

東京海上・円資産バランスファンド

(毎月決算型)

＜愛称 円奏会＞

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／資産複合 (課税上は株式投資信託として取扱われます。)	
信託期間	2012年11月9日から2032年7月23日	
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。	
主要投資対象	東京海上・円資産 バランスファンド (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」、「東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド」、「TMA日本REIT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。
	東京海上・高配当 低ボラティリティ 日本株マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
	TMA日本REIT マザーファンド	わが国の不動産投資信託証券(J-REIT)を主要投資対象とします。
投資制限	東京海上・円資産 バランスファンド (毎月決算型)	・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。 ・外貨建資産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。
	東京海上・円建て 投資適格債券 マザーファンド	・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。
	東京海上・高配当 低ボラティリティ 日本株マザーファンド	・株式への投資割合には、制限を設けません。 ・外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
	TMA日本REIT マザーファンド	・株式への直接投資は行いません。 ・外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	第1回目から第5回目の決算時には、分配を行いません。第6回目以降の毎決算時に、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、基準価額の水増し、市況動向等を勘案して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。	

運用報告書 (全体版)

第94期 (決算日 2020年8月24日)
第95期 (決算日 2020年9月23日)
第96期 (決算日 2020年10月23日)
第97期 (決算日 2020年11月24日)
第98期 (決算日 2020年12月23日)
第99期 (決算日 2021年1月25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・円資産バランスファンド(毎月決算型)＜愛称 円奏会＞」は、このたび、第99期の決算を行いましたので、第94期～第99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/>

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 準 (分配落)	価 額			株 式 債 券 組 入 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 期 騰	中 落 率			
	円	円	%	%	%	%	百万円
70期(2018年8月23日)	11,355	30	△0.8	14.2	70.1	14.7	427,756
71期(2018年9月25日)	11,406	30	0.7	15.0	69.2	14.6	442,982
72期(2018年10月23日)	11,277	30	△0.9	13.8	70.5	14.8	449,988
73期(2018年11月26日)	11,353	30	0.9	14.1	69.2	14.8	467,256
74期(2018年12月25日)	11,125	30	△1.7	13.1	71.4	14.4	473,892
75期(2019年1月23日)	11,300	30	1.8	14.9	69.1	15.1	495,361
76期(2019年2月25日)	11,392	30	1.1	14.7	69.6	14.7	518,921
77期(2019年3月25日)	11,394	30	0.3	14.2	70.0	14.9	534,416
78期(2019年4月23日)	11,331	30	△0.3	14.5	69.9	14.7	550,112
79期(2019年5月23日)	11,337	30	0.3	14.3	69.7	15.1	567,341
80期(2019年6月24日)	11,343	30	0.3	14.4	69.7	14.6	590,713
81期(2019年7月23日)	11,386	30	0.6	14.6	69.2	15.0	611,596
82期(2019年8月23日)	11,439	30	0.7	14.5	69.7	15.1	628,835
83期(2019年9月24日)	11,570	30	1.4	15.5	68.6	14.9	652,624
84期(2019年10月23日)	11,610	30	0.6	15.0	68.4	15.1	673,454
85期(2019年11月25日)	11,584	30	0.0	14.8	68.3	14.3	696,370
86期(2019年12月23日)	11,455	30	△0.9	15.0	68.8	14.2	712,993
87期(2020年1月23日)	11,509	30	0.7	14.8	67.5	14.9	734,427
88期(2020年2月25日)	11,447	30	△0.3	14.2	68.7	14.8	746,008
89期(2020年3月23日)	10,367	30	△9.2	8.1	68.2	7.6	668,122
90期(2020年4月23日)	10,536	30	1.9	3.4	67.5	3.7	672,787
91期(2020年5月25日)	10,523	30	0.2	3.6	67.8	3.8	671,593
92期(2020年6月23日)	10,507	30	0.1	3.8	68.2	3.8	673,085
93期(2020年7月27日)	10,464	30	△0.1	3.8	68.6	3.8	669,774
94期(2020年8月24日)	10,446	30	0.1	3.9	68.8	3.8	665,880
95期(2020年9月23日)	10,426	30	0.1	4.9	69.5	4.7	661,116
96期(2020年10月23日)	10,342	30	△0.5	8.6	69.9	8.6	651,826
97期(2020年11月24日)	10,394	30	0.8	11.2	68.8	10.7	648,837
98期(2020年12月23日)	10,384	30	0.2	11.5	69.5	11.5	642,329
99期(2021年1月25日)	10,423	30	0.7	13.6	69.4	13.6	640,580

(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、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

(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。

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

当ファンドにベンチマークはなく、また当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる指数もないため、ベンチマーク、参考指数を記載していません。

○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	株 組 入 比 率	債 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率
			騰 落 率			
第94期	(期 首) 2020年 7 月27日	円 10,464	% —	% 3.8	% 68.6	% 3.8
	7 月末	10,456	△0.1	3.6	68.7	3.8
	(期 末) 2020年 8 月24日	10,476	0.1	3.9	68.8	3.8
第95期	(期 首) 2020年 8 月24日	10,446	—	3.9	68.8	3.8
	8 月末	10,437	△0.1	3.9	68.9	3.9
	(期 末) 2020年 9 月23日	10,456	0.1	4.9	69.5	4.7
第96期	(期 首) 2020年 9 月23日	10,426	—	4.9	69.5	4.7
	9 月末	10,433	0.1	6.6	69.4	6.7
	(期 末) 2020年10月23日	10,372	△0.5	8.6	69.9	8.6
第97期	(期 首) 2020年10月23日	10,342	—	8.6	69.9	8.6
	10 月末	10,297	△0.4	8.4	70.0	8.4
	(期 末) 2020年11月24日	10,424	0.8	11.2	68.8	10.7
第98期	(期 首) 2020年11月24日	10,394	—	11.2	68.8	10.7
	11 月末	10,363	△0.3	10.9	69.1	10.8
	(期 末) 2020年12月23日	10,414	0.2	11.5	69.5	11.5
第99期	(期 首) 2020年12月23日	10,384	—	11.5	69.5	11.5
	12 月末	10,445	0.6	13.4	69.0	13.4
	(期 末) 2021年 1 月25日	10,453	0.7	13.6	69.4	13.6

(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、「株式組入比率」は実質比率を記載しています。

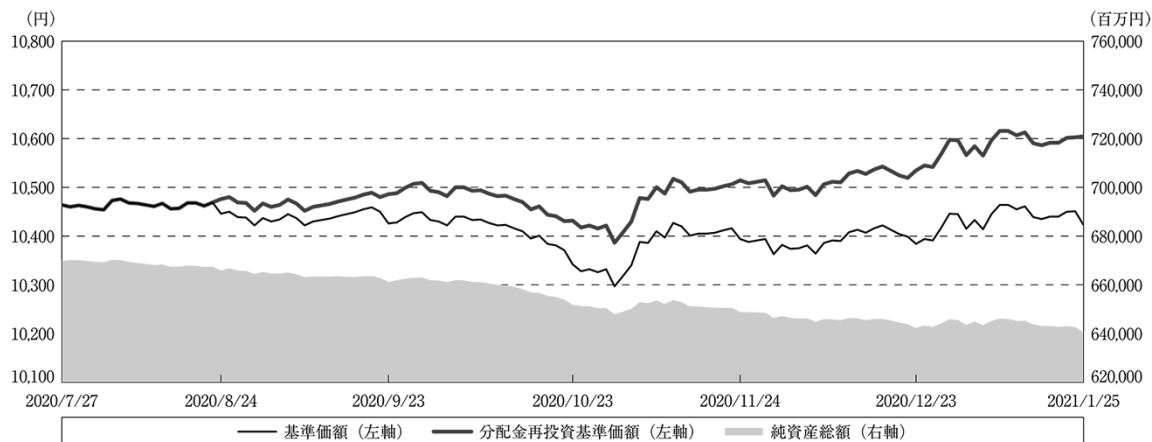
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

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

○運用経過

(2020年7月28日～2021年1月25日)

■作成期間中の基準価額等の推移



第94期首：10,464円

第99期末：10,423円（既払分配金(税込み)：180円）

騰落率：1.3%（分配金再投資ベース）

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

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

(注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2020年7月27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。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

【日本債券】

- ・日銀による資金繰り支援策の期限延長などを背景に、社債の信用スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）が縮小したこと

【日本株式】

- ・企業業績の回復が確認されたこと
- ・米国大統領選挙を巡る政治的な不確実性が低下し、バイデン新政権による大規模な財政支援策への期待が高まったこと

【日本REIT】

- ・J-REITの過度な業績懸念が後退したこと

【日本株式・日本REIT】

- ・新型コロナウイルスワクチン接種の進展への期待が高まったこと

マイナス要因

【日本債券】

- ・安倍首相の辞任を受けて、日銀による金融政策の継続性への懸念が一時的に高まったこと

【日本株式】

- ・米国大統領選挙への不透明感が高まったこと

【日本REIT】

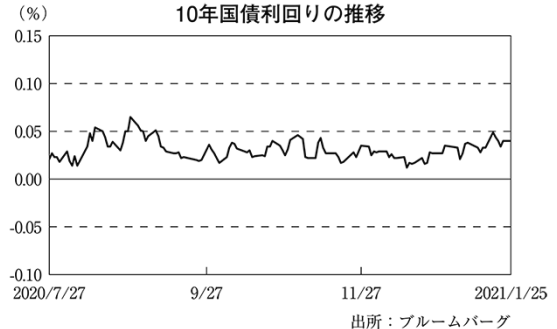
- ・J-REITの主要銘柄の増資発表を受けて需給環境の悪化が懸念されたこと

■投資環境

【日本債券市場】

当作成期初0.02%程度の水準であった10年国債利回りは、2020年8月の安倍首相の辞任報道を受けて、日銀による金融政策の継続性への懸念などから一時0.06%程度まで上昇しました。その後、菅首相の就任により安倍政権下での経済政策が維持される見通しとなったことで、金融政策を巡る懸念が後退し、10年国債利回りは当作成期初の水準まで低下しました。当作成期末にかけては、米国の財政支出拡大に伴う国債増発への懸念などを背景とした米国債利回りの上昇を受けて、10年国債利回りは再度上昇する場面もありましたが、その後低下して0.04%程度の水準で当作成期を終えました。

当作成期の社債の信用スプレッドは、日銀による資金繰り支援策の期限延長などを背景に、前作成期末対比縮小しました。



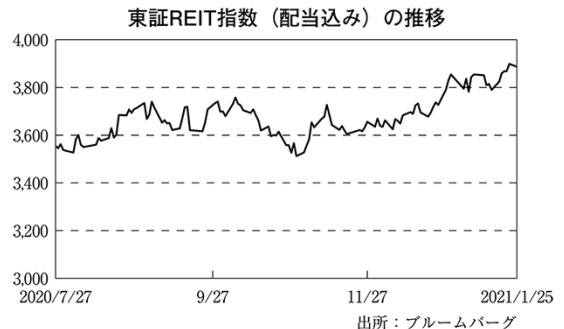
【日本株式市場】

当作成期初は、新型コロナウイルスワクチンの開発とともに経済活動が正常化へ向かうとの期待が高まる一方で、米国連邦議会で追加経済対策を巡る与野党協議が難航したことや、米国大統領選挙への不透明感が高まったことなどを背景に、株式市場は振れを伴いながらも横ばいで推移しました。その後、企業業績の底打ちが確認されたことに加え、米国大統領選挙を通過したことで政治的な不確実性が低下しバイデン新政権による大規模な財政支援策が好感されたことや、欧米の製薬会社が開発中の新型コロナウイルスワクチンの治験で良好な結果が示され接種進展への期待などから世界的に株式市場は上昇し、前作成期末対比上昇した水準で当作成期を終えました。



【日本REIT市場】

当作成期初から2020年9月末にかけては、新型コロナウイルス感染拡大の影響に対する過度な懸念が後退したことなどから、日本REIT市場は上昇しました。10月は、J-REITの主要銘柄が大規模な増資を発表したことを受けて需給環境の悪化が懸念され、日本REIT市場は下落しましたが、当作成期末にかけて、新型コロナウイルスワクチン接種の進展への期待から日本REIT市場は上昇し、前作成期末対比上昇した水準で当作成期を終えました。



■ポートフォリオについて

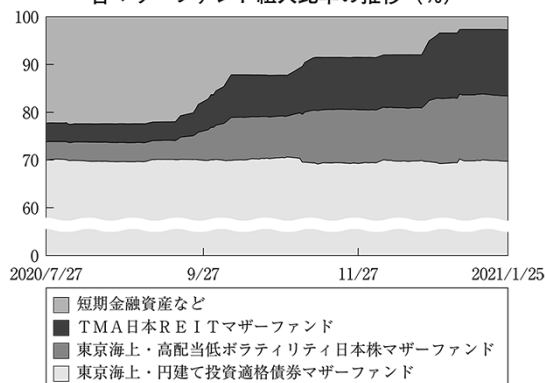
＜東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)＞

マザーファンドへの投資を通じて、日本債券70%、日本株式15%、日本REIT15%の資産配分比率を基本としますが、基準価額の変動リスクが大きくなった場合は、日本株式と日本REITの資産配分比率を引き下げて運用を行います。

当作成期は、市場環境が徐々に落ち着いてきたことから、リスク資産（日本株式と日本REITの合計）の配分比率を段階的に引き上げ、当作成期末での日本株式と日本REITの資産配分比率はそれぞれ14%程度となりました。

以上の運用の結果、主に日本株式、日本REITの上昇がプラス寄与し、当ファンドの基準価額（税引前分配金再投資）は1.3%上昇しました。

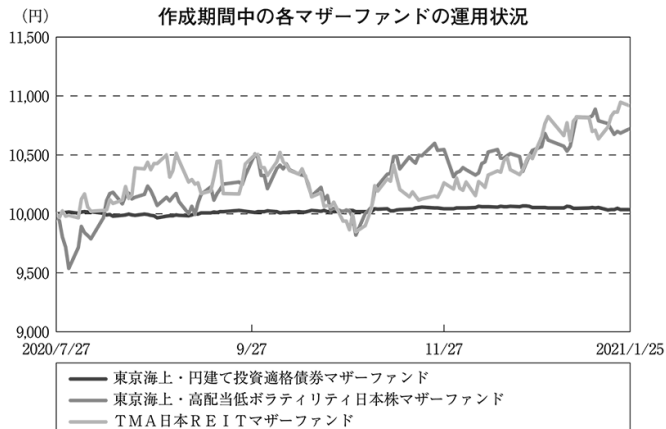
各マザーファンド組入比率の推移（%）



※比率は、純資産総額（一部の未払金の計上を除く）に占める割合です。

各資産の運用は、「東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド」「東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド」「TMA日本REITマザーファンド」にて行っています。

各マザーファンドにおける当作成期の運用経過は以下の通りです。



※各マザーファンドは2020年7月27日を10,000円として指数化したものです。

期間中の騰落率（%）

東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	
	0.4
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	
	7.2
TMA日本REITマザーファンド	
	9.1

＜東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド＞

ポートフォリオ利回りの維持・向上に配慮しながら、社債（金融機関劣後債、生保基金債等を含む）を中心とした投資を行いました。銘柄選択にあたっては、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銘柄分散を図るとともに、信用力に応じた残存年限を選択しました。

なお、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-」で変化ありません。以上の運用結果、当作成期は社債利回りが低下したことから、基準価額は0.4%上昇しました。

＜東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド＞

ポートフォリオ全体の配当利回りを高めつつ、価格変動リスクがTOPIX（東証株価指数）に比べて低くなるようなポートフォリオを構築しました。

当作成期の日本株式市場では、当ファンドで多く保有する価格変動リスクがTOPIXに比べて低い低ボラティリティ株のパフォーマンスは相対的に劣化する結果となりました。また、内需関連業種の銘柄を多く保有していることもマイナス要因となり、基準価額は7.2%上昇したものの、参考指数であるTOPIX（配当込み）の騰落率（+19.3%）を下回りました。なお、価格変動リスクはTOPIXよりも低い水準を維持しました。

＜TMA日本REITマザーファンド＞

日本REITの市場流動性（流動性基準）とスポンサー企業の信用力や財務健全性（信用リスク基準）に基づいて絞り込んだ銘柄を対象として、時価加重比率と売買金額加重比率を合成したポートフォリオを構築し、日本REITの組入比率を高位に維持して運用を行いました。

以上の運用の結果、当作成期は日本REIT市場全体の上昇を受けて基準価額が9.1%上昇し、参考指数である東証REIT指数（配当込み）並みのパフォーマンスとなりました。

■当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けていません。

また、当ファンドの運用方針に対して適切に比較できる参考指数もないため、記載する事項はありません。

■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、1万口当たり、税込み）

項 目	第94期	第95期	第96期	第97期	第98期	第99期
	2020年7月28日～ 2020年8月24日	2020年8月25日～ 2020年9月23日	2020年9月24日～ 2020年10月23日	2020年10月24日～ 2020年11月24日	2020年11月25日～ 2020年12月23日	2020年12月24日～ 2021年1月25日
当期分配金 (対基準価額比率)	30 0.286%	30 0.287%	30 0.289%	30 0.288%	30 0.288%	30 0.287%
当期の収益	3	—	—	—	—	—
当期の収益以外	26	30	30	30	30	30
翌期繰越分配対象額	1,601	1,575	1,549	1,525	1,500	1,480

（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四捨五入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・円資産バランスファンド（毎月決算型）＞

マザーファンドへの投資を通じて、日本債券70%、日本株式15%、日本REIT15%の資産配分比率を基本とし、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保を目指して運用を行います。

当作成期末時点では基準価額の変動リスクが落ち着いてきていたことから、日本株式と日本REITへの資産配分比率は合計28%程度となりましたが、今後も基準価額の変動リスクを一定の水準に抑制することを目標として、日本株式と日本REITの資産配分比率をコントロールする方針です。

各マザーファンドにおける今後の運用方針は以下の通りです。

＜東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド＞

引き続き個別企業の信用力分析を重視し、相対的に信用力が高いと思われる銘柄でポートフォリオを構築していきます。また、残存期間と銘柄の分散ならびに流動性の確保に留意しながら、安定運用を行う方針です。

＜東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド＞

今後も日本の株式を主要投資対象とし、流動性や信用リスクなどを勘案して選定した銘柄に投資します。ポートフォリオ全体の配当利回りを高める戦略と価格変動リスクを低く抑える戦略を組み合わせることで、ポートフォリオ全体の価格変動リスクをTOPIXの価格変動リスクより低く抑えながら、中長期的にTOPIXと同程度のリターンを目指します。

＜TMA日本REITマザーファンド＞

今後も、日本REITの市場流動性とスポンサー企業の信用力や財務健全性に基づいて絞り込んだ銘柄を対象として、時価加重比率と売買金額加重比率を合成したポートフォリオを構築し、中長期的に日本REIT市場全体の動きをおおむね捉える運用を機動的に行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年7月28日～2021年1月25日)

項 目	第94期～第99期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 48	% 0.461	(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)	(23)	(0.225)	* 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)	(23)	(0.225)	* 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) 売 買 委 託 手 数 料	1	0.005	(b) 売買委託手数料＝作成期間の売買委託手数料÷作成期間の平均受益権口数
(株 式)	(0)	(0.000)	* 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投 資 信 託 証 券)	(1)	(0.005)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.000	(c) 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)	(0.000)	* 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	49	0.466	
作成期間の平均基準価額は、10,405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。

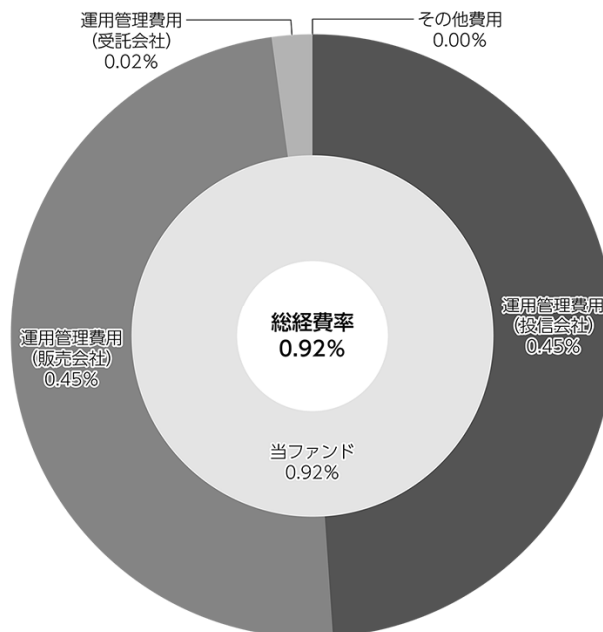
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.92%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7月28日～2021年1月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第94期～第99期			
	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 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	21,756,491	26,621,323	41,127,915	50,301,168
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	24,373,762	63,745,943	2,256,523	5,950,855
TMA日本REITマザーファンド	25,337,586	63,272,868	2,545,017	6,354,395

○株式売買比率

(2020年7月28日～2021年1月25日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	第94期～第99期
	東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド
(a) 当作成期中の株式売買金額	108,953,377千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	73,138,634千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.48

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2020年7月28日～2021年1月25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

(2021年1月25日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第93期末	第99期末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	384,617,277	365,245,852	447,133,972
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	10,104,786	32,222,025	87,817,907
TMA日本REITマザーファンド	10,814,425	33,606,994	88,682,136

○投資信託財産の構成

(2021年1月25日現在)

項 目	第99期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	447,133,972	69.4
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド	87,817,907	13.6
TMA日本REITマザーファンド	88,682,136	13.8
コール・ローン等、その他	20,941,226	3.2
投資信託財産総額	644,575,241	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第94期末	第95期末	第96期末	第97期末	第98期末	第99期末
	2020年8月24日現在	2020年9月23日現在	2020年10月23日現在	2020年11月24日現在	2020年12月23日現在	2021年1月25日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	669,242,189,622	664,665,216,532	655,620,489,514	652,526,059,693	646,536,202,327	644,575,241,724
コール・ローン等	149,784,964,159	133,348,646,653	79,986,204,291	55,389,259,221	45,046,416,779	17,052,335,648
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド(評価額)	464,005,175,892	463,832,809,478	458,543,974,550	449,805,534,026	448,290,635,750	447,133,972,789
東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド(評価額)	26,734,888,557	32,897,685,245	56,892,411,695	73,404,067,800	74,624,600,201	87,817,907,461
TMA日本REITマザーファンド(評価額)	26,109,003,036	31,780,227,103	56,866,898,155	70,552,498,324	74,702,957,299	88,682,136,619
未収入金	2,608,157,978	2,805,848,053	3,331,000,823	3,374,700,322	3,871,592,298	3,888,889,207
(B) 負債	3,361,328,457	3,549,146,098	3,793,782,034	3,688,130,179	4,206,299,110	3,994,621,972
未払収益分配金	1,912,317,777	1,902,382,187	1,890,863,775	1,872,722,557	1,855,751,304	1,843,712,982
未払解約金	974,706,136	1,142,109,053	1,401,582,327	1,287,922,017	1,875,882,778	1,612,602,742
未払信託報酬	473,992,735	504,354,643	501,249,113	527,375,929	474,580,643	538,241,872
未払利息	256,809	245,215	31,819	54,676	29,385	9,376
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)	665,880,861,165	661,116,070,434	651,826,707,480	648,837,929,514	642,329,903,217	640,580,619,752
元本	637,439,259,120	634,127,395,847	630,287,925,251	624,240,852,502	618,583,768,003	614,570,994,040
次期繰越損益金	28,441,602,045	26,988,674,587	21,538,782,229	24,597,077,012	23,746,135,214	26,009,625,712
(D) 受益権総口数	637,439,259,120口	634,127,395,847口	630,287,925,251口	624,240,852,502口	618,583,768,003口	614,570,994,040口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,446円	10,426円	10,342円	10,394円	10,384円	10,423円

(注) 当ファンドの第94期首元本額は640,051,172,057円、第94～99期中追加設定元本額は21,914,446,663円、第94～99期中一部解約元本額は47,394,624,680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

項 目	第94期	第95期	第96期	第97期	第98期	第99期
	2020年7月28日～ 2020年8月24日	2020年8月25日～ 2020年9月23日	2020年9月24日～ 2020年10月23日	2020年10月24日～ 2020年11月24日	2020年11月25日～ 2020年12月23日	2020年12月24日～ 2021年1月25日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 4,181,290	△ 8,780,815	△ 2,262,431	△ 1,868,209	△ 1,251,324	△ 430,726
受取利息	160,825	33,414	26,863	—	26,024	8,090
支払利息	△ 4,342,115	△ 8,814,229	△ 2,289,294	△ 1,868,209	△ 1,277,348	△ 438,816
(B) 有価証券売買損益	1,231,025,919	1,111,882,958	△ 2,890,780,799	5,661,031,836	1,702,470,644	4,786,263,865
売買益	1,518,572,737	2,152,935,370	84,451,674	5,766,625,123	3,004,148,201	6,199,168,598
売買損	△ 287,546,818	△ 1,041,052,412	△ 2,975,232,473	△ 105,593,287	△ 1,301,677,557	△ 1,412,904,733
(C) 信託報酬等	△ 474,047,735	△ 504,409,643	△ 501,304,113	△ 527,430,929	△ 474,635,643	△ 538,296,872
(D) 当期繰損益金(A+B+C)	752,796,894	598,692,500	△ 3,394,347,343	5,131,732,698	1,226,583,677	4,247,536,267
(E) 前期繰越損益金	△ 53,678,863,581	△ 54,230,973,192	△ 52,965,769,436	△ 55,572,795,364	△ 49,665,917,930	△ 47,852,877,442
(F) 追加信託差損益金	83,279,986,509	82,523,337,466	79,789,762,783	76,910,862,235	74,041,220,771	71,458,679,869
(配当等相当額)	(101,248,105,791)	(100,727,803,184)	(98,235,087,086)	(95,427,893,355)	(92,718,771,241)	(90,286,038,602)
(売買損益相当額)	(△ 17,968,119,282)	(△ 18,204,465,718)	(△ 18,445,324,303)	(△ 18,517,031,120)	(△ 18,677,550,470)	(△ 18,827,358,733)
(G) 計(D+E+F)	30,353,919,822	28,891,056,774	23,429,646,004	26,469,799,569	25,601,886,518	27,853,338,694
(H) 収益分配金	△ 1,912,317,777	△ 1,902,382,187	△ 1,890,863,775	△ 1,872,722,557	△ 1,855,751,304	△ 1,843,712,982
次期繰越損益金(G+H)	28,441,602,045	26,988,674,587	21,538,782,229	24,597,077,012	23,746,135,214	26,009,625,712
追加信託差損益金	83,279,986,509	80,620,955,279	77,898,899,008	75,038,139,678	72,185,469,467	69,614,966,887
(配当等相当額)	(101,249,016,286)	(98,826,739,524)	(96,346,564,405)	(93,556,121,205)	(90,864,421,911)	(88,444,068,558)
(売買損益相当額)	(△ 17,969,029,777)	(△ 18,205,784,245)	(△ 18,447,665,397)	(△ 18,517,981,527)	(△ 18,678,952,444)	(△ 18,829,101,671)
分配準備積立金	824,533,771	1,054,033,576	1,299,247,547	1,665,219,494	1,966,995,141	2,540,959,405
繰越損益金	△ 55,662,918,235	△ 54,686,314,268	△ 57,659,364,326	△ 52,106,282,160	△ 50,406,329,394	△ 46,146,300,580

