

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5期（決算日 2024年9月10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、2024年9月10日に第5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 総合連動型上場投信」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 期 金 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
5期(2024年9月10日)	12,261			0	96.1	8,591

(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

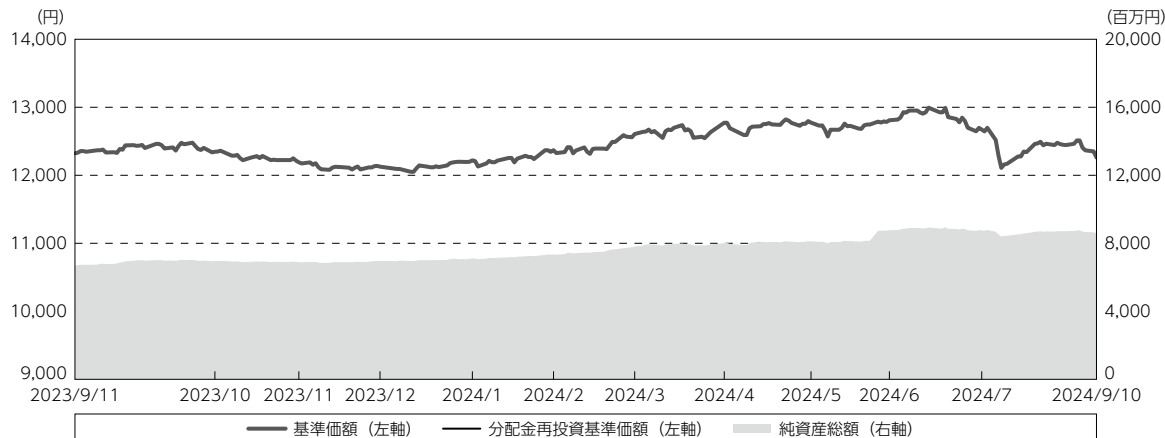
年 月 日	基 準	価 額		投 資 信 託 証 組 入 比 率
		騰 落	率	
(期 首) 2023年9月11日	円 12,323		% —	% 96.7
9月末	12,440		0.9	96.4
10月末	12,346		0.2	97.0
11月末	12,191		△1.1	96.7
12月末	12,127		△1.6	96.3
2024年1月末	12,220		△0.8	97.2
2月末	12,369		0.4	97.2
3月末	12,607		2.3	96.6
4月末	12,773		3.7	97.0
5月末	12,774		3.7	96.7
6月末	12,809		3.9	97.2
7月末	12,672		2.8	96.4
8月末	12,444		1.0	96.3
(期 末) 2024年9月10日	12,261		△0.5	96.1

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

（2023年9月12日～2024年9月10日）

期中の基準価額等の推移



期 首：12,323円

期 末：12,261円 (既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 0.5% (分配金再投資ベース)

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

(注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。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（2023年9月11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おりません。

○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（2023年9月12日～2024年9月10日）は－0.5%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は若干のプラスとなりましたが、運用報酬等がマイナスに寄与しました。

投資環境

2023年は、市場の大幅なボラティリティと、サプライズの連続に見舞われました。年初は「債券の年」になると予想されていましたが、債券市場は軟調な展開となりました。金利上昇は経済を後退させると予想されましたが、大きな危機は起こりませんでした。AIの進歩に牽引されたグロース株は好調なパフォーマンスを見せましたが、バリュー株や金およびTIPS（インフレ連動債）のようなインフレヘッジ資産はアンダーパフォームしました。株式市場は堅調でしたが、中東を中心とする地政学的緊張と財政政策への懸念がマクロ経済に暗い影を落としました。

11月に入ると、FRB（米連邦準備制度理事会）がハト派的なスタンスを示唆し、株式と債券の上昇を引き起こしたため、市場心理は劇的に変化しました。この変化はいわゆる「エブリシング・ラリー（すべての資産の価格が上昇）」につながり、それまでの高金利長期化懸念にもかかわらずリスク資産が急騰しました。

FRBが深刻な景気減速を引き起こすことなく「ソフトランディング」を成功させたとの見方に後押しされ、市場は大幅な上昇で年を越しました。

2024年半ばまで、市場は楽観的な見方を維持し、株式も債券もプラスの勢いを続けました。しかし、インフレ懸念が再燃し、特に日銀の利上げが世界市場に影響を与えたため、市場は一時的に調整しました。こうした課題にもかかわらず、株式は小型株や出遅れセクターへのローテーションに牽引され、堅調を維持しました。

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ポートフォリオの戦略別米ドルベース・リターンの詳細は以下になります。

なお、DBiポートフォリオでは為替ヘッジを行っているため、米ドルベース・リターンに加えて、主に通貨間の金利差に起因するヘッジコスト／プレミアムが生じます。今期はこの要因がポートフォリオの最終的な日本円ベース・リターンにとってマイナスとなりました。

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・ポートフォリオのリターンはドルベースで約+7.3%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、レバティフ・バリュエ、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。

2023年末から2024年前半にかけて、当ポートフォリオのパフォーマンスは、株式ロング・エクスポージャーの増加と戦略的ヘッジによって形成されました。2023年末時点で、当ポートフォリオは慎重なポジションをとっていましたが、株式のロング・エクスポージャーが、特に年末の相場上昇時にリターンの主要な原動力となりました。金利上昇に対するヘッジは2023年初から10月ごろまで効果的でしたが、年末にかけて市場環境が変化するにつれてパフォーマンス低下の要因となりました。2024年初には、当ポートフォリオのグロス株式エクスポージャーは着実に増加しました。2024年3月末には、株式エクスポージャーは40%前後と、より「通常」の水準に戻り、過去数年の最低水準から倍増しましたが、コロナ後の金融主導相場のピークを大きく下回る水準にとどまりました。加えて、当ポートフォリオは米ドルのロング・ポジションを取り、さらに米国の潜在的なインフレ再燃に対するプロテクションを提供しました。株式エクスポージャーの増加は、当期末までの当ポートフォリオの利益を押し上げました。米国の利下げ観測が7月に本格化したため、米ドルのポジションはパフォーマンス低下要因となりました。

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ポートフォリオのリターンはドルベースで約+3.3%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。

2023年後半から2024年半ばにかけて、当ポートフォリオは市場心理の急激な変化と頻繁な反転を特徴とする不安定な時期を経験しました。価格の激しい上下動が見られた2023年は、日本円のショート・ポジションから利益を得ましたが、株式と金利のポジションが損失となり苦戦しました。2024年第1四半期には、株式ロング・ポジションへの転換と米ドルのロング・ポジションにより、当ポートフォリオは大きく反発し、大部分の先物で力強いパフォーマンスを達成しました。

好調なパフォーマンスは第2四半期まで続き、当ポートフォリオの中核となる先物ポジションに焦点を絞った簡素化されたアプローチによって、特に円などの通貨から利益の大部分を獲得しました。2024年半ばまでに、当ポートフォリオは株式のロング・エクスポージャーを減らし、米国債のショート・ポジションを拡大し、通貨ポジションを再び強化しました。

7月は円と米国債の反転による損失に直面し、継続する市場のボラティリティに対応するため、8月初旬までに大幅なリスク抑制を行いました。こうした試練にもかかわらず、当戦略は適応力を維持し、期間を通じて分散投資のメリットを提供しました。

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 5 期
	2023年 9 月12日～ 2024年 9 月10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	2,260

（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

(2023年 9 月12日～2024年 9 月10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)	(75)	(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	6	0.051	(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)	(5)	(0.041)	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	88	0.709	
期中の平均基準価額は、12,481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。

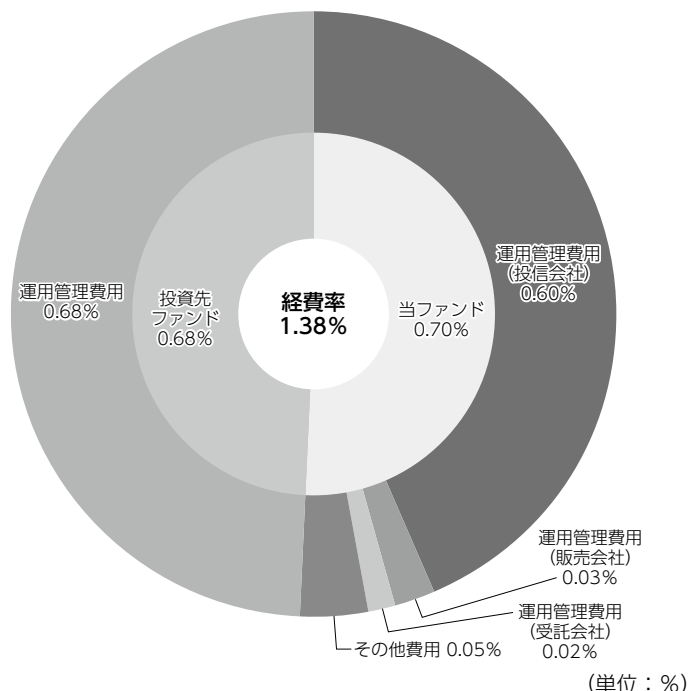
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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1.38%です。



経費率 (①+②)	1.38
①当ファンドの費用の比率	0.70
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

(2023年9月12日～2024年9月10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	口 13,956	千円 1,810,000	口 —	千円 —

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2023年9月12日～2024年9月10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

(2023年9月12日～2024年9月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2024年9月10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		口 30	口 30	千円 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		50,860	64,816	8,257,935	96.1
合計		50,890	64,846	8,257,962	96.1

(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

(2024年9月10日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
投資信託受益証券	千円 8,257,962	% 95.7
コール・ローン等、その他	370,149	4.3
投資信託財産総額	8,628,111	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（2024年9月10日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,628,111,265
コール・ローン等	370,148,285
投資信託受益証券（評価額）	8,257,962,878
未収配当金	102
(B) 負債	36,468,947
未払解約金	7,587,270
未払信託報酬	27,319,552
その他未払費用	1,562,125
(C) 純資産総額（A－B）	8,591,642,318
元本	7,007,435,019
次期繰越損益金	1,584,207,299
(D) 受益権総口数	7,007,435,019口
1万口当たり基準価額（C／D）	12.261円

（注）当ファンドの期首元本額は5,425,549,505円、期中追加設定元本額は2,172,687,101円、期中一部解約元本額は590,801,587円です。

（注）1口当たり純資産額は1.2261円です。

○損益の状況（2023年9月12日～2024年9月10日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	147
受取配当金	147
(B) 有価証券売買損益	△ 27,093,047
売買益	2,412,766
売買損	△ 29,505,813
(C) 信託報酬等	△ 54,212,514
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 81,305,414
(E) 前期繰越損益金	321,974,757
(F) 追加信託差損益金	1,343,537,956
（配当等相当額）	（ 946,286,155）
（売買損益相当額）	（ 397,251,801）
(G) 計（D＋E＋F）	1,584,207,299
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金（G＋H）	1,584,207,299
追加信託差損益金	1,343,537,956
（配当等相当額）	（ 946,286,155）
（売買損益相当額）	（ 397,251,801）
分配準備積立金	620,295,173
繰越損益金	△ 379,625,830

（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（963,912,126円）および分配準備積立金（620,295,173円）より分配対象収益は1,584,207,299円（1万口当たり2,260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	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。 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。 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。 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。 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。 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。
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

