

お金のデザイン・リキッド・オルタナティブ・ファンド

※2025年8月1日付でファンドの名称を「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）」から「お金のデザイン・リキッド・オルタナティブ・ファンド」に変更しました。

運用報告書（全体版）

第6期（決算日 2025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」は、2025年9月10日に第6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	主として追加型証券投資信託「フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）」への投資を通じて、実質的に日本を含む世界の株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引に係る権利への投資を行い、運用環境を問わない安定的な投資信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。
主要投資対象	追加型証券投資信託「フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）」（運用：フィデリティ投信株式会社）の受益証券、ならびに国内上場投資信託「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。 ※なお、上記の主要投資対象ファンドに加え、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・インベストメント・エルエルシー）を主要投資対象ファンドとしておりますが、2025年8月1日以降当該外国投資証券に対する新たな投資は行っておりません。
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。 ③デリバティブ取引の直接利用は行いません。
収益分配	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。



東京都中央区新川1丁目17番21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。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額 (分配落)	基 準 価 額					投 資 信 託 純 資 産 証 組 入 比 券 級 総 額	
		税 分	込 配	み 金	期 謄	中 落 率		
2期(2021年9月10日)	円 12,015			円 0		% 16.2	% 96.8	百万円 6,392
3期(2022年9月12日)	13,068			0		8.8	97.3	8,335
4期(2023年9月11日)	12,323			0		△ 5.7	96.7	6,685
5期(2024年9月10日)	12,261			0		△ 0.5	96.1	8,591
6期(2025年9月10日)	12,216			0		△ 0.4	96.8	9,971

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

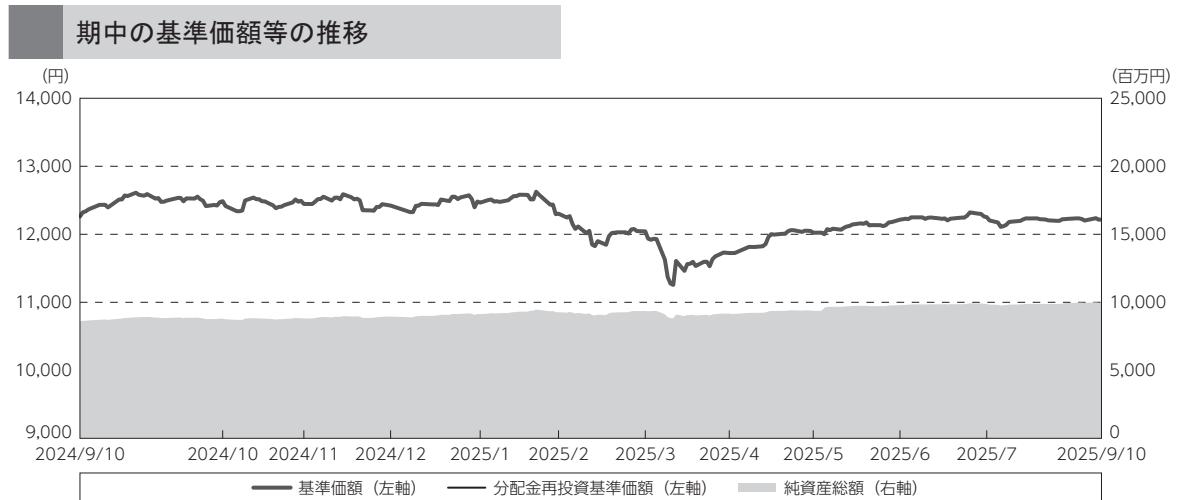
○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額	基 準 価 額		投 資 信 託 純 資 産 証 組 入 比 券 級 総 額
		騰	落 率	
(期 首) 2024年9月10日	円 12,261		% —	% 96.1
9月末	12,611		2.9	96.6
10月末	12,487		1.8	96.7
11月末	12,446		1.5	96.4
12月末	12,422		1.3	97.0
2025年1月末	12,465		1.7	96.5
2月末	12,303		0.3	96.8
3月末	12,043		△1.8	96.6
4月末	11,724		△4.4	97.3
5月末	12,023		△1.9	97.7
6月末	12,215		△0.4	97.2
7月末	12,252		△0.1	96.8
8月末	12,227		△0.3	97.2
(期 末) 2025年9月10日	12,216		△0.4	96.8

(注) 謄落率は期首比です。

○運用経過

(2024年9月11日～2025年9月10日)



期 首：12,261円

期 末：12,216円(既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 0.4% (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（2024年9月10日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) 当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指標がないため、ベンチマークならびに参考指標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（2024年9月11日～2025年9月10日）-0.4%のリターンとなりました。当ファンドでは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」）からフィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）（以下「フィデリティ・ファンド」）へ2025年8月上旬に主要投資対象を変更しました。当ファンドに8月上旬まで組み入れていたDBiポートフォリオおよび8月上旬より組み入れを開始したフィデリティ・ファンドのパフォーマンスは若干のプラスとなったものの、運用報酬等がマイナスに寄与しました。

投資環境

当期は、高ボラティリティ、政治的混乱、そして急速な技術革新に特徴づけられました。第2次トランプ政権は、成長促進型の減税政策と破壊的な関税政策を交互に打ち出し、マクロ経済の動向を支配し続けました。「トランプ・トレード」が株価と米ドルを押し上げる局面もあれば、貿易戦争や資本逃避への懸念がセンチメントを圧迫する局面もありました。2025年4月の「米国解放の日」には、予想外に積極的な関税提案が提示され、近年で最大級の2日間の急落を引き起しましたが、その後、急激な反発が続きました。

株式市場は乱高下しつつも底堅く、この期間の上昇を牽引したのは、米国テクノロジー株と、北米を除く先進国およびその他の海外市場でした。変動するインフレと財政赤字への懸念などを背景に金利が大きく変動しました。通貨、特に米ドル、円、ユーロは、度重なる反転を経験しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンドでは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」）からフィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）（以下「フィデリティ・ファンド」）へ8月上旬に主要投資対象を変更しました。

DBiポートフォリオでは、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。2025年8月5日までの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）

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+8.4%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。

期初から2025年8月までに、株式エクスパートナーはテクノロジー市場と新興国市場へとシフトし、これが2025年4月以降に大きなプラス寄与となりました。米国およびカナダを除く先進国株式市場は昨年第4四半期に苦戦しましたが、今年は大幅な上昇を見せ、全体としてはプラス要因となりました。また、長期国債における金利ポジションがプラス寄与となりました。米ドル指数のポジションはマイナス要因となりました。

CTAポートフォリオ（DBiポートフォリオの約40%を構成）

CTA（Commodity Trading Advisor）ポートフォリオのリターンはドルベースで約-2.1%となりました。

CTAポートフォリオは上位20のマネージド・ファーチャーズ・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。

期初から2025年8月までは、急激な金融市場の動きと散発的なボラティリティの高まりが確認されました。このような市場環境は、従来のトレンド追随型モデルにとって逆風となったものの、CTAポートフォリオのような複製モデルの回復力を浮き彫りにしました。CTAポートフォリオは、期初「トランプ・トレード」の論調と歩調をあわせ、株式と米ドルのロング・ポジションから大きな収益を得ました。しかし、政策の優先事項が関税と保護主義へと移行し、2025年初頭には、ドルが予想外に下落、利回りが低下したため、金のロング・ポジションがプラス寄与となったものの、全体としては大幅なマイナスリターンを記録しました。

2025年4月の「米国解放の日」は、世界的な株式市場の暴落とドルの同時暴落という異例の事態を引き起こし、マネージド・ファーチャーズ市場を揺るがしました。多くのCTAがリスク回避と損失の解消に努める一方で、CTAポートフォリオもこの影響を受けましたが、システムティックなポートフォリオ運用と裁量的なりスク管理の排除に注力したことで、その後の市場の反発局面に参加できました。6月には原油のロング・ポジションや株式エクスパートナーが奏功し、ポートフォリオは良好なパフォーマンスを示しました。

フィデリティ・ファンド

8月8日以降のフィデリティ・ファンドの円ベースのリターンの詳細は以下になります。

フィデリティ・ファンドは、複数のクオンツ・モデル（数学的手法やモデルを用いて、市場データを定量的に分析して運用を行うモデル）を活用し、システムティックな運用を効果的に行うことを目指します。ポートフォリオポジションの構築は、収益追求とリスク管理の両側面のバランスを重視してデザインされた

定量的なロジックに基づき行われます。それにより、様々な角度からポジションの分散を図り、中長期的なリスク調整後リターンを高めることを目指して運用を行います。

フィデリティ・ファンドの円ベースのリターンは、米国を中心とした株式のロングが相場上昇によりプラス寄与したことが主な要因となり、約+0.4%となりました。

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6期	
	2024年9月11日～ 2025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	2,235	

(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、ファンドの收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フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）は、フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引に係る権利に投資を行なうとともに、株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引を通じたレバレッジ取引を行ないます。複数のクオンツ・モデルを活用したシステムティックな運用を効果的に行ない、中長期的な資産の成長を目指します。

○ 1万口当たりの費用明細

(2024年9月11日～2025年9月10日)

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 81	% 0.660	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（投信会社）	(74)	(0.605)	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) その他の費用	4	0.032	(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)	(0.012)	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
（その他の）	(3)	(0.021)	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	85	0.692	
期中の平均基準価額は、12,268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おります。

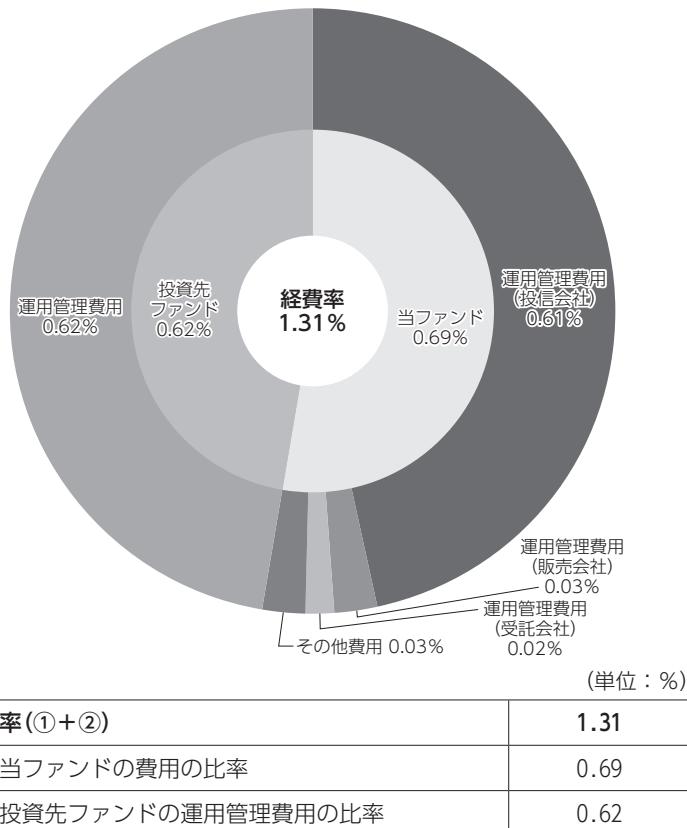
(注) 各項目の費用は、このファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）が支払った費用を含みません。

(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おります。

(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1.31%です。



(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

(2024年9月11日～2025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	9,750	1,250,000	74,567	9,509,866
	フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2 (適格機関投資家専用)	9,653,512,592	9,636,485	—	—
合計		9,653,522,342	10,886,485	74,567	9,509,866

(注) 金額は受け渡し代金。

○利害関係人との取引状況等

(2024年9月11日～2025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

(2024年9月11日～2025年9月10日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2025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 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 フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2 (適格機関投資家専用)	30	30	25	0.0	—
	64,816	—	9,653,512,592	9,655,443	96.8
合計		64,846	9,653,512,622	9,655,469	96.8

(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

(2025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	9,655,469	96.2
コール・ローン等、その他	382,908	3.8
投資信託財産総額	10,038,377	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 (2025年9月10日現在)

項目	当期末
(A) 資産	円
コール・ローン等	10,038,377,542
投資信託受益証券(評価額)	382,904,693
未収配当金	9,655,469,067
未収利息	111
未払利息	3,671
(B) 負債	67,356,744
未払解約金	33,849,846
未払信託報酬	31,765,924
その他未払費用	1,740,974
(C) 純資産総額(A-B)	9,971,020,798
元本	8,162,573,671
次期繰越損益金	1,808,447,127
(D) 受益権総口数	8,162,573,671口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,216円

(注) 当ファンドの期首元本額は7,007,435,019円、期中追加設定元本額は1,856,903,610円、期中一部解約元本額は701,764,958円です。

(注) 1口当たり純資産額は1,2216円です。

○損益の状況 (2024年9月11日～2025年9月10日)

項目	当期末
(A) 配当等収益	円
受取配当金	2,699,501
受取利息	210
その他収益金	1,042,507
(B) 有価証券売買損益	1,656,784
売買益	23,512,641
売買損	79,763,266
(C) 信託報酬等	△ 56,250,625
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 64,098,523
(E) 前期繰越損益金	△ 37,886,381
(F) 追加信託差損益金	219,421,615
(配当等相当額)	1,626,911,893
(売買損益相当額)	(1,259,292,951)
(G) 計(D+E+F)	(367,618,942)
(H) 収益分配金	1,808,447,127
次期繰越損益金(G+H)	0
追加信託差損益金	1,808,447,127
(配当等相当額)	1,626,911,893
(売買損益相当額)	(1,259,292,951)
分配準備積立金	(367,618,942)
繰越損益金	565,531,769
	△ 383,996,535

(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算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(1,259,292,951円)および分配準備積立金(565,531,769円)より分配対象収益は1,824,824,720円(1万口当たり2,235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

＜約款変更＞

- ・「投資信託および投資法人に関する法律」第14条の改正に伴い、投資信託約款の「運用報告書に記載すべき事項」の記載を「運用状況に係る情報」に変更する約款変更を行いました。（2025年4月1日）
- ・主要投資対象の変更およびそれによる運用の基本方針の変更等の理由から約款変更を行いました。（2025年8月1日）

当該約款変更の詳細は下記の通りです。

①主要投資対象の変更およびそれによる運用の基本方針の変更

当ファンドの主要投資対象に追加型証券投資信託「フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2（適格機関投資家専用）」の受益証券を追加しました。

なお、当ファンドの主要投資対象であった外国投資法人「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」の外国投資証券には、2025年8月1日以降、新たな投資は行っておりません。

以上の主要投資対象の変更に整合するよう、運用の基本方針も変更しました。

②当ファンドの名称の変更

上記①の変更に伴い、当ファンドにおける為替ヘッジの対応が変更となることから、当ファンドの名称から為替ヘッジに関する記載を削除し、下記の通りファンド名を変更しました。

旧ファンド名：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）

新ファンド名：お金のデザイン・リキッド・オルタナティブ・ファンド

③受益権の取得申込みおよび一部解約の実行の請求の受付を行わない日の変更

受益権の取得申込みおよび一部解約の実行の請求の受付を行わない日につき、現行の「ニューヨークにおける銀行の休業日」に、「ニューヨーク証券取引所の休業日」、「ロンドン証券取引所の休業日」および「ロンドンにおける銀行の休業日」を追加しました。

④ファンド・オブ・ファンズに則した規定の整備

当ファンドはファンド・オブ・ファンズのため、それを明確化すべく、投資信託約款においてファンド・オブ・ファンズとしては不要な規定（主に投資制限や運用の指図範囲等（先物取引等の運用指図、スワップ取引の運用指図、金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図等を含む）における一部項目）を削除する等の規定の訂正を行いました。

<フィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・ファンド 2 (適格機関投資家専用) >

運用の基本方針	
基本方針	この投資信託は、親投資信託であるフィデリティ・グローバルマクロ・マルチアセット・マザーファンド受益証券を通じて、主として日本を含む世界の株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引に係る権利への投資を行い、投資信託財産の成長を図ることを目的として運用を行います。
主な投資対象	日本を含む世界の株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引に係る権利を主要な投資対象とします。
投資方針	<p>① 複数のクオンツ・モデル（数学的手法やモデルを用いて、市場データを定量的に分析して運用を行うモデル）を活用し、主觀を排除したシステムティックな運用を効果的に行うことを目指します。</p> <p>② 主として株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引に係る権利へ投資します。</p> <p>③ 株価指数先物取引、債券先物取引、先物為替取引を通じたレバレッジ取引を行います。</p> <p>④ 収益獲得を目的としない為替エクスポートージャーについては為替ヘッジを行う場合があります。なお、この投資信託においては、原則として為替ヘッジは行いません。</p>
主な投資制限	<p>① 株式への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>② 債券への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>③ 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>④ デリバティブの利用はヘッジ目的に限定しません。</p> <p>⑤ デリバティブの利用による買いポジション、売りポジションのグロスの合計額は投資信託財産の純資産総額の250%以内とします。</p>
収益分配	年1回
ファンドに係る費用	
運用管理報酬	年率0.55% (税込)
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	組入れ有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、信託事務の諸費用、外国での資産の保管等に要する諸費用等が信託財産より支払われます。法定書類等の作成等に要する費用、監査費用等について、年率0.10% (税込) を上限としてファンドからの支払われます。 ※これらの費用は、運用状況等により変動するため、事前に料率・上限等を示すことができません。
その他	
運用会社	フィデリティ投信株式会社
信託期間	原則無期限 (2025年7月31日設定)
決算日	年1回 (原則として7月20日。休業日の場合は翌営業日)

当ファンドの第一回決算日が2026年7月21日のため、当運用報告書作成時点において、開示できる情報はございません。

<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(2025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(2025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	156,259,880,497	187,074,328,931	
	小計	銘柄数:1 組入時価比率:99.9%	156,259,880,497	187,074,328,931 100.0%	
	合計			187,074,328,931	

(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14期 自 2024年3月8日 至 2024年9月7日	第15期 自 2024年9月8日 至 2025年3月7日
営業収益		
受取利息	68,299	234,944
有価証券売買等損益	△2,356,258,880	△8,207,192,496
営業収益合計	△2,356,190,581	△8,206,957,552
営業費用		
支払利息	1,327	-
受託者報酬	22,813,399	22,326,584
委託者報酬	57,033,427	55,816,423
その他費用	19,738,153	29,716,950
営業費用合計	99,586,306	107,859,957
営業利益又は営業損失（△）	△2,455,776,887	△8,314,817,509
経常利益又は経常損失（△）	△2,455,776,887	△8,314,817,509
当期純利益又は当期純損失（△）	△2,455,776,887	△8,314,817,509
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次損金（△）	△17,596,442,757	△17,263,931,844
剰余金増加額又は欠損金減少額	6,024,709,600	5,684,360,300
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,024,709,600	5,684,360,300
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,557,645,800	6,449,921,700
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,557,645,800	6,449,921,700
分配金	678,776,000	706,959,000
期末剰余金又は期末欠損金（△）	△17,263,931,844	△27,051,269,753

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第14期 自 2024年3月8日 至 2024年9月7日			第15期 自 2024年9月8日 至 2025年3月7日		
1. 分配金の計算過程					
項目			項目		
当期配当等収益額	A	66,972 円	当期配当等収益額	A	234,944 円
親ファンドの配当等収益額	B	765,853,434 円	親ファンドの配当等収益額	B	824,311,369 円
分配準備積立金	C	12,475,792 円	分配準備積立金	C	35,219 円
配当等収益合計額	D=A+B+C	778,396,198 円	配当等収益合計額	D=A+B+C	824,581,532 円
経費	E	99,584,979 円	経費	E	107,859,957 円
収益分配可能額	F=D-E	678,811,219 円	収益分配可能額	F=D-E	716,721,575 円
収益分配金	G	678,776,000 円	収益分配金	G	706,959,000 円
次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	35,219 円	次期繰越金(分配準備積立金)	H=F-G	9,762,575 円
口数	I	199,640,000 口	口数	I	214,230,000 口
100 口当たり分配金	J=G/I×100	340 円	100 口当たり分配金	J=G/I×100	330 円
2. その他費用					
その他費用のうち 6,004,047 円は上場に係る費用、 11,452,785 円は対象指標についての商標使用料であります。					
その他費用のうち 16,321,057 円は上場に係る費用、 11,163,234 円は対象指標についての商標使用料であります。					

◎組入資産の明細

(2024年4月1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	利	率	当期末		
			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452回		0.005	28,000,000	27,970,040	2025/9/1
国庫債券 利付(2年) 第453回		0.005	26,000,000	25,966,720	2025/10/1
国庫債券 利付(2年) 第455回		0.005	15,000,000	14,966,250	2025/12/1
国庫債券 利付(2年) 第456回		0.1	10,000,000	9,989,500	2026/1/1
国庫債券 利付(5年) 第145回		0.1	3,900,000	3,900,819	2025/9/20
国庫債券 利付(5年) 第146回		0.1	5,100,000	5,096,022	2025/12/20
国庫債券 利付(5年) 第147回		0.005	5,600,000	5,581,352	2026/3/20
国庫債券 利付(5年) 第148回		0.005	6,500,000	6,474,130	2026/6/20
国庫債券 利付(5年) 第149回		0.005	4,100,000	4,081,345	2026/9/20
国庫債券 利付(5年) 第150回		0.005	6,300,000	6,267,618	2026/12/20
国庫債券 利付(5年) 第151回		0.005	4,500,000	4,473,450	2027/3/20
国庫債券 利付(5年) 第152回		0.1	4,000,000	3,987,600	2027/3/20
国庫債券 利付(5年) 第153回		0.005	9,000,000	8,938,170	2027/6/20
国庫債券 利付(5年) 第154回		0.1	10,000,000	9,951,800	2027/9/20
国庫債券 利付(5年) 第155回		0.3	4,500,000	4,506,615	2027/12/20
国庫債券 利付(5年) 第156回		0.2	5,000,000	4,988,950	2027/12/20
国庫債券 利付(5年) 第157回		0.2	12,000,000	11,959,920	2028/3/20
国庫債券 利付(5年) 第158回		0.1	6,500,000	6,452,810	2028/3/20
国庫債券 利付(5年) 第159回		0.1	6,000,000	5,950,020	2028/6/20
国庫債券 利付(5年) 第160回		0.2	3,500,000	3,485,405	2028/6/20
国庫債券 利付(5年) 第161回		0.3	2,000,000	2,000,000	2028/6/20
国庫債券 利付(5年) 第162回		0.3	13,000,000	12,979,850	2028/9/20
国庫債券 利付(5年) 第163回		0.4	13,000,000	13,034,320	2028/9/20
国庫債券 利付(5年) 第164回		0.2	5,000,000	4,961,700	2028/12/20
国庫債券 利付(5年) 第165回		0.3	10,000,000	9,969,800	2028/12/20
国庫債券 利付(5年) 第166回		0.4	1,500,000	1,502,430	2028/12/20
国庫債券 C T利付(5年) 第1回		0.3	500,000	498,605	2028/12/20
国庫債券 利付(40年) 第1回		2.4	1,860,000	2,138,125	2048/3/20
国庫債券 利付(40年) 第2回		2.2	2,700,000	2,991,654	2049/3/20
国庫債券 利付(40年) 第3回		2.2	900,000	993,582	2050/3/20
国庫債券 利付(40年) 第4回		2.2	1,630,000	1,793,945	2051/3/20
国庫債券 利付(40年) 第5回		2.0	1,300,000	1,370,018	2052/3/20
国庫債券 利付(40年) 第6回		1.9	2,000,000	2,057,660	2053/3/20
国庫債券 利付(40年) 第7回		1.7	2,500,000	2,444,175	2054/3/20
国庫債券 利付(40年) 第8回		1.4	1,500,000	1,357,755	2055/3/20
国庫債券 利付(40年) 第9回		0.4	4,850,000	3,199,593	2056/3/20
国庫債券 利付(40年) 第10回		0.9	2,810,000	2,172,186	2057/3/20
国庫債券 利付(40年) 第11回		0.8	1,750,000	1,296,417	2058/3/20
国庫債券 利付(40年) 第12回		0.5	2,370,000	1,555,312	2059/3/20
国庫債券 利付(40年) 第13回		0.5	5,000,000	3,238,050	2060/3/20
国庫債券 利付(40年) 第14回		0.7	2,960,000	2,040,298	2061/3/20
国庫債券 利付(40年) 第15回		1.0	4,000,000	3,032,120	2062/3/20
国庫債券 利付(40年) 第16回		1.3	5,500,000	4,557,080	2063/3/20
国庫債券 C T利付(10年) 第1回		0.7	500,000	498,635	2033/12/20
国庫債券 利付(10年) 第340回		0.4	4,200,000	4,219,362	2025/9/20
国庫債券 利付(10年) 第341回		0.3	2,600,000	2,606,890	2025/12/20

銘 柄	利 率	当 期 末		
		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	4,543,311	2026/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第343回	0.1	6,000,000	5,988,720	2026/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第344回	0.1	6,400,000	6,385,792	2026/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第345回	0.1	5,500,000	5,485,865	2026/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第346回	0.1	5,000,000	4,984,500	2027/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第347回	0.1	10,000,000	9,961,600	2027/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第348回	0.1	10,000,000	9,951,800	2027/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第349回	0.1	7,500,000	7,455,750	2027/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第350回	0.1	11,650,000	11,565,421	2028/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第351回	0.1	9,500,000	9,420,865	2028/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第352回	0.1	9,000,000	8,906,850	2028/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第353回	0.1	5,000,000	4,939,650	2028/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第354回	0.1	3,000,000	2,989,050	2029/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第357回	0.1	4,500,000	4,424,535	2029/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第358回	0.1	5,570,000	5,469,461	2030/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第359回	0.1	7,500,000	7,352,325	2030/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第360回	0.1	13,000,000	12,717,900	2030/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第361回	0.1	8,000,000	7,809,760	2030/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第362回	0.1	8,500,000	8,276,705	2031/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第363回	0.1	12,050,000	11,701,996	2031/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第364回	0.1	9,050,000	8,764,110	2031/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第365回	0.1	9,500,000	9,173,295	2031/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第366回	0.2	9,000,000	8,739,630	2032/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第367回	0.2	10,500,000	10,171,035	2032/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第368回	0.2	10,000,000	9,662,000	2032/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第369回	0.5	12,000,000	11,866,080	2032/12/20
国庫債券 利付 (10年) 第370回	0.5	15,000,000	14,796,750	2033/3/20
国庫債券 利付 (10年) 第371回	0.4	9,000,000	8,777,610	2033/6/20
国庫債券 利付 (10年) 第372回	0.8	12,000,000	12,106,440	2033/9/20
国庫債券 利付 (10年) 第373回	0.6	9,000,000	8,885,700	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第1回	2.8	2,000,000	2,260,480	2029/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第2回	2.4	500,000	558,000	2030/2/20
国庫債券 利付 (30年) 第3回	2.3	160,000	178,192	2030/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第4回	2.9	1,400,000	1,623,608	2030/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第5回	2.2	150,000	167,847	2031/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第6回	2.4	900,000	1,024,254	2031/11/20
国庫債券 利付 (30年) 第7回	2.3	600,000	681,456	2032/5/20
国庫債券 利付 (30年) 第8回	1.8	100,000	109,858	2032/11/22
国庫債券 利付 (30年) 第9回	1.4	265,000	282,211	2032/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第10回	1.1	250,000	259,637	2033/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第11回	1.7	660,000	720,258	2033/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第12回	2.1	720,000	812,030	2033/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第13回	2.0	1,090,000	1,218,925	2033/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第14回	2.4	800,000	925,816	2034/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第15回	2.5	1,000,000	1,168,280	2034/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第16回	2.5	1,415,000	1,655,351	2034/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第17回	2.4	1,500,000	1,742,070	2034/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第18回	2.3	2,200,000	2,533,916	2035/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利	率	額 面 金 額	評 価 額
		%	千円	千円	償還年月日
国債証券					
国庫債券	利付 (30年) 第19回	2.3	1,550,000	1,787,460	2035/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第20回	2.5	770,000	905,597	2035/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第21回	2.3	300,000	346,353	2035/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第22回	2.5	600,000	706,746	2036/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第23回	2.5	840,000	990,645	2036/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第24回	2.5	700,000	826,014	2036/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第25回	2.3	500,000	578,560	2036/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第26回	2.4	850,000	993,981	2037/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第27回	2.5	1,150,000	1,359,587	2037/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第28回	2.5	1,000,000	1,182,350	2038/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第29回	2.4	2,000,000	2,337,660	2038/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第30回	2.3	2,500,000	2,885,475	2039/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第31回	2.2	1,700,000	1,935,671	2039/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第32回	2.3	4,000,000	4,604,920	2040/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第33回	2.0	2,400,000	2,653,056	2040/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第34回	2.2	4,500,000	5,091,210	2041/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第35回	2.0	2,300,000	2,525,584	2041/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第36回	2.0	3,500,000	3,837,225	2042/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第37回	1.9	2,300,000	2,477,836	2042/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第38回	1.8	1,600,000	1,693,360	2043/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第39回	1.9	1,400,000	1,502,578	2043/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第40回	1.8	1,300,000	1,369,069	2043/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第41回	1.7	2,000,000	2,068,720	2043/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第42回	1.7	3,000,000	3,096,930	2044/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第43回	1.7	1,000,000	1,031,020	2044/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第44回	1.7	1,400,000	1,441,580	2044/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第45回	1.5	1,700,000	1,687,981	2044/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第46回	1.5	1,800,000	1,784,340	2045/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第47回	1.6	1,700,000	1,713,566	2045/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第48回	1.4	1,900,000	1,843,684	2045/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第49回	1.4	2,900,000	2,808,766	2045/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第50回	0.8	2,400,000	2,052,912	2046/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第51回	0.3	4,150,000	3,152,049	2046/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第52回	0.5	2,200,000	1,745,238	2046/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第53回	0.6	1,700,000	1,375,487	2046/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第54回	0.8	1,700,000	1,435,429	2047/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第55回	0.8	1,500,000	1,262,655	2047/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第56回	0.8	1,700,000	1,426,572	2047/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第57回	0.8	2,000,000	1,673,120	2047/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第58回	0.8	3,000,000	2,501,910	2048/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第59回	0.7	3,000,000	2,435,220	2048/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第60回	0.9	1,650,000	1,401,312	2048/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第61回	0.7	2,000,000	1,612,600	2048/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第62回	0.5	3,000,000	2,286,870	2049/3/20
国庫債券	利付 (30年) 第63回	0.4	4,500,000	3,320,910	2049/6/20
国庫債券	利付 (30年) 第64回	0.4	4,500,000	3,304,575	2049/9/20
国庫債券	利付 (30年) 第65回	0.4	3,800,000	2,781,600	2049/12/20
国庫債券	利付 (30年) 第66回	0.4	6,000,000	4,366,800	2050/3/20

銘 柄	利 率	当 期 末		
		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67回	0.6	3,500,000	2,680,300	2050/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第68回	0.6	3,450,000	2,632,281	2050/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第69回	0.7	2,700,000	2,110,833	2050/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第70回	0.7	2,610,000	2,033,424	2051/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第71回	0.7	2,700,000	2,096,172	2051/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第72回	0.7	2,200,000	1,702,008	2051/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第73回	0.7	3,000,000	2,312,760	2051/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第74回	1.0	4,000,000	3,336,480	2052/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第75回	1.3	3,000,000	2,694,090	2052/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第76回	1.4	3,000,000	2,755,950	2052/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第77回	1.6	3,000,000	2,886,390	2052/12/20
国庫債券 利付 (30年) 第78回	1.4	2,800,000	2,564,772	2053/3/20
国庫債券 利付 (30年) 第79回	1.2	1,500,000	1,307,640	2053/6/20
国庫債券 利付 (30年) 第80回	1.8	3,500,000	3,510,115	2053/9/20
国庫債券 利付 (30年) 第81回	1.6	4,000,000	3,822,880	2053/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第78回	1.9	800,000	817,992	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第79回	2.0	860,000	880,382	2025/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第81回	2.0	360,000	370,108	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第82回	2.1	820,000	844,231	2025/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第83回	2.1	1,370,000	1,415,881	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第84回	2.0	1,200,000	1,238,136	2025/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第85回	2.1	400,000	415,112	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第86回	2.3	1,700,000	1,770,890	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第87回	2.2	500,000	519,870	2026/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第88回	2.3	1,100,000	1,151,480	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第89回	2.2	470,000	490,957	2026/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第90回	2.2	1,500,000	1,574,265	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第91回	2.3	250,000	262,992	2026/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第92回	2.1	650,000	683,566	2026/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第93回	2.0	2,300,000	2,421,992	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第94回	2.1	3,700,000	3,907,163	2027/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第95回	2.3	1,500,000	1,599,900	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第96回	2.1	1,500,000	1,590,315	2027/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第97回	2.2	1,500,000	1,601,400	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第98回	2.1	1,300,000	1,383,408	2027/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第99回	2.1	1,100,000	1,174,734	2027/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第100回	2.2	820,000	881,901	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第101回	2.4	750,000	812,497	2028/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第102回	2.4	1,500,000	1,631,835	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第103回	2.3	600,000	650,232	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第104回	2.1	400,000	430,156	2028/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第105回	2.1	1,900,000	2,048,542	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第106回	2.2	400,000	433,032	2028/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第107回	2.1	800,000	864,768	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第108回	1.9	1,000,000	1,071,680	2028/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第109回	1.9	900,000	967,356	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第110回	2.1	2,600,000	2,819,934	2029/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第111回	2.2	500,000	546,685	2029/6/20

