅金融支援機構債券	財投機関債第208回	0.215	200,000	200,986	2027/5/20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第223回	0.403	100,000	100,435	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	130,605	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	299,766	2025/12/19
成田国際空港	第17回	0.489	400,000	404,996	2025/2/20
成田国際空港	第19回	0.275	100,000	100,732	2026/2/18
沖繩振興開発金融公庫債券	財投機関債第6回	2.04	200,000	212,868	2025/6/20
国際協力機構債券	第6回財投機関債	2.098	200,000	230,976	2030/12/13
国際協力機構債券	第23回財投機関債	0.684	100,000	101,242	2024/2/21
東日本高速道路	第61回	0.14	200,000	198,332	2029/7/31
東日本高速道路	第83回	0.05	200,000	199,496	2026/6/19
東日本高速道路	第86回	0.04	400,000	398,312	2026/12/18
中日本高速道路	第63回	0.576	100,000	101,807	2025/11/13
中日本高速道路	第79回	0.04	300,000	299,853	2024/8/19
中日本高速道路	第86回	0.06	100,000	99,920	2026/1/22
中日本高速道路	第89回	0.05	100,000	99,770	2026/6/1
中日本高速道路	第90回	0.05	300,000	299,223	2026/7/27
中日本高速道路	第91回	0.04	200,000	199,288	2026/9/17
西日本高速道路	第20回	0.759	200,000	202,174	2023/9/20
西日本高速道路	第22回	0.744	400,000	405,572	2024/3/19
西日本高速道路	第23回	0.602	100,000	101,211	2024/6/20
西日本高速道路	第30回	0.17	300,000	300,798	2026/5/22
西日本高速道路	第50回	0.04	200,000	199,906	2024/6/20
西日本高速道路	第64回	0.04	200,000	199,288	2026/9/18
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	303,024	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	101,188	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	202,558	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	111,989	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	506,430	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	297,222	2031/5/30
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第135回	0.11	300,000	296,286	2030/2/27
貸付債権担保第19回住宅金融公庫債券		1.8	47,955	47,964	2039/6/10
貸付債権担保第42回住宅金融公庫債券		2.34	31,527	31,840	2041/5/10
貸付債権担保第7回S種住宅金融公庫債券		2.25	9,812	9,814	2037/5/10
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	21,762	22,037	2041/2/10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	24,848	25,499	2041/3/10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	44,552	45,068	2040/7/10
貸付債権担保第20回住宅金融公庫債券		2.12	48,220	48,231	2039/7/10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	42,676	43,433	2041/7/10
貸付債権担保第8回住宅金融支援機構債券		1.99	68,136	69,297	2042/12/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	11,942	12,209	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	18,253	19,340	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	60,456	63,777	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	8,461	8,462	2032/11/10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	55,408	57,873	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	16,994	16,997	2032/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	65,904	69,261	2046/2/10

銘柄	利	当期			償還年月日
		率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)	%		千円	千円	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	1.51	49,404	51,584	2046/9/10	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	2.34	32,882	34,639	2044/5/10	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	1.89	61,290	64,340	2046/5/10	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	1.36	70,320	73,032	2045/9/10	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	1.21	110,910	115,269	2047/7/10	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	1.34	104,337	108,795	2047/5/10	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	1.26	68,310	71,058	2047/6/10	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	1.64	22,919	23,961	2046/8/10	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	1.6	54,536	57,348	2045/12/10	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	1.07	36,254	37,496	2048/12/10	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	1.07	79,276	82,037	2049/2/10	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	1.08	35,126	36,332	2048/5/10	