(2024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	エクスポートジャー(USD)		エクスポートジャー(%)			
		グロス	ネット	グロス	ネット		
通貨	Short	35,056,562.50	(35,056,562.50)	57.15%	(57.15)%		
	銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートジャー	ネット・エクスポートジャー	グロス・エクスポートジャー(%)	ネット・エクスポートジャー(%)
	EUR/USD CME	06/17/2024	Short	19,287,125.00	(19,287,125.00)	31.44%	(31.44)%
	JAPANESE YEN CME	06/17/2024	Short	15,769,437.50	(15,769,437.50)	25.71%	(25.71)%
	小計			35,056,562.50	(35,056,562.50)	57.15%	(57.15)%
エネルギー			Long	4,285,840.00	4,285,840.00	6.99%	6.99%
	銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートジャー	ネット・エクスポートジャー	グロス・エクスポートジャー(%)	ネット・エクスポートジャー(%)
	CRUDE OIL	05/21/2024	Long	4,285,840.00	4,285,840.00	6.99%	6.99%
	小計			4,285,840.00	4,285,840.00	6.99%	6.99%
金融			Long	38,694,050.00	38,694,050.00	63.08%	63.08%
	銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートジャー	ネット・エクスポートジャー	グロス・エクスポートジャー(%)	ネット・エクスポートジャー(%)
	THREE-MONTH SOFR	12/16/2025	Long	36,285,300.00	36,285,300.00	59.16%	59.16%
	US T. BOND	06/20/2024	Long	2,408,750.00	2,408,750.00	3.93%	3.93%
	小計			38,694,050.00	38,694,050.00	63.08%	63.08%
金融			Short	37,581,343.75	(37,581,343.75)	61.27%	(61.27)%
	銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートジャー	ネット・エクスポートジャー	グロス・エクスポートジャー(%)	ネット・エクスポートジャー(%)
	2 YR T-NOTE	06/28/2024	Short	24,333,640.63	(24,333,640.63)	39.67%	(39.67)%
	US 10 YR NOTES	06/20/2024	Short	8,309,765.63	(8,309,765.63)	13.55%	(13.55)%
	US T. BOND	06/20/2024	Short	4,937,937.50	(4,937,937.50)	8.05%	(8.05)%
	小計			37,581,343.75	(37,581,343.75)	61.27%	(61.27)%
インデックス			Long	43,541,052.00	43,541,052.00	70.98%	70.98%
	銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートジャー	ネット・エクスポートジャー	グロス・エクスポートジャー(%)	ネット・エクスポートジャー(%)
	DOLLAR INDEX	06/17/2024	Long	6,047,602.00	6,047,602.00	9.86%	9.86%
	E MINI RUSSELL	06/21/2024	Long	1,394,835.00	1,394,835.00	2.27%	2.27%
	EMINI MSCI EAFE	06/21/2024	Long	22,274,595.00	22,274,595.00	36.31%	36.31%
	EMINI MSCI EM	06/21/2024	Long	2,150,450.00	2,150,450.00	3.51%	3.51%
	EMINI NASDAQ	06/21/2024	Long	4,434,000.00	4,434,000.00	7.23%	7.23%
	EMINI S&P	06/21/2024	Long	4,777,650.00	4,777,650.00	7.79%	7.79%
	MINI MIDCA	06/21/2024	Long	2,461,920.00	2,461,920.00	4.01%	4.01%
	小計			43,541,052.00	43,541,052.00	70.98%	70.98%
インデックス			Short	839,200.00	(839,200.00)	1.37%	(1.37)%
	銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートジャー	ネット・エクスポートジャー	グロス・エクスポートジャー(%)	ネット・エクスポートジャー(%)
	EMINI MSCI EM	06/21/2024	Short	839,200.00	(839,200.00)	1.37%	(1.37)%
	小計			839,200.00	(839,200.00)	1.37%	(1.37)%
貴金属			Long	4,700,640.00	4,700,640.00	7.66%	7.66%
	銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートジャー	ネット・エクスポートジャー	グロス・エクスポートジャー(%)	ネット・エクスポートジャー(%)
	GOLD CMX	06/26/2024	Long	4,700,640.00	4,700,640.00	7.66%	7.66%
	小計			4,700,640.00	4,700,640.00	7.66%	7.66%
総合計				164,698,688.25	17,744,475.75	268.51%	28.93%

注) グロス・エクスポートジャーは、ロング・エクスポートジャーとショート・エクスポートジャーの絶対値を合計したものです。ネット・エクスポートジャーは、ロング・エクスポートジャーとショート・エクスポート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トジャーを除いています。

◎貸借対照表

(2024年 3 月31日現在)

資産

投資有価証券の公正価額（取得原価 \$ 49,730,893）	\$	49,730,893
デリバティブ契約の公正価額		1,261,114
現金及び現金相当		2,883,863
ブローカーからの未収金		9,273,413
その他資産		97,830

資産合計

63,247,113

負債

負債

デリバティブ契約の公正価額	\$	1,854,022
未払いマネジメントフィー		32,878
未払い費用		21,150

負債合計

1,908,050

純資産

\$ 61,339,063

◎損益計算書

2023年4月1日から2024年3月31日までの期間

投資収入

金利	\$	3,098,992
----	----	-----------

支出

マネジメントフィー	(389,160)
管理費用	(25,474)
取締役報酬	(23,963)
利息	(89,075)
プロフェッショナルフィー他	(76,265)

支出合計	(603,937)
------	-----------

投資マネージャーが負担する支出	105,898
-----------------	---------

純支出	(498,039)
-----	-----------

純投資収益	2,600,953
-------	-----------

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 \$ 210,708を控除）	(5,965,294)
---------------------------------------	-------------

デリバティブ契約にかかる純含み変動額	(2,005,882)
--------------------	-------------

デリバティブ契約にかかる純損失	(7,971,176)
-----------------	-------------

オペレーションの結果による純資産減少額	\$ (5,370,223)
---------------------	----------------

＜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(2024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(2024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	177,718,130,461	223,907,072,567	
	小計	銘柄数:1 組入時価比率:100.0%	177,718,130,461	223,907,072,567 100.0%	
	合計			223,907,072,567	

(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12期 自 2023年3月8日 至 2023年9月7日	第13期 自 2023年9月8日 至 2024年3月7日
営業収益		
受取利息	1	-
有価証券売買等損益	△95,167,725	587,010,317
営業収益合計	△95,167,724	587,010,317
営業費用		
支払利息	9,662	14,160
受託者報酬	6,640,380	12,804,481
委託者報酬	16,600,904	32,011,135
その他費用	6,326,919	20,573,492
営業費用合計	29,577,865	65,403,268
営業利益又は営業損失(△)	△124,745,589	521,607,049
経常利益又は経常損失(△)	△124,745,589	521,607,049
当期純利益又は当期純損失(△)	△124,745,589	521,607,049
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(△)	△4,004,119,317	△4,590,713,906
剰余金増加額又は欠損金減少額	421,971,600	297,283,000
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	421,971,600	297,283,000
剰余金減少額又は欠損金増加額	681,500,600	13,462,293,900
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	681,500,600	13,462,293,900
分配金	202,320,000	362,325,000
期末剰余金又は期末欠損金(△)	△4,590,713,906	△17,596,442,757

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第12期 自 2023年 3月 8日 至 2023年 9月 7日			第13期 自 2023年 9月 8日 至 2024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	△9,661 円	当期配当等収益額	A	△14,160 円
観ファンドの配当等収益額	B	227,949,454 円	観ファンドの配当等収益額	B	438,467,295 円
分配準備積立金	C	5,685,175 円	分配準備積立金	C	1,736,765 円
配当等収益合計額	D=A+B+C	233,624,968 円	配当等収益合計額	D=A+B+C	440,189,900 円
経費	E	29,568,203 円	経費	E	65,389,108 円
収益分配可能額	F=D-E	204,056,765 円	収益分配可能額	F=D-E	374,800,792 円
収益分配金	G	202,320,000 円	収益分配金	G	362,325,000 円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	1,736,765 円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	12,475,792 円
口数	I	67,440,000 口	口数	I	241,550,000 口
100 口当たり分配金	J=G/I×100	300 円	100 口当たり分配金	J=G/I×100	150 円
2. その他費用 その他費用のうち 2,338,307 円は上場に係る費用、 3,324,591 円は対象指数についての商標使用料であります。			2. その他費用 その他費用のうち 12,890,924 円は上場に係る費用、 6,402,181 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

(2023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437回	0.005	1,000,000	1,001,570	2024/6/1
国庫債券	利付(2年)第438回	0.005	5,500,000	5,508,525	2024/7/1
国庫債券	利付(2年)第439回	0.005	4,000,000	4,006,360	2024/8/1
国庫債券	利付(2年)第442回	0.005	3,000,000	3,005,220	2024/11/1
国庫債券	利付(2年)第443回	0.005	2,500,000	2,504,575	2024/12/1
国庫債券	利付(2年)第444回	0.005	1,000,000	1,001,830	2025/1/1
国庫債券	利付(5年)第140回	0.1	5,100,000	5,113,311	2024/6/20
国庫債券	利付(5年)第141回	0.1	9,600,000	9,628,128	2024/9/20
国庫債券	利付(5年)第142回	0.1	1,200,000	1,204,008	2024/12/20
国庫債券	利付(5年)第143回	0.1	6,070,000	6,092,641	2025/3/20
国庫債券	利付(5年)第144回	0.1	4,400,000	4,417,556	2025/6/20
国庫債券	利付(5年)第145回	0.1	3,900,000	3,916,848	2025/9/20
国庫債券	利付(5年)第146回	0.1	5,100,000	5,122,848	2025/12/20
国庫債券	利付(5年)第147回	0.005	5,600,000	5,609,912	2026/3/20
国庫債券	利付(5年)第148回	0.005	7,300,000	7,311,680	2026/6/20
国庫債券	利付(5年)第149回	0.005	4,100,000	4,104,264	2026/9/20
国庫債券	利付(5年)第150回	0.005	6,300,000	6,301,134	2026/12/20
国庫債券	利付(5年)第151回	0.005	5,500,000	5,496,700	2027/3/20
国庫債券	利付(5年)第152回	0.1	4,000,000	4,012,640	2027/3/20
国庫債券	利付(5年)第153回	0.005	11,500,000	11,482,980	2027/6/20
国庫債券	利付(5年)第154回	0.1	5,500,000	5,509,790	2027/9/20
国庫債券	利付(5年)第155回	0.3	1,500,000	1,515,855	2027/12/20
国庫債券	利付(5年)第156回	0.2	2,000,000	2,010,800	2027/12/20
国庫債券	利付(40年)第1回	2.4	1,860,000	2,345,013	2048/3/20
国庫債券	利付(40年)第2回	2.2	2,700,000	3,283,200	2049/3/20
国庫債券	利付(40年)第3回	2.2	900,000	1,094,481	2050/3/20
国庫債券	利付(40年)第4回	2.2	1,630,000	1,985,812	2051/3/20
国庫債券	利付(40年)第5回	2.0	1,300,000	1,528,436	2052/3/20
国庫債券	利付(40年)第6回	1.9	2,300,000	2,654,798	2053/3/20
国庫債券	利付(40年)第7回	1.7	2,000,000	2,210,760	2054/3/20
国庫債券	利付(40年)第8回	1.4	1,500,000	1,542,570	2055/3/20
国庫債券	利付(40年)第9回	0.4	4,550,000	3,457,499	2056/3/20
国庫債券	利付(40年)第10回	0.9	2,110,000	1,877,963	2057/3/20
国庫債券	利付(40年)第11回	0.8	1,750,000	1,501,762	2058/3/20
国庫債券	利付(40年)第12回	0.5	2,070,000	1,590,153	2059/3/20
国庫債券	利付(40年)第13回	0.5	4,070,000	3,113,305	2060/3/20
国庫債券	利付(40年)第14回	0.7	3,960,000	3,232,785	2061/3/20
国庫債券	利付(40年)第15回	1.0	2,700,000	2,412,504	2062/3/20
国庫債券	利付(10年)第334回	0.6	6,600,000	6,657,354	2024/6/20
国庫債券	利付(10年)第335回	0.5	5,600,000	5,649,280	2024/9/20
国庫債券	利付(10年)第336回	0.5	1,750,000	1,767,885	2024/12/20
国庫債券	利付(10年)第337回	0.3	3,000,000	3,020,340	2024/12/20
国庫債券	利付(10年)第338回	0.4	9,000,000	9,086,580	2025/3/20
国庫債券	利付(10年)第339回	0.4	7,000,000	7,074,480	2025/6/20
国庫債券	利付(10年)第340回	0.4	4,200,000	4,249,266	2025/9/20
国庫債券	利付(10年)第341回	0.3	5,900,000	5,958,528	2025/12/20