銘 柄	利 率	当 期 末		
		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112回	2.1	500,000	544,125	2029/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第113回	2.1	500,000	546,215	2029/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第115回	2.2	1,000,000	1,101,850	2029/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第116回	2.2	1,100,000	1,216,050	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第117回	2.1	1,400,000	1,539,538	2030/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第118回	2.0	1,100,000	1,206,381	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第119回	1.8	800,000	867,664	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第120回	1.6	800,000	857,704	2030/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第121回	1.9	1,900,000	2,076,415	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第122回	1.8	900,000	977,904	2030/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第123回	2.1	2,000,000	2,216,620	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第124回	2.0	1,400,000	1,542,492	2030/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第125回	2.2	1,800,000	2,011,338	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第126回	2.0	2,000,000	2,207,080	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第127回	1.9	1,200,000	1,316,160	2031/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第128回	1.9	2,800,000	3,075,156	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第129回	1.8	1,300,000	1,418,690	2031/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第130回	1.8	2,200,000	2,404,160	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第131回	1.7	800,000	868,488	2031/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第132回	1.7	1,300,000	1,412,242	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第133回	1.8	1,900,000	2,078,125	2031/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第134回	1.8	1,900,000	2,081,203	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第135回	1.7	700,000	761,418	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第136回	1.6	700,000	755,790	2032/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第137回	1.7	1,000,000	1,088,690	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第138回	1.5	800,000	858,056	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第139回	1.6	1,000,000	1,080,840	2032/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第140回	1.7	3,000,000	3,268,560	2032/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第141回	1.7	2,600,000	2,834,572	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第142回	1.8	950,000	1,044,002	2032/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第143回	1.6	2,300,000	2,488,232	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第144回	1.5	1,300,000	1,395,368	2033/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第145回	1.7	3,300,000	3,601,290	2033/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第146回	1.7	4,500,000	4,910,490	2033/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第147回	1.6	5,500,000	5,944,950	2033/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第148回	1.5	4,800,000	5,140,896	2034/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第149回	1.5	4,350,000	4,655,152	2034/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第150回	1.4	4,530,000	4,799,489	2034/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第151回	1.2	5,000,000	5,192,300	2034/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第152回	1.2	3,150,000	3,267,117	2035/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第153回	1.3	4,000,000	4,186,440	2035/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第154回	1.2	1,820,000	1,882,626	2035/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第155回	1.0	3,850,000	3,890,771	2035/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第156回	0.4	5,150,000	4,845,686	2036/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第157回	0.2	4,000,000	3,657,600	2036/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第158回	0.5	1,970,000	1,862,851	2036/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第159回	0.6	2,010,000	1,918,203	2036/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第160回	0.7	3,000,000	2,890,050	2037/3/20

銘	柄	当 期 末			
		利	率	額 面 金 額	評 価 額
		%	千円	千円	償還年月日
国債証券					
国庫債券 利付 (20年) 第161回		0.6	3,500,000	3,317,195	2037/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第162回		0.6	3,500,000	3,304,385	2037/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第163回		0.6	3,500,000	3,291,400	2037/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第164回		0.5	4,000,000	3,696,040	2038/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第165回		0.5	3,500,000	3,220,035	2038/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第166回		0.7	4,000,000	3,772,000	2038/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第167回		0.5	8,500,000	7,755,655	2038/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第168回		0.4	2,000,000	1,789,060	2039/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第169回		0.3	4,430,000	3,882,009	2039/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第170回		0.3	4,300,000	3,748,611	2039/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第171回		0.3	5,500,000	4,769,710	2039/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第172回		0.4	4,840,000	4,247,245	2040/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第173回		0.4	7,000,000	6,111,210	2040/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第174回		0.4	6,970,000	6,053,375	2040/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第175回		0.5	7,500,000	6,590,025	2040/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第176回		0.5	8,020,000	7,011,244	2041/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第177回		0.4	7,570,000	6,470,457	2041/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第178回		0.5	6,950,000	6,017,101	2041/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第179回		0.5	8,000,000	6,894,640	2041/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第180回		0.8	6,500,000	5,889,455	2042/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第181回		0.9	5,000,000	4,593,750	2042/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第182回		1.1	4,000,000	3,793,280	2042/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第183回		1.4	4,500,000	4,473,450	2042/12/20
国庫債券 利付 (20年) 第184回		1.1	3,000,000	2,829,090	2043/3/20
国庫債券 利付 (20年) 第185回		1.1	2,000,000	1,879,260	2043/6/20
国庫債券 利付 (20年) 第186回		1.5	8,000,000	8,024,160	2043/9/20
国庫債券 利付 (20年) 第187回		1.3	1,000,000	966,620	2043/12/20
大韓民国円貨債券 (2023) 第2回		0.75	100,000	100,812	2028/9/14
大韓民国円貨債券 (2023) 第3回		1.032	100,000	101,417	2030/9/13
ボーランド共和国 第16回円貨債券 (2023)		0.93	100,000	100,078	2026/11/20
ボーランド共和国 第17回円貨債券 (2023)		1.75	100,000	101,170	2033/11/22
ハンガリー円貨債券 (2020) 第8回		0.74	100,000	99,476	2025/9/18
ハンガリー円貨債券 (2020) 第1回		1.03	100,000	98,328	2027/9/17
小 計			974,440,000	947,365,864	
地方債証券					
東京都 公募第745回		0.533	300,000	301,398	2025/6/20
東京都 公募第747回		0.475	100,000	100,417	2025/9/19
東京都 公募第751回		0.37	100,000	100,213	2025/12/19
東京都 公募第760回		0.045	100,000	99,387	2026/9/18
東京都 公募第761回		0.075	100,000	99,461	2026/9/18
東京都 公募第769回		0.21	500,000	498,325	2027/6/18
東京都 公募第778回		0.165	100,000	99,141	2028/3/17
東京都 公募第784回		0.254	200,000	198,454	2028/9/20
東京都 公募第794回		0.05	100,000	97,759	2029/6/20
東京都 公募第800回		0.08	100,000	97,667	2029/12/20
東京都 公募第813回		0.179	200,000	194,944	2030/12/20
東京都 公募第822回		0.095	130,000	124,907	2031/9/19
東京都 公募第830回		0.275	400,000	386,624	2032/6/18

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額		
地方債証券	%	千円	千円		
東京都 公募第843回	0.8	400,000	400,668	2033/6/20	
東京都 公募(30年)第7回	2.51	100,000	116,678	2038/9/17	
東京都 公募第10回	2.31	200,000	227,444	2039/9/20	
東京都 公募(30年)第5回	0.74	200,000	152,592	2051/9/20	
東京都 公募第7回	2.16	100,000	102,892	2025/9/19	
東京都 公募(20年)第11回	2.22	100,000	105,626	2027/3/19	
東京都 公募(20年)第13回	2.15	100,000	106,553	2027/12/20	
東京都 公募(20年)第15回	2.32	100,000	108,340	2028/9/20	
東京都 公募(20年)第16回	2.01	200,000	214,424	2028/12/20	
東京都 公募(20年)第17回	2.09	200,000	215,164	2028/12/20	
東京都 公募(20年)第20回	2.09	280,000	303,956	2029/9/20	
東京都 公募第23回	2.12	100,000	110,185	2030/12/20	
東京都 公募(20年)第26回	1.74	100,000	108,247	2032/6/18	
東京都 公募(20年)第28回	1.59	100,000	107,108	2033/3/18	
東京都 公募(20年)第29回	1.57	200,000	213,746	2033/9/20	
東京都 公募(20年)第30回	1.508	100,000	105,985	2034/6/20	
東京都 公募(20年)第32回	1.293	100,000	103,366	2035/6/20	
東京都 公募(5年)第32回	0.02	300,000	299,505	2025/6/20	
北海道 公募平成27年度第7回	0.529	100,000	100,477	2025/8/28	
北海道 公募平成29年度第5回	0.18	200,000	199,032	2027/6/30	
北海道 公募平成29年度第7回	0.21	100,000	99,547	2027/8/31	
北海道 公募平成29年度第9回	0.205	100,000	99,452	2027/10/27	
北海道 公募平成29年度第11回	0.635	100,000	93,002	2037/12/25	
北海道 公募平成30年度第15回	0.291	223,200	214,017	2038/9/24	
北海道 公募平成30年度第18回	0.146	200,000	196,744	2029/2/28	
北海道 公募令和2年度第4回	0.165	300,000	293,205	2030/6/26	
北海道 公募令和4年度第5回	0.3	100,000	96,585	2032/8/31	
北海道 公募令和5年度第2回	0.245	100,000	99,331	2028/5/31	
北海道 公募令和5年度第8回	0.895	100,000	100,576	2033/10/31	
北海道 公募令和5年度第10回	0.861	300,000	300,297	2033/12/27	
宮城県 公募第31回1号	0.515	300,000	301,428	2025/9/29	
宮城県 公募第32回2号	0.105	100,000	99,529	2026/9/28	
神奈川県 公募第231回	0.22	200,000	198,934	2027/12/20	
神奈川県 公募第243回	0.075	200,000	195,278	2029/12/20	
神奈川県 公募第247回	0.12	339,150	330,769	2030/6/20	
神奈川県 公募第254回	0.12	180,000	173,271	2031/9/19	
神奈川県 公募第258回	0.29	100,000	96,773	2032/6/18	
神奈川県 公募(30年)第3回	2.62	100,000	118,070	2037/3/19	
神奈川県 公募第7回	2.22	300,000	316,878	2027/3/19	
神奈川県 公募(20年)第13回	2.21	100,000	109,610	2029/12/20	
神奈川県 公募(20年)第14回	1.969	100,000	108,839	2030/7/19	
神奈川県 公募(20年)第17回	1.975	200,000	219,182	2031/7/11	
神奈川県 公募(20年)第20回	1.706	100,000	107,982	2032/6/18	
神奈川県 公募(20年)第21回	1.732	200,000	216,492	2032/9/17	
神奈川県 公募(20年)第26回	1.477	100,000	105,694	2034/6/20	
神奈川県 公募(20年)第27回	1.398	100,000	104,812	2034/9/20	
神奈川県 公募(20年)第46回	0.4	100,000	84,022	2041/6/20	
大阪府 公募第396回	0.554	200,000	200,932	2025/5/28	

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	
大阪府	公募第417回	0.248	102,000	101,831	2027/2/26
大阪府	公募第423回	0.185	100,000	99,497	2027/8/30
大阪府	公募第429回	0.197	179,000	177,738	2028/2/25
大阪府	公募第451回	0.063	130,000	126,835	2029/12/26
大阪府	公募第452回	0.062	100,000	97,490	2030/1/30
大阪府	公募第458回	0.1	140,000	136,225	2030/7/30
大阪府	公募第467回	0.164	140,000	135,805	2031/4/28
大阪府	公募第469回	0.128	150,000	144,882	2031/6/27
大阪府	公募第479回	0.29	200,000	193,662	2032/5/28
大阪府	公募第481回	0.4	100,000	97,395	2032/9/29
大阪府	公募第489回	0.68	176,000	174,065	2033/8/30
大阪府	公募第492回	0.968	156,000	158,001	2033/11/29
大阪府	公募(20年)第1回	2.19	100,000	109,063	2029/9/14
大阪府	公募(20年)第2回	2.23	100,000	109,565	2029/11/16
大阪府	公募第5回	2.16	100,000	109,851	2030/5/28
大阪府	公募第8回	1.83	100,000	108,770	2031/12/22
大阪府	公募(20年)第12回	1.453	200,000	210,692	2034/9/26
大阪府	公募(5年)第173回	0.001	200,000	199,558	2025/7/30
大阪府	公募(5年)第174回	0.001	200,000	199,500	2025/8/28
大阪府	公募(5年)第178回	0.001	400,000	398,312	2025/12/25
大阪府	公募(5年)第184回	0.001	400,000	397,412	2026/6/29
大阪府	公募(5年)第187回	0.001	144,000	142,950	2026/9/29
大阪府	公募(5年)第190回	0.001	200,000	198,376	2026/12/25
京都府	公募(20年)平成20年度第2回	2.26	200,000	216,116	2028/9/21
京都府	公募平成26年度第5回	1.455	100,000	105,455	2034/8/10
京都府	公募(20年)平成27年度第5回	1.23	200,000	205,222	2035/8/17
京都府	公募(15年)平成27年度第8回	0.78	100,000	101,482	2030/10/11
京都府	公募(15年)平成28年度第2回	0.21	200,000	194,646	2031/4/22
京都府	公募(20年)平成28年度第5回	0.327	200,000	182,940	2036/8/15
京都府	公募平成29年度第4回	0.19	100,000	99,585	2027/6/21
京都府	公募令和3年度第5回	0.405	100,000	83,861	2041/8/16
兵庫県	公募平成29年度第22回	0.19	100,000	99,323	2028/1/21
兵庫県	公募令和3年度第5回	0.09	100,000	96,231	2031/7/18
兵庫県	公募(30年)第2回	2.36	200,000	228,590	2040/3/19
兵庫県	公募(15年)第1回	1.66	300,000	309,492	2026/7/29
兵庫県	公募(15年)第3回	1.35	200,000	206,698	2027/7/16
兵庫県	公募(15年)第8回	1.09	500,000	515,010	2029/4/16
兵庫県	公募(15年)第11回	0.718	100,000	101,141	2030/5/10
兵庫県	公募第2回	2.37	100,000	106,949	2027/9/17
兵庫県	公募第9回	2.25	100,000	109,688	2029/11/19
兵庫県	公募(20年)第11回	1.84	200,000	216,160	2030/8/16
兵庫県	公募(20年)第14回	1.72	100,000	108,069	2032/5/24
兵庫県	公募(20年)第19回	1.57	100,000	106,740	2033/12/9
兵庫県	公募(20年)第21回	1.54	100,000	106,270	2034/5/9
兵庫県	公募(20年)第22回	1.4	100,000	104,867	2034/9/8
静岡県	公募平成27年度第11回	0.11	115,400	115,018	2026/3/19
静岡県	公募平成28年度第2回	0.08	300,000	298,833	2026/3/19
静岡県	公募平成29年度第3回	0.17	100,000	99,588	2027/3/19