貸付債権担保第22回住宅金融公庫債券	1.87	19,636	19,640	2039/9/10	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	1.25	107,292	111,774	2048/3/10	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	1.88	22,695	23,962	2045/2/10	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	1.86	23,817	25,165	2045/3/10	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	1.87	22,160	23,409	2045/4/10	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	1.85	21,588	22,722	2046/3/10	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	1.41	61,322	64,063	2046/12/10	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	1.42	88,764	92,673	2047/1/10	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	1.44	30,209	31,557	2047/2/10	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	1.21	69,196	71,954	2048/9/10	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	2.25	64,692	67,966	2044/4/10	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	1.82	65,358	68,801	2045/1/10	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	1.52	116,340	121,429	2045/8/10	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	68,702	71,803	2047/3/10	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	1.16	119,025	123,574	2047/9/10	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	1.07	102,831	106,303	2048/4/10	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	81,394	85,162	2048/6/10	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	67,616	70,459	2048/8/10	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	1.04	167,964	173,627	2049/4/10	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	1.01	289,590	298,929	2049/5/10	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	44,519	45,782	2049/9/10	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	45,806	47,153	2049/10/10	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	47,221	48,424	2049/11/10	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	98,986	100,819	2050/1/10	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	104,948	106,055	2050/2/10	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	55,060	56,248	2050/3/10	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	58,938	60,032	2050/5/10	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	175,536	179,647	2050/6/10	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	181,524	186,452	2050/7/10	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	122,374	125,528	2050/8/10	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	0.84	59,037	60,442	2050/9/10	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	0.89	60,253	61,856	2050/10/10	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	0.41	227,583	226,986	2051/12/10	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	0.48	152,614	152,861	2052/1/10	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	0.46	153,860	153,830	2052/2/10	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	0.47	76,630	76,706	2052/3/10	

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
貸付債権担保第119回	住宅金融支援機構債券	0.46	153,474	153,512	2052/4/10
貸付債権担保第120回	住宅金融支援機構債券	0.4	77,284	77,038	2052/5/10
貸付債権担保第121回	住宅金融支援機構債券	0.43	77,966	77,846	2052/6/10
貸付債権担保第123回	住宅金融支援機構債券	0.46	79,113	79,112	2052/8/10
貸付債権担保第125回	住宅金融支援機構債券	0.42	316,640	315,731	2052/10/10
貸付債権担保第126回	住宅金融支援機構債券	0.43	239,586	238,996	2052/11/10
貸付債権担保第128回	住宅金融支援機構債券	0.42	159,776	159,259	2053/1/10
貸付債権担保第129回	住宅金融支援機構債券	0.46	163,342	163,155	2053/2/10
貸付債権担保第134回	住宅金融支援機構債券	0.39	165,444	164,532	2053/7/10
貸付債権担保第135回	住宅金融支援機構債券	0.39	83,201	82,723	2053/8/10
貸付債権担保第136回	住宅金融支援機構債券	0.44	83,926	83,718	2053/9/10
貸付債権担保第140回	住宅金融支援機構債券	0.38	84,144	83,543	2054/1/10