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 (10年) 第342回	0.1	4,550,000	4,570,884	2026/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第343回	0.1	6,000,000	6,027,960	2026/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第344回	0.1	6,400,000	6,427,712	2026/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第345回	0.1	7,000,000	7,025,970	2026/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第346回	0.1	8,600,000	8,627,176	2027/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第347回	0.1	12,000,000	12,030,240	2027/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第348回	0.1	6,800,000	6,812,104	2027/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第349回	0.1	4,800,000	4,804,464	2027/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第350回	0.1	10,150,000	10,152,436	2028/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第351回	0.1	6,500,000	6,498,310	2028/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第352回	0.1	5,400,000	5,394,114	2028/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第353回	0.1	2,500,000	2,495,725	2028/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第354回	0.1	1,850,000	1,845,079	2029/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第355回	0.1	1,900,000	1,892,970	2029/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第356回	0.1	1,800,000	1,790,784	2029/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第357回	0.1	3,500,000	3,477,950	2029/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第358回	0.1	4,470,000	4,436,251	2030/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第359回	0.1	6,200,000	6,142,774	2030/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第360回	0.1	9,000,000	8,901,000	2030/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第361回	0.1	10,000,000	9,864,000	2030/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第362回	0.1	8,700,000	8,561,322	2031/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第363回	0.1	9,950,000	9,770,800	2031/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第364回	0.1	10,150,000	9,957,657	2031/9/20
国庫債券	利付 (10年) 第365回	0.1	10,000,000	9,805,100	2031/12/20
国庫債券	利付 (10年) 第366回	0.2	1,800,000	1,782,720	2032/3/20
国庫債券	利付 (10年) 第367回	0.2	7,000,000	6,971,580	2032/6/20
国庫債券	利付 (10年) 第369回	0.5	6,500,000	6,610,175	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第1回	2.8	2,000,000	2,336,400	2029/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第2回	2.4	500,000	575,095	2030/2/20
国庫債券	利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	183,486	2030/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第4回	2.9	1,400,000	1,678,502	2030/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	172,752	2031/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第6回	2.4	600,000	705,432	2031/11/20
国庫債券	利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	704,742	2032/5/20
国庫債券	利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	113,202	2032/11/22
国庫債券	利付 (30年) 第9回	1.4	265,000	289,780	2032/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	266,125	2033/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第11回	1.7	660,000	741,642	2033/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第12回	2.1	720,000	838,735	2033/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第13回	2.0	1,090,000	1,260,127	2033/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第14回	2.4	1,800,000	2,159,892	2034/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第15回	2.5	2,000,000	2,426,020	2034/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第16回	2.5	1,415,000	1,720,017	2034/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第17回	2.4	1,500,000	1,809,390	2034/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第18回	2.3	2,200,000	2,632,080	2035/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	2,050,000	2,457,765	2035/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	1,270,000	1,555,267	2035/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	300,000	360,888	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	737,100	2036/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	1,840,000	2,265,242	2036/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	863,016	2036/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	603,885	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	1,039,065	2037/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	2,950,000	3,654,696	2037/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	1,500,000	1,860,615	2038/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	2,000,000	2,460,720	2038/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	2,500,000	3,041,525	2039/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,700,000	2,043,298	2039/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	2,500,000	3,046,400	2040/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,400,000	2,809,056	2040/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	2,800,000	3,368,008	2041/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	2,694,197	2041/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	2,000,000	2,344,940	2042/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,656,753	2042/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,600,000	1,819,040	2043/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,400,000	1,615,936	2043/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,300,000	1,476,683	2043/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	1,500,000	1,675,860	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	1,600,000	1,786,336	2044/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,300,000	1,451,632	2044/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,563,506	2044/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,700,000	1,832,022	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,800,000	1,939,356	2045/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,700,000	1,863,370	2045/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,900,000	2,006,286	2045/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	2,900,000	3,060,892	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	2,400,000	2,241,288	2046/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第51回	0.3	3,650,000	3,031,544	2046/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第52回	0.5	2,200,000	1,911,008	2046/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第53回	0.6	1,700,000	1,507,509	2046/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第54回	0.8	1,700,000	1,574,914	2047/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第55回	0.8	1,500,000	1,386,120	2047/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第56回	0.8	1,700,000	1,566,941	2047/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第57回	0.8	1,600,000	1,470,992	2047/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第58回	0.8	2,100,000	1,923,852	2048/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第59回	0.7	1,600,000	1,427,184	2048/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第60回	0.9	1,150,000	1,072,248	2048/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第61回	0.7	1,500,000	1,329,105	2048/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第62回	0.5	3,000,000	2,517,030	2049/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第63回	0.4	3,000,000	2,441,070	2049/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第64回	0.4	3,300,000	2,675,640	2049/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第65回	0.4	2,200,000	1,780,900	2049/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第66回	0.4	2,000,000	1,610,100	2050/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第67回	0.6	3,500,000	2,968,700	2050/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第68回	0.6	2,450,000	2,073,508	2050/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第69回	0.7	2,200,000	1,909,644	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	2,610,000	2,261,016	2051/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第71回	0.7	2,400,000	2,077,008	2051/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第72回	0.7	1,700,000	1,471,248	2051/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第73回	0.7	2,000,000	1,727,400	2051/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第74回	1.0	1,800,000	1,682,838	2052/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第75回	1.3	2,000,000	2,012,780	2052/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第76回	1.4	2,000,000	2,064,600	2052/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第77回	1.6	1,500,000	1,620,765	2052/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第70回	2.4	540,000	556,502	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第71回	2.2	200,000	205,626	2024/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第72回	2.1	1,470,000	1,517,466	2024/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第73回	2.0	1,200,000	1,243,176	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第74回	2.1	800,000	830,160	2024/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第75回	2.1	600,000	625,818	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第76回	1.9	910,000	945,581	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第77回	2.0	700,000	728,749	2025/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	835,120	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	899,663	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第80回	2.1	1,400,000	1,467,676	2025/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	378,450	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	864,050	2025/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,450,665	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,267,392	2025/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	425,568	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第86回	2.3	1,700,000	1,818,762	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	533,445	2026/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,183,204	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	504,037	2026/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,615,755	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	270,160	2026/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第92回	2.1	650,000	700,706	2026/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第93回	2.0	2,300,000	2,480,251	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第94回	2.1	3,700,000	4,004,621	2027/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第95回	2.3	3,100,000	3,394,686	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第96回	2.1	2,400,000	2,607,960	2027/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第97回	2.2	2,300,000	2,519,213	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第98回	2.1	1,300,000	1,418,105	2027/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第99回	2.1	1,100,000	1,204,654	2027/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第100回	2.2	820,000	905,460	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第101回	2.4	250,000	278,525	2028/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第102回	2.4	1,500,000	1,678,935	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	668,460	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	441,492	2028/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,104,839	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	445,296	2028/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第107回	2.1	800,000	889,656	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第108回	1.9	1,600,000	1,761,152	2028/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	993,942	2029/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券		%	千円	千円	
国庫債券	利付 (20年) 第110回	2.1	2,600,000	2,902,146	2029/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第111回	2.2	800,000	900,960	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第112回	2.1	1,800,000	2,016,072	2029/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第113回	2.1	2,000,000	2,246,860	2029/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第115回	2.2	1,000,000	1,133,640	2029/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,251,052	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第117回	2.1	1,400,000	1,582,630	2030/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第118回	2.0	500,000	563,195	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	889,752	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	878,392	2030/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第121回	1.9	1,200,000	1,346,592	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第122回	1.8	900,000	1,003,338	2030/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第123回	2.1	1,500,000	1,708,095	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第124回	2.0	1,000,000	1,131,170	2030/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第125回	2.2	1,400,000	1,608,712	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第126回	2.0	1,200,000	1,360,212	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第127回	1.9	500,000	562,860	2031/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第128回	1.9	800,000	902,240	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第129回	1.8	1,300,000	1,455,727	2031/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第130回	1.8	2,200,000	2,470,402	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	891,728	2031/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,452,100	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第133回	1.8	1,400,000	1,575,672	2031/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第134回	1.8	1,900,000	2,143,105	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第135回	1.7	700,000	783,468	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	777,378	2032/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,121,500	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	882,904	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第139回	1.6	1,000,000	1,112,560	2032/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第140回	1.7	3,000,000	3,366,420	2032/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第141回	1.7	2,600,000	2,917,434	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第142回	1.8	950,000	1,074,877	2032/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第143回	1.6	2,300,000	2,559,486	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第144回	1.5	1,300,000	1,434,238	2033/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第145回	1.7	3,300,000	3,708,210	2033/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第146回	1.7	3,400,000	3,822,858	2033/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第147回	1.6	4,500,000	5,016,150	2033/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第148回	1.5	4,300,000	4,749,307	2034/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第149回	1.5	4,350,000	4,804,227	2034/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第150回	1.4	4,030,000	4,406,563	2034/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第151回	1.2	3,000,000	3,211,080	2034/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第152回	1.2	2,650,000	2,835,341	2035/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第153回	1.3	2,100,000	2,271,150	2035/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第154回	1.2	2,820,000	3,014,467	2035/9/20
国庫債券	利付 (20年) 第155回	1.0	3,850,000	4,020,054	2035/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第156回	0.4	5,150,000	4,987,105	2036/3/20
国庫債券	利付 (20年) 第157回	0.2	4,540,000	4,270,596	2036/6/20
国庫債券	利付 (20年) 第158回	0.5	3,470,000	3,386,650	2036/9/20

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159回	0.6	3,010,000	2,968,612	2036/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第160回	0.7	2,000,000	1,994,920	2037/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第161回	0.6	3,100,000	3,044,169	2037/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第162回	0.6	1,700,000	1,664,538	2037/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第163回	0.6	2,000,000	1,953,760	2037/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第164回	0.5	3,600,000	3,455,676	2038/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第165回	0.5	2,700,000	2,584,872	2038/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第166回	0.7	2,300,000	2,262,096	2038/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第167回	0.5	2,600,000	2,473,822	2038/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第168回	0.4	3,200,000	2,987,104	2039/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第169回	0.3	4,430,000	4,053,893	2039/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第170回	0.3	4,300,000	3,918,762	2039/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第171回	0.3	4,500,000	4,086,900	2039/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第172回	0.4	3,340,000	3,073,868	2040/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第173回	0.4	4,250,000	3,895,507	2040/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第174回	0.4	6,970,000	6,367,095	2040/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第175回	0.5	5,500,000	5,093,770	2040/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第176回	0.5	6,020,000	5,557,423	2041/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第177回	0.4	5,070,000	4,583,634	2041/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第178回	0.5	4,250,000	3,903,540	2041/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第179回	0.5	5,000,000	4,584,200	2041/12/20
国庫債券	利付 (20年) 第180回	0.8	2,000,000	1,931,620	2042/ 3 /20
国庫債券	利付 (20年) 第181回	0.9	2,500,000	2,453,775	2042/ 6 /20
国庫債券	利付 (20年) 第182回	1.1	1,500,000	1,521,960	2042/ 9 /20
国庫債券	利付 (20年) 第183回	1.4	1,500,000	1,598,805	2042/12/20
メキシコ合衆国 第19回円貨社債 (2014)		1.44	200,000	201,594	2024/ 7 /24
ハンガリー円貨債券 (2020) 第8回		0.74	100,000	99,458	2025/ 9 /18
小 計			717,490,000	727,245,958	
地方債証券					
東京都	公募第736回	0.505	100,000	100,698	2024/ 9 /20
東京都	公募第745回	0.533	300,000	303,180	2025/ 6 /20
東京都	公募第760回	0.045	100,000	99,775	2026/ 9 /18
東京都	公募第761回	0.075	100,000	99,879	2026/ 9 /18
東京都	公募第769回	0.21	500,000	500,520	2027/ 6 /18
東京都	公募第778回	0.165	100,000	99,681	2028/ 3 /17
東京都	公募第784回	0.254	200,000	199,880	2028/ 9 /20
東京都	公募第813回	0.179	200,000	195,578	2030/12/20
東京都	公募第822回	0.095	130,000	125,200	2031/ 9 /19
東京都	公募第830回	0.275	400,000	387,628	2032/ 6 /18
東京都	公募 (30年) 第7回	2.51	100,000	121,994	2038/ 9 /17
東京都	公募第10回	2.31	200,000	238,866	2039/ 9 /20
東京都	公募第7回	2.16	100,000	105,194	2025/ 9 /19
東京都	公募 (20年) 第13回	2.15	100,000	108,996	2027/12/20
東京都	公募 (20年) 第16回	2.01	200,000	219,368	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第17回	2.09	200,000	220,268	2028/12/20
東京都	公募 (20年) 第20回	2.09	180,000	199,834	2029/ 9 /20
東京都	公募第23回	2.12	100,000	112,221	2030/12/20
東京都	公募 (20年) 第26回	1.74	100,000	109,848	2032/ 6 /18

