

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、基準価額の水準、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118期 (決算日 2022年8月23日)
第119期 (決算日 2022年9月26日)
第120期 (決算日 2022年10月24日)
第121期 (決算日 2022年11月24日)
第122期 (決算日 2022年12月23日)
第123期 (決算日 2023年1月23日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。
さて、「東京海上・円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123期の決算を行いましたので、第118期～第123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 価 額 (分配落)	税 分 込 配 金 期 騰 落 中 率	株 組 入 比 率	債 組 入 比 率	投 資 信 託 組 入 比 率	純 資 産 額
	円	円	%	%	%	百万円
94期(2020年8月24日)	10,446	30	0.1	3.9	68.8	665,880
95期(2020年9月23日)	10,426	30	0.1	4.9	69.5	661,116
96期(2020年10月23日)	10,342	30	△0.5	8.6	69.9	651,826
97期(2020年11月24日)	10,394	30	0.8	11.2	68.8	648,837
98期(2020年12月23日)	10,384	30	0.2	11.5	69.5	642,329
99期(2021年1月25日)	10,423	30	0.7	13.6	69.4	640,580
100期(2021年2月24日)	10,459	30	0.6	13.6	68.8	637,133
101期(2021年3月23日)	10,536	30	1.0	11.9	68.9	637,839
102期(2021年4月23日)	10,541	30	0.3	11.5	69.8	631,849
103期(2021年5月24日)	10,487	30	△0.2	11.8	69.7	624,434
104期(2021年6月23日)	10,520	30	0.6	14.4	69.3	621,786
105期(2021年7月26日)	10,533	30	0.4	14.5	70.0	616,515
106期(2021年8月23日)	10,459	30	△0.4	14.4	69.9	608,258
107期(2021年9月24日)	10,504	30	0.7	15.3	69.4	602,806
108期(2021年10月25日)	10,361	30	△1.1	14.0	70.0	590,205
109期(2021年11月24日)	10,327	30	△0.0	14.2	69.9	582,877
110期(2021年12月23日)	10,285	30	△0.1	14.7	69.1	574,576
111期(2022年1月24日)	10,076	30	△1.7	12.1	70.5	558,008
112期(2022年2月24日)	9,940	30	△1.1	11.7	70.1	544,600
113期(2022年3月23日)	9,978	30	0.7	10.9	68.5	540,176
114期(2022年4月25日)	9,919	30	△0.3	9.2	69.7	530,588
115期(2022年5月23日)	9,908	30	0.2	11.6	69.6	525,770
116期(2022年6月23日)	9,764	30	△1.2	7.2	69.8	512,567
117期(2022年7月25日)	9,837	30	1.1	9.0	69.3	510,304
118期(2022年8月23日)	9,806	30	△0.0	11.0	69.3	503,933
119期(2022年9月26日)	9,644	30	△1.3	11.7	69.7	490,314
120期(2022年10月24日)	9,491	30	△1.3	6.9	69.7	476,223
121期(2022年11月24日)	9,583	30	1.3	7.2	69.2	473,682
122期(2022年12月23日)	9,381	30	△1.8	7.0	69.3	457,538
123期(2023年1月23日)	9,335	20	△0.3	4.8	69.7	447,506

(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 証 券 組 入 比 率
			騰 落 率			
第118期	(期 首)	円	%	%	%	%
	2022年 7 月25日	9,837	—	9.0	69.3	9.0
	7 月末	9,852	0.2	8.9	69.5	9.4
	(期 末)					
	2022年 8 月23日	9,836	△0.0	11.0	69.3	11.4
第119期	(期 首)					
	2022年 8 月23日	9,806	—	11.0	69.3	11.4
	8 月末	9,810	0.0	11.5	69.3	12.0
	(期 末)					
	2022年 9 月26日	9,674	△1.3	11.7	69.7	11.8
第120期	(期 首)					
	2022年 9 月26日	9,644	—	11.7	69.7	11.8
	9 月末	9,633	△0.1	9.6	69.5	9.6
	(期 末)					
	2022年10月24日	9,521	△1.3	6.9	69.7	6.7
第121期	(期 首)					
	2022年10月24日	9,491	—	6.9	69.7	6.7
	10月末	9,601	1.2	6.9	69.6	7.1
	(期 末)					
	2022年11月24日	9,613	1.3	7.2	69.2	6.9
第122期	(期 首)					
	2022年11月24日	9,583	—	7.2	69.2	6.9
	11月末	9,537	△0.5	7.0	69.3	7.0
	(期 末)					
	2022年12月23日	9,411	△1.8	7.0	69.3	6.8
第123期	(期 首)					
	2022年12月23日	9,381	—	7.0	69.3	6.8
	12月末	9,351	△0.3	7.0	69.3	6.9
	(期 末)					
	2023年 1 月23日	9,355	△0.3	4.8	69.7	5.2

(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。

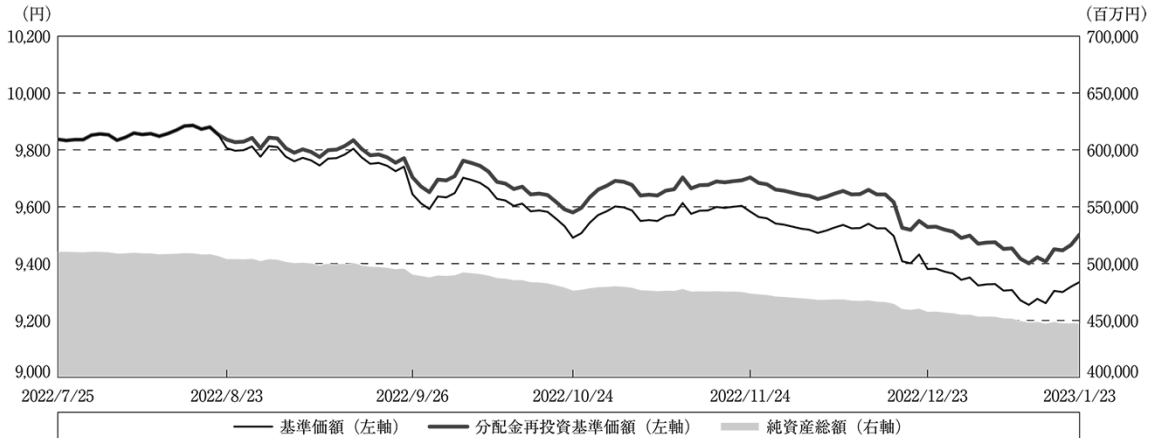
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しています。

(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

(2022年7月26日～2023年1月23日)

■作成期間中の基準価額等の推移



第118期首：9,837円

第123期末：9,335円（既払分配金(税込み)：170円）

騰落率：△ 3.4%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、作成期首（2022年7月25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

【日本株式・日本REIT】

- ・10月の米国コアCPI（消費者物価指数）が事前予想を下回り、FRB（米連邦準備制度理事会）による金融引き締め強化に対する懸念が和らいだ場面があったこと

マイナス要因

【日本債券】

- ・日銀がYCC（イールドカーブ・コントロール）政策の変動許容幅を従来の±0.25%程度から±0.5%程度に拡大したこと

【日本株式・日本REIT】

- ・米国のCPIが事前予想を上回り、FRBによる金融引き締め強化に対する懸念が高まった場面があったこと
- ・日銀がYCC変動許容幅を拡大したことによる金利の上昇や、防衛費増額のための増税策が議論されたことなどが市場で嫌気されたこと

■投資環境

【日本債券市場】

作成期初から2022年12月前半にかけては、日銀がYCC政策を継続する姿勢を示したことから、10年国債利回りは0.20%から0.25%程度の水準で推移しました。その後、12月後半に日銀が10年国債利回りの変動許容幅を従来の±0.25%程度から±0.5%程度に拡大したことを受けて10年国債利回りは一時0.50%程度まで上昇したものの、2023年1月中旬にYCCの更なる修正が予想されるなか、日銀は変動許容幅を維持したことを受けて10年国債利回りは低下し、0.40%程度で当作成期を終えました。

社債の信用スプレッドは、ベースとなる国債利回りの上昇を受けて慎重な姿勢の投資家が増加したことなどから、拡大しました。

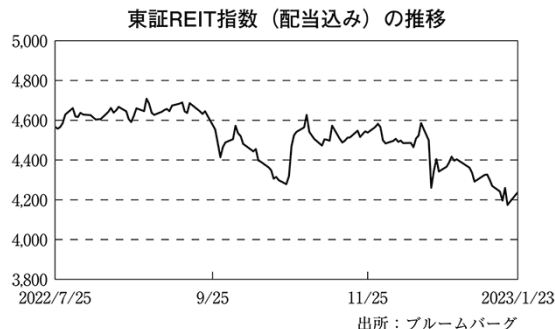
【日本株式市場】

作成期初からしばらく一進一退の展開でしたが、2022年9月中旬以降は米国のCPIが事前予想を上回ったことなどを背景に、FRBによる金融引き締め強化に対する懸念が高まり、日本株式市場は下落しました。

その後、10月の米国コアCPIが事前予想を下回ったことを受けて、日本株式市場は上昇しましたが、日銀が12月の金融政策決定会合でYCC政策の下での10年国債利回りの変動許容幅を拡大したことが金融緩和政策の転換と受け止められ、10年国債利回りの上昇とともに、円高米ドル安が進行したことに加え、防衛費増額の財源を賄うために法人税などの増税策が議論されていることが嫌気され、日本株式市場は下落しました。2023年1月になると海外株式市場の上昇に連動して、日本株式市場も戻り歩調となり、前作成期末対比では小幅に上昇して当作成期を終えました。

【日本REIT市場】

作成期初から2022年10月中旬にかけては、米国の金融引き締めの強化や景気後退リスクへの懸念が強まったことなどを受けて日本REIT市場は下落しました。10月下旬、米国で事前予想を下回る経済指標の発表を受けて金融引き締めに対する過度な懸念が和らぎ日本REIT市場は反発上昇する場面もあったものの、12月の日銀の金融緩和政策の修正を受けて国内の長期金利が上昇したことによって日本REIT市場は再び下落し、前作成期末対比でも下落しました。