貸付債権担保第142回	住宅金融支援機構債券	0.32	259,845	256,877	2054/3/10
貸付債権担保第144回	住宅金融支援機構債券	0.33	258,975	256,102	2054/5/10
貸付債権担保第150回	住宅金融支援機構債券	0.21	449,695	440,566	2054/11/10
貸付債権担保第152回	住宅金融支援機構債券	0.33	181,820	179,687	2055/1/10
貸付債権担保第154回	住宅金融支援機構債券	0.3	183,262	180,650	2055/3/10
貸付債権担保第164回	住宅金融支援機構債券	0.33	287,067	283,182	2056/1/10
貸付債権担保第165回	住宅金融支援機構債券	0.36	191,340	189,237	2056/2/10
貸付債権担保第166回	住宅金融支援機構債券	0.41	287,844	285,820	2056/3/10
貸付債権担保第167回	住宅金融支援機構債券	0.41	193,174	191,746	2056/4/10
貸付債権担保第168回	住宅金融支援機構債券	0.4	193,346	191,733	2056/5/10
貸付債権担保第169回	住宅金融支援機構債券	0.39	291,225	288,472	2056/6/10
貸付債権担保第170回	住宅金融支援機構債券	0.36	487,895	482,054	2056/7/10
貸付債権担保第174回	住宅金融支援機構債券	0.38	296,436	293,261	2056/11/10
貸付債権担保第175回	住宅金融支援機構債券	0.36	297,600	293,841	2056/12/10
貸付債権担保第176回	住宅金融支援機構債券	0.32	298,263	293,800	2057/1/10
貸付債権担保第177回	住宅金融支援機構債券	0.4	199,656	198,014	2057/2/10
貸付債権担保第178回	住宅金融支援機構債券	0.48	300,000	299,928	2057/3/10
貸付債権担保第179回	住宅金融支援機構債券	0.46	300,000	299,727	2057/4/10
フランス預金供託公庫 第4回元貨債券(2014)		0.725	100,000	101,115	2024/7/30
小 計			60,880,889	63,220,691	
金融債券					
商工債券	利付第818回い号	0.17	100,000	100,121	2023/7/27
商工債券	利付第819回い号	0.18	300,000	300,411	2023/8/25
商工債券	利付第829回い号	0.13	200,000	200,084	2024/6/27
商工債券	利付第831回い号	0.08	200,000	199,854	2024/8/27
商工債券	利付第833回い号	0.05	100,000	99,813	2024/10/25
商工債券	利付第845回い号	0.12	300,000	299,727	2025/10/27
商工債券	利付第852回い号	0.09	100,000	99,648	2026/5/27
商工債券	利付第854回い号	0.08	400,000	398,284	2026/7/27
商工債券	利付第856回い号	0.09	200,000	199,110	2026/9/25
しんきん中金債券	利付第374回	0.05	300,000	299,187	2026/1/27
しんきん中金債券	利付第377回	0.04	100,000	99,633	2026/4/27
しんきん中金債券	利付第379回	0.04	400,000	398,312	2026/6/26
しんきん中金債券	利付第380回	0.03	100,000	99,527	2026/7/27
商工債券	利付(3年)第258回	0.04	100,000	99,836	2024/7/26

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
金融債券		%	千円	千円	
商工債券	利付(10年)第15回	0.48	200,000	202,348	2025/9/19
小計			3,100,000	3,095,895	
普通社債券(含む投資法人債券)					
東京電力	第548回	2.347	100,000	110,509	2028/9/29
東京電力	第560回	2.114	100,000	109,961	2029/12/10
中部電力	第500回	0.875	200,000	203,036	2024/5/24
中部電力	第524回	0.39	100,000	100,362	2027/5/25
中部電力	第530回	0.274	200,000	197,660	2029/6/25
関西電力	第509回	0.47	100,000	100,614	2027/5/25
関西電力	第511回	0.41	300,000	300,804	2027/9/17
関西電力	第527回	0.28	200,000	200,388	2024/4/25
関西電力	第535回	0.18	200,000	199,586	2025/12/19
中国電力	第377回	1.121	100,000	101,363	2023/8/25
中国電力	第400回	0.34	100,000	99,973	2027/9/24
中国電力	第402回	0.25	100,000	100,184	2024/10/25
中国電力	第416回	0.355	100,000	99,577	2029/5/25
中国電力	第422回	0.35	600,000	595,110	2030/4/25
中国電力	第425回	0.37	100,000	99,327	2030/6/25
北陸電力	第307回	1.055	100,000	103,308	2026/6/25
北陸電力	第308回	0.769	100,000	101,459	2024/9/25
北陸電力	第326回	0.719	100,000	99,241	2038/4/23
東北電力	第475回	0.809	100,000	101,558	2024/9/25
東北電力	第481回	0.803	200,000	203,806	2025/7/25
東北電力	第484回	0.758	100,000	100,620	2036/5/23
東北電力	第491回	0.42	100,000	100,696	2027/2/25
東北電力	第508回	0.465	100,000	100,303	2029/4/25
東北電力	第521回	0.45	300,000	299,886	2030/5/24
東北電力	第529回	0.07	200,000	198,546	2026/4/24
四国電力	第281回	1.111	100,000	101,410	2023/9/25
九州電力	第424回	1.233	100,000	101,757	2023/11/24
九州電力	第428回	0.936	105,000	106,793	2024/7/25
九州電力	第449回	0.43	200,000	200,928	2027/4/23
九州電力	第451回	0.45	100,000	100,412	2027/5/25
九州電力	第476回	0.43	100,000	99,752	2029/5/25
九州電力	第481回	0.324	300,000	296,781	2029/7/25
九州電力	第484回	0.375	200,000	198,376	2029/11/22
九州電力	第493回	0.1	300,000	298,026	2026/5/25
北海道電力	第321回	0.886	100,000	101,827	2024/12/25
北海道電力	第323回	1.337	100,000	106,547	2030/3/25
北海道電力	第338回	0.84	100,000	101,268	2036/11/25
北海道電力	第345回	0.27	300,000	300,447	2024/9/25
東京電力パワーグリッド	第6回	0.85	100,000	101,468	2027/8/31
東京電力パワーグリッド	第11回	0.79	300,000	303,477	2028/1/25
東京電力パワーグリッド	第14回	0.43	100,000	100,221	2023/7/24
東京電力パワーグリッド	第15回	0.89	300,000	302,211	2030/7/24
