

東京海上・円建て投資適格債券ファンド (毎月決算型)

〈愛称 円債くん〉

運用報告書 (全体版)

第119期 (決算日 2020年4月23日)
 第120期 (決算日 2020年5月25日)
 第121期 (決算日 2020年6月23日)
 第122期 (決算日 2020年7月27日)
 第123期 (決算日 2020年8月24日)
 第124期 (決算日 2020年9月23日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
 さて、「東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)〈愛称 円債くん〉」は、このたび、第124期の決算を行いましたので、第119期～第124期の運用状況をまとめ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。

東京海上アセットマネジメント

東京都千代田区丸の内1-8-2 鉄鋼ビルディング

お問い合わせ窓口

東京海上アセットマネジメント サービスデスク 0120-712-016

受付時間：営業日の9時～17時

<https://www.tokiomarineam.co.jp/>

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／国内／債券 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	無期限 (2010年5月28日設定)	
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。	
主要投資対象	東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)	「東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド」を主要投資対象とします。
	東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	わが国の法人が発行する円建ての社債(金融機関劣後債、生保基金債等を含みます。)を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)	<ul style="list-style-type: none"> 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
	東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	<ul style="list-style-type: none"> 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
配分方針	毎決算時に、原則として経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等から、基準価額の水準、市況動向等を勘案して安定した分配を行う方針です。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。
また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近30期の運用実績

決 算 期	基 (分配落)	準 価 額			参 考	指 数		債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 分	込 配	み 金		期 騰 落	中 率		
	円		円				%		百万円
95期(2018年4月23日)	9,698		18		180.386		△0.3	99.3	48,966
96期(2018年5月23日)	9,697		10		180.629		0.1	99.5	48,907
97期(2018年6月25日)	9,701		10		180.932		0.1	99.7	48,250
98期(2018年7月23日)	9,647		10		180.241		△0.5	99.8	47,499
99期(2018年8月23日)	9,605		10		179.808		△0.3	99.6	46,390
100期(2018年9月25日)	9,557		10		179.225		△0.4	99.7	45,207
101期(2018年10月23日)	9,540		10		179.120		△0.1	99.7	44,283
102期(2018年11月26日)	9,594		10		180.310		0.7	99.3	43,697
103期(2018年12月25日)	9,639		10		181.096		0.6	100.0	43,307
104期(2019年1月23日)	9,657		10		182.231		0.3	99.7	43,007
105期(2019年2月25日)	9,681		10		183.065		0.4	99.7	42,755
106期(2019年3月25日)	9,713		10		183.984		0.4	99.8	42,370
107期(2019年4月23日)	9,659		10		183.335		△0.5	99.8	41,530
108期(2019年5月23日)	9,676		10		183.812		0.3	99.6	41,763
109期(2019年6月24日)	9,749		10		185.537		0.9	99.7	41,694
110期(2019年7月23日)	9,734		10		185.554		△0.1	99.5	41,127
111期(2019年8月23日)	9,782		10		187.331		0.6	99.8	41,020
112期(2019年9月24日)	9,763		10		186.800		△0.1	99.3	40,558
113期(2019年10月23日)	9,685		10		185.354		△0.7	98.9	40,068
114期(2019年11月25日)	9,654		10		184.555		△0.2	97.8	39,681
115期(2019年12月23日)	9,592		10		183.308		△0.5	98.0	39,710
116期(2020年1月23日)	9,622		10		184.128		0.4	96.7	39,810
117期(2020年2月25日)	9,664		10		185.373		0.5	97.5	39,666
118期(2020年3月23日)	9,490		10		182.460		△1.7	92.0	38,123
119期(2020年4月23日)	9,495		10		183.536		0.2	96.1	38,165
120期(2020年5月25日)	9,476		10		183.337		△0.1	97.1	38,017
121期(2020年6月23日)	9,461		10		183.003		△0.1	97.4	37,776
122期(2020年7月27日)	9,452		10		182.926		△0.0	98.0	37,456
123期(2020年8月24日)	9,434		10		182.763		△0.1	98.7	37,183
124期(2020年9月23日)	9,449		10		183.157		0.2	99.0	36,784

(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

参考指数はNOMURA-BPI/Ladder20年です。

NOMURA-BPI/Ladderは、野村証券が公表する、日本の国債でラダー型運用を行った場合のパフォーマンスを表すインデックスです。

○当作成期中の基準価額と市況等の推移

決 算 期	年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数		債 券 組 入 比 率
		騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	
第119期	(期 首) 2020年3月23日	円 9,490	% -	182.460	% -	% 92.0
	3月末	9,491	0.0	182.909	0.2	91.3
	(期 末) 2020年4月23日	9,505	0.2	183.536	0.6	96.1
第120期	(期 首) 2020年4月23日	9,495	-	183.536	-	96.1
	4月末	9,514	0.2	183.925	0.2	96.1
	(期 末) 2020年5月25日	9,486	△0.1	183.337	△0.1	97.1
第121期	(期 首) 2020年5月25日	9,476	-	183.337	-	97.1
	5月末	9,474	△0.0	183.228	△0.1	97.0
	(期 末) 2020年6月23日	9,471	△0.1	183.003	△0.2	97.4
第122期	(期 首) 2020年6月23日	9,461	-	183.003	-	97.4
	6月末	9,444	△0.2	182.712	△0.2	97.1
	(期 末) 2020年7月27日	9,462	0.0	182.926	△0.0	98.0
第123期	(期 首) 2020年7月27日	9,452	-	182.926	-	98.0
	7月末	9,466	0.1	183.141	0.1	97.9
	(期 末) 2020年8月24日	9,444	△0.1	182.763	△0.1	98.7
第124期	(期 首) 2020年8月24日	9,434	-	182.763	-	98.7
	8月末	9,418	△0.2	182.419	△0.2	99.0
	(期 末) 2020年9月23日	9,459	0.3	183.157	0.2	99.0

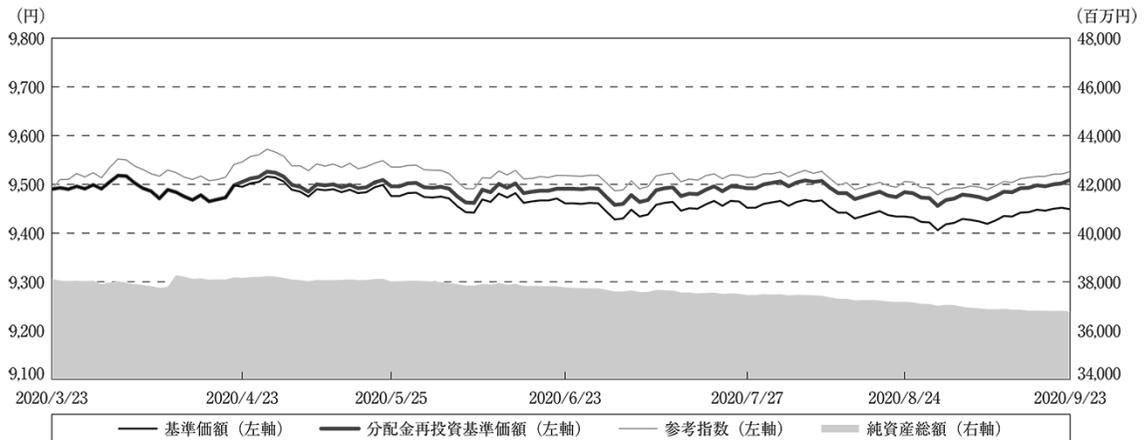
(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

○運用経過

(2020年3月24日～2020年9月23日)

■作成期間中の基準価額等の推移



(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および参考指数は、作成期首(2020年3月23日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

(注) 参考指数は、NOMURA-BPI/Ladder20年です。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・新型コロナウイルス感染拡大に対応した主要各国の大規模な財政・金融政策を受けて、国内長期金利(10年国債利回り)が低下(債券価格の上昇)したこと
- ・日銀によるCP(コマーシャル・ペーパー)・社債買入れオペの拡充などにより、社債利回りが低下したこと
- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・新型コロナウイルス感染拡大に伴う企業業績の悪化懸念から、社債利回りが上昇する局面があったこと

■投資環境

【国債市場の概況】

当作成期の国内長期金利は小幅に低下しました。

当作成期初、0.08%程度の水準であった国内長期金利は、2020年3月下旬以降、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による景気急減速に対処するために、主要各国が大規模な財政・金融政策を相次いで発動したことを受けて低下し、その後は-0.05%から+0.05%程度の狭いレンジで推移しました。7月以降は、第二次補正予算の編成を受けて、国債増発による需給の悪化が懸念されましたが、日銀による国債の積極的な買入れを背景に金利上昇圧力は限定的なものにとどまり、国内長期金利は前作成期末よりも小幅に低下した0.02%程度の水準で当作成期を終えました。

【社債市場の概況】

当作成期初、新型コロナウイルス感染拡大を受けた企業業績の悪化懸念から、社債利回りは上昇しました。しかし、2020年4月下旬以降、相対的に高い利回りを求めて国内社債市場に資金が流入したことや、日銀がCP・社債買入れオペの拡充を決定したことなどから、国内社債市場は落ち着きを取り戻し、社債利回りは前作成期末対比小幅に低下して当作成期を終えました。

個別銘柄では、日産自動車が2020年3月期に巨額の赤字を計上し、日産自動車および同社の金融子会社である日産フィナンシャルサービスの社債価格が下落しました。また、新型コロナウイルス感染拡大により、長期的な旅客需要の低迷が懸念された日本航空およびANAホールディングスの社債価格も下落しました。

■ポートフォリオについて

〈東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)〉

「東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持しました。

当ファンドの基準価額(税引前分配金再投資)は、マザーファンドの値動きを反映し、0.2%上昇しました。

〈東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド〉

わが国の法人が発行する円建ての社債を中心に投資し、投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、年限別の金利変動リスクを出来る限り平均化させ、インカムゲイン(利息等収益)を中心に安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行いました。当作成期の運用経過は以下の通りです。

当作成期は、ポートフォリオの利回り向上を意識して、社債(金融機関劣後債、生保基金債などを含む)を中心とした組み入れを維持しました。組み入れにあたっては、個別企業の信用リスクが変動した際の影響を可能な限り回避するよう業種分散を図るとともに、信用力の程度に応じた残存年限を選択しました。

また、流動性確保の観点から、国債や政府保証債、地方債などにも投資しました。当作成期末のポートフォリオの平均残存期間は10年程度、平均格付は「AA-」(格付が取得できない債券を除く)を維持しました。以上の運用の結果、基準価額は0.5%上昇しました。

なお、前述の日産フィナンシャルサービス債、日本航空債、ANAホールディングス債は当ファンドで保有していますが、ファンド全体に占める保有割合は各々0.1%未満、0.4%程度、0.1%程度と僅かであり、収益に与える影響は軽微でした。今後もその動向を注視していきますが、現時点で発行体の債務の返済能力に特段の懸念はないと考えています。

【組入上位銘柄】

＜国債、地方債、政府保証債＞

(2020年9月23日現在)

	銘柄	比率
		%
1	第22回政府保証民間都市開発債券	0.1
2	令和2年度第2回島根県公募公債	0.1
3	第37回東京都公募公債(20年)	0.1

＜金融債、事業債、円建社債、MBS・ABS＞

	銘柄	比率
		%
1	第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	0.2
2	第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.1
3	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.1

＜CP＞

	銘柄	比率
		%
1	東銀リース CP 200326	0.1
2	ニッセイ・リース CP 200327	0.1
3	ニッセイ・リース CP 200625	0.1

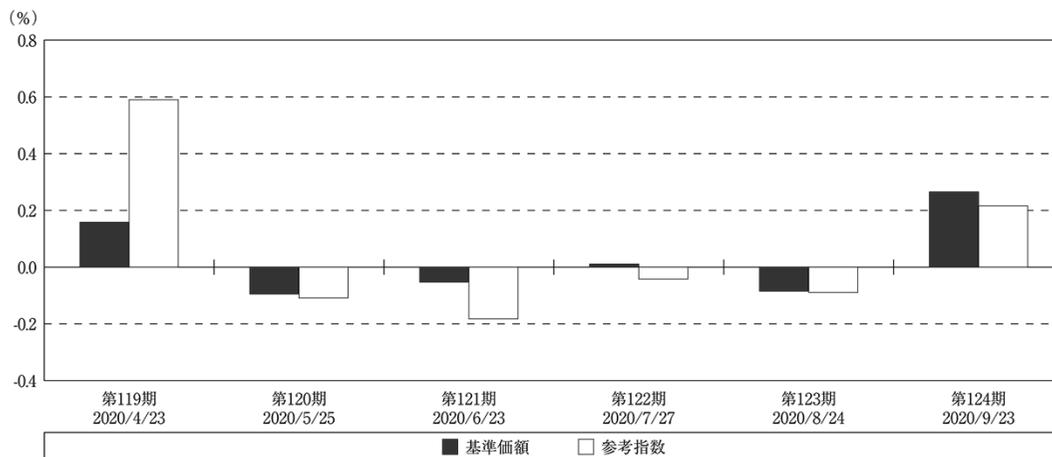
組入銘柄総数	1,561銘柄
--------	---------

(注) 比率は純資産総額に対する割合です。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。
 グラフは、当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率の対比です。

基準価額と参考指数の対比 (期別騰落率)



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注) 参考指数は、NOMURA-BPI/Ladder20年です。

■分配金

当ファンドの収益分配方針に基づき、基準価額の水準や市況動向などを勘案して、次表の通りとしました。なお、収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

(単位：円、1万円当たり、税込み)

項 目	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
	2020年3月24日～ 2020年4月23日	2020年4月24日～ 2020年5月25日	2020年5月26日～ 2020年6月23日	2020年6月24日～ 2020年7月27日	2020年7月28日～ 2020年8月24日	2020年8月25日～ 2020年9月23日
当期分配金 (対基準価額比率)	10 0.105%	10 0.105%	10 0.106%	10 0.106%	10 0.106%	10 0.106%
当期の収益	—	—	0	—	—	—
当期の収益以外	10	10	9	10	10	10
翌期繰越分配対象額	254	245	236	227	218	213

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

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

○今後の運用方針

<東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)>

「東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド」を主要投資対象とし、高位の組入比率を維持します。

<東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド>

国債市場は、2020年7月以降、第二次補正予算の編成を受けた国債増発による需給の悪化が懸念されましたが、需給が極端に悪化しないよう日銀が積極的な買入れを続けていることや、新型コロナウイルス感染再拡大のリスクも考慮すると、国内長期金利は引き続き低水準で推移すると考えます。

国内社債市場については、低金利による運用難が続くなか、金融市場のボラティリティ(変動性)が低下している環境下、相対的に高い利回りを求めて国内社債市場に資金が流入する構図は続くと考えます。ただし、新型コロナウイルス感染再拡大への警戒が煙り続けるなか、未だ多くの企業の業績低迷が懸念されるため、投資家のリスク選好度は新型コロナウイルス感染拡大前の水準には戻らないと考えます。

以上のような環境下、今後も流動性の確保に留意しながら、相対的に信用力が高いと判断する銘柄でポートフォリオを構築し、安定運用を行います。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年3月24日～2020年9月23日)

項 目	第119期～第124期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 27	% 0.288	(a) 信託報酬＝作成期間の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(13)	(0.139)	* 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価
（ 販 売 会 社 ）	(13)	(0.139)	* 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価
（ 受 託 会 社 ）	(1)	(0.011)	* 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	0	0.001	(b) その他費用＝作成期間のその他費用÷作成期間の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(0)	(0.001)	* 監査費用は、監査法人に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	27	0.289	
作成期間の平均基準価額は、9,467円です。			

(注) 作成期間の費用（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) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

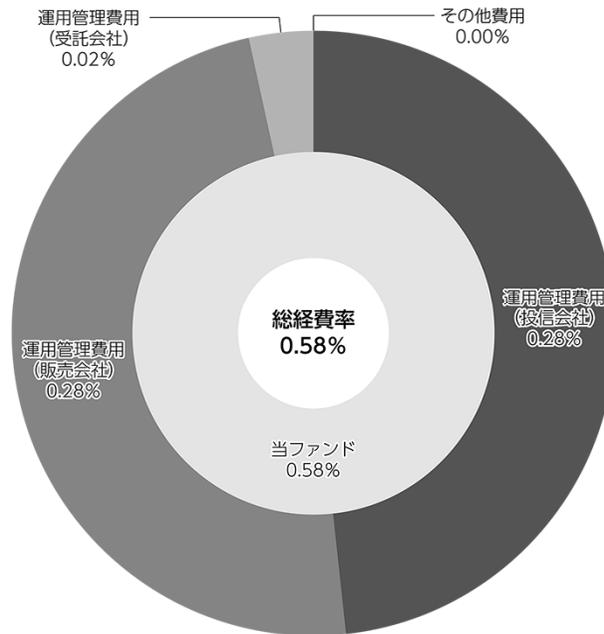
(注) その他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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）を作成期間の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

○総経費率

作成期間の運用・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。）を作成期間の平均受益権口数に作成期間の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.58%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) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(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

(2020年3月24日～2020年9月23日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘	柄	第119期～第124期			
		設		約	
		口	金	口	金
		数	額	数	額
		千口	千円	千口	千円
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド		917,639	1,117,708	2,163,953	2,636,974

○利害関係人との取引状況等

(2020年3月24日～2020年9月23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。

○組入資産の明細

(2020年9月23日現在)

親投資信託残高

銘	柄	第118期末	第124期末	
		口	口	評
		数	数	価
		千口	千口	額
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド		31,323,196	30,076,882	36,784,026

親投資信託における組入資産の明細につきましては、後述の親投資信託の「運用報告書」をご参照ください。

○投資信託財産の構成

(2020年9月23日現在)