(注) (B) 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) (C) 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) (F) 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94期	第95期	第96期	第97期	第98期	第99期
	2020年7月28日～ 2020年8月24日	2020年8月25日～ 2020年9月23日	2020年9月24日～ 2020年10月23日	2020年10月24日～ 2020年11月24日	2020年11月25日～ 2020年12月23日	2020年12月24日～ 2021年1月25日
a. 配当等収益(費用控除後)	208,899,532円	238,632,661円	258,312,898円	384,121,759円	327,365,634円	597,778,745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	101,249,016,286円	100,729,121,711円	98,237,428,180円	95,428,843,762円	92,720,173,215円	90,287,781,540円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	2,527,952,016円	815,400,915円	1,040,934,649円	1,281,097,735円	1,639,629,507円	1,943,180,660円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	103,985,867,834円	101,783,155,287円	99,536,675,727円	97,094,063,256円	94,687,168,356円	92,828,740,945円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,631円	1,605円	1,579円	1,555円	1,530円	1,510円
g. 分配金	1,912,317,777円	1,902,382,187円	1,890,863,775円	1,872,722,557円	1,855,751,304円	1,843,712,982円
h. 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円	30円	30円	30円

○分配金のお知らせ

	第94期	第95期	第96期	第97期	第98期	第99期
1 万口当たり分配金（税込み）	30円	30円	30円	30円	30円	30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。

○（参考情報）親投資信託の組入資産の明細

(2021年1月25日現在)

＜東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド＞

下記は、東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド全体(558,487,823千円)の内容です。

国内公社債

(A)国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	第99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	38,600,000	45,135,742	6.6	—	6.6	—	—
地方債証券	166,657,278	177,676,187	26.0	—	25.9	0.1	—
	(166,657,278)	(177,676,187)	(26.0)	(—)	(25.9)	(0.1)	(—)
特殊債券 (除く金融債)	32,700,000	35,717,620	5.2	—	5.2	—	—
	(32,700,000)	(35,717,620)	(5.2)	(—)	(5.2)	(—)	(—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	414,207,000	420,916,691	61.6	—	39.2	15.1	7.2
	(414,207,000)	(420,916,691)	(61.6)	(—)	(39.2)	(15.1)	(7.2)
合 計	652,164,278	679,446,240	99.4	—	76.9	15.2	7.2
	(613,564,278)	(634,310,498)	(92.8)	(—)	(70.3)	(15.2)	(7.2)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の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	第99期末				銘 柄	第99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8回利付国債(30年)	1.8	500,000	598,610	2032/11/22	第25回利付国債(30年)	2.3	500,000	654,725	2036/12/20
第9回利付国債(30年)	1.4	500,000	575,415	2032/12/20	第26回利付国債(30年)	2.4	500,000	664,250	2037/3/20
第10回利付国債(30年)	1.1	500,000	558,320	2033/3/20	第27回利付国債(30年)	2.5	500,000	675,500	2037/9/20
第11回利付国債(30年)	1.7	500,000	595,410	2033/6/20	第28回利付国債(30年)	2.5	500,000	678,265	2038/3/20
第12回利付国債(30年)	2.1	500,000	621,420	2033/9/20	第29回利付国債(30年)	2.4	500,000	672,615	2038/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	500,000	616,655	2033/12/20	第30回利付国債(30年)	2.3	500,000	666,350	2039/3/20
第14回利付国債(30年)	2.4	500,000	644,190	2034/3/20	第31回利付国債(30年)	2.2	500,000	659,625	2039/9/20
第15回利付国債(30年)	2.5	500,000	653,030	2034/6/20	第32回利付国債(30年)	2.3	500,000	671,925	2040/3/20
第16回利付国債(30年)	2.5	500,000	654,970	2034/9/20	第33回利付国債(30年)	2.0	500,000	646,325	2040/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	500,000	649,625	2034/12/20	第34回利付国債(30年)	2.2	500,000	667,785	2041/3/20
第18回利付国債(30年)	2.3	500,000	644,435	2035/3/20	第35回利付国債(30年)	2.0	500,000	650,725	2041/9/20
第19回利付国債(30年)	2.3	500,000	646,035	2035/6/20	第36回利付国債(30年)	2.0	500,000	652,785	2042/3/20
第20回利付国債(30年)	2.5	500,000	662,255	2035/9/20	第37回利付国債(30年)	1.9	500,000	644,930	2042/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	649,090	2035/12/20	第38回利付国債(30年)	1.8	500,000	635,930	2043/3/20
第22回利付国債(30年)	2.5	500,000	665,620	2036/3/20	第39回利付国債(30年)	1.9	500,000	646,850	2043/9/20
第23回利付国債(30年)	2.5	500,000	667,290	2036/6/20	第137回利付国債(20年)	1.7	500,000	590,480	2032/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	500,000	668,920	2036/9/20	第138回利付国債(20年)	1.5	500,000	579,205	2032/6/20

銘柄		第99期末				銘柄		第99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
		%	千円	千円	千円			%	千円	千円	千円
国債証券						地方債証券					
第139回利付国債 (20年)		1.6	500,000	584,845	2032/6/20	平成27年度第4回北海道公募公債 (20年)		1.357	600,000	686,322	2035/6/29
第140回利付国債 (20年)		1.7	500,000	591,780	2032/9/20	平成27年度第12回北海道公募公債 (20年)		1.156	200,000	223,320	2035/12/25
第141回利付国債 (20年)		1.7	500,000	593,020	2032/12/20	平成28年度第3回北海道公募公債 (20年)		0.363	700,000	699,293	2036/6/30
第142回利付国債 (20年)		1.8	500,000	598,890	2032/12/20	平成29年度第11回北海道公募公債 (20年)		0.635	200,000	206,620	2037/12/25
第143回利付国債 (20年)		1.6	500,000	588,230	2033/3/20	平成30年度第4回北海道公募公債 (20年)		0.569	600,000	612,528	2038/6/25
第144回利付国債 (20年)		1.5	500,000	582,245	2033/3/20	平成30年度第5回北海道公募公債 (20年)		0.391	646,240	655,662	2038/6/25
第145回利付国債 (20年)		1.7	500,000	595,410	2033/6/20	平成30年度第9回北海道公募公債 (20年)		0.654	500,000	517,120	2038/9/24
第146回利付国債 (20年)		1.7	500,000	596,575	2033/9/20	平成30年度第10回北海道公募公債 (20年)		0.426	461,600	470,273	2038/9/24
第147回利付国債 (20年)		1.6	500,000	591,365	2033/12/20	平成30年度第15回北海道公募公債 (20年)		0.291	646,240	648,656	2038/9/24
第148回利付国債 (20年)		1.5	500,000	585,880	2034/3/20	令和元年度第4回北海道公募公債 (20年)		0.323	700,000	679,679	2039/6/24
第149回利付国債 (20年)		1.5	500,000	586,720	2034/6/20	令和元年度第5回北海道公募公債 (20年)		0.2	682,080	681,391	2039/6/24
第150回利付国債 (20年)		1.4	500,000	580,875	2034/9/20	令和元年度第9回北海道公募公債 (20年)		0.2	200,000	189,436	2039/9/22
第151回利付国債 (20年)		1.2	600,000	681,132	2034/12/20	第4回1号宮城県公募公債 (20年)		0.434	360,000	367,254	2038/8/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	600,000	681,594	2035/3/20	第4回2号宮城県公募公債 (20年)		0.244	462,500	463,785	2039/2/18
第153回利付国債 (20年)		1.3	600,000	690,426	2035/6/20	第5回1号宮城県公募公債 (20年)		0.17	475,000	472,729	2039/8/19
第154回利付国債 (20年)		1.2	600,000	682,476	2035/9/20	第5回2号宮城県公募公債 (20年)		0.188	380,000	379,414	2039/12/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	600,000	665,112	2035/12/20	第5回3号宮城県公募公債 (20年)		0.158	390,000	388,385	2040/2/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	700,000	713,755	2036/3/20	第17回神奈川県公募公債 (20年)		1.975	200,000	237,336	2031/7/11
第157回利付国債 (20年)		0.2	700,000	691,733	2036/6/20	第19回神奈川県公募公債 (20年)		1.818	300,000	353,067	2032/1/30
第158回利付国債 (20年)		0.5	700,000	722,540	2036/9/20	第20回神奈川県公募公債 (20年)		1.706	500,000	584,210	2032/6/18
第159回利付国債 (20年)		0.6	700,000	732,417	2036/12/20	第21回神奈川県公募公債 (20年)		1.732	200,000	234,730	2032/9/17
第160回利付国債 (20年)		0.7	700,000	742,546	2037/3/20	第22回神奈川県公募公債 (20年)		1.802	200,000	236,832	2032/12/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	700,000	731,101	2037/6/20	第23回神奈川県公募公債 (20年)		1.804	100,000	118,971	2033/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	700,000	730,401	2037/9/20	第25回神奈川県公募公債 (20年)		1.578	400,000	466,372	2033/12/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	700,000	729,666	2037/12/20	第26回神奈川県公募公債 (20年)		1.477	600,000	694,080	2034/6/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	700,000	716,982	2038/3/20	第27回神奈川県公募公債 (20年)		1.398	600,000	688,182	2034/9/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	700,000	716,044	2038/6/20	第28回神奈川県公募公債 (20年)		0.941	300,000	326,091	2034/12/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	700,000	738,878	2038/9/20	第29回神奈川県公募公債 (20年)		1.289	600,000	681,510	2035/6/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	700,000	714,077	2038/12/20	第30回神奈川県公募公債 (20年)		1.161	100,000	111,846	2035/9/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	700,000	700,588	2039/3/20	第31回神奈川県公募公債 (20年)		1.002	200,000	219,084	2035/12/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	700,000	686,826	2039/6/20	第32回神奈川県公募公債 (20年)		0.18	200,000	194,610	2036/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	700,000	685,468	2039/9/20	第33回神奈川県公募公債 (20年)		0.64	500,000	520,270	2036/12/19
第171回利付国債 (20年)		0.3	700,000	684,691	2039/12/20	第34回神奈川県公募公債 (20年)		0.654	100,000	104,068	2037/6/19
第172回利付国債 (20年)		0.4	700,000	696,283	2040/3/20	第36回神奈川県公募公債 (20年)		0.625	100,000	103,398	2037/12/18
第173回利付国債 (20年)		0.4	700,000	695,611	2040/6/20	第37回神奈川県公募公債 (20年)		0.53	200,000	203,072	2038/6/18
小計			38,600,000	45,135,742		第40回神奈川県公募公債 (20年)		0.2	800,000	760,840	2039/6/20
地方債証券						第42回神奈川県公募公債 (20年)		0.34	500,000	486,765	2039/9/20
第1回東京都公募公債 (30年)		2.21	400,000	495,756	2033/6/20	第2回大阪府公募公債		0.285	300,000	297,030	2035/12/25
第6回東京都公募公債 (30年)		2.58	100,000	134,855	2037/9/18	第7回大阪府公募公債 (20年)		1.84	620,000	727,731	2031/9/26
第7回東京都公募公債 (30年)		2.51	100,000	134,985	2038/9/17	第8回大阪府公募公債 (20年)		1.83	600,000	705,144	2031/12/22
第24回東京都公募公債 (20年)		1.98	100,000	118,618	2031/6/20	第9回大阪府公募公債 (20年)		1.83	100,000	117,804	2032/3/12
第25回東京都公募公債 (20年)		1.8	200,000	234,632	2031/12/19	第10回大阪府公募公債 (20年)		1.72	530,000	620,751	2032/9/24
第26回東京都公募公債 (20年)		1.74	600,000	703,326	2032/6/18	第11回大阪府公募公債 (20年)		1.693	500,000	588,590	2033/9/27
第27回東京都公募公債 (20年)		1.68	300,000	351,000	2032/12/20	第12回大阪府公募公債 (20年)		1.453	540,000	622,954	2034/9/26
第28回東京都公募公債 (20年)		1.59	100,000	116,133	2033/3/18	第13回大阪府公募公債 (20年)		1.203	700,000	786,058	2035/9/28
第30回東京都公募公債 (20年)		1.508	400,000	464,324	2034/6/20	第14回大阪府公募公債 (20年)		0.54	300,000	307,080	2036/9/29
第31回東京都公募公債 (20年)		1.238	400,000	450,376	2034/9/20	第15回大阪府公募公債 (20年)		0.721	600,000	629,790	2037/3/30
第32回東京都公募公債 (20年)		1.293	600,000	681,840	2035/6/20	第17回大阪府公募公債 (20年)		0.668	700,000	725,578	2038/9/27
第33回東京都公募公債 (20年)		0.18	700,000	681,135	2036/6/20	平成23年度第5回京都市公募公債 (20年)		1.79	400,000	468,012	2031/10/17
第34回東京都公募公債 (20年)		0.668	500,000	521,420	2037/6/19	平成24年度第3回京都市公募公債 (20年)		1.63	600,000	696,840	2032/8/13
第35回東京都公募公債 (20年)		0.525	700,000	710,185	2038/6/18	平成26年度第5回京都市公募公債 (20年)		1.455	600,000	692,850	2034/8/10
第37回東京都公募公債 (20年)		0.444	800,000	792,776	2040/6/20	平成28年度第5回京都市公募公債 (20年)		0.327	600,000	596,214	2036/8/15
平成25年度第12回北海道公募公債 (20年)		1.635	400,000	468,736	2033/12/27	平成29年度第2回京都市公募公債 (15年)		0.391	500,000	510,495	2032/4/23
平成26年度第4回北海道公募公債 (20年)		1.569	200,000	233,484	2034/6/27	平成29年度第5回京都市公募公債 (20年)		0.63	100,000	103,571	2037/8/14
平成26年度第12回北海道公募公債 (20年)		1.303	200,000	226,946	2034/12/26	平成30年度第5回京都市公募公債 (20年)		0.658	600,000	621,822	2038/8/13

銘 柄	第99期末				銘 柄	第99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8回京都府公債券(20年)	0.435	450,000	457,866	2038/10/15	平成26年度第1回広島県公債券(20年)	1.41	600,000	689,442	2034/9/12
令和元年度第5回京都府公債券(20年)	0.2	400,000	379,936	2039/8/19	平成27年度第1回広島県公債券(20年)	1.212	500,000	562,855	2035/9/25
第1回兵庫県公債券(18年)	1.26	400,000	447,024	2032/8/6	平成28年度第1回広島県公債券(20年)	0.414	200,000	201,296	2036/9/26
第14回兵庫県公債券(15年)	0.428	200,000	204,712	2032/5/26	平成29年度第2回広島県公債券(20年)	0.597	700,000	720,986	2037/9/25
第6回兵庫県公債券(20年)	0.436	663,180	675,621	2038/9/10	平成30年度第1回広島県公債券(20年)	0.568	700,000	715,351	2038/5/17
第13回兵庫県公債券(20年)	1.83	500,000	589,105	2032/3/16	平成30年度第2回広島県公債券(20年)	0.668	600,000	622,404	2038/9/17
第15回兵庫県公債券(20年)	1.64	600,000	696,264	2032/7/23	平成31年度第1回広島県公債券(20年)	0.419	700,000	693,420	2039/4/19
第16回兵庫県公債券(20年)	1.7	100,000	117,045	2032/11/19	令和元年度第2回広島県公債券(20年)	0.2	400,000	379,524	2039/9/20
第19回兵庫県公債券(20年)	1.57	100,000	116,311	2033/12/9	令和2年度第1回広島県公債券(20年)	0.315	800,000	774,720	2040/4/17
第20回兵庫県公債券(20年)	1.53	200,000	232,072	2034/3/10	第3回埼玉県公債券(15年)	0.43	500,000	512,945	2032/1/30
第21回兵庫県公債券(20年)	1.54	300,000	348,849	2034/5/9	第11回埼玉県公債券(20年)	2.0	200,000	237,644	2031/6/20
第22回兵庫県公債券(20年)	1.4	500,000	573,070	2034/9/8	第12回埼玉県公債券(20年)	1.73	100,000	117,074	2032/5/24
第24回兵庫県公債券(20年)	1.23	200,000	225,128	2035/3/23	第13回埼玉県公債券(20年)	1.599	600,000	698,208	2033/5/20
第26回兵庫県公債券(20年)	0.665	300,000	313,563	2036/3/7	第14回埼玉県公債券(20年)	1.546	600,000	699,036	2034/5/8
第28回兵庫県公債券(20年)	0.273	700,000	689,619	2036/6/20	第15回埼玉県公債券(20年)	1.166	400,000	447,364	2035/2/16
第30回兵庫県公債券(20年)	0.607	300,000	309,516	2036/12/19	第16回埼玉県公債券(20年)	1.216	200,000	225,234	2035/8/14
第32回兵庫県公債券(20年)	0.621	400,000	413,644	2037/5/1	第18回埼玉県公債券(20年)	0.323	500,000	497,325	2036/5/20
第35回兵庫県公債券(20年)	0.578	600,000	613,716	2038/5/28	第20回埼玉県公債券(20年)	0.626	300,000	310,998	2037/5/15
第37回兵庫県公債券(20年)	0.472	500,000	499,890	2039/2/18	第21回埼玉県公債券(20年)	0.625	500,000	516,970	2037/12/11
第38回兵庫県公債券(20年)	0.352	300,000	292,764	2039/6/20	第22回埼玉県公債券(20年)	0.568	600,000	613,188	2038/5/21
第10回静岡県公債券(20年)	0.355	368,440	372,839	2038/6/18	第23回埼玉県公債券(20年)	0.626	300,000	308,493	2038/12/17
第12回静岡県公債券(20年)	0.257	584,220	586,451	2039/3/18	第24回埼玉県公債券(20年)	0.431	100,000	99,258	2039/5/17
第2回静岡県公債券(30年)	2.54	300,000	406,440	2038/9/17	第25回埼玉県公債券(20年)	0.32	450,000	436,009	2039/12/20
第12回静岡県公債券(20年)	2.003	230,000	273,361	2031/6/20	平成29年度第1回福岡県公債券(15年)	0.419	400,000	408,936	2032/11/22
第14回静岡県公債券(20年)	1.736	500,000	585,885	2032/6/18	平成30年度第2回福岡県公債券(15年)	0.542	600,000	620,838	2033/10/17
第15回静岡県公債券(20年)	1.701	450,000	526,747	2032/10/15	令和元年度第1回福岡県公債券(15年)	0.254	600,000	597,606	2034/6/14
第18回静岡県公債券(20年)	1.473	600,000	693,690	2034/7/10	令和元年度第2回福岡県公債券(15年)	0.269	400,000	398,088	2034/12/13
第19回静岡県公債券(20年)	1.253	300,000	339,276	2035/7/27	平成22年度第2回福岡県公債券(20年)	2.116	100,000	119,569	2031/2/21
第22回静岡県公債券(20年)	0.443	200,000	202,162	2036/9/19	平成23年度第2回福岡県公債券(20年)	1.806	100,000	117,034	2031/8/18
第23回静岡県公債券(20年)	0.626	100,000	103,637	2037/6/19	平成24年度第1回福岡県公債券(20年)	1.734	100,000	117,106	2032/5/21
第24回静岡県公債券(20年)	0.63	200,000	207,180	2037/9/18	平成24年度第2回福岡県公債券(20年)	1.635	600,000	697,248	2032/8/16
第25回静岡県公債券(20年)	0.53	600,000	609,216	2038/6/18	平成25年度第1回福岡県公債券(20年)	1.599	300,000	349,104	2033/5/20
第26回静岡県公債券(20年)	0.711	600,000	626,628	2038/9/17	平成25年度第2回福岡県公債券(20年)	1.787	100,000	118,907	2033/8/12
第28回静岡県公債券(20年)	0.31	700,000	677,880	2039/9/20	平成26年度第1回福岡県公債券(20年)	1.542	250,000	291,097	2034/5/26
平成23年度第5回愛知県公債券(20年)	1.988	100,000	118,700	2031/6/20	平成26年度第2回福岡県公債券(20年)	1.451	300,000	346,428	2034/9/22
平成23年度第16回愛知県公債券(20年)	1.8	100,000	117,478	2032/1/26	平成26年度第4回福岡県公債券(20年)	1.249	200,000	225,960	2035/2/23
平成24年度第4回愛知県公債券(20年)	1.687	200,000	233,206	2032/6/11	平成27年度第1回福岡県公債券(20年)	1.285	500,000	567,680	2035/5/22
平成24年度第17回愛知県公債券(20年)	1.829	400,000	475,476	2033/2/8	平成28年度第1回福岡県公債券(20年)	0.308	500,000	496,230	2036/5/23
平成25年度第3回愛知県公債券(20年)	1.509	200,000	230,526	2033/5/13	平成28年度第4回福岡県公債券(20年)	0.744	600,000	633,516	2037/2/13
平成25年度第11回愛知県公債券(20年)	1.77	100,000	118,755	2033/9/13	平成29年度第1回福岡県公債券(20年)	0.626	100,000	103,606	2037/5/29
平成26年度第4回愛知県公債券(20年)	1.542	100,000	116,403	2034/5/15	令和元年度第1回福岡県公債券(20年)	0.359	600,000	585,942	2039/11/25
平成26年度第13回愛知県公債券(20年)	1.363	600,000	685,872	2034/11/14	第9回千葉県公債券(20年)	0.416	450,000	457,101	2038/10/15
平成27年度第3回愛知県公債券(20年)	1.115	700,000	778,218	2035/5/8	第10回千葉県公債券(20年)	1.8	300,000	350,916	2031/8/18
平成27年度第14回愛知県公債券(20年)	1.129	200,000	222,726	2035/11/19	第11回千葉県公債券(20年)	1.87	100,000	118,033	2031/12/12
平成28年度第2回愛知県公債券(20年)	0.387	100,000	100,465	2036/5/12	第12回千葉県公債券(20年)	1.839	400,000	472,472	2032/4/16
平成28年度第12回愛知県公債券(20年)	0.429	300,000	302,046	2036/11/18	第13回千葉県公債券(20年)	1.701	550,000	643,802	2032/10/15
平成29年度第12回愛知県公債券(20年)	0.606	400,000	412,340	2037/11/20	第14回千葉県公債券(20年)	1.137	700,000	775,124	2033/4/15
平成30年度第2回愛知県公債券(20年)	0.54	100,000	101,804	2038/4/30	第15回千葉県公債券(20年)	1.604	100,000	116,757	2033/10/14
平成30年度第12回愛知県公債券(20年)	0.706	300,000	312,921	2038/11/15	平成26年度第1回千葉県公債券(20年)	1.555	600,000	699,252	2034/4/14
平成30年度第14回愛知県公債券(20年)	0.291	540,000	542,511	2038/12/14	第17回千葉県公債券(20年)	1.403	600,000	688,974	2034/10/13
令和元年度第5回愛知県公債券(20年)	0.288	400,000	386,320	2039/7/12	第18回千葉県公債券(20年)	1.138	600,000	668,616	2035/4/13
令和元年度第12回愛知県公債券(20年)	0.156	285,000	283,272	2039/11/18	平成27年度第1回千葉県公債券(20年)	1.166	100,000	111,890	2035/10/15
平成23年度第1回広島県公債券(20年)	1.83	100,000	117,376	2031/9/22	第23回千葉県公債券(20年)	0.63	300,000	310,572	2037/10/15
平成24年度第1回広島県公債券(20年)	1.7	600,000	701,940	2032/9/14	第24回千葉県公債券(20年)	0.559	200,000	204,182	2038/4/15
平成25年度第1回広島県公債券(20年)	1.75	300,000	355,527	2033/9/13	第25回千葉県公債券(20年)	0.701	700,000	730,037	2038/10/15