東京電力パワーグリッド	第28回	1.01	100,000	101,764	2029/7/10
東京電力パワーグリッド	第35回	1.2	100,000	103,211	2030/4/23
東京電力パワーグリッド	第38回	0.58	400,000	402,360	2025/7/16

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
東京電力パワーグリッド 第40回		1.37	400,000	416,096	2035/7/13
東京電力パワーグリッド 第45回		0.8	300,000	299,562	2031/4/22
INPEX 第1回社債間限定同順位特約付		0.08	500,000	498,310	2026/3/16
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	198,958	2030/7/12
五洋建設 第7回社債間限定同順位特約付		0.14	100,000	99,494	2026/9/25
大和ハウス工業 第9回社債間限定同順位特約付		0.69	100,000	99,178	2036/11/28
大和ハウス工業 第25回特定社債間限定同順位特約付		0.28	300,000	297,015	2031/6/3
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	199,700	2023/7/14
明治ホールディングス 第10回社債間限定同順位特約付		0.05	200,000	198,546	2026/4/23
アサヒグループホールディングス 第16回特定社債間限定同順位		0.08	300,000	298,341	2026/3/13
コカ・コーラボトラーズジャパン 第3回社債間限定同順位特約付		0.27	100,000	98,603	2029/9/19
味の素 第24回特定社債間限定同順位特約付		0.19	100,000	100,136	2024/3/8
日本たばこ産業 第13回		0.355	100,000	99,749	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	99,338	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	100,747	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		0.34	200,000	199,356	2026/8/28
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付		0.97	100,000	98,391	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		0.06	100,000	99,864	2023/12/20
セブン&アイ・ホールディングス 第14回社債間限定同順位特約		0.19	600,000	599,514	2025/12/19
セブン&アイ・ホールディングス 第15回社債間限定同順位特約		0.28	200,000	199,220	2027/12/20
東レ 第30回社債間限定同順位特約付		0.375	100,000	100,000	2027/7/16
東レ 第33回社債間限定同順位特約付		0.38	100,000	99,633	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	197,864	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	100,204	2028/1/26
王子ホールディングス 第42回社債間限定同順位特約付		0.08	600,000	596,898	2026/3/24
日本製紙 第15回社債間限定同順位特約付		0.35	100,000	98,591	2031/9/10
住友化学 第56回社債間限定同順位特約付		0.38	100,000	99,917	2027/9/13
イビデン 第11回社債間限定同順位特約付		0.001	100,000	99,695	2024/9/9
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付		0.39	100,000	100,044	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	99,619	2029/5/30
三菱ケミカルホールディングス 第33回社債間限定同順位特約付		0.28	200,000	197,898	2030/2/28
三菱ケミカルホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付		0.83	100,000	97,884	2040/6/11
ダイセル 第17回社債間限定同順位特約付		0.5	100,000	100,258	2030/12/13
電通 第3回社債間限定同順位特約付		0.424	100,000	100,015	2028/10/25
電通 第6回社債間限定同順位特約付		0.49	300,000	300,336	2030/7/8
武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付		0.4	200,000	196,554	2031/10/14
ツムラ 第1回社債間限定同順位特約付		0.23	100,000	99,866	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	99,801	2025/9/17
オリエンタルランド 第18回社債間限定同順位特約付		0.29	200,000	197,956	2030/9/17
ヤフー 第6回社債間限定同順位特約付		0.35	100,000	99,905	2024/12/6
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付		0.37	200,000	198,522	2026/7/31
楽天 第13回社債間限定同順位特約付		0.45	100,000	96,169	2029/6/25
楽天 第15回社債間限定同順位特約付		0.5	100,000	99,617	2024/12/2
出光興産 第14回社債間限定同順位特約付		0.34	100,000	98,739	2031/7/15
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付		0.295	100,000	99,865	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	298,953	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		0.26	100,000	99,691	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		0.25	100,000	99,972	2025/7/14

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
三菱マテリアル	第36回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	99,199	2028/6/7
住友金属鉱山	第33回社債間限定同順位特約付	0.09	200,000	198,682	2026/9/15
住友電気工業	第26回社債間限定同順位特約付	0.3	200,000	198,914	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	299,508	2023/7/18
日立建機	第20回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	98,819	2031/3/18
荏原製作所	第10回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,586	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	213,232	2028/12/13