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券		%	千円	千円	
東京都	公募 (20年) 第28回	1.59	100,000	108,187	2033/3/18
東京都	公募 (20年) 第29回	1.57	200,000	216,836	2033/9/20
東京都	公募 (20年) 第30回	1.508	100,000	108,003	2034/6/20
東京都	公募 (5年) 第31回	0.005	300,000	299,925	2024/6/20
東京都	公募 (5年) 第32回	0.02	300,000	299,766	2025/6/20
北海道	公募平成26年度第13回	0.461	100,000	100,715	2024/12/26
北海道	公募平成27年度第7回	0.529	100,000	101,092	2025/8/28
北海道	公募平成29年度第5回	0.18	200,000	199,788	2027/6/30
北海道	公募平成29年度第7回	0.21	100,000	99,956	2027/8/31
北海道	公募平成29年度第9回	0.205	100,000	99,886	2027/10/27
北海道	公募平成30年度第15回	0.291	238,560	232,295	2038/9/24
北海道	公募平成30年度第18回	0.146	200,000	198,106	2029/2/28
北海道	公募令和2年度第4回	0.165	300,000	294,207	2030/6/26
北海道	公募令和4年度第5回	0.3	100,000	97,049	2032/8/31
宮城県	公募第31回1号	0.515	300,000	303,441	2025/9/29
宮城県	公募第32回2号	0.105	100,000	99,982	2026/9/28
神奈川県	公募第206回	0.654	100,000	100,768	2024/6/20
神奈川県	公募第208回	0.551	100,000	100,642	2024/6/20
神奈川県	公募第210回	0.451	200,000	201,416	2024/12/20
神奈川県	公募第212回	0.42	100,000	100,736	2025/3/19
神奈川県	公募第231回	0.22	200,000	199,952	2027/12/20
神奈川県	公募第243回	0.075	200,000	195,994	2029/12/20
神奈川県	公募第247回	0.12	200,000	195,716	2030/6/20
神奈川県	公募第258回	0.29	100,000	97,079	2032/6/18
神奈川県	公募 (30年) 第3回	2.62	100,000	122,696	2037/3/19
神奈川県	公募第7回	2.22	300,000	324,426	2027/3/19
神奈川県	公募 (20年) 第14回	1.969	100,000	110,915	2030/7/19
神奈川県	公募 (20年) 第17回	1.975	200,000	223,026	2031/7/11
神奈川県	公募 (20年) 第20回	1.706	100,000	109,552	2032/6/18
神奈川県	公募 (20年) 第21回	1.732	200,000	219,570	2032/9/17
神奈川県	公募 (20年) 第26回	1.477	100,000	107,681	2034/6/20
大阪府	公募第384回	0.67	100,000	100,748	2024/5/29
大阪府	公募第387回	0.521	300,000	302,052	2024/8/28
大阪府	公募第389回	0.53	100,000	100,767	2024/10/30
大阪府	公募第396回	0.554	200,000	202,086	2025/5/28
大阪府	公募第417回	0.248	102,000	102,288	2027/2/26
大阪府	公募第423回	0.185	100,000	99,846	2027/8/30
大阪府	公募第429回	0.197	179,000	178,539	2028/2/25
大阪府	公募第452回	0.062	100,000	97,765	2030/1/30
大阪府	公募第467回	0.164	140,000	135,973	2031/4/28
大阪府	公募第469回	0.128	150,000	144,996	2031/6/27
大阪府	公募第479回	0.29	200,000	194,118	2032/5/28
大阪府	公募第481回	0.4	100,000	97,652	2032/9/29
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	112,061	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	110,668	2031/12/22
大阪府	公募 (5年) 第173回	0.001	200,000	199,654	2025/7/30
大阪府	公募 (5年) 第174回	0.001	200,000	199,642	2025/8/28
大阪府	公募 (5年) 第178回	0.001	400,000	399,080	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	398,588	2026/6/29
大阪府 公募（5年）第190回		0.001	200,000	198,854	2026/12/25
京都府 公募平成26年度第5回		1.455	100,000	107,544	2034/8/10
京都府 公募平成26年度第7回		0.564	200,000	201,566	2024/9/19
京都府 公募（20年）平成27年度第5回		1.23	200,000	210,026	2035/8/17
京都府 公募（15年）平成27年度第8回		0.78	100,000	102,363	2030/10/11
京都府 公募（15年）平成28年度第2回		0.21	200,000	195,124	2031/4/22
京都府 公募（20年）平成28年度第5回		0.327	100,000	93,419	2036/8/15
京都府 公募平成29年度第4回		0.19	100,000	100,020	2027/6/21
兵庫県 公募平成26年度第17回		0.46	100,000	100,780	2025/2/26
兵庫県 公募平成29年度第22回		0.19	100,000	99,690	2028/1/21
兵庫県 公募（30年）第2回		2.36	200,000	240,272	2040/3/19
兵庫県 公募（15年）第1回		1.66	300,000	315,315	2026/7/29
兵庫県 公募（15年）第3回		1.35	200,000	209,700	2027/7/16
兵庫県 公募（12年）第3回		0.56	300,000	303,030	2025/4/16
兵庫県 公募（15年）第8回		1.09	100,000	104,504	2029/4/16
兵庫県 公募（15年）第11回		0.718	100,000	101,986	2030/5/10
兵庫県 公募第2回		2.37	100,000	109,508	2027/9/17
兵庫県 公募第9回		2.25	100,000	112,089	2029/11/19
兵庫県 公募（20年）第11回		1.84	200,000	219,920	2030/8/16
兵庫県 公募（20年）第14回		1.72	100,000	109,552	2032/5/24
兵庫県 公募（20年）第21回		1.54	100,000	108,144	2034/5/9
兵庫県 公募（20年）第22回		1.4	100,000	106,789	2034/9/8
静岡県 公募平成26年度第3回		0.679	165,000	166,244	2024/5/27
静岡県 公募平成26年度第8回		0.564	100,000	100,792	2024/9/25
静岡県 公募平成26年度第9回		0.554	200,000	201,624	2024/10/24
静岡県 公募平成27年度第11回		0.11	115,400	115,515	2026/3/19
静岡県 公募平成28年度第2回		0.08	300,000	300,033	2026/3/19
静岡県 公募平成29年度第3回		0.17	100,000	100,039	2027/3/19
静岡県 公募（31年）第1回		0.095	174,000	171,856	2029/3/19
静岡県 公募（5年）令和3年度第2回		0.01	100,000	99,804	2026/3/19
静岡県 公募（5年）令和3年度第5回		0.005	300,000	299,181	2026/6/19
静岡県 公募（15年）第2回		1.406	200,000	210,262	2027/6/25
静岡県 公募（15年）第5回		1.087	200,000	208,904	2028/11/20
静岡県 公募（15年）第9回		0.739	100,000	102,170	2030/9/20
静岡県 公募（20年）第11回		1.841	100,000	110,075	2030/10/18
静岡県 公募（20年）第14回		1.736	200,000	219,626	2032/6/18
静岡県 公募（20年）第18回		1.473	100,000	107,676	2034/7/10
静岡県 公募（20年）第30回		0.449	200,000	180,504	2040/9/20
愛知県 公募平成20年度第8回		2.04	100,000	109,853	2028/12/20
愛知県 公募（20年）平成22年度第8回		1.891	200,000	220,964	2030/9/13
愛知県 公募（20年）平成24年度第4回		1.687	100,000	109,292	2032/6/11
愛知県 公募（15年）平成24年度第14回		1.314	400,000	420,276	2027/12/13
愛知県 公募平成24年度第17回		1.829	100,000	110,473	2033/2/8
愛知県 公募（30年）平成25年度第8回		2.024	120,000	138,218	2043/6/19
愛知県 公募（20年）平成25年度第17回		1.608	200,000	217,772	2033/12/20
愛知県 公募平成26年度第8回		1.814	100,000	111,120	2044/6/20
愛知県 公募平成26年度第13回		1.363	100,000	106,574	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	302,412	2025/ 2 /26
愛知県	公募（15年）平成27年度第 2 回	0.74	300,000	306,696	2030/ 4 /26
愛知県	公募平成27年度第15回	0.471	100,000	101,091	2025/11/27
愛知県	公募平成29年度第 8 回	0.2	100,000	100,000	2027/ 8 /31
愛知県	公募平成29年度第 9 回	0.15	100,000	99,756	2027/ 9 /15
愛知県	公募平成30年度第 7 回	0.18	200,000	199,180	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26年度第 5 回	0.33	109,650	110,224	2025/ 1 /27
広島県	公募平成26年度第 7 回	0.46	200,000	201,644	2025/ 3 /25
広島県	公募平成29年度第 3 回	0.15	100,000	99,755	2027/ 9 /27
広島県	公募平成29年度第 4 回	0.22	211,300	211,300	2027/11/24
広島県	公募令和 2 年度第 2 回	0.165	100,000	98,098	2030/ 7 /22
広島県	公募令和 2 年度第 7 回	0.214	300,000	293,316	2031/ 3 /19
埼玉県	公募平成26年度第 3 回	0.67	100,000	100,731	2024/ 5 /20
埼玉県	公募平成26年度第 6 回	0.554	200,000	201,558	2024/ 9 /26
埼玉県	公募平成26年度第 7 回	0.476	400,000	403,032	2024/12/25
埼玉県	公募平成26年度第 9 回	0.429	100,000	100,739	2025/ 2 /25
埼玉県	公募平成27年度第 9 回	0.235	100,000	100,476	2026/ 2 /25
埼玉県	公募平成28年度第 5 回	0.05	100,000	99,850	2026/ 7 /28
埼玉県	公募平成30年度第 4 回	0.205	200,000	199,520	2028/ 6 /26
埼玉県	公募令和元年度第 4 回	0.055	100,000	98,322	2029/ 6 /20
埼玉県	公募令和 2 年度第 4 回	0.145	300,000	294,108	2030/ 6 /17
埼玉県	公募（15年）第 1 回	0.941	100,000	103,676	2029/10/19
埼玉県	公募（15年）第 2 回	0.869	200,000	206,226	2030/ 5 /22
埼玉県	公募（15年）第 3 回	0.43	100,000	99,002	2032/ 1 /30
埼玉県	公募（25年）第 2 回	0.781	200,000	187,670	2042/ 9 /19
埼玉県	公募（30年）第 9 回	0.845	200,000	179,258	2048/ 3 /19
埼玉県	公募（20年）第 6 回	2.26	100,000	110,800	2028/ 9 /21
埼玉県	公募（20年）第16回	1.216	100,000	104,852	2035/ 8 /14
埼玉県	公募（20年）第19回	0.536	100,000	95,780	2036/12/12
埼玉県	公募（20年）第20回	0.626	100,000	96,675	2037/ 5 /15
福岡県	公募平成26年度第 1 回	0.654	100,000	100,778	2024/ 6 /26
福岡県	公募平成27年度第 1 回	0.578	300,000	303,507	2025/ 6 /26
福岡県	公募平成29年度第 1 回	0.2	100,000	100,062	2027/ 6 /23
福岡県	公募平成23年度第 1 回	1.491	100,000	104,958	2026/11/27
福岡県	公募（15年）平成27年度第 1 回	0.784	200,000	204,662	2030/11/25
福岡県	公募（15年）令和元年度第 1 回	0.254	100,000	94,644	2034/ 6 /14
福岡県	公募（30年）平成19年度第 1 回	2.62	100,000	122,946	2037/ 9 /18
福岡県	公募（30年）平成26年度第 1 回	1.827	100,000	111,342	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	91,926	2047/12/20
福岡県	公募（30年・定時償還）令和元年度第 3 回	0.432	100,000	79,064	2049/ 6 /18
福岡県	公募（20年）平成20年度第 1 回	2.26	300,000	331,881	2028/ 8 /18
福岡県	公募（20年）平成20年度第 2 回	2.05	100,000	109,909	2028/12/20
福岡県	公募（20年）平成22年度第 1 回	1.77	300,000	328,647	2030/ 8 /19
福岡県	公募（20年）平成22年度第 2 回	2.116	300,000	337,164	2031/ 2 /21
福岡県	公募（20年）平成24年度第 2 回	1.635	100,000	108,793	2032/ 8 /16
千葉県	公募平成26年度第 3 回	0.611	200,000	201,542	2024/ 7 /25
千葉県	公募平成26年度第 6 回	0.335	120,000	120,637	2025/ 1 /24