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
地方債証券					
静岡県 公募 (31年) 第1回	0.095	174,000	170,747	千円	2029/3/19
静岡県 公募 (5年) 令和3年度第2回	0.01	100,000	99,474	千円	2026/3/19
静岡県 公募 (5年) 令和3年度第5回	0.005	300,000	298,110	千円	2026/6/19
静岡県 公募 (15年) 第2回	1.406	300,000	310,422	千円	2027/6/25
静岡県 公募 (15年) 第5回	1.087	200,000	205,834	千円	2028/11/20
静岡県 公募 (15年) 第9回	0.739	100,000	101,243	千円	2030/9/20
静岡県 公募 (30年) 第15回	0.731	100,000	76,139	千円	2051/9/20
静岡県 公募 (20年) 第11回	1.841	100,000	108,232	千円	2030/10/18
静岡県 公募 (20年) 第14回	1.736	200,000	216,432	千円	2032/6/18
静岡県 公募 (20年) 第18回	1.473	200,000	211,268	千円	2034/7/10
静岡県 公募 (20年) 第30回	0.449	200,000	172,350	千円	2040/9/20
愛知県 公募 (20年) 平成19年度第2回	2.41	100,000	106,665	千円	2027/6/18
愛知県 公募平成20年度第8回	2.04	100,000	107,376	千円	2028/12/20
愛知県 公募 (20年) 平成22年度第8回	1.891	200,000	216,918	千円	2030/9/13
愛知県 公募 (15年) 平成23年度第13回	1.529	100,000	103,193	千円	2026/11/13
愛知県 公募 (20年) 平成24年度第4回	1.687	100,000	107,817	千円	2032/6/11
愛知県 公募 (15年) 平成24年度第14回	1.314	400,000	413,864	千円	2027/12/13
愛知県 公募平成24年度第17回	1.829	100,000	109,153	千円	2033/2/8
愛知県 公募 (30年) 平成25年度第8回	2.024	120,000	128,841	千円	2043/6/19
愛知県 公募 (20年) 平成25年度第17回	1.608	400,000	428,220	千円	2033/12/20
愛知県 公募 (20年) 平成26年度第4回	1.542	100,000	106,298	千円	2034/5/15
愛知県 公募平成26年度第8回	1.814	100,000	103,174	千円	2044/6/20
愛知県 公募平成26年度第13回	1.363	200,000	208,868	千円	2034/11/14
愛知県 公募 (15年) 平成27年度第2回	0.74	300,000	303,879	千円	2030/4/26
愛知県 公募 (30年) 平成27年度第8回	1.579	100,000	98,571	千円	2045/6/20
愛知県 公募平成27年度第15回	0.471	100,000	100,399	千円	2025/11/27
愛知県 公募平成29年度第8回	0.2	100,000	99,547	千円	2027/8/31
愛知県 公募平成29年度第9回	0.15	100,000	99,368	千円	2027/9/15
愛知県 公募平成30年度第7回	0.18	200,000	198,002	千円	2028/7/31
愛知県 公募令和3年度第10回	0.001	200,000	198,516	千円	2026/10/15
広島県 公募平成29年度第3回	0.15	100,000	99,344	千円	2027/9/27
広島県 公募平成29年度第4回	0.22	211,300	210,270	千円	2027/11/24
広島県 公募令和2年度第2回	0.165	100,000	97,740	千円	2030/7/22
広島県 公募令和2年度第7回	0.214	300,000	292,347	千円	2031/3/19
広島県 公募令和5年度第4回	0.977	140,000	141,905	千円	2033/11/24
広島県 公募 (20年) 令和3年度第2回	0.434	100,000	84,131	千円	2041/9/20
埼玉県 公募平成27年度第9回	0.235	100,000	99,937	千円	2026/2/25
埼玉県 公募平成28年度第5回	0.05	100,000	99,444	千円	2026/7/28
埼玉県 公募平成30年度第4回	0.205	200,000	198,340	千円	2028/6/26
埼玉県 公募令和元年度第4回	0.055	100,000	97,784	千円	2029/6/20
埼玉県 公募令和2年度第4回	0.145	300,000	293,046	千円	2030/6/17
埼玉県 公募令和5年度第4回	0.767	100,000	99,616	千円	2033/9/27
埼玉県 公募 (15年) 第1回	0.941	200,000	204,822	千円	2029/10/19
埼玉県 公募 (15年) 第2回	0.869	200,000	204,090	千円	2030/5/22
埼玉県 公募 (15年) 第3回	0.43	100,000	98,250	千円	2032/1/30
埼玉県 公募 (25年) 第2回	0.781	200,000	176,216	千円	2042/9/19
埼玉県 公募 (30年) 第9回	0.845	200,000	165,130	千円	2048/3/19
埼玉県 公募 (15年) 第7回	0.34	200,000	186,304	千円	2035/8/17

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券					
埼玉県	公募 (15年) 第8回	0.367	100,000	92,446	2036/4/18
埼玉県	公募 (20年) 第6回	2.26	100,000	108,058	2028/9/21
埼玉県	公募 (20年) 第13回	1.599	100,000	107,169	2033/5/20
埼玉県	公募 (20年) 第16回	1.216	200,000	204,930	2035/8/14
埼玉県	公募 (20年) 第19回	0.536	200,000	186,902	2036/12/12
埼玉県	公募 (20年) 第20回	0.626	100,000	93,965	2037/5/15
埼玉県	公募 (20年) 第26回	0.377	100,000	85,744	2040/5/21
埼玉県	公募 (20年) 第27回	0.44	100,000	85,612	2040/12/11
福岡県	公募平成27年度第1回	0.578	300,000	301,563	2025/6/26
福岡県	公募平成29年度第1回	0.2	100,000	99,615	2027/6/23
福岡県	公募平成23年度第1回	1.491	100,000	103,140	2026/11/27
福岡県	公募 (15年) 平成27年度第1回	0.784	200,000	202,944	2030/11/25
福岡県	公募 (15年) 令和元年度第1回	0.254	300,000	281,718	2034/6/14
福岡県	公募 (15年) 令和元年度第2回	0.269	200,000	186,740	2034/12/13
福岡県	公募 (30年) 平成19年度第1回	2.62	100,000	118,081	2037/9/18
福岡県	公募 (30年) 平成26年度第1回	1.827	100,000	103,373	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	84,594	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	72,744	2049/6/18
福岡県	公募 (20年) 平成20年度第1回	2.26	300,000	323,823	2028/8/18
福岡県	公募 (20年) 平成20年度第2回	2.05	100,000	107,422	2028/12/20
福岡県	公募 (20年) 平成22年度第1回	1.77	300,000	322,974	2030/8/19
福岡県	公募 (20年) 平成22年度第2回	2.116	300,000	330,885	2031/2/21
福岡県	公募 (20年) 平成24年度第2回	1.635	100,000	107,440	2032/8/16
福岡県	公募 (20年) 平成26年度第1回	1.542	100,000	106,315	2034/5/26
福岡県	公募 (20年) 平成29年度第1回	0.626	100,000	93,897	2037/5/29
福岡県	公募 (20年・定時償還) 令和3年度第1回	0.449	200,000	168,674	2041/9/20
千葉県	公募平成27年度第6回	0.469	200,000	200,772	2025/12/25
千葉県	公募平成28年度第4回	0.085	200,000	198,962	2026/9/25
千葉県	公募平成29年度第4回	0.15	100,000	99,345	2027/9/24
千葉県	公募平成29年度第8回	0.2	100,000	99,254	2028/3/24
千葉県	公募令和元年度第6回	0.135	300,000	293,727	2030/1/25
千葉県	公募令和3年度第2回	0.01	200,000	198,822	2026/5/25
千葉県	公募令和4年度第4回	0.374	100,000	97,190	2032/9/24
千葉県	公募令和5年度第9回	0.778	200,000	198,888	2033/12/23
千葉県	公募 (20年) 第1回	2.06	400,000	412,452	2025/12/19
千葉県	公募 (20年) 第8回	2.18	100,000	109,835	2030/4/19
千葉県	公募 (20年) 第13回	1.701	200,000	216,052	2032/10/15
千葉県	公募 (20年) 第16回	1.555	300,000	319,107	2034/4/14
千葉県	公募 (20年) 第17回	1.403	100,000	104,836	2034/10/13
千葉県	公募 (20年) 第20回	0.42	100,000	93,066	2036/4/15
千葉県	公募 (20年) 第25回	0.701	100,000	92,840	2038/10/15
新潟県	公募平成30年度第2回	0.264	200,000	198,252	2028/11/30
新潟県	公募令和2年度第2回	0.135	120,000	116,613	2030/11/29
長野県	公募令和3年度第1回	0.19	300,000	291,678	2031/4/16
長野県	公募令和3年度第5回	0.001	100,000	99,188	2026/12/25
茨城県	公募令和3年度第3回	0.005	200,000	198,638	2026/8/25
茨城県	公募令和5年度第1回	0.681	100,000	99,098	2033/6/30
茨城県	公募令和5年度第2回	0.354	200,000	199,430	2028/8/24

銘柄	利回り	当期末		
		額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券				
群馬県 公募第12回	0.519	100,000	100,473	2025/8/15
群馬県 公募第22回	0.135	100,000	97,468	2030/8/19
群馬県 公募(5年)第13回	0.005	300,000	297,975	2026/8/18
群馬県 公募(20年)第3回	1.687	100,000	107,852	2032/6/25
大分県 公募令和5年度第1回	0.895	100,000	100,666	2033/10/31
共同発行市場地方債 公募第148回	0.553	100,000	100,506	2025/7/25
共同発行市場地方債 公募第152回	0.496	400,000	401,756	2025/11/25
共同発行市場地方債 公募第154回	0.405	400,000	401,068	2026/1/23
共同発行市場地方債 公募第156回	0.1	200,000	199,294	2026/3/25
共同発行市場地方債 公募第157回	0.08	300,000	298,770	2026/4/24
共同発行市場地方債 公募第161回	0.06	300,000	298,350	2026/8/25
共同発行市場地方債 公募第172回	0.225	600,000	597,996	2027/7/23
共同発行市場地方債 公募第184回	0.175	100,000	98,984	2028/7/25
共同発行市場地方債 公募第186回	0.25	400,000	396,828	2028/9/25
共同発行市場地方債 公募第188回	0.264	300,000	297,522	2028/11/24
共同発行市場地方債 公募第190回	0.16	610,000	601,222	2029/1/25
共同発行市場地方債 公募第191回	0.14	100,000	98,419	2029/2/22
共同発行市場地方債 公募第194回	0.11	300,000	294,345	2029/5/25
共同発行市場地方債 公募第196回	0.06	400,000	391,080	2029/7/25
共同発行市場地方債 公募第197回	0.06	300,000	293,133	2029/8/24
共同発行市場地方債 公募第198回	0.05	110,000	107,384	2029/9/25
共同発行市場地方債 公募第200回	0.07	100,000	97,641	2029/11/22
共同発行市場地方債 公募第204回	0.05	100,000	97,299	2030/3/25
共同発行市場地方債 公募第206回	0.131	300,000	292,956	2030/5/24
共同発行市場地方債 公募第213回	0.125	300,000	291,351	2030/12/25
共同発行市場地方債 公募第215回	0.145	400,000	388,184	2031/2/25
共同発行市場地方債 公募第228回	0.199	300,000	288,951	2032/3/25
共同発行市場地方債 公募第229回	0.299	250,000	242,525	2032/4/23
共同発行市場地方債 公募第234回	0.369	300,000	291,450	2032/9/24
共同発行市場地方債 公募第239回	0.74	100,000	99,879	2033/2/25
堺市 公募平成22年度第1回	1.97	100,000	109,132	2030/11/19
堺市 公募平成26年度第1回	1.664	100,000	100,438	2044/9/20
堺市 公募第3回	0.125	100,000	96,034	2031/12/22
堺市 公募令和5年度第2回	0.841	200,000	200,624	2033/9/20
長崎県 公募令和元年度第3回	0.05	100,000	97,759	2029/6/20
長崎県 公募令和4年度第3回	0.364	100,000	97,385	2032/6/18
島根県 公募(30年)平成29年度第1回	0.919	100,000	84,736	2047/6/20
島根県 公募(5年)令和2年度第3回	0.02	150,000	149,482	2025/11/27
佐賀県 公募平成28年度第1回	0.08	100,000	99,431	2026/11/30
福島県 公募令和3年度第2回	0.046	300,000	297,762	2027/2/24
熊本県 公募平成28年度第2回	0.06	132,000	131,206	2026/10/28
熊本市 公募平成29年度第1回	0.19	100,000	99,384	2027/11/30
新潟市 公募平成29年度第1回	0.21	100,000	99,428	2027/12/24
新潟市 公募令和5年度第1回	0.861	200,000	200,382	2033/12/23
静岡市 公募令和5年度第1回	0.977	100,000	101,361	2033/11/24
大阪市 公募平成27年度第6回	0.471	100,000	100,398	2025/11/25
大阪市 公募令和2年度第2回	0.131	300,000	292,962	2030/5/22
大阪市 公募令和3年度第2回	0.16	300,000	290,754	2031/5/21

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券					
大阪市	公募(15年)第1回	1.753	100,000	103,331	2026/7/17
大阪市	公募(15年)第2回	1.531	200,000	207,018	2027/2/19
大阪市	公募(20年)第1回	2.3	300,000	320,883	2027/11/15
大阪市	公募(20年)第5回	2.47	100,000	109,004	2028/9/21
大阪市	公募(20年)第6回	2.21	100,000	108,162	2028/12/20
大阪市	公募(20年)第17回	1.721	200,000	216,452	2032/12/21
大阪市	公募(20年)第19回	1.138	100,000	101,823	2035/4/24
大阪市	公募(20年)第26回	0.635	100,000	93,412	2037/10/23
名古屋市	公募第501回	0.175	200,000	198,858	2027/9/29
名古屋市	公募第503回	0.205	100,000	99,274	2028/3/24
名古屋市	公募第504回	0.205	200,000	198,346	2028/6/20
名古屋市	公募第511回	0.075	200,000	194,884	2030/3/27
名古屋市	公募第512回	0.15	300,000	293,127	2030/6/20
名古屋市	公募(12年)第1回	1.033	200,000	202,148	2025/6/20
名古屋市	公募(15年)第2回	0.905	100,000	102,220	2029/11/16
名古屋市	公募(5年)第30回	0.001	200,000	198,388	2026/12/18
名古屋市	公募(30年)第13回	0.977	100,000	85,570	2047/9/20
名古屋市	公募(20年)第15回	1.712	100,000	108,148	2033/9/9
名古屋市	公募(20年)第17回	1.203	200,000	204,882	2035/5/28
名古屋市	公募(20年)第18回	1.139	100,000	101,466	2035/11/20
名古屋市	公募(20年)第19回	0.323	100,000	91,910	2036/4/28
京都市	公募平成29年度第1回	0.21	100,000	99,584	2027/8/25
京都市	公募平成29年度第4回	0.235	101,280	100,743	2028/1/31
京都市	公募平成30年度第1回	0.249	101,090	100,341	2028/8/28
京都市	公募(20年)第2回	2.12	100,000	102,826	2025/9/19
京都市	公募(20年)第5回	2.36	200,000	211,124	2026/12/18
京都市	公募(20年)第6回	2.38	100,000	106,983	2027/9/17
京都市	公募(20年)第13回	1.359	100,000	104,354	2034/11/24
京都市	公募(20年)第15回	0.487	200,000	185,846	2036/11/28
神戸市	公募(20年)平成20年度第24回	2.08	100,000	107,561	2028/12/20
神戸市	公募平成25年度第12回	1.52	100,000	106,126	2034/2/17
神戸市	公募(20年)平成26年度第3回	1.482	100,000	105,725	2034/7/14
神戸市	公募平成28年度第1回	0.08	200,000	199,188	2026/4/17
神戸市	公募平成30年度第2回	0.845	200,000	165,130	2048/3/19
神戸市	公募令和3年度第6回	0.713	100,000	76,032	2051/6/20
横浜市	公募平成28年度第5回	0.23	300,000	299,355	2027/2/19
横浜市	公募平成29年度第3回	0.22	100,000	99,640	2027/8/13
横浜市	公募2019年度第3回	0.05	200,000	195,198	2029/10/16
横浜市	公募(30年)第2回	2.49	200,000	231,870	2035/3/20
横浜市	公募(20年)第11回	2.2	100,000	105,117	2026/12/18
横浜市	公募(20年)第18回	2.21	100,000	108,720	2029/5/25
横浜市	公募(20年)第26回	1.776	100,000	108,730	2033/1/28
横浜市	公募(20年)第30回	1.376	100,000	104,583	2034/10/20
横浜市	公募(20年)第32回	1.138	100,000	101,518	2035/10/19
横浜市	公募(20年)第35回	0.443	100,000	92,527	2036/10/28
札幌市	公募(15年)平成23年度第9回	1.493	200,000	206,756	2027/2/12
札幌市	公募(20年)平成24年度第1回	1.79	100,000	108,608	2032/4/23
札幌市	公募(20年)平成24年度第11回	1.794	200,000	217,736	2033/2/28