項	目	第124期末	
		評	比
		価	率
		額	
		千円	%
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド		36,784,026	99.7
コール・ローン等、その他		120,599	0.3
投資信託財産総額		36,904,625	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第119期末	第120期末	第121期末	第122期末	第123期末	第124期末
	2020年4月23日現在	2020年5月25日現在	2020年6月23日現在	2020年7月27日現在	2020年8月24日現在	2020年9月23日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	38,266,384,010	38,107,729,765	37,896,265,487	37,555,672,524	37,291,499,734	36,904,625,698
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド(評価額)	38,165,297,390	38,017,437,240	37,776,167,050	37,456,257,455	37,183,047,974	36,784,026,929
未収入金	101,086,620	90,292,525	120,098,437	99,415,069	108,451,760	120,598,769
(B) 負債	101,086,620	90,292,525	120,098,437	99,415,069	108,451,760	120,598,769
未払収益分配金	40,194,350	40,120,715	39,926,431	39,628,586	39,414,809	38,930,186
未払解約金	42,370,413	30,995,634	62,883,977	39,689,464	52,588,624	64,253,909
未払信託報酬	18,466,857	19,121,176	17,233,029	20,042,019	16,393,327	17,359,674
その他未払費用	55,000	55,000	55,000	55,000	55,000	55,000
(C) 純資産総額(A-B)	38,165,297,390	38,017,437,240	37,776,167,050	37,456,257,455	37,183,047,974	36,784,026,929
元本	40,194,350,692	40,120,715,419	39,926,431,291	39,628,586,786	39,414,809,449	38,930,186,936
次期繰越損益金	△ 2,029,053,302	△ 2,103,278,179	△ 2,150,264,241	△ 2,172,329,331	△ 2,231,761,475	△ 2,146,160,007
(D) 受益権総口数	40,194,350,692口	40,120,715,419口	39,926,431,291口	39,628,586,786口	39,414,809,449口	38,930,186,936口
1万円当たり基準価額(C/D)	9.495円	9.476円	9.461円	9.452円	9.434円	9.449円

(注) 当ファンドの第119期首元本額は40,170,846,711円、第119～124期中追加設定元本額は1,179,715,391円、第119～124期中一部解約元本額は2,420,375,166円です。

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万円当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況

項 目	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
	2020年3月24日～ 2020年4月23日	2020年4月24日～ 2020年5月25日	2020年5月26日～ 2020年6月23日	2020年6月24日～ 2020年7月27日	2020年7月28日～ 2020年8月24日	2020年8月25日～ 2020年9月23日
	円	円	円	円	円	円
(A) 有価証券売買損益	78,276,880	△ 18,640,665	75,104	21,791,345	△ 15,209,064	114,524,752
売買益	110,027,894	3,328,184	28,090,112	52,680,277	9,450,660	145,089,116
売買損	△ 31,751,014	△ 21,968,849	△ 28,015,008	△ 30,888,932	△ 24,659,724	△ 30,564,364
(B) 信託報酬等	△ 18,521,857	△ 19,176,176	△ 17,288,029	△ 20,097,019	△ 16,448,327	△ 17,414,674
(C) 当期損益金(A+B)	59,755,023	△ 37,816,841	△ 17,212,925	1,694,326	△ 31,657,391	97,110,078
(D) 前期繰越損益金	△1,007,330,908	△ 944,052,294	△ 974,449,290	△1,019,622,201	△1,009,658,184	△1,026,094,548
(E) 追加信託差損益金	△1,041,283,067	△1,081,288,329	△1,118,675,595	△1,114,772,870	△1,151,031,091	△1,178,245,351
(配当等相当額)	(1,018,165,525)	(976,504,328)	(932,011,537)	(925,152,782)	(880,854,317)	(831,169,750)
(売買損益相当額)	(△2,059,448,592)	(△2,057,792,657)	(△2,050,687,132)	(△2,039,925,652)	(△2,031,885,408)	(△2,009,415,101)
(F) 計(C+D+E)	△1,988,858,952	△2,063,157,464	△2,110,337,810	△2,132,700,745	△2,192,346,666	△2,107,229,821
(G) 収益分配金	△ 40,194,350	△ 40,120,715	△ 39,628,431	△ 39,628,586	△ 39,414,809	△ 38,930,186
次期繰越損益金(F+G)	△2,029,053,302	△2,103,278,179	△2,150,264,241	△2,172,329,331	△2,231,761,475	△2,146,160,007
追加信託差損益金	△1,081,477,417	△1,121,409,044	△1,118,675,595	△1,154,401,456	△1,190,445,900	△1,217,175,537
(配当等相当額)	(978,209,085)	(936,409,871)	(932,049,870)	(885,583,294)	(841,466,584)	(792,267,848)
(売買損益相当額)	(△2,059,686,502)	(△2,057,818,915)	(△2,050,725,465)	(△2,039,984,750)	(△2,031,912,484)	(△2,009,443,385)
分配準備積立金	46,255,838	50,207,739	13,462,818	17,697,026	21,271,572	38,900,095
繰越損益金	△ 993,831,723	△1,032,076,874	△1,045,051,464	△1,035,624,901	△1,062,587,147	△ 967,884,565

(注) (A) 有価証券売買損益は、各期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (B) 信託報酬等は、消費税等相当額を含めて表示しています。

(注) (E) 追加信託差損益金は、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です。

(注) 分配金の計算過程は以下の通りです。

項 目	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
	2020年3月24日～ 2020年4月23日	2020年4月24日～ 2020年5月25日	2020年5月26日～ 2020年6月23日	2020年6月24日～ 2020年7月27日	2020年7月28日～ 2020年8月24日	2020年8月25日～ 2020年9月23日
a. 配当等収益(費用控除後)	16,729,628円	4,123,906円	3,560,922円	4,390,378円	3,718,318円	17,939,452円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円	0円	0円	0円	0円	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	1,018,403,435円	976,530,586円	932,049,870円	925,211,880円	880,881,393円	831,198,034円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	29,526,210円	46,083,833円	49,828,327円	13,306,648円	17,553,254円	20,960,643円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,064,659,273円	1,026,738,325円	985,439,119円	942,908,906円	902,152,965円	870,098,129円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	264円	255円	246円	237円	228円	223円
g. 分配金	40,194,350円	40,120,715円	39,926,431円	39,628,586円	39,414,809円	38,930,186円
h. 分配金(1万口当たり)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

○分配金のお知らせ

	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期	第124期
1万口当たり分配金(税込み)	10円	10円	10円	10円	10円	10円

(注) 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、分配金は全額普通分配金となります。

(注) 分配前の基準価額が個別元本を上回り、分配後の基準価額が個別元本を下回る場合は、分配金は個別元本を上回る部分が普通分配金、下回る部分が元本払戻金(特別分配金)となります。

(注) 分配前の基準価額が個別元本と同額または下回る場合は、分配金は全額元本払戻金(特別分配金)となります。

(注) 元本払戻金(特別分配金)が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金(特別分配金)を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド

運用報告書 第11期 (決算日 2020年9月23日)

(計算期間 2019年9月25日～2020年9月23日)

ここに、法令・諸規則に基づき、当マザーファンド（親投資信託）の直前の計算期間にかかる運用状況をご報告申し上げます。

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。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。また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数		債組入比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
7期(2016年9月23日)	12,012	4.7	181.508	5.5	98.4	240,404
8期(2017年9月25日)	11,981	△0.3	180.167	△0.7	99.5	347,397
9期(2018年9月25日)	11,929	△0.4	179.225	△0.5	99.8	423,906
10期(2019年9月24日)	12,407	4.0	186.800	4.2	99.3	650,697
11期(2020年9月23日)	12,230	△1.4	183.157	△2.0	99.0	709,731

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数		債組入比率	券率
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2019年9月24日	12,407	—	186.800	—	99.3	99.3
9月末	12,377	△0.2	186.484	△0.2	99.3	99.3
10月末	12,343	△0.5	185.451	△0.7	98.6	98.6
11月末	12,316	△0.7	184.713	△1.1	97.8	97.8
12月末	12,293	△0.9	183.987	△1.5	97.0	97.0
2020年1月末	12,345	△0.5	184.822	△1.1	96.9	96.9
2月末	12,424	0.1	186.307	△0.3	96.7	96.7
3月末	12,173	△1.9	182.909	△2.1	91.3	91.3
4月末	12,221	△1.5	183.925	△1.5	96.1	96.1
5月末	12,189	△1.8	183.228	△1.9	96.9	96.9
6月末	12,169	△1.9	182.712	△2.2	97.0	97.0
7月末	12,216	△1.5	183.141	△2.0	97.9	97.9
8月末	12,173	△1.9	182.419	△2.3	99.0	99.0
(期末) 2020年9月23日	12,230	△1.4	183.157	△2.0	99.0	99.0

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数はNOMURA-BPI/Ladder20年です。
NOMURA-BPI/Ladderとは、野村證券が公表する、日本の国債でラダー型運用を行った場合のパフォーマンスを表すインデックスです。

○運用経過

(2019年9月25日～2020年9月23日)

■期中の基準価額等の推移

期首：12,407円
 期末：12,230円
 騰落率：△1.4%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・日銀によるCP（コマーシャル・ペーパー）・社債買入れオペの拡充などにより、2020年3月下旬以降社債利回りが低下（債券価格の上昇）に転じたこと
- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・米中貿易摩擦や英国のEU（欧州連合）離脱の期限延長に関する合意などを背景に、国内長期金利（10年国債利回り）が上昇したこと
- ・新型コロナウイルス感染拡大に伴う企業業績の悪化懸念から、社債利回りが上昇する局面があったこと

■投資環境

【国債市場の概況】

期初-0.23%程度であった国内長期金利は、米中貿易摩擦や英国のEU離脱問題に好転の兆しが見え始めるなか、日銀による追加金融緩和観測が低下したことから上昇基調で推移し、2019年12月中旬には0%を上回る水準まで上昇しました。その後、新型コロナウイルスの感染拡大を背景とした市場流動性の低下により、国内長期金利は2020年3月中旬にかけて大きく上下する展開となりました。3月下旬以降は、主要各国が大規模な財政・金融政策を相次いで発動したことを受けて、市場のボラティリティ（変動性）が低下し、国内長期金利は-0.05%から+0.05%程度の狭いレンジで推移しました。7月以降は、第二次補正予算の編成を受けて、国債増発による需給の悪化が懸念されましたが、日銀の積極的な買入れを背景に金利上昇圧力は限定的なものにとどまり、国内長期金利は0.02%程度の水準で期を終えました。

【社債市場の概況】

期初から2019年12月にかけては、社債利回りはおおむね横ばいで推移しました。しかし、2020年1月から3月頃までは新型コロナウイルスの感染拡大を受けた企業業績の悪化懸念から、社債利回りは上昇しました。4月下旬以降、相対的に高い利回りを求めて国内社債市場に資金が流入したことや、日銀がCP・社債買入れオペの拡充を決定したことなどから、国内社債市場は落ち着きを取り戻しましたが、社債利回りは前期末対比上昇して期を終えました。

個別銘柄では、日産自動車様が2020年3月期に巨額の赤字を計上し、日産自動車および同社の金融子会社である日産フィナンシャルサービスの社債価格が下落しました。また、新型コロナウイルス感染拡大により、長期的な旅客需要の低迷が懸念された日本航空およびANAホールディングスの社債価格も下落しました。

基準価額と参考指数の推移



(注) 参考指数は、期首（2019年9月24日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、NOMURA-BPI/Ladder 20年です。

■ポートフォリオについて

わが国の法人が発行する円建ての社債を中心に投資し、投資する債券の残存年限を幅広く分散させることにより、年限別の金利変動リスクを出来る限り平均化させ、インカムゲイン（利息等収益）を中心に安定した収益の確保と信託財産の中長期的な成長を図ることを目標として運用を行いました。当期の運用経過は以下の通りです。

当期は、ポートフォリオの利回り向上を意識して、社債（金融機関劣後債、生保基金債などを含む）を中心とした組み入れを維持しました。組み入れにあたっては、個別企業の信用リスクが変動した際の影響を可能な限り回避するよう業種分散を図るとともに、信用力の程度に応じた残存年限を選択しました。

また、流動性確保の観点から、国債や政府保証債、地方債などにも投資しました。当期末のポートフォリオの平均残存期間は10年程度、平均格付は「AA-」（格付が取得できない債券を除く）を維持しました。以上の運用の結果、基準価額は1.4%下落しました。

なお、前述の日産フィナンシャルサービス債、日本航空債、ANAホールディングス債は当ファンドで保有していますが、ファンド全体に占める保有割合は各々0.1%未満、0.4%程度、0.1%程度と僅かであり、収益に与える影響は軽微でした。今後もその動向を注視しますが、現時点で発行体の債務の返済能力に特段の懸念はないと考えています。

○今後の運用方針

国債市場は、2020年7月以降、第二次補正予算の編成を受けた国債増発による需給の悪化が懸念されましたが、需給が極端に悪化しないよう日銀が積極的な買入れを続けていることや、新型コロナウイルス感染再拡大のリスクも考慮すると、国内長期金利は引き続き低水準で推移すると考えます。

国内社債市場については、低金利による運用難が続くなか、金融市場のボラティリティが低下している環境下、相対的に高い利回りを求めて国内社債市場に資金が流入する構図は続くと考えます。ただし、新型コロナウイルス感染再拡大への警戒が熾り続けるなか、未だ多くの企業の業績低迷が懸念されるため、投資家のリスク選好度は新型コロナウイルス感染拡大前の水準には戻らないと考えます。

以上のような環境下、今後も流動性の確保に留意しながら、相対的に信用力が高いと判断する銘柄でポートフォリオを構築し、安定運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2019年9月25日～2020年9月23日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2019年9月25日～2020年9月23日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	22,066,515	9,332,196
	地方債証券	37,326,285	22,021,183 (1,008,936)
内	特殊債券	15,425,260	9,066,813 (600,000)
	社債券（投資法人債券を含む）	120,326,321	54,906,384 (26,600,000)

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子分は含まれていません)

(注) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれていません。

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

その他有価証券

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	コマーシャル・ペーパー	82,993,757	— (78,000,000)

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は償還による減少分です。

○利害関係人との取引状況等

(2019年9月25日～2020年9月23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。

○組入資産の明細

(2020年9月23日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区分	当 期 末							
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率			
					5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	
国債証券	38,200,000	45,011,235	6.3	—	6.3	—	—	
地方債証券	172,851,863	185,593,341	26.1	—	26.1	0.1	—	
	(172,851,863)	(185,593,341)	(26.1)	(—)	(26.1)	(0.1)	(—)	
特殊債券 (除く金融債)	34,900,000	38,466,876	5.4	—	5.4	—	—	
	(34,900,000)	(38,466,876)	(5.4)	(—)	(5.4)	(—)	(—)	
金融債券	100,000	100,084	0.0	—	—	0.0	—	
	(100,000)	(100,084)	(0.0)	(—)	(—)	(0.0)	(—)	
普通社債券 (含む投資法人債券)	426,307,000	433,399,580	61.1	—	38.7	15.4	7.0	
	(426,307,000)	(433,399,580)	(61.1)	(—)	(38.7)	(15.4)	(7.0)	
合 計	672,358,863	702,571,116	99.0	—	76.5	15.5	7.0	
	(634,158,863)	(657,559,881)	(92.6)	(—)	(70.2)	(15.5)	(7.0)	