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	公募平成27年度第6回	0.469	200,000	202,206	2025/12/25
千葉県	公募平成28年度第4回	0.085	200,000	199,826	2026/9/25
千葉県	公募平成29年度第4回	0.15	100,000	99,755	2027/9/24
千葉県	公募平成29年度第8回	0.2	100,000	99,852	2028/3/24
千葉県	公募令和元年度第6回	0.135	300,000	294,966	2030/1/25
千葉県	公募令和4年度第4回	0.374	100,000	97,617	2032/9/24
千葉県	公募(20年)第1回	2.06	400,000	421,668	2025/12/19
千葉県	公募(20年)第8回	2.18	100,000	112,138	2030/4/19
千葉県	公募(20年)第13回	1.701	200,000	218,958	2032/10/15
千葉県	公募(20年)第16回	1.555	200,000	217,058	2034/4/14
千葉県	公募(20年)第17回	1.403	100,000	107,031	2034/10/13
新潟県	公募平成30年度第2回	0.264	200,000	199,820	2028/11/30
新潟県	公募令和2年度第2回	0.135	120,000	116,944	2030/11/29
長野県	公募令和3年度第1回	0.19	300,000	292,236	2031/4/16
茨城県	公募令和3年度第3回	0.005	200,000	199,320	2026/8/25
群馬県	公募第12回	0.519	100,000	101,100	2025/8/15
群馬県	公募(5年)第13回	0.005	300,000	299,037	2026/8/18
群馬県	公募(20年)第3回	1.687	100,000	109,230	2032/6/25
岐阜県	公募平成26年度第1回	0.554	186,670	188,135	2024/9/30
共同発行市場地方債	公募第136回	0.611	200,000	201,542	2024/7/25
共同発行市場地方債	公募第137回	0.566	500,000	503,770	2024/8/23
共同発行市場地方債	公募第139回	0.544	155,000	156,236	2024/10/25
共同発行市場地方債	公募第143回	0.448	540,000	544,185	2025/2/25
共同発行市場地方債	公募第145回	0.406	1,000,000	1,007,450	2025/4/25
共同発行市場地方債	公募第152回	0.496	400,000	404,620	2025/11/25
共同発行市場地方債	公募第154回	0.405	300,000	302,820	2026/1/23
共同発行市場地方債	公募第156回	0.1	200,000	200,142	2026/3/25
共同発行市場地方債	公募第157回	0.08	300,000	299,994	2026/4/24
共同発行市場地方債	公募第161回	0.06	300,000	299,541	2026/8/25
共同発行市場地方債	公募第172回	0.225	600,000	600,894	2027/7/23
共同発行市場地方債	公募第184回	0.175	100,000	99,566	2028/7/25
共同発行市場地方債	公募第186回	0.25	400,000	399,672	2028/9/25
共同発行市場地方債	公募第188回	0.264	300,000	299,730	2028/11/24
共同発行市場地方債	公募第190回	0.16	610,000	605,382	2029/1/25
共同発行市場地方債	公募第191回	0.14	100,000	99,080	2029/2/22
共同発行市場地方債	公募第194回	0.11	200,000	197,404	2029/5/25
共同発行市場地方債	公募第196回	0.06	400,000	393,140	2029/7/25
共同発行市場地方債	公募第197回	0.06	300,000	294,666	2029/8/24
共同発行市場地方債	公募第200回	0.07	100,000	98,029	2029/11/22
共同発行市場地方債	公募第206回	0.131	300,000	293,970	2030/5/24
共同発行市場地方債	公募第213回	0.125	300,000	291,813	2030/12/25
共同発行市場地方債	公募第215回	0.145	400,000	389,084	2031/2/25
共同発行市場地方債	公募第228回	0.199	300,000	290,151	2032/3/25
共同発行市場地方債	公募第229回	0.299	250,000	243,732	2032/4/23
共同発行市場地方債	公募第234回	0.369	300,000	292,719	2032/9/24
堺市	公募平成22年度第1回	1.97	100,000	111,001	2030/11/19
堺市	公募平成26年度第1回	1.664	100,000	108,476	2044/9/20
堺市	公募第3回	0.125	100,000	96,332	2031/12/22

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	
長崎県	公募令和元年度第3回	0.05	100,000	98,291	2029/6/20
長崎県	公募令和4年度第3回	0.364	100,000	97,724	2032/6/18
島根県	公募(30年)平成29年度第1回	0.919	100,000	92,123	2047/6/20
島根県	公募(5年)令和2年度第3回	0.02	150,000	149,839	2025/11/27
佐賀県	公募平成28年度第1回	0.08	100,000	99,817	2026/11/30
福島県	公募平成26年度第1回	0.495	200,000	201,528	2024/11/28
滋賀県	公募平成26年度第1回	0.495	142,000	143,084	2024/11/28
熊本県	公募平成28年度第2回	0.06	132,000	131,717	2026/10/28
熊本市	公募平成29年度第1回	0.19	100,000	99,861	2027/11/30
新潟市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	99,929	2027/12/24
浜松市	公募平成26年度第1回	0.335	100,000	100,530	2025/1/23
大阪市	公募平成26年度第5回	0.593	100,000	100,839	2024/9/27
大阪市	公募平成27年度第6回	0.471	100,000	101,089	2025/11/25
大阪市	公募令和2年度第2回	0.131	300,000	293,976	2030/5/22
大阪市	公募令和3年度第2回	0.16	300,000	291,321	2031/5/21
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	105,447	2026/7/17
大阪市	公募(20年)第1回	2.3	300,000	328,659	2027/11/15
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	111,935	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	110,810	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	200,000	218,988	2032/12/21
大阪市	公募(20年)第26回	0.635	100,000	96,328	2037/10/23
名古屋市	公募第488回	0.598	300,000	302,505	2024/9/20
名古屋市	公募第489回	0.461	100,000	100,725	2024/12/20
名古屋市	公募第501回	0.175	200,000	199,732	2027/9/29
名古屋市	公募第503回	0.205	100,000	99,876	2028/3/24
名古屋市	公募第504回	0.205	200,000	199,524	2028/6/20
名古屋市	公募第511回	0.075	200,000	195,572	2030/3/27
名古屋市	公募第512回	0.15	300,000	294,207	2030/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	204,340	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	103,441	2029/11/16
名古屋市	公募(20年)第19回	0.323	100,000	93,732	2036/4/28
京都市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	100,043	2027/8/25
京都市	公募平成29年度第4回	0.235	101,280	101,327	2028/1/31
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	105,096	2025/9/19
京都市	公募(20年)第5回	2.36	200,000	216,460	2026/12/18
京都市	公募(20年)第6回	2.38	100,000	109,649	2027/9/17
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	106,539	2034/11/24
京都市	公募(20年)第15回	0.487	200,000	190,382	2036/11/28
神戸市	公募平成26年度第17回	0.28	300,000	301,299	2025/1/27
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	199,994	2026/4/17
神戸市	公募平成30年度第2回	0.845	200,000	179,258	2048/3/19
横浜市	公募公債平成26年度5回	0.471	200,000	201,468	2024/12/13
横浜市	公募平成28年度第5回	0.23	300,000	300,927	2027/2/19
横浜市	公募平成29年度第3回	0.22	100,000	100,108	2027/8/13
横浜市	公募2019年度第3回	0.05	200,000	195,950	2029/10/16
横浜市	公募(30年)第2回	2.49	200,000	238,662	2035/3/20
横浜市	公募(20年)第11回	2.2	100,000	107,639	2026/12/18
横浜市	公募(20年)第18回	2.21	100,000	111,335	2029/5/25

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	
横浜市 公募 (20年) 第26回		1.776	100,000	110,139	2033/1/28
横浜市 公募 (20年) 第30回		1.376	100,000	106,750	2034/10/20
札幌市 公募 (15年) 平成23年度第9回		1.493	200,000	210,338	2027/2/12
札幌市 公募 (20年) 平成24年度第1回		1.79	100,000	110,417	2032/4/23
札幌市 公募 (20年) 平成24年度第11回		1.794	100,000	110,093	2033/2/28
札幌市 公募平成26年度第4回		0.54	100,000	100,629	2024/6/20
札幌市 公募平成26年度第9回		0.43	200,000	201,344	2024/12/20
札幌市 公募 (5年) 令和3年度第8回		0.155	100,000	96,664	2031/12/19
札幌市 公募 (5年) 令和4年度第4回		0.444	100,000	98,213	2032/9/17
川崎市 公募第95回		0.539	160,000	158,496	2032/9/17
川崎市 公募 (20年) 第14回		1.79	100,000	110,506	2032/3/19
川崎市 公募 (20年) 第17回		1.527	100,000	107,695	2033/5/9
川崎市 公募 (20年) 第19回		1.362	100,000	106,463	2034/9/20
川崎市 公募 (30年) 第11回		0.817	100,000	89,110	2048/3/19
北九州市 公募 (10年) 令和2年度第2回		0.125	200,000	194,400	2030/12/24
北九州市 公募 (20年) 第3回		2.33	200,000	218,706	2027/9/21
北九州市 公募 (20年) 第14回		1.732	100,000	109,464	2032/11/12
福岡市 公募 (20年) 平成21年度第3回		2.14	200,000	222,654	2029/9/18
福岡市 公募 (20年) 平成23年度第4回		1.89	100,000	110,883	2031/8/19
福岡市 公募平成26年度第2回		1.49	100,000	107,816	2034/6/20
福岡市 公募平成26年度第5回		0.539	100,000	100,794	2024/10/28
福岡市 公募平成26年度第8回		0.465	160,000	161,331	2025/3/25
福岡市 公募 (5年) 2020年度第9回		0.01	300,000	299,547	2025/12/25
広島市 公募平成26年度第2回		0.456	100,000	100,723	2024/12/25
広島市 公募平成27年度第2回		0.464	500,000	505,445	2025/12/25
広島市 公募 (10年) 平成30年度第6回		0.146	241,000	238,867	2029/2/22
広島市 公募 (10年) 令和3年度第6回		0.244	100,000	97,343	2032/2/25
千葉市 公募平成26年度第2回		0.505	200,000	201,560	2024/11/27
三重県 公募平成28年度第1回		0.165	155,000	155,172	2026/12/25
福井県 公募平成27年度第4回		0.085	200,000	199,996	2026/4/27
福井県 公募令和元年度第3回		0.05	200,000	195,856	2029/10/29
福井県 公募令和4年度第5回		0.374	100,000	97,507	2032/9/29
徳島県 公募平成29年度第2回		0.19	200,000	199,722	2027/11/30
徳島県 公募平成30年度第2回		0.264	300,000	299,730	2028/11/28
山梨県 公募令和元年度第1回		0.05	100,000	97,927	2029/10/30
岡山県 公募平成28年度第2回		0.205	168,900	169,200	2027/3/31
岡山県 公募令和2年度第3回		0.224	300,000	293,403	2031/3/31
岡山県 公募令和3年度第1回		0.189	100,000	96,928	2032/1/30
秋田県 公募令和3年度第1回		0.234	116,600	113,120	2032/3/25
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	110,886	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	335,865	2029/12/20
愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券 第148回		0.15	100,000	92,274	2034/9/15
福岡北九州高速道路債券 第117回		2.26	100,000	110,500	2028/12/20
福岡北九州高速道路債券 第136回		0.833	100,000	102,483	2030/3/19
福岡北九州高速道路債券 第145回		0.56	100,000	95,077	2036/12/16
小 計			54,223,360	55,228,690	
特殊債券(除金融債)					
政保 地方公共団体金融機構債券 第64回		0.544	100,000	100,768	2024/9/13