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
地方債証券					
札幌市 公募 (20年) 平成28年度第4回	0.414	100,000	92,362	千円	2036/ 9/19
札幌市 公募 (5年) 令和3年度第8回	0.155	100,000	96,259	千円	2031/12/19
札幌市 公募 (5年) 令和4年度第4回	0.444	100,000	97,793	千円	2032/ 9/17
札幌市 公募 (20年) 第6回	2.24	200,000	217,926	千円	2029/ 6/20
川崎市 公募第95回	0.539	160,000	157,745	千円	2032/ 9/17
川崎市 公募 (20年) 第14回	1.79	200,000	217,186	千円	2032/ 3/19
川崎市 公募 (20年) 第17回	1.527	100,000	106,535	千円	2033/ 5/ 9
川崎市 公募 (20年) 第18回	1.541	100,000	106,247	千円	2034/ 3/17
川崎市 公募 (20年) 第19回	1.362	100,000	104,467	千円	2034/ 9/20
川崎市 公募 (20年) 第20回	1.133	100,000	101,810	千円	2035/ 3/20
川崎市 公募 (20年) 第22回	0.377	100,000	92,547	千円	2036/ 4/22
川崎市 公募 (30年) 第11回	0.817	100,000	82,036	千円	2048/ 3/19
川崎市 公募 (5年) 第62回	0.005	200,000	198,678	千円	2026/ 7/30
川崎市 公募 (5年) 第66回	0.14	230,000	228,424	千円	2027/ 9/17
川崎市 公募 (5年) 第67回	0.309	100,000	99,703	千円	2028/ 3/17
北九州市 公募 (10年) 令和2年度第2回	0.125	200,000	194,236	千円	2030/12/24
北九州市 公募 (10年) 令和5年度第2回	0.861	200,000	200,384	千円	2033/12/22
北九州市 公募 (20年) 第3回	2.33	200,000	213,666	千円	2027/ 9/21
北九州市 公募 (20年) 第14回	1.732	100,000	108,304	千円	2032/11/12
福岡市 公募 (20年) 平成21年度第3回	2.14	200,000	217,686	千円	2029/ 9/18
福岡市 公募 (20年) 平成23年度第4回	1.89	100,000	109,012	千円	2031/ 8/19
福岡市 公募平成26年度第2回	1.49	100,000	105,816	千円	2034/ 6/20
福岡市 公募 (5年) 2020年度第9回	0.01	300,000	298,779	千円	2025/12/25
福岡市 公募 (20年) 2021年度第6回	0.482	100,000	84,736	千円	2041/10/18
広島市 公募平成27年度第2回	0.464	500,000	501,885	千円	2025/12/25
広島市 公募 (10年) 平成30年度第6回	0.146	241,000	237,259	千円	2029/ 2/22
広島市 公募 (10年) 令和3年度第6回	0.244	100,000	96,763	千円	2032/ 2/25
広島市 公募 (10年) 令和5年度第5回	0.861	100,000	100,191	千円	2033/12/23
さいたま市 公募第21回	0.861	320,100	320,711	千円	2033/12/23
三重県 公募平成28年度第1回	0.165	155,000	154,431	千円	2026/12/25
三重県 公募令和5年度第3回	0.861	200,000	200,382	千円	2033/12/23
福井県 公募平成27年度第4回	0.085	200,000	199,196	千円	2026/ 4/27
福井県 公募令和元年度第3回	0.05	200,000	195,168	千円	2029/10/29
福井県 公募令和4年度第5回	0.374	100,000	97,186	千円	2032/ 9/29
徳島県 公募平成29年度第2回	0.19	200,000	198,768	千円	2027/11/30
徳島県 公募平成30年度第2回	0.264	300,000	297,516	千円	2028/11/28
山梨県 公募令和元年度第1回	0.05	100,000	97,583	千円	2029/10/30
岡山県 公募平成28年度第2回	0.205	168,900	168,373	千円	2027/ 3/31
岡山県 公募令和2年度第3回	0.224	300,000	292,512	千円	2031/ 3/31
岡山県 公募令和3年度第1回	0.189	100,000	96,383	千円	2032/ 1/30
秋田県 公募令和3年度第1回	0.234	116,600	112,657	千円	2032/ 3/25
神奈川県住宅供給公社債券 第4回	0.325	100,000	98,922	千円	2028/ 4/24
広島県・広島市折半保証広島高速道路債券 第22回	0.491	100,000	84,516	千円	2041/ 2/19
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第96回	2.34	100,000	107,890	千円	2028/12/20
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第102回	2.298	300,000	327,111	千円	2029/12/20
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第128回	0.425	100,000	98,112	千円	2030/12/20
愛知県・名古屋市折半保証名古屋高速道路債券 第148回	0.15	100,000	90,817	千円	2034/ 9/15
福岡北九州高速道路債券 第117回	2.26	100,000	107,572	千円	2028/12/20

銘柄	利	当期末			償還年月日
		率	額面金額	評価額	
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	100,962	2030/3/19
福岡北九州高速道路債券 第145回	0.56		100,000	92,021	2036/12/16
東京都住宅供給公社債券 第19回	1.43		300,000	310,608	2028/9/15
東京都住宅供給公社債券 第23回	1.303		100,000	101,291	2035/9/14
小計			60,096,020	60,334,185	
特殊債券(除く金融債)					
政保 地方公共団体金融機構債券 第72回	0.509		189,000	189,859	2025/5/23
政保 地方公共団体金融機構債券 第73回	0.484		338,000	339,493	2025/6/13
政保 地方公共団体金融機構債券 第75回	0.44		124,000	124,520	2025/8/15
政保 地方公共団体金融機構債券 第76回	0.425		141,000	141,571	2025/9/12
政保 地方公共団体金融機構債券 第77回	0.386		121,000	121,416	2025/10/15
政保 地方公共団体金融機構債券 第78回	0.381		616,000	617,977	2025/11/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第80回	0.32		300,000	300,585	2026/1/19
政保 地方公共団体金融機構債券 第83回	0.02		116,000	115,481	2026/4/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第85回	0.01		100,000	99,471	2026/6/15
政保 地方公共団体金融機構債券 第91回	0.085		300,000	298,590	2026/12/14
政保 地方公共団体金融機構債券 第95回	0.14		137,000	136,461	2027/4/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第97回	0.13		300,000	298,617	2027/6/14
政保 地方公共団体金融機構債券 第98回	0.16		122,000	121,516	2027/7/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第100回	0.09		108,000	107,222	2027/9/17
政保 地方公共団体金融機構債券 第108回	0.145		157,000	155,638	2028/5/19
政保 地方公共団体金融機構債券 第110回	0.13		100,000	98,987	2028/7/18
政保 地方公共団体金融機構債券 第113回	0.219		110,000	109,134	2028/10/16
政保 地方公共団体金融機構債券 第119回	0.04		116,000	113,713	2029/4/13
政保 地方公共団体金融機構債券 第120回	0.001		103,000	100,611	2029/7/13
政保 地方公共団体金融機構債券 第121回	0.001		100,000	97,546	2029/10/15
日本政策金融公庫債券 政府保証第47回	0.09		100,000	99,275	2027/9/24
日本政策金融公庫債券 政府保証第55回	0.085		108,000	106,265	2029/2/19
日本政策金融公庫債券 政府保証第63回	0.11		270,000	262,091	2031/2/25
新関西国際空港債券 政府保証第5回	0.145		117,000	116,564	2027/3/30
日本政策投資銀行社債 政府保証第37回	0.085		400,000	398,120	2026/12/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第41回	0.09		333,000	330,662	2027/9/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第42回	0.155		420,000	417,459	2027/12/15
日本政策投資銀行社債 政府保証第55回	0.105		300,000	295,257	2029/3/19
日本政策投資銀行社債 政府保証第62回	0.001		200,000	194,498	2030/3/18
日本政策投資銀行社債 政府保証第75回	0.344		370,000	359,754	2032/9/14
日本政策投資銀行社債 政府保証第78回	0.748		220,000	218,779	2033/12/19
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	108,877	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	218,042	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	218,488	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	219,850	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	219,338	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	109,246	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	217,388	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	110,566	2040/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第127回	2.0		300,000	329,328	2031/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券 政府保証債第146回	1.8		100,000	108,659	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	107,990	2032/5/31

銘 柄	利 率	当 期 末			償 還 年 月 日
		額 面 金 額	評 価 額	千円	
特殊債券(除く金融債)	%			千円	
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.83	100,000	105,421	千円	2042/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.67	100,000	107,942	千円	2032/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	300,000	323,070	千円	2032/7/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	300,000	321,273	千円	2032/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.919	300,000	320,274	千円	2042/8/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.645	200,000	215,652	千円	2032/10/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.66	100,000	107,963	千円	2032/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	100,000	108,547	千円	2033/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.757	200,000	217,664	千円	2033/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.779	400,000	436,260	千円	2033/7/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.475	100,000	105,903	千円	2034/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.483	100,000	106,019	千円	2034/4/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.72	100,000	102,127	千円	2044/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.478	200,000	212,044	千円	2034/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.72	100,000	101,998	千円	2044/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	100,000	105,063	千円	2034/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.396	100,000	105,106	千円	2034/9/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.315	100,000	104,237	千円	2034/11/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.97	100,000	100,583	千円	2035/1/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	500,000	512,375	千円	2035/2/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.391	444,000	445,340	千円	2025/4/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.079	500,000	507,695	千円	2035/4/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	200,000	205,002	千円	2035/5/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.22	100,000	102,835	千円	2035/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.386	400,000	401,348	千円	2025/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.119	100,000	101,635	千円	2035/10/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.381	583,000	584,853	千円	2025/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	151,000	150,341	千円	2026/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.237	100,000	91,129	千円	2036/5/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.522	200,000	187,352	千円	2036/11/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.085	100,000	99,523	千円	2026/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	403,000	401,500	千円	2027/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.13	100,000	99,515	千円	2027/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.155	600,000	597,174	千円	2027/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.09	100,000	99,272	千円	2027/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.84	100,000	83,195	千円	2047/12/27
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	500,000	497,195	千円	2028/2/29
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	131,000	129,937	千円	2028/3/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	99,083	千円	2028/6/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.13	200,000	197,914	千円	2028/7/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.209	100,000	99,257	千円	2028/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.001	113,000	110,248	千円	2029/9/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.422	100,000	72,431	千円	2049/12/28
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.284	500,000	497,915	千円	2028/8/31
日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.477	200,000	199,646	千円	2030/9/30
日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.532	500,000	496,355	千円	2043/12/28
民間都市開発推進機構 政府保証第17回	0.145	400,000	399,368	千円	2026/2/26
民間都市開発推進機構 政府保証第20回	0.145	113,600	112,679	千円	2028/3/29

銘柄	利回り	当期期末			
		額面金額	評価額	償還年月日	
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
関西国際空港債券 政府保証第54回	2.4	400,000	434,000	2028/6/23	
新関西国際空港社債 財投機関債第6回	1.445	300,000	312,090	2028/9/15	
新関西国際空港社債 財投機関債第9回	1.231	100,000	103,133	2028/12/20	
新関西国際空港社債 財投機関債第12回	1.067	100,000	102,392	2029/9/20	
新関西国際空港社債 財投機関債第14回	1.318	100,000	102,476	2034/12/20	
新関西国際空港社債 財投機関債第28回	0.205	100,000	96,515	2031/3/20	
日本政策投資銀行社債 財投機関債第47回	1.027	100,000	102,533	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	398,012	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	199,158	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	99,655	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	298,272	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	197,738	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	297,456	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	397,624	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	386,988	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	487,088	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	116,271	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	300,000	312,450	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	104,889	2026/9/18	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第23回	2.39	500,000	532,825	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	117,220	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	241,416	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	324,894	2028/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第43回	0.5	300,000	268,938	2038/9/17	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第47回	2.41	100,000	109,279	2029/4/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第55回	2.22	100,000	109,450	2030/2/8	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第89回	1.711	100,000	107,477	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	216,110	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	375,763	2033/3/18	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第105回	1.853	600,000	652,614	2033/3/18	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第126回	1.023	100,000	102,359	2029/3/19	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第145回	1.523	300,000	290,526	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	98,064	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	101,915	2035/3/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第152回	1.626	100,000	98,479	2045/3/17	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第155回	1.3	100,000	102,656	2035/6/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第157回	0.857	100,000	101,631	2030/6/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第160回	1.284	200,000	204,900	2035/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第163回	1.197	100,000	101,506	2035/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第164回	1.149	100,000	101,014	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	69,271	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	92,461	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	77,187	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	149,904	2050/9/20	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第278回	0.075	300,000	298,845	2025/12/19	
日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第9回	2.9	100,000	116,578	2032/5/20	
日本高速道路保有・債務返済機構承継 財投機関債第28回	2.83	500,000	588,175	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	118,652	2034/6/20	

銘柄	利	当期末			
		額	面	金	額
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		
公営企業債券 30年第4回財投機関債	2.95	300,000	356,823	2034/3/24	
地方公営企業等金融機関債券(20年) 第1回	2.07	100,000	107,316	2028/12/20	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第1回	2.266	300,000	326,814	2029/6/28	
地方公共団体金融機関債券 20年第4回	2.12	100,000	108,898	2029/12/28	
地方公共団体金融機関債券 F16回	2.042	100,000	104,613	2027/1/7	
地方公共団体金融機関債券 20年第6回	2.242	300,000	329,439	2030/3/28	
地方公共団体金融機関債券 20年第7回	2.202	400,000	438,944	2030/4/26	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第10回	1.752	300,000	321,927	2030/8/28	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第19回	1.84	200,000	217,070	2031/12/26	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第20回	1.8	100,000	108,289	2032/1/28	
地方公共団体金融機関債券 F96回	1.546	300,000	310,053	2027/1/29	
地方公共団体金融機関債券 F122回	1.412	100,000	103,342	2027/6/18	
地方公共団体金融機関債券 F124回	1.418	100,000	103,337	2027/6/4	
地方公共団体金融機関債券 F132回	1.09	500,000	505,815	2025/7/30	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第24回	1.702	200,000	215,204	2032/9/28	
地方公共団体金融機関債券 F143回	1.351	300,000	309,843	2027/8/25	
地方公共団体金融機関債券 F147回	1.291	100,000	102,776	2027/3/19	
地方公共団体金融機関債券 F160回	1.052	100,000	102,503	2028/5/26	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第29回	1.725	100,000	107,820	2033/6/28	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第32回	1.624	100,000	106,714	2033/10/28	
地方公共団体金融機関債券(15年) 第2回	1.161	200,000	206,220	2028/12/28	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第37回	1.535	200,000	211,110	2034/6/28	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第38回	1.487	300,000	315,132	2034/7/28	
地方公共団体金融機関債券 F240回	1.069	300,000	309,006	2030/2/28	
地方公共団体金融機関債券 F243回	1.285	300,000	312,666	2032/7/21	
地方公共団体金融機関債券 F248回	1.512	100,000	104,250	2036/7/25	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第39回	1.425	200,000	208,756	2034/9/28	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第40回	1.381	100,000	103,886	2034/10/27	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第43回	1.171	100,000	101,392	2035/4/27	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第44回	1.298	200,000	205,282	2035/6/28	
地方公共団体金融機関債券 第74回	0.519	500,000	502,025	2025/7/28	
地方公共団体金融機関債券 第77回	0.491	100,000	100,366	2025/10/28	
地方公共団体金融機関債券 F308回	1.192	200,000	200,256	2037/3/19	
地方公共団体金融機関債券 第79回	0.484	400,000	401,336	2025/12/26	
地方公共団体金融機関債券 第84回	0.09	100,000	99,484	2026/5/28	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第53回	0.18	200,000	177,976	2036/7/28	
地方公共団体金融機関債券(20年) 第58回	0.721	100,000	94,445	2037/3/27	
地方公共団体金融機関債券 第95回	0.2	200,000	199,056	2027/4/28	
地方公共団体金融機関債券 第101回	0.235	400,000	397,740	2027/10/28	
地方公共団体金融機関債券 第67回	0.564	100,000	90,828	2038/6/28	
地方公共団体金融機関債券 2回	0.646	100,000	66,015	2060/1/28	
地方公共団体金融機関債券 12回	0.716	200,000	152,670	2050/11/28	
地方公共団体金融機関債券 第166回	0.75	200,000	198,750	2033/3/28	
公営企業債券(20年) 第19回財投機関債	2.37	100,000	105,404	2026/12/18	
公営企業債券(20年) 第20回財投機関債	2.25	100,000	105,538	2027/3/24	
公営企業債券(20年) 第23回財投機関債	2.29	200,000	213,092	2027/9/24	
公営企業債券(20年) 第24回財投機関債	2.29	100,000	107,426	2028/4/25	
公営企業債券(20年) 第25回財投機関債	2.5	100,000	108,584	2028/6/20	