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

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

(B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第357回利付国債 (10年)	0.1	300,000	303,330	2029/12/20	第157回利付国債 (20年)	0.2	700,000	692,601	2036/6/20
第8回利付国債 (30年)	1.8	500,000	601,045	2032/11/22	第158回利付国債 (20年)	0.5	700,000	724,122	2036/9/20
第9回利付国債 (30年)	1.4	500,000	577,190	2032/12/20	第159回利付国債 (20年)	0.6	700,000	734,216	2036/12/20
第10回利付国債 (30年)	1.1	500,000	559,580	2033/3/20	第160回利付国債 (20年)	0.7	700,000	745,150	2037/3/20
第11回利付国債 (30年)	1.7	500,000	597,980	2033/6/20	第161回利付国債 (20年)	0.6	700,000	733,467	2037/6/20
第12回利付国債 (30年)	2.1	500,000	625,015	2033/9/20	第162回利付国債 (20年)	0.6	700,000	732,760	2037/9/20
第13回利付国債 (30年)	2.0	500,000	620,070	2033/12/20	第163回利付国債 (20年)	0.6	700,000	732,613	2037/12/20
第14回利付国債 (30年)	2.4	500,000	648,265	2034/3/20	第164回利付国債 (20年)	0.5	700,000	720,265	2038/3/20
第15回利付国債 (30年)	2.5	500,000	656,820	2034/6/20	第165回利付国債 (20年)	0.5	700,000	719,334	2038/6/20
第16回利付国債 (30年)	2.5	500,000	658,735	2034/9/20	第166回利付国債 (20年)	0.7	700,000	742,714	2038/9/20
第17回利付国債 (30年)	2.4	500,000	653,640	2034/12/20	第167回利付国債 (20年)	0.5	700,000	717,381	2038/12/20
第18回利付国債 (30年)	2.3	500,000	648,265	2035/3/20	第168回利付国債 (20年)	0.4	700,000	704,242	2039/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	500,000	649,840	2035/6/20	第169回利付国債 (20年)	0.3	700,000	691,411	2039/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	500,000	666,385	2035/9/20	第170回利付国債 (20年)	0.3	700,000	690,690	2039/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	500,000	653,335	2035/12/20	第171回利付国債 (20年)	0.3	700,000	689,955	2039/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	500,000	670,210	2036/3/20	第172回利付国債 (20年)	0.4	700,000	701,897	2040/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	500,000	671,865	2036/6/20	小 計		38,200,000	45,011,235	
第24回利付国債 (30年)	2.5	500,000	673,480	2036/9/20	地方債証券				
第25回利付国債 (30年)	2.3	500,000	659,435	2036/12/20	第1回東京都公募公債 (30年)	2.21	400,000	498,340	2033/6/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	500,000	669,135	2037/3/20	第6回東京都公募公債 (30年)	2.58	100,000	135,742	2037/9/18
第27回利付国債 (30年)	2.5	500,000	680,565	2037/9/20	第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	100,000	135,957	2038/9/17
第28回利付国債 (30年)	2.5	500,000	684,450	2038/3/20	第22回東京都公募公債 (20年)	1.92	200,000	235,102	2030/6/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	500,000	678,630	2038/9/20	第23回東京都公募公債 (20年)	2.12	100,000	119,997	2030/12/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	500,000	672,780	2039/3/20	第24回東京都公募公債 (20年)	1.98	100,000	119,213	2031/6/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	500,000	667,670	2039/9/20	第25回東京都公募公債 (20年)	1.8	200,000	235,826	2031/12/19
第32回利付国債 (30年)	2.3	500,000	679,705	2040/3/20	第26回東京都公募公債 (20年)	1.74	600,000	706,338	2032/6/18
第33回利付国債 (30年)	2.0	500,000	654,125	2040/9/20	第27回東京都公募公債 (20年)	1.68	300,000	352,623	2032/12/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	500,000	676,160	2041/3/20	第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	116,642	2033/3/18
第35回利付国債 (30年)	2.0	500,000	658,730	2041/9/20	第30回東京都公募公債 (20年)	1.508	400,000	465,632	2034/6/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	500,000	660,890	2042/3/20	第31回東京都公募公債 (20年)	1.238	400,000	451,324	2034/9/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	500,000	652,900	2042/9/20	第32回東京都公募公債 (20年)	1.293	600,000	682,710	2035/6/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	500,000	644,405	2043/3/20	第33回東京都公募公債 (20年)	0.18	700,000	680,260	2036/6/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	500,000	656,310	2043/6/20	第34回東京都公募公債 (20年)	0.668	500,000	522,660	2037/6/19
第137回利付国債 (20年)	1.7	500,000	593,150	2032/6/20	第35回東京都公募公債 (20年)	0.525	700,000	712,145	2038/6/18
第138回利付国債 (20年)	1.5	500,000	581,540	2032/6/20	第37回東京都公募公債 (20年)	0.444	800,000	799,128	2040/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	500,000	587,345	2032/6/20	平成25年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.635	400,000	469,920	2033/12/27
第140回利付国債 (20年)	1.7	500,000	594,420	2032/9/20	平成26年度第4回北海道公募公債 (20年)	1.569	200,000	233,858	2034/6/27
第141回利付国債 (20年)	1.7	500,000	595,640	2032/12/20	平成26年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.303	200,000	227,106	2034/12/26
第142回利付国債 (20年)	1.8	500,000	601,675	2032/12/20	平成27年度第4回北海道公募公債 (20年)	1.357	600,000	687,276	2035/6/29
第143回利付国債 (20年)	1.6	500,000	590,660	2033/3/20	平成27年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.156	200,000	223,496	2035/12/25
第144回利付国債 (20年)	1.5	500,000	584,510	2033/3/20	平成28年度第3回北海道公募公債 (20年)	0.363	700,000	697,221	2036/6/30
第145回利付国債 (20年)	1.7	500,000	597,980	2033/6/20	平成29年度第11回北海道公募公債 (20年)	0.635	200,000	206,920	2037/12/25
第146回利付国債 (20年)	1.7	500,000	599,120	2033/9/20	平成30年度第4回北海道公募公債 (20年)	0.569	600,000	612,756	2038/6/25
第147回利付国債 (20年)	1.6	500,000	593,720	2033/12/20	平成30年度第5回北海道公募公債 (20年)	0.391	664,160	675,769	2038/6/25
第148回利付国債 (20年)	1.5	500,000	588,050	2034/3/20	平成30年度第9回北海道公募公債 (20年)	0.654	500,000	517,835	2038/9/24
第149回利付国債 (20年)	1.5	500,000	588,870	2034/6/20	平成30年度第10回北海道公募公債 (20年)	0.426	474,400	484,722	2038/9/24
第150回利付国債 (20年)	1.4	500,000	582,835	2034/9/20	平成30年度第15回北海道公募公債 (20年)	0.291	664,160	670,741	2038/9/24
第151回利付国債 (20年)	1.2	600,000	683,532	2034/12/20	令和元年度第4回北海道公募公債 (20年)	0.323	700,000	682,262	2039/6/24
第152回利付国債 (20年)	1.2	600,000	683,976	2035/3/20	令和元年度第5回北海道公募公債 (20年)	0.2	700,000	700,780	2039/6/24
第153回利付国債 (20年)	1.3	600,000	692,988	2035/6/20	令和元年度第9回北海道公募公債 (20年)	0.2	200,000	190,748	2039/9/22
第154回利付国債 (20年)	1.2	600,000	684,822	2035/9/20	第4回1回宮城県公募公債 (20年)	0.434	360,000	368,314	2038/8/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	600,000	667,524	2035/12/20	第4回2回宮城県公募公債 (20年)	0.244	462,500	464,932	2039/2/18
第156回利付国債 (20年)	0.4	700,000	715,120	2036/3/20	第5回1回宮城県公募公債 (20年)	0.17	475,000	473,684	2039/8/19

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
第5回2号宮城県公募債(20年)	0.188	390,000	390,273	2039/12/20	第19回兵庫県公募債(20年)	1.57	100,000	116,737	2033/12/9
第5回3号宮城県公募債(20年)	0.158	390,000	388,999	2040/2/20	第20回兵庫県公募債(20年)	1.53	200,000	232,742	2034/3/10
第15回神奈川県公募債(20年)	1.94	100,000	118,052	2030/11/12	第21回兵庫県公募債(20年)	1.54	300,000	349,857	2034/5/9
第17回神奈川県公募債(20年)	1.975	200,000	238,522	2031/7/11	第22回兵庫県公募債(20年)	1.4	500,000	574,495	2034/9/8
第19回神奈川県公募債(20年)	1.818	300,000	354,678	2032/1/30	第24回兵庫県公募債(20年)	1.23	200,000	225,388	2035/3/23
第20回神奈川県公募債(20年)	1.706	500,000	586,670	2032/6/18	第26回兵庫県公募債(20年)	0.665	300,000	313,623	2036/3/7
第21回神奈川県公募債(20年)	1.732	200,000	235,866	2032/9/17	第28回兵庫県公募債(20年)	0.273	700,000	688,912	2036/6/20
第22回神奈川県公募債(20年)	1.802	200,000	237,992	2032/12/20	第30回兵庫県公募債(20年)	0.607	300,000	310,419	2036/12/19
第23回神奈川県公募債(20年)	1.804	100,000	119,485	2033/6/20	第32回兵庫県公募債(20年)	0.621	400,000	414,412	2037/5/1
第25回神奈川県公募債(20年)	1.578	400,000	468,104	2033/12/20	第35回兵庫県公募債(20年)	0.578	600,000	615,102	2038/5/28
第26回神奈川県公募債(20年)	1.477	600,000	695,982	2034/6/20	第37回兵庫県公募債(20年)	0.472	500,000	501,865	2039/2/18
第27回神奈川県公募債(20年)	1.398	600,000	690,360	2034/9/20	第38回兵庫県公募債(20年)	0.352	300,000	294,408	2039/6/20
第28回神奈川県公募債(20年)	0.941	300,000	326,253	2034/12/20	第10回静岡県公募債(20年)	0.355	378,960	384,568	2038/6/18
第29回神奈川県公募債(20年)	1.289	600,000	682,368	2035/6/20	第12回静岡県公募債(20年)	0.257	584,220	588,406	2039/3/18
第30回神奈川県公募債(20年)	1.161	100,000	112,026	2035/9/20	第2回静岡県公募債(30年)	2.54	300,000	409,386	2038/9/18
第31回神奈川県公募債(20年)	1.002	200,000	219,496	2035/12/20	第10回静岡県公募債(20年)	2.072	300,000	356,958	2030/6/14
第32回神奈川県公募債(20年)	0.18	200,000	194,360	2036/6/20	第11回静岡県公募債(20年)	1.841	350,000	409,514	2030/10/18
第33回神奈川県公募債(20年)	0.64	500,000	521,085	2036/12/19	第12回静岡県公募債(20年)	2.003	230,000	274,748	2031/6/18
第34回神奈川県公募債(20年)	0.654	100,000	104,312	2037/6/19	第14回静岡県公募債(20年)	1.736	500,000	588,390	2032/6/10
第36回神奈川県公募債(20年)	0.625	100,000	103,629	2037/12/18	第15回静岡県公募債(20年)	1.701	450,000	529,240	2032/10/15
第37回神奈川県公募債(20年)	0.53	200,000	203,634	2038/6/18	第18回静岡県公募債(20年)	1.473	600,000	695,568	2034/7/10
第40回神奈川県公募債(20年)	0.2	800,000	764,768	2039/6/20	第19回静岡県公募債(20年)	1.253	300,000	339,906	2035/7/27
第42回神奈川県公募債(20年)	0.34	500,000	491,235	2039/9/20	第22回静岡県公募債(20年)	0.443	200,000	202,516	2036/9/19
第5回大阪府公募債(20年)	2.16	350,000	419,093	2030/5/28	第23回静岡県公募債(20年)	0.626	100,000	103,871	2037/6/19
第6回大阪府公募債(20年)	1.98	200,000	236,768	2030/9/13	第24回静岡県公募債(20年)	0.63	200,000	207,648	2037/9/18
第7回大阪府公募債(20年)	1.84	620,000	731,476	2031/9/26	第25回静岡県公募債(20年)	0.53	600,000	610,902	2038/6/18
第8回大阪府公募債(20年)	1.83	600,000	708,762	2031/12/22	第26回静岡県公募債(20年)	0.711	600,000	628,674	2038/9/17
第9回大阪府公募債(20年)	1.83	100,000	118,336	2032/3/12	第28回静岡県公募債(20年)	0.31	700,000	684,407	2039/9/20
第10回大阪府公募債(20年)	1.72	530,000	623,714	2032/9/24	平成22年度第4回愛知県公募債(20年)	2.072	100,000	118,986	2030/6/14
第11回大阪府公募債(20年)	1.693	500,000	590,940	2033/9/27	平成22年度第14回愛知県公募債(20年)	2.087	350,000	418,694	2030/12/13
第12回大阪府公募債(20年)	1.453	540,000	624,574	2034/9/26	平成23年度第5回愛知県公募債(20年)	1.988	100,000	119,297	2031/6/20
第13回大阪府公募債(20年)	1.203	700,000	787,381	2035/9/28	平成23年度第16回愛知県公募債(20年)	1.8	100,000	118,009	2032/1/26
第14回大阪府公募債(20年)	0.54	300,000	307,695	2036/9/29	平成24年度第4回愛知県公募債(20年)	1.687	200,000	234,176	2032/6/11
第15回大阪府公募債(20年)	0.721	600,000	631,302	2037/3/30	平成24年度第17回愛知県公募債(20年)	1.829	400,000	477,828	2033/2/8
第17回大阪府公募債(20年)	0.668	700,000	727,811	2038/9/27	平成25年度第3回愛知県公募債(20年)	1.509	200,000	231,414	2033/5/13
平成22年度第3回京都府公募債	2.0	600,000	712,218	2030/11/22	平成25年度第11回愛知県公募債(20年)	1.77	100,000	119,253	2033/9/13
平成23年度第5回京都府公募債(20年)	1.79	400,000	470,380	2031/10/17	平成26年度第4回愛知県公募債(20年)	1.542	100,000	116,818	2034/5/15
平成24年度第3回京都府公募債(20年)	1.63	600,000	700,050	2032/8/13	平成26年度第13回愛知県公募債(20年)	1.363	600,000	687,456	2034/11/14
平成26年度第5回京都府公募債(20年)	1.455	600,000	694,692	2034/8/10	平成27年度第3回愛知県公募債(20年)	1.115	700,000	778,890	2035/5/8
平成27年度第2回京都府公募債(15年)	0.729	600,000	636,174	2030/4/26	平成27年度第14回愛知県公募債(20年)	1.129	200,000	223,216	2035/11/19
平成27年度第8回京都府公募債(15年)	0.78	600,000	638,376	2030/10/11	平成28年度第2回愛知県公募債(20年)	0.387	100,000	100,403	2036/5/12
平成28年度第2回京都府公募債(15年)	0.21	200,000	200,982	2031/4/22	平成28年度第12回愛知県公募債(20年)	0.429	300,000	302,784	2036/11/18
平成28年度第5回京都府公募債(20年)	0.327	600,000	596,154	2036/8/15	平成29年度第12回愛知県公募債(20年)	0.606	400,000	413,564	2037/11/20
平成29年度第2回京都府公募債(15年)	0.391	500,000	510,845	2032/4/23	平成30年度第2回愛知県公募債(20年)	0.54	100,000	102,135	2038/4/30
平成29年度第5回京都府公募債(20年)	0.63	100,000	103,804	2037/8/14	平成30年度第12回愛知県公募債(20年)	0.706	300,000	314,304	2038/11/15
平成30年度第5回京都府公募債(20年)	0.658	600,000	624,804	2038/8/13	平成30年度第14回愛知県公募債(20年)	0.291	555,000	560,813	2038/12/14
平成30年度第8回京都府公募債(20年)	0.435	462,500	473,384	2038/10/15	令和元年度第5回愛知県公募債(20年)	0.288	400,000	388,428	2039/7/12
令和元年度第5回京都府公募債(20年)	0.2	400,000	381,912	2039/8/19	令和元年度第12回愛知県公募債(20年)	1.56	292,500	291,559	2039/11/18
第1回兵庫県公募債(18年)	1.26	400,000	448,656	2032/8/6	平成20年度第1回広島県公募債(20年)	1.83	100,000	117,982	2031/9/22
第12回兵庫県公募債(15年)	0.781	200,000	212,590	2030/12/6	平成24年度第1回広島県公募債(20年)	1.7	600,000	705,282	2032/9/14
第14回兵庫県公募債(15年)	0.428	200,000	204,864	2032/5/26	平成25年度第1回広島県公募債(20年)	1.75	300,000	357,003	2033/9/19
第6回兵庫県公募債(20年)	0.436	663,180	677,723	2038/9/10	平成26年度第1回広島県公募債(20年)	1.41	600,000	691,194	2034/9/12
第13回兵庫県公募債(20年)	1.83	500,000	591,765	2032/3/16	平成27年度第1回広島県公募債(20年)	1.212	500,000	563,830	2035/9/25
第15回兵庫県公募債(20年)	1.64	600,000	699,054	2032/7/23	平成28年度第1回広島県公募債(20年)	0.414	200,000	201,630	2036/9/26
第16回兵庫県公募債(20年)	1.7	100,000	117,523	2032/11/19	平成29年度第2回広島県公募債(20年)	0.597	700,000	722,540	2037/9/25