銘	柄	第99期末				銘	柄	第99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
		%	千円	千円				%	千円	千円	
地方債証券						地方債証券					
第27回千葉県公募公債 (20年)		0.251	800,000	765,904	2039/10/14	第15回名古屋市長市公募公債 (20年)		1.712	300,000	354,084	2033/9/9
平成29年度第1回新潟県公募公債		0.616	700,000	723,478	2037/8/14	第16回名古屋市長市公募公債 (20年)		1.52	200,000	232,402	2034/6/9
平成30年度第1回新潟県公募公債		0.653	700,000	724,913	2038/8/20	第17回名古屋市長市公募公債 (20年)		1.203	500,000	562,120	2033/5/28
令和元年度第1回新潟県公募公債		0.2	800,000	759,872	2039/8/19	第18回名古屋市長市公募公債 (20年)		1.139	700,000	780,542	2035/11/20
令和2年度第1回新潟県公募公債		0.435	800,000	790,728	2040/8/17	第19回名古屋市長市公募公債 (20年)		0.323	300,000	298,614	2036/4/28
令和2年度第2回長野県公募公債		0.14	200,000	200,260	2030/10/16	第20回名古屋市長市公募公債 (20年)		0.645	600,000	623,352	2037/5/25
平成30年度第2回茨城県公募公債		0.386	500,000	507,540	2038/7/30	第21回名古屋市長市公募公債 (20年)		0.568	700,000	715,358	2038/5/18
令和元年度第2回茨城県公募公債		0.19	500,000	497,050	2039/7/29	第22回名古屋市長市公募公債 (20年)		0.431	700,000	694,806	2039/5/20
令和2年度第2回茨城県公募公債		0.356	300,000	302,268	2040/7/31	第20回京都市公募公債 (20年)		0.331	525,000	530,239	2038/7/16
第2回群馬県公募公債 (20年)		0.2	370,000	368,975	2039/6/17	第3回京都市公募公債 (20年)		0.244	647,500	649,300	2039/2/18
第2回群馬県公募公債 (20年)		2.019	100,000	119,155	2031/7/18	第4回京都市公募公債 (20年)		0.18	277,500	276,276	2039/7/15
第3回群馬県公募公債 (20年)		1.687	600,000	699,948	2032/6/25	第10回京都市公募公債 (20年)		1.803	200,000	234,580	2031/11/21
第4回群馬県公募公債 (20年)		1.667	100,000	117,307	2033/6/17	第11回京都市公募公債 (20年)		1.701	100,000	117,124	2032/11/19
第5回群馬県公募公債 (20年)		1.529	600,000	698,034	2034/6/16	第13回京都市公募公債 (20年)		1.359	300,000	342,861	2034/11/24
第6回群馬県公募公債 (20年)		1.267	600,000	679,560	2035/6/11	第14回京都市公募公債 (20年)		1.139	400,000	446,400	2035/11/22
第7回群馬県公募公債 (20年)		0.313	700,000	695,219	2036/6/13	第15回京都市公募公債 (20年)		0.487	500,000	507,705	2036/11/28
第9回群馬県公募公債 (20年)		0.554	400,000	407,992	2038/6/11	第16回京都市公募公債 (20年)		0.611	600,000	619,002	2037/11/27
第10回群馬県公募公債 (20年)		0.338	500,000	487,585	2039/6/17	第17回京都市公募公債 (20年)		0.683	700,000	726,936	2038/11/26
第11回群馬県公募公債 (20年)		0.416	400,000	394,412	2040/6/12	第18回京都市公募公債 (20年)		0.355	400,000	390,360	2039/11/18
平成30年度第1回大分県公募公債		0.38	300,000	304,269	2038/7/16	平成22年度第9回神戸市公募公債 (20年)		2.09	350,000	417,287	2031/1/24
令和元年度第1回大分県公募公債		0.19	600,000	596,868	2039/7/15	平成23年度第4回神戸市公募公債 (20年)		1.913	150,000	177,298	2031/9/12
令和2年度第1回大分県公募公債		0.281	585,000	587,152	2040/7/10	平成23年度第14回神戸市公募公債 (20年)		1.794	200,000	234,980	2032/2/13
平成23年度第1回堺市公募公債 (20年)		1.8	500,000	585,670	2031/11/21	平成24年度第3回神戸市公募公債 (20年)		1.635	500,000	586,985	2032/8/13
平成24年度第1回堺市公募公債		1.732	600,000	704,316	2032/11/12	平成24年度第12回神戸市公募公債 (20年)		1.711	500,000	586,740	2032/12/17
平成30年度第2回堺市公募公債		0.386	630,000	638,164	2038/11/15	平成25年度第12回神戸市公募公債 (20年)		1.52	100,000	115,988	2034/2/17
令和元年度第2回堺市公募公債		0.21	570,000	569,441	2039/11/18	平成26年度第3回神戸市公募公債 (20年)		1.482	300,000	347,232	2034/7/14
平成30年度第2回長崎県公募公債		0.491	500,000	512,365	2038/8/20	平成27年度第9回神戸市公募公債 (20年)		1.007	100,000	109,674	2036/1/25
令和元年度第2回長崎県公募公債		0.18	400,000	397,048	2039/8/26	平成28年度第9回神戸市公募公債 (20年)		0.645	400,000	416,296	2037/1/23
平成28年度第2回島根県公募公債 (20年)		0.506	100,000	102,008	2036/9/30	平成29年度第5回神戸市公募公債 (20年)		0.597	200,000	205,990	2037/9/18
平成29年度第2回島根県公募公債		0.583	700,000	719,439	2037/9/18	平成30年度第6回神戸市公募公債 (20年)		0.668	300,000	311,202	2038/9/17
平成30年度第2回島根県公募公債		0.668	700,000	726,138	2038/9/17	令和元年度第6回神戸市公募公債 (20年)		0.2	500,000	474,405	2039/9/20
令和元年度第2回島根県公募公債		0.2	400,000	379,524	2039/9/20	第1回横浜市公募公債 (30年)		2.63	500,000	656,185	2034/9/20
令和2年度第2回島根県公募公債		0.459	800,000	793,416	2040/9/21	第2回横浜市公募公債 (30年)		2.49	500,000	650,855	2035/3/30
平成30年度第1回栃木県公募公債		0.421	540,000	548,775	2038/10/22	第4回横浜市公募公債 (30年)		2.54	210,000	279,896	2036/12/19
令和元年度第1回栃木県公募公債		0.14	475,000	470,839	2039/10/24	第25回横浜市公募公債 (20年)		1.72	400,000	468,180	2032/7/16
平成30年度第1回奈良県公募公債		0.396	270,000	274,228	2038/9/17	平成26年度第1回札幌市公募公債 (20年)		1.776	300,000	354,819	2033/1/28
令和元年度第1回奈良県公募公債		0.15	285,000	283,406	2039/9/20	第27回横浜市公募公債 (20年)		1.599	300,000	349,104	2033/5/20
第15回大阪市公募公債 (20年)		2.12	250,000	298,802	2031/1/24	第28回横浜市公募公債 (20年)		1.586	300,000	349,677	2033/11/11
第17回大阪市公募公債 (20年)		1.721	200,000	234,960	2032/12/21	第29回横浜市公募公債 (20年)		1.528	200,000	232,518	2034/5/26
第18回大阪市公募公債 (20年)		1.262	700,000	792,162	2035/2/27	第30回横浜市公募公債 (20年)		1.376	550,000	629,700	2034/10/20
第19回大阪市公募公債 (20年)		1.138	600,000	668,754	2035/4/24	第31回横浜市公募公債 (20年)		1.18	300,000	336,072	2035/4/20
第20回大阪市公募公債 (20年)		1.184	200,000	224,412	2035/8/31	平成25年度第10回札幌市公募公債 (20年)		0.443	100,000	100,981	2036/10/28
第21回大阪市公募公債 (20年)		0.97	300,000	327,456	2036/1/29	第40回横浜市公募公債 (20年)		0.559	700,000	714,651	2038/4/16
第22回大阪市公募公債 (20年)		0.347	700,000	698,684	2036/5/30	第42回横浜市公募公債 (20年)		0.47	373,200	378,932	2038/12/17
第24回大阪市公募公債 (20年)		0.655	200,000	208,148	2037/4/21	平成23年度第3回札幌市公募公債 (20年)		1.944	600,000	710,238	2031/7/29
第26回大阪市公募公債 (20年)		0.635	500,000	518,035	2037/10/23	平成24年度第1回札幌市公募公債		1.79	600,000	705,654	2032/4/23
第27回大阪市公募公債 (20年)		0.544	200,000	203,714	2038/4/20	平成24年度第4回札幌市公募公債 (20年)		1.635	200,000	232,394	2032/8/13
第28回大阪市公募公債 (20年)		0.381	437,500	444,049	2038/5/28	平成24年度第11回札幌市公募公債 (20年)		1.794	100,000	118,541	2033/2/28
第29回大阪市公募公債 (20年)		0.218	647,500	647,007	2039/5/27	平成25年度第1回札幌市公募公債 (20年)		1.72	200,000	235,862	2033/6/14
第1回名古屋市長市公募公債 (20年)		0.17	292,308	290,846	2039/8/19	平成25年度第10回札幌市公募公債 (20年)		1.53	300,000	348,618	2034/3/17
第2回名古屋市長市公募公債 (20年)		0.156	285,000	283,267	2039/11/18	平成26年度第1回札幌市公募公債 (20年)		1.524	500,000	581,035	2034/5/26
第1回名古屋市長市公募公債 (30年)		2.53	500,000	653,580	2035/3/20	平成26年度第10回札幌市公募公債 (20年)		1.267	400,000	452,848	2035/3/20
第3回名古屋市長市公募公債 (30年)		2.5	100,000	133,599	2037/9/18	平成27年度第3回札幌市公募公債 (20年)		1.211	200,000	225,036	2035/7/31
第6回名古屋市長市公募公債 (30年)		2.45	100,000	135,311	2039/12/20	平成29年度第5回札幌市公募公債 (20年)		0.597	600,000	617,970	2037/9/18
第14回名古屋市長市公募公債 (20年)		1.648	500,000	581,660	2032/8/10	平成30年度第1回札幌市公募公債 (20年)		0.366	350,000	354,711	2038/5/21

銘	柄	第99期末				銘	柄	第99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
		%	千円	千円				%	千円	千円	
地方債証券						地方債証券					
平成30年度第8回札幌市公募公債(20年)		0.626	700,000	719,824	2038/12/20	平成24年度第2回福井県公募公債		1.711	100,000	117,364	2032/12/21
令和元年度第4回札幌市公募公債(20年)		0.15	300,000	298,080	2039/9/20	平成25年度第1回福井県公募公債		1.667	100,000	117,324	2033/6/21
令和2年度第5回札幌市公募公債(20年)		0.445	700,000	692,468	2040/10/12	平成26年度第1回福井県公募公債		1.482	100,000	115,756	2034/7/18
第14回川崎市公募公債(20年)		1.79	100,000	117,526	2032/3/19	平成27年度第1回福井県公募公債		1.28	600,000	681,138	2035/7/17
第15回川崎市公募公債(20年)		1.727	300,000	351,924	2032/9/17	平成28年度第1回福井県公募公債		0.18	700,000	680,512	2036/7/29
第18回川崎市公募公債(20年)		1.541	600,000	698,070	2034/3/17	平成29年度第1回福井県公募公債		0.659	100,000	104,088	2037/7/24
第20回川崎市公募公債(20年)		1.133	200,000	222,786	2035/3/20	平成30年度第1回福井県公募公債		0.535	500,000	507,730	2038/7/30
第21回川崎市公募公債(20年)		1.11	200,000	222,264	2035/9/20	平成30年度第4回福井県公募公債		0.386	450,000	455,832	2038/11/15
第22回川崎市公募公債(20年)		0.377	600,000	601,914	2036/4/22	令和元年度第1回福井県公募公債		0.286	400,000	386,152	2039/7/29
第23回川崎市公募公債(20年)		0.549	300,000	308,172	2036/9/19	令和元年度第4回福井県公募公債		0.21	285,000	284,449	2039/11/18
第24回川崎市公募公債(20年)		0.683	100,000	104,575	2037/4/17	令和2年度第1回福井県公募公債		0.249	600,000	599,820	2040/7/13
第27回川崎市公募公債(20年)		0.559	300,000	306,279	2038/4/16	令和2年度第3回福井県公募公債		0.449	600,000	594,552	2040/8/3
第28回川崎市公募公債(20年)		0.422	360,000	365,832	2038/10/29	平成30年度第1回徳島県公募公債		0.331	360,000	363,646	2038/7/30
第29回川崎市公募公債(20年)		0.223	555,000	555,333	2039/4/22	令和元年度第1回徳島県公募公債		0.18	380,000	378,495	2039/7/29
第30回川崎市公募公債(20年)		0.2	600,000	570,630	2039/6/20	令和2年度第1回徳島県公募公債		0.281	400,000	402,308	2040/7/31
第31回川崎市公募公債(20年)		0.14	380,000	376,853	2039/10/21	平成29年度第1回岡山県公募公債		0.352	425,000	430,304	2037/12/22
第33回川崎市公募公債(20年)		0.44	600,000	594,156	2040/6/20	平成30年度第1回岡山県公募公債		0.29	630,000	633,786	2038/12/21
第6回北九州市公募公債(20年)		0.18	663,040	659,665	2039/7/22	令和元年度第1回岡山県公募公債		0.192	380,000	379,555	2039/12/20
第10回北九州市公募公債(20年)		2.09	250,000	297,770	2031/1/24	第5回神奈川県住宅供給公社債券		0.709	600,000	608,022	2038/4/23
第11回北九州市公募公債(20年)		2.019	500,000	595,160	2031/7/18	第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	400,000	397,744	2029/4/23
第13回北九州市公募公債(20年)		1.706	400,000	467,288	2032/7/16	第7回神奈川県住宅供給公社債券		0.534	300,000	293,367	2039/4/22
第14回北九州市公募公債(20年)		1.732	600,000	704,316	2032/11/12	第1回川崎市土地開発公社債券		0.02	700,000	696,906	2024/6/25
第15回北九州市公募公債(20年)		1.667	100,000	117,166	2033/6/17	第2回公営企業債券(30年)		2.39	100,000	126,423	2033/12/20
第16回北九州市公募公債(20年)		1.604	100,000	116,603	2033/10/11	第3回公営企業債券(30年)		2.59	300,000	386,748	2033/12/20
第17回北九州市公募公債(20年)		1.529	600,000	697,212	2034/6/20	第8回地方公共団体金融機構債券(30年)		2.5	200,000	260,650	2035/9/21
第18回北九州市公募公債(20年)		1.376	200,000	228,680	2034/10/20	第12回地方公共団体金融機構債券(20年)		2.092	100,000	118,809	2030/12/27
第19回北九州市公募公債(20年)		1.312	600,000	682,458	2035/6/19	第13回地方公共団体金融機構債券(20年)		2.132	100,000	119,307	2031/1/28
第20回北九州市公募公債(20年)		1.111	100,000	110,983	2035/10/26	第17回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.87	100,000	117,444	2031/9/26
平成23年度第4回福岡市公募公債(20年)		1.89	300,000	353,733	2031/8/19	第19回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.84	100,000	117,397	2031/12/26
平成24年度第2回福岡市公募公債(20年)		1.702	400,000	467,436	2032/7/20	第21回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.812	100,000	117,484	2032/4/28
平成24年度第6回福岡市公募公債(20年)		1.696	300,000	350,868	2032/9/17	第24回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.702	500,000	583,010	2032/9/28
平成25年度第1回福岡市公募公債(20年)		1.808	100,000	119,066	2033/7/19	第32回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.624	100,000	116,621	2033/10/28
平成25年度第6回福岡市公募公債(20年)		1.511	400,000	463,496	2034/2/17	第33回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.668	500,000	586,535	2033/12/28
平成26年度第2回福岡市公募公債(20年)		1.49	600,000	695,088	2034/6/20	第35回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.569	300,000	348,660	2034/3/28
平成26年度第6回福岡市公募公債(20年)		1.371	200,000	228,684	2034/9/20	第37回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.535	200,000	231,860	2034/6/28
平成27年度第6回福岡市公募公債(20年)		1.121	100,000	111,228	2035/12/18	第40回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.381	600,000	684,294	2034/10/27
平成28年度第6回福岡市公募公債(20年)		0.429	700,000	704,739	2036/11/25	第42回地方公共団体金融機構債券(20年)		0.999	100,000	108,958	2035/1/26
平成30年度第7回福岡市公募公債(20年)		0.701	700,000	729,456	2038/10/19	第44回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.298	300,000	339,309	2035/6/28
平成30年度第8回福岡市公募公債(20年)		0.416	450,000	457,105	2038/10/19	第46回地方公共団体金融機構債券(20年)		1.189	100,000	111,630	2035/9/28
平成31年度第2回福岡市公募公債(20年)		0.225	569,230	569,674	2039/4/22	第51回地方公共団体金融機構債券(20年)		0.377	400,000	399,256	2036/4/28
平成31年度第3回福岡市公募公債(20年)		0.419	600,000	594,360	2039/4/22	第67回地方公共団体金融機構債券(20年)		0.564	200,000	203,194	2038/6/28
2019年度第5回福岡市公募公債(20年)		0.286	300,000	289,614	2039/7/29	第71回地方公共団体金融機構債券(20年)		0.2	500,000	473,570	2039/9/28
2019年度第7回福岡市公募公債(20年)		0.271	500,000	480,375	2039/10/24	第79回地方公共団体金融機構債券(20年)		0.345	400,000	388,608	2039/12/28
平成29年度第2回広島市公募公債		0.616	200,000	206,712	2037/8/18	第80回地方公共団体金融機構債券(20年)		0.354	500,000	486,060	2040/1/27
平成29年度第4回広島市公募公債		0.62	600,000	619,830	2037/11/20	第83回地方公共団体金融機構債券(20年)		0.44	400,000	394,700	2040/6/28
平成30年度第2回広島市公募公債		0.639	700,000	723,310	2038/8/20	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	310,593	2037/2/27
平成30年度第4回広島市公募公債		0.706	700,000	730,163	2038/11/19	第10回大阪府住宅供給公社債券		0.395	300,000	302,355	2027/6/18
令和元年度第2回広島市公募公債		0.2	800,000	759,872	2039/8/19	第12回大阪府住宅供給公社債券		0.34	500,000	501,990	2028/6/20
令和元年度第4回広島市公募公債		0.355	400,000	390,356	2039/11/21	第13回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券		0.514	500,000	508,750	2032/2/27
令和2年度第2回広島市公募公債		0.435	500,000	494,205	2040/8/21	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	415,652	2037/2/27
平成29年度第1回仙台市公募公債		0.616	700,000	723,149	2037/10/19	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	474,795	2040/2/28
平成30年度第1回仙台市公募公債		0.426	540,000	549,784	2038/8/20	第121回福岡北九州高速道路債券		2.31	400,000	471,288	2029/12/20
平成30年度第2回仙台市公募公債		0.729	700,000	733,278	2038/10/18	第147回福岡北九州高速道路債券		0.502	500,000	508,150	2032/3/19
令和元年度第1回仙台市公募公債		0.17	380,000	378,001	2039/8/19	第148回福岡北九州高速道路債券		0.731	500,000	514,945	2037/3/19
令和元年度第2回仙台市公募公債		0.15	700,000	692,398	2039/10/14	第150回福岡北九州高速道路債券		0.396	600,000	601,110	2033/3/18

銘	柄	第99期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
地方債証券					
第13回東京都住宅供給公社債券		2.4	400,000	476,612	2030/5/24
第24回東京都住宅供給公社債券		0.519	500,000	497,065	2036/9/12
第26回東京都住宅供給公社債券		0.697	600,000	608,814	2037/9/11
第29回東京都住宅供給公社債券		0.749	200,000	203,946	2038/9/17
第30回東京都住宅供給公社債券		0.496	180,000	182,340	2038/9/17
第32回東京都住宅供給公社債券		0.341	300,000	282,216	2039/9/26
第33回東京都住宅供給公社債券		0.25	285,000	282,591	2039/9/26
第35回東京都住宅供給公社債券		0.251	500,000	498,260	2029/12/24
第36回東京都住宅供給公社債券		0.416	400,000	396,156	2034/12/22
第37回東京都住宅供給公社債券		0.435	200,000	197,824	2035/9/21
小計			166,657,278	177,676,187	
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	138,360	2038/6/30
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	355,821	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	593,740	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	239,892	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	118,148	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	354,699	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	234,528	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	234,686	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	117,479	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	587,985	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	117,957	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	232,920	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	578,380	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	349,935	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	233,604	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	586,310	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	471,900	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	473,536	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	703,986	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	571,220	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	595,580	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	709,398	2033/8/31
第203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	116,511	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	581,570	2033/11/30
第208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	701,844	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	233,280	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	580,690	2034/2/28
第219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	464,016	2034/5/31
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	579,340	2034/6/30
第223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	576,900	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	574,935	2034/8/31
第228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	575,375	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	571,605	2034/10/31
第233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	570,485	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	565,135	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	547,660	2035/1/31
第239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	560,835	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	565,020	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	666,690	2035/4/27
第249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	337,422	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	683,556	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	793,751	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	113,103	2035/8/31

銘	柄	第99期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
特殊債券(除く金融債)					
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	112,701	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	781,025	2035/11/28
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	223,220	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	713,776	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	492,860	2036/5/31
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	485,580	2036/7/31
第293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	503,345	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	205,466	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	514,060	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	623,436	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	740,131	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	104,836	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	620,226	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	103,003	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	616,866	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	102,571	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	618,414	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	719,481	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	102,449	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	714,392	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	102,082	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	723,520	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	516,875	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	730,639	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	104,078	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	719,761	2038/12/28
第373回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.522	700,000	709,905	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	701,890	2039/2/28
第378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	696,353	2039/3/31
第21回政府保証民間都市開発債券		0.618	300,000	309,366	2038/12/27
第22回政府保証民間都市開発債券		0.245	1,000,000	958,050	2040/2/28
第23回政府保証民間都市開発債券		0.397	800,000	787,496	2040/6/29
小計			32,700,000	35,717,620	
普通社債券(含む投資法人債券)					
第501回中部電力株式会社社債		0.803	200,000	205,172	2024/9/25
第503回中部電力株式会社社債		0.584	200,000	203,926	2025/3/25
第508回中部電力株式会社社債		0.18	200,000	200,514	2023/4/25
第511回中部電力株式会社社債		0.21	100,000	100,299	2026/7/24
第513回中部電力株式会社社債		0.14	300,000	300,537	2023/8/25
第530回中部電力株式会社社債		0.274	600,000	600,690	2029/6/25
第511回関西電力株式会社社債		0.41	600,000	605,874	2027/9/17
第512回関西電力株式会社社債		0.32	400,000	402,908	2024/10/25
第515回関西電力株式会社社債		0.435	600,000	605,958	2028/4/25
第518回関西電力株式会社社債		0.44	300,000	303,039	2028/6/20
第527回関西電力株式会社社債		0.28	500,000	502,665	2024/4/25
第378回中国電力株式会社社債		1.004	300,000	307,596	2023/10/25
第381回中国電力株式会社社債		0.953	100,000	102,776	2024/4/25
第383回中国電力株式会社社債		0.764	400,000	409,840	2024/10/25
第398回中国電力株式会社社債		0.425	400,000	405,764	2027/7/23
第402回中国電力株式会社社債		0.25	100,000	100,541	2024/10/25
第404回中国電力株式会社社債		0.355	100,000	100,855	2028/4/25
第311回北陸電力株式会社社債		0.847	200,000	208,234	2027/9/24
第314回北陸電力株式会社社債		0.36	100,000	101,061	2026/2/25
第318回北陸電力株式会社社債		0.26	450,000	451,710	2026/12/25
第321回北陸電力株式会社社債		0.365	300,000	302,955	2027/4/23

銘 柄	第99期末				償還年月日	銘 柄	第99期末				償還年月日
	利率	額面金額	評 価 額	千円			利率	額面金額	評 価 額	千円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円			普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	505,375	2027/6/25		第18回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	119,963	2031/5/9	
第475回東北電力株式会社社債	0.809	500,000	512,665	2024/9/25		第124回都市再生債券	0.273	300,000	294,267	2036/6/20	
第476回東北電力株式会社社債	0.57	100,000	101,769	2025/1/24		第128回都市再生債券	0.39	500,000	498,170	2036/9/19	
第491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	607,752	2027/2/25		第131回都市再生債券	0.487	500,000	505,075	2036/11/25	
第492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	404,804	2027/4/23		第133回都市再生債券	0.767	200,000	210,288	2037/2/20	
第496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	302,658	2027/9/24		第141回都市再生債券	0.63	100,000	102,879	2038/2/19	
第517回東北電力株式会社社債	0.31	100,000	100,079	2030/2/25		第145回都市再生債券	0.584	300,000	306,237	2038/6/18	
第281回四国電力株式会社社債	1.111	500,000	513,770	2023/9/25		第150回都市再生債券	0.716	500,000	519,800	2038/11/19	
第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	100,498	2026/11/25		第156回都市再生債券	0.343	400,000	388,440	2039/6/17	
第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	202,356	2027/11/25		第157回都市再生債券	0.2	400,000	378,888	2039/9/16	
第307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	298,983	2029/9/25		第160回都市再生債券	0.335	600,000	581,898	2039/12/19	
第309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	504,980	2030/5/24		第167回都市再生債券	0.43	300,000	296,733	2040/12/20	
第429回九州電力株式会社社債	0.909	300,000	308,637	2024/9/25		第62回独立行政法人福祉医療機構債券	0.18	400,000	401,296	2030/6/20	
第437回九州電力株式会社社債	0.685	600,000	615,774	2026/1/23		第6回中部国際空港株式会社社債	0.206	500,000	502,230	2029/2/22	
第465回九州電力株式会社社債	0.38	500,000	504,225	2028/7/25		第69回一般担保住宅金融支援機構債券	2.31	200,000	242,902	2031/4/18	
第489回九州電力株式会社社債	0.44	400,000	404,336	2030/5/24		第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	210,000	250,321	2031/6/13	
第290回北海道電力株式会社社債	2.09	300,000	301,473	2021/4/23		第81回一般担保住宅金融支援機構債券	1.926	100,000	118,027	2031/9/12	
第321回北海道電力株式会社社債	0.886	111,000	114,223	2024/12/25		第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	117,540	2031/11/18	
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	400,000	411,984	2025/12/25		第94回一般担保住宅金融支援機構債券	1.882	500,000	589,980	2032/2/13	
第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	202,588	2027/6/25		第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	118,342	2032/3/12	
第346回北海道電力株式会社社債	0.31	700,000	704,627	2024/12/25		第106回一般担保住宅金融支援機構債券	1.794	100,000	117,431	2032/6/18	
第7回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.46	200,000	201,174	2022/10/24		第109回一般担保住宅金融支援機構債券	1.787	200,000	234,802	2032/7/16	
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.81	500,000	508,985	2027/10/22		第115回一般担保住宅金融支援機構債券	1.811	500,000	589,245	2032/9/14	
第10回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.45	100,000	100,632	2023/1/25		第118回一般担保住宅金融支援機構債券	1.814	100,000	117,943	2032/10/15	
第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.44	500,000	503,305	2023/4/19		第120回一般担保住宅金融支援機構債券	1.836	400,000	472,968	2032/11/12	
第30回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	600,000	606,894	2024/10/9		第125回一般担保住宅金融支援機構債券	1.898	100,000	119,000	2033/1/25	
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	600,000	613,872	2029/10/9		第127回一般担保住宅金融支援機構債券	1.923	300,000	358,575	2033/2/18	
第14回新関西国際空港株式会社社債	1.318	600,000	674,292	2034/12/20		第130回一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	234,972	2032/12/20	
第16回新関西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	334,782	2035/9/20		第159回一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	300,000	331,947	2035/5/18	
第18回新関西国際空港株式会社社債	0.675	500,000	512,840	2037/12/18		第166回一般担保住宅金融支援機構債券	1.221	100,000	111,997	2035/8/20	
第23回新関西国際空港株式会社社債	0.512	700,000	695,688	2038/12/20		第211回一般担保住宅金融支援機構債券	0.406	500,000	509,205	2032/6/18	
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220回一般担保住宅金融支援機構債券	0.616	200,000	205,488	2037/10/20	
第97回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.536	700,000	708,610	2038/7/12		第223回一般担保住宅金融支援機構債券	0.403	200,000	203,278	2032/11/19	
第108回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.439	700,000	692,293	2039/4/11		第239回一般担保住宅金融支援機構債券	0.393	300,000	303,882	2033/6/20	
第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.253	400,000	382,012	2039/7/11		第255回一般担保住宅金融支援機構債券	0.548	200,000	202,030	2039/1/20	
第125回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.379	700,000	682,731	2040/4/24		第291回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	300,000	301,962	2034/2/20	
第130回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.479	500,000	496,810	2040/7/20		第279回一般担保住宅金融支援機構債券	0.285	800,000	793,640	2034/12/20	
第135回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.35	500,000	499,655	2035/10/15		第283回一般担保住宅金融支援機構債券	0.274	400,000	395,700	2035/2/20	
第34回日本政策投資銀行債券	2.67	200,000	269,670	2037/3/19		第308回一般担保住宅金融支援機構債券	0.306	400,000	397,232	2035/12/20	
第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	133,114	2035/9/20		第21回成田国際空港株式会社社債	0.427	500,000	497,975	2036/8/22	
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	200,000	263,616	2035/12/20		第23回成田国際空港株式会社社債	0.677	700,000	721,980	2036/12/16	
第10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	702,296	2038/9/17		第25回成田国際空港株式会社社債	0.771	300,000	307,518	2037/12/18	
第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.19	100,000	120,091	2031/3/20		第27回成田国際空港株式会社社債	0.657	600,000	613,932	2038/3/12	
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	500,000	591,375	2032/3/19		第30回成田国際空港株式会社社債	0.77	700,000	727,839	2038/10/22	
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	500,000	586,820	2032/9/17		第35回成田国際空港株式会社社債	0.27	100,000	94,546	2039/9/16	
第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.55	500,000	579,355	2034/3/17		第36回成田国際空港株式会社社債	0.2	400,000	400,316	2030/1/29	
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.133	100,000	110,717	2035/3/20		第37回成田国際空港株式会社社債	0.424	300,000	291,240	2040/1/27	
第191回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.661	200,000	206,790	2037/12/18		第39回成田国際空港株式会社社債	0.409	600,000	599,508	2035/10/28	
第194回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.64	500,000	514,925	2037/12/18		第40回成田国際空港株式会社社債	0.529	500,000	498,320	2038/10/28	
第210回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.677	700,000	724,206	2038/9/17		第41回成田国際空港株式会社社債	0.575	600,000	596,298	2040/10/26	
第9回道路債債券	2.9	100,000	129,659	2032/5/20		第7回国際協力機構債券	1.991	100,000	118,394	2031/6/13	
第21回道路債債券	2.75	100,000	129,982	2033/6/20		第15回国際協力機構債券	1.724	300,000	305,427	2032/9/17	
第28回道路債債券	2.83	500,000	659,535	2033/12/20		第19回国際協力機構債券	1.725	100,000	117,453	2033/6/20	
第33回道路債債券	2.91	100,000	133,871	2034/6/20		第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	117,762	2033/9/20	
第43回道路債債券	2.66	200,000	262,794	2034/12/20		第25回国際協力機構債券	1.52	600,000	693,828	2034/6/20	