銘柄	利	当期末			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		
首都高速道路 第28回	0.04	200,000	198,410		2026/9/18
首都高速道路 第33回	0.523	300,000	299,898		2028/12/20
阪神高速道路 第25回	0.03	100,000	99,377		2026/3/19
都市再生債券 財投機関債第93回	1.102	100,000	102,826		2029/6/20
都市再生債券 財投機関債第97回	1.017	100,000	102,480		2029/9/20
都市再生債券 財投機関債第101回	0.935	100,000	102,025		2029/11/20
都市再生債券 財投機関債第109回	0.918	100,000	101,997		2030/6/20
都市再生債券 財投機関債第113回	0.851	300,000	304,590		2030/9/20
都市再生債券 財投機関債第121回	0.482	200,000	197,848		2031/2/20
都市再生債券 財投機関債第127回	0.075	200,000	198,654		2026/9/18
都市再生債券 財投機関債第141回	0.63	100,000	92,001		2038/2/19
都市再生債券 財投機関債第155回	0.804	100,000	71,351		2058/3/19
都市再生債券 財投機関債第166回	0.806	100,000	69,844		2060/3/19
都市再生債券 財投機関債第170回	0.491	100,000	84,968		2041/6/20
都市再生債券 財投機関債第191回	1.907	100,000	95,859		2063/3/19
本州四国連絡橋債券 財投機関債第7回	2.26	100,000	102,480		2025/6/20
福祉医療機構債券 第50回財投機関債	0.215	300,000	298,473		2027/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第3回	2.26	400,000	422,416		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	213,242		2027/6/18
住宅金融支援機構債券 財投機関債第49回	2.11	100,000	109,211		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	108,489		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	109,704		2031/6/13
住宅金融支援機構債券 財投機関債第77回	1.751	900,000	927,603		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	109,658		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	108,843		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	216,528		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	206,696		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	108,741		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	103,300		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	107,744		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	108,350		2032/9/14
住宅金融支援機構債券 財投機関債第119回	1.428	100,000	103,547		2027/9/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第120回	1.836	100,000	108,620		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	324,834		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	111,043		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	205,114		2028/3/17
住宅金融支援機構債券 財投機関債第134回	1.306	100,000	103,503		2028/5/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第137回	1.31	200,000	207,130		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	103,104		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	102,594		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	451,453		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	298,407		2026/5/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第195回	0.448	100,000	91,682		2036/10/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第198回	0.155	300,000	298,386		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	199,038		2027/5/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第213回	0.26	100,000	99,603		2027/7/20
住宅金融支援機構債券 財投機関債第222回	0.21	200,000	198,566		2027/11/19
住宅金融支援機構債券 財投機関債第223回	0.403	100,000	96,753		2032/11/19

銘柄	利	当期末			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	
住宅金融支援機構債券	財投機関債第227回	0.26	100,000	99,381	2028/1/20
住宅金融支援機構債券	財投機関債第244回	0.274	130,000	128,879	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	74,300	2049/9/17
住宅金融支援機構債券	財投機関債第301回	0.04	300,000	298,665	2025/12/19
住宅金融支援機構債券	財投機関債第306回	0.334	200,000	183,820	2035/11/20
成田国際空港 第19回		0.275	100,000	99,845	2026/2/18
成田国際空港 第39回		0.409	300,000	276,363	2035/10/26
沖縄振興開発金融公庫債券	財投機関債第6回	2.04	200,000	204,474	2025/6/20
国際協力機構債券	第6回財投機関債	2.098	200,000	219,176	2030/12/13
国際協力機構債券	第15回財投機関債	1.724	100,000	107,623	2032/9/17
国際協力機構債券	第25回財投機関債	1.52	100,000	105,158	2034/6/20
国際協力機構債券	第32回財投機関債	1.212	100,000	101,660	2035/9/20
国際協力機構債券	第35回財投機関債	0.08	100,000	99,414	2026/6/19
国際協力機構債券	第40回財投機関債	0.22	100,000	99,507	2027/6/18
国際協力機構債券	第68回財投機関債	0.399	100,000	97,129	2032/6/18
東日本高速道路 第57回		0.11	100,000	99,447	2026/6/19
東日本高速道路 第61回		0.14	200,000	195,292	2029/7/31
東日本高速道路 第64回		0.14	100,000	97,482	2029/11/29
東日本高速道路 第69回		0.225	100,000	97,689	2030/4/24
東日本高速道路 第83回		0.05	200,000	198,632	2026/6/19
東日本高速道路 第86回		0.04	400,000	396,448	2026/12/18
東日本高速道路 第89回		0.04	130,000	128,845	2026/12/18
東日本高速道路 第95回		0.23	750,000	746,182	2027/6/18
中日本高速道路 第63回		0.576	100,000	100,456	2025/11/13
中日本高速道路 第86回		0.06	500,000	497,600	2026/1/22
中日本高速道路 第89回		0.05	100,000	99,342	2026/6/1
中日本高速道路 第90回		0.05	300,000	297,855	2026/7/27
中日本高速道路 第91回		0.04	200,000	198,412	2026/9/17
中日本高速道路 第93回		0.125	200,000	198,504	2027/3/18
中日本高速道路 第96回		0.439	200,000	200,064	2027/12/13
中日本高速道路 第97回		0.628	200,000	201,406	2028/1/21
中日本高速道路 第98回		0.514	300,000	300,732	2028/2/21
中日本高速道路 第101回		0.439	500,000	498,695	2028/8/17
西日本高速道路 第29回		0.31	200,000	199,916	2026/2/12
西日本高速道路 第30回		0.17	300,000	298,818	2026/5/22
西日本高速道路 第34回		0.335	300,000	299,655	2027/2/16
西日本高速道路 第61回		0.04	300,000	297,882	2026/6/19
西日本高速道路 第62回		0.04	1,100,000	1,091,255	2026/9/18
西日本高速道路 第64回		0.04	200,000	198,410	2026/9/18
西日本高速道路 第69回		0.225	200,000	198,952	2027/6/18
西日本高速道路 第77回		0.39	200,000	199,282	2028/5/25
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第69回	1.441	200,000	209,042	2034/8/4
鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	財投機関債第90回	0.2	300,000	290,154	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	291,939	2030/2/27
貸付債権担保第40回住宅金融公庫債券		1.93	19,770	19,770	2041/3/10
貸付債権担保第7回住宅金融支援機構債券		2.14	9,705	9,705	2042/11/10
貸付債権担保第25回住宅金融支援機構債券		2.28	14,560	15,146	2044/6/10
貸付債権担保第28回住宅金融支援機構債券		1.98	50,313	52,393	2044/9/10

銘柄	利	当期末			
		額	面	金額	評価額
	%	千円	千円	償還年月日	
特殊債券(除く金融債)					
貸付債権担保第42回住宅金融支援機構債券	1.43	44,608	45,983	2045/11/10	
貸付債権担保第45回住宅金融支援機構債券	1.79	52,290	54,225	2046/2/10	
貸付債権担保第52回住宅金融支援機構債券	1.51	38,790	39,972	2046/9/10	
貸付債権担保第24回住宅金融支援機構債券	2.34	25,942	26,804	2044/5/10	
貸付債権担保第48回住宅金融支援機構債券	1.89	48,633	50,423	2046/5/10	
貸付債権担保第40回住宅金融支援機構債券	1.36	56,259	57,670	2045/9/10	
貸付債権担保第62回住宅金融支援機構債券	1.21	85,098	86,882	2047/7/10	
貸付債権担保第60回住宅金融支援機構債券	1.34	74,580	76,687	2047/5/10	
貸付債権担保第61回住宅金融支援機構債券	1.26	50,186	51,372	2047/6/10	
貸付債権担保第51回住宅金融支援機構債券	1.64	18,110	18,706	2046/8/10	
貸付債権担保第43回住宅金融支援機構債券	1.6	44,412	46,107	2045/12/10	
貸付債権担保第79回住宅金融支援機構債券	1.07	29,334	29,759	2048/12/10	
貸付債権担保第81回住宅金融支援機構債券	1.07	65,112	65,994	2049/2/10	
貸付債権担保第72回住宅金融支援機構債券	1.08	28,179	28,614	2048/5/10	
貸付債権担保第70回住宅金融支援機構債券	1.25	87,546	89,550	2048/3/10	
貸付債権担保第33回住宅金融支援機構債券	1.88	18,374	19,138	2045/2/10	
貸付債権担保第34回住宅金融支援機構債券	1.86	18,842	19,615	2045/3/10	
貸付債権担保第35回住宅金融支援機構債券	1.87	17,827	18,544	2045/4/10	
貸付債権担保第46回住宅金融支援機構債券	1.85	17,047	17,688	2046/3/10	
貸付債権担保第55回住宅金融支援機構債券	1.41	48,430	49,914	2046/12/10	
貸付債権担保第56回住宅金融支援機構債券	1.42	68,973	71,080	2047/1/10	
貸付債権担保第57回住宅金融支援機構債券	1.44	23,097	23,821	2047/2/10	
貸付債権担保第76回住宅金融支援機構債券	1.21	55,282	56,463	2048/9/10	
貸付債権担保第23回住宅金融支援機構債券	2.25	52,992	54,655	2044/4/10	
貸付債権担保第32回住宅金融支援機構債券	1.82	52,926	54,880	2045/1/10	
貸付債権担保第39回住宅金融支援機構債券	1.52	93,335	96,148	2045/8/10	
貸付債権担保第58回住宅金融支援機構債券	1.4	51,710	53,304	2047/3/10	
貸付債権担保第64回住宅金融支援機構債券	1.16	92,283	93,963	2047/9/10	
貸付債権担保第71回住宅金融支援機構債券	1.07	82,650	83,910	2048/4/10	
貸付債権担保第73回住宅金融支援機構債券	1.3	66,288	67,902	2048/6/10	
貸付債権担保第75回住宅金融支援機構債券	1.26	55,152	56,448	2048/8/10	
貸付債権担保第83回住宅金融支援機構債券	1.04	140,932	142,456	2049/4/10	
貸付債権担保第84回住宅金融支援機構債券	1.01	241,136	243,482	2049/5/10	
貸付債権担保第88回住宅金融支援機構債券	0.93	37,588	37,727	2049/9/10	
貸付債権担保第89回住宅金融支援機構債券	0.95	38,474	38,645	2049/10/10	
貸付債権担保第90回住宅金融支援機構債券	0.87	39,499	39,489	2049/11/10	
貸付債権担保第92回住宅金融支援機構債券	0.74	83,994	83,216	2050/1/10	
貸付債権担保第93回住宅金融支援機構債券	0.6	89,614	87,902	2050/2/10	
貸付債権担保第94回住宅金融支援機構債券	0.8	47,259	46,889	2050/3/10	
貸付債権担保第96回住宅金融支援機構債券	0.74	50,414	49,740	2050/5/10	
貸付債権担保第97回住宅金融支援機構債券	0.83	148,791	147,567	2050/6/10	
貸付債権担保第98回住宅金融支援機構債券	0.9	155,343	154,471	2050/7/10	
貸付債権担保第99回住宅金融支援機構債券	0.88	104,650	103,849	2050/8/10	
貸付債権担保第100回住宅金融支援機構債券	0.84	51,092	50,588	2050/9/10	
貸付債権担保第101回住宅金融支援機構債券	0.89	51,999	51,638	2050/10/10	
貸付債権担保第115回住宅金融支援機構債券	0.41	199,806	191,390	2051/12/10	
貸付債権担保第116回住宅金融支援機構債券	0.48	134,208	129,081	2052/1/10	
貸付債権担保第117回住宅金融支援機構債券	0.46	134,848	129,392	2052/2/10	

銘柄	利	当期末		
		額面金額	評価額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
貸付債権担保第118回住宅金融支援機構債券	0.47	66,933	64,320	2052/3/10
貸付債権担保第119回住宅金融支援機構債券	0.46	134,716	129,308	2052/4/10
貸付債権担保第120回住宅金融支援機構債券	0.4	67,614	64,551	2052/5/10
貸付債権担保第121回住宅金融支援機構債券	0.43	68,435	65,419	2052/6/10
貸付債権担保第123回住宅金融支援機構債券	0.46	69,782	66,760	2052/8/10
貸付債権担保第125回住宅金融支援機構債券	0.42	277,040	264,232	2052/10/10
貸付債権担保第126回住宅金融支援機構債券	0.43	210,216	200,455	2052/11/10
貸付債権担保第128回住宅金融支援機構債券	0.42	140,238	133,669	2053/1/10
貸付債権担保第129回住宅金融支援機構債券	0.46	143,504	136,950	2053/2/10
貸付債権担保第134回住宅金融支援機構債券	0.39	145,520	137,913	2053/7/10
貸付債権担保第135回住宅金融支援機構債券	0.39	73,116	69,277	2053/8/10
貸付債権担保第136回住宅金融支援機構債券	0.44	73,795	70,156	2053/9/10
貸付債権担保第140回住宅金融支援機構債券	0.38	73,706	69,720	2054/1/10
貸付債権担保第142回住宅金融支援機構債券	0.32	228,966	215,351	2054/3/10
貸付債権担保第144回住宅金融支援機構債券	0.33	226,986	213,478	2054/5/10
貸付債権担保第150回住宅金融支援機構債券	0.21	402,565	373,729	2054/11/10
貸付債権担保第152回住宅金融支援機構債券	0.33	162,242	151,989	2055/1/10
貸付債権担保第154回住宅金融支援機構債券	0.3	164,600	153,667	2055/3/10
貸付債権担保第162回住宅金融支援機構債券	0.35	256,602	240,092	2055/11/10
貸付債権担保第164回住宅金融支援機構債券	0.33	260,346	242,835	2056/1/10
貸付債権担保第165回住宅金融支援機構債券	0.36	172,136	161,026	2056/2/10
貸付債権担保第166回住宅金融支援機構債券	0.41	260,139	244,358	2056/3/10
貸付債権担保第167回住宅金融支援機構債券	0.41	173,186	162,573	2056/4/10
貸付債権担保第168回住宅金融支援機構債券	0.4	172,688	161,931	2056/5/10
貸付債権担保第169回住宅金融支援機構債券	0.39	263,241	246,438	2056/6/10
貸付債権担保第170回住宅金融支援機構債券	0.36	439,635	411,107	2056/7/10
貸付債権担保第174回住宅金融支援機構債券	0.38	269,067	251,779	2056/11/10
貸付債権担保第175回住宅金融支援機構債券	0.36	271,260	253,253	2056/12/10
貸付債権担保第176回住宅金融支援機構債券	0.32	271,020	251,869	2057/1/10
貸付債権担保第177回住宅金融支援機構債券	0.4	180,834	169,197	2057/2/10
貸付債権担保第178回住宅金融支援機構債券	0.48	272,019	256,516	2057/3/10
貸付債権担保第179回住宅金融支援機構債券	0.46	272,820	256,483	2057/4/10
貸付債権担保第180回住宅金融支援機構債券	0.5	182,338	172,338	2057/5/10
貸付債権担保第183回住宅金融支援機構債券	0.53	555,606	525,175	2057/8/10
貸付債権担保第185回住宅金融支援機構債券	0.58	280,866	266,541	2057/10/10
貸付債権担保第186回住宅金融支援機構債券	0.74	188,326	181,715	2057/11/10
貸付債権担保第195回住宅金融支援機構債券	0.93	195,728	192,848	2058/8/10
貸付債権担保第197回住宅金融支援機構債券	1.08	294,444	293,952	2058/10/10
貸付債権担保第198回住宅金融支援機構債券	1.18	197,006	198,392	2058/11/10
貸付債権担保第199回住宅金融支援機構債券	1.11	395,576	396,019	2058/12/10
貸付債権担保第200回住宅金融支援機構債券	1.05	497,640	496,296	2059/1/10
貸付債権担保第202回住宅金融支援機構債券	1.08	300,000	300,855	2059/3/10
貸付債権担保第203回住宅金融支援機構債券	1.14	500,000	502,730	2059/4/10
小計		70,745,379	71,308,090	
金融債券				
商工債券 利付第845回い号	0.12	300,000	298,911	2025/10/27
商工債券 利付第852回い号	0.09	100,000	99,220	2026/5/27
商工債券 利付第854回い号	0.08	400,000	396,500	2026/7/27