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
平成30年度第1回広島県公募債(20年)	0.568	700,000	717,619	2038/5/17	第27回千葉県公募債(20年)	0.251	800,000	772,728	2039/10/14
平成30年度第2回広島県公募債(20年)	0.668	600,000	624,366	2038/9/17	平成29年度第1回新潟県公募債	0.616	700,000	725,074	2037/8/14
平成31年度第1回広島県公募債(20年)	0.419	700,000	696,871	2039/4/19	平成30年度第1回新潟県公募債	0.653	700,000	728,378	2038/8/20
令和元年度第2回広島県公募債(20年)	0.2	400,000	382,836	2039/9/20	令和元年度第1回新潟県公募債	0.2	800,000	763,824	2039/8/19
令和2年度第1回広島県公募債(20年)	0.315	800,000	779,872	2040/4/17	令和2年度第1回新潟県公募債	0.435	800,000	797,800	2040/8/17
第2回埼玉県公募債(15年)	0.869	100,000	107,359	2030/5/22	平成30年度第2回茨城県公募債	0.386	500,000	508,980	2038/7/30
第3回埼玉県公募債(15年)	0.43	500,000	513,380	2032/1/30	令和元年度第2回茨城県公募債	0.19	500,000	498,035	2039/7/29
平成22年度第10回埼玉県公募債(20年)	1.94	500,000	590,260	2030/11/12	令和2年度第2回茨城県公募債	0.356	300,000	303,423	2040/7/31
第11回埼玉県公募債(20年)	2.0	200,000	238,848	2031/6/20	第2回群馬県公募債(20年)	0.2	380,000	380,178	2039/6/17
第12回埼玉県公募債(20年)	1.73	100,000	117,575	2032/5/24	第1回群馬県公募債(20年)	1.841	250,000	292,510	2030/10/18
第13回埼玉県公募債(20年)	1.599	600,000	701,022	2033/5/20	第2回群馬県公募債(20年)	2.019	100,000	119,699	2031/7/18
第14回埼玉県公募債(20年)	1.546	600,000	701,088	2034/5/8	第3回群馬県公募債(20年)	1.687	600,000	702,858	2032/6/25
第15回埼玉県公募債(20年)	1.166	400,000	447,832	2035/2/16	第4回群馬県公募債(20年)	1.667	100,000	117,779	2033/6/17
第16回埼玉県公募債(20年)	1.216	200,000	225,632	2035/8/14	第5回群馬県公募債(20年)	1.529	600,000	700,038	2034/6/16
第18回埼玉県公募債(20年)	0.323	500,000	496,910	2036/5/20	第6回群馬県公募債(20年)	1.267	600,000	680,382	2035/6/11
第20回埼玉県公募債(20年)	0.626	300,000	311,553	2037/5/15	第7回群馬県公募債(20年)	0.313	700,000	694,617	2036/7/13
第21回埼玉県公募債(20年)	0.625	500,000	518,540	2037/12/11	第9回群馬県公募債(20年)	0.554	400,000	409,180	2038/6/11
第22回埼玉県公募債(20年)	0.568	600,000	615,108	2038/5/21	第10回群馬県公募債(20年)	0.338	500,000	490,325	2039/6/17
第23回埼玉県公募債(20年)	0.626	300,000	309,948	2038/12/17	第11回群馬県公募債(20年)	0.416	400,000	397,176	2040/6/12
第24回埼玉県公募債(20年)	0.431	100,000	99,758	2039/5/17	平成30年度第1回大分県公募債	0.38	300,000	305,247	2038/7/16
第25回埼玉県公募債(20年)	0.32	450,000	440,028	2039/12/20	令和元年度第1回大分県公募債	0.19	600,000	598,176	2039/7/15
平成27年度第1回福岡県公募債(15年)	0.784	500,000	532,060	2030/11/25	令和2年度第1回大分県公募債	0.281	600,000	604,674	2040/7/10
平成29年度第1回福岡県公募債(15年)	0.419	400,000	409,460	2032/11/22	平成23年度第1回堺市公募債(20年)	1.8	500,000	587,995	2031/11/21
平成30年度第2回福岡県公募債(15年)	0.542	600,000	621,456	2033/10/17	平成24年度第1回堺市公募債	1.732	600,000	706,830	2032/11/12
令和元年度第1回福岡県公募債(15年)	0.254	600,000	597,246	2034/6/14	平成30年度第2回堺市公募債	0.386	647,500	659,889	2038/11/15
令和元年度第2回福岡県公募債(15年)	0.269	400,000	397,780	2034/12/13	令和元年度第2回堺市公募債	0.21	585,000	586,137	2039/11/18
平成22年度第2回福岡県公募債(20年)	2.116	100,000	120,221	2031/2/21	平成30年度第2回長崎県公募債	0.491	500,000	513,995	2038/8/20
平成23年度第2回福岡県公募債(20年)	1.806	100,000	117,633	2031/8/18	令和元年度第2回長崎県公募債	0.18	400,000	397,928	2039/8/26
平成24年度第1回福岡県公募債(20年)	1.734	100,000	117,609	2032/5/21	平成28年度第2回島根県公募債(20年)	0.506	100,000	102,205	2036/9/30
平成24年度第2回福岡県公募債(20年)	1.635	600,000	700,062	2032/8/16	平成29年度第2回島根県公募債	0.583	700,000	720,951	2037/9/18
平成25年度第1回福岡県公募債(20年)	1.599	300,000	350,511	2033/5/20	平成30年度第2回島根県公募債	0.668	700,000	728,427	2038/9/17
平成25年度第2回福岡県公募債(20年)	1.787	100,000	119,414	2033/8/12	令和元年度第2回島根県公募債	0.2	400,000	382,836	2039/9/20
平成26年度第1回福岡県公募債(20年)	1.542	250,000	291,942	2034/5/26	令和2年度第2回島根県公募債	0.459	800,000	802,056	2040/9/21
平成26年度第2回福岡県公募債(20年)	1.451	300,000	347,337	2034/9/22	平成30年度第1回栃木県公募債	0.421	555,000	567,368	2038/10/22
平成26年度第4回福岡県公募債(20年)	1.249	200,000	226,242	2035/2/23	令和元年度第1回栃木県公募債	0.14	487,500	484,579	2039/10/24
平成27年度第1回福岡県公募債(20年)	1.285	500,000	568,405	2035/5/22	平成30年度第1回奈良県公募債	0.396	270,000	274,978	2038/9/17
平成28年度第1回福岡県公募債(20年)	0.308	500,000	495,800	2036/5/23	令和元年度第1回奈良県公募債	0.15	285,000	283,972	2039/9/20
平成28年度第4回福岡県公募債(20年)	0.744	600,000	634,680	2037/2/13	第11回大阪市公募債(20年)	2.25	100,000	120,417	2030/3/26
平成29年度第1回福岡県公募債(20年)	0.626	100,000	103,859	2037/5/29	第13回大阪市公募債(20年)	2.08	550,000	654,846	2030/6/14
令和元年度第1回福岡県公募債(20年)	0.359	600,000	591,402	2039/11/25	第14回大阪市公募債(20年)	1.97	300,000	355,038	2030/10/30
第9回千葉県公募債(20年)	0.416	462,500	472,594	2038/10/15	第15回大阪市公募債(20年)	2.12	250,000	300,095	2031/1/24
第9回千葉県公募債(20年)	1.84	400,000	467,844	2030/10/11	第17回大阪市公募債(20年)	1.721	200,000	236,068	2032/12/21
第10回千葉県公募債(20年)	1.8	300,000	352,707	2031/8/18	第18回大阪市公募債(20年)	1.262	700,000	793,177	2035/2/27
第11回千葉県公募債(20年)	1.87	100,000	118,653	2031/12/12	第19回大阪市公募債(20年)	1.138	600,000	669,378	2035/4/24
第12回千葉県公募債(20年)	1.839	400,000	474,888	2032/4/16	第20回大阪市公募債(20年)	1.184	200,000	224,790	2035/8/31
第13回千葉県公募債(20年)	1.701	550,000	646,849	2032/10/15	第21回大阪市公募債(20年)	0.97	300,000	327,804	2036/1/29
第14回千葉県公募債(20年)	1.137	700,000	777,518	2033/4/15	第22回大阪市公募債(20年)	0.347	700,000	698,159	2036/5/30
第15回千葉県公募債(20年)	1.604	100,000	117,200	2033/10/14	第24回大阪市公募債(20年)	0.655	200,000	208,740	2037/4/21
第16回千葉県公募債(20年)	1.555	600,000	701,322	2034/4/14	第26回大阪市公募債(20年)	0.635	500,000	519,205	2037/10/23
第17回千葉県公募債(20年)	1.403	600,000	690,672	2034/10/13	第27回大阪市公募債(20年)	0.544	200,000	204,396	2038/4/20
第18回千葉県公募債(20年)	1.138	600,000	669,240	2035/4/13	第28回大阪市公募債(20年)	0.381	450,000	457,911	2038/5/28
第19回千葉県公募債(20年)	1.166	100,000	112,150	2035/10/15	第29回大阪市公募債(20年)	0.218	665,000	666,496	2039/5/27
第23回千葉県公募債(20年)	0.63	300,000	311,271	2037/10/15	第1回名古屋市公募債(20年)	0.17	292,308	291,501	2039/8/19
第24回千葉県公募債(20年)	0.559	200,000	204,884	2038/4/15	第2回名古屋市公募債(20年)	0.156	292,500	291,559	2039/11/18
第25回千葉県公募債(20年)	0.701	700,000	732,851	2038/10/15	第1回名古屋市公募債(30年)	2.53	500,000	656,165	2035/3/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
第3回名古屋市公募債(30年)	2.5	100,000	134,460	2037/9/18	平成24年度第11回札幌市公募債(20年)	1.794	100,000	119,117	2033/2/28
第6回名古屋市公募債(30年)	2.45	100,000	136,992	2039/12/20	平成25年度第1回札幌市公募債(20年)	1.72	200,000	236,844	2033/6/14
第14回名古屋市公募債(20年)	1.648	500,000	584,360	2032/8/10	平成25年度第10回札幌市公募債(20年)	1.53	300,000	349,635	2034/3/17
第15回名古屋市公募債(20年)	1.712	300,000	355,524	2033/9/9	平成26年度第1回札幌市公募債(20年)	1.524	500,000	582,700	2034/5/26
第16回名古屋市公募債(20年)	1.52	200,000	233,062	2034/6/9	平成26年度第10回札幌市公募債(20年)	1.267	400,000	453,740	2035/3/30
第17回名古屋市公募債(20年)	1.203	500,000	562,725	2035/5/28	平成27年度第3回札幌市公募債(20年)	1.211	200,000	225,272	2035/7/31
第18回名古屋市公募債(20年)	1.139	700,000	782,285	2035/11/20	平成29年度第5回札幌市公募債(20年)	0.597	600,000	619,296	2037/9/18
第19回名古屋市公募債(20年)	0.323	300,000	298,371	2036/4/28	平成30年度第1回札幌市公募債(20年)	0.366	360,000	365,850	2038/5/21
第20回名古屋市公募債(20年)	0.645	600,000	624,924	2037/5/25	平成30年度第8回札幌市公募債(20年)	0.266	700,000	723,205	2038/12/20
第21回名古屋市公募債(20年)	0.568	700,000	717,619	2038/5/18	令和元年度第4回札幌市公募債(20年)	0.15	300,000	298,746	2039/9/20
第22回名古屋市公募債(20年)	0.431	700,000	698,306	2039/5/20	第11回川崎市公募債(20年)	1.84	150,000	175,491	2030/10/18
第1回京都市公募債(15年)	0.781	100,000	106,427	2030/12/20	第14回川崎市公募債(20年)	1.79	100,000	118,049	2032/3/19
第2回京都市公募債(20年)	0.331	540,000	546,814	2038/7/16	第15回川崎市公募債(20年)	1.727	300,000	353,622	2032/9/17
第3回京都市公募債(20年)	0.244	647,500	650,905	2039/2/18	第18回川崎市公募債(20年)	1.541	600,000	700,128	2034/3/17
第4回京都市公募債(20年)	0.18	285,000	284,544	2039/7/15	第20回川崎市公募債(20年)	1.133	200,000	222,996	2035/3/20
第9回京都市公募債(20年)	2.148	200,000	240,426	2030/12/17	第21回川崎市公募債(20年)	1.11	200,000	222,594	2035/9/20
第10回京都市公募債(20年)	1.803	200,000	235,778	2031/11/21	第22回川崎市公募債(20年)	0.377	600,000	601,524	2036/4/22
第11回京都市公募債(20年)	1.701	100,000	117,673	2032/11/19	第23回川崎市公募債(20年)	0.549	300,000	308,811	2036/9/19
第13回京都市公募債(20年)	1.359	300,000	343,641	2034/11/24	第24回川崎市公募債(20年)	0.683	100,000	104,803	2037/4/17
第14回京都市公募債(20年)	1.139	400,000	447,036	2035/11/22	第27回川崎市公募債(20年)	0.559	300,000	307,326	2038/4/16
第15回京都市公募債(20年)	0.487	500,000	509,030	2036/11/28	第28回川崎市公募債(20年)	0.422	370,000	378,282	2038/10/29
第16回京都市公募債(20年)	0.611	600,000	620,850	2037/11/27	第29回川崎市公募債(20年)	0.223	570,000	571,895	2039/4/22
第17回京都市公募債(20年)	0.683	700,000	730,632	2038/11/26	第30回川崎市公募債(20年)	0.2	600,000	573,576	2039/6/20
第18回京都市公募債(20年)	0.355	400,000	393,992	2039/11/18	第31回川崎市公募債(20年)	0.14	390,000	387,855	2039/10/21
平成22年度第4回神戸市公募債(20年)	1.895	100,000	117,604	2030/9/13	第6回北九州市公募債(20年)	0.18	680,960	679,366	2039/7/22
平成22年度第9回神戸市公募債(20年)	2.09	350,000	419,342	2031/1/24	第10回北九州市公募債(20年)	2.09	250,000	299,072	2031/1/24
平成23年度第4回神戸市公募債(20年)	1.913	150,000	178,246	2031/9/12	第11回北九州市公募債(20年)	2.019	500,000	597,540	2031/7/18
平成23年度第14回神戸市公募債(20年)	1.794	200,000	236,036	2032/2/13	第13回北九州市公募債(20年)	1.706	400,000	468,700	2032/7/16
平成24年度第3回神戸市公募債(20年)	1.635	500,000	583,665	2032/8/13	第14回北九州市公募債(20年)	1.732	600,000	706,830	2032/11/12
平成24年度第12回神戸市公募債(20年)	1.711	500,000	589,495	2032/12/17	第15回北九州市公募債(20年)	1.667	100,000	117,489	2033/6/17
平成25年度第12回神戸市公募債(20年)	1.52	100,000	116,325	2034/2/17	第16回北九州市公募債(20年)	1.604	100,000	116,894	2033/10/11
平成26年度第3回神戸市公募債(20年)	1.482	300,000	348,180	2034/7/14	第17回北九州市公募債(20年)	1.529	600,000	698,268	2034/6/20
平成27年度第9回神戸市公募債(20年)	1.007	100,000	109,801	2036/1/25	第18回北九州市公募債(20年)	1.376	200,000	228,912	2034/10/20
平成28年度第9回神戸市公募債(20年)	0.645	400,000	416,944	2037/1/23	第19回北九州市公募債(20年)	1.312	600,000	682,860	2035/6/19
平成29年度第5回神戸市公募債(20年)	0.597	200,000	206,432	2037/9/18	第20回北九州市公募債(20年)	1.111	100,000	110,983	2035/10/26
平成30年度第6回神戸市公募債(20年)	0.668	300,000	312,183	2038/9/17	平成23年度第4回福岡市公募債(20年)	1.89	300,000	355,614	2031/8/19
令和元年度第6回神戸市公募債(20年)	0.2	500,000	478,545	2039/9/20	平成24年度第2回福岡市公募債(20年)	1.702	400,000	469,392	2032/7/20
第1回横浜市公募債(30年)	2.63	500,000	659,525	2034/9/20	平成24年度第6回福岡市公募債(20年)	1.696	300,000	352,536	2032/9/17
第2回横浜市公募債(30年)	2.49	500,000	653,385	2035/3/20	平成25年度第1回福岡市公募債(20年)	1.808	100,000	119,579	2033/7/19
第4回横浜市公募債(30年)	2.54	210,000	281,509	2036/12/19	平成25年度第6回福岡市公募債(20年)	1.511	400,000	464,832	2034/2/17
第21回横浜市公募債(20年)	1.969	100,000	118,112	2030/7/19	平成26年度第2回福岡市公募債(20年)	1.49	600,000	697,014	2034/6/19
第22回横浜市公募債(20年)	1.895	100,000	117,546	2030/9/13	平成26年度第6回福岡市公募債(20年)	1.371	200,000	229,240	2034/9/20
第25回横浜市公募債(20年)	1.72	400,000	470,156	2032/7/16	平成27年度第6回福岡市公募債(20年)	1.121	100,000	111,550	2035/12/18
第26回横浜市公募債(20年)	1.776	300,000	356,322	2033/1/28	平成28年度第6回福岡市公募債(20年)	0.429	700,000	706,461	2036/11/25
第27回横浜市公募債(20年)	1.599	300,000	350,511	2033/5/20	平成30年度第7回福岡市公募債(20年)	0.701	700,000	732,844	2038/10/19
第28回横浜市公募債(20年)	1.586	300,000	350,985	2033/11/11	平成30年度第8回福岡市公募債(20年)	0.416	462,500	472,598	2038/10/19
第29回横浜市公募債(20年)	1.528	200,000	233,184	2034/5/26	平成31年度第2回福岡市公募債(20年)	0.225	584,615	586,679	2039/4/22
第30回横浜市公募債(20年)	1.376	400,000	459,060	2034/10/20	平成31年度第3回福岡市公募債(20年)	0.419	600,000	597,318	2039/4/22
第31回横浜市公募債(20年)	1.18	300,000	336,420	2035/4/20	2019年度第5回福岡市公募債(20年)	0.286	300,000	291,198	2039/7/29
第35回横浜市公募債(20年)	0.443	100,000	101,156	2036/10/28	2019年度第7回福岡市公募債(20年)	0.271	500,000	484,695	2039/10/24
第40回横浜市公募債(20年)	0.559	700,000	717,094	2038/4/16	平成29年度第2回広島市公募債(20年)	0.616	200,000	207,168	2037/8/18
第42回横浜市公募債(20年)	0.47	379,000	387,507	2038/12/17	平成29年度第4回広島市公募債(20年)	0.62	600,000	621,696	2037/11/20
平成23年度第3回札幌市公募債(20年)	1.944	600,000	713,724	2031/7/29	平成30年度第2回広島市公募債(20年)	0.639	700,000	726,747	2038/8/20
平成24年度第1回札幌市公募債(20年)	1.79	600,000	708,780	2032/4/23	平成30年度第4回広島市公募債(20年)	0.706	700,000	733,362	2038/11/19
平成24年度第4回札幌市公募債(20年)	1.635	200,000	233,466	2032/8/13	令和元年度第2回広島市公募債(20年)	0.2	800,000	763,824	2039/8/19

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
令和元年度第4回広島市公募債	0.355	400,000	393,988	2039/11/21
令和2年度第2回広島市公募債	0.435	500,000	498,170	2040/8/21
平成29年度第1回仙台市公募債	0.616	700,000	724,745	2037/10/19
平成30年度第1回仙台市公募債	0.426	540,000	551,453	2038/8/20
平成30年度第2回仙台市公募債	0.729	700,000	736,134	2038/10/18
令和元年度第1回仙台市公募債	0.17	380,000	378,943	2039/8/19
令和元年度第2回仙台市公募債	0.15	700,000	693,833	2039/10/14
平成24年度第2回福岡県公募債	1.711	100,000	117,915	2032/12/21
平成25年度第1回福岡県公募債	1.667	100,000	117,794	2033/6/21
平成26年度第1回福岡県公募債	1.482	100,000	116,072	2034/7/18
平成27年度第1回福岡県公募債	1.28	600,000	681,972	2035/7/17
平成28年度第1回福岡県公募債	0.18	700,000	679,623	2036/7/29
平成29年度第1回福岡県公募債	0.659	100,000	104,332	2037/7/24
平成30年度第1回福岡県公募債	0.535	500,000	509,135	2038/7/30
平成30年度第4回福岡県公募債	0.386	462,500	471,352	2038/11/15
令和元年度第1回福岡県公募債	0.286	400,000	388,264	2039/7/29
令和元年度第4回福岡県公募債	0.21	292,500	292,786	2039/11/18
令和2年度第1回福岡県公募債	0.249	600,000	601,086	2040/7/13
令和2年度第3回福岡県公募債	0.449	600,000	599,886	2040/8/3
平成30年度第1回徳島県公募債	0.331	360,000	364,539	2038/7/30
令和元年度第1回徳島県公募債	0.18	380,000	379,361	2039/7/29
令和2年度第1回徳島県公募債	0.281	400,000	403,510	2040/7/31
平成29年度第1回岡山県公募債	0.352	437,500	443,852	2037/12/22
平成30年度第1回岡山県公募債	0.29	647,500	653,152	2038/12/21
令和元年度第1回岡山県公募債	0.192	390,000	390,419	2039/12/20
第5回神奈川県住宅供給公社債券	0.709	600,000	610,416	2038/4/23
第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	400,000	397,820	2029/4/23
第7回神奈川県住宅供給公社債券	0.534	300,000	295,455	2039/4/22
第1回川崎市土地開発公社債券	0.02	700,000	696,738	2024/6/25
第2回営企業債券(30年)	2.39	100,000	127,102	2033/12/20
第3回営企業債券(30年)	2.59	300,000	389,223	2033/12/20
第8回地方公共団体金融機構債券(30年)	2.5	200,000	261,786	2035/9/21
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	119,509	2030/12/27
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.132	100,000	120,016	2031/1/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	117,986	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	100,000	117,929	2031/12/26
第21回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.812	100,000	117,999	2032/4/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	500,000	586,065	2032/9/28
第32回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	100,000	117,058	2033/10/28
第33回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.668	500,000	588,775	2033/12/28
第35回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.569	300,000	349,899	2034/3/28
第37回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.535	200,000	232,656	2034/6/28
第40回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.381	600,000	686,322	2034/10/27
第42回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.999	100,000	109,164	2035/1/26
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.298	300,000	340,182	2035/6/28
第46回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.189	100,000	111,803	2035/9/28
第51回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.377	400,000	398,960	2036/4/28
第67回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.564	200,000	204,088	2038/6/28
第77回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.2	500,000	476,850	2039/9/28
第79回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.345	400,000	391,512	2039/12/28
第80回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.354	500,000	489,710	2040/1/27
第83回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.44	400,000	398,188	2040/6/28
第11回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.763	300,000	311,511	2037/2/27
第10回大阪府住宅供給公社債券	0.395	300,000	302,679	2027/6/18
第12回大阪府住宅供給公社債券	0.34	500,000	502,655	2028/6/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
第134回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.514	500,000	509,055	2032/2/27
第135回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.768	400,000	415,648	2037/2/27
第151回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.32	500,000	478,130	2040/2/28
第121回福岡北九州高速道路債券	2.31	400,000	474,196	2029/12/30
第147回福岡北九州高速道路債券	0.502	500,000	508,435	2032/3/19
第148回福岡北九州高速道路債券	0.731	500,000	516,415	2037/3/19
第150回福岡北九州高速道路債券	0.396	600,000	600,834	2033/3/18
第13回東京都住宅供給公社債券	2.4	400,000	479,348	2030/5/24
第24回東京都住宅供給公社債券	0.519	500,000	495,935	2036/9/12
第26回東京都住宅供給公社債券	0.697	600,000	608,508	2037/9/11
第29回東京都住宅供給公社債券	0.749	200,000	205,008	2038/9/17
第30回東京都住宅供給公社債券	0.496	180,000	183,469	2038/9/17
第32回東京都住宅供給公社債券	0.341	300,000	283,596	2039/9/26
第33回東京都住宅供給公社債券	0.25	292,500	290,660	2039/9/26
第35回東京都住宅供給公社債券	0.251	500,000	498,245	2039/12/24
第36回東京都住宅供給公社債券	0.416	400,000	395,812	2024/10/22
第37回東京都住宅供給公社債券	0.435	200,000	200,712	2035/9/21
小 計		172,851,863	185,593,341	
特殊債券(除く金融債)				
第61回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	139,411	2038/6/30
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	300,000	358,248	2030/4/30
第114回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	300,000	353,358	2030/7/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	117,852	2030/9/30
第121回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	500,000	584,740	2030/10/31
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	500,000	600,980	2030/12/27
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	300,000	357,885	2031/1/31
第130回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	500,000	596,860	2031/2/28
第134回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	241,374	2031/4/30
第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	118,791	2031/6/30
第141回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	300,000	356,622	2031/7/31
第143回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	235,740	2031/8/29
第146回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	235,896	2031/9/30
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	118,086	2031/10/31
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	500,000	591,020	2031/12/26
第160回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	118,495	2032/3/19
第169回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	200,000	233,878	2032/7/30
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	500,000	580,990	2032/8/31
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.641	300,000	351,576	2032/9/30
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.645	200,000	234,558	2032/10/29
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.68	500,000	589,080	2032/11/30
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	400,000	474,164	2033/1/31
第185回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.757	400,000	475,828	2033/2/28
第187回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.662	600,000	707,244	2033/3/18
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	500,000	573,370	2033/4/28
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.779	500,000	598,150	2033/7/29
第199回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.702	600,000	712,770	2033/8/31
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.556	100,000	117,022	2033/10/31
第205回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.532	500,000	584,090	2033/11/30
第206回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.577	600,000	704,502	2033/12/28
第210回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.547	200,000	234,142	2034/1/31
第212回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	500,000	582,770	2034/2/28
第214回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.478	400,000	465,636	2034/3/31
第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.466	500,000	581,335	2034/6/30
第222回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.427	500,000	578,825	2034/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	500,000	577,575	2034/8/31