■ポートフォリオについて

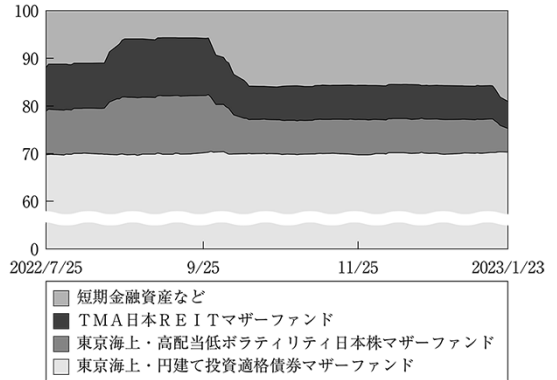
＜東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)＞

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。

作成期初、日本株式と日本REITの資産配分比率はそれぞれ9%程度で運用を開始しました。作成期中はFRBの金融政策の動向が意識されたほか、英国の大規模減税策や日銀によるYCC政策の修正など、リスクが高まった局面ではリスク資産のウェイトを引き下げるなど機動的に対応し、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5～6%程度となりました。

以上の運用の結果、当ファンドの基準価額(税引前分配金再投資)は、3.4%下落しました。

各マザーファンド組入比率の推移(%)

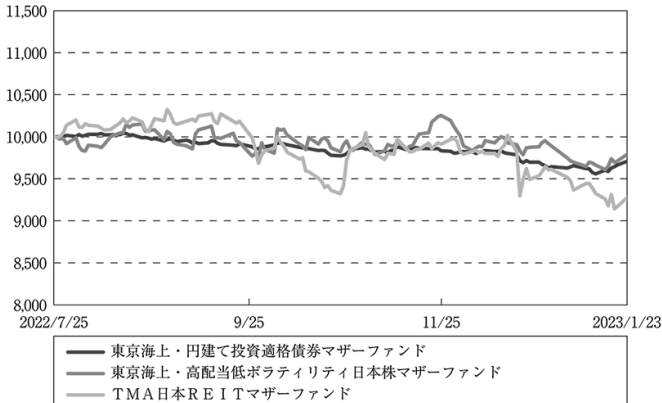


※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

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。

(円) 作成期間中の各マザーファンドの運用状況



※各マザーファンドは2022年7月25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	△2.9
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	△2.1
TMA日本REITマザーファンド	△7.3

＜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、作成期末における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。

以上の運用の結果、当作成期は社債利回りが上昇したことから、基準価額は2.9%下落しました。

＜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、当マザー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。相場上昇をけん引した景気敏感銘柄等の組入比率が相対的に低かったことなどから基準価額は2.1%下落し、参考指数であるTOPIX（配当込み）の騰落率を下回りました。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＞

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日本REITの銘柄を対象として、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、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市場全体の下落を受けて基準価額は7.3%下落し、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118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
	2022年7月26日～ 2022年8月23日	2022年8月24日～ 2022年9月26日	2022年9月27日～ 2022年10月24日	2022年10月25日～ 2022年11月24日	2022年11月25日～ 2022年12月23日	2022年12月24日～ 2023年1月23日
当期分配金 (対基準価額比率)	30 0.305%	30 0.310%	30 0.315%	30 0.312%	30 0.319%	20 0.214%
当期の収益	—	3	10	4	—	—
当期の収益以外	30	26	20	25	30	20
翌期繰越分配対象額	1,027	1,001	982	957	927	908

（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。

今後も基準価額変動リスクの変化に合わせて日本株式と日本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考える銘柄でポートフォリオを構築します。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

(2022年 7 月26日～2023年 1 月23日)

項 目	第118期～第123期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 44	% 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)	(22)	(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)	(22)	(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	0.007	(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)	(0.007)	
(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	45	0.468	
作成期間の平均基準価額は、9,630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。

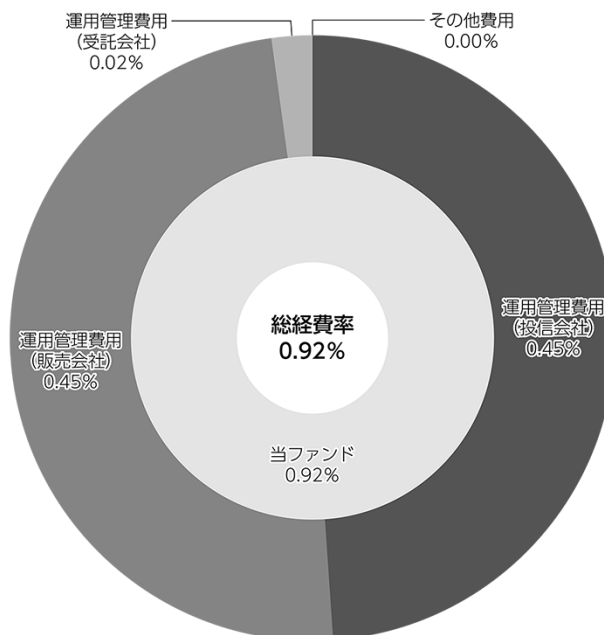
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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

(2022年7月26日～2023年1月23日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	第118期～第123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	7,706,218	9,192,258	34,009,700	40,419,393
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	5,681,924	16,203,796	14,169,338	39,576,384
TMA日本REITマザーファンド	5,163,963	16,182,397	11,394,923	34,297,312

○株式売買比率

(2022年7月26日～2023年1月23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118期～第123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	76,560,239千円
(b) 当作成期中の平均組入株式時価総額	60,063,191千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.27

(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

(2022年7月26日～2023年1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

(2023年1月23日現在)

親投資信託残高

銘 柄	第117期末	第123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	294,853,819	268,550,338	314,982,691
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	16,498,251	8,010,837	22,193,224
TMA日本REITマザーファンド	15,099,014	8,868,054	25,456,637

○投資信託財産の構成

(2023年1月23日現在)

項 目	第123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	314,982,691	69.8
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	22,193,224	4.9
TMA日本REITマザーファンド	25,456,637	5.6
コール・ローン等、その他	88,872,675	19.7
投資信託財産総額	451,505,227	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況

項 目	第118期末	第119期末	第120期末	第121期末	第122期末	第123期末
	2022年8月23日現在	2022年9月26日現在	2022年10月24日現在	2022年11月24日現在	2022年12月23日現在	2023年1月23日現在
	円	円	円	円	円	円
(A) 資産	506,586,457,235	493,279,299,158	479,948,660,085	476,668,869,771	460,646,077,080	451,505,227,182
コール・ローン等	34,874,463,664	28,276,963,579	76,593,790,654	74,384,956,729	72,151,925,515	73,871,074,404
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド(評価額)	352,229,146,348	344,537,518,210	333,443,155,087	330,717,823,253	320,716,997,456	314,982,691,697
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)	58,860,836,839	58,880,348,658	33,954,321,658	35,008,976,685	33,022,673,511	22,193,224,938
TMA日本REITマザーファンド(評価額)	58,174,462,018	58,788,350,414	32,825,627,728	34,037,629,641	32,132,753,301	25,456,637,643
未収入金	2,447,548,366	2,796,118,297	3,131,764,958	2,519,483,463	2,621,727,297	15,001,598,500
(B) 負債	2,653,372,791	2,964,999,105	3,724,919,784	2,986,178,556	3,108,018,758	3,999,044,658
未払収益分配金	1,541,783,004	1,525,289,560	1,505,342,442	1,482,872,151	1,463,153,802	958,765,360
未払解約金	737,741,913	1,009,424,504	1,874,350,334	1,128,755,552	1,300,973,732	2,685,111,602
未払信託報酬	373,769,551	430,169,990	345,035,088	374,323,264	343,682,971	355,085,412
未払利息	26,036	53,749	141,436	171,696	155,966	26,391
その他未払費用	52,287	61,302	50,484	55,893	52,287	55,893
(C) 純資産総額(A－B)	503,933,084,444	490,314,300,053	476,223,740,301	473,682,691,215	457,538,058,322	447,506,182,524
元本	513,927,668,267	508,429,853,403	501,780,814,122	494,290,717,185	487,717,934,014	479,382,680,061
次期繰越損益金	△ 9,994,583,823	△ 18,115,553,350	△ 25,557,073,821	△ 20,608,025,970	△ 30,179,875,692	△ 31,876,497,537
(D) 受益権総口数	513,927,668,267口	508,429,853,403口	501,780,814,122口	494,290,717,185口	487,717,934,014口	479,382,680,061口
1万口当たり基準価額(C/D)	9,806円	9,644円	9,491円	9,583円	9,381円	9,335円