パナソニック	第17回社債間限定同順位特約付	0.47	200,000	201,638	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	99,829	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	99,808	2025/12/24
パナソニック	第22回社債間限定同順位特約付	0.29	200,000	198,662	2027/12/24
パナソニック	第23回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	98,718	2030/12/24
ソニー	第32回	0.28	100,000	100,189	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	99,034	2027/6/7
三菱重工業	第35回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,735	2027/8/27
三菱重工業	第38回社債間限定同順位特約付(第2回グリーンボ)	0.09	300,000	298,227	2026/9/1
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	100,204	2024/9/13
三井住友トラスト・パナソニックファイナンス	第9回社債間限定	0.22	100,000	99,729	2025/10/10
トヨタ自動車	第26回社債間限定同順位特約付	0.05	700,000	697,487	2026/3/18
トヨタ自動車	第27回社債間限定同順位特約付	0.219	300,000	297,366	2031/3/18
楽天カード	第3回社債間限定同順位特約付	0.42	100,000	98,265	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	100,358	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	99,538	2025/12/2
丸紅	第113回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	98,809	2031/4/18
豊田通商	第18回社債間限定同順位特約付	1.014	100,000	102,779	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	205,652	2026/7/10
三井物産	第64回社債間限定同順位特約付	2.36	100,000	110,488	2027/5/21
三井物産	第71回社債間限定同順位特約付	1.187	100,000	105,524	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	105,742	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	99,916	2027/7/26
クレディセゾン	第50回社債間限定同順位特約付	0.904	100,000	101,495	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	99,994	2027/7/30
クレディセゾン	第76回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	98,523	2029/7/31
イオン	第20回社債間限定同順位特約付	0.82	100,000	101,313	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	101,261	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	100,070	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	202,446	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	111,666	2027/7/27
三菱東京UFJ銀行	第23回劣後特約付	2.91	100,000	116,536	2029/10/16
三菱東京UFJ銀行	第24回劣後特約付	2.27	100,000	112,582	2030/9/27
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	303,225	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	101,277	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	104,794	2030/5/29
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	199,608	2026/1/27
セブン銀行	第11回社債間限定同順位特約付	0.536	100,000	101,018	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	302,010	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	202,124	2024/7/16
みずほ銀行	第7回劣後特約付	2.87	100,000	109,949	2026/11/6

銘柄	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
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	199,566	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	299,769	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	198,708	2028/1/20
NTTファイナンス	第2回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	100,054	2026/12/18
NTTファイナンス	第16回日本電信電話保証付	0.18	100,000	99,956	2025/12/19
NTTファイナンス	第17回日本電信電話保証付	0.28	200,000	199,612	2027/12/20
NTTファイナンス	第18回日本電信電話保証付	0.38	300,000	299,874	2030/9/20
東京センチュリー	第33回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	98,947	2028/4/27
ホンダファイナンス	第69回社債間限定同順位特約付	0.09	200,000	198,912	2026/6/19
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	99,781	2027/10/22
トヨタファイナンス	第96回社債間限定同順位特約付	0.06	800,000	797,080	2026/4/15
リコーリース	第28回社債間限定同順位特約付	0.345	100,000	99,786	2027/7/20
イオンフィナンシャルサービス	第6回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	100,006	2024/5/28
アコム	第77回特定社債間限定同順位特約付	0.274	100,000	100,082	2023/8/30
アコム	第78回特定社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	100,024	2026/8/28
ジャックス	第19回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,058	2023/6/15
オリエントコーポレーション	第32回社債間限定同順位特約付	0.55	100,000	98,670	2032/1/20