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	
政保	地方公共団体金融機構債券 第65回	0.539	400,000	403,232	2024/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第69回	0.414	420,000	423,183	2025/ 2 /17
政保	地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509	189,000	190,980	2025/ 5 /23
政保	地方公共団体金融機構債券 第78回	0.381	616,000	621,691	2025/11/18
政保	地方公共団体金融機構債券 第80回	0.32	300,000	302,391	2026/ 1 /19
政保	地方公共団体金融機構債券 第83回	0.02	116,000	115,908	2026/ 4 /17
政保	地方公共団体金融機構債券 第91回	0.085	300,000	299,889	2026/12/14
政保	地方公共団体金融機構債券 第108回	0.145	157,000	156,594	2028/ 5 /19
政保	地方公共団体金融機構債券 第110回	0.13	100,000	99,621	2028/ 7 /18
政保	地方公共団体金融機構債券 第113回	0.219	110,000	110,023	2028/10/16
政保	地方公共団体金融機構債券 第119回	0.04	116,000	114,481	2029/ 4 /13
政保	地方公共団体金融機構債券 11回	0.001	500,000	499,895	2024/ 8 /28
日本政策金融公庫債券 政府保証第63回		0.11	270,000	263,417	2031/ 2 /25
新関西国際空港債券 政府保証第5回		0.145	117,000	117,092	2027/ 3 /30
日本政策投資銀行社債 政府保証第37回		0.085	400,000	399,852	2026/12/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回		0.155	300,000	299,577	2027/12/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第52回		0.001	410,000	409,909	2025/ 1 /24
日本政策投資銀行社債 政府保証第55回		0.105	300,000	297,528	2029/ 3 /19
日本政策投資銀行社債 政府保証第75回		0.344	370,000	363,476	2032/ 9 /14
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	111,505	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	223,084	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	223,436	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	225,064	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	224,126	2030/ 4 /30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第111回		2.0	100,000	111,550	2030/ 6 /28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第114回		1.9	200,000	221,824	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	116,728	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146回		1.8	100,000	110,885	2031/ 9 /30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第164回		1.675	100,000	110,502	2032/ 5 /31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第165回		1.83	100,000	112,366	2042/ 5 /30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第167回		1.67	100,000	110,305	2032/ 6 /30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第169回		1.634	200,000	220,042	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	300,000	327,903	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	341,847	2042/ 8 /29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第176回		1.645	200,000	219,882	2032/10/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第181回		1.66	100,000	109,838	2032/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第183回		1.726	100,000	110,390	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	221,454	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196回		1.779	400,000	444,232	2033/ 7 /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	108,543	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	110,348	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	108,499	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	302,346	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	110,363	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	191,453	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	635,229	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233回		1.315	100,000	106,703	2034/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第234回		0.466	100,000	100,787	2024/12/27

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
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	525,265	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	201,738	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	400,000	416,148	2035/ 4 /27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第246回	1.178	100,000	105,176	2035/ 5 /31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第258回	0.386	400,000	403,676	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	404,741	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	150,882	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	192,300	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	99,943	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	403,318	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	99,936	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	599,862	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	99,664	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	91,138	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	500,240	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	130,706	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	99,706	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	199,178	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	99,999	2028/ 8 /31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	政府保証債第398回	0.422	100,000	79,806	2049/12/28
民間都市開発推進機構	政府保証第17回	0.145	400,000	401,208	2026/ 2 /26
関西国際空港債券	政府保証第54回	2.4	300,000	334,140	2028/ 6 /23
預金保険機構債券	政府保証第230回	0.1	600,000	600,684	2024/ 8 / 6
預金保険機構債券	政府保証第231回	0.1	300,000	300,381	2024/10/ 4
新関西国際空港社債	財投機関債第 6 回	1.445	300,000	316,164	2028/ 9 /15
新関西国際空港社債	財投機関債第 9 回	1.231	100,000	104,474	2028/12/20
新関西国際空港社債	財投機関債第12回	1.067	100,000	103,620	2029/ 9 /20
日本政策投資銀行社債	財投機関債第47回	1.027	100,000	103,891	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	399,684	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	199,958	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	100,084	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	299,460	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	198,732	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	299,493	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	399,100	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	388,268	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	400,000	520,968	2045/ 9 /20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第 4 回	2.59	100,000	120,220	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	213,898	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	107,554	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	327,198	2027/ 7 /20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第26回	2.67	100,000	122,246	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33回	2.91	200,000	259,676	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	332,640	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	112,017	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	108,931	2032/ 6 /18
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第95回	1.773	200,000	219,616	2032/ 9 /17
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第103回	1.69	350,000	379,788	2033/ 3 /18

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
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	109,971	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130回	0.56	200,000	201,282	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	201,206	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	201,566	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	309,426	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	104,636	2045/3/17
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第151回	1.215	100,000	104,697	2035/3/20
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第157回	0.857	100,000	102,738	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	103,770	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	76,807	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	95,585	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204回	1.044	100,000	85,832	2058/3/19
日本高速道路保有・債務返済機構債券	財投機関債第260回	0.651	200,000	161,268	2050/9/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第9回	2.9	100,000	119,418	2032/5/20
日本高速道路保有・債務返済機構承継	財投機関債第28回	2.83	400,000	481,180	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	122,180	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	1,032,380	2024/9/20
公営企業債券 30年第4回財投機関債		2.95	300,000	367,932	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	109,713	2028/12/20
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第1回		2.266	300,000	334,710	2029/6/28
地方公共団体金融機構債券 20年第4回		2.12	100,000	111,226	2029/12/28
地方公共団体金融機構債券 F16回		2.042	100,000	106,957	2027/1/7
地方公共団体金融機構債券 20年第6回		2.242	300,000	336,804	2030/3/28
地方公共団体金融機構債券 20年第7回		2.202	400,000	448,668	2030/4/26
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第10回		1.752	300,000	327,777	2030/8/28
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第20回		1.8	100,000	110,041	2032/1/28
地方公共団体金融機構債券 F104回		1.314	100,000	102,431	2025/3/7
地方公共団体金融機構債券 F122回		1.412	100,000	104,935	2027/6/18
地方公共団体金融機構債券 F124回		1.418	100,000	104,938	2027/6/4
地方公共団体金融機構債券 F132回		1.09	500,000	511,870	2025/7/30
地方公共団体金融機構債券 F142回		1.016	100,000	101,605	2024/11/28
地方公共団体金融機構債券 F145回		1.059	200,000	203,944	2025/3/19
地方公共団体金融機構債券 F147回		1.291	100,000	104,273	2027/3/19
地方公共団体金融機構債券 F160回		1.052	100,000	103,786	2028/5/26
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第29回		1.725	100,000	109,314	2033/6/28
地方公共団体金融機構債券 (15年) 第2回		1.161	200,000	209,248	2028/12/28
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第38回		1.487	100,000	107,856	2034/7/28
地方公共団体金融機構債券 F240回		1.069	300,000	313,110	2030/2/28
地方公共団体金融機構債券 F248回		1.512	100,000	108,070	2036/7/25
地方公共団体金融機構債券 第64回		0.574	100,000	100,787	2024/9/27
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第39回		1.425	200,000	214,388	2034/9/28
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第43回		1.171	100,000	104,305	2035/4/27
地方公共団体金融機構債券 第74回		0.519	300,000	303,126	2025/7/28
地方公共団体金融機構債券 第77回		0.491	100,000	101,083	2025/10/28
地方公共団体金融機構債券 第79回		0.484	400,000	404,416	2025/12/26
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第53回		0.18	200,000	182,924	2036/7/28
地方公共団体金融機構債券 (20年) 第58回		0.721	100,000	97,644	2037/3/27
地方公共団体金融機構債券 第95回		0.2	200,000	199,838	2027/4/28

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
地方公共団体金融機構債券	第101回	0.235	400,000	399,456	2027/10/28
地方公共団体金融機構債券	12回	0.716	200,000	165,084	2050/11/28
公営企業債券 (20年)	第19回財投機関債	2.37	100,000	108,067	2026/12/18
公営企業債券 (20年)	第20回財投機関債	2.25	100,000	107,989	2027/ 3 /24
公営企業債券 (20年)	第23回財投機関債	2.29	200,000	217,998	2027/ 9 /24
公営企業債券 (20年)	第24回財投機関債	2.29	100,000	109,933	2028/ 4 /25
公営企業債券 (20年)	第25回財投機関債	2.5	100,000	111,277	2028/ 6 /20
首都高速道路	第28回	0.04	200,000	198,726	2026/ 9 /18
阪神高速道路	第25回	0.03	100,000	99,568	2026/ 3 /19
都市再生債券	財投機関債第93回	1.102	100,000	104,325	2029/ 6 /20
都市再生債券	財投機関債第96回	0.599	200,000	201,614	2024/ 9 /20
都市再生債券	財投機関債第97回	1.017	100,000	103,828	2029/ 9 /20
都市再生債券	財投機関債第101回	0.935	100,000	103,305	2029/11/20
都市再生債券	財投機関債第109回	0.918	100,000	103,165	2030/ 6 /20
都市再生債券	財投機関債第113回	0.851	300,000	307,938	2030/ 9 /20
都市再生債券	財投機関債第121回	0.482	200,000	199,222	2031/ 2 /20
都市再生債券	財投機関債第127回	0.075	100,000	99,723	2026/ 9 /18
都市再生債券	財投機関債第155回	0.804	100,000	79,486	2058/ 3 /19
本州四国連絡橋債券	財投機関債第 7 回	2.26	100,000	104,742	2025/ 6 /20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第 3 回	2.26	400,000	432,004	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	218,486	2027/ 6 /18
住宅金融支援機構債券	財投機関債第42回	1.94	100,000	103,693	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	111,531	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	110,722	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	111,907	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	315,588	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	111,890	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	110,941	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	220,758	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	210,334	2026/12/18
住宅金融支援機構債券	財投機関債第94回	1.882	100,000	110,788	2032/ 2 /13
住宅金融支援機構債券	財投機関債第111回	1.404	100,000	104,858	2027/ 6 /18
住宅金融支援機構債券	財投機関債第112回	1.738	100,000	109,221	2032/ 8 /16
住宅金融支援機構債券	財投機関債第115回	1.811	100,000	110,133	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	109,956	2032/11/12
住宅金融支援機構債券	財投機関債第123回	1.801	300,000	330,171	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	118,183	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	207,692	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	105,106	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	104,617	2028/10/20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第162回	1.299	100,000	105,607	2035/ 6 /20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第177回	0.484	450,000	454,747	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	299,715	2026/ 5 /20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第198回	0.155	300,000	299,610	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	199,836	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	97,046	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	129,589	2028/ 8 /18
住宅金融支援機構債券	財投機関債第277回	0.547	100,000	79,310	2049/ 9 /17

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	
住宅金融支援機構債券	財投機関債第301回	0.04	300,000	299,550	2025/12/19
成田国際空港	第17回	0.489	400,000	402,852	2025/ 2 /20
成田国際空港	第19回	0.275	100,000	100,299	2026/ 2 /18
沖縄振興開発金融公庫債券	財投機関債第 6 回	2.04	200,000	208,670	2025/ 6 /20
国際協力機構債券	第 6 回財投機関債	2.098	200,000	223,480	2030/12/13
国際協力機構債券	第15回財投機関債	1.724	100,000	109,373	2032/ 9 /17
国際協力機構債券	第25回財投機関債	1.52	100,000	107,903	2034/ 6 /20
国際協力機構債券	第32回財投機関債	1.212	100,000	104,485	2035/ 9 /20
国際協力機構債券	第35回財投機関債	0.08	100,000	99,823	2026/ 6 /19
東日本高速道路	第57回	0.11	100,000	99,696	2026/ 6 /19
東日本高速道路	第61回	0.14	200,000	196,392	2029/ 7 /31
東日本高速道路	第64回	0.14	100,000	97,934	2029/11/29
東日本高速道路	第83回	0.05	200,000	199,008	2026/ 6 /19
東日本高速道路	第86回	0.04	400,000	396,904	2026/12/18
中日本高速道路	第63回	0.576	100,000	101,086	2025/11/13
中日本高速道路	第79回	0.04	300,000	299,892	2024/ 8 /19
中日本高速道路	第86回	0.06	100,000	99,690	2026/ 1 /22
中日本高速道路	第89回	0.05	100,000	99,526	2026/ 6 / 1
中日本高速道路	第90回	0.05	300,000	298,413	2026/ 7 /27
中日本高速道路	第91回	0.04	200,000	198,726	2026/ 9 /17
西日本高速道路	第23回	0.602	100,000	100,667	2024/ 6 /20
西日本高速道路	第30回	0.17	300,000	299,715	2026/ 5 /22
西日本高速道路	第50回	0.04	200,000	199,962	2024/ 6 /20
西日本高速道路	第64回	0.04	200,000	198,726	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68回	0.586	200,000	201,468	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	107,161	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	503,895	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	291,321	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	293,271	2030/ 2 /27
貸付債権担保第39回住宅金融公庫債券		1.84	19,218	19,218	2041/ 2 /10
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	22,006	22,300	2041/ 3 /10
貸付債権担保第32回住宅金融公庫債券		1.69	39,656	39,656	2040/ 7 /10
貸付債権担保第44回住宅金融公庫債券		2.3	38,460	38,460	2041/ 7 /10
貸付債権担保第 8 回住宅金融支援機構債券		1.99	59,460	59,460	2042/12/10
貸付債権担保第 7 回住宅金融支援機構債券		2.14	10,746	10,904	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	16,294	17,141	2044/ 6 /10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	55,215	58,042	2044/ 9 /10
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券		1.43	49,402	51,228	2045/11/10
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券		1.79	57,960	60,380	2046/ 2 /10
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券		1.51	43,008	44,543	2046/ 9 /10
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券		2.34	28,692	29,965	2044/ 5 /10
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券		1.89	53,877	56,127	2046/ 5 /10
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券		1.36	62,136	64,072	2045/ 9 /10
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券		1.21	93,576	96,383	2047/ 7 /10
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券		1.34	83,022	85,843	2047/ 5 /10
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券		1.26	55,890	57,629	2047/ 6 /10
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券		1.64	19,938	20,692	2046/ 8 /10
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券		1.6	48,626	50,692	2045/12/10