(注) 当ファンドの第118期首元本額は518,764,903,881円、第118～123期中追加設定元本額は7,257,136,843円、第118～123期中一部解約元本額は46,639,360,663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118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
	2022年7月26日～ 2022年8月23日	2022年8月24日～ 2022年9月26日	2022年9月27日～ 2022年10月24日	2022年10月25日～ 2022年11月24日	2022年11月25日～ 2022年12月23日	2022年12月24日～ 2023年1月23日
	円	円	円	円	円	円
(A) 配当等収益	△ 528,541	△ 1,425,362	△ 2,528,465	△ 4,625,490	△ 5,032,717	△ 2,134,735
受取利息	25,962	—	—	—	—	131,294
支払利息	△ 554,503	△ 1,425,362	△ 2,528,465	△ 4,625,490	△ 5,032,717	△ 2,266,029
(B) 有価証券売買損益	301,901,663	△ 6,268,422,437	△ 5,824,194,527	6,425,344,595	△ 8,029,184,142	△ 894,544,889
売買益	665,206,372	31,147,365	633,209,172	6,524,371,463	48,132,061	727,912,445
売買損	△ 363,304,709	△ 6,299,569,802	△ 6,457,403,699	△ 99,026,868	△ 8,077,316,203	△ 1,622,457,334
(C) 信託報酬等	△ 373,821,838	△ 430,231,292	△ 345,085,572	△ 374,379,157	△ 343,735,258	△ 355,141,305
(D) 当期繰損益金(A+B+C)	△ 72,448,716	△ 6,700,079,091	△ 6,171,808,564	6,046,339,948	△ 8,377,952,117	△ 1,251,820,929
(E) 前期繰越損益金	△42,544,668,424	△42,292,052,429	△48,496,896,833	△54,224,453,945	△47,656,567,807	△55,436,547,551
(F) 追加信託差損益金	34,164,316,321	32,401,867,730	30,616,974,018	29,052,960,178	27,317,798,034	25,770,636,303
(配当等相当額)	(52,678,291,131)	(50,848,138,369)	(48,932,515,195)	(47,217,838,410)	(45,374,399,774)	(43,642,292,873)
(売買損益相当額)	(△18,513,974,810)	(△18,446,270,639)	(△18,315,541,177)	(△18,164,878,232)	(△18,056,601,740)	(△17,871,656,570)
(G) 計(D+E+F)	△ 8,452,800,819	△16,590,263,790	△24,051,731,379	△19,125,153,819	△28,716,721,890	△30,917,732,177
(H) 収益分配金	△ 1,541,783,004	△ 1,525,289,560	△ 1,505,342,442	△ 1,482,872,151	△ 1,463,153,802	△ 958,765,360
次期繰越損益金(G+H)	△ 9,994,583,823	△18,115,553,350	△25,557,073,821	△20,608,025,970	△30,179,875,692	△31,876,497,537
追加信託差損益金	32,879,497,151	31,130,793,096	29,613,412,390	27,817,233,385	26,342,362,166	24,811,870,943
(配当等相当額)	(51,393,836,712)	(49,578,013,395)	(47,930,219,434)	(45,982,376,015)	(44,399,294,251)	(42,684,008,663)
(売買損益相当額)	(△18,514,339,561)	(△18,447,220,299)	(△18,316,807,044)	(△18,165,142,630)	(△18,056,932,085)	(△17,872,137,720)
分配準備積立金	1,422,910,246	1,335,320,777	1,384,057,830	1,348,847,669	839,718,432	859,247,689
繰越損益金	△44,296,991,220	△50,581,667,223	△56,554,544,041	△49,774,107,024	△57,361,956,290	△57,547,616,169

(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118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
	2022年7月26日～ 2022年8月23日	2022年8月24日～ 2022年9月26日	2022年9月27日～ 2022年10月24日	2022年10月25日～ 2022年11月24日	2022年11月25日～ 2022年12月23日	2022年12月24日～ 2023年1月23日
a. 配当等収益(費用控除後)	0円	185,941,892円	570,839,287円	235,668,238円	0円	35,658,736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	52,678,655,882円	50,849,088,029円	48,933,781,062円	47,218,102,808円	45,374,730,119円	43,642,774,023円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	1,679,874,080円	1,403,593,811円	1,314,999,357円	1,360,324,789円	1,327,436,366円	823,588,953円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	54,358,529,962円	52,438,623,732円	50,819,619,706円	48,814,095,835円	46,702,166,485円	44,502,021,712円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	1,057円	1,031円	1,012円	987円	957円	928円
g. 分配金	1,541,783,004円	1,525,289,560円	1,505,342,442円	1,482,872,151円	1,463,153,802円	958,765,360円
h. 分配金(1万口当たり)	30円	30円	30円	30円	30円	20円

○分配金のお知らせ

	第118期	第119期	第120期	第121期	第122期	第123期
1 万口当たり分配金（税込み）	30円	30円	30円	30円	30円	20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

(2023年1月23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(414,531,648千円)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123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
国債証券	千円	千円	%	%	%	%	%
	22,600,000	23,246,001	4.8	—	4.8	—	—
	(1,000,000)	(1,063,643)	(0.2)	(—)	(0.2)	(—)	(—)
地方債証券	128,276,991	125,284,117	25.8	—	25.6	0.1	0.1
	(128,276,991)	(125,284,117)	(25.8)	(—)	(25.6)	(0.1)	(0.1)
	特殊債券 (除く金融債)	18,900,000	17,958,840	3.7	—	3.7	—
	(18,900,000)	(17,958,840)	(3.7)	(—)	(3.7)	(—)	(—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	323,596,000	315,218,758	64.8	—	44.0	14.6	6.2
	(323,596,000)	(315,218,758)	(64.8)	(—)	(44.0)	(14.6)	(6.2)
	合 計	493,372,991	481,707,717	99.1	—	78.1	14.7
	(471,772,991)	(459,525,359)	(94.5)	(—)	(73.5)	(14.7)	(6.3)

(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123期末				銘 柄	第123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22回利付国債 (30年)	2.5	500,000	605,825	2036/3/20	第39回利付国債 (30年)	1.9	500,000	554,635	2043/6/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	500,000	606,190	2036/6/20	第156回利付国債 (20年)	0.4	700,000	665,098	2036/3/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	500,000	606,500	2036/9/20	第157回利付国債 (20年)	0.2	700,000	644,861	2036/6/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	500,000	593,840	2036/12/20	第158回利付国債 (20年)	0.5	700,000	668,794	2036/9/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	500,000	600,165	2037/3/20	第159回利付国債 (20年)	0.6	700,000	675,717	2036/12/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	500,000	607,110	2037/9/20	第160回利付国債 (20年)	0.7	700,000	682,423	2037/3/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	500,000	607,065	2038/3/20	第161回利付国債 (20年)	0.6	700,000	670,656	2037/6/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	500,000	599,620	2038/9/20	第162回利付国債 (20年)	0.6	700,000	668,052	2037/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	500,000	591,615	2039/3/20	第163回利付国債 (20年)	0.6	700,000	665,406	2037/12/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	500,000	582,745	2039/9/20	第164回利付国債 (20年)	0.5	700,000	653,086	2038/3/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	500,000	589,120	2040/3/20	第165回利付国債 (20年)	0.5	700,000	650,244	2038/6/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	500,000	564,855	2040/9/20	第166回利付国債 (20年)	0.7	700,000	667,506	2038/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	500,000	580,575	2041/3/20	第167回利付国債 (20年)	0.5	700,000	644,455	2038/12/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	500,000	563,975	2041/9/20	第168回利付国債 (20年)	0.4	700,000	631,064	2039/3/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	500,000	564,045	2042/3/20	第169回利付国債 (20年)	0.3	700,000	617,463	2039/6/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	500,000	555,660	2042/9/20	第170回利付国債 (20年)	0.3	700,000	613,830	2039/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	500,000	546,020	2043/3/20	第171回利付国債 (20年)	0.3	700,000	610,603	2039/12/20

銘 柄	第123期末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第172回利付国債 (20年)	0.4	700,000	618,149	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	700,000	615,391	2040/6/20
第27回利付国債 (物価連動・10年)	0.005	1,000,000	1,063,643	2032/3/10
小 計		22,600,000	23,246,001	
地方債証券				
第6回東京都公募公債 (30年)	2.58	100,000	120,268	2037/9/18
第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	100,000	119,233	2038/9/17
第27回東京都公募公債 (20年)	1.68	300,000	328,110	2032/12/20
第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	108,279	2033/3/18
第30回東京都公募公債 (20年)	1.508	400,000	430,964	2034/6/20
第31回東京都公募公債 (20年)	1.238	400,000	418,328	2034/9/20
第32回東京都公募公債 (20年)	1.293	600,000	628,860	2035/6/20
第33回東京都公募公債 (20年)	0.18	700,000	631,505	2036/6/20
第34回東京都公募公債 (20年)	0.668	500,000	475,240	2037/6/19
第35回東京都公募公債 (20年)	0.525	700,000	641,060	2038/6/18
第37回東京都公募公債 (20年)	0.444	800,000	695,472	2040/6/20
平成25年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.635	400,000	436,220	2033/12/27
平成26年度第4回北海道公募公債 (20年)	1.569	200,000	216,100	2034/6/27
平成26年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.303	200,000	209,834	2034/12/26
平成27年度第4回北海道公募公債 (20年)	1.357	600,000	632,148	2035/6/29
平成27年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.156	200,000	205,588	2035/12/25
平成28年度第3回北海道公募公債 (20年)	0.363	700,000	646,114	2036/6/30
平成29年度第11回北海道公募公債 (20年)	0.635	200,000	187,504	2037/12/25
平成30年度第4回北海道公募公債 (20年)	0.569	600,000	552,132	2038/6/25
令和元年度第9回北海道公募公債 (20年)	0.654	500,000	464,055	2038/9/24
令和元年度第4回北海道公募公債 (20年)	0.323	700,000	607,117	2039/6/24
令和元年度第9回北海道公募公債 (20年)	0.2	200,000	168,754	2039/9/22
第4回2号宮城県公募公債 (20年)	0.244	412,500	397,559	2039/2/18
第5回1号宮城県公募公債 (20年)	0.17	425,000	406,329	2039/8/19
第5回2号宮城県公募公債 (20年)	0.188	340,000	325,315	2039/12/20
第5回3号宮城県公募公債 (20年)	0.158	350,000	333,739	2040/2/20
第22回神奈川県公募公債 (20年)	1.802	200,000	221,004	2032/12/20
第23回神奈川県公募公債 (20年)	1.804	100,000	110,763	2033/6/20
第25回神奈川県公募公債 (20年)	1.578	400,000	434,308	2033/12/20
第26回神奈川県公募公債 (20年)	1.477	600,000	644,166	2034/6/20
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	600,000	638,034	2034/9/20
第28回神奈川県公募公債 (20年)	0.941	300,000	303,348	2034/12/20
第29回神奈川県公募公債 (20年)	1.289	600,000	628,596	2035/6/20
第31回神奈川県公募公債 (20年)	1.002	200,000	201,926	2035/12/20
第32回神奈川県公募公債 (20年)	0.18	200,000	180,430	2036/6/20
第33回神奈川県公募公債 (20年)	0.64	500,000	476,870	2036/12/19
第34回神奈川県公募公債 (20年)	0.654	100,000	94,873	2037/6/19
第36回神奈川県公募公債 (20年)	0.625	100,000	93,751	2037/12/18
第37回神奈川県公募公債 (20年)	0.53	200,000	183,290	2038/6/18
第40回神奈川県公募公債 (20年)	0.2	800,000	680,672	2039/6/20
第42回神奈川県公募公債 (20年)	0.34	500,000	433,160	2039/9/20
第10回大阪府公募公債 (20年)	1.72	530,000	587,918	2032/9/24
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	500,000	548,585	2033/9/27
第12回大阪府公募公債 (20年)	1.453	540,000	576,514	2034/9/26
第14回大阪府公募公債 (20年)	0.54	300,000	282,555	2036/9/29
第15回大阪府公募公債 (20年)	0.721	600,000	575,286	2037/3/30
第17回大阪府公募公債 (20年)	0.668	700,000	651,371	2038/9/27
平成26年度第5回京都府公募公債 (20年)	1.455	600,000	642,438	2034/8/10
平成28年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.327	600,000	550,866	2036/8/15
平成29年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.63	100,000	94,289	2037/8/14