銘柄	利	当期末		
		率	額面金額	評価額
金融債券		%	千円	千円
商工債券 利付第856回	0.09	200,000	198,108	2026/9/25
商工債券 利付第862回	0.18	100,000	99,146	2027/3/26
商工債券 利付第868回	0.24	100,000	98,971	2027/9/27
商工債券 利付第871回	0.35	100,000	99,212	2027/12/27
商工債券 利付第872回	0.45	100,000	99,531	2028/1/27
商工債券 利付第876回	0.45	400,000	397,436	2028/5/26
商工債券 利付第878回	0.43	200,000	198,362	2028/7/27
商工債券 利付第879回	0.48	400,000	397,260	2028/8/25
商工債券 利付第883回	0.63	200,000	199,584	2028/12/27
商工債券 利付第885回	0.65	300,000	298,998	2029/2/27
しんきん中金債券 利付第374回	0.05	300,000	298,440	2026/1/27
しんきん中金債券 利付第377回	0.04	100,000	99,332	2026/4/27
しんきん中金債券 利付第379回	0.04	400,000	397,064	2026/6/26
しんきん中金債券 利付第380回	0.03	100,000	99,216	2026/7/27
しんきん中金債券 利付第387回	0.09	100,000	99,151	2027/2/26
しんきん中金債券 利付第400回	0.38	100,000	99,646	2028/3/27
しんきん中金債券 利付第401回	0.36	300,000	298,659	2028/4/27
しんきん中金債券 利付第402回	0.3	100,000	99,275	2028/5/26
しんきん中金債券 利付第403回	0.26	100,000	99,068	2028/6/27
しんきん中金債券 利付第407回	0.46	300,000	299,259	2028/10/27
商工債券 利付(3年) 第274回	0.14	200,000	199,246	2025/11/27
商工債券 利付(10年) 第15回	0.48	200,000	200,466	2025/9/19
商工債券 利付(10年) 第16回	0.45	100,000	100,110	2025/12/19
商工債券 利付(10年) 第41回	0.4	300,000	286,491	2032/3/19
小計		5,600,000	5,556,662	
普通社債券(含む投資法人債券)				
東京電力 第548回	2.347	100,000	102,873	2028/9/29
東京電力 第560回	2.114	100,000	101,728	2029/12/10
中部電力 第524回	0.39	100,000	99,612	2027/5/25
中部電力 第530回	0.274	200,000	195,152	2029/6/25
中部電力 第559回	0.85	100,000	91,143	2038/6/25
中部電力 第560回	1.2	100,000	91,217	2042/7/25
関西電力 第509回	0.47	100,000	99,675	2027/5/25
関西電力 第511回	0.41	300,000	297,963	2027/9/17
関西電力 第520回	0.73	100,000	88,328	2038/7/16
関西電力 第522回	0.47	200,000	197,744	2028/9/20
関西電力 第535回	0.18	200,000	199,062	2025/12/19
関西電力 第536回	0.44	100,000	96,933	2030/12/20
関西電力 第556回	0.9	100,000	97,807	2033/7/25
関西電力 第557回	1.45	100,000	93,894	2043/7/24
中国電力 第394回	0.712	100,000	91,025	2036/11/25
中国電力 第400回	0.34	100,000	99,180	2027/9/24
中国電力 第406回	0.752	100,000	89,076	2038/5/25
中国電力 第416回	0.355	100,000	97,991	2029/5/25
中国電力 第422回	0.35	600,000	583,176	2030/4/25
中国電力 第425回	0.37	100,000	97,184	2030/6/25
中国電力 第448回	0.92	100,000	98,418	2033/5/25
中国電力 第452回	1.41	100,000	93,726	2043/7/24

銘柄	利	当期末			
		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		
北陸電力 第307回	1.055	100,000	101,279	2026/6/25	
北陸電力 第312回	1.086	100,000	101,386	2030/9/25	
北陸電力 第322回	0.38	100,000	99,427	2027/6/25	
北陸電力 第326回	0.719	200,000	177,302	2038/4/23	
北陸電力 第330回	0.34	100,000	97,868	2029/5/25	
北陸電力 第339回	0.5	100,000	90,604	2035/8/24	
東北電力 第481回	0.803	200,000	201,220	2025/7/25	
東北電力 第484回	0.758	100,000	92,181	2036/5/23	
東北電力 第491回	0.42	100,000	99,727	2027/2/25	
東北電力 第508回	0.465	100,000	98,535	2029/4/25	
東北電力 第521回	0.45	300,000	292,980	2030/5/24	
東北電力 第529回	0.07	200,000	198,344	2026/4/24	
東北電力 第560回	0.87	200,000	195,438	2033/7/25	
四国電力 第293回	0.84	100,000	91,880	2037/5/25	
四国電力 第321回	1.15	100,000	77,076	2052/4/25	
四国電力 第328回	1.022	100,000	99,069	2033/9/22	
九州電力 第449回	0.43	200,000	199,336	2027/4/23	
九州電力 第451回	0.45	100,000	99,644	2027/5/25	
九州電力 第476回	0.43	100,000	98,265	2029/5/25	
九州電力 第478回	0.606	100,000	88,597	2037/6/25	
九州電力 第481回	0.324	300,000	292,638	2029/7/25	
九州電力 第484回	0.375	200,000	195,306	2029/11/22	
九州電力 第493回	0.1	300,000	297,540	2026/5/25	
北海道電力 第323回	1.337	300,000	308,664	2030/3/25	
北海道電力 第325回	1.264	130,000	133,182	2030/10/25	
北海道電力 第338回	0.84	100,000	92,233	2036/11/25	
北海道電力 第350回	0.754	100,000	89,145	2038/3/25	
北海道電力 第385回	1.03	100,000	99,084	2033/5/25	
沖縄電力 第32回	0.22	100,000	99,864	2025/10/24	
東京電力パワーグリッド 第6回	0.85	100,000	100,344	2027/8/31	
東京電力パワーグリッド 第11回	0.79	300,000	299,475	2028/1/25	
東京電力パワーグリッド 第15回	0.89	300,000	295,917	2030/7/24	
東京電力パワーグリッド 第28回	1.01	100,000	100,028	2029/7/10	
東京電力パワーグリッド 第32回	1.28	300,000	290,832	2034/10/6	
東京電力パワーグリッド 第35回	1.2	100,000	100,622	2030/4/23	
東京電力パワーグリッド 第38回	0.58	400,000	400,272	2025/7/16	
東京電力パワーグリッド 第40回	1.37	400,000	388,220	2035/7/13	
東京電力パワーグリッド 第45回	0.8	300,000	291,969	2031/4/22	
東京電力パワーグリッド 第50回	0.94	100,000	97,383	2032/4/26	
東京電力パワーグリッド 第51回	1.1	200,000	183,706	2037/4/24	
東京電力パワーグリッド 第54回	1.2	100,000	99,113	2032/7/21	
東京電力リニューアブルパワー 第5回社債間限定同順位特約付グリ	1.431	200,000	199,504	2034/2/28	
I N P E X 第1回社債間限定同順位特約付	0.08	500,000	496,530	2026/3/16	
清水建設 第34回社債間限定同順位特約付	1.302	100,000	100,410	2033/11/28	
長谷工コーポレーション 第14回社債間限定同順位特約付	0.47	200,000	195,110	2030/7/12	
戸田建設 第5回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	96,998	2029/12/6	
五洋建設 第7回社債間限定同順位特約付	0.14	100,000	99,021	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	92,204	2036/11/28	

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額	面	金額	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
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	287,916	2031/6/3	
大和ハウス工業 第26回特定社債間限定同順位特約付	0.67	100,000	84,146	2041/6/3	
大和ハウス工業 第29回特定社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	99,870	2025/10/27	
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	198,538	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	298,158	2026/3/13	
アサヒグループホールディングス 第23回特定社債間限定同順位	1.033	100,000	99,603	2033/9/7	
コカ・コーラボトラーズジャパン 第2回社債間限定同順位特約付	0.2	100,000	99,344	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	97,377	2029/9/19	
ニチレイ 第24回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	99,884	2025/8/29	
日本たばこ産業 第13回	0.355	100,000	98,748	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	99,176	2027/8/31	
野村不動産ホールディングス 第15回	0.39	100,000	96,173	2031/2/26	
森ビルズリート投資法人 第17回特定投資法人債間限定同順位特約付	0.34	200,000	198,534	2026/8/28	
森ビル 第23回社債間限定同順位特約付	0.97	100,000	89,824	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	97,702	2029/7/11	
東急不動産ホールディングス 第21回社債間限定同順位特約付	0.88	100,000	87,690	2039/7/11	
東急不動産ホールディングス 第29回社債間限定同順位特約付	0.45	100,000	99,198	2028/6/1	
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付	0.19	600,000	597,918	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付	0.28	200,000	198,052	2027/12/20	
東レ 第30回社債間限定同順位特約付	0.375	100,000	99,526	2027/7/16	
東レ 第33回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	98,728	2028/7/18	
旭化成 第12回社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	97,178	2029/9/6	
旭化成 第25回社債間限定同順位特約付	1.232	100,000	100,191	2033/12/5	
日本土地建物 第4回社債間限定同順位特約付	0.734	200,000	197,044	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	99,282	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	595,266	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	92,098	2031/9/10	
大王製紙 第21回社債間限定同順位特約付	0.605	100,000	99,979	2025/10/24	
レゾナックホールディングス 第3回社債間限定同順位特約付	1.5	100,000	99,282	2033/6/15	
レゾナックホールディングス 第35回社債間限定同順位特約付	0.55	100,000	93,833	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	88,810	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	98,949	2027/9/13	
住友化学 第60回社債間限定同順位特約付	0.9	100,000	84,235	2039/4/15	
住友化学 第61回社債間限定同順位特約付	0.4	100,000	97,711	2029/4/16	
住友化学 第65回社債間限定同順位特約付	0.68	100,000	76,515	2041/10/11	
イビデン 第12回社債間限定同順位特約付	0.11	100,000	99,062	2026/9/9	
日本酸素ホールディングス 第4回社債間限定同順位特約付	0.599	100,000	99,789	2028/8/31	
日本酸素ホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	1.052	100,000	99,004	2033/8/31	
三菱瓦斯化学 第24回社債間限定同順位特約付	0.608	100,000	99,888	2028/10/18	
三井化学 第48回社債間限定同順位特約付	0.39	100,000	98,840	2028/6/19	
三井化学 第58回社債間限定同順位特約付	0.662	100,000	100,015	2029/3/1	
J S R 第9回社債間限定同順位特約付	0.29	100,000	99,159	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	97,577	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	193,250	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	84,416	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	97,249	2030/12/13	
UBE 株式会社 第21回社債間限定同順位特約付	1.611	100,000	101,239	2033/11/24	
電通 第3回社債間限定同順位特約付	0.424	100,000	98,917	2028/10/25	

銘柄	利回り	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%			千円	
電通 第6回社債間限定同順位特約付	0.49	300,000	294,699	2030/7/8	
武田薬品工業 第16回社債間限定同順位特約付	0.4	300,000	286,029	2031/10/14	
アステラス製薬 第1回無担保社債間限定	0.26	100,000	99,828	2025/12/5	
アステラス製薬 第3回無担保社債間限定	0.32	100,000	99,751	2026/8/31	
アステラス製薬 第4回無担保社債間限定	0.519	100,000	99,703	2028/8/31	
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	99,755	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	193,540	2030/9/17	
ヤフー 第12回社債間限定同順位特約付	0.37	200,000	197,584	2026/7/31	
楽天 第13回社債間限定同順位特約付	0.45	100,000	77,802	2029/6/25	
出光興産 第14回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	95,438	2031/7/15	
JX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	99,532	2026/7/28	
コスモエネルギーホールディングス 第1回社債間限定同順位特約付	0.54	100,000	99,451	2028/5/8	
TOYO TIRE 第4回社債間限定同順位特約付	1.212	100,000	99,099	2033/9/6	
ブリヂストン 第11回社債間限定同順位特約付	0.295	100,000	99,365	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	99,499	2026/9/4	
AGC 第2回社債間限定同順位特約付	0.79	100,000	97,939	2033/6/8	
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	98,447	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	96,985	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	296,214	2028/6/20	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第28回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	99,556	2026/5/27	
ジェイ エフ イー ホールディングス 第34回社債間限定同順位特約付	0.25	100,000	99,863	2025/7/14	
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	98,162	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	198,062	2026/9/15	
住友金属鉱山 第35回社債間限定同順位特約付	0.394	100,000	98,670	2028/7/19	
住友電気工業 第26回社債間限定同順位特約付	0.3	200,000	198,734	2027/3/1	
LIXILグループ 第16回社債間限定同順位特約付	0.704	100,000	96,665	2032/8/27	
YKK 第13回社債間限定同順位特約付	0.355	100,000	99,146	2028/6/15	
住友重機械工業 第8回社債間限定同順位特約付	0.414	100,000	99,312	2028/7/19	
日立建機 第20回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	95,334	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	99,538	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	98,564	2029/7/27	
タダノ 第7回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	96,281	2029/12/13	
セガサミーホールディングス 第5回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	96,678	2029/10/10	
日本精工 第55回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	99,679	2026/3/6	
ジェイテクト 第11回社債間限定同順位特約付	1.008	100,000	99,220	2033/9/2	
日立製作所 第17回社債間限定同順位特約付	1.371	200,000	206,672	2028/12/13	
日立製作所 第23回社債間限定同順位特約付	1.184	100,000	99,819	2033/12/14	
日本電気 第63回社債間限定同順位特約付	0.84	100,000	96,103	2033/7/11	
セイコーエプソン 第15回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	99,443	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	199,664	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	99,514	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	197,074	2027/12/24	
パナソニック 第23回社債間限定同順位特約付	0.39	200,000	193,142	2030/12/24	
パナソニック 第24回社債間限定同順位特約付	0.709	100,000	99,853	2028/9/14	
パナソニック 第26回社債間限定同順位特約付	1.342	100,000	101,557	2033/9/14	
ソニー 第39回	0.35	100,000	99,956	2027/3/5	
ソニー 第40回	0.627	100,000	100,032	2029/3/7	
ソニー 第41回	1.001	100,000	99,603	2034/3/7	

銘柄	利	当期末			
		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	
T D K 第7回社債間限定同順位特約付	0.43	100,000	97,214	2030/7/26	
東海理化電機製作所 第1回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	99,045	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	99,185	2027/8/27	
三菱重工業 第38回社債間限定同順位特約付(第2回グリーンボーン)	0.09	300,000	297,162	2026/9/1	
I H I 第47回社債間限定同順位特約付	0.35	100,000	99,777	2025/9/3	
I H I 第50回社債間限定同順位特約付	0.62	100,000	94,950	2032/6/4	
J A 三井リース 第14回社債間限定同順位特約付	0.3	100,000	96,944	2029/9/6	
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	99,661	2025/10/10	
いすゞ自動車 第31回社債間限定同順位特約付	0.27	100,000	98,751	2028/2/4	
いすゞ自動車 第32回社債間限定同順位特約付	0.11	100,000	99,040	2026/9/29	
トヨタ自動車 第26回社債間限定同順位特約付	0.05	700,000	694,974	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	289,065	2031/3/18	
S U B A R U 第8回社債間限定同順位特約付	1.059	100,000	100,392	2030/11/29	
楽天カード 第3回社債間限定同順位特約付	0.42	100,000	90,245	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	99,481	2025/12/2	
オリンパス 第27回社債間限定同順位特約付	0.47	100,000	97,548	2030/7/19	
大日本印刷 第4回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	97,832	2029/7/19	
大日本印刷 第5回社債間限定同順位特約付	0.27	100,000	97,298	2030/3/8	
アシックス 第7回特定社債間限定同順位特約付	0.792	100,000	100,197	2028/12/14	
丸紅 第113回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	96,828	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	101,002	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	202,230	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	105,614	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	102,115	2029/7/13	
日本紙パルプ商事 第7回社債間限定同順位特約付	0.33	100,000	96,752	2029/12/12	
住友商事 第49回社債間限定同順位特約付	1.286	100,000	102,961	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	99,376	2027/7/26	
住友商事 第61回社債間限定同順位特約付	0.644	100,000	100,274	2028/3/1	
三菱商事 第80回担保提供制限等財務上特約無	1.485	100,000	104,037	2028/9/8	
三菱商事 第83回担保提供制限等財務上特約無	1.054	100,000	100,267	2034/3/21	
丸井グループ 第43回社債間限定同順位特約付	0.4	100,000	99,529	2027/1/22	
クレディセゾン 第65回社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,148	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	96,999	2029/7/31	
クレディセゾン 第99回社債間限定同順位特約付	0.629	100,000	99,279	2029/1/31	
イオン 第24回社債間限定同順位特約付	0.799	100,000	99,332	2028/8/17	
三義UFJファイナンシャル・グループ 第7回劣後特約付	1.393	100,000	100,820	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	99,776	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	200,184	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	106,173	2027/7/27	
三菱東京UFJ銀行 第23回劣後特約付	2.91	100,000	109,315	2029/10/16	
三菱東京UFJ銀行 第24回劣後特約付	2.27	100,000	106,059	2030/9/27	
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	100,089	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	100,213	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	198,868	2026/1/27	
セブン銀行 第12回社債間限定同順位特約付	0.39	300,000	298,047	2027/9/17	
みずほ銀行 第7回劣後特約付	2.87	100,000	104,820	2026/11/6	
芙蓉総合リース 第30回社債間限定同順位特約付	0.36	100,000	94,882	2031/6/18	
芙蓉総合リース 第40回社債間限定同順位特約付	0.707	100,000	99,849	2029/2/28	