日立キャピタル	第61回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	100,083	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	98,412	2029/10/19
オリックス	第202回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	98,466	2031/4/21
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	99,601	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	300,000	300,291	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	100,316	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	296,901	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	101,798	2025/8/12
大和証券グループ本社	第36回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	99,567	2026/6/2
三井住友海上火災保険	第7回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,641	2026/11/13
三井不動産	第71回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	198,802	2030/4/16
三菱地所	第93回担保提供制限等財務上特約無	2.555	200,000	227,946	2028/7/28
三菱地所	第120回担保提供制限等財務上特約無	0.24	100,000	99,786	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	100,109	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	94,834	2039/7/19
エヌ・ティ・ティ都市開発	第15回社債間限定同順位特約付	1.25	100,000	105,714	2028/9/20
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	101,163	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	113,371	2028/3/17
積水ハウス・S I レジデンシャル投資法人	第5回特定投資法人債	0.871	100,000	101,281	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	99,680	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	201,626	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	108,394	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	200,456	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	210,634	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	99,861	2037/5/29
京成電鉄	第58回社債間限定同順位特約付	0.001	200,000	199,156	2024/8/30
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	227,488	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	113,006	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	105,624	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	109,692	2045/1/27
東日本旅客鉄道	第119回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	99,867	2027/1/27

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
東日本旅客鉄道	第133回社債間限定同順位特約付	1.246	100,000	101,700	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	173,784	2059/12/23
東日本旅客鉄道	第147回社債間限定同順位特約付	0.265	100,000	99,413	2030/4/22
東日本旅客鉄道	第153回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	99,074	2030/7/19
東日本旅客鉄道	第164回社債間限定同順位特約付	0.245	100,000	98,982	2031/4/15
東日本旅客鉄道	第165回社債間限定同順位特約付	0.596	100,000	96,081	2041/4/15
東日本旅客鉄道	第167回社債間限定同順位特約付	0.978	100,000	92,153	2061/4/15
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	110,271	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	334,011	2027/12/20
西日本旅客鉄道	第60回社債間限定同順位特約付	0.255	200,000	198,578	2030/5/21
西日本旅客鉄道	第65回社債間限定同順位特約付	0.24	200,000	198,206	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	194,052	2040/8/27
西日本旅客鉄道	第77回社債間限定同順位特約付	0.961	100,000	91,712	2061/4/22
東海旅客鉄道	第17回社債間限定同順位特約付	2.21	200,000	210,050	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	229,368	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	108,846	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	317,100	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	114,516	2045/3/6
東京地下鉄	第22回	0.215	100,000	99,845	2027/6/21
東京地下鉄	第23回	0.661	100,000	100,294	2037/6/19
東京地下鉄	第24回	1.035	100,000	100,923	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	198,870	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	102,085	2031/3/4
阪急阪神ホールディングス	第47回	1.202	400,000	422,452	2029/7/18