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79回住宅金融支援機構債券		1.07	32,241	33,037	2048/12/10
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券		1.07	71,616	73,345	2049/ 2 /10
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券		1.08	31,372	32,154	2048/ 5 /10
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券		1.25	96,135	99,255	2048/ 3 /10
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券		1.88	20,536	21,562	2045/ 2 /10
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券		1.86	20,738	21,788	2045/ 3 /10
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券		1.87	19,673	20,630	2045/ 4 /10
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券		1.85	19,016	19,827	2046/ 3 /10
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券		1.41	53,240	55,183	2046/12/10
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券		1.42	75,855	78,600	2047/ 1 /10
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券		1.44	25,494	26,434	2047/ 2 /10
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券		1.21	61,826	63,714	2048/ 9 /10
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券		2.25	58,092	60,585	2044/ 4 /10
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券		1.82	58,092	60,785	2045/ 1 /10
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券		1.52	102,860	106,574	2045/ 8 /10
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券		1.4	56,956	59,075	2047/ 3 /10
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券		1.16	101,856	104,755	2047/ 9 /10
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券		1.07	91,734	93,982	2048/ 4 /10
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券		1.3	73,422	76,031	2048/ 6 /10
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券		1.26	60,746	62,745	2048/ 8 /10
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券		1.04	153,320	156,762	2049/ 4 /10
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券		1.01	262,640	268,197	2049/ 5 /10
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券		0.93	40,658	41,330	2049/ 9 /10
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券		0.95	41,826	42,551	2049/10/10
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券		0.87	42,884	43,454	2049/11/10
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券		0.74	90,884	91,392	2050/ 1 /10
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券		0.6	96,446	96,161	2050/ 2 /10
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券		0.8	50,838	51,243	2050/ 3 /10
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券		0.74	54,592	54,814	2050/ 5 /10
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券		0.83	161,616	163,062	2050/ 6 /10
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券		0.9	167,427	169,466	2050/ 7 /10
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券		0.88	113,096	114,285	2050/ 8 /10
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券		0.84	55,000	55,457	2050/ 9 /10
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券		0.89	55,920	56,540	2050/10/10
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券		0.41	213,540	208,931	2051/12/10
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券		0.48	143,352	140,830	2052/ 1 /10
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券		0.46	144,094	141,282	2052/ 2 /10
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券		0.47	71,656	70,337	2052/ 3 /10
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券		0.46	143,784	141,011	2052/ 4 /10
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券		0.4	72,288	70,559	2052/ 5 /10
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券		0.43	72,876	71,236	2052/ 6 /10
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券		0.46	74,294	72,708	2052/ 8 /10
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券		0.42	296,692	289,526	2052/10/10
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券		0.43	224,424	219,017	2052/11/10
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券		0.42	149,932	146,236	2053/ 1 /10
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券		0.46	153,582	150,060	2053/ 2 /10
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券		0.39	155,954	151,450	2053/ 7 /10
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券		0.39	78,519	76,232	2053/ 8 /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136回住宅金融支援機構債券		0.44	78,615	76,572	2053/9/10
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券		0.38	78,780	76,369	2054/1/10
貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券		0.32	243,822	235,115	2054/3/10
貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券		0.33	242,340	233,717	2054/5/10
貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券		0.21	426,640	406,664	2054/11/10
貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券		0.33	172,538	165,881	2055/1/10
貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券		0.3	173,892	166,670	2055/3/10
貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券		0.33	274,074	262,346	2056/1/10
貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券		0.36	181,414	174,108	2056/2/10
貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券		0.41	273,579	263,582	2056/3/10
貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券		0.41	183,684	176,867	2056/4/10
貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券		0.4	183,390	176,419	2056/5/10
貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券		0.39	277,833	266,916	2056/6/10
貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券		0.36	463,895	444,499	2056/7/10
貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券		0.38	283,326	271,644	2056/11/10
貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券		0.36	286,218	273,830	2056/12/10
貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券		0.32	286,230	272,719	2057/1/10
貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券		0.4	191,222	183,389	2057/2/10
貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券		0.48	286,056	276,347	2057/3/10
貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券		0.46	288,783	278,242	2057/4/10
貸付債権担保第180回住宅金融支援機構債券		0.5	192,402	185,944	2057/5/10
貸付債権担保第183回住宅金融支援機構債券		0.53	586,170	566,879	2057/8/10
貸付債権担保第185回住宅金融支援機構債券		0.58	295,602	287,005	2057/10/10
貸付債権担保第186回住宅金融支援機構債券		0.74	197,558	194,406	2057/11/10
フランス預金供託公庫 第4回円貨債券 (2014)		0.725	100,000	100,592	2024/7/30
小 計			57,245,879	58,722,992	
金融債券					
商工債券 利付第829回い号		0.13	200,000	200,060	2024/6/27
商工債券 利付第831回い号		0.08	200,000	199,898	2024/8/27
商工債券 利付第833回い号		0.05	100,000	99,866	2024/10/25
商工債券 利付第845回い号		0.12	300,000	299,538	2025/10/27
商工債券 利付第852回い号		0.09	100,000	99,591	2026/5/27
商工債券 利付第854回い号		0.08	400,000	398,020	2026/7/27
商工債券 利付第856回い号		0.09	200,000	198,926	2026/9/25
商工債券 利付第868回い号		0.24	100,000	99,491	2027/9/27
商工債券 利付第872回い号		0.45	100,000	100,355	2028/1/27
しんさん中金債券 利付第374回		0.05	300,000	299,403	2026/1/27
しんさん中金債券 利付第377回		0.04	100,000	99,661	2026/4/27
しんさん中金債券 利付第379回		0.04	400,000	398,516	2026/6/26
しんさん中金債券 利付第380回		0.03	100,000	99,570	2026/7/27
しんさん中金債券 利付第400回		0.38	100,000	100,195	2028/3/27
商工債券 利付(3年)第258回		0.04	100,000	99,907	2024/7/26
商工債券 利付(10年)第15回		0.48	200,000	201,550	2025/9/19
商工債券 利付(10年)第41回		0.4	200,000	194,184	2032/3/19
小 計			3,200,000	3,188,731	
普通社債券(含む投資法人債券)					
東京電力 第548回		2.347	100,000	103,565	2028/9/29
東京電力 第560回		2.114	100,000	102,303	2029/12/10

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
中部電力	第500回	0.875	200,000	201,624	2024/ 5 /24
中部電力	第524回	0.39	100,000	99,593	2027/ 5 /25
中部電力	第530回	0.274	200,000	194,436	2029/ 6 /25
中部電力	第559回	0.85	100,000	93,010	2038/ 6 /25
中部電力	第560回	1.2	100,000	93,947	2042/ 7 /25
関西電力	第509回	0.47	100,000	99,796	2027/ 5 /25
関西電力	第511回	0.41	300,000	298,104	2027/ 9 /17
関西電力	第522回	0.47	200,000	197,834	2028/ 9 /20
関西電力	第535回	0.18	200,000	198,842	2025/12/19
中国電力	第400回	0.34	100,000	99,145	2027/ 9 /24
中国電力	第402回	0.25	100,000	100,038	2024/10/25
中国電力	第406回	0.752	100,000	91,639	2038/ 5 /25
中国電力	第416回	0.355	100,000	97,618	2029/ 5 /25
中国電力	第422回	0.35	600,000	579,372	2030/ 4 /25
中国電力	第425回	0.37	100,000	96,558	2030/ 6 /25
北陸電力	第307回	1.055	100,000	102,124	2026/ 6 /25
北陸電力	第308回	0.769	100,000	100,842	2024/ 9 /25
北陸電力	第322回	0.38	100,000	99,564	2027/ 6 /25
北陸電力	第326回	0.719	200,000	182,424	2038/ 4 /23
北陸電力	第330回	0.34	100,000	97,759	2029/ 5 /25
東北電力	第475回	0.809	100,000	100,901	2024/ 9 /25
東北電力	第481回	0.803	200,000	202,268	2025/ 7 /25
東北電力	第484回	0.758	100,000	93,680	2036/ 5 /23
東北電力	第491回	0.42	100,000	99,731	2027/ 2 /25
東北電力	第508回	0.465	100,000	98,258	2029/ 4 /25
東北電力	第521回	0.45	300,000	291,402	2030/ 5 /24
東北電力	第529回	0.07	200,000	198,116	2026/ 4 /24
四国電力	第293回	0.84	100,000	94,077	2037/ 5 /25
九州電力	第428回	0.936	105,000	105,987	2024/ 7 /25
九州電力	第449回	0.43	200,000	199,282	2027/ 4 /23
九州電力	第451回	0.45	100,000	99,675	2027/ 5 /25
九州電力	第476回	0.43	100,000	97,943	2029/ 5 /25
九州電力	第478回	0.606	100,000	90,371	2037/ 6 /25
九州電力	第481回	0.324	300,000	291,456	2029/ 7 /25
九州電力	第484回	0.375	200,000	194,094	2029/11/22
九州電力	第493回	0.1	300,000	297,102	2026/ 5 /25
北海道電力	第321回	0.886	100,000	101,118	2024/12/25
北海道電力	第323回	1.337	100,000	103,276	2030/ 3 /25
北海道電力	第338回	0.84	100,000	93,927	2036/11/25
北海道電力	第345回	0.27	300,000	300,216	2024/ 9 /25
沖縄電力	第32回	0.22	100,000	99,961	2025/10/24
東京電力パワーグリッド	第6回	0.85	100,000	99,756	2027/ 8 /31
東京電力パワーグリッド	第11回	0.79	300,000	297,540	2028/ 1 /25
東京電力パワーグリッド	第15回	0.89	300,000	292,704	2030/ 7 /24
東京電力パワーグリッド	第28回	1.01	100,000	99,434	2029/ 7 /10
東京電力パワーグリッド	第35回	1.2	100,000	99,949	2030/ 4 /23
東京電力パワーグリッド	第38回	0.58	400,000	399,608	2025/ 7 /16
東京電力パワーグリッド	第40回	1.37	400,000	389,084	2035/ 7 /13