銘 柄	第123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	
平成30年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.658	600,000	559,374	2038/8/13
令和元年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.2	400,000	339,012	2039/8/19
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	109,953	2032/11/19
第19回兵庫県公募公債 (20年)	1.57	100,000	108,476	2033/12/9
第20回兵庫県公募公債 (20年)	1.53	200,000	216,024	2034/3/10
第21回兵庫県公募公債 (20年)	1.54	300,000	324,168	2034/5/9
第22回兵庫県公募公債 (20年)	1.4	500,000	532,030	2034/9/8
第24回兵庫県公募公債 (20年)	1.23	200,000	208,500	2035/3/23
第26回兵庫県公募公債 (20年)	0.665	300,000	290,025	2036/3/7
第28回兵庫県公募公債 (20年)	0.273	700,000	639,926	2036/6/20
第30回兵庫県公募公債 (20年)	0.607	300,000	284,748	2036/12/19
第32回兵庫県公募公債 (20年)	0.621	400,000	378,492	2037/5/1
第35回兵庫県公募公債 (20年)	0.578	600,000	554,514	2038/5/28
第37回兵庫県公募公債 (20年)	0.472	500,000	448,550	2039/2/18
第38回兵庫県公募公債 (20年)	0.352	300,000	262,098	2039/6/20
第2回静岡県公募公債 (30年)	2.54	300,000	358,902	2038/9/17
第14回静岡県公募公債 (20年)	1.736	500,000	553,555	2032/6/18
第15回静岡県公募公債 (20年)	1.701	450,000	497,151	2032/10/15
第18回静岡県公募公債 (20年)	1.473	600,000	643,710	2034/7/10
第19回静岡県公募公債 (20年)	1.253	300,000	312,822	2035/7/27
第22回静岡県公募公債 (20年)	0.443	200,000	186,294	2036/9/19
第23回静岡県公募公債 (20年)	0.626	100,000	94,466	2037/6/19
第24回静岡県公募公債 (20年)	0.63	200,000	188,276	2037/9/18
第25回静岡県公募公債 (20年)	0.53	600,000	549,870	2038/6/18
第26回静岡県公募公債 (20年)	0.711	600,000	562,890	2038/9/17
第28回静岡県公募公債 (20年)	0.31	700,000	603,568	2039/9/20
平成24年度第4回愛知県公募公債 (20年)	1.687	200,000	220,260	2032/6/11
平成24年度第17回愛知県公募公債 (20年)	1.829	400,000	442,540	2033/2/8
平成25年度第3回愛知県公募公債 (20年)	1.509	200,000	215,566	2033/5/13
平成25年度第11回愛知県公募公債 (20年)	1.77	100,000	110,666	2033/9/13
平成26年度第4回愛知県公募公債 (20年)	1.542	100,000	108,088	2034/5/15
平成26年度第13回愛知県公募公債 (20年)	1.363	600,000	635,160	2034/11/14
平成27年度第3回愛知県公募公債 (20年)	1.115	700,000	719,537	2035/5/8
平成27年度第14回愛知県公募公債 (20年)	1.129	200,000	205,170	2035/11/19
平成28年度第2回愛知県公募公債 (20年)	0.387	100,000	92,974	2036/5/12
平成28年度第12回愛知県公募公債 (20年)	0.429	300,000	278,217	2036/11/18
平成29年度第12回愛知県公募公債 (20年)	0.606	400,000	374,624	2037/11/20
平成30年度第2回愛知県公募公債 (20年)	0.54	100,000	91,968	2038/4/30
平成30年度第12回愛知県公募公債 (20年)	0.706	300,000	280,686	2038/11/15
令和元年度第5回愛知県公募公債 (20年)	0.288	400,000	345,092	2039/7/12
平成24年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.7	600,000	665,394	2032/9/14
平成25年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.75	300,000	331,404	2033/9/13
平成26年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.41	600,000	639,096	2034/9/12
平成27年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.212	500,000	518,080	2035/9/25
平成28年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.414	200,000	185,472	2036/9/26
平成29年度第2回広島県公募公債 (20年)	0.597	700,000	656,012	2037/9/25
平成30年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.568	700,000	646,135	2038/5/17
平成30年度第2回広島県公募公債 (20年)	0.668	600,000	559,128	2038/9/17
平成31年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.419	700,000	602,662	2039/4/19
令和元年度第2回広島県公募公債 (20年)	0.2	300,000	253,662	2039/9/20
令和2年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.315	800,000	681,496	2040/4/17
第8回埼玉県公募公債 (15年)	0.367	400,000	371,300	2036/4/18
第12回埼玉県公募公債 (20年)	1.73	100,000	110,344	2032/5/24
第13回埼玉県公募公債 (20年)	1.599	600,000	651,960	2033/5/20
第14回埼玉県公募公債 (20年)	1.546	600,000	648,702	2034/5/8