銘 柄	第99期末				銘 柄	第99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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第27回国際協力機構債券	1.451	400,000	459,464	2034/ 9 /20	第4回協和エクシオ株式会社無担保社債	0.12	500,000	496,265	2024/10/25
第33回国際協力機構債券	1.13	100,000	110,731	2035/12/20	第5回協和エクシオ株式会社無担保社債	0.19	200,000	197,550	2026/10/23
第36回国際協力機構債券	0.313	100,000	98,668	2036/ 6 /20	第1回高砂熟芋工業株式会社無担保社債	0.37	200,000	200,376	2024/ 4 /19
第39回国際協力機構債券	0.744	400,000	418,880	2037/ 2 /20	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	592,680	2029/ 7 /13
第43回国際協力機構債券	0.625	700,000	719,243	2037/12/18	第1回パルソールホールディングス株式会社無担保社債	0.08	700,000	699,832	2021/ 6 /14
第45回国際協力機構債券	0.559	600,000	609,570	2038/ 6 /18	第13回森永乳業株式会社無担保社債	0.884	500,000	510,960	2024/ 5 /8
第49回国際協力機構債券	0.333	300,000	290,820	2039/ 6 /20	第14回森永乳業株式会社無担保社債	0.774	100,000	102,337	2025/12/10
第54回国際協力機構債券	0.445	600,000	592,584	2040/ 6 /26	第15回森永乳業株式会社無担保社債	0.37	700,000	702,506	2027/ 7 /23
第56回国際協力機構債券	0.459	700,000	692,384	2040/ 9 /20	第16回森永乳業株式会社無担保社債	0.395	200,000	200,764	2028/ 9 /14
第58回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.81	600,000	711,822	2033/ 8 /19	第17回森永乳業株式会社無担保社債	0.24	400,000	393,092	2029/ 9 /6
第63回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.56	400,000	464,052	2034/ 2 /27	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	300,630	2024/ 9 /13
第69回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.441	500,000	573,380	2034/ 8 /4	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	400,176	2023/ 1 /30
第75回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.157	200,000	222,134	2035/ 2 /26	第1回雪印メグミルク株式会社無担保社債	0.45	800,000	801,624	2028/12/25
第78回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.801	100,000	105,991	2030/ 5 /28	第10回日本ハム株式会社無担保社債	0.15	200,000	199,688	2024/ 2 /20
第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.221	200,000	223,982	2035/ 8 /17	第12回日本ハム株式会社無担保社債	0.25	700,000	698,845	2026/ 2 /20
第90回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2	500,000	500,000	2031/ 5 /30	第12回日本ハム株式会社無担保社債	0.36	600,000	598,596	2029/ 2 /20
第96回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.274	700,000	703,997	2031/11/28	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	300,129	2022/ 6 /1
第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.739	500,000	523,250	2037/ 2 /27	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	594,456	2026/ 9 /4
第102回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.428	500,000	510,370	2032/ 5 /28	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	492,220	2029/ 9 /5
第106回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.616	500,000	514,000	2037/ 8 /25	第10回アサヒ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	800,744	2022/ 6 /13
第113回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.63	200,000	205,752	2038/ 2 /26	第13回アサヒ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	700,938	2027/ 6 /11
第115回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.395	100,000	101,298	2033/ 5 /30	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	604,626	2021/ 9 /24
第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.663	400,000	413,216	2038/ 8 /27	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	509,170	2025/ 2 /28
第121回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.515	500,000	513,290	2033/11/28	第13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	300,246	2023/12/6
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	600,000	597,474	2034/ 5 /30	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	498,890	2024/ 9 /5
第36回大成建設株式会社無担保社債	0.14	400,000	400,252	2022/ 7 /22	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	790,768	2029/ 9 /5
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	200,000	203,838	2023/ 5 /9	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	100,018	2030/ 6 /4
第22回株式会社大林組無担保社債	0.385	600,000	603,642	2028/ 9 /13	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	499,890	2022/ 4 /25
第23回株式会社大林組無担保社債	0.13	500,000	499,705	2020/10/25	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	400,500	2024/ 4 /25
第23回清水建設株式会社無担保社債	0.25	800,000	803,320	2024/ 8 /2	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	200,446	2027/ 4 /23
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	200,000	199,948	2027/11/30	第6回サントリアールホールディングス株式会社無担保社債	0.22	800,000	801,352	2026/ 6 /2
第25回清水建設株式会社無担保社債	0.27	200,000	197,372	2029/ 9 /3	第3回コカ・コーラウエスト株式会社無担保社債	0.524	500,000	502,645	2022/ 6 /17
第26回清水建設株式会社無担保社債	0.11	300,000	299,631	2024/12/12	第1回コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス社債	0.1	800,000	797,632	2024/ 9 /19
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	707,679	2028/11/1	第2回コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス社債	0.2	800,000	795,632	2026/ 9 /18
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	596,154	2029/ 7 /19	第3回コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス社債	0.27	600,000	593,562	2029/ 9 /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	500,830	2025/ 7 /11	第3回サントリアール食品インテリナショナル株式会社無担保社債	0.001	500,000	499,630	2021/ 7 /26
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	501,680	2030/ 7 /12	第2 回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	600,000	598,512	2024/ 2 /23
第44回鹿島建設株式会社無担保社債	0.3	300,000	299,787	2026/ 7 /22	第10回日清オイログループ株式会社無担保社債	0.769	300,000	306,234	2024/ 9 /10
第46回鹿島建設株式会社無担保社債	0.11	300,000	298,758	2025/ 2 /28	第11回日清オイログループ株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,107	2024/12/4
第8 回西松建設株式会社無担保社債	0.18	800,000	795,904	2024/ 9 /20	第12回日清オイログループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	300,324	2027/12/3
第10回西松建設株式会社無担保社債	0.33	500,000	500,385	2025/ 7 /18	第3 回不二製油グループ本社株式会社無担保社債	0.456	200,000	200,812	2022/12/9
第23回前田建設工業株式会社無担保社債	0.28	400,000	400,524	2023/ 7 /28	第2 回株式会社Jーオイルミズ無担保社債	0.37	600,000	600,798	2027/ 5 /28
第26回前田建設工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	298,686	2024/ 9 /12	第33回双日株式会社無担保社債	0.519	400,000	402,192	2024/ 3 /8
第3 回戸田建設株式会社無担保社債	0.27	400,000	400,012	2022/12/14	第35回双日株式会社無担保社債	0.605	300,000	300,537	2028/ 3 /8
第3 回五洋建設株式会社無担保社債	0.68	500,000	501,175	2021/ 7 /30	第7 回キッコーマン株式会社無担保社債	1.312	400,000	404,256	2021/12/15
第3 回住友林業株式会社無担保社債	0.33	600,000	601,974	2026/ 6 /17	第24回味の素株式会社無担保社債	0.19	500,000	501,385	2024/ 3 /8
第4 回住友林業株式会社無担保社債	0.25	400,000	400,616	2025/ 3 /7	第25回味の素株式会社無担保社債	0.355	700,000	704,851	2027/ 3 /9
第5 回住友林業株式会社無担保社債	0.35	400,000	400,032	2028/ 3 /7	第3 回キュービー株式会社無担保社債	0.23	700,000	699,455	2026/ 2 /13
第8 回住友林業株式会社無担保社債	0.38	500,000	499,865	2029/ 3 /6	第22回株式会社ニチレイ無担保社債	0.36	600,000	601,152	2021/10/22
第9 回住友林業株式会社無担保社債	0.28	700,000	691,439	2029/12/6	第23回株式会社ニチレイ無担保社債	0.19	600,000	599,970	2023/10/25
第12回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.07	700,000	700,021	2022/ 6 /1	第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	700,000	700,875	2025/ 8 /29
第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	100,102	2027/ 6 /1	第25回株式会社ニチレイ無担保社債	0.24	300,000	300,318	2027/ 8 /31
第19回積水ハウス株式会社無担保社債	0.04	500,000	499,785	2021/ 7 /20	第11回日本たばこ産業株式会社社債	0.599	100,000	101,879	2025/ 7 /15
第21回積水ハウス株式会社無担保社債	0.2	800,000	798,136	2026/ 7 /17	第12回日本たばこ産業株式会社社債	0.11	700,000	699,440	2023/ 9 /8
第3 回協和エクシオ株式会社無担保社債	0.15	200,000	199,832	2022/ 2 /24	第5 回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	300,000	306,537	2024/ 4 /24

銘柄	利率	第99期末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
第8回ヒューリック株式会社無担保社債	0.3	700,000	697,284	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	301,140	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	696,962	2027/8/4	
第42回東洋紡株式会社無担保社債	0.23	500,000	496,590	2026/12/11	
第4回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,745	2024/12/20	
第5回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.33	300,000	299,538	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	308,190	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	300,081	2021/6/2	
第14回森ビル株式会社無担保社債	0.861	300,000	306,111	2024/8/14	
第17回森ビル株式会社無担保社債	0.523	100,000	100,218	2021/8/13	
第20回森ビル株式会社無担保社債	0.12	500,000	499,960	2021/10/25	
第21回森ビル株式会社無担保社債	0.44	600,000	599,346	2027/2/16	
第28回東レ株式会社無担保社債	0.18	300,000	300,102	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	498,620	2027/7/30	
第1回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.514	300,000	302,064	2022/6/20	
第28回東レ株式会社無担保社債	0.925	200,000	202,350	2022/7/20	
第29回東レ株式会社無担保社債	1.012	100,000	102,092	2023/7/14	
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	700,000	702,212	2027/7/16	
第31回東レ株式会社無担保社債	0.25	600,000	601,866	2024/7/19	
第33回東レ株式会社無担保社債	0.38	400,000	399,708	2028/7/18	
第7回株式会社クラレ無担保社債	0.19	500,000	499,740	2025/4/25	
第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	599,202	2028/4/25	
第10回旭化成株式会社無担保社債	0.1	400,000	399,596	2023/12/6	
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	498,920	2024/9/6	
第12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	496,640	2029/9/6	
第15回旭化成株式会社無担保社債	0.28	500,000	500,685	2030/6/19	
第33回王子製紙株式会社無担保社債	0.28	700,000	703,836	2025/1/24	
第34回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	201,662	2028/1/26	
第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	302,670	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	699,811	2030/7/17	
第25回北越製紙株式会社無担保社債	0.17	600,000	600,114	2021/6/17	
第26回北越製紙株式会社無担保社債	0.18	500,000	500,330	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	600,162	2024/3/13	
第20回レンゴー株式会社無担保社債	0.498	400,000	402,304	2022/9/2	
第21回レンゴー株式会社無担保社債	0.28	600,000	601,860	2023/12/8	
第22回レンゴー株式会社無担保社債	0.39	700,000	703,899	2026/12/8	
第25回レンゴー株式会社無担保社債	0.415	200,000	200,328	2028/12/13	
第27回レンゴー株式会社無担保社債	0.3	800,000	790,888	2029/12/12	
第1回株式会社マクロミル無担保社債	0.27	200,000	199,910	2021/7/27	
第49回住友化学株式会社無担保社債	0.944	100,000	102,494	2024/4/25	
第54回住友化学株式会社無担保社債	0.2	500,000	500,945	2023/9/1	
第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	701,645	2027/9/13	
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	200,420	2024/9/13	
第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,938	2028/4/17	
第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	400,048	2024/4/16	
第6回株式会社クレハ無担保社債	0.14	600,000	599,730	2022/9/1	
第21回デンカ株式会社無担保社債	0.28	600,000	599,190	2025/4/23	
第22回デンカ株式会社無担保社債	0.23	500,000	496,605	2026/12/4	
第10回イビデン株式会社無担保社債	0.11	600,000	596,082	2024/9/12	
第3回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	400,172	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	601,836	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	400,072	2030/5/31	
第13回大陽日酸株式会社無担保社債	0.14	700,000	700,112	2021/12/15	
第14回大陽日酸株式会社無担保社債	0.39	400,000	401,540	2026/12/15	
第16回大陽日酸株式会社無担保社債	0.19	400,000	396,892	2026/10/16	

銘柄	利率	第99期末			償還年月日
		額面金額	評価額	額	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
第7回株式会社カネカ無担保社債	0.11	200,000	198,838	2024/9/12	
第8回株式会社カネカ無担保社債	0.24	200,000	196,702	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	401,572	2030/9/3	
第42回三井化学株式会社無担保社債	1.354	100,000	100,632	2021/7/28	
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	300,000	301,131	2024/7/24	
第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	100,358	2027/7/23	
第50回三井化学株式会社無担保社債	0.27	500,000	493,035	2029/12/5	
第10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	200,946	2022/6/3	
第10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	302,400	2022/12/2	
第20回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.32	600,000	602,604	2026/6/9	
第20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	603,990	2028/12/19	
第30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	697,970	2027/2/26	
第30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	990,500	2030/2/28	
第1回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.14	500,000	500,180	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	601,260	2024/9/13	
第17回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.5	200,000	200,892	2030/12/13	
第6回積水化学工業株式会社無担保社債	0.28	700,000	701,183	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	492,960	2029/9/13	
第7回日本ゼオン株式会社無担保社債	0.559	200,000	200,802	2022/6/22	
第13回宇都興産株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,750	2022/5/25	
第4回日本化薬株式会社無担保社債	0.13	400,000	398,424	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	599,556	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	600,888	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	494,610	2029/9/27	
第3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	703,983	2028/10/25	
第1回株式会社ADEKA無担保社債	0.18	300,000	298,953	2024/3/15	
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	500,000	500,310	2024/5/31	
第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	599,496	2027/6/4	
第6回テルモ株式会社無担保社債	0.17	400,000	400,376	2023/4/19	
第7回テルモ株式会社無担保社債	0.24	200,000	200,020	2026/4/17	
第9回テルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	997,940	2027/4/26	
第3回みちがわホールディングス株式会社無担保社債	0.15	400,000	397,308	2024/10/25	
第1回沢井製薬株式会社無担保社債	0.594	300,000	301,482	2022/6/10	
第4回第一三共株式会社無担保社債	0.846	600,000	610,704	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	199,806	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	300,258	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	1,003,280	2029/3/7	
第37回D I C株式会社無担保社債	1.0	100,000	103,314	2025/9/18	
第41回D I C株式会社無担保社債	0.15	600,000	600,108	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	802,608	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	501,165	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	700,357	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	500,025	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	800,840	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	797,856	2024/10/31	
第3回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.882	700,000	710,409	2022/12/2	
第7回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	300,387	2027/3/3	
第10回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.24	200,000	200,792	2025/12/5	
第13回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	499,450	2024/7/26	
第15回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債	0.12	500,000	499,550	2025/3/5	
第4回荒川化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	498,420	2024/12/19	
第4回出光興産株式会社無担保社債	0.541	400,000	400,924	2021/8/4	
第5回出光興産株式会社無担保社債	0.2	200,000	200,304	2022/12/5	
第6回出光興産株式会社無担保社債	0.27	700,000	700,560	2025/9/19	
第8回出光興産株式会社無担保社債	0.09	200,000	199,118	2024/9/20	

銘柄	第99期末				銘柄	第99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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第9回出光興産株式会社無担保社債	0.18	400,000	396,052	2026/9/18	第1回グローリー株式会社無担保社債	0.15	500,000	498,135	2023/12/6
第6回JXホールディングス株式会社無担保社債	1.119	300,000	307,431	2023/7/19	第43回日本精工株式会社無担保社債	0.769	100,000	101,858	2024/9/10
第9回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,232	2024/6/4	第44回日本精工株式会社無担保社債	0.12	300,000	299,973	2022/3/14
第13回JXホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	701,015	2026/7/28	第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	299,421	2027/12/7
第2回JXTGホールディングス株式会社無担保社債	0.405	700,000	703,633	2027/8/3	第49回日本精工株式会社無担保社債	0.29	700,000	699,405	2025/11/28
第13回横濱ゴム株式会社無担保社債	0.25	100,000	100,310	2023/12/8	第51回日本精工株式会社無担保社債	0.19	300,000	297,066	2026/9/2
第9回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.08	500,000	499,950	2022/4/21	第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.345	400,000	398,236	2028/3/8
第10回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.2	500,000	501,105	2024/4/19	第9回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	500,000	493,265	2029/11/28
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	800,000	802,280	2027/4/21	第10回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.21	600,000	595,248	2026/11/27
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	200,000	200,538	2026/4/17	第5回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	600,000	600,486	2023/12/8
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	1,005,340	2029/4/19	第12回THK株式会社無担保社債	0.27	500,000	500,960	2025/2/7
第22回住友ゴム工業株式会社無担保社債	1.378	100,000	100,543	2021/6/28	第14回THK株式会社無担保社債	0.29	700,000	700,595	2026/2/6
第3回パンドーラ化学株式会社無担保社債	0.4	200,000	200,406	2024/1/19	第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	600,000	611,850	2023/12/13
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	602,616	2027/5/28	第29回富士電機株式会社無担保社債	0.28	500,000	501,070	2023/8/31
第1回AGC株式会社無担保社債	0.23	700,000	701,638	2025/10/10	第30回富士電機株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,671	2022/5/21
第15回住友大阪セメント株式会社無担保社債	0.24	600,000	600,666	2023/8/30	第3回日本電産株式会社無担保社債	0.956	600,000	608,388	2027/9/20
第25回太平洋セメント株式会社無担保社債	0.63	200,000	200,636	2021/9/10	第8回日本電産株式会社無担保社債	0.1	800,000	796,920	2024/7/19
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.37	800,000	798,640	2028/6/14	第9回日本電産株式会社無担保社債	0.02	800,000	798,704	2022/11/28
第10回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.11	400,000	398,764	2024/6/20	第10回日本電産株式会社無担保社債	0.09	800,000	796,280	2024/11/28
第11回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.27	500,000	493,580	2029/6/20	第50回日本電気株式会社無担保社債	0.29	500,000	500,790	2022/6/15
第1回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.28	400,000	399,260	2026/9/18	第53回日本電気株式会社無担保社債	0.26	300,000	300,075	2023/9/21
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.22	500,000	500,965	2024/5/20	第15回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.34	300,000	300,945	2026/9/18
第4回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,916	2027/5/20	第16回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.26	400,000	401,124	2024/9/6
第5回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.23	400,000	400,432	2024/12/20	第17回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.36	700,000	701,190	2027/9/6
第70回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.951	100,000	101,186	2022/6/20	第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	800,000	801,240	2030/7/16
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	688,177	2029/6/20	第12回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	600,000	603,288	2022/3/18
第2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	610,230	2024/9/19	第15回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	500,000	500,320	2021/9/17
第3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	499,525	2025/5/21	第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	400,000	404,376	2026/9/18
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	0.26	500,000	495,875	2026/5/27	第19回パナソニック株式会社無担保社債	0.37	600,000	597,468	2030/3/5
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	591,708	2029/5/25	第31回ソニー株式会社無担保社債	0.23	500,000	500,350	2021/9/17
第29回住友金属鉱山株式会社無担保社債	1.257	400,000	402,692	2021/8/31	第32回ソニー株式会社無担保社債	0.28	100,000	100,315	2023/9/20
第30回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.02	400,000	399,640	2021/9/17	第33回ソニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	301,329	2026/9/18
第31回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.1	700,000	695,912	2024/12/13	第35回ソニー株式会社無担保社債	0.18	400,000	396,064	2026/10/9
第32回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.25	800,000	784,784	2029/12/13	第36回ソニー株式会社無担保社債	0.3	700,000	689,458	2029/10/10
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	498,600	2023/9/14	第6回TDK株式会社無担保社債	0.31	200,000	200,208	2027/7/28
第26回住友電気工業株式会社無担保社債	0.3	700,000	699,223	2027/3/1	第7回TDK株式会社無担保社債	0.43	800,000	800,880	2030/7/26
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	600,576	2026/12/16	第5回株式会社堀場製作所無担保社債	0.18	700,000	689,521	2026/10/16
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	591,258	2029/10/25	第6回株式会社堀場製作所無担保社債	0.27	600,000	587,808	2029/10/17
第9回LIXILグループ無担保社債	0.08	500,000	499,820	2021/8/31	第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	1,000,000	997,800	2027/6/18
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	699,706	2022/3/9	第5回スタンレー電気株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,175	2024/4/19
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	600,720	2024/3/8	第1回株式会社村田製作所無担保社債	0.08	700,000	699,804	2022/1/24
第19回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.109	200,000	201,290	2021/9/17	第2回株式会社村田製作所無担保社債	0.15	700,000	699,769	2024/1/24
第29回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.08	500,000	495,735	2026/6/19	第3回株式会社村田製作所無担保社債	0.06	800,000	796,784	2024/9/10
第2回ナブテスコ株式会社無担保社債	0.14	600,000	599,988	2021/12/13	第1回東海理化電機製作所無担保社債	0.34	300,000	299,094	2027/6/7
第4回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.17	700,000	699,881	2023/3/15	第26回三菱重工業株式会社無担保社債	0.877	600,000	611,958	2023/9/4
第5回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.13	500,000	498,930	2024/7/24	第40回川崎重工業株式会社無担保社債	0.988	200,000	204,692	2023/12/15
第6回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.29	400,000	396,244	2030/1/24	第45回川崎重工業株式会社無担保社債	0.1	300,000	299,916	2021/7/15
第17回日立建機株式会社無担保社債	0.16	500,000	499,455	2022/12/13	第40回株式会社IHI無担保社債	0.592	300,000	300,447	2021/6/17
第9回株式会社住友原製作所無担保社債	0.18	100,000	99,969	2022/10/24	第43回株式会社IHI無担保社債	0.2	400,000	397,912	2024/10/17
第19回ダイキン工業株式会社無担保社債	1.204	200,000	204,188	2022/12/12	第6回J A三井リース株式会社無担保社債	0.2	300,000	300,219	2022/1/27
第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,982	2026/9/30	第7回J A三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,069	2022/9/15
第23回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.13	600,000	597,186	2026/10/9	第8回J A三井リース株式会社無担保社債	0.31	200,000	200,492	2024/9/13
第24回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.18	600,000	592,716	2029/10/11	第15回J A三井リース株式会社無担保社債	0.22	600,000	599,238	2025/1/24
第27回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.26	300,000	299,355	2030/9/18	第4回昭和リース株式会社無担保社債	0.3	800,000	794,584	2024/12/18
第6回株式会社タダノ無担保社債	0.25	800,000	793,184	2026/12/11	第5回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.37	500,000	497,610	2029/9/4

銘	柄	第99期末				銘	柄	第99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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円			普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
第7回コンソリディ・フィナンシャルグループ(劣後)	0.6	500,000	500,565	2030/9/3		第4回株式会社新生銀行無担保社債	0.25	600,000	600,378	2021/10/27	
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	400,228	2021/8/9		第5回株式会社新生銀行無担保社債	0.21	400,000	399,732	2023/7/13	
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	0.304	300,000	300,201	2021/8/2		第6回株式会社新生銀行無担保社債	0.24	700,000	699,671	2023/12/13	
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	601,020	2022/8/4		第14回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.19	100,000	100,116	2022/9/8	
第4回三井住友トラスト・パナソニックフィナンシャル無担保社債	0.23	700,000	700,161	2023/10/25		第21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	696,094	2030/1/15	
第12回三井住友トラスト・パナソニックフィナンシャル無担保社債	0.14	800,000	797,568	2024/10/25		第22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	798,104	2029/12/12	
第14回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.963	100,000	101,893	2023/3/20		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	101,661	2024/6/26	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	600,000	594,714	2026/9/25		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	213,194	2030/6/18	
第13回本田技研工業株式会社無担保社債	0.12	800,000	796,352	2025/3/5		第12回株式会社社りそなホールディングス無担保社債	0.12	500,000	499,865	2021/1/24	
第14回本田技研工業株式会社無担保社債	0.15	800,000	791,688	2027/3/5		第18回株式会社社りそなホールディングス無担保社債	0.06	600,000	599,754	2021/7/23	
第1回株式会社SUBARU無担保社債	0.12	600,000	598,560	2024/12/17		第20回株式会社社りそなホールディングス無担保社債	0.27	500,000	500,055	2025/7/23	
第2回株式会社SUBARU無担保社債	0.21	700,000	695,611	2026/12/17		第23回株式会社社りそなホールディングス無担保社債	0.06	600,000	599,010	2022/12/13	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	400,000	399,800	2025/3/13		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	202,054	2024/9/5	
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	701,260	2023/9/25		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	430,786	2026/2/27	
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	800,096	2024/8/1		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	793,968	2026/6/8	
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	800,376	2024/8/2		第13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	600,678	2030/9/2	
第3回株式会社トプコン無担保社債	0.3	500,000	499,840	2025/6/24		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	723,013	2026/12/18	
第4回日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	796,808	2029/7/19		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	687,516	2027/7/27	
第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	0.14	700,000	700,049	2021/12/7		第38回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	200,000	226,068	2027/4/20	
第2回株式会社アシックス無担保社債	0.2	600,000	599,604	2024/3/13		第23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	712,200	2029/10/16	
第4回株式会社ニフコ無担保社債	0.25	500,000	498,685	2025/5/8		第24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	457,068	2030/9/27	
第5回株式会社ニフコ無担保社債	0.385	500,000	498,280	2028/5/8		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	214,142	2025/11/12	
第6回株式会社ニフコ無担保社債	0.28	700,000	687,932	2029/9/11		第28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	108,315	2026/1/20	
第59回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.378	200,000	200,950	2021/6/4		第30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	1,106,127	2021/6/9	
第67回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.964	100,000	101,419	2022/9/9		第33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	108,970	2026/6/9	
第87回丸紅株式会社無担保社債	1.29	200,000	201,662	2021/10/15		第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.849	400,000	404,736	2024/9/12	
第102回丸紅株式会社無担保社債	0.756	300,000	305,562	2024/7/25		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	840,504	2030/5/29	
第5回長瀬産業株式会社無担保社債	0.539	200,000	201,042	2022/6/16		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	488,222	2025/10/15	
第6回長瀬産業株式会社無担保社債	0.15	400,000	398,740	2024/12/12		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	238,382	2026/6/15	
第7回長瀬産業株式会社無担保社債	0.29	600,000	592,146	2029/12/12		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	129,621	2026/9/15	
第16回豊田通商株式会社無担保社債	1.35	300,000	303,315	2021/12/8		第14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	706,911	2028/3/16	
第17回豊田通商株式会社無担保社債	0.81	100,000	101,832	2023/12/5		第8回株式会社社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.878	100,000	100,584	2021/6/1	
第18回豊田通商株式会社無担保社債	1.014	200,000	207,758	2025/12/5		第9回株式会社社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	500,000	554,170	2026/12/21	
第19回豊田通商株式会社無担保社債	0.954	100,000	103,882	2026/7/10		第11回株式会社社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.78	200,000	203,306	2022/3/15	
第1回ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.14	200,000	200,026	2022/2/22		第12回株式会社社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.464	800,000	888,304	2027/3/15	
第2回ユニー・ファミリーマートホールディングス	0.24	800,000	799,968	2024/2/22		第1回株式会社千歳銀行無担保社債(劣後特約付)	0.911	600,000	604,506	2024/8/29	
第63回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	226,472	2027/4/23		第4回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.48	800,000	796,408	2029/4/26	
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	800,000	801,656	2029/7/11		第5回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.37	800,000	794,128	2029/11/28	
第75回三井物産株式会社無担保社債	0.23	700,000	697,214	2029/12/12		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	106,757	2025/10/26	
第6回日本紙パルプ商事株式会社無担保社債	0.19	400,000	397,748	2024/12/12		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	670,074	2026/4/27	
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	101,812	2022/3/16		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	447,200	2027/5/15	
第46回住友商事株式会社無担保社債	0.884	100,000	101,379	2022/12/12		第10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	328,998	2026/6/15	
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	100,413	2021/5/24		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	101,637	2022/3/22	
第78回三菱商事株式会社無担保社債	1.155	100,000	101,209	2022/3/9		第10回株式会社セブン銀行無担保社債	0.803	500,000	507,340	2023/3/20	
第79回三菱商事株式会社無担保社債	1.022	100,000	101,247	2022/5/20		第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	500,000	507,150	2024/12/20	
第30回阪和興業株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,488	2023/6/13		第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	505,275	2027/9/17	
第26回株式会社丸井グループ無担保社債	0.562	200,000	200,326	2021/6/4		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)	0.66	600,000	598,176	2026/6/19	
第30回株式会社丸井グループ無担保社債	0.13	500,000	500,030	2021/8/17		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)	0.55	500,000	499,755	2027/1/26	
第31回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	500,000	500,345	2022/5/25		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	298,920	2027/6/21	
第34回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	800,000	800,288	2023/10/25		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	806,792	2030/6/24	
第36回株式会社丸井グループ無担保社債	0.25	300,000	296,514	2026/10/16		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	801,208	2030/6/24	
第48回株式会社クレディセゾン無担保社債	1.038	200,000	204,688	2023/10/20		第24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	201,010	2021/6/1	
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	102,297	2024/4/24		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	545,440	2026/6/1	
第79回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.22	500,000	500,160	2025/1/31		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	657,444	2026/12/18	
第81回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.2	400,000	399,512	2025/7/15		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	109,744	2026/1/30	