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.396	500,000	578,010	2034/9/29
第230回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.338	500,000	574,115	2034/10/31
第230回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.315	500,000	572,935	2034/11/30
第235回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.224	500,000	566,650	2034/12/28
第237回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.97	500,000	548,765	2035/1/31
第240回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	500,000	562,235	2035/2/28
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.216	500,000	566,505	2035/3/30
第245回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.079	600,000	668,202	2035/4/27
第246回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	300,000	338,265	2035/5/31
第250回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.278	600,000	685,428	2035/6/29
第252回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	700,000	795,830	2035/7/31
第255回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.22	100,000	113,393	2035/8/31
第257回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.187	100,000	112,980	2035/9/28
第262回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.109	700,000	783,349	2035/11/30
第264回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.113	200,000	223,884	2035/12/28
第272回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.461	700,000	714,602	2036/3/31
第278回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.237	500,000	493,085	2036/5/30
第284回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.149	500,000	485,665	2036/7/31
第290回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.397	500,000	504,190	2036/10/31
第296回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.522	200,000	205,464	2036/11/28
第298回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.547	500,000	515,550	2036/12/26
第301回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.618	600,000	625,356	2037/1/30
第304回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.737	700,000	742,658	2037/2/27
第307回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.681	100,000	105,168	2037/3/31
第314回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.59	600,000	622,206	2037/5/29
第316回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.569	100,000	103,305	2037/6/30
第322回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	600,000	618,666	2037/8/31
第325回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.549	100,000	102,867	2037/9/30
第328回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.585	600,000	620,754	2037/10/30
第331回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.566	700,000	721,595	2037/11/30
第343回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.562	100,000	102,906	2038/3/31
第349回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.538	700,000	717,150	2038/5/31
第352回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.543	100,000	102,458	2038/6/30
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	700,000	726,971	2038/8/31
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	500,000	519,300	2038/9/30
第364回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	700,000	734,615	2038/10/29
第367回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.676	100,000	104,698	2038/11/30
第370回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.6	700,000	723,205	2038/12/28
第372回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.52	700,000	713,377	2039/1/31
第376回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.46	700,000	705,390	2039/2/28
第379回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.419	700,000	699,874	2039/3/31
第21回政府保証民間開都市開発債券	0.618	300,000	310,863	2038/12/27
第22回政府保証民間開都市開発債券	0.245	1,000,000	965,090	2040/2/28
第23回政府保証民間開都市開発債券	0.397	800,000	793,744	2040/6/29
第54回政府保証関西国際空港債券	2.4	500,000	592,695	2028/6/23
小 計		34,900,000	38,466,876	
金融債券				
い第830号商工債	0.11	100,000	100,084	2024/7/26
小 計		100,000	100,084	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第497回中部電力株式会社社債	0.986	700,000	700,546	2020/10/23
第501回中部電力株式会社社債	0.803	200,000	205,690	2024/9/25
第503回中部電力株式会社社債	0.584	200,000	204,290	2025/3/25
第508回中部電力株式会社社債	0.18	200,000	200,668	2023/4/25
第511回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	100,289	2026/7/24

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第513回中部電力株式会社社債	0.14	300,000	300,786	2023/8/25
第518回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,337	2023/1/25
第520回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,359	2023/3/24
第522回中部電力株式会社社債	0.13	200,000	200,332	2022/4/25
第530回中部電力株式会社社債	0.274	600,000	601,230	2029/6/25
第511回関西電力株式会社社債	0.41	600,000	603,690	2027/9/17
第512回関西電力株式会社社債	0.32	400,000	402,764	2024/10/25
第515回関西電力株式会社社債	0.435	600,000	604,218	2028/4/25
第518回関西電力株式会社社債	0.44	300,000	302,151	2028/6/20
第527回関西電力株式会社社債	0.28	500,000	502,765	2024/4/25
第369回中国電力株式会社社債	0.976	800,000	800,616	2020/10/23
第378回中国電力株式会社社債	1.004	300,000	308,679	2023/10/25
第381回中国電力株式会社社債	0.953	100,000	103,121	2024/4/25
第383回中国電力株式会社社債	0.764	400,000	410,812	2024/10/25
第398回中国電力株式会社社債	0.425	400,000	405,652	2027/7/23
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,631	2024/10/25
第404回中国電力株式会社社債	0.355	100,000	100,894	2028/4/25
第311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	208,430	2027/9/24
第314回北陸電力株式会社社債	0.36	100,000	100,994	2026/2/25
第318回北陸電力株式会社社債	0.26	450,000	451,386	2026/12/25
第321回北陸電力株式会社社債	0.365	300,000	302,820	2027/4/23
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	505,155	2027/6/25
第475回東北電力株式会社社債	0.809	500,000	513,935	2024/9/25
第476回東北電力株式会社社債	0.57	100,000	101,964	2025/1/24
第491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	607,794	2027/2/25
第492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	404,668	2027/4/23
第496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	302,583	2027/9/24
第517回東北電力株式会社社債	0.31	100,000	100,007	2030/2/25
第281回四国電力株式会社社債	1.111	500,000	515,840	2039/9/25
第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	100,527	2026/11/25
第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	202,616	2027/11/25
第307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	299,076	2029/9/25
第309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	505,420	2030/5/24
第429回九州電力株式会社社債	0.909	300,000	309,249	2024/9/25
第437回九州電力株式会社社債	0.685	600,000	615,516	2026/1/23
第465回九州電力株式会社社債	0.38	500,000	503,570	2028/7/25
第489回九州電力株式会社社債	0.44	400,000	403,376	2030/5/24
第290回北海道電力株式会社社債	2.09	300,000	303,579	2021/4/23
第298回北海道電力株式会社社債	1.82	500,000	500,035	2020/9/25
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	300,000	301,932	2021/12/24
第321回北海道電力株式会社社債	0.886	111,000	114,479	2024/12/25
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	400,000	412,032	2025/12/25
第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	202,252	2027/6/25
第346回北海道電力株式会社社債	0.31	700,000	705,047	2024/12/25
第355回北海道電力株式会社社債	0.14	100,000	100,088	2021/12/24
第7回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.46	200,000	201,036	2020/10/24
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.81	500,000	504,745	2027/10/22
第10回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.45	100,000	100,512	2023/1/25
第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.44	500,000	502,685	2023/4/19
第30回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	600,000	604,680	2024/10/9
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	600,000	606,324	2029/10/9
第6回新関西国際空港株式会社社債	1.445	300,000	331,146	2028/9/15
第9回新関西国際空港株式会社社債	1.231	300,000	326,787	2028/12/20
第12回新関西国際空港株式会社社債	1.067	400,000	431,960	2029/9/20
第14回新関西国際空港株式会社社債	1.318	600,000	677,832	2034/12/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第16回新開西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	335,535	2035/9/20
第18回新開西国際空港株式会社社債	0.675	500,000	514,710	2037/12/18
第23回新開西国際空港株式会社社債	0.512	700,000	700,231	2038/12/20
第79回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.396	700,000	712,110	2032/6/18
第95回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.04	100,000	100,014	2023/9/20
第97回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.536	700,000	711,102	2038/7/12
第108回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.439	700,000	696,297	2039/4/11
第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.253	400,000	384,344	2039/7/11
第125回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.379	700,000	687,953	2040/4/24
第130回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.479	500,000	501,270	2040/7/20
第34回日本政策投資銀行債券	2.67	200,000	271,660	2037/3/19
第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	133,836	2035/9/20
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	200,000	264,976	2035/12/20
第3回日本高速道路保有・債務返済機構債券(指定金融機関等限)	0.5	700,000	704,669	2038/9/17
第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.19	100,000	120,813	2031/3/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	500,000	594,425	2032/3/19
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	500,000	589,650	2032/9/17
第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.55	500,000	581,005	2034/3/17
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.133	100,000	110,983	2035/3/20
第191回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.661	200,000	207,582	2037/12/18
第194回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.64	500,000	516,855	2037/12/18
第210回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.677	700,000	727,048	2038/9/17
第9回道路債債券	2.9	100,000	130,522	2032/5/20
第21回道路債債券	2.75	100,000	130,784	2033/6/20
第28回道路債債券	2.83	500,000	663,200	2033/12/20
第33回道路債債券	2.91	100,000	134,615	2034/6/20
第43回道路債債券	2.66	200,000	264,066	2034/12/20
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	120,642	2031/5/9
第121回都市再生債券	0.482	700,000	721,637	2031/2/20
第124回都市再生債券	0.273	300,000	294,156	2036/6/20
第128回都市再生債券	0.39	500,000	499,270	2036/9/19
第131回都市再生債券	0.487	500,000	505,955	2036/11/25
第133回都市再生債券	0.767	200,000	210,654	2037/2/20
第141回都市再生債券	0.63	100,000	103,324	2038/2/19
第145回都市再生債券	0.584	300,000	307,365	2038/6/18
第150回都市再生債券	0.716	500,000	522,475	2038/11/19
第156回都市再生債券	0.343	400,000	390,916	2039/6/17
第157回都市再生債券	0.2	400,000	381,508	2039/9/16
第160回都市再生債券	0.335	600,000	586,224	2039/12/19
第6回関西国際空港株式会社社債	2.7	200,000	230,724	2026/9/18
第17回独立行政法人福祉医療機構債券	2.46	500,000	594,955	2028/12/20
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	113,662	2026/3/20
第62回独立行政法人福祉医療機構債券	0.18	400,000	401,344	2030/6/20
第4回中部国際空港株式会社社債	0.305	600,000	607,062	2027/2/22
第6回中部国際空港株式会社社債	0.206	500,000	502,175	2029/2/22
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	117,979	2030/7/16
第69回一般担保住宅金融支援機構債券	2.31	500,000	610,845	2031/4/18
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	210,000	251,638	2031/6/13
第81回一般担保住宅金融支援機構債券	1.926	100,000	118,588	2031/9/12
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,080	2031/11/18
第94回一般担保住宅金融支援機構債券	1.882	500,000	592,685	2032/2/13
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	118,888	2032/3/12
第106回一般担保住宅金融支援機構債券	1.794	100,000	117,937	2032/6/18
第109回一般担保住宅金融支援機構債券	1.787	200,000	235,808	2032/7/16
第115回一般担保住宅金融支援機構債券	1.811	500,000	591,800	2032/9/14

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第18回一般担保住宅金融支援機構債券	1.814	100,000	118,451	2032/10/15
第120回一般担保住宅金融支援機構債券	1.896	400,000	475,008	2032/11/12
第120回一般担保住宅金融支援機構債券	1.838	100,000	119,724	2033/1/25
第127回一般担保住宅金融支援機構債券	1.923	300,000	360,381	2033/2/18
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	235,938	2032/12/20
第159回一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	300,000	332,664	2035/5/18
第166回一般担保住宅金融支援機構債券	1.221	100,000	112,261	2035/8/20
第211回一般担保住宅金融支援機構債券	0.406	500,000	509,220	2032/6/18
第220回一般担保住宅金融支援機構債券	0.616	200,000	206,084	2037/10/20
第223回一般担保住宅金融支援機構債券	0.403	200,000	203,386	2032/11/19
第239回一般担保住宅金融支援機構債券	0.393	300,000	303,837	2033/6/20
第255回一般担保住宅金融支援機構債券	0.548	200,000	202,974	2039/1/20
第257回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	300,000	301,860	2034/2/20
第279回一般担保住宅金融支援機構債券	0.285	800,000	792,968	2034/12/20
第283回一般担保住宅金融支援機構債券	0.274	400,000	395,340	2035/2/20
第18回成田国際空港株式会社社債	0.556	100,000	102,325	2025/10/30
第20回成田国際空港株式会社社債	0.105	300,000	299,823	2026/8/21
第21回成田国際空港株式会社社債	0.427	500,000	498,315	2036/8/22
第23回成田国際空港株式会社社債	0.677	700,000	723,520	2036/12/16
第25回成田国際空港株式会社社債	0.671	300,000	308,634	2037/12/18
第27回成田国際空港株式会社社債	0.657	600,000	616,626	2038/3/12
第30回成田国際空港株式会社社債	0.77	700,000	729,316	2038/10/22
第35回成田国際空港株式会社社債	0.27	100,000	95,187	2039/9/16
第36回成田国際空港株式会社社債	0.2	400,000	400,384	2030/1/29
第37回成田国際空港株式会社社債	0.424	300,000	294,420	2040/1/27
第6回沖繩振興開発金融公庫債券	2.204	100,000	109,511	2025/6/20
第7回国際協力機構債券	1.991	100,000	119,040	2031/6/13
第15回国際協力機構債券	1.724	300,000	351,873	2032/9/17
第19回国際協力機構債券	1.725	100,000	117,925	2033/6/20
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	118,232	2033/9/20
第25回国際協力機構債券	1.52	600,000	695,718	2034/6/20
第27回国際協力機構債券	1.451	400,000	460,616	2034/9/20
第33回国際協力機構債券	1.13	100,000	111,041	2035/12/20
第36回国際協力機構債券	0.313	100,000	98,644	2036/6/20
第39回国際協力機構債券	0.744	400,000	419,896	2037/2/20
第43回国際協力機構債券	0.625	700,000	721,910	2037/12/18
第45回国際協力機構債券	0.559	600,000	612,258	2038/6/20
第49回国際協力機構債券	0.333	300,000	292,668	2039/6/20
第54回国際協力機構債券	0.445	600,000	597,828	2040/6/26
第56回国際協力機構債券	0.459	700,000	702,436	2040/9/20
第58回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.81	600,000	714,798	2033/8/19
第63回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.56	400,000	465,392	2034/2/27
第69回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.441	500,000	574,820	2034/8/4
第75回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.157	200,000	222,486	2035/2/26
第78回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.801	100,000	106,210	2030/5/28
第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.221	200,000	224,510	2035/8/17
第90回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2	500,000	500,230	2031/5/30
第96回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.274	700,000	704,200	2031/11/28
第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.739	500,000	524,515	2037/2/27
第102回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.428	500,000	510,715	2032/5/28
第106回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.616	500,000	515,485	2037/8/25
第113回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.63	200,000	206,654	2038/2/26
第115回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.395	100,000	101,358	2033/5/30
第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.663	400,000	414,824	2038/8/27
第121回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.515	500,000	513,370	2033/11/28