銘	柄	第123期末					銘	柄	第123期末							
		利率	額面金額	評 価 額	千円	償還年月日			利率	額面金額	評 価 額	千円	償還年月日			
地方債証券																
第15回埼玉県公債 (20年)	1.166	400,000	414,324	2035/2/16	0.583	700,000	654,829	2037/9/18								
第18回埼玉県公債 (20年)	0.323	500,000	460,795	2036/5/20	0.668	700,000	652,316	2038/9/17								
第20回埼玉県公債 (20年)	0.626	300,000	283,842	2037/5/15	0.2	400,000	338,216	2039/9/20								
第21回埼玉県公債 (20年)	0.625	500,000	469,085	2037/12/11	0.459	800,000	694,472	2040/9/21								
第22回埼玉県公債 (20年)	0.568	600,000	553,794	2038/5/21	0.421	480,000	467,966	2038/10/22								
第23回埼玉県公債 (20年)	0.626	300,000	276,831	2038/12/17	0.14	425,000	405,450	2039/10/24								
第24回埼玉県公債 (20年)	0.431	100,000	88,665	2039/5/17	0.15	255,000	243,634	2039/9/20								
第25回埼玉県公債 (20年)	0.32	450,000	386,496	2039/12/20	1.721	200,000	219,514	2032/12/21								
平成30年度第2回福岡県公債 (15年)	0.542	600,000	589,026	2033/10/17	1.262	700,000	732,473	2035/2/27								
令和元年度第1回福岡県公債 (15年)	0.254	600,000	564,870	2034/6/14	1.138	600,000	618,558	2035/4/24								
令和元年度第2回福岡県公債 (15年)	0.269	400,000	374,272	2034/12/13	0.97	300,000	301,401	2036/1/29								
平成24年度第1回福岡県公債 (20年)	1.734	100,000	110,359	2032/5/21	0.347	700,000	646,989	2036/5/30								
平成25年度第1回福岡県公債 (20年)	1.599	300,000	325,980	2033/5/20	0.655	200,000	190,220	2037/4/21								
平成25年度第2回福岡県公債 (20年)	1.787	100,000	110,658	2033/8/12	0.635	500,000	470,550	2037/10/23								
平成26年度第1回福岡県公債 (20年)	1.542	250,000	270,130	2034/5/26	0.544	200,000	184,188	2038/4/20								
平成26年度第2回福岡県公債 (20年)	1.451	300,000	320,715	2034/9/22	2.53	500,000	595,300	2035/3/20								
平成26年度第4回福岡県公債 (20年)	1.249	200,000	208,986	2035/2/23	2.5	100,000	119,172	2037/9/18								
平成27年度第1回福岡県公債 (20年)	1.285	500,000	523,740	2035/5/22	2.45	100,000	117,820	2039/12/20								
平成28年度第1回福岡県公債 (20年)	0.308	500,000	459,890	2036/5/23	1.712	300,000	329,931	2033/9/9								
平成28年度第4回福岡県公債 (20年)	0.744	600,000	579,270	2037/2/13	1.52	200,000	215,582	2034/6/9								
平成29年度第1回福岡県公債 (20年)	0.626	100,000	94,602	2037/5/29	1.203	500,000	518,920	2035/5/28								
令和元年度第1回福岡県公債 (20年)	0.359	600,000	519,636	2039/11/25	0.323	300,000	276,732	2036/4/28								
第13回千葉県公債 (20年)	1.701	550,000	607,629	2032/10/15	0.645	600,000	569,046	2037/5/25								
第14回千葉県公債 (20年)	1.137	700,000	728,973	2033/4/15	0.568	700,000	646,128	2038/5/18								
第15回千葉県公債 (20年)	1.604	100,000	108,924	2033/10/14	0.431	700,000	620,620	2039/5/20								
第16回千葉県公債 (20年)	1.555	600,000	649,662	2034/4/14	1.701	100,000	109,962	2032/11/19								
第17回千葉県公債 (20年)	1.403	600,000	638,184	2034/10/13	1.359	300,000	317,313	2034/11/24								
第18回千葉県公債 (20年)	1.138	600,000	618,846	2035/4/13	0.487	500,000	467,135	2036/11/28								
第23回千葉県公債 (20年)	0.63	300,000	282,162	2037/10/15	0.611	600,000	561,918	2037/11/27								
第24回千葉県公債 (20年)	0.559	200,000	184,590	2038/4/15	0.683	700,000	652,274	2038/11/26								
第25回千葉県公債 (20年)	0.701	700,000	654,703	2038/10/15	0.355	400,000	346,512	2039/11/18								
第27回千葉県公債 (20年)	0.251	800,000	681,448	2039/10/14	1.913	150,000	166,465	2031/9/12								
平成29年度第1回新潟県公債	0.616	700,000	658,791	2037/8/14	1.635	500,000	550,495	2032/8/13								
平成30年度第1回新潟県公債	0.653	700,000	651,644	2038/8/20	1.52	100,000	107,930	2034/2/17								
令和元年度第1回新潟県公債	0.2	800,000	678,024	2039/8/19	1.482	300,000	322,152	2034/7/14								
令和2年度第1回新潟県公債	0.435	800,000	692,224	2040/8/17	1.007	100,000	100,896	2036/1/25								
令和2年度第2回長野県公債	0.14	200,000	194,088	2030/10/16	0.645	400,000	381,164	2037/1/23								
令和3年度第1回長野県公債	0.19	400,000	387,908	2031/4/16	0.597	200,000	187,466	2037/9/18								
令和元年度第2回茨城県公債	0.19	500,000	480,165	2039/7/29	0.668	300,000	279,564	2038/9/17								
令和2年度第2回茨城県公債	0.356	300,000	293,943	2040/7/31	0.2	400,000	338,216	2039/9/20								
第2回群馬県公債 (20年)	0.2	330,000	316,288	2039/6/17	2.63	500,000	599,415	2034/9/20								
第3回群馬県公債 (20年)	1.687	600,000	661,824	2032/6/25	2.49	500,000	593,095	2035/3/20								
第4回群馬県公債 (20年)	1.667	100,000	109,378	2033/6/17	2.54	210,000	251,311	2036/12/19								
第5回群馬県公債 (20年)	1.529	600,000	647,382	2034/6/16	1.72	400,000	442,884	2032/7/16								
第6回群馬県公債 (20年)	1.267	600,000	627,066	2035/6/11	1.776	300,000	330,345	2033/1/28								
第7回群馬県公債 (20年)	0.313	700,000	643,671	2036/6/13	1.599	300,000	325,980	2033/5/20								
第9回群馬県公債 (20年)	0.554	400,000	368,108	2038/6/11	1.586	300,000	326,076	2033/11/11								
第10回群馬県公債 (20年)	0.338	500,000	435,910	2039/6/17	1.528	200,000	215,812	2034/5/26								
第11回群馬県公債 (20年)	0.416	400,000	345,980	2040/6/12	1.376	550,000	583,154	2034/10/20								
令和元年度第1回大分県公債	0.19	582,000	558,423	2039/7/15	1.18	300,000	310,830	2035/4/20								
令和2年度第1回大分県公債	0.281	525,000	507,186	2040/7/10	0.443	100,000	92,989	2036/10/28								
平成24年度第1回堺市公債	1.732	600,000	662,352	2032/11/12	0.559	700,000	646,051	2038/4/16								
平成30年度第2回長崎県公債	0.491	470,590	461,799	2038/8/20	1.635	200,000	220,198	2032/8/13								
令和元年度第2回長崎県公債	0.18	400,000	383,204	2039/8/26	1.794	100,000	110,288	2033/2/28								
平成28年度第2回島根県公債 (20年)	0.506	100,000	93,945	2036/9/30	1.72	200,000	219,872	2033/6/14								

銘	柄	第123期末					償還年月日	銘	柄	第123期末					償還年月日
		利率	額面金額	評 価	額	額				利率	額面金額	評 価	額	額	
		%	千円		千円					%	千円		千円		
地方債証券								地方債証券							
平成25年度第10回札幌市公債公債 (20年)		1.53	300,000	324,072	2034/3/17			令和2年度第3回福井県公債公債		0.449	600,000	520,860	2040/8/3		
平成26年度第1回札幌市公債公債 (20年)		1.524	500,000	539,325	2045/5/26			令和元年度第1回徳島県公債公債		0.18	340,000	326,005	2039/7/29		
平成26年度第10回札幌市公債公債 (20年)		1.267	400,000	418,616	2035/3/20			令和2年度第1回徳島県公債公債		0.281	360,000	347,403	2040/7/31		
平成29年度第5回札幌市公債公債 (20年)		0.597	600,000	562,338	2037/9/18			令和元年度第1回岡山県公債公債		0.192	340,000	325,519	2039/12/20		
平成30年度第8回札幌市公債公債 (20年)		0.626	700,000	645,911	2038/12/20			第5回神奈川県住宅供給公社債券		0.709	600,000	556,014	2038/4/23		
令和元年度第4回札幌市公債公債 (20年)		0.15	268,440	256,537	2039/9/20			第6回神奈川県住宅供給公社債券		0.215	300,000	292,040	2029/4/23		
令和2年度第5回札幌市公債公債 (20年)		0.445	700,000	605,577	2040/10/12			第7回神奈川県住宅供給公社債券		0.534	300,000	265,461	2039/4/22		
第15回川崎市公債公債 (20年)		1.727	300,000	333,468	2032/9/17			第1回川崎市土地開発公社債券		0.02	700,000	697,865	2024/6/25		
第18回川崎市公債公債 (20年)		1.541	600,000	648,822	2034/3/17			第2回川崎市土地開発公社債券		2.39	100,000	115,944	2033/12/20		
第20回川崎市公債公債 (20年)		1.133	200,000	206,248	2035/3/20			第3回川崎市土地開発公社債券		2.59	300,000	354,012	2033/12/20		
第22回川崎市公債公債 (20年)		0.377	600,000	557,622	2036/4/22			第8回地方公共団体金融機構債券 (30年)		2.5	200,000	235,642	2035/9/21		
第23回川崎市公債公債 (20年)		0.549	300,000	283,584	2036/9/19			第21回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.812	100,000	110,505	2032/4/28		
第24回川崎市公債公債 (20年)		0.683	100,000	95,518	2037/4/17			第24回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.702	500,000	552,435	2032/9/28		
第27回川崎市公債公債 (20年)		0.559	300,000	276,879	2038/4/16			第32回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.624	100,000	108,343	2033/10/28		
第30回川崎市公債公債 (20年)		0.2	600,000	510,504	2039/6/20			第33回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.668	500,000	544,485	2033/12/28		
第33回川崎市公債公債 (20年)		0.44	600,000	520,902	2040/6/20			第35回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.569	300,000	323,841	2034/3/28		
第13回北九州市公債公債 (20年)		1.706	400,000	441,988	2032/7/16			第37回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.535	200,000	214,944	2034/6/28		
第15回北九州市公債公債 (20年)		1.667	100,000	109,378	2033/6/17			第40回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.381	600,000	633,492	2034/10/27		
第16回北九州市公債公債 (20年)		1.604	100,000	108,810	2033/10/11			第42回地方公共団体金融機構債券 (20年)		0.999	100,000	101,311	2035/1/26		
第17回北九州市公債公債 (20年)		1.529	600,000	646,080	2034/6/20			第44回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.298	300,000	312,873	2035/6/28		
第18回北九州市公債公債 (20年)		1.376	200,000	211,716	2034/10/20			第46回地方公共団体金融機構債券 (20年)		1.189	100,000	102,832	2035/9/28		
第19回北九州市公債公債 (20年)		1.312	600,000	629,076	2035/6/19			第51回地方公共団体金融機構債券 (20年)		0.377	400,000	369,560	2036/4/28		
第20回北九州市公債公債 (20年)		1.111	100,000	102,193	2035/10/26			第67回地方公共団体金融機構債券 (20年)		0.564	200,000	182,954	2038/6/28		
平成24年度第2回福岡市公債公債 (20年)		1.702	400,000	442,292	2032/7/20			第77回地方公共団体金融機構債券 (20年)		0.2	500,000	419,525	2039/9/28		
平成24年度第6回福岡市公債公債 (20年)		1.696	300,000	332,619	2032/9/17			第79回地方公共団体金融機構債券 (20年)		0.345	400,000	342,264	2039/12/28		
平成25年度第1回福岡市公債公債 (20年)		1.808	100,000	110,758	2033/7/19			第80回地方公共団体金融機構債券 (20年)		0.354	500,000	427,780	2040/1/27		
平成25年度第6回福岡市公債公債 (20年)		1.511	400,000	431,352	2034/2/17			第83回地方公共団体金融機構債券 (20年)		0.44	400,000	344,564	2040/6/28		
平成26年度第2回福岡市公債公債 (20年)		1.49	600,000	644,982	2034/6/20			第110回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券		0.763	300,000	287,322	2037/2/27		
平成26年度第6回福岡市公債公債 (20年)		1.371	200,000	212,104	2034/9/20			第12回大阪府住宅供給公社債券		0.395	300,000	298,808	2027/6/18		
平成27年度第6回福岡市公債公債 (20年)		1.121	100,000	102,448	2035/12/18			第12回大阪府住宅供給公社債券		0.34	500,000	495,670	2028/6/20		
平成28年度第6回福岡市公債公債 (20年)		0.429	700,000	648,718	2036/11/25			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	497,300	2032/2/27		
平成30年度第7回福岡市公債公債 (20年)		0.701	700,000	654,675	2038/10/19			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	383,340	2037/2/27		
平成31年度第3回福岡市公債公債 (20年)		0.419	600,000	531,972	2039/4/22			第151回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券		0.32	400,000	337,028	2040/2/28		
2019年度第5回福岡市公債公債 (20年)		0.286	300,000	258,435	2039/7/29			第121回福岡県北九州高速道路債券		2.31	400,000	447,648	2029/12/20		
2019年度第7回福岡市公債公債 (20年)		0.271	500,000	427,135	2039/10/24			第147回福岡県北九州高速道路債券		0.502	500,000	496,600	2032/3/19		
平成29年度第2回広島市公債公債		0.616	200,000	188,220	2037/8/18			第148回福岡県北九州高速道路債券		0.731	500,000	476,270	2037/3/19		
平成29年度第4回広島市公債公債		0.62	600,000	562,998	2037/11/20			第150回福岡県北九州高速道路債券		0.396	600,000	581,520	2033/3/18		
平成30年度第2回広島市公債公債		0.639	700,000	650,363	2038/8/20			第24回東京都住宅供給公社債券		0.519	500,000	462,875	2036/9/12		
平成30年度第4回広島市公債公債		0.706	700,000	654,899	2038/11/19			第26回東京都住宅供給公社債券		0.697	600,000	560,094	2037/9/11		
令和元年度第2回広島市公債公債		0.2	800,000	678,024	2039/8/19			第29回東京都住宅供給公社債券		0.749	200,000	185,106	2038/9/17		
令和元年度第4回広島市公債公債		0.355	400,000	346,244	2039/11/21			第30回東京都住宅供給公社債券		0.496	160,000	156,334	2038/9/17		
令和2年度第2回広島市公債公債		0.435	500,000	432,605	2040/8/21			第32回東京都住宅供給公社債券		0.341	300,000	254,358	2039/9/26		
平成29年度第1回仙台市公債公債		0.616	700,000	657,111	2037/10/19			第33回東京都住宅供給公社債券		0.25	255,000	242,668	2039/9/26		
平成30年度第2回仙台市公債公債		0.729	700,000	657,706	2038/10/18			第36回東京都住宅供給公社債券		0.416	400,000	375,308	2034/12/22		
令和元年度第1回仙台市公債公債		0.17	340,000	325,397	2039/8/19			第37回東京都住宅供給公社債券		0.435	200,000	186,542	2035/9/21		
令和元年度第2回仙台市公債公債		0.15	700,000	668,108	2039/10/14			小計			128,276,991	125,284,117			
平成24年度第2回福井県公債公債		1.711	100,000	109,664	2032/12/21			特殊債券(除く金融債)							
平成25年度第1回福井県公債公債		1.667	100,000	109,386	2033/6/21			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	122,605	2038/6/30		
平成26年度第1回福井県公債公債		1.482	100,000	107,389	2034/7/18			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	529,650	2034/11/30		
平成27年度第1回福井県公債公債		1.28	600,000	627,420	2035/7/17			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	524,850	2034/12/28		
平成28年度第1回福井県公債公債		0.18	700,000	630,287	2036/7/29			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	509,590	2035/1/31		
平成29年度第1回福井県公債公債		0.659	100,000	94,788	2037/7/24			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	520,740	2035/2/28		
平成30年度第1回福井県公債公債		0.535	500,000	457,600	2038/7/30			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	523,680	2035/3/30		
令和元年度第1回福井県公債公債		0.286	400,000	344,580	2039/7/29			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	618,408	2035/4/27		
令和2年度第1回福井県公債公債		0.249	538,461	518,613	2040/7/13			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	312,432	2035/5/31		