阪急阪神ホールディングス	第49回	0.817	100,000	100,920	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	102,597	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	99,577	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	97,994	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	109,447	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	100,299	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	189,370	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	94,444	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	93,594	2036/6/9
滋澤倉庫	第8回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	99,692	2023/6/14
KDDI	第20回社債間限定同順位特約付	0.803	100,000	101,150	2023/12/20
KDDI	第25回社債間限定同順位特約付	0.395	100,000	100,120	2028/11/22
ソフトバンク	第11回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	99,385	2026/6/3
ソフトバンク	第12回社債間限定同順位特約付	0.42	200,000	197,650	2028/6/2
ソフトバンク	第14回社債間限定同順位特約付	0.24	100,000	98,963	2026/10/9
ソフトバンク	第16回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	97,950	2031/10/10
電源開発	第40回社債間限定同順位特約付	0.889	100,000	101,621	2024/6/20
電源開発	第41回社債間限定同順位特約付	0.782	100,000	101,477	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	100,489	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	100,076	2028/9/20
電源開発	第73回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	197,158	2031/5/20
東京瓦斯	第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	121,129	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	92,195	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	89,955	2049/6/4

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
大阪瓦斯 第43回社債間限定同順位特約付	0.851	200,000	189,250	2051/6/2
北海道瓦斯 第17回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	100,024	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	97,201	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	99,643	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	99,916	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	100,285	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	100,121	2024/6/12
フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 第29回円貨社債	0.25	200,000	199,214	2024/10/10
フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 第31回円貨社債	0.423	100,000	97,713	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	99,322	2026/6/17
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第6回非上位円貨社債	1.258	200,000	202,802	2024/1/25
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第4回非上位円貨社債	1.258	200,000	202,822	2024/1/25
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第25回非上位円貨社債	0.302	200,000	196,942	2026/12/16
クレディ・アグリコル・エス・エー 第6回円貨社債 (2014)	0.865	100,000	100,657	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	99,690	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	98,004	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	100,338	2025/6/5
エイチエスピーシー・ホールディングス・ビーエルシー 第2回円	0.842	100,000	100,542	2023/9/26
エイチエスピーシー・ホールディングス・ビーエルシー 第3回円	1.207	100,000	101,495	2026/9/25
ロイズ・バンキング・グループ・ビーエルシー 第6回円貨社債	0.65	100,000	100,278	2023/5/30
ロイズ・バンキング・グループ・ビーエルシー 第7回円貨社債	0.968	100,000	98,970	2028/5/30
サンタンデール銀行 第1回円貨社債	0.463	100,000	99,718	2024/12/5
フランス電力 第4回円貨社債 (2017)	1.088	100,000	98,298	2027/1/26
現代キャピタル・サービシズ・インク 第15回円貨社債	0.65	200,000	198,894	2023/8/2
ビー・エヌ・ビー・パリバ 第1回円貨社債 (2017)	0.967	100,000	100,514	2024/3/1
ウエストパック・バンキング・コーポレーション 第12回円貨社	0.32	200,000	200,052	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	200,026	2024/1/23
小 計		40,705,000	40,993,825	
合 計		802,409,209	831,900,264	

* 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 (2021年4月1日～2022年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,723,401,519
受取利息	5,724,911,537
支払利息	△ 1,510,018
(B) 有価証券売買損益	△ 16,033,601,285
売買益	164,384,768
売買損	△ 16,197,986,053
(C) 当期損益金(A+B)	△ 10,310,199,766
(D) 前期繰越損益金	180,400,353,686
(E) 追加信託差損益金	45,850,802,345
(F) 解約差損益金	△ 19,130,270,780
(G) 計(C+D+E+F)	196,810,685,485
次期繰越損益金(G)	196,810,685,485

* 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。