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	600,000	597,108	2034/5/30
第36回大成建設株式会社無担保社債	0.14	400,000	399,812	2022/7/22
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	200,000	204,156	2023/5/9
第22回株式会社大林組無担保社債	0.385	600,000	601,410	2028/9/13
第23回株式会社大林組無担保社債	0.13	500,000	499,015	2023/10/25
第23回清水建設株式会社無担保社債	0.25	800,000	800,640	2024/8/2
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	200,000	199,654	2027/11/30
第25回清水建設株式会社無担保社債	0.27	200,000	196,744	2029/9/3
第26回清水建設株式会社無担保社債	0.11	300,000	297,639	2024/12/12
第11回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.524	700,000	705,446	2028/11/1
第12回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.35	600,000	591,924	2029/7/19
第13回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.24	500,000	500,875	2025/7/11
第14回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.47	500,000	501,190	2030/7/12
第44回鹿島建設株式会社無担保社債	0.3	300,000	299,202	2026/7/22
第46回鹿島建設株式会社無担保社債	0.11	300,000	298,440	2025/2/28
第8回西松建設株式会社無担保社債	0.18	800,000	796,240	2024/9/20
第10回西松建設株式会社無担保社債	0.33	500,000	500,400	2025/7/18
第23回前田建設工業株式会社無担保社債	0.28	400,000	399,668	2023/7/28
第26回前田建設工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	297,894	2024/9/12
第3回戸田建設株式会社無担保社債	0.27	400,000	399,736	2022/12/14
第3回五洋建設株式会社無担保社債	0.68	500,000	501,940	2021/7/30
第3回住友林業株式会社無担保社債	0.33	600,000	600,108	2026/6/17
第4回住友林業株式会社無担保社債	0.25	400,000	399,672	2025/3/7
第5回住友林業株式会社無担保社債	0.35	400,000	398,420	2028/3/7
第8回住友林業株式会社無担保社債	0.38	500,000	497,570	2029/3/6
第9回住友林業株式会社無担保社債	0.28	700,000	687,995	2029/12/6
第12回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.07	700,000	698,698	2022/6/1
第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	99,573	2027/6/1
第19回積水ハウス株式会社無担保社債	0.04	500,000	499,580	2021/7/20
第21回積水ハウス株式会社無担保社債	0.2	800,000	795,352	2026/7/17
第3回協和エンコオ株式会社無担保社債	0.15	200,000	199,742	2022/2/24
第4回協和エンコオ株式会社無担保社債	0.12	500,000	496,385	2024/10/25
第5回協和エンコオ株式会社無担保社債	0.19	200,000	197,610	2026/10/23
第5回日揮株式会社無担保社債	0.2	400,000	399,344	2022/10/13
第1回高砂熱学工業株式会社無担保社債	0.37	200,000	200,112	2024/4/19
第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	0.2	600,000	591,828	2029/7/13
第1回ソノルホールディングス株式会社無担保社債	0.08	700,000	699,636	2021/6/14
第13回森永乳業株式会社無担保社債	0.884	500,000	511,120	2024/5/8
第14回森永乳業株式会社無担保社債	0.774	100,000	102,340	2025/12/10
第15回森永乳業株式会社無担保社債	0.37	700,000	701,162	2027/7/23
第16回森永乳業株式会社無担保社債	0.395	200,000	200,314	2028/9/14
第17回森永乳業株式会社無担保社債	0.24	400,000	392,112	2029/9/6
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	300,000	299,775	2024/9/13
第8回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.12	400,000	399,344	2023/1/30
第1回雪印メグミルク株式会社無担保社債	0.45	800,000	800,344	2028/12/25
第10回日本ハム株式会社無担保社債	0.15	200,000	199,430	2024/2/20
第11回日本ハム株式会社無担保社債	0.25	700,000	697,123	2026/2/20
第12回日本ハム株式会社無担保社債	0.36	600,000	598,062	2029/2/20
第28回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.614	400,000	400,356	2020/12/4
第32回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.15	300,000	299,694	2022/6/1
第33回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.2	600,000	592,980	2026/9/4
第34回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.3	500,000	492,295	2029/9/5
第10回アセシグループホールディングス株式会社無担保社債	0.17	800,000	800,128	2022/6/13
第12回アセシグループホールディングス株式会社無担保社債	0.33	700,000	698,614	2027/6/11
第9回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.239	600,000	606,774	2021/9/24

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.603	500,000	508,105	2025/2/28
第11回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.12	300,000	299,577	2023/12/6
第12回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	497,275	2024/9/5
第13回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.23	800,000	788,280	2029/9/5
第17回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.37	100,000	100,097	2030/6/4
第14回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.1	500,000	499,400	2022/4/25
第15回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	400,000	399,800	2024/4/25
第16回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.315	200,000	199,672	2027/4/23
第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.22	800,000	798,344	2026/6/2
第3回ココ・コーラウエスト株式会社無担保社債	0.524	500,000	503,485	2022/6/17
第1回ココ・コーポラトーズジャパンホールディングス社債	0.1	800,000	798,128	2024/9/19
第2回ココ・コーポラトーズジャパンホールディングス社債	0.2	800,000	796,168	2026/9/18
第3回ココ・コーポラトーズジャパンホールディングス社債	0.27	600,000	593,766	2029/9/19
第3回サントリー食品インターナショナル株式会社無担保社債	0.001	500,000	499,325	2021/7/26
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	600,000	598,902	2024/2/23
第10回日清オリオグループ株式会社無担保社債	0.769	300,000	306,123	2024/9/10
第11回日清オリオグループ株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,880	2024/12/4
第12回日清オリオグループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	299,481	2022/12/3
第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債	0.456	200,000	200,950	2022/12/19
第2回株式会社J-オイルミルズ無担保社債	0.37	600,000	600,378	2027/5/28
第33回双日株式会社無担保社債	0.519	400,000	402,940	2024/3/8
第35回双日株式会社無担保社債	0.605	300,000	300,438	2028/3/8
第7回キッコーマン株式会社無担保社債	1.312	400,000	405,588	2021/12/15
第24回味の素株式会社無担保社債	0.19	500,000	499,740	2024/3/8
第25回味の素株式会社無担保社債	0.355	700,000	702,219	2027/3/9
第3回キユーピー株式会社無担保社債	0.23	700,000	697,501	2026/2/13
第22回株式会社ニチレイ無担保社債	0.36	600,000	601,314	2021/10/22
第23回株式会社ニチレイ無担保社債	0.19	600,000	599,556	2023/10/25
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	700,000	698,705	2025/8/29
第25回株式会社ニチレイ無担保社債	0.24	300,000	300,720	2027/8/31
第11回日本たばこ産業株式会社社債	0.599	100,000	101,875	2025/7/15
第12回日本たばこ産業株式会社社債	0.11	700,000	699,272	2023/9/8
第5回エスニック株式会社無担保社債	0.949	300,000	307,185	2024/4/24
第8回エスニック株式会社無担保社債	0.3	700,000	695,604	2026/6/25
第4回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.468	300,000	301,185	2022/8/5
第6回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.435	700,000	697,214	2027/8/4
第42回東洋紡株式会社無担保社債	0.23	500,000	495,415	2026/12/11
第4回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,763	2024/12/20
第5回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.33	300,000	299,901	2027/9/17
第5回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.924	300,000	308,880	2025/5/30
第8回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.19	300,000	300,201	2021/6/1
第12回森ビル株式会社無担保社債	0.8	500,000	500,385	2020/11/2
第14回森ビル株式会社無担保社債	0.861	300,000	305,835	2024/8/14
第17回森ビル株式会社無担保社債	0.523	100,000	100,267	2021/8/13
第20回森ビル株式会社無担保社債	0.12	500,000	499,370	2021/10/25
第21回森ビル株式会社無担保社債	0.44	600,000	599,412	2027/2/16
第8回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	300,000	300,141	2021/12/16
第13回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.41	500,000	499,170	2027/7/30
第11回株式会社セブン&7イ-ホールディングス無担保社債	0.514	300,000	302,205	2022/6/20
第12回株式会社セブン&7イ-ホールディングス無担保社債	0.781	400,000	410,944	2025/6/20
第28回東レ株式会社無担保社債	0.925	200,000	202,576	2022/7/20
第29回東レ株式会社無担保社債	1.012	100,000	102,137	2023/7/14
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	700,000	697,228	2027/7/16
第31回東レ株式会社無担保社債	0.25	600,000	599,694	2024/7/19
第33回東レ株式会社無担保社債	0.38	400,000	397,696	2028/7/18

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第7回株式会社クラレ無担保社債	0.19	500,000	498,335	2025/4/25
第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	598,020	2028/4/25
第10回旭化成株式会社無担保社債	0.1	400,000	398,788	2023/12/6
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	497,335	2024/9/6
第12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	492,005	2029/9/6
第15回旭化成株式会社無担保社債	0.28	500,000	500,710	2030/6/19
第33回王子製紙株式会社無担保社債	0.28	700,000	700,490	2025/1/24
第34回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	200,862	2028/1/26
第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	301,197	2028/11/29
第40回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	700,000	700,686	2030/7/17
第25回北越紀州製紙株式会社無担保社債	0.17	600,000	599,946	2021/6/17
第26回北越紀州製紙株式会社無担保社債	0.18	500,000	499,805	2021/12/20
第27回北越コーポレーション株式会社無担保社債	0.22	600,000	598,062	2024/3/13
第20回レンゴー株式会社無担保社債	0.498	400,000	402,460	2022/9/2
第21回レンゴー株式会社無担保社債	0.28	600,000	601,452	2023/12/8
第22回レンゴー株式会社無担保社債	0.39	700,000	702,296	2026/12/8
第25回レンゴー株式会社無担保社債	0.415	200,000	199,610	2028/12/13
第27回レンゴー株式会社無担保社債	0.3	800,000	788,360	2029/12/12
第1回株式会社マクロミル無担保社債	0.27	200,000	199,896	2021/7/27
第49回住友化学株式会社無担保社債	0.944	100,000	102,488	2024/4/25
第54回住友化学株式会社無担保社債	0.2	500,000	499,790	2023/9/1
第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	699,769	2027/9/13
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,850	2024/9/13
第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,672	2028/4/17
第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	398,528	2029/4/16
第6回株式会社クラレ無担保社債	0.14	600,000	599,412	2022/9/4
第8回セントラル硝子株式会社無担保社債	0.39	600,000	599,916	2024/2/23
第21回デンカ株式会社無担保社債	0.28	600,000	598,014	2025/4/23
第22回デンカ株式会社無担保社債	0.23	500,000	495,430	2026/12/4
第10回イビデン株式会社無担保社債	0.11	600,000	595,782	2024/9/12
第3回回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	398,856	2028/2/29
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	600,000	599,556	2028/8/31
第6回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.38	400,000	400,388	2030/5/31
第13回大陽日酸株式会社無担保社債	0.14	700,000	699,475	2021/12/15
第14回大陽日酸株式会社無担保社債	0.39	400,000	400,096	2026/12/15
第16回大陽日酸株式会社無担保社債	0.19	400,000	395,232	2026/10/16
第7回株式会社カネカ無担保社債	0.11	200,000	198,594	2024/9/12
第8回株式会社カネカ無担保社債	0.24	200,000	196,218	2029/9/12
第23回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	0.34	400,000	401,944	2030/9/3
第42回三井化学株式会社無担保社債	1.354	100,000	101,013	2021/7/28
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	300,000	300,180	2024/7/24
第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	100,033	2027/7/23
第50回三井化学株式会社無担保社債	0.27	500,000	491,420	2029/12/5
第16回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.433	200,000	201,090	2022/6/3
第19回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.476	300,000	302,202	2022/12/2
第32回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.22	600,000	601,794	2026/6/9
第39回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.42	600,000	602,898	2028/12/19
第3回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	700,000	696,437	2027/2/26
第38回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.28	1,000,000	989,130	2030/2/28
第11回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.14	500,000	499,210	2022/9/15
第12回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.23	600,000	598,842	2024/9/13
第6回積水化学工業株式会社無担保社債	0.28	700,000	699,335	2026/6/12
第7回積水化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	491,360	2029/9/13
第7回日本ゼオン株式会社無担保社債	0.559	200,000	200,966	2022/6/22
第13回宇部興産株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,205	2022/5/25

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第4回日本化薬株式会社無担保社債	0.13	400,000	397,840	2024/12/20
第3回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.25	600,000	598,716	2026/9/16
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	600,000	600,672	2028/3/23
第6回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.24	500,000	493,490	2029/9/27
第2回株式会社電通無担保社債	0.24	700,000	697,802	2025/10/24
第3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	702,436	2028/10/25
第1回株式会社A D E K A無担保社債	0.18	300,000	298,719	2024/3/15
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	500,000	499,925	2024/5/31
第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	598,620	2027/6/2
第6回テレルモ株式会社無担保社債	0.17	400,000	399,696	2023/4/19
第7回テレルモ株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,376	2026/4/17
第9回テレルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	995,780	2027/4/26
第3回みかかホールディングス株式会社無担保社債	0.15	400,000	397,596	2024/10/25
第1回沢井製薬株式会社無担保社債	0.594	300,000	301,806	2022/6/10
第4回第一三共株式会社無担保社債	0.846	600,000	611,214	2023/9/15
第1回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.12	200,000	199,492	2024/3/7
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	300,000	299,241	2026/3/6
第3回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.375	1,000,000	1,001,260	2029/3/7
第37回D I C株式会社無担保社債	1.0	100,000	103,271	2025/9/18
第41回D I C株式会社無担保社債	0.15	600,000	599,724	2022/7/12
第12回株式会社オリエントランド無担保社債	0.373	800,000	802,568	2022/3/18
第14回株式会社オリエントランド無担保社債	0.23	500,000	498,490	2026/1/23
第15回株式会社オリエントランド無担保社債	0.305	700,000	694,652	2029/1/25
第5回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	0.108	500,000	499,590	2021/12/6
第2回住友三井オートサービス株式会社無担保社債	0.23	800,000	799,896	2023/10/31
第4回住友三井オートサービス株式会社無担保社債	0.15	800,000	796,784	2024/10/31
第3回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.882	700,000	710,724	2022/12/2
第7回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	298,473	2027/3/3
第10回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,666	2025/12/5
第13回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	497,540	2024/7/26
第15回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.12	500,000	497,175	2025/3/5
第6回ココニカホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	700,616	2024/12/13
第1回荒川化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	498,140	2024/12/19
第4回出光興産株式会社無担保社債	0.541	400,000	401,272	2021/8/4
第5回出光興産株式会社無担保社債	0.2	200,000	200,232	2022/12/5
第6回出光興産株式会社無担保社債	0.27	700,000	697,662	2025/9/19
第8回出光興産株式会社無担保社債	0.09	200,000	198,586	2024/9/18
第9回出光興産株式会社無担保社債	0.18	400,000	394,824	2026/9/20
第6回J Xホールディングス株式会社無担保社債	1.119	300,000	307,605	2023/7/19
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,034	2024/6/4
第13回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	698,530	2026/7/28
第2回J X T Gホールディングス株式会社無担保社債	0.405	700,000	700,469	2027/8/3
第13回横浜ゴム株式会社無担保社債	0.25	100,000	100,114	2023/12/8
第9回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.08	500,000	499,795	2022/4/21
第10回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.2	500,000	500,990	2024/4/19
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	800,000	799,200	2027/4/21
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	200,000	200,252	2026/4/17
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	1,001,690	2029/4/19
第22回住友ゴム工業株式会社無担保社債	1.378	100,000	100,917	2021/6/28
第3回バンドー化学株式会社無担保社債	0.4	200,000	200,432	2024/1/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	600,786	2027/5/28
第1回A G C株式会社無担保社債	0.23	700,000	699,517	2025/10/10
第15回住友大阪セメント株式会社無担保社債	0.24	600,000	600,102	2023/8/30
第25回太平洋セメント株式会社無担保社債	0.63	200,000	200,766	2021/9/10
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.37	800,000	798,520	2028/6/14

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第10回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.11	400,000	398,456	2024/6/20
第11回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.27	500,000	493,070	2026/6/20
第1回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.28	400,000	396,468	2026/9/18
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.22	500,000	500,835	2024/5/20
第4回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,513	2027/5/20
第5回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.23	400,000	399,684	2024/12/20
第70回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.951	100,000	101,406	2022/6/20
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	688,513	2029/6/20
第20回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.703	600,000	607,638	2024/9/19
第25回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.26	500,000	495,705	2025/5/21
第28回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.26	500,000	492,785	2026/5/27
第29回ジェイエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.365	600,000	588,648	2029/5/25
第29回住友金属山株式会社無担保社債	1.257	400,000	403,984	2021/8/31
第30回住友金属山株式会社無担保社債	0.02	400,000	399,268	2021/9/17
第31回住友金属山株式会社無担保社債	0.1	700,000	695,065	2024/12/13
第32回住友金属山株式会社無担保社債	0.25	800,000	784,824	2029/12/13
第5回DOWAホールディングス株式会社無担保社債	0.11	500,000	496,275	2024/9/18
第4回DOWAホールディングス株式会社無担保社債	0.14	500,000	498,165	2023/9/14
第26回住友電気工業株式会社無担保社債	0.3	700,000	697,984	2027/3/1
第13回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	600,000	599,418	2026/12/16
第14回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.29	600,000	590,868	2029/10/25
第9回LIXILグループ無担保社債	0.08	500,000	499,290	2021/8/31
第1回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	0.09	700,000	699,223	2022/3/9
第2回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	0.22	600,000	600,324	2024/3/8
第19回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.109	200,000	201,864	2021/9/17
第29回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.08	500,000	493,660	2026/6/19
第2回ナブテスコ株式会社無担保社債	0.14	600,000	599,622	2021/12/13
第4回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.17	700,000	699,398	2023/3/15
第5回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.13	500,000	497,930	2024/7/24
第6回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.29	400,000	395,876	2030/1/24
第17回日立建機株式会社無担保社債	0.16	500,000	499,005	2022/12/13
第9回株式会社荏原製作所無担保社債	0.18	100,000	99,854	2022/10/24
第19回ダイキン工業株式会社無担保社債	1.204	200,000	204,752	2022/12/12
第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,784	2026/9/30
第23回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.13	600,000	595,668	2026/10/9
第24回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.18	600,000	591,852	2029/10/11
第27回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.26	300,000	300,594	2030/9/18
第6回株式会社タダノ無担保社債	0.25	800,000	793,632	2026/12/11
第6回ブラザー工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	100,009	2020/11/26
第1回グローリー株式会社無担保社債	0.15	500,000	497,715	2023/12/6
第43回日本精工株式会社無担保社債	0.769	100,000	102,041	2024/9/10
第44回日本精工株式会社無担保社債	0.12	300,000	299,754	2022/3/14
第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	298,959	2027/12/7
第49回日本精工株式会社無担保社債	0.29	700,000	698,838	2025/11/28
第51回日本精工株式会社無担保社債	0.19	300,000	296,835	2026/9/2
第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.345	400,000	398,852	2028/3/8
第9回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	500,000	493,395	2029/11/28
第10回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.21	600,000	594,522	2026/11/27
第5回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	600,000	600,492	2023/12/8
第12回T H K株式会社無担保社債	0.27	500,000	499,705	2025/2/7
第14回T H K株式会社無担保社債	0.29	700,000	698,250	2026/2/6
第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	600,000	613,440	2023/12/13
第29回富士電機株式会社無担保社債	0.28	500,000	500,375	2023/8/31
第30回富士電機株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,642	2027/5/21
第3回日本電産株式会社無担保社債	0.956	600,000	609,354	2022/9/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第8回日本電産株式会社無担保社債	0.1	800,000	796,392	2024/7/19
第9回日本電産株式会社無担保社債	0.02	800,000	797,216	2022/11/28
第10回日本電産株式会社無担保社債	0.09	800,000	795,400	2024/11/28
第50回日本電気株式会社無担保社債	0.29	500,000	500,515	2022/6/15
第53回日本電気株式会社無担保社債	0.26	300,000	299,775	2023/9/21
第15回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.34	300,000	300,768	2026/9/18
第16回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.26	400,000	400,956	2024/9/6
第17回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.36	700,000	699,769	2027/9/6
第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	800,000	801,912	2030/7/16
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	600,000	604,014	2022/3/18
第15回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	500,000	500,385	2021/9/17
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	400,000	402,428	2026/9/18
第19回パナソニック株式会社無担保社債	0.37	600,000	592,992	2030/3/5
第31回ソニー株式会社無担保社債	0.23	500,000	500,245	2021/9/17
第32回ソニー株式会社無担保社債	0.28	100,000	100,133	2023/9/20
第33回ソニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	300,528	2026/9/18
第35回ソニー株式会社無担保社債	0.18	400,000	394,668	2026/10/9
第36回ソニー株式会社無担保社債	0.3	700,000	687,295	2029/10/10
第7回TDK株式会社無担保社債	0.31	200,000	200,738	2027/7/28
第7回TDK株式会社無担保社債	0.43	800,000	800,784	2030/7/26
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	0.609	700,000	700,273	2020/10/30
第5回株式会社堀場製作所無担保社債	0.18	700,000	689,612	2026/10/10
第6回株式会社堀場製作所無担保社債	0.27	600,000	587,802	2029/10/17
第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	1,000,000	995,710	2027/6/18
第5回スタンレー電気株式会社無担保社債	0.15	500,000	498,685	2024/4/19
第1回株式会社村田製作所無担保社債	0.08	700,000	699,426	2022/1/24
第2回株式会社村田製作所無担保社債	0.15	700,000	699,209	2024/1/24
第3回株式会社村田製作所無担保社債	0.06	800,000	795,624	2024/9/10
第1回東海理化電機製作所無担保社債	0.34	300,000	299,016	2027/6/7
第26回三菱重工株式会社無担保社債	0.877	600,000	611,094	2023/9/4
第31回三菱重工株式会社無担保社債	0.63	100,000	101,483	2025/9/2
第40回川崎重工株式会社無担保社債	0.988	200,000	204,830	2023/12/15
第12回川崎重工株式会社無担保社債	0.791	100,000	101,991	2024/7/18
第45回川崎重工株式会社無担保社債	0.1	300,000	299,850	2021/7/15
第51回川崎重工株式会社無担保社債	0.15	300,000	298,713	2024/7/12
第40回株式会社IHI無担保社債	0.592	300,000	300,765	2021/6/17
第43回株式会社IHI無担保社債	0.2	400,000	397,772	2024/10/17
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	0.2	300,000	300,237	2022/1/27
第7回J A三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,078	2022/9/15
第8回J A三井リース株式会社無担保社債	0.31	200,000	200,322	2024/9/13
第15回J A三井リース株式会社無担保社債	0.22	600,000	597,852	2025/1/24
第10回昭和三井リース株式会社無担保社債	0.3	800,000	794,392	2024/12/18
第5回コンソルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.37	500,000	496,412	2029/9/4
第7回コンソルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.6	500,000	500,572	2030/9/3
第1回B号明治安田生命2016基金特定目的会社特定社債	0.28	400,000	400,380	2021/8/9
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	0.304	300,000	300,390	2021/8/2
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	600,000	600,942	2022/8/4
第4回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス無担保社債	0.23	700,000	699,265	2023/10/25
第7回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス無担保社債	0.14	800,000	795,184	2024/10/25
第14回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.963	100,000	102,253	2023/3/20
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	600,000	594,294	2026/9/25
第13回本田技研工業株式会社無担保社債	0.12	800,000	795,480	2025/3/5
第14回本田技研工業株式会社無担保社債	0.15	800,000	790,880	2027/3/5
第1回株式会社SUBARU無担保社債	0.12	600,000	597,264	2024/12/17
第2回株式会社SUBARU無担保社債	0.21	700,000	694,407	2026/12/17