銘柄	利率	第99期末			
		額面金額	評価額	償還年月日	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
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	226,016	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	556,890	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	238,138	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	434,756	2026/9/11	
第20回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.49	400,000	406,704	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	100,110	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	501,590	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	499,980	2023/11/2	
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	500,000	498,750	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	608,202	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	603,030	2032/9/17	
第45回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.07	500,000	491,390	2022/6/20	
第25回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.2	500,000	500,380	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	499,275	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	500,055	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	699,916	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	598,146	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	497,920	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	600,198	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	599,892	2023/9/7	
第10回インフィニティサービス株式会社無担保社債	0.3	800,000	796,936	2025/1/30	
第6回インフィニティサービス株式会社無担保社債	0.35	400,000	399,980	2024/5/28	
第8回インフィニティサービス株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,482	2024/9/20	
第9回インフィニティサービス株式会社無担保社債	0.38	700,000	693,931	2026/9/18	
第12回株式会社ジャックス無担保社債	0.545	100,000	100,344	2021/12/3	
第13回株式会社ジャックス無担保社債	0.644	200,000	201,064	2022/2/25	
第17回株式会社ジャックス無担保社債	0.37	200,000	200,690	2024/6/7	
第20回株式会社ジャックス無担保社債	0.36	300,000	300,618	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	502,010	2023/7/22	
第19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	502,470	2025/7/18	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	300,000	311,679	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	501,750	2024/6/20	
第5回株式会社アプラスフィナンシャル無担保社債	0.25	600,000	596,436	2023/10/13	
第6回株式会社アプラスフィナンシャル無担保社債	0.29	600,000	593,724	2024/12/5	
第171回オリックス株式会社無担保社債	1.126	220,000	224,987	2023/4/28	
第175回オリックス株式会社無担保社債	1.064	100,000	102,615	2023/11/24	
第180回オリックス株式会社無担保社債	0.797	500,000	511,485	2024/9/4	
第181回オリックス株式会社無担保社債	0.812	100,000	102,390	2024/9/26	
第197回オリックス株式会社無担保社債	0.19	300,000	300,273	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	500,925	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	408,056	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	200,674	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	303,231	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	604,248	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	400,200	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	201,094	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	200,530	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	602,262	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	500,185	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	200,578	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	400,644	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	100,019	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	100,043	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	200,098	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	200,268	2024/8/9	

銘柄	利率	第99期末			
		額面金額	評価額	償還年月日	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
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	699,328	2023/9/4	
第3回ゾーフィナンシャルホールディングス株式会社無担保社債	0.11	400,000	399,344	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	399,488	2024/7/31	
第10回E&K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	600,480	2023/7/13	
第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	117,857	2030/12/20	
第43回三井不動産株式会社無担保社債	1.272	100,000	100,461	2030/6/18	
第45回三井不動産株式会社無担保社債	0.997	300,000	303,534	2022/5/24	
第46回三井不動産株式会社無担保社債	0.964	100,000	101,363	2022/8/30	
第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	117,662	2033/8/2	
第56回三井不動産株式会社無担保社債	0.2	400,000	400,120	2024/8/28	
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	400,000	400,548	2026/3/13	
第67回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	300,516	2029/4/13	
第71回三井不動産株式会社無担保社債	0.31	600,000	594,504	2030/4/16	
第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	234,634	2032/12/20	
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	227,478	2027/9/17	
第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.425	300,000	342,711	2027/10/29	
第93回三菱地所株式会社無担保社債	2.555	200,000	233,120	2028/7/28	
第113回三菱地所株式会社無担保社債	1.067	100,000	103,485	2024/12/27	
第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	300,465	2026/12/18	
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	299,271	2027/6/18	
第125回三菱地所株式会社無担保社債	0.19	700,000	700,511	2025/3/14	
第130回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	700,000	695,177	2029/8/3	
第94回住友不動産株式会社無担保社債	0.968	300,000	306,759	2023/12/12	
第96回住友不動産株式会社無担保社債	0.914	200,000	204,452	2024/3/18	
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	200,000	204,536	2024/4/26	
第98回住友不動産株式会社無担保社債	0.884	500,000	511,430	2024/6/10	
第104回住友不動産株式会社無担保社債	0.826	100,000	102,523	2025/4/28	
第108回住友不動産株式会社無担保社債	0.4	500,000	501,580	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	349,680	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	407,448	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	215,686	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	815,688	2024/9/20	
第12回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.09	200,000	214,440	2029/9/20	
第10回森トラスト総合リート投資法人無担保投資法人債	0.1	700,000	695,359	2023/2/20	
第100回東武鉄道株式会社無担保社債	1.1	200,000	204,264	2023/4/25	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	600,000	625,092	2026/6/17	
第111回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	600,000	605,262	2031/9/5	
第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	505,125	2036/12/5	
第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	900,000	905,040	2037/9/11	
第119回東武鉄道株式会社無担保社債	0.758	500,000	499,825	2038/5/24	
第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	781,864	2039/7/22	
第123回東武鉄道株式会社無担保社債	0.8	700,000	699,335	2040/4/20	
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	512,445	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	101,402	2025/1/28	
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	301,689	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	306,033	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	613,056	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	709,933	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	705,313	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	406,516	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	201,340	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	694,834	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	682,430	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	708,568	2030/5/22	
第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	767,688	2039/9/16	

銘柄		第99期末				銘柄		第99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
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
第4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	597,378	2040/6/8		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	463,796	2030/9/27	
第64回東京急行電鉄株式会社無担保社債	2.7	100,000	106,169	2023/6/6		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	118,026	2030/12/20	
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	101,274	2022/6/7		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	217,556	2026/12/22	
第76回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.563	500,000	542,875	2027/6/7		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	345,987	2032/7/23	
第78回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.528	400,000	437,548	2028/6/12		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	347,298	2032/12/27	
第79回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.709	200,000	204,002	2024/4/26		第89回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.757	300,000	306,309	2034/1/30	
第80回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.211	200,000	215,392	2029/4/27		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	454,976	2034/7/25	
第82回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.307	600,000	661,044	2033/6/3		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	107,075	2035/1/29	
第83回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.459	200,000	202,298	2031/4/22		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	510,695	2037/1/27	
第84回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.662	100,000	101,292	2036/4/22		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	307,635	2037/7/27	
第85回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	615,162	2036/9/26		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	712,278	2038/1/26	
第88回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.723	700,000	706,825	2038/5/28		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	776,824	2039/12/23	
第38回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.291	600,000	646,074	2028/12/11		第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	200,000	228,590	2027/12/20	
第39回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.222	500,000	537,525	2029/6/12		第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	115,921	2028/3/17	
第40回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.804	300,000	308,187	2036/12/1		第21回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.247	300,000	349,521	2029/3/21	
第41回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.751	700,000	710,983	2037/6/12		第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.175	200,000	233,468	2029/9/18	
第42回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.77	700,000	711,655	2037/12/4		第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.262	200,000	236,616	2030/3/12	
第43回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.676	1,000,000	999,320	2038/7/12		第28回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.111	800,000	939,360	2030/6/11	
第44回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.576	600,000	584,634	2039/11/28		第35回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.836	300,000	306,243	2032/9/27	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	600,000	599,418	2040/6/11		第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	228,766	2034/6/20	
第60回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.846	100,000	101,370	2022/10/18		第38回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.288	400,000	444,360	2034/12/12	
第68回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.098	600,000	644,664	2030/6/12		第40回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.21	400,000	440,440	2035/8/31	
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	504,655	2036/8/29		第41回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.816	200,000	209,308	2036/2/26	
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	715,176	2037/5/29		第44回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.175	500,000	501,325	2026/12/11	
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	610,584	2037/11/30		第45回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.604	700,000	708,148	2036/12/12	
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	800,000	816,856	2038/8/30		第41回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.591	800,000	795,992	2040/5/21	
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	700,000	704,417	2028/12/20		第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	101,000	103,533	2022/2/15	
第83回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.209	400,000	398,376	2029/6/20		第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.31	300,000	342,513	2027/9/17	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	591,432	2039/6/20		第34回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.3	300,000	343,704	2027/12/20	
第88回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.73	800,000	802,608	2040/4/23		第37回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	232,018	2028/5/22	
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	114,514	2027/11/29		第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	800,000	924,712	2029/1/29	
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	1.199	400,000	402,372	2021/7/28		第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.312	200,000	234,346	2029/4/24	
第34回京王電鉄株式会社無担保社債	0.32	300,000	302,853	2026/3/10		第46回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.157	100,000	116,990	2029/12/18	
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	102,198	2031/3/10		第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	300,000	354,255	2030/4/23	
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	504,140	2027/9/17		第58回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.895	200,000	233,394	2031/12/16	
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	613,212	2037/9/18		第63回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.725	200,000	231,628	2033/5/24	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	0.295	100,000	100,581	2027/11/29		第65回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.786	500,000	584,020	2033/9/13	
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	508,825	2037/11/27		第69回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	600,000	682,512	2034/7/28	
第40回京王電鉄株式会社無担保社債	0.205	600,000	596,400	2030/1/30		第101回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.309	100,000	110,698	2032/9/30	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	401,652	2040/5/25		第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.362	700,000	784,700	2034/11/28	
第48回京王電鉄株式会社無担保社債	1.004	200,000	204,490	2023/7/25		第73回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.014	700,000	752,535	2035/1/26	
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	604,572	2031/6/20		第76回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.196	100,000	109,991	2035/4/20	
第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	612,960	2038/9/7		第76回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.297	100,000	111,313	2035/6/18	
第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	1,011,470	2039/3/8		第77回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.21	100,000	110,110	2035/8/31	
第54回京成電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	399,612	2040/6/12		第78回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.018	200,000	214,904	2036/1/25	
第57回京成電鉄株式会社無担保社債	0.7	400,000	396,868	2040/8/31		第79回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.421	500,000	495,125	2036/4/14	
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	124,997	2033/9/20		第2回東京地下鉄株式会社社債	2.36	100,000	107,803	2024/6/20	
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	113,244	2026/7/17		第6回東京地下鉄株式会社社債	2.43	100,000	114,960	2027/9/17	
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	113,122	2026/9/18		第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	200,000	229,272	2027/12/20	
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	565,030	2027/4/16		第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	500,000	590,295	2030/3/19	
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	229,394	2027/9/17		第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	114,920	2032/5/25	
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	116,058	2028/7/25		第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	116,313	2033/6/14	
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	350,889	2028/12/12		第16回東京地下鉄株式会社社債	0.778	300,000	312,168	2036/3/11	
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	350,805	2029/12/21		第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	684,796	2036/6/20	
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	354,735	2030/3/22		第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	700,000	712,768	2037/6/19	

銘 柄	第99期末				銘 柄	第99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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	610,206	2037/12/15	第7回日本通運株式会社社無担保社債	1.09	100,000	100,704	2021/10/20
第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	101,130	2038/5/24	第9回日本通運株式会社社無担保社債	0.28	600,000	601,722	2026/2/25
第38回東京地下鉄株式会社社債	0.445	600,000	582,132	2040/1/31	第10回日本通運株式会社社無担保社債	0.12	300,000	299,799	2023/7/14
第41回東京地下鉄株式会社社債	0.275	300,000	301,653	2030/6/12	第11回日本通運株式会社社無担保社債	0.2	300,000	299,139	2026/7/14
第49回東京地下鉄株式会社社債	0.574	300,000	297,543	2041/1/22	第14回日本通運株式会社社無担保社債	0.28	300,000	300,402	2027/6/16
第1回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.758	600,000	604,644	2032/3/17	第7回ニコソホールディングス株式会社社無担保社債	0.28	400,000	393,532	2029/10/11
第2回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.67	500,000	497,895	2032/12/6	第9回ニコソホールディングス株式会社社無担保社債	0.42	800,000	799,040	2030/9/18
第3回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.445	700,000	699,545	2028/12/6	第3回株式会社日立物流無担保社債	0.1	600,000	599,454	2021/9/28
第4回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.27	600,000	588,606	2029/12/12	第7回株式会社日立物流無担保社債	0.405	600,000	596,976	2028/9/4
第2回株式会社鴻池運輸無担保社債	0.18	300,000	299,877	2022/3/2	第2回横浜高速鉄道株式会社社無担保社債	0.455	200,000	201,388	2027/2/23
第44回西日本鉄道株式会社社無担保社債	0.345	600,000	603,390	2026/3/4	第3回横浜高速鉄道株式会社社無担保社債	0.39	400,000	400,308	2028/2/28
第45回西日本鉄道株式会社社無担保社債	0.717	700,000	718,907	2031/3/4	第4回横浜高速鉄道株式会社社無担保社債	0.445	700,000	702,751	2028/12/14
第46回西日本鉄道株式会社社無担保社債	0.69	700,000	702,975	2036/9/9	第3回九州旅客鉄道株式会社社無担保社債	0.3	800,000	790,888	2029/12/11
第47回西日本鉄道株式会社社無担保社債	0.903	700,000	722,792	2037/4/14	第6回横浜高速鉄道株式会社社無担保社債	0.45	500,000	499,865	2030/9/17
第48回西日本鉄道株式会社社無担保社債	0.782	500,000	505,710	2037/9/4	第1回九州旅客鉄道株式会社社無担保社債	0.295	600,000	601,500	2029/3/7
第50回西日本鉄道株式会社社無担保社債	0.395	700,000	702,149	2028/9/6	第3回九州旅客鉄道株式会社社無担保社債	0.23	300,000	298,359	2029/12/10
第51回西日本鉄道株式会社社無担保社債	0.672	700,000	688,919	2039/5/30	第4回九州旅客鉄道株式会社社無担保社債	0.51	400,000	386,644	2039/12/9
第99回近鉄グループホールディングス株式会社社無担保社債	0.8	500,000	500,100	2031/9/2	第6回九州旅客鉄道株式会社社無担保社債	0.29	400,000	399,524	2030/6/7
第102回近鉄グループホールディングス株式会社社無担保社債	0.772	700,000	692,587	2032/7/27	第7回九州旅客鉄道株式会社社無担保社債	0.691	500,000	496,210	2040/6/8
第106回近鉄グループホールディングス株式会社社無担保社債	0.505	700,000	699,580	2028/1/25	第1回東京臨海高速鉄道株式会社社無担保社債	0.26	500,000	499,625	2030/10/22
第111回近鉄グループホールディングス株式会社社無担保社債	0.955	700,000	671,762	2038/7/26	第1回日本航空株式会社社無担保社債	0.47	700,000	675,087	2026/12/18
第112回近鉄グループホールディングス株式会社社無担保社債	0.47	800,000	788,880	2029/7/11	第2回日本航空株式会社社無担保社債	0.17	600,000	596,766	2021/12/20
第117回近鉄グループホールディングス株式会社社無担保社債	0.91	900,000	844,461	2040/1/30	第3回日本航空株式会社社無担保社債	0.399	500,000	470,980	2028/9/21
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社社無担保社債	0.819	600,000	611,880	2023/10/25	第5回日本航空株式会社社無担保社債	0.22	500,000	489,285	2024/3/19
第47回阪急阪神ホールディングス株式会社社無担保社債	1.202	500,000	538,910	2029/7/18	第7回日本航空株式会社社無担保社債	0.28	800,000	734,824	2029/12/14
第48回阪急阪神ホールディングス株式会社社無担保社債	0.817	800,000	825,776	2036/12/15	第30回ANAホールディングス株式会社社無担保社債	1.2	700,000	696,881	2026/9/18
第51回阪急阪神ホールディングス株式会社社無担保社債	0.789	700,000	714,224	2038/9/13	第15回三菱倉庫株式会社社無担保社債	0.734	500,000	507,960	2024/3/12
第52回阪急阪神ホールディングス株式会社社無担保社債	0.215	500,000	497,490	2029/11/21	第16回三菱倉庫株式会社社無担保社債	0.21	300,000	299,862	2024/12/6
第54回阪急阪神ホールディングス株式会社社無担保社債	0.486	800,000	766,560	2040/2/27	第17回三菱倉庫株式会社社無担保社債	0.34	500,000	500,404	2027/12/8
第37回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.87	200,000	204,620	2024/7/29	第18回三菱倉庫株式会社社無担保社債	0.22	700,000	689,031	2029/12/5
第40回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.841	600,000	618,744	2031/6/3	第19回三菱倉庫株式会社社無担保社債	0.61	400,000	385,296	2039/12/5
第41回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.7	700,000	709,086	2031/12/8	第3回株式会社社住友倉庫無担保社債	0.366	500,000	502,055	2022/12/16
第42回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.647	600,000	602,784	2032/5/28	第4回株式会社社住友倉庫無担保社債	0.639	300,000	306,561	2025/12/17
第43回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.941	700,000	713,573	2037/11/30	第5回株式会社社住友倉庫無担保社債	0.21	400,000	399,964	2025/3/26
第44回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.878	800,000	805,776	2038/5/21	第6回株式会社社住友倉庫無担保社債	0.838	700,000	709,338	2038/3/26
第45回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.871	700,000	716,331	2033/12/6	第7回株式会社社住友倉庫無担保社債	0.08	200,000	199,260	2024/9/24
第46回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.69	500,000	485,380	2039/11/28	第8回株式会社社住友倉庫無担保社債	0.21	600,000	592,530	2029/9/21
第47回南海電気鉄道株式会社社無担保社債	0.48	300,000	300,186	2030/6/4	第10回株式会社社住友倉庫無担保社債	0.27	300,000	299,208	2030/10/15
第24回京阪電気鉄道株式会社社無担保社債	1.7	300,000	308,946	2022/12/9	第63回日本電信電話株式会社社電信電話債券	0.69	500,000	506,320	2023/3/20
第25回京阪電気鉄道株式会社社無担保社債	1.34	100,000	100,618	2021/7/20	第20回KDDI株式会社社無担保社債	0.803	700,000	713,174	2023/12/20
第28回京阪電気鉄道株式会社社無担保社債	0.725	800,000	819,608	2025/9/1	第21回KDDI株式会社社無担保社債	0.669	500,000	509,210	2024/9/20
第29回京阪ホールディングス株式会社社無担保社債	0.34	600,000	602,610	2026/6/16	第22回KDDI株式会社社無担保社債	0.31	700,000	699,559	2028/7/12
第30回京阪ホールディングス株式会社社無担保社債	0.74	700,000	699,419	2038/7/16	第24回KDDI株式会社社無担保社債	0.25	700,000	701,407	2025/11/21
第31回京阪ホールディングス株式会社社無担保社債	0.455	200,000	201,344	2029/1/24	第25回KDDI株式会社社無担保社債	0.395	400,000	401,872	2028/11/22
第32回京阪ホールディングス株式会社社無担保社債	0.63	700,000	682,080	2039/12/16	第26回KDDI株式会社社無担保社債	0.13	100,000	99,899	2024/4/26
第50回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.857	200,000	207,246	2027/4/30	第27回KDDI株式会社社無担保社債	0.23	700,000	699,342	2026/4/24
第52回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.75	600,000	608,070	2036/8/29	第29回KDDI株式会社社無担保社債	0.02	800,000	798,848	2022/11/29
第53回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.85	600,000	619,944	2035/2/28	第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	400,000	406,484	2023/9/20
第54回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.806	700,000	711,914	2037/5/29	第23回沖縄電力株式会社社債	0.469	200,000	203,058	2025/3/25
第55回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.79	600,000	606,750	2037/12/4	第25回沖縄電力株式会社社債	0.25	700,000	703,773	2027/6/25
第56回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.748	600,000	601,170	2038/5/25	第26回沖縄電力株式会社社債	0.28	700,000	703,815	2028/12/25
第57回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.863	500,000	509,560	2038/9/10	第27回沖縄電力株式会社社債	0.19	800,000	796,704	2030/3/25
第58回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.725	800,000	796,088	2039/4/25	第28回沖縄電力株式会社社債	0.24	300,000	299,565	2030/12/20
第59回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.53	400,000	384,964	2039/9/5	第38回電源開発株式会社社無担保社債	0.978	300,000	307,653	2023/12/20
第63回名古屋鉄道株式会社社無担保社債	0.69	300,000	295,086	2040/10/26	第39回電源開発株式会社社無担保社債	0.929	200,000	205,038	2024/2/20

銘	柄	第99期末				銘	柄	第99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
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
第40回電源開発株式会社無担保社債		0.889	200,000	205,198	2024/6/20	第14回広島ガス株式会社無担保社債		0.35	800,000	800,160	2030/10/15
第49回電源開発株式会社無担保社債		0.4	300,000	303,201	2027/5/20	第16回西部瓦斯株式会社無担保社債		0.355	700,000	703,045	2028/12/13
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.85	200,000	204,162	2027/8/31	第3回東京都競馬株式会社無担保社債		0.18	700,000	699,195	2023/7/5
第26回東京瓦斯株式会社無担保社債		2.29	100,000	107,420	2024/5/27	第5回SCSK株式会社無担保社債		0.14	500,000	500,170	2021/12/15
第35回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.852	400,000	465,136	2031/12/26	第6回SCSK株式会社無担保社債		0.14	600,000	599,754	2022/7/21
第36回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.737	400,000	461,208	2032/5/25	第1回日鉄住金物産株式会社無担保社債		0.15	400,000	399,348	2023/3/3
第37回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.764	300,000	349,539	2033/9/26	第3回日鉄住金物産株式会社無担保社債		0.29	200,000	199,504	2025/6/13
第39回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.554	700,000	800,191	2034/5/26	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	604,902	2022/12/16
第41回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.57	700,000	705,250	2036/11/28	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	821,776	2025/12/18
第43回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.67	700,000	714,168	2037/6/9	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	300,231	2023/6/6
第46回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.58	700,000	701,134	2038/7/20	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	401,260	2025/6/6
第48回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.704	300,000	306,024	2038/11/29	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	906,561	2028/6/6
第52回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.486	1,000,000	981,180	2039/5/23	小 計			414,207,000	420,916,691	
第55回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.28	800,000	755,192	2039/9/13	合 計			652,164,278	679,446,240	
第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債		1.606	400,000	459,428	2034/3/24	(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。					
第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債		1.402	600,000	675,672	2034/10/24	(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。					
第31回東邦瓦斯株式会社無担保社債		2.06	600,000	613,908	2022/3/18						
第36回東邦瓦斯株式会社無担保社債		1.628	300,000	326,004	2027/3/19						
第38回東邦瓦斯株式会社無担保社債		0.933	500,000	510,530	2023/7/12						
第13回広島ガス株式会社無担保社債		0.405	600,000	604,086	2028/9/13						

国内その他有価証券

区 分	第99期末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	999,990	0.1

(注) 比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

＜東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド＞

下記は、東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド全体(46,326,254千口)の内容です。

国内株式

銘柄	第93期末	第99期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.3%)			
雪国まいたけ	—	143	259,545
サカタのタネ	—	22	79,860
建設業 (9.4%)			
ミライト・ホールディングス	180	180	306,720
安藤・間	547	777	571,095
東急建設	320	—	—
コムシスホールディングス	—	48	149,520
長谷工コーポレーション	—	598	746,902
三井住友建設	570	530	235,850
大豊建設	—	118	436,010
奥村組	71	169	449,709
熊谷組	125	356	942,332
N I P P O	—	379	1,021,026
日本国土開発	100	—	—
ライト工業	120	210	361,410
積水ハウス	348	796	1,695,878
関電工	271	822	743,910
きんでん	—	108	186,084
協和エクシオ	177	669.6	1,856,131
九電工	28	308	990,220
三機工業	32	365	455,155
高砂熱学工業	22	344	550,056
食料品 (25.3%)			
ニッポン	65	205	331,895
森永製菓	103	312	1,227,720
江崎グリコ	95	315	1,442,700
山崎製パン	108	76	135,584
カルビー	187	625	1,968,750
森永乳業	—	326	1,675,640
明治ホールディングス	88	344	2,463,040
雪印メグミルク	—	123	281,547
プリマハム	—	83	263,110
アサヒグループホールディングス	110	—	—

銘柄	第93期末	第99期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キリンホールディングス	—	850	1,952,875
サントリー食品インターナショナル	172	690	2,521,950
伊藤園	45	219	1,421,310
日清オイリオグループ	48	144	436,320
不二製油グループ本社	—	120	367,800
味の素	386	1,030	2,518,865
キュービー	219	628	1,428,072
ハウス食品グループ本社	119	307	1,151,250
カゴメ	40	283	960,785
ニチレイ	219	812	2,375,912
東洋水産	113	481	2,481,960
日清食品ホールディングス	79	281	2,534,620
日本たばこ産業	332	801	1,644,853
繊維製品 (1.2%)			
帝人	—	304	595,840
ワコールホールディングス	115	115	236,785
ホギメディカル	26	192	620,160
パルプ・紙 (2.2%)			
日本製紙	—	40	49,680
大王製紙	120	525	1,027,425
レンゴー	320	1,948	1,673,332
化学 (6.2%)			
ライオン	—	812	1,913,884
ノエビアホールディングス	38	74	342,620
小林製薬	—	168	1,995,840
アース製薬	—	36	218,160
エフビコ	40	312	1,302,600
ユニ・チャーム	—	408	1,967,376
医薬品 (3.6%)			
武田薬品工業	174	470	1,745,580
中外製薬	—	97	547,953
科研製薬	54	194	795,400
持田製薬	—	63	246,015
日医工	40	110	110,220

銘柄	第93期末	第99期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
キョーリン製薬ホールディングス	190	547	1,071,026
石油・石炭製品 (2.7%)			
ENEOSホールディングス	900	5,915	2,575,391
コスモエネルギーホールディングス	—	370	858,770
ゴム製品 (—%)			
ブリヂストン	208	—	—
ガラス・土石製品 (0.1%)			
日本カーボン	—	39	161,265
非鉄金属 (0.9%)			
アサヒホールディングス	67	260	1,125,800
電気機器 (1.3%)			
沖電気工業	294	760	820,800
エレコム	—	49	247,450
日本光電工業	—	155	486,700
キャノン	344	54	120,150
輸送用機器 (—%)			
SUBARU	80	—	—
その他製品 (0.7%)			
リンテック	64	265	643,685
コクヨ	20	224	300,832
電気・ガス業 (7.3%)			
中部電力	542	2,006	2,643,908
沖縄電力	60	45	63,810
東京瓦斯	291	1,078	2,539,768
大阪瓦斯	350	1,245	2,453,895
東邦瓦斯	59	229	1,440,410
陸運業 (1.1%)			
相鉄ホールディングス	45	2	4,902
名古屋鉄道	70	65	172,965
センコーグループホールディングス	200	609	605,346
九州旅客鉄道	243	161	344,057
S Gホールディングス	77	100	277,500
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
住友倉庫	—	160	206,080
情報・通信業 (11.8%)			
N E C ネットエスアイ	108	78	149,526
コーエーテクモホールディングス	97	207	1,244,070
インフォコム	—	234	799,110

銘柄	第93期末	第99期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
アルテリア・ネットワークス	134	548	879,540
オービック	—	58	1,213,940
トレンドマイクロ	109	250	1,415,000
伊藤忠テクノソリューションズ	—	663	2,469,675
エイベックス	138	387	511,227
スカパーJ S A Tホールディングス	324	790	375,250
日本電信電話	290	928	2,542,720
K D D I	224	677	2,207,020
N T T ドコモ	247	—	—
東宝	20	—	—
T K C	—	24	172,560
N S D	109	240	490,080
ミロク情報サービス	—	115.2	239,616
卸売業 (11.1%)			
T O K A I ホールディングス	135	408	398,208
シップヘルスケアホールディングス	20	182	1,112,020
コメダホールディングス	151	467	883,097
アズワン	13	—	—
伊藤忠商事	311	640	2,003,200
三井物産	448	980	1,996,260
住友商事	314	802	1,154,078
三菱商事	135	964	2,610,030
菱洋エレクトロ	50	233.8	799,596
岩谷産業	73	207	1,442,790
サンゲツ	65	—	—
P A L T A C	—	2	11,140
日鉄物産	33	—	—
オートバックスセブン	176	575	815,925
イエローハット	41	40	67,280
因幡電機産業	73	231	573,573
小売業 (7.4%)			
ローソン	22	9	43,650
サンエー	—	25	102,125
エービーシー・マート	98	124	734,080
エディオン	261	421	429,841
ジンスホールディングス	14	—	—
D C Mホールディングス	231	852	921,864
ドトール・日レスホールディングス	87	87	135,894