銘 柄	第123期末					銘 柄	第123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530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	631,782	2035/6/29		第491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	596,736	2027/2/25	
第72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	662,606	2036/3/31		第492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	397,184	2027/4/23	
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	458,085	2036/5/30		第496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	296,400	2027/9/24	
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	451,280	2036/7/31		第517回東北電力株式会社社債	0.31	100,000	95,863	2030/2/25	
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	464,950	2036/10/31		第536回東北電力株式会社社債	0.29	400,000	374,128	2031/9/25	
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	188,952	2036/11/28		第538回東北電力株式会社社債	0.33	700,000	656,446	2031/11/25	
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	473,485	2036/12/26		第541回東北電力株式会社社債	0.35	700,000	653,786	2032/1/23	
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	573,930	2037/1/30		第543回東北電力株式会社社債	0.34	700,000	693,189	2032/4/23	
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	679,742	2037/2/27		第544回東北電力株式会社社債	0.574	700,000	669,473	2037/4/23	
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	96,275	2037/3/31		第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	98,943	2026/11/25	
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	568,806	2037/5/29		第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	197,564	2027/11/25	
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	94,391	2037/6/30		第307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	287,202	2029/9/25	
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	564,252	2037/8/31		第309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	481,535	2030/5/24	
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	93,754	2037/9/30		第317回四国電力株式会社社債	0.6	200,000	163,860	2041/10/25	
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	564,744	2037/10/30		第320回四国電力株式会社社債	0.534	200,000	190,086	2032/4/23	
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	656,124	2037/11/30		第323回四国電力株式会社社債	0.659	800,000	781,536	2032/6/25	
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	93,072	2038/3/31		第465回九州電力株式会社社債	0.38	500,000	488,495	2028/7/25	
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	647,458	2038/5/31		第489回九州電力株式会社社債	0.44	400,000	384,748	2030/5/24	
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	92,455	2038/6/30		第502回九州電力株式会社社債	0.493	500,000	472,630	2032/2/25	
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	653,667	2038/8/31		第504回九州電力株式会社社債	0.589	700,000	669,788	2032/4/23	
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	466,090	2038/9/30		第507回九州電力株式会社社債	0.644	800,000	773,008	2032/5/25	
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	658,357	2038/10/29		第321回北海道電力株式会社社債	0.886	11,000	11,120	2024/12/25	
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	93,706	2038/11/30		第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	197,904	2027/6/25	
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	647,290	2038/12/28		第372回北海道電力株式会社社債	0.33	200,000	187,154	2031/12/25	
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	639,212	2039/1/31		第15回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.89	600,000	578,406	2030/7/24	
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	631,792	2039/2/28		第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	600,000	586,848	2029/9/19	
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	626,318	2039/3/31		第40回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.37	500,000	474,325	2035/7/13	
第211回政府保証民間都市開発債券	0.618	300,000	278,136	2038/12/27		第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	800,000	759,688	2031/4/22	
第222回政府保証民間都市開発債券	0.245	1,000,000	850,870	2040/2/28		第46回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.05	700,000	630,560	2036/4/22	
第23回政府保証民間都市開発債券	0.397	800,000	694,944	2040/6/29		第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.88	800,000	699,984	2036/8/29	
小 計		18,900,000	17,958,840			第50回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.94	800,000	765,248	2032/4/26	
普通社債券(含む投資法人債券)						第14回新関西国際空港株式会社社債	1.318	600,000	619,110	2034/12/20	
第530回中部電力株式会社社債	0.274	600,000	577,464	2029/6/25		第16回新関西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	305,190	2035/9/19	
第554回中部電力株式会社社債	0.463	100,000	94,512	2032/2/25		第18回新関西国際空港株式会社社債	0.675	500,000	457,975	2037/12/18	
第556回中部電力株式会社社債	0.544	800,000	765,016	2032/4/23		第23回新関西国際空港株式会社社債	0.512	700,000	612,920	2038/12/20	
第511回関西電力株式会社社債	0.41	600,000	593,112	2027/9/17		第97回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.536	700,000	636,398	2038/7/12	
第515回関西電力株式会社社債	0.435	600,000	590,232	2028/4/25		第108回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.439	700,000	617,673	2039/4/11	
第518回関西電力株式会社社債	0.44	300,000	294,723	2028/6/20		第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.253	400,000	340,000	2039/7/11	
第541回関西電力株式会社社債	0.37	800,000	752,208	2031/9/19		第312回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.379	700,000	597,471	2040/4/24	
第544回関西電力株式会社社債	0.34	500,000	468,270	2031/10/24		第130回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.479	500,000	432,630	2040/7/20	
第548回関西電力株式会社社債	0.574	900,000	860,031	2032/4/23		第135回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.35	500,000	464,030	2035/10/15	
第551回関西電力株式会社社債	0.664	800,000	774,368	2032/5/25		第147回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.443	200,000	169,462	2041/7/12	
第398回中国電力株式会社社債	0.425	400,000	396,680	2027/7/23		第34回日本政策投資銀行債券	2.67	200,000	204,066	2037/3/19	
第404回中国電力株式会社社債	0.355	100,000	98,116	2028/4/25		第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	119,807	2035/9/20	
第416回中国電力株式会社社債	0.355	300,000	290,493	2029/5/25		第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	200,000	237,242	2035/12/20	
第434回中国電力株式会社社債	0.463	500,000	472,560	2032/2/25		第430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	630,623	2038/9/17	
第436回中国電力株式会社社債	0.534	300,000	286,629	2032/4/23		第93回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	500,000	554,065	2032/3/19	
第443回中国電力株式会社社債	0.59	800,000	792,472	2028/8/25		第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	500,000	556,365	2032/9/17	
第311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	202,152	2027/9/24		第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.55	500,000	537,845	2034/3/17	
第314回北陸電力株式会社社債	0.36	100,000	99,862	2026/2/25		第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.133	100,000	102,506	2035/3/20	
第318回北陸電力株式会社社債	0.26	450,000	445,513	2026/12/25		第191回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.661	200,000	187,112	2037/12/18	
第321回北陸電力株式会社社債	0.365	300,000	297,639	2027/4/23		第194回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.64	500,000	466,155	2037/12/18	
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	495,700	2027/6/25		第210回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.677	700,000	648,039	2038/9/17	
第342回北陸電力株式会社社債	0.3	100,000	94,247	2031/4/25		第9回道路債券	2.9	100,000	120,324	2032/5/20	
第349回北陸電力株式会社社債	0.544	600,000	574,482	2032/4/23		第21回道路債券	2.75	100,000	119,171	2033/6/20	