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	400,000	399,672	2025/3/13
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	700,000	701,064	2023/9/25
第1回日本生命2019基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	0.25	800,000	799,568	2024/8/1
第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	0.29	800,000	800,184	2024/8/2
第2回楽天カード株式会社無担保社債	0.3	600,000	597,048	2024/12/12
第3回株式会社トブコム無担保社債	0.3	500,000	500,625	2025/6/24
第4回日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	793,200	2029/7/19
第1回株式会社アシックス無担保社債	0.14	700,000	699,818	2021/12/7
第2回株式会社アシックス無担保社債	0.2	600,000	599,298	2024/3/13
第4回株式会社ニフコ無担保社債	0.25	500,000	497,425	2025/5/8
第5回株式会社ニフコ無担保社債	0.385	500,000	497,435	2028/5/8
第6回株式会社ニフコ無担保社債	0.28	700,000	686,812	2029/9/11
第59回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.378	200,000	201,788	2021/6/4
第67回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.964	100,000	101,671	2022/9/9
第87回丸紅株式会社無担保社債	1.29	200,000	202,400	2021/10/15
第102回丸紅株式会社無担保社債	0.756	300,000	305,835	2024/7/25
第5回長瀬産業株式会社無担保社債	0.539	200,000	201,028	2022/6/16
第6回長瀬産業株式会社無担保社債	0.15	400,000	396,692	2024/12/12
第7回長瀬産業株式会社無担保社債	0.29	600,000	589,182	2029/12/12
第16回豊田通商株式会社無担保社債	1.35	300,000	304,485	2021/12/8
第17回豊田通商株式会社無担保社債	0.81	100,000	101,991	2023/12/5
第18回豊田通商株式会社無担保社債	1.014	200,000	207,868	2025/12/5
第19回豊田通商株式会社無担保社債	0.954	100,000	103,951	2026/7/10
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.14	200,000	199,714	2022/2/22
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.24	800,000	798,264	2024/2/22
第3回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	227,664	2027/4/23
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	800,000	800,344	2029/7/11
第75回三井物産株式会社無担保社債	0.23	700,000	695,919	2029/12/12
第6回日本紙パルプ商事株式会社無担保社債	0.19	400,000	396,288	2024/12/12
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	102,339	2022/3/16
第46回住友商事株式会社無担保社債	0.884	100,000	101,623	2022/12/12
第78回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	100,812	2021/5/24
第78回三菱商事株式会社無担保社債	1.155	100,000	101,541	2022/3/9
第79回三菱商事株式会社無担保社債	1.022	100,000	101,530	2022/5/20
第30回阪和興業株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,104	2023/6/13
第26回株式会社丸井グループ無担保社債	0.562	200,000	200,444	2021/6/4
第30回株式会社丸井グループ無担保社債	0.13	500,000	499,410	2021/8/17
第31回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	500,000	499,205	2022/5/25
第34回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	800,000	796,720	2023/10/25
第36回株式会社丸井グループ無担保社債	0.25	300,000	294,183	2026/10/16
第48回株式会社クレディセゾン無担保社債	1.038	200,000	204,844	2023/10/20
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	102,199	2024/4/24
第79回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.22	500,000	498,415	2025/1/31
第81回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.2	400,000	400,036	2025/7/15
第4回株式会社新生銀行無担保社債	0.25	600,000	600,582	2021/10/27
第5回株式会社新生銀行無担保社債	0.21	400,000	399,616	2023/7/13
第6回株式会社新生銀行無担保社債	0.24	700,000	698,789	2023/12/13
第14回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.19	100,000	100,097	2022/9/8
第15回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.11	700,000	700,056	2020/12/8
第2回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.29	700,000	694,263	2030/1/15
第2回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.61	800,000	780,960	2029/12/12
第1回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.94	100,000	101,457	2024/6/26
第7回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	1.393	200,000	209,020	2030/6/18
第12回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.12	500,000	499,690	2022/1/24
第18回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.06	600,000	599,568	2021/7/23

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第20回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.27	500,000	498,735	2025/7/23
第29回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.06	600,000	598,470	2022/12/13
第1回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.857	200,000	201,874	2024/9/5
第3回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.66	430,000	430,399	2026/2/27
第6回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.575	800,000	790,048	2027/6/8
第15回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.53	600,000	600,561	2030/9/2
第4回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.62	725,000	721,926	2026/12/18
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	2.54	600,000	685,926	2027/7/27
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	200,000	227,610	2027/4/20
第20回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.91	600,000	713,292	2029/10/16
第2回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.27	400,000	457,464	2030/9/27
第26回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.95	200,000	214,660	2025/11/12
第29回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.16	100,000	108,694	2026/1/20
第32回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.62	1,100,000	1,111,847	2021/6/9
第3回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	108,976	2026/6/9
第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ	0.849	400,000	405,052	2024/9/12
第4回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	1.328	800,000	834,232	2030/5/29
第7回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.92	480,000	488,913	2025/10/15
第9回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.469	240,000	238,368	2026/6/15
第13回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.545	130,000	129,278	2026/9/15
第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.585	710,000	704,724	2028/3/16
第8回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.878	100,000	101,186	2021/6/1
第9回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	500,000	557,420	2026/12/22
第11回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.78	200,000	204,340	2022/3/15
第12回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.464	800,000	890,656	2027/3/15
第1回株式会社千葉銀行無担保社債(劣後特約付)	0.911	600,000	603,132	2024/8/29
第4回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.48	800,000	794,576	2029/4/26
第5回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.37	800,000	789,580	2029/11/26
第8回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.92	100,000	107,361	2025/10/21
第6回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.78	600,000	674,694	2026/4/27
第8回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.49	400,000	447,024	2027/5/10
第13回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.341	300,000	329,241	2026/6/15
第15回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.62	100,000	102,166	2022/3/22
第10回株式会社セブン銀行無担保社債	0.803	500,000	508,535	2023/3/20
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	700,000	710,675	2024/12/20
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	505,850	2027/9/17
第9回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.56	600,000	597,120	2026/6/19
第10回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後特約付)	0.65	500,000	499,370	2027/1/26
第12回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.61	300,000	298,356	2027/6/21
第21回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.895	800,000	800,400	2030/6/24
第22回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.56	800,000	800,424	2030/6/24
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.43	300,000	300,448	2020/9/28
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.61	100,000	100,347	2020/12/17
第2回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.6	200,000	202,038	2021/6/1
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	500,000	545,410	2026/6/1
第28回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.17	600,000	658,152	2026/12/18
第5回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.49	100,000	110,073	2026/1/30
第7回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.87	200,000	226,248	2026/11/6
第9回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.52	500,000	557,660	2027/4/27
第15回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	3.03	200,000	238,092	2029/9/28
第18回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.14	400,000	433,944	2026/9/11
第1回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.49	400,000	408,564	2022/6/3
第14回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.19	100,000	100,083	2022/5/30
第15回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.33	500,000	501,690	2024/12/6
第17回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.21	500,000	499,935	2023/11/2

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	500,000	498,295	2026/12/11
第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.529	600,000	608,352	2031/12/19
第5回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.489	600,000	604,410	2032/9/17
第15回株式会社産フナショナルサービス無担保社債	0.07	500,000	487,005	2022/6/20
第24回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.32	200,000	200,058	2025/4/11
第25回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.2	500,000	499,030	2023/10/13
第44回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.08	500,000	498,905	2022/9/20
第49回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	500,000	497,935	2025/6/19
第52回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.2	700,000	696,626	2025/9/19
第56回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.09	600,000	596,574	2024/6/19
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	500,000	496,010	2026/6/19
第27回リコーリース株式会社無担保社債	0.16	600,000	599,940	2022/7/20
第33回リコーリース株式会社無担保社債	0.19	600,000	599,046	2023/9/7
第1回オンフナショナルサービス株式会社無担保社債	0.3	800,000	795,096	2025/1/30
第6回オンフナショナルサービス株式会社無担保社債	0.35	400,000	399,940	2024/5/28
第8回オンフナショナルサービス株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,378	2024/9/20
第9回オンフナショナルサービス株式会社無担保社債	0.38	700,000	692,650	2026/9/18
第9回株式会社ジャックス無担保社債	0.79	300,000	300,615	2021/1/22
第12回株式会社ジャックス無担保社債	0.545	100,000	100,403	2021/12/3
第13回株式会社ジャックス無担保社債	0.644	200,000	201,230	2022/2/25
第17回株式会社ジャックス無担保社債	0.37	200,000	200,372	2024/6/7
第20回株式会社ジャックス無担保社債	0.36	300,000	299,121	2025/6/13
第9回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.46	500,000	502,390	2023/7/22
第9回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.54	500,000	500,280	2025/7/18
第53回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.815	100,000	102,114	2024/3/19
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	300,000	311,121	2026/9/18
第66回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.26	500,000	500,850	2024/6/20
第5回株式会社アブラスフナショナルサービス無担保社債	0.25	600,000	594,252	2023/10/13
第6回株式会社アブラスフナショナルサービス無担保社債	0.29	600,000	590,838	2024/12/5
第171回オリックス株式会社無担保社債	1.126	220,000	225,579	2023/4/28
第175回オリックス株式会社無担保社債	1.064	100,000	102,854	2023/11/24
第180回オリックス株式会社無担保社債	0.797	500,000	512,010	2024/9/4
第181回オリックス株式会社無担保社債	0.812	100,000	102,478	2024/9/26
第197回オリックス株式会社無担保社債	0.19	300,000	299,952	2025/1/30
第11回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.411	500,000	501,380	2021/8/5
第12回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.726	400,000	408,476	2024/8/5
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.25	200,000	200,520	2024/9/13
第17回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.45	300,000	302,382	2028/2/8
第20回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.41	600,000	602,766	2028/8/3
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	400,000	400,072	2023/10/25
第59回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.385	200,000	200,602	2028/5/26
第61回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.35	200,000	200,004	2028/7/12
第77回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.29	600,000	602,352	2023/4/7
第27回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.508	500,000	500,905	2021/2/24
第36回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.355	200,000	200,674	2022/1/21
第16回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.687	400,000	401,232	2021/5/21
第30回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.22	100,000	99,961	2022/8/26
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.723	100,000	100,233	2021/2/25
第50回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	200,000	200,016	2022/8/10
第51回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.34	200,000	200,084	2024/8/9
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	698,691	2023/9/4
第11回オンフナショナルサービス株式会社無担保社債	0.11	400,000	399,384	2022/12/7
第6回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.13	400,000	399,476	2024/7/31
第3回NECキャピタルソリューション株式会社無担保社債	0.29	600,000	598,680	2023/7/13
第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	117,955	2030/12/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第43回三井不動産株式会社無担保社債	1.272	100,000	100,821	2021/6/18
第45回三井不動産株式会社無担保社債	0.997	300,000	304,218	2022/5/24
第46回三井不動産株式会社無担保社債	0.964	100,000	101,549	2022/8/30
第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	117,527	2033/8/2
第56回三井不動産株式会社無担保社債	0.2	400,000	399,860	2024/8/28
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	400,000	399,416	2026/3/13
第67回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	300,132	2029/4/13
第71回三井不動産株式会社無担保社債	0.31	600,000	593,142	2030/4/16
第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	234,712	2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	228,204	2027/9/17
第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.425	300,000	343,824	2027/10/29
第93回三菱地所株式会社無担保社債	2.555	200,000	233,928	2028/7/28
第113回三菱地所株式会社無担保社債	1.067	100,000	103,624	2024/12/27
第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	299,706	2026/12/18
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	298,413	2026/6/18
第125回三菱地所株式会社無担保社債	0.19	700,000	698,118	2025/3/14
第130回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	700,000	693,427	2029/8/3
第94回住友不動産株式会社無担保社債	0.968	300,000	307,230	2023/12/12
第96回住友不動産株式会社無担保社債	0.914	200,000	204,484	2024/3/18
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	200,000	204,550	2024/4/26
第98回住友不動産株式会社無担保社債	0.884	500,000	511,395	2024/6/10
第104回住友不動産株式会社無担保社債	0.826	100,000	102,252	2025/4/28
第108回住友不動産株式会社無担保社債	0.4	500,000	500,310	2027/5/7
第8回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.99	300,000	350,754	2031/9/19
第10回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.75	400,000	407,704	2023/9/20
第11回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.25	200,000	215,838	2028/9/20
第12回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.61	800,000	815,280	2024/9/20
第13回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.09	200,000	216,210	2029/9/20
第13回森トラスト総合リート投資法人無担保社債A債	0.1	700,000	696,654	2023/2/20
第100回東武鉄道株式会社無担保社債	1.1	200,000	204,606	2023/4/25
第102回東武鉄道株式会社無担保社債	1.36	300,000	316,029	2025/10/23
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	600,000	625,278	2026/6/17
第111回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	600,000	602,202	2031/9/5
第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	504,180	2036/12/5
第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	900,000	902,538	2037/9/11
第119回東武鉄道株式会社無担保社債	0.758	500,000	498,745	2038/5/24
第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	778,592	2039/7/22
第123回東武鉄道株式会社無担保社債	0.8	700,000	697,753	2040/4/20
第120回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.61	400,000	401,128	2041/4/22
第31回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.97	500,000	512,780	2024/4/22
第32回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.58	100,000	101,294	2025/1/17
第33回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.43	300,000	301,542	2023/1/27
第34回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.68	300,000	305,559	2026/1/28
第35回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.733	600,000	612,426	2031/6/27
第36回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.7	700,000	708,988	2032/1/30
第37回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.681	700,000	704,172	2033/3/4
第38回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.778	400,000	405,436	2033/9/20
第39回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.495	200,000	201,782	2029/1/25
第40回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.619	700,000	693,392	2034/6/20
第41回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.71	700,000	681,793	2039/10/25
第42回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.6	700,000	708,757	2030/5/22
第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	772,536	2039/9/16
第4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	602,172	2040/6/8
第64回東京急行電鉄株式会社無担保社債	2.7	100,000	107,020	2023/6/6
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	101,525	2022/6/7