銘柄	第93期末	第99期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ウエルシアホールディングス	—	236	855,500
クレイトSDホールディングス	—	43	147,490
ジョイフル本田	—	291	414,966
セブン&アイ・ホールディングス	71	113	452,565
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	—	270	615,060
日本瓦斯	11	279	1,411,740
島忠	109	—	—
ライフコーポレーション	—	105	344,400
リンガーハット	64	—	—
ヤオコー	31	165	1,107,150
ケーズホールディングス	430	515	740,570
アインホールディングス	—	44.1	287,091
ヤマダホールディングス	962	—	—
吉野家ホールディングス	215	—	—
王将フードサービス	29	88	511,280
銀行業 (2.8%)			
ゆうちょ銀行	125	—	—
あおぞら銀行	83	200	389,200
三井住友フィナンシャルグループ	30	742	2,460,472

銘柄	第93期末	第99期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
セブン銀行	—	2,905	668,150
保険業 (1.9%)			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	250	769	2,393,128
その他金融業 (—%)			
オリックス	210	—	—
不動産業 (—%)			
タカラレーベン	220	—	—
サービス業 (2.5%)			
ミクシィ	—	288	726,624
H. U. グループホールディングス	140	370	1,169,200
ユー・エス・エス	193	200	420,000
セコム	23	79	748,130
メイテック	33	—	—
イオンディライト	—	13	35,438
合計	株数・金額	18,250	56,367
	銘柄数<比率>	111	133
			<99.0%>

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の< >内は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の比率です。

＜TMA日本REITマザーファンド＞

下記は、TMA日本REITマザーファンド全体(48,298,139千口)の内容です。

国内投資信託証券

銘柄	第93期末		第99期末		
	口数	口数	評価額	比率	
	口	口	千円	%	
SOSiLA物流リート投資法人	2,023	7,303	923,099	0.7	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,014	3,054	1,698,024	1.3	
MCUBS MidCity投資法人	7,431	22,331	2,108,046	1.7	
森ヒルズリート投資法人	3,491	12,147	1,780,750	1.4	
産業ファンド投資法人	3,397	16,737	3,230,241	2.5	
アドバンス・レジデンス投資法人	4,502	13,314	4,060,770	3.2	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	3,129	11,339	2,064,831	1.6	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,800	4,370	1,822,290	1.4	
GLP投資法人	13,495	42,595	7,262,447	5.7	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,360	7,090	2,085,878	1.6	
日本プロロジスリート投資法人	6,551	17,281	5,763,213	4.5	
星野リゾート・リート投資法人	587	1,887	973,692	0.8	
One リート投資法人	448	2,298	598,858	0.5	
イオンリート投資法人	3,191	17,591	2,411,726	1.9	
ヒューリックリート投資法人	5,010	15,860	2,431,338	1.9	
日本リート投資法人	1,028	3,688	1,309,240	1.0	
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	40,600	112,600	1,607,928	1.3	
積水ハウス・リート投資法人	13,893	38,143	2,818,767	2.2	
ケネディクス商業リート投資法人	2,554	6,674	1,665,830	1.3	
サムティ・レジデンシャル投資法人	760	3,600	397,800	0.3	
野村不動産マスターファンド投資法人	16,118	48,638	7,441,614	5.8	
ラサールロジポート投資法人	2,978	13,389	2,198,473	1.7	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,400	4,740	2,512,200	2.0	
投資法人みらい	5,334	21,634	864,278	0.7	
森トラスト・ホテルリート投資法人	1,060	2,940	337,806	0.3	
三菱地所物流リート投資法人	948	3,702	1,540,032	1.2	
CREロジスティクスファンド投資法人	1,970	7,460	1,130,190	0.9	
タカラレーベン不動産投資法人	800	—	—	—	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,894	8,584	1,117,636	0.9	
日本ビルファンド投資法人	3,467	13,335	7,907,655	6.2	
ジャパンリアルエステイト投資法人	3,732	10,397	6,279,788	4.9	
日本リテールファンド投資法人	9,277	24,397	4,589,075	3.6	
オリックス不動産投資法人	9,162	27,662	4,672,111	3.7	
日本プライムリアルティ投資法人	2,821	9,331	3,349,829	2.6	
プレミア投資法人	6,145	12,495	1,590,613	1.2	
東急リアル・エステート投資法人	3,924	11,134	1,834,883	1.4	
グローバル・ワン不動産投資法人	4,400	13,770	1,422,441	1.1	
ユナイテッド・アーバン投資法人	9,134	32,934	4,406,569	3.5	
森トラスト総合リート投資法人	4,057	8,147	1,085,995	0.9	
フロンティア不動産投資法人	766	2,108	871,658	0.7	
平和不動産リート投資法人	3,807	9,027	1,177,120	0.9	
日本ロジスティクスファンド投資法人	2,238	9,818	3,063,216	2.4	

銘 柄	第93期末		第99期末		
	口 数		口 数	評 価 額	比 率
	口		口	千円	%
福岡リート投資法人	1,207		4,957	771,309	0.6
ケネディクス・オフィス投資法人	1,664		4,449	2,905,197	2.3
いちごオフィスリート投資法人	6,256		18,906	1,472,777	1.2
大和証券オフィス投資法人	758		3,768	2,456,736	1.9
阪急阪神リート投資法人	1,972		8,892	1,131,062	0.9
スターツプロシード投資法人	130		1,890	368,928	0.3
大和ハウスリート投資法人	5,175		19,935	5,378,463	4.2
大和証券リビング投資法人	7,784		22,824	2,216,210	1.7
ジャパンエクセレント投資法人	5,452		16,222	2,029,372	1.6
合 計	口 数 ・ 金 額		244,094	757,387	125,138,015
	銘 柄 数<比 率>		51	50	<98.2%>

(注) 比率は、このファンドが組み入れている親投資信託の純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった場合は、別銘柄として掲載しています。

(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。

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	純 資 産 額
	期 騰	落 中 率	期 騰	落 中 率		
	円	%		%	%	百万円
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
	騰 落	率	騰 落	率
(期 首)	円	%		%
2019年9月24日	12,407	—	186.800	—
9月末	12,377	△0.2	186.484	△0.2
10月末	12,343	△0.5	185.451	△0.7
11月末	12,316	△0.7	184.713	△1.1
12月末	12,293	△0.9	183.987	△1.5
2020年1月末	12,345	△0.5	184.822	△1.1
2月末	12,424	0.1	186.307	△0.3
3月末	12,173	△1.9	182.909	△2.1
4月末	12,221	△1.5	183.925	△1.5
5月末	12,189	△1.8	183.228	△1.9
6月末	12,169	△1.9	182.712	△2.2
7月末	12,216	△1.5	183.141	△2.0
8月末	12,173	△1.9	182.419	△2.3
(期 末)				
2020年9月23日	12,230	△1.4	183.157	△2.0

(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

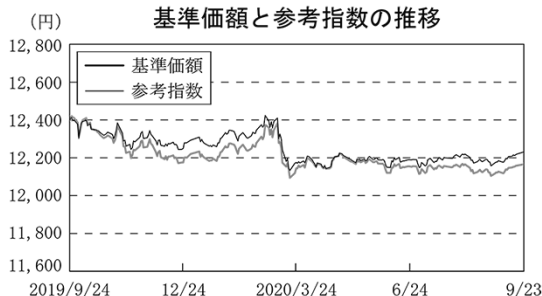
【国債市場の概況】

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。



(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
国内	国債証券	22,066,515	9,332,196
	地方債証券	37,326,285	22,021,183 (1,008,936)
	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
国内	コマーシャル・ペーパー	千円 82,993,757	千円 —
			(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			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第5回2号宮城県公募公債(20年)	0.188	390,000	390,273	2039/12/20
第5回3号宮城県公募公債(20年)	0.158	390,000	388,999	2040/2/20
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	100,000	118,052	2030/11/12
第17回神奈川県公募公債(20年)	1.975	200,000	238,522	2031/7/11
第19回神奈川県公募公債(20年)	1.818	300,000	354,678	2032/1/30
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	500,000	586,670	2032/6/18
第21回神奈川県公募公債(20年)	1.732	200,000	235,866	2032/9/17
第22回神奈川県公募公債(20年)	1.802	200,000	237,992	2032/12/20
第23回神奈川県公募公債(20年)	1.804	100,000	119,485	2033/6/20
第25回神奈川県公募公債(20年)	1.578	400,000	468,104	2033/12/20
第26回神奈川県公募公債(20年)	1.477	600,000	695,982	2034/6/20
第27回神奈川県公募公債(20年)	1.398	600,000	690,360	2034/9/20
第28回神奈川県公募公債(20年)	0.941	300,000	326,253	2034/12/20
第29回神奈川県公募公債(20年)	1.289	600,000	682,368	2035/6/20
第30回神奈川県公募公債(20年)	1.161	100,000	112,026	2035/9/20
第31回神奈川県公募公債(20年)	1.002	200,000	219,496	2035/12/20
第32回神奈川県公募公債(20年)	0.18	200,000	194,360	2036/6/20
第33回神奈川県公募公債(20年)	0.64	500,000	521,085	2036/12/19
第34回神奈川県公募公債(20年)	0.654	100,000	104,312	2037/6/19
第36回神奈川県公募公債(20年)	0.625	100,000	103,629	2037/12/18
第37回神奈川県公募公債(20年)	0.53	200,000	203,634	2038/6/18
第40回神奈川県公募公債(20年)	0.2	800,000	764,768	2039/6/20
第42回神奈川県公募公債(20年)	0.34	500,000	491,235	2039/9/20
第5回大阪府公募公債(20年)	2.16	350,000	419,093	2030/5/28
第6回大阪府公募公債(20年)	1.98	200,000	236,768	2030/9/13
第7回大阪府公募公債(20年)	1.84	620,000	731,476	2031/9/26
第8回大阪府公募公債(20年)	1.83	600,000	708,762	2031/12/22
第9回大阪府公募公債(20年)	1.83	100,000	118,336	2032/3/12
第10回大阪府公募公債(20年)	1.72	530,000	623,714	2032/9/24
第11回大阪府公募公債(20年)	1.693	500,000	590,940	2033/9/27
第12回大阪府公募公債(20年)	1.453	540,000	624,574	2034/9/26
第13回大阪府公募公債(20年)	1.203	700,000	787,381	2035/9/28
第14回大阪府公募公債(20年)	0.54	300,000	307,695	2036/9/29
第15回大阪府公募公債(20年)	0.721	600,000	631,302	2037/3/30
第17回大阪府公募公債(20年)	0.668	700,000	727,811	2038/9/27
平成22年度第3回京都府公募公債	2.0	600,000	712,218	2030/11/22
平成23年度第5回京都府公募公債(20年)	1.79	400,000	470,380	2031/10/17
平成24年度第3回京都府公募公債(20年)	1.63	600,000	700,050	2032/8/13
平成26年度第5回京都府公募公債(20年)	1.455	600,000	694,692	2034/8/10
平成27年度第2回京都府公募公債(15年)	0.729	600,000	636,174	2030/4/26
平成27年度第8回京都府公募公債(15年)	0.78	600,000	638,376	2030/10/11
平成28年度第2回京都府公募公債(15年)	0.21	200,000	200,982	2031/4/22
平成28年度第5回京都府公募公債(20年)	0.327	600,000	596,154	2036/8/15
平成29年度第2回京都府公募公債(15年)	0.391	500,000	510,845	2032/4/23
平成29年度第5回京都府公募公債(20年)	0.63	100,000	103,804	2037/8/14
平成30年度第5回京都府公募公債(20年)	0.658	600,000	624,804	2038/8/13
平成30年度第8回京都府公募公債(20年)	0.435	462,500	473,384	2038/10/15
令和元年度第5回京都府公募公債(20年)	0.2	400,000	381,912	2039/8/19
第1回兵庫県公募公債(18年)	1.26	400,000	448,656	2032/8/6
第12回兵庫県公募公債(15年)	0.781	200,000	212,590	2030/12/6
第14回兵庫県公募公債(15年)	0.428	200,000	204,864	2032/5/26
第6回兵庫県公募公債(20年)	0.436	663,180	677,723	2038/9/10
第13回兵庫県公募公債(20年)	1.83	500,000	591,765	2032/3/16
第15回兵庫県公募公債(20年)	1.64	600,000	699,054	2032/7/23
第16回兵庫県公募公債(20年)	1.7	100,000	117,523	2032/11/19

銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第19回兵庫県公募公債(20年)	1.57	100,000	116,737	2033/12/9
第20回兵庫県公募公債(20年)	1.53	200,000	232,742	2034/3/10
第21回兵庫県公募公債(20年)	1.54	300,000	349,857	2034/5/9
第22回兵庫県公募公債(20年)	1.4	500,000	574,495	2034/9/8
第24回兵庫県公募公債(20年)	1.23	200,000	225,388	2035/3/23
第26回兵庫県公募公債(20年)	0.665	300,000	313,623	2036/3/7
第28回兵庫県公募公債(20年)	0.273	700,000	688,912	2036/6/20
第30回兵庫県公募公債(20年)	0.607	300,000	310,419	2036/12/19
第32回兵庫県公募公債(20年)	0.621	400,000	414,412	2037/5/1
第35回兵庫県公募公債(20年)	0.578	600,000	615,102	2038/5/28
第37回兵庫県公募公債(20年)	0.472	500,000	501,865	2039/2/18
第38回兵庫県公募公債(20年)	0.352	300,000	294,408	2039/6/20
第10回静岡県公募公債(20年)	0.355	378,960	384,568	2038/6/18
第12回静岡県公募公債(20年)	0.257	584,220	588,046	2039/3/18
第2回静岡県公募公債(30年)	2.54	300,000	409,386	2038/9/17
第10回静岡県公募公債(20年)	2.072	300,000	356,958	2030/6/14
第11回静岡県公募公債(20年)	1.841	350,000	409,514	2030/10/18
第12回静岡県公募公債(20年)	2.003	230,000	274,748	2031/6/20
第14回静岡県公募公債(20年)	1.736	500,000	588,390	2032/6/18
第15回静岡県公募公債(20年)	1.701	450,000	529,240	2032/10/15
第18回静岡県公募公債(20年)	1.473	600,000	695,568	2034/7/10
第19回静岡県公募公債(20年)	1.253	300,000	339,906	2035/7/27
第22回静岡県公募公債(20年)	0.443	200,000	202,516	2036/9/19
第23回静岡県公募公債(20年)	0.626	100,000	103,871	2037/6/19
第24回静岡県公募公債(20年)	0.63	200,000	207,648	2037/9/18
第25回静岡県公募公債(20年)	0.53	600,000	610,902	2038/6/14
第26回静岡県公募公債(20年)	0.711	600,000	628,674	2038/9/17
第28回静岡県公募公債(20年)	0.31	700,000	684,047	2039/9/20
平成22年度第4回愛知県公募公債(20年)	2.072	100,000	118,986	2030/6/14
平成22年度第14回愛知県公募公債(20年)	2.087	350,000	418,694	2030/12/13
平成23年度第5回愛知県公募公債(20年)	1.988	100,000	119,297	2031/6/20
平成23年度第16回愛知県公募公債(20年)	1.8	100,000	118,009	2032/1/26
平成24年度第4回愛知県公募公債(20年)	1.687	200,000	234,176	2032/6/11
平成24年度第17回愛知県公募公債(20年)	1.829	400,000	477,828	2033/2/8
平成25年度第3回愛知県公募公債(20年)	1.509	200,000	231,414	2033/5/13
平成25年度第11回愛知県公募公債(20年)	1.77	100,000	119,253	2033/9/13
平成26年度第4回愛知県公募公債(20年)	1.542	100,000	116,818	2034/5/15
平成26年度第13回愛知県公募公債(20年)	1.363	600,000	687,456	2034/11/14
平成27年度第3回愛知県公募公債(20年)	1.115	700,000	778,890	2035/5/8
平成27年度第14回愛知県公募公債(20年)	1.129	200,000	223,216	2035/11/19
平成28年度第2回愛知県公募公債(20年)	0.387	100,000	100,403	2036/5/12
平成28年度第12回愛知県公募公債(20年)	0.429	300,000	302,784	2036/11/18
平成29年度第12回愛知県公募公債(20年)	0.606	400,000	413,564	2037/11/20
平成30年度第2回愛知県公募公債(20年)	0.54	100,000	102,135	2038/4/30
平成30年度第12回愛知県公募公債(20年)	0.706	300,000	314,304	2038/11/15
平成30年度第14回愛知県公募公債(20年)	0.291	555,000	560,813	2038/12/14
令和元年度第5回愛知県公募公債(20年)	0.288	400,000	388,428	2039/7/12
令和元年度第12回愛知県公募公債(20年)	0.156	292,500	291,559	2039/11/18
平成23年度第1回広島県公募公債(20年)	1.83	100,000	117,982	2031/9/22
平成24年度第1回広島県公募公債(20年)	1.7	600,000	705,282	2032/9/14
平成25年度第1回広島県公募公債(20年)	1.75	300,000	357,003	2033/9/13
平成26年度第1回広島県公募公債(20年)	1.41	600,000	691,194	2034/9/12
平成27年度第1回広島県公募公債(20年)	1.212	500,000	563,830	2035/9/25
平成28年度第1回広島県公募公債(20年)	0.414	200,000	201,630	2036/9/26
平成29年度第2回広島県公募公債(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
		%	千円	千円				%	千円	千円	
地方債証券						地方債証券					
平成30年度第1回広島県公債 (20年)		0.568	700,000	717,619	2038/5/17	第27回千葉県公債 (20年)		0.251	800,000	772,728	2039/10/14
平成30年度第2回広島県公債 (20年)		0.668	600,000	624,366	2038/9/17	平成29年度第1回新潟県公債 (20年)		0.616	700,000	725,074	2037/8/14
平成31年度第1回広島県公債 (20年)		0.419	700,000	696,871	2039/4/19	平成30年度第1回新潟県公債 (20年)		0.653	700,000	728,378	2038/8/20
令和元年度第2回広島県公債 (20年)		0.2	400,000	382,836	2039/9/20	令和元年度第1回新潟県公債 (20年)		0.2	800,000	763,824	2039/8/19
令和2年度第1回広島県公債 (20年)		0.315	800,000	779,872	2040/4/17	令和2年度第1回新潟県公債 (20年)		0.435	800,000	797,800	2040/8/17
第2回埼玉県公債 (15年)		0.869	100,000	107,359	2030/5/22	平成30年度第2回茨城県公債 (20年)		0.386	500,000	508,980	2038/7/30
第3回埼玉県公債 (15年)		0.43	500,000	513,380	2032/1/30	令和元年度第2回茨城県公債 (20年)		0.19	500,000	498,035	2039/7/29
平成22年度第10回埼玉県公債 (20年)		1.94	500,000	590,260	2030/11/12	令和2年度第2回茨城県公債 (20年)		0.356	300,000	303,423	2040/7/31
第11回埼玉県公債 (20年)		2.0	200,000	238,848	2031/6/20	第2回群馬県公債 (20年)		0.2	380,000	380,178	2039/6/17
第12回埼玉県公債 (20年)		1.73	100,000	117,575	2032/5/24	第1回群馬県公債 (20年)		1.841	250,000	292,510	2030/10/18
第13回埼玉県公債 (20年)		1.599	600,000	701,022	2033/5/20	第2回群馬県公債 (20年)		2.019	100,000	119,699	2031/7/18
第14回埼玉県公債 (20年)		1.546	600,000	701,088	2034/5/8	第3回群馬県公債 (20年)		1.687	600,000	702,858	2032/6/25
第15回埼玉県公債 (20年)		1.166	400,000	447,832	2035/2/16	第4回群馬県公債 (20年)		1.667	100,000	117,779	2033/6/17
第16回埼玉県公債 (20年)		1.216	200,000	225,632	2035/8/14	第5回群馬県公債 (20年)		1.529	600,000	700,038	2034/6/16
第18回埼玉県公債 (20年)		0.323	500,000	496,910	2036/5/20	第6回群馬県公債 (20年)		1.267	600,000	680,382	2035/6/11
第20回埼玉県公債 (20年)		0.626	300,000	311,553	2037/5/15	第7回群馬県公債 (20年)		0.313	700,000	694,617	2036/7/13
第21回埼玉県公債 (20年)		0.625	500,000	518,540	2037/12/11	第9回群馬県公債 (20年)		0.554	400,000	409,180	2038/6/11
第22回埼玉県公債 (20年)		0.568	600,000	615,108	2038/5/21	第10回群馬県公債 (20年)		0.338	500,000	490,325	2039/6/17
第23回埼玉県公債 (20年)		0.626	300,000	309,948	2038/12/17	第11回群馬県公債 (20年)		0.416	400,000	397,176	2040/6/12
第24回埼玉県公債 (20年)		0.431	100,000	99,758	2039/5/17	平成30年度第1回大分県公債 (20年)		0.38	300,000	305,247	2038/7/16
第25回埼玉県公債 (20年)		0.32	450,000	440,028	2039/12/20	令和元年度第1回大分県公債 (20年)		0.19	600,000	598,176	2039/7/15
平成27年度第1回福岡県公債 (15年)		0.784	500,000	532,060	2030/11/25	令和2年度第1回大分県公債 (20年)		0.281	600,000	604,674	2040/7/10
平成29年度第1回福岡県公債 (15年)		0.419	400,000	409,460	2032/11/22	平成23年度第1回堺市公債 (20年)		1.8	500,000	587,995	2031/11/21
平成30年度第2回福岡県公債 (15年)		0.542	600,000	621,456	2033/10/17	平成24年度第1回堺市公債 (20年)		1.732	600,000	706,830	2032/11/12
令和元年度第1回福岡県公債 (15年)		0.254	600,000	597,246	2034/6/14	平成30年度第2回堺市公債 (20年)		0.386	647,500	659,889	2038/11/15
令和元年度第2回福岡県公債 (15年)		0.269	400,000	397,780	2034/12/13	令和元年度第2回堺市公債 (20年)		0.21	585,000	586,137	2039/11/18
平成22年度第2回福岡県公債 (20年)		2.116	100,000	120,221	2031/2/21	平成30年度第2回長崎県公債 (20年)		0.491	500,000	513,995	2038/8/20
平成23年度第2回福岡県公債 (20年)		1.806	100,000	117,633	2031/8/18	令和元年度第2回長崎県公債 (20年)		0.18	400,000	397,928	2039/8/26
平成24年度第1回福岡県公債 (20年)		1.734	100,000	117,609	2032/5/21	平成28年度第2回島根県公債 (20年)		0.506	100,000	102,205	2036/9/30
平成24年度第2回福岡県公債 (20年)		1.635	600,000	700,062	2032/8/16	平成29年度第2回島根県公債 (20年)		0.583	700,000	720,951	2037/9/18
平成25年度第1回福岡県公債 (20年)		1.599	300,000	350,511	2033/5/20	平成30年度第2回島根県公債 (20年)		0.668	700,000	728,427	2038/9/17
平成25年度第2回福岡県公債 (20年)		1.787	100,000	119,414	2033/8/12	令和元年度第2回島根県公債 (20年)		0.2	400,000	382,836	2039/9/20
平成26年度第1回福岡県公債 (20年)		1.542	250,000	291,942	2034/5/26	令和2年度第2回島根県公債 (20年)		0.459	800,000	802,056	2040/9/21
平成26年度第2回福岡県公債 (20年)		1.451	300,000	347,337	2034/9/22	平成30年度第1回栃木県公債 (20年)		0.421	555,000	567,368	2038/10/22
平成26年度第4回福岡県公債 (20年)		1.249	200,000	226,242	2035/2/23	令和元年度第1回栃木県公債 (20年)		0.14	487,500	484,579	2039/10/24
平成27年度第1回福岡県公債 (20年)		1.285	500,000	568,405	2035/5/22	平成30年度第1回奈良県公債 (20年)		0.396	270,000	274,978	2038/9/17
平成28年度第1回福岡県公債 (20年)		0.308	500,000	495,800	2036/5/23	令和元年度第1回奈良県公債 (20年)		0.15	285,000	283,972	2039/9/20
平成28年度第4回福岡県公債 (20年)		0.744	600,000	634,680	2037/2/13	第11回大阪市公債 (20年)		2.25	100,000	120,417	2030/3/26
平成29年度第1回福岡県公債 (20年)		0.626	100,000	103,859	2037/5/29	第13回大阪市公債 (20年)		2.08	550,000	654,846	2030/6/14
令和元年度第1回福岡県公債 (20年)		0.359	600,000	591,402	2039/11/25	第14回大阪市公債 (20年)		1.97	300,000	355,038	2030/10/30
第9回千葉県公債 (20年)		0.416	462,500	472,594	2038/10/15	第15回大阪市公債 (20年)		2.12	250,000	300,295	2031/1/24
第9回千葉県公債 (20年)		1.84	400,000	467,844	2030/10/11	第17回大阪市公債 (20年)		1.721	200,000	236,068	2032/12/21
第10回千葉県公債 (20年)		1.8	300,000	352,707	2031/8/18	第18回大阪市公債 (20年)		1.262	700,000	793,177	2035/2/27
第11回千葉県公債 (20年)		1.87	100,000	118,653	2031/12/12	第19回大阪市公債 (20年)		1.138	600,000	669,378	2035/4/24
第12回千葉県公債 (20年)		1.839	400,000	474,888	2032/4/16	第20回大阪市公債 (20年)		1.184	200,000	224,790	2035/8/31
第13回千葉県公債 (20年)		1.701	550,000	646,849	2032/10/15	第21回大阪市公債 (20年)		0.97	300,000	327,804	2036/1/29
第14回千葉県公債 (20年)		1.137	700,000	777,518	2033/4/15	第22回大阪市公債 (20年)		0.347	700,000	698,159	2036/5/30
第15回千葉県公債 (20年)		1.604	100,000	117,200	2033/10/14	第24回大阪市公債 (20年)		0.655	200,000	208,740	2037/4/21
第16回千葉県公債 (20年)		1.555	600,000	701,322	2034/4/14	第26回大阪市公債 (20年)		0.635	500,000	519,205	2037/10/23
第17回千葉県公債 (20年)		1.403	600,000	690,672	2034/10/13	第27回大阪市公債 (20年)		0.544	200,000	204,396	2038/4/20
第18回千葉県公債 (20年)		1.138	600,000	669,240	2035/4/13	第28回大阪市公債 (20年)		0.381	450,000	457,911	2038/5/28
第19回千葉県公債 (20年)		1.166	100,000	112,150	2035/10/15	第29回大阪市公債 (20年)		0.218	665,000	666,496	2039/5/27
第23回千葉県公債 (20年)		0.63	300,000	311,271	2037/10/15	第1回名古屋市公債 (20年)		0.17	292,308	291,501	2039/8/19
第24回千葉県公債 (20年)		0.559	200,000	204,884	2038/4/15	第2回名古屋市公債 (20年)		0.156	292,500	291,559	2039/11/18
第25回千葉県公債 (20年)		0.701	700,000	732,851	2038/10/15	第1回名古屋市公債 (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回名古屋市長公債 (30年)	2.5	100,000	134,460	2037/9/18	平成24年度第11回札幌市公債 (20年)	1.794	100,000	119,117	2033/2/28
第6回名古屋市長公債 (30年)	2.45	100,000	136,992	2039/12/20	平成25年度第1回札幌市公債 (20年)	1.72	200,000	236,844	2033/6/14
第14回名古屋市長公債 (20年)	1.648	500,000	584,360	2032/8/10	平成25年度第10回札幌市公債 (20年)	1.53	300,000	349,635	2034/3/17
第15回名古屋市長公債 (20年)	1.712	300,000	355,524	2033/9/9	平成26年度第1回札幌市公債 (20年)	1.524	500,000	582,700	2034/5/26
第16回名古屋市長公債 (20年)	1.52	200,000	233,062	2034/6/9	平成26年度第10回札幌市公債 (20年)	1.267	400,000	453,740	2035/3/20
第17回名古屋市長公債 (20年)	1.203	500,000	562,725	2035/5/28	平成27年度第3回札幌市公債 (20年)	1.211	200,000	225,272	2035/7/31
第18回名古屋市長公債 (20年)	1.139	700,000	782,285	2035/11/20	平成29年度第5回札幌市公債 (20年)	0.597	600,000	619,296	2037/9/18
第19回名古屋市長公債 (20年)	0.323	300,000	298,371	2036/4/28	平成30年度第1回札幌市公債 (20年)	0.366	360,000	365,850	2038/5/21
第20回名古屋市長公債 (20年)	0.645	600,000	624,924	2037/5/25	平成30年度第8回札幌市公債 (20年)	0.326	700,000	723,205	2038/12/20
第21回名古屋市長公債 (20年)	0.568	700,000	717,619	2038/5/18	令和元年度第4回札幌市公債 (20年)	0.15	300,000	298,746	2039/9/20
第22回名古屋市長公債 (20年)	0.431	700,000	698,306	2039/5/20	第11回川崎市公債 (20年)	1.84	150,000	175,491	2030/10/18
第1回京都市公債 (15年)	0.781	100,000	106,427	2030/12/20	第14回川崎市公債 (20年)	1.79	100,000	118,049	2032/3/19
第2回京都市公債 (20年)	0.331	540,000	546,814	2038/7/16	第15回川崎市公債 (20年)	1.727	300,000	353,622	2032/9/17
第3回京都市公債 (20年)	0.244	647,500	650,905	2039/2/18	第18回川崎市公債 (20年)	1.541	600,000	700,128	2034/3/17
第4回京都市公債 (20年)	0.18	285,000	284,544	2039/7/15	第20回川崎市公債 (20年)	1.131	200,000	222,996	2035/3/20
第9回京都市公債 (20年)	2.143	200,000	240,426	2030/12/17	第21回川崎市公債 (20年)	1.11	200,000	222,594	2035/9/20
第10回京都市公債 (20年)	1.803	200,000	235,778	2031/11/21	第22回川崎市公債 (20年)	0.377	600,000	601,524	2036/4/22
第11回京都市公債 (20年)	1.701	100,000	117,673	2032/11/19	第23回川崎市公債 (20年)	0.549	300,000	308,811	2036/9/19
第13回京都市公債 (20年)	1.359	300,000	343,641	2034/11/24	第24回川崎市公債 (20年)	0.683	100,000	104,803	2037/4/17
第14回京都市公債 (20年)	1.139	400,000	447,036	2035/11/22	第27回川崎市公債 (20年)	0.559	300,000	307,326	2038/4/16
第15回京都市公債 (20年)	0.487	500,000	509,030	2036/11/28	第28回川崎市公債 (20年)	0.422	370,000	378,282	2038/10/29
第16回京都市公債 (20年)	0.611	600,000	620,850	2037/11/27	第29回川崎市公債 (20年)	0.223	570,000	571,895	2039/4/22
第17回京都市公債 (20年)	0.683	700,000	730,632	2038/11/26	第30回川崎市公債 (20年)	0.2	600,000	573,576	2039/6/20
第18回京都市公債 (20年)	0.355	400,000	393,992	2039/11/18	第31回川崎市公債 (20年)	0.14	390,000	387,855	2039/10/21
平成22年度第4回神戸市公債 (20年)	1.895	100,000	117,604	2030/9/13	第6回北九州市公債 (20年)	0.18	680,960	679,366	2039/7/22
平成22年度第9回神戸市公債 (20年)	2.09	350,000	419,342	2031/1/24	第10回北九州市公債 (20年)	2.09	250,000	299,072	2031/1/24
平成23年度第4回神戸市公債 (20年)	1.913	150,000	178,246	2031/9/12	第11回北九州市公債 (20年)	2.019	500,000	597,540	2031/7/18
平成23年度第14回神戸市公債 (20年)	1.794	200,000	236,036	2032/2/13	第13回北九州市公債 (20年)	1.706	400,000	468,700	2032/7/16
平成24年度第3回神戸市公債 (20年)	1.635	500,000	583,665	2032/8/13	第14回北九州市公債 (20年)	1.732	600,000	706,830	2032/11/12
平成24年度第12回神戸市公債 (20年)	1.711	500,000	589,495	2032/12/17	第15回北九州市公債 (20年)	1.667	100,000	117,489	2033/6/17
平成25年度第12回神戸市公債 (20年)	1.52	100,000	116,325	2034/2/17	第16回北九州市公債 (20年)	1.604	100,000	116,894	2033/10/11
平成26年度第3回神戸市公債 (20年)	1.482	300,000	348,180	2034/7/14	第17回北九州市公債 (20年)	1.529	600,000	698,268	2034/6/20
平成27年度第9回神戸市公債 (20年)	1.007	100,000	109,801	2036/1/25	第18回北九州市公債 (20年)	1.376	200,000	228,912	2034/10/20
平成28年度第9回神戸市公債 (20年)	0.645	400,000	416,944	2037/1/23	第19回北九州市公債 (20年)	1.312	600,000	682,860	2035/6/19
平成29年度第5回神戸市公債 (20年)	0.597	200,000	206,432	2037/9/18	第20回北九州市公債 (20年)	1.111	100,000	110,983	2035/10/26
平成30年度第6回神戸市公債 (20年)	0.668	300,000	312,183	2038/9/17	平成23年度第4回福岡市公債 (20年)	1.89	300,000	355,614	2031/8/19
令和元年度第6回神戸市公債 (20年)	0.2	500,000	478,545	2039/9/20	平成24年度第2回福岡市公債 (20年)	1.702	400,000	469,392	2032/7/20
第1回横浜市長公債 (30年)	2.63	500,000	659,525	2034/9/20	平成24年度第6回福岡市公債 (20年)	1.696	300,000	352,536	2032/9/17
第2回横浜市長公債 (30年)	2.49	500,000	653,385	2035/3/20	平成25年度第1回福岡市公債 (20年)	1.808	100,000	119,579	2033/7/19
第4回横浜市長公債 (30年)	2.54	210,000	281,509	2036/12/19	平成25年度第6回福岡市公債 (20年)	1.511	400,000	464,832	2034/2/17
第21回横浜市長公債 (20年)	1.969	100,000	118,112	2030/7/19	平成26年度第2回福岡市公債 (20年)	1.49	600,000	697,014	2034/6/20
第22回横浜市長公債 (20年)	1.895	100,000	117,546	2030/9/13	平成26年度第6回福岡市公債 (20年)	1.371	200,000	229,240	2034/9/20
第25回横浜市長公債 (20年)	1.72	400,000	470,156	2032/7/16	平成27年度第6回福岡市公債 (20年)	1.121	100,000	111,550	2035/12/18
第26回横浜市長公債 (20年)	1.776	300,000	356,322	2033/1/28	平成28年度第6回福岡市公債 (20年)	0.429	700,000	706,461	2036/11/25
第27回横浜市長公債 (20年)	1.599	300,000	350,511	2033/5/20	平成30年度第7回福岡市公債 (20年)	0.701	700,000	732,844	2038/10/19
第28回横浜市長公債 (20年)	1.586	300,000	350,985	2033/11/11	平成30年度第8回福岡市公債 (20年)	0.416	462,500	472,598	2038/10/19
第29回横浜市長公債 (20年)	1.528	200,000	233,184	2034/5/26	平成31年度第2回福岡市公債 (20年)	0.225	584,615	586,679	2039/4/22
第30回横浜市長公債 (20年)	1.376	400,000	459,060	2034/10/20	平成31年度第3回福岡市公債 (20年)	0.419	600,000	597,318	2039/4/22
第31回横浜市長公債 (20年)	1.18	300,000	336,420	2035/4/20	2019年度第5回福岡市公債 (20年)	0.286	300,000	291,198	2039/7/29
第35回横浜市長公債 (20年)	0.443	100,000	101,156	2036/10/28	2019年度第7回福岡市公債 (20年)	0.271	500,000	484,695	2039/10/24
第40回横浜市長公債 (20年)	0.559	700,000	717,094	2038/4/16	平成29年度第2回広島市公債 (20年)	0.616	200,000	207,168	2037/8/18
第42回横浜市長公債 (20年)	0.47	379,900	387,507	2038/12/17	平成29年度第4回広島市公債 (20年)	0.62	600,000	621,696	2037/11/20
平成23年度第3回札幌市公債 (20年)	1.944	600,000	713,724	2031/7/29	平成30年度第2回広島市公債 (20年)	0.639	700,000	726,747	2038/8/20
平成24年度第1回札幌市公債 (20年)	1.79	600,000	708,780	2032/4/23	平成30年度第4回広島市公債 (20年)	0.706	700,000	733,362	2038/11/19
平成24年度第4回札幌市公債 (20年)	1.635	200,000	233,466	2032/8/13	令和元年度第2回広島市公債 (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
地方債証券	%	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
地方債証券	%	千円	千円	
第134回愛知県・名古屋府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・名古屋府折半保証名古屋高速道路債券	0.768	400,000	415,640	2037/2/27
第151回愛知県・名古屋府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	2029/12/20
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	2029/12/24
第36回東京都住宅供給公社債券	0.416	400,000	395,812	2034/12/22
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	238,878	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200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208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219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	2034/5/31
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223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				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
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第228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513回中部電力株式会社社債	0.14	300,000	300,786	2023/8/25
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518回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,337	2023/1/25
第233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520回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,359	2023/3/24
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522回中部電力株式会社社債	0.13	200,000	200,332	2022/4/25
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530回中部電力株式会社社債	0.274	600,000	601,230	2029/6/25
第239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511回関西電力株式会社社債	0.41	600,000	603,690	2027/9/17
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512回関西電力株式会社社債	0.32	400,000	402,764	2024/10/25
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515回関西電力株式会社社債	0.435	600,000	604,218	2028/4/25
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518回関西電力株式会社社債	0.44	300,000	302,151	2028/6/20
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527回関西電力株式会社社債	0.28	500,000	502,765	2024/4/25
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369回中国電力株式会社社債	0.976	800,000	800,616	2020/10/23
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378回中国電力株式会社社債	1.004	300,000	308,679	2023/10/25
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381回中国電力株式会社社債	0.953	100,000	103,121	2024/4/25
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383回中国電力株式会社社債	0.764	400,000	410,812	2024/10/25
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398回中国電力株式会社社債	0.425	400,000	405,652	2027/7/23
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402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,631	2024/10/25
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404回中国電力株式会社社債	0.355	100,000	100,894	2028/4/25
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311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	208,430	2027/9/24
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314回北陸電力株式会社社債	0.36	100,000	100,994	2026/2/25
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318回北陸電力株式会社社債	0.26	450,000	451,386	2026/12/25
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321回北陸電力株式会社社債	0.365	300,000	302,820	2027/4/23
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322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	505,155	2027/6/25
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475回東北電力株式会社社債	0.809	500,000	513,935	2024/9/25
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476回東北電力株式会社社債	0.57	100,000	101,964	2025/1/24
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491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	607,794	2027/2/25
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492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	404,668	2027/4/23
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496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	302,583	2027/9/24
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517回東北電力株式会社社債	0.31	100,000	100,007	2030/2/25
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281回四国電力株式会社社債	1.111	500,000	515,840	2038/9/25
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289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	100,527	2026/11/25
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296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	202,616	2027/11/25
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307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	299,076	2029/9/25
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309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	505,420	2030/5/24
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429回九州電力株式会社社債	0.909	300,000	309,249	2024/9/25
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437回九州電力株式会社社債	0.685	600,000	615,516	2026/1/23
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465回九州電力株式会社社債	0.38	500,000	503,570	2028/7/25
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489回九州電力株式会社社債	0.44	400,000	403,376	2030/5/24
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290回北海道電力株式会社社債	2.09	300,000	303,579	2021/4/23
第373回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.522	700,000	713,377	2039/1/31	第298回北海道電力株式会社社債	1.82	500,000	500,035	2020/9/25
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320回北海道電力株式会社社債	0.585	300,000	301,932	2021/12/24
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321回北海道電力株式会社社債	0.886	111,000	114,479	2024/12/25
第21回政府保証民間都市開発債券	0.618	300,000	310,863	2038/12/27	第326回北海道電力株式会社社債	0.789	400,000	412,032	2025/12/25
第22回政府保証民間都市開発債券	0.245	1,000,000	965,090	2040/2/28	第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	202,252	2027/6/25
第23回政府保証民間都市開発債券	0.397	800,000	793,744	2040/6/29	第346回北海道電力株式会社社債	0.31	700,000	705,047	2024/12/25
第54回政府保証関西国際空港債券	2.4	500,000	592,695	2028/6/23	第355回北海道電力株式会社社債	0.14	100,000	100,088	2021/12/24
小 計		34,900,000	38,466,876		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	2022/10/24
金融債券					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
い第830号商工債	0.11	100,000	100,084	2024/7/26	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
小 計		100,000	100,084		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
普通社債券(含む投資法人債券)					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497回中部電力株式会社社債	0.986	700,000	700,546	2020/10/23	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501回中部電力株式会社社債	0.803	200,000	205,690	2024/9/25	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503回中部電力株式会社社債	0.584	200,000	204,290	2025/3/25	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508回中部電力株式会社社債	0.18	200,000	200,668	2023/4/25	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511回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	100,289	2026/7/24	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回新関西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	335,535	2035/9/20
第18回新関西国際空港株式会社社債	0.675	500,000	514,710	2037/12/18
第23回新関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43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	110,883	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 回道路格債券	2.9	100,000	130,522	2032/5/20
第21回道路格債券	2.75	100,000	130,784	2033/6/20
第28回道路格債券	2.83	500,000	663,200	2033/12/20
第33回道路格債券	2.91	100,000	134,615	2034/6/20
第43回道路格債券	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回関西国際空港株式会社社債	2.46	500,000	594,955	2028/12/20
第11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118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	1.836	400,000	475,008	2032/11/12
第125回一般担保住宅金融支援機構債券	1.898	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 回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	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35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38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	0.74	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	0.279	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	2037/8/26
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	2038/2/25
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回パソ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回アサヒ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回アサヒ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回コカ・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回コカ・コーラボトラ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回コカ・コーラボトラ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回コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス社債	0.27	600,000	593,766	2027/9/14	
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回日清オイ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回日清オイ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回日清オイリオグループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	299,481	2027/12/3	
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	2022/12/9	
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回キュ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回エキュリック株式会社無担保社債	0.949	300,000	307,185	2024/4/24	
第8回エキュリ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7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	2020/11/5	
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	200,000	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				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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		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8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	598,020	2028/4/25	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10回旭化成株式会社無担保社債	0.1	400,000	398,788	2023/12/6	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11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	497,335	2024/9/6	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12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	492,005	2029/9/6	第2回株式会社電通無担保社債	0.24	700,000	697,802	2025/10/24
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3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	702,436	2028/10/25
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1回株式会社ADEKA無担保社債	0.18	300,000	298,719	2024/3/15
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1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	500,000	499,925	2024/5/31
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2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	598,620	2027/6/2
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6回テルモ株式会社無担保社債	0.17	400,000	399,696	2023/4/19
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7回テルモ株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,376	2026/4/17
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9回テルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	995,780	2027/4/26
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3回みちがわ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37回D I C株式会社無担保社債	1.0	100,000	103,271	2025/9/18
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41回D I C株式会社無担保社債	0.15	600,000	599,724	2022/7/12
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61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	398,528	2022/4/16	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6回株式会社クレハ無担保社債	0.14	600,000	599,412	2029/9/1	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	2023/10/31
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21回デンカ株式会社無担保社債	0.28	600,000	598,014	2025/4/23	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3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回エコマノルタ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4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5回出光興産株式会社無担保社債	0.2	200,000	200,132	2022/12/5
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回出光興産株式会社無担保社債	0.09	200,000	198,586	2024/9/20
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9回出光興産株式会社無担保社債	0.18	400,000	394,824	2026/9/14
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12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22回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.32	600,000	601,794	2026/6/9	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26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	0.23	700,000	696,437	2027/2/26	第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	1.375	1,000,000	1,001,690	2029/4/19
第33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15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	600,786	2027/5/28
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1回AGC株式会社無担保社債	0.23	700,000	699,517	2025/10/10
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13回宇部興産株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,205	2022/5/25	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2回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.703	600,000	607,638	2024/9/19	
第5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	0.26	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回住友金属鉱山株式会社無担保社債	1.257	400,000	403,984	2021/8/31	
第30回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.02	400,000	399,268	2021/9/17	
第31回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.1	700,000	695,065	2024/12/13	
第32回住友金属鉱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回ソーニー株式会社無担保社債	0.23	500,000	500,245	2021/9/17	
第32回ソーニー株式会社無担保社債	0.28	100,000	100,133	2023/9/20	
第33回ソーニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	300,528	2026/9/18	
第35回ソーニー株式会社無担保社債	0.18	400,000	394,668	2026/10/9	
第36回ソー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回株式会社工場製作所無担保社債	0.609	700,000	700,273	2020/10/30	
第5回株式会社工場製作所無担保社債	0.18	700,000	689,612	2026/10/16	
第6回株式会社工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回川崎重工工業株式会社無担保社債	0.988	200,000	204,830	2023/12/15	
第42回川崎重工工業株式会社無担保社債	0.791	100,000	101,991	2024/7/18	
第45回川崎重工工業株式会社無担保社債	0.1	300,000	299,850	2021/7/15	
第51回川崎重工工業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I H I 無担保社債	0.592	300,000	300,765	2021/6/17	
第43回株式会社I H I 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(劣貨)	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(劣貨)	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S U B A R U 無担保社債	0.12	600,000	597,264	2024/12/17	
第2回株式会社S U B A R U 無担保社債	0.21	700,000	694,407	2026/12/17	

銘柄	利率	当 期 末			
		額面金額	評 価 額	償還年月日	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
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回株式会社トブロン無担保社債	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	2021/6/14	
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1回ユニー・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回ユニー・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76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1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	利率	当 期 末			
		額面金額	評 価 額	償還年月日	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		
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23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13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24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20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30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33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(劣後)	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14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)	2.42	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	2029/11/28	
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	2025/10/28	
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10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1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24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	2026/9/1	
第20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	利率	当 期 末			償還年月日	銘柄	利率	当 期 末			償還年月日
		額面金額	評 価 額	千 円				額面金額	評 価 額	千 円	
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円			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15回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.07	500,000	487,005	2022/6/20	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66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	400,000	396,416	2026/3/13		
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1回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.3	800,000	795,096	2025/1/30	第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	298,706	2026/12/18		
第6回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.35	400,000	399,940	2024/5/28	第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	298,413	2027/6/18		
第8回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.3	200,000	199,378	2024/9/20	第125回三菱地所株式会社無担保社債	0.19	700,000	699,118	2025/3/14		
第9回イオンフィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.38	700,000	692,650	2026/9/18	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19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	2028/9/18		
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5回株式会社アプラスフィナンシャル無担保社債	0.25	600,000	594,252	2023/10/13	第13回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.09	200,000	214,210	2029/9/20		
第6回株式会社アプラスフィナンシャル無担保社債	0.29	600,000	590,838	2024/12/5	第10回森トラスト総合リート投資法人無担保投資法人債	0.1	700,000	696,654	2023/2/20		
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129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	2025/1/18		
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3回リー・フィナンシャルホールディングス株式会社無担保社債	0.11	400,000	399,384	2022/12/7	第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	772,536	2038/9/16		
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4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	602,172	2040/6/8		
第13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	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	2017/11/29
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43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	2032/12/12
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32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	2028/5/12
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73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	2035/6/11
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	2.36	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	0.778	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				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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		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11回日本通運株式会社社債無担保社債	0.2	300,000	297,750	2026/7/14
第41回東京地下鉄株式会社社債	0.275	300,000	301,716	2030/6/12	第14回日本通運株式会社社債無担保社債	0.28	300,000	300,690	2027/6/16
第1回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.758	600,000	607,932	2032/3/17	第5回ニコソホールディングス株式会社社債無担保社債	0.614	700,000	700,700	2020/12/18
第2回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.67	500,000	500,600	2032/12/6	第7回ニコソホールディングス株式会社社債無担保社債	0.28	400,000	392,908	2029/10/11
第3回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.445	700,000	703,080	2028/12/6	第9回ニコソホールディングス株式会社社債無担保社債	0.42	800,000	801,184	2030/9/18
第4回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.27	600,000	591,252	2029/12/12	第3回株式会社日立物流無担保社債	0.1	600,000	599,052	2021/9/28
第2回株式会社鴻池運輸無担保社債	0.18	300,000	299,694	2022/3/2	第7回株式会社日立物流無担保社債	0.405	600,000	596,802	2028/9/4
第44回西日本鉄道株式会社社債無担保社債	0.345	600,000	601,536	2026/3/4	第2回横浜高速鉄道株式会社社債無担保社債	0.455	200,000	201,246	2027/2/23
第45回西日本鉄道株式会社社債無担保社債	0.717	700,000	717,598	2031/3/4	第3回横浜高速鉄道株式会社社債無担保社債	0.39	400,000	400,444	2028/2/28
第46回西日本鉄道株式会社社債無担保社債	0.69	700,000	700,070	2036/9/9	第4回横浜高速鉄道株式会社社債無担保社債	0.445	700,000	703,087	2028/12/14
第47回西日本鉄道株式会社社債無担保社債	0.903	700,000	721,147	2037/4/14	第5回横浜高速鉄道株式会社社債無担保社債	0.3	800,000	789,760	2029/12/11
第48回西日本鉄道株式会社社債無担保社債	0.782	500,000	504,740	2037/9/4	第6回横浜高速鉄道株式会社社債無担保社債	0.45	500,000	500,735	2030/9/17
第50回西日本鉄道株式会社社債無担保社債	0.395	700,000	701,099	2028/9/6	第1回九州旅客鉄道株式会社社債無担保社債	0.295	600,000	602,250	2029/3/7
第51回西日本鉄道株式会社社債無担保社債	0.672	700,000	688,345	2039/5/30	第3回九州旅客鉄道株式会社社債無担保社債	0.23	300,000	298,797	2029/12/10
第9回近鉄グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.8	500,000	501,545	2031/9/2	第4回九州旅客鉄道株式会社社債無担保社債	0.51	400,000	389,500	2039/12/9
第117回近鉄グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.772	700,000	697,179	2032/7/27	第6回九州旅客鉄道株式会社社債無担保社債	0.29	400,000	399,824	2030/6/7
第106回近鉄グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.505	700,000	701,505	2028/1/25	第7回九州旅客鉄道株式会社社債無担保社債	0.691	500,000	501,460	2040/6/8
第111回近鉄グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.955	700,000	682,444	2038/7/26	第1回日本航空株式会社社債無担保社債	0.47	700,000	673,652	2026/12/18
第112回近鉄グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.47	800,000	791,344	2029/7/11	第2回日本航空株式会社社債無担保社債	0.17	600,000	594,942	2021/12/20
第116回近鉄グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.22	400,000	398,648	2025/1/30	第3回日本航空株式会社社債無担保社債	0.399	500,000	471,850	2028/9/21
第117回近鉄グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.91	900,000	863,946	2040/1/30	第5回日本航空株式会社社債無担保社債	0.22	500,000	488,115	2024/3/19
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.819	600,000	613,014	2023/10/25	第7回日本航空株式会社社債無担保社債	0.28	800,000	735,888	2029/12/14
第47回阪急阪神ホールディングス株式会社社債無担保社債	1.202	500,000	541,060	2029/7/18	第30回ANAホールディングス株式会社社債無担保社債	1.2	700,000	696,843	2026/9/18
第49回阪急阪神ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.817	800,000	824,512	2036/12/15	第15回三菱倉庫株式会社社債無担保社債	0.734	500,000	508,415	2024/3/12
第51回阪急阪神ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.789	700,000	714,581	2038/9/13	第16回三菱倉庫株式会社社債無担保社債	0.21	300,000	299,268	2024/12/6
第52回阪急阪神ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.215	500,000	497,780	2029/11/21	第17回三菱倉庫株式会社社債無担保社債	0.34	500,000	499,660	2027/12/8
第54回阪急阪神ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.486	800,000	772,176	2040/2/27	第18回三菱倉庫株式会社社債無担保社債	0.22	700,000	689,150	2029/12/5
第37回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.87	200,000	204,886	2024/7/29	第19回三菱倉庫株式会社社債無担保社債	0.61	400,000	388,712	2039/12/5
第40回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.841	600,000	616,416	2031/6/3	第3回株式会社住友倉庫無担保社債	0.366	500,000	501,395	2022/12/16
第41回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.7	700,000	707,021	2031/12/8	第4回株式会社住友倉庫無担保社債	0.639	300,000	304,728	2025/12/17
第42回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.647	600,000	600,498	2032/5/28	第5回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	400,000	398,248	2025/3/26
第43回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.941	700,000	710,171	2037/11/30	第6回株式会社住友倉庫無担保社債	0.838	700,000	710,164	2038/3/26
第44回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.878	800,000	801,704	2038/5/21	第7回株式会社住友倉庫無担保社債	0.08	200,000	198,502	2024/9/24
第45回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.871	700,000	714,091	2033/12/6	第8回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	600,000	588,084	2029/9/21
第46回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.69	500,000	483,315	2039/11/28	第1回朝日放送グループホールディングス株式会社社債無担保社債	0.16	200,000	198,994	2024/9/2
第47回南海電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.48	300,000	300,987	2030/6/4	第63回日本電信電話株式会社社債電話債券	0.69	500,000	505,860	2023/3/20
第24回京阪電気鉄道株式会社社債無担保社債	1.7	300,000	310,245	2022/12/9	第20回KDDI株式会社社債無担保社債	0.803	700,000	714,875	2023/12/20
第25回京阪電気鉄道株式会社社債無担保社債	1.34	100,000	101,000	2021/7/20	第22回KDDI株式会社社債無担保社債	0.669	500,000	510,110	2024/9/20
第28回京阪電気鉄道株式会社社債無担保社債	0.725	800,000	818,016	2025/9/1	第21回KDDI株式会社社債無担保社債	0.31	700,000	699,482	2028/7/12
第29回京阪ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.34	600,000	600,786	2026/6/16	第24回KDDI株式会社社債無担保社債	0.25	700,000	700,973	2025/11/21
第30回京阪ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.74	700,000	698,992	2038/7/16	第25回KDDI株式会社社債無担保社債	0.395	400,000	401,916	2028/11/21
第31回京阪ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.455	200,000	200,974	2029/1/24	第26回KDDI株式会社社債無担保社債	0.13	100,000	99,914	2024/4/26
第32回京阪ホールディングス株式会社社債無担保社債	0.63	700,000	681,422	2039/12/16	第27回KDDI株式会社社債無担保社債	0.23	700,000	697,809	2026/4/24
第50回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.857	200,000	207,000	2027/4/30	第29回KDDI株式会社社債無担保社債	0.02	800,000	798,080	2022/11/29
第52回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.75	600,000	605,658	2036/8/29	第20回株式会社N T T ドコモ無担保社債	0.73	400,000	406,132	2023/9/20
第53回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.85	600,000	618,324	2035/2/28	第22回沖縄電力株式会社社債	0.996	300,000	305,175	2022/6/24
第54回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.806	700,000	710,094	2037/5/29	第23回沖縄電力株式会社社債	0.469	200,000	203,488	2025/3/25
第55回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.79	600,000	606,030	2037/12/4	第25回沖縄電力株式会社社債	0.25	700,000	703,969	2027/6/25
第56回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.748	600,000	600,360	2038/5/25	第26回沖縄電力株式会社社債	0.28	700,000	704,529	2028/12/28
第57回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.863	500,000	509,005	2038/9/10	第27回沖縄電力株式会社社債	0.19	800,000	795,984	2030/3/25
第58回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.725	800,000	793,616	2039/4/25	第38回電源開発株式会社社債無担保社債	0.978	300,000	308,517	2023/12/20
第59回名古屋鉄道株式会社社債無担保社債	0.53	400,000	382,928	2039/9/5	第39回電源開発株式会社社債無担保社債	0.929	200,000	205,572	2024/2/20
第7回日本通運株式会社社債無担保社債	1.09	100,000	100,979	2021/10/20	第40回電源開発株式会社社債無担保社債	0.889	200,000	205,694	2024/6/20
第9回日本通運株式会社社債無担保社債	0.28	600,000	598,806	2026/2/25	第49回電源開発株式会社社債無担保社債	0.4	300,000	302,739	2027/5/20
第10回日本通運株式会社社債無担保社債	0.12	300,000	299,001	2023/7/14	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				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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		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5回SCSK株式会社無担保社債	0.14	500,000	499,565	2021/12/15
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6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	600,000	598,848	2022/7/21
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
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	小 計		426,307,000	433,399,580	
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	合 計		672,358,863	702,571,116	
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					