銘 柄	第123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28回道路債券	2.83	500,000	600,835	2033/12/20
第33回道路債券	2.91	100,000	121,451	2034/6/20
第43回道路債券	2.66	200,000	238,326	2034/12/20
第124回都市再生債券	0.273	300,000	272,172	2036/6/20
第128回都市再生債券	0.39	500,000	459,010	2036/9/19
第131回都市再生債券	0.487	500,000	464,080	2036/11/25
第133回都市再生債券	0.767	200,000	192,236	2037/2/20
第141回都市再生債券	0.63	100,000	92,802	2038/2/19
第145回都市再生債券	0.584	300,000	275,079	2038/6/18
第150回都市再生債券	0.716	500,000	464,760	2038/11/19
第156回都市再生債券	0.343	400,000	345,968	2039/6/17
第157回都市再生債券	0.2	400,000	335,304	2039/9/16
第160回都市再生債券	0.335	600,000	512,016	2039/12/19
第167回都市再生債券	0.43	300,000	255,777	2040/12/20
第6回中部国際空港株式会社債	0.206	500,000	490,270	2029/2/22
第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	110,411	2031/11/18
第94回一般担保住宅金融支援機構債券	1.882	500,000	552,455	2032/2/13
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	110,861	2032/3/12
第106回一般担保住宅金融支援機構債券	1.794	100,000	110,932	2032/6/18
第109回一般担保住宅金融支援機構債券	1.787	200,000	222,248	2032/7/16
第115回一般担保住宅金融支援機構債券	1.811	500,000	558,045	2032/9/14
第118回一般担保住宅金融支援機構債券	1.814	100,000	111,364	2032/10/15
第120回一般担保住宅金融支援機構債券	1.836	400,000	444,180	2032/11/12
第125回一般担保住宅金融支援機構債券	1.898	100,000	110,821	2033/1/25
第127回一般担保住宅金融支援機構債券	1.923	300,000	332,733	2033/2/18
第130回一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	219,466	2032/12/20
第159回一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	300,000	306,690	2035/5/18
第166回一般担保住宅金融支援機構債券	1.221	100,000	103,174	2035/8/20
第220回一般担保住宅金融支援機構債券	0.616	200,000	186,334	2037/10/20
第239回一般担保住宅金融支援機構債券	0.393	300,000	288,261	2033/6/20
第255回一般担保住宅金融支援機構債券	0.548	200,000	180,458	2039/1/20
第257回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	300,000	285,444	2034/2/20
第279回一般担保住宅金融支援機構債券	0.285	800,000	745,832	2034/12/20
第283回一般担保住宅金融支援機構債券	0.274	400,000	371,060	2035/2/20
第308回一般担保住宅金融支援機構債券	0.306	400,000	368,020	2035/12/20
第315回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	500,000	460,615	2036/4/18
第21回成田国際空港株式会社債	0.427	500,000	452,860	2036/8/22
第23回成田国際空港株式会社債	0.677	700,000	652,225	2036/12/16
第25回成田国際空港株式会社債	0.671	300,000	274,638	2037/12/18
第27回成田国際空港株式会社債	0.657	600,000	545,538	2038/3/12
第30回成田国際空港株式会社債	0.77	700,000	640,752	2038/10/22
第35回成田国際空港株式会社債	0.27	100,000	82,551	2039/9/16
第36回成田国際空港株式会社債	0.2	400,000	389,452	2030/1/29
第37回成田国際空港株式会社債	0.424	300,000	252,132	2040/1/27
第39回成田国際空港株式会社債	0.409	600,000	550,206	2035/10/26
第40回成田国際空港株式会社債	0.529	500,000	440,495	2038/10/28
第41回成田国際空港株式会社債	0.575	600,000	510,804	2040/10/26
第15回国際協力機構債券	1.724	300,000	332,478	2032/9/17
第19回国際協力機構債券	1.725	100,000	109,260	2033/6/20
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	109,299	2033/9/20
第25回国際協力機構債券	1.52	600,000	643,842	2034/6/20
第27回国際協力機構債券	1.451	400,000	425,580	2034/9/20
第33回国際協力機構債券	1.13	100,000	101,851	2035/12/20
第36回国際協力機構債券	0.313	100,000	91,245	2036/6/20
第39回国際協力機構債券	0.744	400,000	383,120	2037/2/20

銘 柄	第123期末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第43回国際協力機構債券	0.625	700,000	651,294	2037/12/18
第45回国際協力機構債券	0.559	600,000	547,866	2038/6/18
第49回国際協力機構債券	0.333	300,000	258,885	2039/6/20
第54回国際協力機構債券	0.445	600,000	516,564	2040/6/26
第56回国際協力機構債券	0.459	700,000	602,147	2040/9/20
第58回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.81	600,000	660,216	2038/8/19
第63回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.56	400,000	430,788	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	531,520	2034/8/4
第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.157	200,000	205,628	2035/2/26
第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.221	200,000	206,344	2035/8/17
第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.739	500,000	478,570	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	492,100	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	466,715	2037/8/25
第113回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.63	200,000	185,588	2038/2/26
第115回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.395	100,000	96,172	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	369,948	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	483,825	2033/11/28
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	600,000	564,720	2034/5/10
第3回I N P E X株式会社社無担保社債	0.25	600,000	573,186	2031/10/15
第22回株式会社大林組無担保社債	0.385	600,000	593,430	2028/9/13
第23回清水建設株式会社社無担保社債	0.25	800,000	800,176	2024/8/2
第24回清水建設株式会社社無担保社債	0.365	200,000	198,326	2027/11/30
第25回清水建設株式会社社無担保社債	0.27	200,000	194,492	2029/9/3
第1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	695,268	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	585,306	2029/7/19
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	488,325	2030/7/12
第44回鹿島建設株式会社社無担保社債	0.3	300,000	299,244	2026/7/22
第8回西松建設株式会社社無担保社債	0.18	800,000	797,944	2024/9/20
第10回西松建設株式会社社無担保社債	0.33	500,000	499,265	2025/7/18
第26回前田建設工業株式会社社無担保社債	0.15	300,000	298,998	2024/9/12
第3回住友林業株式会社社無担保社債	0.33	600,000	599,130	2026/6/17
第5回住友林業株式会社社無担保社債	0.35	400,000	395,104	2028/3/7
第8回住友林業株式会社社無担保社債	0.38	500,000	491,185	2029/3/6
第9回住友林業株式会社社無担保社債	0.28	700,000	678,888	2029/12/6
第19回大和ハウス工業株式会社社無担保社債	0.285	100,000	99,328	2027/6/1
第21回積水ハウス株式会社社無担保社債	0.2	800,000	796,608	2026/7/17
第4回協和エクシオ株式会社社無担保社債	0.12	500,000	498,120	2024/10/25
第5回協和エクシオ株式会社社無担保社債	0.19	200,000	197,844	2026/10/23
第1回高砂熱学工業株式会社社無担保社債	0.37	200,000	200,086	2024/4/19
第1回株式会社日清製粉グループ本社社無担保社債	0.2	600,000	582,486	2029/7/13
第13回森永乳業株式会社社無担保社債	0.884	500,000	504,200	2024/5/8
第15回森永乳業株式会社社無担保社債	0.37	700,000	695,625	2027/7/23
第16回森永乳業株式会社社無担保社債	0.395	200,000	197,380	2028/9/14
第17回森永乳業株式会社社無担保社債	0.24	400,000	386,624	2029/9/6
第7回明治ホールディングス株式会社社無担保社債	0.22	300,000	300,021	2024/9/13
第1回雪印メグミルク株式会社社無担保社債	0.45	800,000	788,176	2028/12/25
第11回日本ハム株式会社社無担保社債	0.25	700,000	698,537	2026/2/20
第12回日本ハム株式会社社無担保社債	0.36	600,000	591,030	2029/2/20
第3回サッポロホールディングス株式会社社無担保社債	0.2	600,000	593,232	2026/9/4
第3回サッポロホールディングス株式会社社無担保社債	0.3	500,000	481,390	2029/9/5
第1回アサヒグループホールディングス株式会社社無担保社債	0.33	700,000	696,619	2027/6/11
第13回キリンホールディングス株式会社社無担保社債	0.23	800,000	774,704	2029/9/5
第17回キリンホールディングス株式会社社無担保社債	0.37	100,000	97,305	2030/6/4
第15回宝ホールディングス株式会社社無担保社債	0.22	400,000	400,252	2024/4/25
第16回宝ホールディングス株式会社社無担保社債	0.315	200,000	199,020	2027/4/23