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第76回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.563	500,000	544,700	2027/6/7
第78回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.528	400,000	439,200	2028/6/12
第79回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.709	200,000	204,288	2024/4/26
第80回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.211	200,000	216,074	2029/4/27
第82回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.307	600,000	659,772	2033/6/3
第83回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.459	200,000	202,026	2031/4/22
第84回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,036	2036/4/22
第85回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	613,710	2036/9/26
第88回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.723	700,000	707,063	2038/5/28
第38回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.291	600,000	647,160	2028/12/11
第39回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.222	500,000	538,250	2029/6/12
第40回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.804	300,000	307,695	2036/12/1
第41回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.751	700,000	710,731	2037/6/12
第42回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.77	700,000	711,417	2037/12/4
第43回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.676	1,000,000	997,910	2038/7/12
第44回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.576	600,000	585,534	2039/11/28
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	600,000	602,160	2040/6/11
第60回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.846	100,000	101,571	2022/10/18
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	500,000	519,340	2025/12/12
第68回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.098	600,000	646,428	2030/6/12
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	503,685	2036/8/29
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	716,079	2037/5/29
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	611,328	2037/11/30
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	800,000	817,280	2038/8/30
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	700,000	705,677	2028/12/20
第83回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.209	400,000	399,120	2029/6/20
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	593,400	2039/6/20
第88回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.73	800,000	807,720	2040/4/23
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	115,253	2027/11/29
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	1.199	400,000	403,872	2021/7/28
第34回京王電鉄株式会社無担保社債	0.32	300,000	302,562	2026/3/10
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	102,354	2031/3/10
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	504,480	2027/9/17
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	615,420	2037/9/18
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	0.295	100,000	100,674	2027/11/29
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	510,240	2037/11/27
第40回京王電鉄株式会社無担保社債	0.205	600,000	597,276	2030/1/30
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	404,224	2040/5/25
第48回京成電鉄株式会社無担保社債	1.004	200,000	204,884	2023/7/25
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	596,610	2031/6/20
第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	612,798	2038/9/7
第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	1,011,860	2039/3/8
第54回京成電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	402,136	2040/6/12
第57回京成電鉄株式会社無担保社債	0.7	400,000	401,816	2040/8/31
第28回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.47	100,000	125,722	2033/9/20
第45回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.55	100,000	114,090	2026/7/17
第47回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.46	100,000	113,936	2026/9/18
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.26	500,000	569,085	2027/4/16
第51回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	231,032	2027/9/17
第55回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.357	100,000	116,931	2028/7/25
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	300,000	353,340	2028/12/12
第65回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.149	300,000	352,896	2029/12/21
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.249	300,000	356,952	2030/3/22
第71回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.905	400,000	465,780	2030/9/27
第73回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.098	100,000	118,578	2030/12/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	200,000	218,756	2026/12/22
第86回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.732	300,000	347,106	2032/7/23
第91回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.751	300,000	348,792	2032/12/27
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.757	300,000	307,098	2024/1/30
第103回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	400,000	455,736	2034/7/25
第106回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.981	100,000	107,091	2035/1/29
第120回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.675	500,000	511,685	2037/1/27
第124回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.713	300,000	308,256	2037/7/27
第127回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.675	700,000	715,001	2038/1/26
第143回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.444	800,000	780,480	2039/12/23
第15回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	200,000	230,220	2027/12/20
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	116,832	2028/3/17
第21回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.247	300,000	351,552	2029/3/21
第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.175	200,000	234,966	2029/9/18
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.262	200,000	238,100	2030/3/12
第28回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.111	800,000	943,424	2030/6/11
第35回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.836	300,000	307,179	2023/9/27
第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	229,180	2034/6/20
第38回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.288	400,000	444,788	2034/12/12
第40回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.21	400,000	440,700	2035/8/31
第41回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.816	200,000	209,654	2036/2/26
第44回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.175	500,000	501,710	2026/12/11
第45回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.604	700,000	708,855	2036/12/12
第61回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.591	800,000	799,432	2040/5/21
第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	101,000	104,350	2022/2/15
第9回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.31	300,000	344,889	2027/9/17
第34回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.3	300,000	346,065	2027/12/20
第37回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	233,822	2028/5/22
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	800,000	930,504	2029/1/29
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.312	200,000	235,836	2029/4/24
第46回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.157	100,000	117,689	2029/12/18
第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	300,000	356,247	2030/4/23
第58回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.895	200,000	234,284	2031/12/16
第63回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.725	200,000	232,516	2033/5/24
第65回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.786	500,000	586,220	2033/9/13
第69回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	600,000	683,646	2034/7/28
第70回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.309	100,000	111,005	2032/9/30
第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	700,000	785,617	2034/11/28
第74回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.014	700,000	753,221	2035/1/26
第75回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.196	100,000	110,064	2035/4/20
第76回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.297	100,000	111,484	2035/6/16
第77回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.221	100,000	110,252	2035/8/31
第78回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.018	200,000	215,372	2036/1/25
第79回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.421	500,000	494,685	2036/4/14
第2回東京地下鉄株式会社社債	2.26	100,000	108,581	2024/6/20
第6回東京地下鉄株式会社社債	2.43	100,000	115,792	2027/9/17
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	200,000	230,852	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	500,000	593,955	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	115,288	2032/5/25
第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	116,754	2033/6/14
第16回東京地下鉄株式会社社債	0.748	300,000	312,648	2036/3/11
第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	684,509	2036/6/20
第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	700,000	714,112	2037/6/19
第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	611,832	2037/12/15
第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	101,419	2038/5/24

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第38回東京地下鉄株式会社社債	0.445	600,000	584,880	2040/1/31
第41回東京地下鉄株式会社社債	0.275	300,000	301,716	2030/6/12
第1回株式会社西武ホールディングス社債	0.758	600,000	607,932	2032/3/17
第2回株式会社西武ホールディングス社債	0.67	500,000	500,600	2032/12/6
第3回株式会社西武ホールディングス社債	0.445	700,000	703,080	2028/12/6
第4回株式会社西武ホールディングス社債	0.27	600,000	591,252	2028/12/12
第2回株式会社鴻池運輸社債	0.18	300,000	299,694	2022/3/2
第44回西日本鉄道株式会社社債	0.345	600,000	601,536	2026/3/4
第45回西日本鉄道株式会社社債	0.717	700,000	717,598	2031/3/4
第46回西日本鉄道株式会社社債	0.69	700,000	700,070	2036/9/9
第47回西日本鉄道株式会社社債	0.903	700,000	721,147	2037/4/14
第48回西日本鉄道株式会社社債	0.782	500,000	504,740	2037/9/4
第50回西日本鉄道株式会社社債	0.395	700,000	701,099	2028/9/6
第51回西日本鉄道株式会社社債	0.672	700,000	688,345	2039/5/30
第90回近鉄グループホールディングス社債	0.8	500,000	501,545	2031/9/2
第72回近鉄グループホールディングス社債	0.772	700,000	697,179	2032/7/27
第106回近鉄グループホールディングス社債	0.505	700,000	701,505	2028/1/25
第111回近鉄グループホールディングス社債	0.955	700,000	682,444	2038/7/26
第112回近鉄グループホールディングス社債	0.47	800,000	791,344	2029/7/11
第116回近鉄グループホールディングス社債	0.22	400,000	398,648	2025/1/30
第117回近鉄グループホールディングス社債	0.91	900,000	863,946	2040/1/30
第160回阪急ホールディングス社債	0.819	600,000	613,014	2023/10/25
第171回阪急ホールディングス社債	1.202	500,000	541,060	2029/7/18
第19回阪急ホールディングス社債	0.817	800,000	824,512	2036/12/15
第51回阪急ホールディングス社債	0.789	700,000	714,581	2038/9/13
第52回阪急ホールディングス社債	0.215	500,000	497,780	2029/11/21
第54回阪急ホールディングス社債	0.486	800,000	772,176	2040/2/27
第37回南海電気鉄道株式会社社債	0.87	200,000	204,886	2024/7/29
第40回南海電気鉄道株式会社社債	0.841	600,000	616,416	2031/6/3
第41回南海電気鉄道株式会社社債	0.7	700,000	707,021	2031/12/8
第42回南海電気鉄道株式会社社債	0.647	600,000	600,498	2032/5/28
第43回南海電気鉄道株式会社社債	0.941	700,000	710,171	2037/11/30
第44回南海電気鉄道株式会社社債	0.878	800,000	801,704	2038/5/21
第45回南海電気鉄道株式会社社債	0.871	700,000	714,091	2033/12/6
第46回南海電気鉄道株式会社社債	0.69	500,000	483,315	2039/11/28
第47回南海電気鉄道株式会社社債	0.48	300,000	300,987	2030/6/4
第24回京阪電気鉄道株式会社社債	1.7	300,000	310,245	2022/12/9
第25回京阪電気鉄道株式会社社債	1.34	100,000	101,000	2021/7/20
第28回京阪電気鉄道株式会社社債	0.725	800,000	818,016	2025/9/1
第29回京阪ホールディングス社債	0.34	600,000	600,786	2026/6/16
第30回京阪ホールディングス社債	0.74	700,000	698,992	2038/7/16
第31回京阪ホールディングス社債	0.455	200,000	200,974	2029/1/24
第32回京阪ホールディングス社債	0.63	700,000	681,422	2039/12/16
第50回名古屋鉄道株式会社社債	0.857	200,000	207,000	2027/4/30
第52回名古屋鉄道株式会社社債	0.75	600,000	605,658	2036/8/29
第53回名古屋鉄道株式会社社債	0.85	600,000	618,324	2035/2/28
第54回名古屋鉄道株式会社社債	0.806	700,000	710,094	2037/5/29
第55回名古屋鉄道株式会社社債	0.79	600,000	606,030	2037/12/4
第56回名古屋鉄道株式会社社債	0.748	600,000	600,360	2038/5/25
第57回名古屋鉄道株式会社社債	0.863	500,000	509,005	2038/9/10
第58回名古屋鉄道株式会社社債	0.725	800,000	793,616	2039/4/25
第59回名古屋鉄道株式会社社債	0.53	400,000	382,928	2039/9/5
第7回日本通運株式会社社債	1.09	100,000	100,979	2021/10/20
第9回日本通運株式会社社債	0.28	600,000	598,806	2026/2/25
第10回日本通運株式会社社債	0.12	300,000	299,001	2023/7/14

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第11回日本通運株式会社社債	0.2	300,000	297,750	2026/7/14
第14回日本通運株式会社社債	0.28	300,000	300,690	2027/6/16
第5回ニコソホールディングス社債	0.614	700,000	700,700	2020/12/18
第7回ニコソホールディングス社債	0.28	400,000	392,908	2029/10/11
第9回ニコソホールディングス社債	0.42	800,000	801,184	2030/9/18
第3回株式会社日立物流社債	0.1	600,000	599,052	2021/9/28
第7回株式会社日立物流社債	0.405	600,000	596,802	2028/9/4
第2回横浜高速鉄道株式会社社債	0.455	200,000	201,246	2027/2/23
第3回横浜高速鉄道株式会社社債	0.39	400,000	400,444	2028/2/28
第4回横浜高速鉄道株式会社社債	0.445	700,000	703,087	2028/12/14
第5回横浜高速鉄道株式会社社債	0.3	800,000	789,760	2029/12/11
第6回横浜高速鉄道株式会社社債	0.45	500,000	500,735	2030/9/17
第1回九州旅客鉄道株式会社社債	0.295	600,000	602,250	2029/3/7
第3回九州旅客鉄道株式会社社債	0.23	300,000	298,797	2029/12/10
第4回九州旅客鉄道株式会社社債	0.51	400,000	389,500	2039/12/9
第6回九州旅客鉄道株式会社社債	0.29	400,000	399,824	2030/6/7
第7回九州旅客鉄道株式会社社債	0.691	500,000	501,460	2040/6/8
第1回日本航空株式会社社債	0.47	700,000	673,652	2026/12/18
第2回日本航空株式会社社債	0.17	600,000	594,942	2021/12/20
第3回日本航空株式会社社債	0.399	500,000	471,850	2028/9/21
第5回日本航空株式会社社債	0.22	500,000	488,115	2024/3/19
第7回日本航空株式会社社債	0.28	800,000	735,888	2029/12/14
第30回ANAホールディングス社債	1.2	700,000	696,843	2026/9/18
第15回三菱倉庫株式会社社債	0.734	500,000	508,415	2024/3/12
第16回三菱倉庫株式会社社債	0.31	300,000	299,268	2024/12/6
第17回三菱倉庫株式会社社債	0.24	500,000	499,660	2027/12/8
第18回三菱倉庫株式会社社債	0.22	700,000	689,150	2029/12/5
第19回三菱倉庫株式会社社債	0.61	400,000	388,712	2039/12/1
第3回株式会社住友倉庫社債	0.366	500,000	501,395	2022/12/16
第4回株式会社住友倉庫社債	0.639	300,000	304,728	2025/12/17
第5回株式会社住友倉庫社債	0.21	400,000	398,248	2025/3/26
第6回株式会社住友倉庫社債	0.838	700,000	710,164	2038/3/26
第7回株式会社住友倉庫社債	0.08	200,000	198,502	2024/9/24
第8回株式会社住友倉庫社債	0.21	600,000	588,094	2029/9/21
第1回朝日放送グループホールディングス社債	0.16	200,000	198,994	2024/9/2
第63回日本電信電話株式会社社債	0.69	500,000	505,860	2033/3/20
第20回KDD I株式会社社債	0.803	700,000	714,875	2023/12/20
第21回KDD I株式会社社債	0.669	500,000	510,110	2024/9/20
第22回KDD I株式会社社債	0.31	700,000	699,482	2028/7/12
第24回KDD I株式会社社債	0.25	700,000	700,973	2025/11/21
第25回KDD I株式会社社債	0.395	400,000	401,916	2028/11/21
第26回KDD I株式会社社債	0.13	100,000	99,914	2024/4/26
第27回KDD I株式会社社債	0.23	700,000	697,809	2026/4/24
第29回KDD I株式会社社債	0.02	800,000	798,080	2022/11/29
第20回株式会社NTTドコモ社債	0.73	400,000	406,132	2023/9/20
第22回沖縄電力株式会社社債	0.996	300,000	305,175	2022/6/24
第23回沖縄電力株式会社社債	0.469	200,000	203,488	2025/3/25
第25回沖縄電力株式会社社債	0.25	700,000	703,969	2027/6/25
第26回沖縄電力株式会社社債	0.28	700,000	704,529	2028/12/23
第27回沖縄電力株式会社社債	0.19	800,000	795,984	2030/3/25
第38回電源開発株式会社社債	0.978	300,000	308,517	2023/12/20
第39回電源開発株式会社社債	0.929	200,000	205,572	2024/2/20
第40回電源開発株式会社社債	0.889	200,000	205,694	2024/6/20
第49回電源開発株式会社社債	0.4	300,000	302,739	2027/5/20
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.85	200,000	202,522	2027/8/31

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第26回東京瓦斯株式会社無担保社債	2.29	100,000	108,174	2024/5/27
第35回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.852	400,000	466,860	2031/12/26
第36回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.737	400,000	462,720	2032/5/25
第37回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.764	300,000	351,051	2033/9/26
第39回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.554	700,000	803,208	2034/5/26
第41回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.57	700,000	705,894	2036/11/28
第43回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.67	700,000	715,057	2037/6/9
第46回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.58	700,000	702,856	2038/7/20
第48回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.704	300,000	306,681	2038/11/29
第52回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.486	1,000,000	984,990	2039/5/23
第55回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.28	800,000	758,976	2039/9/13
第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.606	400,000	460,928	2034/3/24
第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.402	600,000	676,584	2034/10/24
第31回東邦瓦斯株式会社無担保社債	2.06	600,000	617,538	2022/3/18
第36回東邦瓦斯株式会社無担保社債	1.628	300,000	326,583	2027/3/19
第38回東邦瓦斯株式会社無担保社債	0.933	500,000	511,340	2023/7/12
第13回広島ガス株式会社無担保社債	0.405	600,000	601,638	2028/9/13
第16回西部瓦斯株式会社無担保社債	0.355	700,000	702,541	2028/12/13

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第3回東京都競馬株式会社無担保社債	0.18	700,000	698,467	2023/7/5
第5回SCSK株式会社無担保社債	0.14	500,000	499,565	2021/12/15
第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	600,000	598,848	2022/7/21
第1回日鉄住金物産株式会社無担保社債	0.15	400,000	398,984	2023/3/3
第3回日鉄住金物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	198,904	2025/6/13
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	600,000	604,410	2022/12/16
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.749	800,000	819,672	2025/12/18
第5回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.11	300,000	299,277	2023/6/6
第6回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.22	400,000	399,660	2025/6/6
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	900,000	902,718	2028/6/6
小 計		426,307,000	433,399,580	
合 計		672,358,863	702,571,116	

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
コマーシャル・ペーパー	千円 4,999,629	% 0.7

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

○投資信託財産の構成

(2020年9月23日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 702,571,116	% 98.5
その他有価証券	4,999,629	0.7
コール・ローン等、その他	5,997,205	0.8
投資信託財産総額	713,567,950	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年9月23日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	713,567,950,959
コール・ローン等	4,525,748,075
公社債(評価額)	702,571,116,509
其他有価証券	4,999,629,098
未収入金	302,838,000
未収利息	1,165,943,489
前払費用	2,675,788
(B) 負債	3,836,526,120
未払金	900,000,000
未払解約金	2,936,517,798
未払利息	8,322
(C) 純資産総額(A-B)	709,731,424,839
元本	580,322,215,319
次期繰越損益金	129,409,209,520
(D) 受益権総口数	580,322,215,319口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,230円

(注) 当親ファンドの期首元本額は524,452,392,259円、期中追加設定元本額は205,102,839,473円、期中一部解約元本額は149,233,016,413円です。

(元本の内訳)

東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)	379,258,225,248円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)	165,576,557,441円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)	30,076,882,199円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(年2回決算型)	5,235,083,504円
TMA債券バランスファンド<適格機関投資家限定>	175,466,927円

(注) 上記表中の次期繰越損益金が△表示の場合は、当該金額が投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額(元本の欠損)となります。

(注) 上記表中の1万口当たり基準価額が、投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第11号に規定する計算口数当たりの純資産の額となります。

○損益の状況 (2019年9月25日～2020年9月23日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	5,125,626,091
受取利息	5,130,443,390
支払利息	△ 4,817,299
(B) 有価証券売買損益	△ 15,295,962,630
売買益	102,731,225
売買損	△ 15,398,693,855
(C) 当期損益金(A+B)	△ 10,170,336,539
(D) 前期繰越損益金	126,244,711,982
(E) 追加信託差損益金	47,063,085,109
(F) 解約差損益金	△ 33,728,251,032
(G) 計(C+D+E+F)	129,409,209,520
次期繰越損益金(G)	129,409,209,520

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (E)追加信託差損益金は、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です。

(注) (F)解約差損益金は、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分です。

○お知らせ

- ・弊社ホームページアドレスを一部変更したことに伴い、2019年10月1日付で所要の約款変更を行いました。
- ・2019年10月24日付で、信託金の限度額を2兆円とする約款変更を行いました。