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。

東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド

運用報告書 第8期（決算日 2020年5月28日）

（計算期間 2019年5月29日～2020年5月28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	株 組 入 比 率	純 資 産 額
	期 騰 落	中 率			
	円	%		%	百万円
4期(2016年5月30日)	20,913	△ 2.1	1,924.64	97.5	36,426
5期(2017年5月29日)	25,278	20.9	2,259.91	97.6	89,988
6期(2018年5月28日)	28,649	13.3	2,601.87	96.9	96,585
7期(2019年5月28日)	25,745	△10.1	2,334.11	97.0	107,652
8期(2020年5月28日)	26,104	1.4	2,437.16	96.1	37,394

○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	株 組 入 比 率
	騰 落	率		
(期 首)	円	%		%
2019年5月28日	25,745	—	2,334.11	97.0
5月末	25,175	△ 2.2	2,275.96	97.5
6月末	25,421	△ 1.3	2,338.89	97.6
7月末	25,598	△ 0.6	2,360.18	97.8
8月末	25,417	△ 1.3	2,280.58	98.9
9月末	26,665	3.6	2,418.29	95.8
10月末	27,832	8.1	2,539.02	96.9
11月末	28,296	9.9	2,588.40	96.2
12月末	28,474	10.6	2,625.91	97.1
2020年1月末	28,075	9.1	2,569.77	99.0
2月末	25,271	△ 1.8	2,305.76	99.1
3月末	24,460	△ 5.0	2,167.60	92.3
4月末	24,757	△ 3.8	2,261.88	95.4
(期 末)				
2020年5月28日	26,104	1.4	2,437.16	96.1

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数はTOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。
TOPIXは、東京証券取引所の知的財産であり、この指数の算出、数値の公表、利用など株価指数に関するすべての権利は東京証券取引所が有しています。東京証券取引所は、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIXの商標もしくは使用の停止を行う権利を有しています。

○運用経過

(2019年5月29日～2020年5月28日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：25,745円

期 末：26,104円

騰落率： 1.4%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・米中貿易協議の進展
- ・英国のEU（欧州連合）離脱問題の進展
- ・欧米でのロックダウン（都市封鎖）緩和に伴う経済活動再開への期待

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による経済の減速



(注) 参考指数は、期首（2019年5月28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、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

■投資環境

当期の国内株式市場は小幅に上昇しました。

期初は米中貿易摩擦などにより上値の重い展開となりましたが、2019年9月以降は米中貿易協議の進展や英国のEU離脱期限の延長に関する合意などを受けて、世界的に政治的リスクが後退し、投資家心理が改善したことから、年末にかけて国内株式市場は上昇しました。

2020年以降は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による経済の減速が嫌気され、3月にかけて国内株式市場は大きく下落しました。その後、主要中央銀行が大規模な金融緩和を実施するなか、欧米でのロックダウン緩和に伴う経済活動再開や、新型コロナウイルスのワクチン開発への期待などから、国内株式市場は大きく上昇して、前期末対比小幅に上昇した水準で期を終えました。

■ポートフォリオについて

配当利回りをTOPIX（東証株価指数）よりも高めつつ、価格変動リスクが低くなると期待されるポートフォリオを構築しました。その結果、ポートフォリオは食料品、小売業といった内需・ディフェンシブ（景気変動の影響を受けにくい）業種が中心となりました。

ポートフォリオの β （ベータ：TOPIXに対する感応度）を低く抑えたため、相場下落局面では下値が限定的だったことがパフォーマンスにプラスに寄与したものの、2020年3月中旬以降の株価上昇局面で、当ファンドの基準価額の上昇率がTOPIX（配当込み）に劣後したことから、当期のパフォーマンスはTOPIX（配当込み）を下回る結果となりました。また、価格変動リスクはTOPIXと比較して低く抑えることができました。

以上の運用の結果、基準価額は1.4%上昇しました。

○今後の運用方針

世界経済の先行き不透明感が強まっていることや、新型コロナウイルス感染の第2波の到来、さらに感染拡大の責任を巡る米中関係の悪化などの懸念材料はあるものの、世界の主要各国が打ち出す大規模な金融緩和や財務拡大などの対応が経済を下支えし、国内株式市場は緩やかながらも回復基調に戻ると予想します。

以上のような環境下、今後も日本の株式を主要投資対象とし、流動性や信用リスクなどを勘案して選定した銘柄に投資します。ポートフォリオ全体の配当利回りを高める戦略と価格変動リスクを低く抑える戦略を組み合わせることで、ポートフォリオ全体の価格変動リスクをTOPIXより低く抑えながら、中長期的にTOPIXと同程度のリターンを目指します。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月29日～2020年5月28日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 2	% 0.008	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(2)	(0.008)	
合 計	2	0.008	
期中の平均基準価額は、26,286円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○ 売買及び取引の状況

(2019年5月29日～2020年5月28日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		40,871	90,482,388	78,539	143,214,092
		(954)	(—)		

(注) 金額は受渡代金です。

(注) () 内は株式分割、移転、合併等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

○ 株式売買比率

(2019年5月29日～2020年5月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	233,696,480千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	116,826,846千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.00

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月29日～2020年5月28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5月28日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業（－％）			
ホクト	182	—	—
建設業（8.6％）			
ミライト・ホールディングス	353	185	283,790
安藤・間	1,650	454	319,616
東急建設	693	292	173,156
長谷工コーポレーション	430	—	—
三井住友建設	—	640	301,440
奥村組	234	75	199,725
東鉄工業	104	—	—
熊谷組	41	125	333,375
大東建託	51	—	—
前田道路	48	—	—
日本国土開発	—	45	25,425
ライト工業	352	120	176,280
積水ハウス	741	359	724,641
中電工	38	—	—
関電工	712	259	260,813
協和エクシオ	—	125	305,625
食料品（21.2％）			
日本製粉	256	63	103,761
三井製糖	151	—	—
森永製菓	—	95	437,950
江崎グリコ	273	95	484,500
山崎製パン	—	108	200,016
カルビー	409	169	514,605

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
明治ホールディングス	221	92	731,400
日本ハム	203.4	—	—
アサヒグループホールディングス	—	110	454,630
サントリー食品インターナショナル	422	166	720,440
ダイドーグループホールディングス	85	—	—
日清オイリオグループ	131	41	141,040
味の素	480	345	627,037
キュービー	649	202	429,856
ハウス食品グループ本社	—	95	345,325
ニチレイ	—	229	659,520
東洋水産	391	117	647,010
日清食品ホールディングス	44	45	400,500
フジッコ	107	—	—
日本たばこ産業	819	329	711,133
繊維製品（0.6％）			
東洋紡	491	—	—
帝人	620	—	—
ワコールホールディングス	51	100	231,600
化学（0.9％）			
ノエビアホールディングス	23	38	187,530
アース製薬	62	—	—
エフピコ	—	15	116,850
医薬品（4.0％）			
武田薬品工業	526	174	724,362
田辺三菱製薬	369.8	—	—
科研製薬	167	51	293,760

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日医工	380	40	52,120
沢井製薬	248	—	—
キョーリン製薬ホールディングス	378	160	364,320
石油・石炭製品 (0.9%)			
J X T Gホールディングス	—	750	317,175
ゴム製品 (2.1%)			
ブリヂストン	506	208	757,120
住友ゴム工業	419	—	—
ガラス・土石製品 (0.1%)			
黒崎播磨	7	5	20,025
非鉄金属 (0.3%)			
アサヒホールディングス	355	40	109,040
機械 (—%)			
技研製作所	151	—	—
平和	102.2	—	—
SANKYO	37.5	—	—
電気機器 (3.0%)			
日新電機	377	—	—
沖電気工業	768	289	317,900
カシオ計算機	360	—	—
キヤノン	676	325	750,425
輸送用機器 (2.1%)			
日産自動車	1,140	—	—
SUBARU	538	310	762,290
精密機器 (1.9%)			
ニコン	—	620	675,180
シチズン時計	210	—	—
その他製品 (0.2%)			
バラマウントベッドホールディングス	70.4	—	—
リンテック	—	13	33,475
コクヨ	—	20	28,520
電気・ガス業 (7.2%)			
中部電力	210	488	715,408
沖縄電力	291	61.95	124,209
東京瓦斯	761	288	735,408
大阪瓦斯	1,066	339	730,206
東邦瓦斯	159	56	291,200

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
陸運業 (4.9%)			
西日本旅客鉄道	140	87	617,787
近鉄グループホールディングス	330	—	—
名古屋鉄道	421	—	—
センコーグループホールディングス	1,029	185	156,140
九州旅客鉄道	560.5	233	737,445
S Gホールディングス	—	75	256,125
空運業 (0.3%)			
日本航空	583	50	110,625
A N Aホールディングス	485	—	—
情報・通信業 (11.5%)			
N E C ネットエスアイ	133	171	327,978
コーエーテクモホールディングス	106	98	297,430
ティーガイア	197	—	—
アルテリア・ネットワークス	—	116	222,720
トレンドマイクロ	—	109	647,460
マーベラス	160	—	—
エイベックス	—	135	131,625
スカパー J S A Tホールディングス	1,055	303	134,532
コネクシオ	74	—	—
日本電信電話	435	285	702,097
K D D I	713	225	708,975
N T T ドコモ	822	232	690,548
東宝	—	20	79,800
N S D	115	115	191,475
卸売業 (9.7%)			
T O K A Iホールディングス	712	129	129,645
コマダホールディングス	433	151	286,145
第一興商	162	44	167,640
アズワン	—	6	69,480
伊藤忠商事	971	309	719,970
三井物産	1,134	430	717,670
住友商事	1,323	314	407,886
菱洋エレクトロ	—	30	82,470
岩谷産業	215	67	254,600
サンケツ	205	65	104,650
伊藤忠エネクス	143	—	—

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
リョーサン	94	—	—
日鉄物産	94	34	127,500
オートボックスセブン	514	174	235,074
因幡電機産業	75	69	173,466
小売業 (12.6%)			
ローソン	250	27	160,920
エービーシー・マート	263	95	627,950
エディオン	1,010	261	262,305
アルペン	115	—	—
ジーンズホールディングス	—	19	127,490
D C Mホールディングス	844	244	273,036
ドトール・日レスホールディングス	242	87	158,514
すかいらくホールディングス	1,090	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	470	71	267,670
L I X I L ビバ	225	—	—
西松屋チェーン	342	96	91,392
ユナイテッドアローズ	—	47	90,381
日本瓦斯	—	11	46,035
島忠	182	109	320,024
チヨダ	32	—	—
リンガーハット	105	61	149,633
A O K I ホールディングス	377	—	—
コメリ	57	—	—
青山商事	298	—	—
ヤオコー	—	20	137,400
ケーズホールディングス	955	440	606,760
ヤマダ電機	2,431.4	1,000	524,000

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
吉野家ホールディングス	479	215	531,050
王将フードサービス	65	26	166,920
プレナス	217	—	—
パローホールディングス	119.8	—	—
サンドラッグ	50	—	—
銀行業 (1.4%)			
ゆうちょ銀行	1,811	358	322,200
あおぞら銀行	540	87	178,176
みずほフィナンシャルグループ	2,900	—	—
池田泉州ホールディングス	1,240	—	—
保険業 (1.9%)			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	—	223	693,530
その他金融業 (1.0%)			
オリックス	450	258	373,584
不動産業 (0.3%)			
野村不動産ホールディングス	194	—	—
タカラレーベン	1,157	298	111,750
サービス業 (3.3%)			
みらかホールディングス	485	135	336,285
りらいあコミュニケーションズ	400	40	48,920
ユー・エス・エス	40	193	369,016
セコム	—	17	157,335
メイテック	173	50	260,500
合 計	株 数 ・ 金 額	54,833	18,119
	銘柄数<比率>	124	105
			35,932,468
			<96.1%>

(注) 銘柄欄の () 内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の < > 内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

○投資信託財産の構成

(2020年5月28日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	35,932,468	94.6
コール・ローン等、その他	2,048,610	5.4
投資信託財産総額	37,981,078	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月28日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	37,981,078,156
コール・ローン等	684,202,907
株式(評価額)	35,932,468,750
未収入金	473,263,499
未収配当金	891,143,000
(B) 負債	586,535,876
未払金	556,156,525
未払解約金	30,377,816
未払利息	1,535
(C) 純資産総額(A－B)	37,394,542,280
元本	14,325,263,356
次期繰越損益金	23,069,278,924
(D) 受益権総口数	14,325,263,356口
1万口当たり基準価額(C／D)	26,104円

(注) 当親ファンドの期首元本額は41,814,150,407円、期中追加設定元本額は29,482,688,529円、期中一部解約元本額は56,971,575,580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) 10,007,470,356円
 東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) 4,283,779,490円
 東京海上・安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定> 33,979,571円
 年金安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定> 33,939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5月29日～2020年5月28日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,554,256,119
受取配当金	3,543,928,150
受取利息	7,767
その他収益金	12,004,127
支払利息	△ 1,683,925
(B) 有価証券売買損益	△15,798,088,644
売買益	7,033,083,327
売買損	△22,831,171,971
(C) 当期損益金(A＋B)	△12,243,832,525
(D) 前期繰越損益金	65,838,149,570
(E) 追加信託差損益金	49,444,079,230
(F) 解約差損益金	△79,969,117,351
(G) 計(C＋D＋E＋F)	23,069,278,924
次期繰越損益金(G)	23,069,278,924

(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3,000億円とする約款変更を行いました。

TMA日本REITマザーファンド

運用報告書 第9期（決算日 2020年7月10日）

（計算期間 2019年7月11日～2020年7月10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	投 資 信 託 資 産 額		
	期 騰 落 率	中 率				
5 期(2016年 7 月11日)	22,108	16.3	3,328.23	15.5	98.4	百万円 6,026
6 期(2017年 7 月10日)	20,806	△ 5.9	3,104.17	△ 6.7	97.5	54,693
7 期(2018年 7 月10日)	23,145	11.2	3,456.85	11.4	98.4	71,950
8 期(2019年 7 月10日)	27,259	17.8	4,064.84	17.6	98.2	120,486
9 期(2020年 7 月10日)	23,933	△12.2	3,521.95	△13.4	98.2	37,309

○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	投 資	信 託
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%		%
2019年7月10日	27,259	—	4,064.84	—		98.2
7月末	27,636	1.4	4,120.33	1.4		96.6
8月末	28,732	5.4	4,275.94	5.2		95.2
9月末	30,103	10.4	4,477.77	10.2		95.7
10月末	31,090	14.1	4,625.77	13.8		96.5
11月末	30,840	13.1	4,584.30	12.8		96.8
12月末	29,970	9.9	4,450.34	9.5		98.4
2020年1月末	31,046	13.9	4,608.85	13.4		97.1
2月末	28,531	4.7	4,218.40	3.8		97.0
3月末	22,702	△16.7	3,343.59	△17.7		92.6
4月末	22,441	△17.7	3,313.25	△18.5		95.6
5月末	24,268	△11.0	3,586.37	△11.8		97.8
6月末	23,928	△12.2	3,525.99	△13.3		98.1
(期 末)						
2020年7月10日	23,933	△12.2	3,521.95	△13.4		98.2

(注) 騰落率は期首比です。

参考指数は東証REIT指数（配当込み）です。
東証REIT指数（配当込み）は、東京証券取引所（以下「東証」といいます。）に上場しているREIT全銘柄の動きを捉える指数で、基準日（2003年3月31日）の時価総額を1,000として算出され、東証に上場しているREIT全銘柄に投資した場合の投資成果（市場における価格の変動と分配金の受け取りを合わせた投資効果）を表します。なお、東証REIT指数は東証の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数の商標又は標章に関するすべての権利は、東証が有しています。なお、ファンドは、東証により提供、保証又は販売されるものではなく、東証は、ファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

○運用経過

(2019年7月11日～2020年7月10日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：27,259円
 期 末：23,933円
 騰落率：△12.2%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・景気変動の影響を受けにくいREITの特性が市場で評価されたこと

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの感染拡大による経済活動の停滞
- ・米中貿易協議の進展などによる長期金利の上昇



(注) 参考指数は、期首(2019年7月10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、東証REIT指数(配当込み)です。

■投資環境

期初から2019年10月にかけては、米国で2年債と10年債の利回りが逆転するなど世界経済の減速が懸念されるなか、REITの景気変動の影響を受けにくい特性が市場で評価され、日本REIT市場は上昇しました。

11月から12月にかけては、米中貿易協議の進展や大型補正予算を伴う経済政策への期待から、国内長期金利が上昇し、日本REIT市場は下落しました。

その後、2020年3月中旬にかけて新型コロナウイルスの感染拡大に伴い、経済活動の停滞が長期化すると懸念が高まり、日本REIT市場は急落しました。

3月下旬以降は金融・財政政策への期待が強まったこと、4月上旬に発令された緊急事態宣言が5月には解除されて、経済活動再開への期待が高まったことから、日本REIT市場は反発しました。

■ポートフォリオについて

日本REITの市場流動性(流動性基準)とスポンサー企業の信用力や財務健全性(信用リスク基準)に基づいて絞り込んだ銘柄を対象として、時価加重比率と売買金額加重比率を組み合わせた投資比率でポートフォリオを構築し、中長期的に日本REIT市場全体の動きをおおむね捉える運用を機動的に行いました。

以上の運用の結果、日本REIT市場全体の下落を受けて基準価額は12.2%下落し、参考指数である東証REIT指数(配当込み)におおむね連動する値動きとなりました。

○今後の運用方針

日本REIT市場は、新型コロナウイルス感染拡大によるホテルや商業施設等への影響に注意が必要なものの、その他のセクターの保有資産からは安定した賃料収入が期待できることから、底堅い展開になると想定します。

今後も、運用方針に基づき、ファンドにおけるREITの組入比率は高位を維持してポートフォリオを構築し、中長期的に日本REIT市場全体の動きをおおむね捉える運用を機動的に行う方針です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年7月11日～2020年7月10日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 17	% 0.060	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(投 資 信 託 証 券)	(17)	(0.060)	
合 計	17	0.060	
期中の平均基準価額は、27,607円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

○ 売買及び取引の状況

(2019年7月11日～2020年7月10日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	S O S i L A 物流リート投資法人	8,423	1,013,768	6,400	668,746
	日本アコモデーションファンド投資法人	60	38,398	3,437	1,955,707
	MCUBS M i d C i t y 投資法人	6,282	711,568	21,111	1,661,665
	森ヒルズリート投資法人	2,550	443,311	9,058	1,182,105
	産業ファンド投資法人	3,383	542,956	7,146	984,636
	アドバンス・レジデンス投資法人	5,764	1,969,577	11,693	3,378,108
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1,020	186,185	8,023	1,294,861
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	2,510	1,317,069	6,455	2,373,243
	GLP投資法人	9,350	1,253,480	28,977	3,390,483
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,790 (256)	951,719 (85,075)	4,850	1,383,846
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人 (新)	256 (△ 256)	85,075 (△ 85,075)	—	—
	日本プロロジスリート投資法人	4,779	1,376,027	16,208	4,422,489
	星野リゾート・リート投資法人	—	—	2,261	765,739
	O n e リート投資法人	540	172,104	3,430	843,214
	イオンリート投資法人	6,100	860,616	9,442	950,630
	ヒューリックリート投資法人	2,250	433,019	10,301	1,234,085
	日本リート投資法人	334	140,765	3,822	1,250,357
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	17,400	309,359	97,084	1,410,406
	積水ハウス・リート投資法人	21,170	1,890,153	37,009	2,453,780

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内		口	千円	口	千円
	ケネディクス商業リート投資法人	3,505	948,108	4,810	823,672
	サムティ・レジデンスリアル投資法人	2,400	267,226	1,800	141,374
	野村不動産マスターファンド投資法人	13,020	2,383,017	38,742	5,073,941
	ラサールロジポート投資法人	200	26,278	11,938	1,700,415
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,455	672,025	1,650	708,561
	投資法人みらい	8,484	430,651	6,100	215,673
	森トラスト・ホテルリート投資法人	600	86,637	4,010	398,996
	三菱地所物流リート投資法人	1,250	434,134	3,034	980,559
	C R E ロジスティクスファンド投資法人	1,720	258,542	—	—
	タカラレーベン不動産投資法人	1,750	200,109	950	68,240
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	3,910	488,179	4,206	418,147
	伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人（新）	(2,190)	(254,806)		
		(△ 2,190)	(△ 254,806)		
	日本ビルファンド投資法人	1,690	1,305,207	8,210	5,725,134
	ジャパンリアルエステイト投資法人	2,290	1,642,675	10,263	6,511,556
	日本リートリアルファンド投資法人	4,150	842,281	20,160	2,711,250
	オリックス不動産投資法人	4,510	768,909	21,652	3,368,071
	日本プライムリアルティ投資法人	3,485	1,651,229	5,941	1,954,445
	プレミアム投資法人	6,310	961,895	13,219	1,374,716
	東急リアル・エステート投資法人	3,275	660,045	8,755	1,152,934
	グローバル・ワン不動産投資法人	3,480	488,297	8,974	801,549
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,250	907,111	19,441	2,277,706
	森トラスト総合リート投資法人	2,284	445,261	10,287	1,306,555
	インヴィンシブル投資法人	4,000	254,267	54,407	1,856,782
	フロンティア不動産投資法人	600	257,024	2,300	695,136
	平和不動産リート投資法人	4,100	535,311	5,652	519,145
	日本ロジスティクスファンド投資法人	2,150	590,159	5,537	1,305,369
	福岡リート投資法人	1,930	353,693	4,440	600,697
	ケネディクス・オフィス投資法人	660	536,734	3,675	2,048,553
	いちごオフィスリート投資法人	7,750	810,924	10,921	752,904
	大和証券オフィス投資法人	1,210	989,013	3,543	2,104,242
	阪急阪神リート投資法人	1,840	293,638	7,168	891,481
スターツプロシード投資法人	380	78,873	250	43,794	
大和ハウスリート投資法人	2,150	606,718	13,083	3,267,304	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	21,300	1,781,453	50,344	2,255,013	
大和証券リビング投資法人	3,200	325,992	19,887	1,702,024	
ジャパンエクセレント投資法人	3,850	680,349	10,273	1,304,831	
合 計		227,289	37,911,942	682,329	88,664,900

(注) 金額は受渡代金です。

(注) ()内は分割・償還等による増減分で、上段の数字には含まれていません。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として記載しています。

○利害関係人との取引状況等

(2019年7月11日～2020年7月10日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2020年7月10日現在)

国内投資信託証券

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
S O S i L A物流リート投資法人	—	2,023	297,381	0.8
日本アコモデーションファンド投資法人	4,431	1,054	710,396	1.9
MCUBS M i d C i t y投資法人	21,860	7,031	490,763	1.3
森ヒルズリート投資法人	10,249	3,741	518,128	1.4
産業ファンド投資法人	7,160	3,397	640,334	1.7
アドバンス・レジデンス投資法人	10,511	4,582	1,583,081	4.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	10,132	3,129	622,671	1.7
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,745	2,800	982,800	2.6
G L P投資法人	33,122	13,495	2,198,335	5.9
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,164	2,360	811,840	2.2
日本プロロジスリート投資法人	17,980	6,551	2,207,687	5.9
星野リゾート・リート投資法人	2,848	587	249,475	0.7
O n e リート投資法人	3,338	448	112,672	0.3
イオンリート投資法人	6,883	3,541	395,529	1.1
ヒューリックリート投資法人	13,061	5,010	620,238	1.7
日本リート投資法人	4,296	808	253,712	0.7
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	118,284	38,600	501,414	1.3
積水ハウス・リート投資法人	29,732	13,893	983,624	2.6
ケネディクス商業リート投資法人	3,859	2,554	484,749	1.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	—	600	62,280	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	41,840	16,118	2,085,669	5.6
ラサールロジポート投資法人	14,716	2,978	530,084	1.4
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,595	1,400	730,800	2.0
投資法人みらい	2,950	5,334	189,623	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	4,470	1,060	98,156	0.3
三菱地所物流リート投資法人	2,732	948	416,172	1.1
C R E ロジスティクスファンド投資法人	—	1,720	269,180	0.7
タカラレーベン不動産投資法人	—	800	67,200	0.2
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	—	1,894	288,645	0.8
日本ビルファンド投資法人	9,987	3,467	2,073,266	5.6
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,825	3,852	2,114,748	5.7
日本リテールファンド投資法人	25,537	9,527	1,206,118	3.2
オリックス不動産投資法人	26,304	9,162	1,258,858	3.4
日本プライムリアルティ投資法人	5,277	2,821	839,529	2.3

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率	
	口	口	千円	%	
プレミアム投資法人	13,054	6,145	701,144	1.9	
東急リアル・エステート投資法人	9,404	3,924	541,512	1.5	
グローバル・ワン不動産投資法人	10,144	4,650	453,840	1.2	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,325	9,134	1,002,913	2.7	
森トラスト総合リート投資法人	12,260	4,257	543,193	1.5	
インヴィンシブル投資法人	50,407	—	—	—	
フロンティア不動産投資法人	2,386	686	220,549	0.6	
平和不動産リート投資法人	5,359	3,807	374,608	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,625	2,238	687,066	1.8	
福岡リート投資法人	3,717	1,207	148,581	0.4	
ケネディクス・オフィス投資法人	4,789	1,774	1,060,852	2.8	
いちごオフィスリート投資法人	9,427	6,256	437,920	1.2	
大和証券オフィス投資法人	3,091	758	431,302	1.2	
阪急阪神リート投資法人	7,300	1,972	233,287	0.6	
スターツプロシード投資法人	—	130	27,794	0.1	
大和ハウスリート投資法人	16,108	5,175	1,426,747	3.8	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,044	—	—	—	
大和証券リビング投資法人	24,471	7,784	817,320	2.2	
ジャパンエクセレント投資法人	11,875	5,452	624,254	1.7	
合 計	口 数 ・ 金 額	242,634	36,628,049		
	銘 柄 数 < 比 率 >	51	< 98.2% >		

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として記載しています。

(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。

○投資信託財産の構成

(2020年7月10日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	36,628,049	97.8
コール・ローン等、その他	808,583	2.2
投資信託財産総額	37,436,632	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年7月10日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	37,436,632,329
コール・ローン等	436,244,281
投資証券(評価額)	36,628,049,200
未収入金	55,992,914
未収配当金	316,345,934
(B) 負債	126,854,671
未払金	80,338,928
未払解約金	46,515,459
未払利息	284
(C) 純資産総額(A－B)	37,309,777,658
元本	15,589,390,568
次期繰越損益金	21,720,387,090
(D) 受益権総口数	15,589,390,568口
1万口当たり基準価額(C／D)	23,933円

(注) 当親ファンドの期首元本額は44,200,648,126円、期中追加設定元本額は20,164,377,975円、期中一部解約元本額は48,775,635,533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)	10,881,160,584円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)	4,690,549,315円
東京海上・安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定>	17,663,029円
年金安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定>	17,640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7月11日～2020年7月10日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,075,609,324
受取配当金	4,076,805,570
受取利息	9,814
その他収益金	57
支払利息	△ 1,206,117
(B) 有価証券売買損益	△30,948,792,446
売買益	3,360,064,980
売買損	△34,308,857,426
(C) 当期損益金(A＋B)	△26,873,183,122
(D) 前期繰越損益金	76,285,853,581
(E) 追加信託差損益金	39,233,438,833
(F) 解約差損益金	△66,925,722,202
(G) 計(C＋D＋E＋F)	21,720,387,090
次期繰越損益金(G)	21,720,387,090

(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、追加信託金の限度額を3,000億円とする約款変更を行いました。