銘柄	利回り	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		
みずほリース 第24回社債間限定同順位特約付	0.914	100,000	99,952	2031/2/28	
みずほリース 第3回社債間限定同順位特約付	0.24	300,000	299,436	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	197,718	2028/1/20	
みずほリース 第9回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	98,056	2028/9/1	
NTTファイナンス 第2回社債間限定同順位特約付	0.26	100,000	99,397	2026/12/18	
NTTファイナンス 第16回日本電信電話保証付	0.18	200,000	199,136	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	197,980	2027/12/20	
NTTファイナンス 第18回日本電信電話保証付	0.38	800,000	781,680	2030/9/20	
NTTファイナンス 第25回社債間限定同順位特約付	0.648	100,000	99,537	2030/6/20	
NTTファイナンス 第26回社債間限定同順位特約付	0.838	100,000	98,638	2033/6/20	
NTTファイナンス 第30回社債間限定同順位特約付	1.213	100,000	101,717	2033/9/20	
日産フィナンシャルサービス 第56回社債間限定同順位特約付	0.52	200,000	198,376	2026/6/19	
東京センチュリー 第28回社債間限定同順位特約付	0.44	100,000	96,754	2030/10/22	
東京センチュリー 第33回社債間限定同順位特約付	0.28	100,000	98,386	2028/4/27	
東京センチュリー 第34回社債間限定同順位特約付	0.22	100,000	97,982	2028/7/21	
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	99,792	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	198,406	2026/6/19	
ホンダファイナンス 第83回社債間限定同順位特約付	0.509	100,000	99,525	2028/9/20	
SBIホールディングス 第26回社債間限定同順位特約付	0.8	200,000	198,228	2026/7/24	
SBIホールディングス 第37回社債間限定同順位特約付	1.0	200,000	199,486	2027/3/5	
トヨタファイナンス 第81回社債間限定同順位特約付	0.265	100,000	99,108	2027/10/22	
トヨタファイナンス 第94回社債間限定同順位特約付	0.11	100,000	99,679	2025/10/21	
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	793,864	2026/4/15	
リコーアイリース 第28回社債間限定同順位特約付	0.345	100,000	99,170	2027/7/20	
イオンフィナンシャルサービス 第17回社債間限定同順位特約付	0.34	100,000	99,166	2026/7/31	
イオンフィナンシャルサービス 第21回社債間限定同順位特約付	0.8	200,000	199,454	2028/2/24	
アコム 第78回特定社債間限定同順位特約付	0.38	100,000	99,386	2026/8/28	
オリエントコーポレーション 第30回社債間限定同順位特約付	0.47	100,000	94,109	2031/7/18	
オリエントコーポレーション 第32回社債間限定同順位特約付	0.55	200,000	187,864	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	99,489	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	97,005	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	99,669	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	95,391	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	99,274	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	400,000	396,828	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	99,232	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	292,017	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	100,558	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	99,201	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	99,855	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	99,084	2026/11/13	
NECキャピタルソリューション 第19回社債間限定同順位特約付	0.18	100,000	99,021	2026/7/16	
三井不動産 第60回社債間限定同順位特約付	0.305	100,000	98,794	2028/5/2	
三井不動産 第71回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	194,626	2030/4/16	
三井不動産 第83回社債間限定同順位特約付	0.81	300,000	293,127	2033/6/6	
三井不動産 第84回社債間限定同順位特約付	1.057	100,000	99,552	2033/9/12	
三菱地所 第93回担保提供制限等財務上特約無	2.555	200,000	216,314	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	99,189	2027/6/18	

銘柄	利	当期末			償還年月日
		率	額面金額	評価額	
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
三菱地所 第129回担保提供制限等財務上特約無	0.17	100,000	99,341	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	95,648	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	99,634	2027/3/19	
東京建物 第34回社債間限定同順位特約付	0.88	100,000	96,452	2033/7/6	
ダイビル 第19回特定社債間限定同順位特約付	0.96	100,000	87,076	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	91,997	2035/11/27	
住友不動産 第109回社債間限定同順位特約付	0.31	200,000	192,162	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	96,453	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	84,452	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	102,794	2028/9/20	
日本ビルファンド投資法人 第17回	0.888	100,000	88,802	2038/5/21	
ジャパンリアルエスティート投資法人 第4回特定投資法人債間限定	2.56	100,000	102,992	2025/9/29	
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	94,066	2031/12/5	
グローバル・ワン不動産投資法人 第9回	0.47	100,000	99,253	2026/10/16	
野村不動産オフィスアンド投資法人 第7回特定投資法人債間限定	2.9	100,000	107,966	2028/3/17	
東京急行電鉄 第82回社債間限定同順位特約付	1.307	100,000	102,158	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	194,576	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	204,296	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	92,728	2037/5/29	
京王電鉄 第38回社債間限定同順位特約付	0.295	100,000	99,220	2027/11/29	
京成電鉄 第63回社債間限定同順位特約付	0.798	100,000	97,828	2033/7/20	
東日本旅客鉄道 第47回社債間限定同順位特約付	2.46	100,000	105,004	2026/9/18	
東日本旅客鉄道 第57回社債間限定同順位特約付	2.376	200,000	216,334	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	107,482	2030/9/27	
東日本旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	2.098	100,000	108,877	2030/12/20	
東日本旅客鉄道 第86回社債間限定同順位特約付	1.732	100,000	106,721	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	98,360	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	92,819	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	99,316	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	76,802	2058/9/27	
東日本旅客鉄道 第142回社債間限定同順位特約付	0.809	200,000	103,224	2069/7/23	
東日本旅客鉄道 第145回社債間限定同順位特約付	0.771	200,000	128,758	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	97,441	2030/4/22	
東日本旅客鉄道 第151回社債間限定同順位特約付	0.992	100,000	56,027	2070/4/22	
東日本旅客鉄道 第153回社債間限定同順位特約付	0.23	100,000	97,044	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	96,329	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	84,848	2041/4/15	
東日本旅客鉄道 第167回社債間限定同順位特約付	0.978	200,000	136,214	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	99,829	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	105,402	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	319,287	2027/12/20	
西日本旅客鉄道 第53回社債間限定同順位特約付	1.263	100,000	77,289	2058/8/30	
西日本旅客鉄道 第60回社債間限定同順位特約付	0.255	200,000	194,642	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	193,996	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	172,962	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	67,657	2061/4/22	
東海旅客鉄道 第51回社債間限定同順位特約付	2.212	200,000	217,964	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	103,309	2032/9/30	

銘柄	利回り	当期末			償還年月日
		額面金額	評価額	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%			千円	
東海旅客鉄道 第73回社債間限定同順位特約付	1.014	300,000	296,037	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	97,434	2045/3/6	
東京地下鉄 第22回	0.215	100,000	99,190	2027/6/21	
東京地下鉄 第23回	0.661	100,000	91,903	2037/6/19	
東京地下鉄 第24回	1.035	100,000	83,824	2047/6/21	
東京地下鉄 第44回	1.087	100,000	58,500	2070/6/12	
東京地下鉄 第49回	0.574	100,000	84,932	2041/1/22	
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	192,414	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	98,733	2031/3/4	
阪急阪神ホールディングス 第47回	1.202	400,000	411,316	2029/7/18	
阪急阪神ホールディングス 第49回	0.817	100,000	94,055	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	100,972	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	99,426	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	92,506	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	99,119	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	106,556	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	99,614	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	155,272	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	84,654	2039/12/9	
日本航空 第12回社債間限定同順位特約付	1.2	100,000	98,172	2033/6/17	
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	88,654	2036/6/9	
KDDI 第25回社債間限定同順位特約付	0.395	100,000	98,546	2028/11/22	
KDDI 第30回社債間限定同順位特約付	0.21	100,000	99,745	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	99,095	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	194,828	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	98,556	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	93,166	2031/10/10	
ソフトバンク 第23回社債間限定同順位特約付	1.3	100,000	97,147	2033/7/12	
電源開発 第50回社債間限定同順位特約付	0.415	100,000	99,493	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	98,903	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	98,768	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	191,552	2031/5/20	
電源開発 第86回社債間限定同順位特約付	0.93	100,000	98,472	2033/5/20	
JERA 第3回無担保社債間限定同順位特約付	0.15	100,000	98,813	2026/11/25	
JERA 第17回無担保社債間限定同順位特約付	0.9	200,000	199,936	2030/4/25	
東京瓦斯 第28回社債間限定同順位特約付	2.29	200,000	211,594	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	106,804	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	103,810	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	83,073	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	73,978	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	151,514	2051/6/2	
大阪瓦斯 第51回社債間限定同順位特約付	0.785	100,000	98,313	2033/6/2	
東邦瓦斯 第44回社債間限定同順位特約付	0.835	100,000	85,354	2042/3/3	
北海道瓦斯 第23回社債間限定同順位特約付	0.51	100,000	92,058	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	98,521	2028/9/13	
西部ガスホールディングス 第21回社債間限定同順位特約付	1.215	100,000	100,521	2033/10/12	
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	99,295	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	91,504	2038/6/4	

銘柄	利	当期末			償還年月日
		額面	金額	評価額	
普通社債券(含む投資法人債券)					
フランス相互信用連合銀行 (BFCM)	0.423	100,000	96,055	2029/10/10	
フランス相互信用連合銀行 (BFCM)	1.203	200,000	201,576	2028/10/16	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第14回円貨社債	0.45	100,000	99,084	2026/6/17	
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	196,744	2026/12/16	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第29回非上位円貨社債	0.899	100,000	100,135	2025/12/15	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第36回円貨社債	0.895	100,000	99,971	2026/12/14	
ビー・ピー・シー・イー・エス・エー 第37回円貨社債	1.214	100,000	100,108	2028/12/14	
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	97,732	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	99,803	2025/6/5	
エイチエスピー・ホールディングス・ビーエルシー 第3回円	1.207	100,000	99,911	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	97,558	2028/5/30	
フランス電力 第4回円貨社債 (2017)	1.088	100,000	100,350	2027/1/26	
ビー・エヌ・ピー・パリバ 第8回円貨社債	1.01	200,000	199,904	2028/9/7	
小計		52,630,000	51,213,029		
合計		1,163,511,399	1,135,777,832		

*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 (2023年4月1日～2024年4月1日)

項目	当期
(A) 配当等収益	円
受取利息	7,188,807,049
支払利息	△ 2,325,304
(B) 有価証券売買損益	△ 28,365,511,509
売買益	470,470,530
売買損	△ 28,835,982,039
(C) 当期損益金(A+B)	△ 21,176,704,460
(D) 前期繰越損益金	199,211,229,765
(E) 追加信託差損益金	77,390,808,476
(F) 解約差損益金	△ 21,675,437,573
(G) 計(C+D+E+F)	233,749,896,208
次期繰越損益金(G)	233,749,896,208

*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。

<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ースペース）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・ペータ・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

※DBiリキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッドについては、2025年8月1日以降当該外国投資証券に対する新たな投資は行っておりませんが、本運用報告書作成対象期間中に組み入れのあったファンドのため、本ページ以降は参考情報として2025年3月31日現在における、DBiリキッド・オルタナティブ・ファンド・リミテッドに関する情報を記載しております。

◎組入資産の明細

(2025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	エクスポートージャー(USD)		エクスポートージャー(%)		ネット・エクスポートージャー(%)
		グロス	ネット	グロス	ネット	
通貨	Short	10,422,350.00	(10,422,350.00)	16.19%	(16.19)%	
銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートージャー	ネット・エクスポートージャー	グロス・エクスポートージャー(%)	ネット・エクスポートージャー(%)
EUR/USD CME	06/16/2025	Short	7,841,600.00	(7,841,600.00)	12.18%	(12.18)%
JAPANESE YEN CME	06/16/2025	Short	2,580,750.00	(2,580,750.00)	4.01%	(4.01)%
小計			10,422,350.00	(10,422,350.00)	16.19%	(16.19)%
エネルギー	Short	1,135,200.00	(1,135,200.00)	1.76%	(1.76)%	
銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートージャー	ネット・エクスポートージャー	グロス・エクスポートージャー(%)	ネット・エクスポートージャー(%)
CRUDE OIL	05/20/2025	Short	1,135,200.00	(1,135,200.00)	1.76%	(1.76)%
小計			1,135,200.00	(1,135,200.00)	1.76%	(1.76)%
金融	Long	38,871,437.50	38,871,437.50	60.39%	60.39%	
銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートージャー	ネット・エクスポートージャー	グロス・エクスポートージャー(%)	ネット・エクスポートージャー(%)
THREE-MONTH SOFR	12/15/2026	Long	38,871,437.50	38,871,437.50	60.39%	60.39%
小計			38,871,437.50	38,871,437.50	60.39%	60.39%
金融	Short	12,912,359.38	(12,912,359.38)	20.06%	(20.06)%	
銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートージャー	ネット・エクスポートージャー	グロス・エクスポートージャー(%)	ネット・エクスポートージャー(%)
2 YR T-NOTE	06/30/2025	Short	4,350,609.38	(4,350,609.38)	6.76%	(6.76)%
US 10 YR NOTES	06/19/2025	Short	6,450,687.50	(6,450,687.50)	10.02%	(10.02)%
US T. BOND	06/19/2025	Short	2,111,062.50	(2,111,062.50)	3.28%	(3.28)%
小計			12,912,359.38	(12,912,359.38)	20.06%	(20.06)%
インデックス	Long	69,904,323.00	69,904,323.00	108.60%	108.60%	
銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートージャー	ネット・エクスポートージャー	グロス・エクスポートージャー(%)	ネット・エクスポートージャー(%)
DOLLAR INDEX	06/16/2025	Long	37,501,763.00	37,501,763.00	58.26%	58.26%
E MINI RUSSELL	06/20/2025	Long	1,216,260.00	1,216,260.00	1.89%	1.89%
EMINI MSCI EAFE	06/20/2025	Long	17,155,730.00	17,155,730.00	26.65%	26.65%
EMINI MSCI EM	06/20/2025	Long	6,331,560.00	6,331,560.00	9.84%	9.84%
EMINI NASDAQ	06/20/2025	Long	5,054,270.00	5,054,270.00	7.85%	7.85%
MINI MIDCA	06/20/2025	Long	2,644,740.00	2,644,740.00	4.11%	4.11%
小計			69,904,323.00	69,904,323.00	108.60%	108.60%
インデックス	Short	2,543,962.50	(2,543,962.50)	3.95%	(3.95)%	
銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートージャー	ネット・エクスポートージャー	グロス・エクスポートージャー(%)	ネット・エクスポートージャー(%)
EMINI S&P	06/20/2025	Short	2,543,962.50	(2,543,962.50)	3.95%	(3.95)%
小計			2,543,962.50	(2,543,962.50)	3.95%	(3.95)%
貴金属	Long	5,355,510.00	5,355,510.00	8.32%	8.32%	
銘柄名	限月	ロング/ショート	グロス・エクスポートージャー	ネット・エクスポートージャー	グロス・エクスポートージャー(%)	ネット・エクスポートージャー(%)
GOLD CMX	06/26/2025	Long	5,355,510.00	5,355,510.00	8.32%	8.32%
小計			5,355,510.00	5,355,510.00	8.32%	8.32%
総合計			141,145,142.38	87,117,398.63	219.29%	135.35%

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

◎貸借対照表

(2025年3月31日現在)

資産

投資有価証券の公正価額（取得原価 \$ 53,846,909）	\$	53,846,909
デリバティブ契約の公正価額		657,238
現金及び現金相当		2,189,890
ブローカーからの未収金		13,687,344
その他資産		469,663
<hr/>		
資産合計		70,851,044

負債

負債

デリバティブ契約の公正価額	\$	1,647,584
ブローカーへの未収金		4,779,445
未払いマネジメントフィー		37,137
未払い費用		21,150
<hr/>		
負債合計		6,485,316

純資産

\$	64,365,728
----	------------

◎損益計算書

2024年4月1日から2025年3月31までの期間

投資収入

金利

\$ 3,190,468

支出

マネジメントフィー

(443,641)

管理費用

(27,676)

取締役報酬

(28,200)

利息

(70,716)

プロフェッショナルフィー他

(77,911)

支出合計

(648,144)

投資マネージャーが負担する支出

110,934

純支出

(537,210)

純投資収益

2,653,258

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 \$ 181,891を控除）

(4,993,968)

デリバティブ契約にかかる純含み変動額

(397,438)

デリバティブ契約にかかる純損失

(5,391,406)

オペレーションの結果による純資産減少額

\$ (2,738,148)