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
東京電力パワーグリッド	第45回	0.8	300,000	288,372	2031/ 4 /22
東京電力パワーグリッド	第50回	0.94	100,000	96,247	2032/ 4 /26
東京電力パワーグリッド	第54回	1.2	100,000	98,217	2032/ 7 /21
I N P E X	第1回社債間限定同順位特約付	0.08	500,000	497,225	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	196,368	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	99,472	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	95,644	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	290,211	2031/ 6 /3
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	198,972	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	298,515	2026/ 3 /13
キリンホールディングス	第10回社債間限定同順位特約付	0.603	100,000	100,812	2025/ 2 /28
コカ・コーラボトラーズジャパン	第2回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	99,612	2026/ 9 /18
コカ・コーラボトラーズジャパン	第3回社債間限定同順位特約付	0.27	100,000	97,873	2029/ 9 /19
日本たばこ産業	第13回	0.355	100,000	99,313	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	99,108	2027/ 8 /31
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	199,408	2026/ 8 /28
森ビル	第23回社債間限定同順位特約付	0.97	100,000	93,605	2038/ 5 /17
東急不動産ホールディングス	第20回社債間限定同順位特約付	0.37	100,000	98,095	2029/ 7 /11
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	599,046	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	198,724	2027/12/20
東レ	第30回社債間限定同順位特約付	0.375	100,000	99,768	2027/ 7 /16
東レ	第33回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,036	2028/ 7 /18
旭化成	第11回社債間限定同順位特約付	0.07	100,000	99,905	2024/ 9 /6
日本土地建物	第4回社債間限定同順位特約付	0.734	200,000	195,800	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	99,822	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	597,084	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	92,718	2031/ 9 /10
レゾナックホールディングス	第35回社債間限定同順位特約付	0.55	100,000	94,955	2031/12/2
住友化学	第52回社債間限定同順位特約付	0.85	100,000	93,942	2036/ 9 /1
住友化学	第56回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,121	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	99,797	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	98,994	2028/ 6 /19
J S R	第9回社債間限定同順位特約付	0.29	100,000	99,562	2027/ 5 /28
三菱ケミカルホールディングス	第29回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	97,806	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	193,468	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	88,889	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	97,841	2030/12/13
電通	第3回社債間限定同順位特約付	0.424	100,000	99,509	2028/10/25
電通	第6回社債間限定同順位特約付	0.49	300,000	296,511	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	190,982	2031/10/14
ツムラ	第1回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	100,017	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	99,893	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	194,700	2030/ 9 /17
ヤフー	第6回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	99,846	2024/12/6
ヤフー	第12回社債間限定同順位特約付	0.37	200,000	197,956	2026/ 7 /31
楽天	第13回社債間限定同順位特約付	0.45	100,000	78,672	2029/ 6 /25
楽天	第15回社債間限定同順位特約付	0.5	100,000	95,229	2024/12/2
富士フイルムホールディングス	第16回社債間限定同順位特約付	0.1	100,000	99,851	2025/ 4 /18

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
出光興産 第14回社債間限定同順位特約付		0.34	100,000	96,109	2031/ 7 /15
J Xホールディングス 第13回社債間限定同順位特約付		0.3	100,000	99,907	2026/ 7 /28
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付		0.295	100,000	99,673	2027/ 4 /21
住友理工 第7回社債間限定同順位特約付		0.35	100,000	100,007	2026/ 9 /4
太平洋セメント 第27回社債間限定同順位特約付		0.564	100,000	98,559	2028/10/25
日本碍子 第7回社債間限定同順位特約付		0.18	100,000	97,324	2028/12/21
新日鐵住金 第9回社債間限定同順位特約付		0.385	300,000	297,810	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	99,910	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	100,061	2025/ 7 /14
プロテリアル 第32回社債間限定同順位特約付		0.28	100,000	99,844	2025/12/ 5
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	98,845	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	198,814	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	199,176	2027/ 3 /1
L I X I Lグループ 第16回社債間限定同順位特約付		0.704	100,000	98,327	2032/ 8 /27
日立建機 第20回社債間限定同順位特約付		0.38	100,000	96,154	2031/ 3 /18
住原製作所 第10回社債間限定同順位特約付		0.19	100,000	99,623	2025/10/22
ダイキン工業 第30回社債間限定同順位特約付		0.459	100,000	99,042	2029/ 7 /27
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付		1.371	200,000	210,126	2028/12/13
セイコーエプソン 第15回社債間限定同順位特約付		0.34	100,000	99,887	2026/ 9 /18
パナソニック 第17回社債間限定同順位特約付		0.47	200,000	200,664	2026/ 9 /18
パナソニック 第21回社債間限定同順位特約付		0.19	100,000	99,719	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	197,212	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	95,982	2030/12/24
T D K 第7回社債間限定同順位特約付		0.43	100,000	97,727	2030/ 7 /26
デンソー 第17回社債間限定同順位特約付		0.18	100,000	100,107	2025/ 3 /19
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	99,315	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	99,567	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	297,966	2026/ 9 /1
I H I 第50回社債間限定同順位特約付		0.62	100,000	96,509	2032/ 6 /4
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	100,056	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	99,665	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	696,780	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	291,534	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	89,391	2026/12/11
ニコン 第22回特定社債間限定同順位特約付		0.15	100,000	99,579	2025/12/ 2
丸紅 第113回社債間限定同順位特約付		0.36	100,000	96,110	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	102,039	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	204,288	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	108,135	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	103,988	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	104,012	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	99,461	2027/ 7 /26
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付		0.38	100,000	98,895	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	96,830	2029/ 7 /31
イオン 第20回社債間限定同順位特約付		0.82	100,000	100,762	2024/ 6 /28
三菱UFJ Fフィナンシャル・グループ 第1回劣後特約付		0.94	100,000	100,312	2024/ 6 /26
三菱UFJ Fフィナンシャル・グループ 第7回劣後特約付		1.393	100,000	101,907	2030/ 6 /18
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	99,832	2025/ 7 /23

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
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	200,502	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	108,716	2027/7/27
三菱東京ＵＦＪ銀行	第23回劣後特約付	2.91	100,000	111,967	2029/10/16
三菱東京ＵＦＪ銀行	第24回劣後特約付	2.27	100,000	108,366	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	300,549	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	100,247	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	100,993	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	198,942	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	100,608	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	298,920	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	200,536	2024/7/16
みずほ銀行	第7回劣後特約付	2.87	100,000	106,996	2026/11/6
みずほリース	第3回社債間限定同順位特約付	0.24	300,000	299,091	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	197,404	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	99,899	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	99,882	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	198,954	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	295,122	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	97,998	2028/4/27
ホンダファイナンス	第63回社債間限定同順位特約付	0.16	100,000	99,817	2025/6/19
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	198,828	2026/6/19
ＳＢＩホールディングス	第26回社債間限定同順位特約付	0.8	200,000	197,996	2026/7/24
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	99,618	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	796,472	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	99,150	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	100,005	2024/5/28
アコム	第78回特定社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,072	2026/8/28
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	94,923	2032/1/20
日立キャピタル	第61回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	99,639	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	96,810	2029/10/19
オリックス	第189回社債間限定同順位特約付	0.445	100,000	99,877	2027/2/26
オリックス	第202回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	95,599	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	99,257	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	297,339	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	99,102	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	291,615	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	101,079	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	99,145	2026/6/2
大和証券グループ本社	第39回社債間限定同順位特約付	0.794	100,000	100,408	2028/2/24
三井住友海上火災保険	第7回社債間限定同順位特約付	0.19	100,000	99,436	2026/11/13
三井不動産	第60回社債間限定同順位特約付	0.305	100,000	99,016	2028/5/2
三井不動産	第68回社債間限定同順位特約付	0.09	100,000	99,911	2024/9/12
三井不動産	第71回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	194,988	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	221,340	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	99,452	2027/6/18
三菱地所	第129回担保提供制限等財務上特約無	0.17	100,000	99,624	2026/8/5
三菱地所	第135回担保提供制限等財務上特約無	0.26	100,000	95,855	2031/6/20
東京建物	第25回社債間限定同順位特約付	0.52	100,000	99,993	2027/3/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
ダイビル	第19回特定社債間限定同順位特約付	0.96	100,000	91,588	2039/7/19
京阪神ビルディング	第13回社債間限定同順位特約付	0.86	100,000	94,535	2035/11/27
住友不動産	第109回社債間限定同順位特約付	0.31	100,000	96,510	2031/5/9
イオンモール	第22回社債間限定同順位特約付	0.4	100,000	97,492	2029/7/3
イオンモール	第23回社債間限定同順位特約付	0.9	100,000	88,553	2039/7/1
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	104,502	2028/9/20
日本プライムリアルティ投資法人	第27回特定投資法人債間限定	0.42	100,000	95,660	2031/12/5
グローバル・ワン不動産投資法人	第9回	0.47	100,000	99,660	2026/10/16
野村不動産オフィスファンド投資法人	第7回特定投資法人債間限	2.9	100,000	110,988	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	100,775	2024/8/30
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	201,028	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	102,531	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	194,508	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	205,634	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	94,636	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	199,504	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	221,046	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	109,052	2030/9/27
東日本旅客鉄道	第86回社債間限定同順位特約付	1.732	100,000	108,738	2032/7/23
東日本旅客鉄道	第106回社債間限定同順位特約付	0.981	100,000	99,777	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	97,999	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	99,433	2027/1/27
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	85,704	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	145,438	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	97,560	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	97,011	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	96,312	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	87,960	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	77,325	2061/4/15
東日本旅客鉄道	第184回社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	99,962	2025/10/14
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	107,658	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	325,563	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	194,798	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	193,980	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	178,602	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	76,788	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	206,026	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	221,856	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	104,412	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	300,381	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	102,769	2045/3/6
東京地下鉄	第22回	0.215	100,000	99,251	2027/6/21
東京地下鉄	第23回	0.661	100,000	93,823	2037/6/19
東京地下鉄	第24回	1.035	100,000	89,252	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	194,242	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	99,143	2031/3/4
阪急阪神ホールディングス	第47回	1.202	400,000	414,208	2029/7/18
阪急阪神ホールディングス	第49回	0.817	100,000	95,606	2036/12/15

銘 柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
名古屋鉄道	第50回社債間限定同順位特約付	0.857	100,000	101,441	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	99,810	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	95,581	2036/7/14
日立物流	第4回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	99,406	2026/9/28
日本郵船	第32回社債間限定同順位特約付	2.13	100,000	108,114	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	99,706	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	168,828	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	88,182	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	90,108	2036/6/9
KDDI	第25回社債間限定同順位特約付	0.395	100,000	99,125	2028/11/22
KDDI	第30回社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	100,004	2025/10/27
ソフトバンク	第11回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	99,301	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	195,412	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	98,696	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	94,177	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	100,857	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	100,811	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	99,570	2027/7/20
電源開発	第55回社債間限定同順位特約付	0.375	100,000	98,739	2028/5/19
電源開発	第59回社債間限定同順位特約付	0.414	100,000	98,469	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	189,724	2031/5/20
JERA	第3回無担保社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	97,839	2026/11/25
東京瓦斯	第28回社債間限定同順位特約付	2.29	100,000	107,956	2027/6/15
東京瓦斯	第37回社債間限定同順位特約付	1.764	100,000	108,574	2033/9/26
東京瓦斯	第38回社債間限定同順位特約付	1.984	100,000	109,466	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	85,455	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	78,875	2049/6/4
大阪瓦斯	第43回社債間限定同順位特約付	0.851	200,000	163,096	2051/6/2
北海道瓦斯	第23回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	92,985	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	98,609	2028/9/13
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	99,957	2028/6/6
ファーストリテイリング	第8回特定社債間限定同順位特約付	0.88	100,000	96,043	2038/6/4
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	100,039	2024/6/12
フランス相互信用連合銀行 (BF CM)	第24回円貨社債	0.384	100,000	99,439	2024/10/11
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	198,780	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	95,303	2029/10/10
ビー・ビー・シー・イー・エス・エー	第14回円貨社債	0.45	100,000	98,577	2026/6/17
ビー・ビー・シー・イー・エス・エー	第25回非上位円貨社債	0.302	200,000	195,082	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	100,259	2024/11/28
クレディ・アグリコル・エス・エー	第16回円貨社債 (2018)	0.509	100,000	96,926	2028/6/8
マラヤン・バンキング・ベルハッド	第4回円貨社債 (2019)	0.34	100,000	99,804	2024/5/21
スタンダード・チャータード	第3回円貨社債 (2015)	1.043	100,000	99,773	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3回円	1.207	100,000	98,402	2026/9/25
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	95,144	2028/5/30
サンタンデール銀行	第1回円貨社債	0.463	100,000	99,072	2024/12/5
フランス電力	第4回円貨社債 (2017)	1.088	100,000	99,095	2027/1/26
小 計			42,405,000	41,816,556	
合 計			874,564,239	886,202,928	

* 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 (2022年4月1日～2023年3月31日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	6,156,585,037
受取利息	6,158,410,934
支払利息	△ 1,825,897
(B) 有価証券売買損益	△ 20,727,669,936
売買益	875,135,051
売買損	△ 21,602,804,987
(C) 当期損益金(A+B)	△ 14,571,084,899
(D) 前期繰越損益金	196,810,685,485
(E) 追加信託差損益金	42,746,409,227
(F) 解約差損益金	△ 25,774,780,048
(G) 計(C+D+E+F)	199,211,229,765
次期繰越損益金(G)	199,211,229,765

* 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。