銘柄	利率	第123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	797,128	2026/6/2	
第10回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.519	800,000	791,520	2032/6/8	
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	581,334	2029/9/19	
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	600,000	599,130	2024/2/23	
第12回日清オリオグループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	296,643	2027/12/3	
第2回株式会社J-オイルミルズ無担保社債	0.37	600,000	596,118	2027/5/28	
第35回双日株式会社無担保社債	0.605	300,000	298,347	2028/3/8	
第24回味の素株式会社無担保社債	0.19	500,000	500,080	2024/3/8	
第25回味の素株式会社無担保社債	0.355	700,000	698,992	2027/3/9	
第3回キューピー株式会社無担保社債	0.23	700,000	698,544	2026/2/13	
第25回株式会社ニチレイ無担保社債	0.24	300,000	296,928	2027/8/31	
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	300,000	302,292	2024/4/24	
第8回ヒューリック株式会社無担保社債	0.3	700,000	695,800	2026/6/25	
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	694,225	2027/8/4	
第43回東洋紡株式会社無担保社債	0.25	400,000	391,944	2028/12/7	
第4回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,622	2024/12/20	
第5回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.33	300,000	297,654	2027/9/17	
第14回森ビル株式会社無担保社債	0.861	300,000	302,535	2024/8/14	
第21回森ビル株式会社無担保社債	0.44	600,000	597,786	2027/2/16	
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	496,430	2027/7/30	
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	700,000	697,704	2027/7/16	
第31回東レ株式会社無担保社債	0.25	600,000	600,216	2024/7/19	
第33回東レ株式会社無担保社債	0.38	400,000	396,216	2028/7/18	
第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	592,002	2028/4/25	
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	498,910	2024/9/6	
第12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	486,815	2029/9/6	
第15回旭化成株式会社無担保社債	0.28	500,000	486,110	2030/6/19	
第34回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	198,766	2028/1/26	
第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	297,117	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	681,331	2030/7/17	
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	599,766	2024/3/13	
第25回レンゴー株式会社無担保社債	0.415	200,000	197,276	2028/12/13	
第27回レンゴー株式会社無担保社債	0.3	800,000	777,880	2029/12/12	
第49回住友化学株式会社無担保社債	0.944	100,000	100,848	2024/4/25	
第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	694,239	2027/9/13	
第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	98,576	2028/4/17	
第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	392,360	2029/4/16	
第22回デンカ株式会社無担保社債	0.23	500,000	494,735	2026/12/4	
第3回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	395,124	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	592,350	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	388,700	2030/5/31	
第8回株式会社カネカ無担保社債	0.24	200,000	192,930	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	387,600	2030/9/3	
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	300,000	299,886	2024/7/24	
第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,288	2027/7/23	
第50回三井化学株式会社無担保社債	0.27	500,000	484,280	2029/12/5	
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	0.42	600,000	592,314	2028/12/19	
第13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	967,890	2030/2/28	
第17回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.5	200,000	195,100	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	699,223	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	485,340	2029/9/13	
第4回日本化薬株式会社無担保社債	0.13	400,000	397,532	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	597,234	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	594,378	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	486,065	2029/9/27	

銘柄	利率	第123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3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	693,903	2028/10/25	
第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	1,000,000	945,970	2031/10/14	
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	500,000	499,465	2024/5/31	
第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	593,952	2027/6/2	
第7回テルモ株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,690	2026/4/17	
第9回テルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	992,170	2027/4/26	
第3回みらいホールディングス株式会社無担保社債	0.15	400,000	398,080	2024/10/25	
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	299,460	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	984,670	2029/3/7	
第37回D I C株式会社無担保社債	1.0	100,000	101,629	2025/9/18	
第14回株式会社オリエントランド無担保社債	0.23	500,000	499,130	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	687,420	2029/1/25	
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	297,969	2027/3/3	
第10回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	498,835	2024/7/26	
第4回荒川化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	498,050	2024/12/19	
第9回日出光興産株式会社無担保社債	0.18	400,000	396,648	2026/9/18	
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	100,760	2024/6/4	
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	697,620	2026/7/28	
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	695,450	2027/8/3	
第4回ENEOSホールディングス株式会社無担保社債	0.834	400,000	395,872	2032/6/15	
第16回横浜ゴム株式会社無担保社債	0.58	800,000	789,912	2032/6/4	
第10回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.2	500,000	499,910	2024/4/19	
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	800,000	795,088	2027/4/21	
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	200,000	199,626	2026/4/17	
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	984,670	2029/4/19	
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	597,954	2027/5/28	
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.37	800,000	788,504	2028/6/14	
第10回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.11	400,000	398,908	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	485,610	2029/6/20	
第1回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.28	400,000	398,804	2026/9/18	
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.22	500,000	500,295	2024/5/20	
第4回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,566	2027/5/20	
第5回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.23	400,000	400,256	2024/12/20	
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	682,738	2029/6/20	
第2回ジェイティーホールディングス株式会社無担保社債	0.703	600,000	604,674	2024/9/19	
第28回ジェイティーホールディングス株式会社無担保社債	0.26	500,000	498,705	2026/5/27	
第29回ジェイティーホールディングス株式会社無担保社債	0.365	600,000	588,498	2029/5/25	
第32回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.25	800,000	773,728	2029/12/13	
第26回住友電気工業株式会社無担保社債	0.3	700,000	694,722	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	596,496	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	580,530	2029/10/25	
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	599,634	2024/3/8	
第29回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.08	500,000	497,045	2026/6/19	
第5回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.13	500,000	498,915	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	388,744	2030/1/24	
第15回株式会社クボタ無担保社債	0.514	600,000	594,432	2032/6/2	
第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,444	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	594,774	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	580,500	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	289,233	2030/9/18	
第6回株式会社タダノ無担保社債	0.25	800,000	788,696	2026/12/11	
第1回グローリー株式会社無担保社債	0.15	500,000	498,800	2023/12/6	
第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	296,850	2027/12/7	
第51回日本精工株式会社無担保社債	0.19	300,000	297,357	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	394,608	2028/3/8	

銘柄	利率	第123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9回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	500,000	484,335	2029/11/28	
第14回T H K株式会社無担保社債	0.29	700,000	698,558	2026/2/6	
第30回富士電機株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,147	2027/5/21	
第8回日本電産株式会社無担保社債	0.1	800,000	798,048	2024/7/19	
第15回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.34	300,000	299,211	2026/9/18	
第17回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.36	700,000	693,630	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	778,248	2030/7/16	
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	400,000	400,388	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	583,944	2030/3/5	
第33回ソニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	300,540	2026/9/18	
第35回ソニー株式会社無担保社債	0.18	400,000	396,944	2026/10/9	
第36回ソニー株式会社無担保社債	0.3	700,000	682,570	2029/10/10	
第6回T D K株式会社無担保社債	0.31	200,000	197,608	2027/7/28	
第7回T D K株式会社無担保社債	0.43	800,000	777,592	2030/7/26	
第5回株式会社堀場製作所無担保社債	0.18	700,000	691,222	2026/10/16	
第6回株式会社堀場製作所無担保社債	0.27	600,000	578,718	2029/10/17	
第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	1,000,000	994,170	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	499,110	2024/4/19	
第3回株式会社村田製作所無担保社債	0.06	800,000	797,072	2024/9/10	
第1回東海理化電機製作所無担保社債	0.34	300,000	296,775	2027/6/7	
第43回株式会社I H I 無担保社債	0.2	400,000	398,516	2024/10/17	
第4回昭和リース株式会社無担保社債	0.3	800,000	794,872	2024/12/18	
第5回コルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.37	500,000	496,325	2029/9/4	
第7回コルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.6	500,000	495,435	2030/9/3	
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	600,000	595,368	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	797,376	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	789,112	2027/3/5	
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	400,000	399,144	2025/3/13	
第1回明治生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	700,000	699,363	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	798,360	2024/8/1	
第1回明治生命2019基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	0.29	800,000	797,640	2024/8/2	
第1回日本生命2021基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	0.28	400,000	397,116	2026/8/3	
第3回株式会社社トボン無担保社債	0.3	500,000	498,205	2025/6/24	
第4回大日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	782,264	2029/7/19	
第2回株式会社アシックス無担保社債	0.2	600,000	599,088	2024/3/13	
第4回株式会社社ニフコ無担保社債	0.25	500,000	498,745	2025/5/8	
第5回株式会社社ニフコ無担保社債	0.385	500,000	493,830	2028/5/8	
第6回株式会社社ニフコ無担保社債	0.28	700,000	678,307	2029/9/11	
第102回丸紅株式会社無担保社債	0.756	300,000	302,088	2024/7/25	
第7回長瀬産業株式会社無担保社債	0.29	600,000	580,734	2029/12/12	
第8回長瀬産業株式会社無担保社債	0.64	400,000	393,260	2032/6/9	
第19回豊田通商株式会社無担保社債	0.954	100,000	102,036	2026/7/10	
第63回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	216,218	2027/4/23	
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	800,000	782,736	2029/7/11	
第75回三井物産株式会社無担保社債	0.23	700,000	679,532	2029/12/12	
第36回株式会社丸井グループ無担保社債	0.25	300,000	296,571	2026/10/16	
第6回株式会社社新生銀行無担保社債	0.24	700,000	698,691	2023/12/13	
第2回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.29	700,000	695,408	2030/1/15	
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	100,550	2024/6/26	
第2回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.25	700,000	687,155	2027/11/4	
第3回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.42	600,000	561,666	2032/11/4	
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	204,968	2030/6/18	
第7回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.71	700,000	674,520	2033/6/9	
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	497,905	2025/7/23	
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)	0.857	200,000	200,660	2024/9/5	

銘柄	利率	第123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	429,501	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	790,480	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	595,212	2030/9/2	
第16回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.4	1,000,000	982,410	2031/12/22	
第4回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債	0.62	725,000	719,171	2026/12/18	
第5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	653,292	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	215,848	2027/4/20	
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	677,112	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	437,560	2030/9/27	
第26回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.95	200,000	207,550	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	104,628	2026/1/20	
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	105,238	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	401,936	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	816,464	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	483,998	2025/10/15	
第7回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.469	240,000	238,334	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	129,223	2026/9/15	
第9回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.585	710,000	700,507	2028/3/16	
第1回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	500,000	530,980	2026/12/22	
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	852,048	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	600,432	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	796,468	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	793,160	2029/11/26	
第6回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.49	800,000	788,936	2031/10/29	
第7回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.95	300,000	297,996	2032/9/27	
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	103,715	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	639,876	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	427,212	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	316,221	2026/6/15	
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	0.15	700,000	690,949	2026/11/6	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	500,000	502,700	2024/12/20	
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	496,325	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	595,662	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	496,170	2027/1/26	
第12回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.61	300,000	296,409	2027/6/21	
第19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)	0.538	300,000	298,453	2029/10/30	
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	785,720	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	794,584	2030/6/24	
第23回株式会社みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後特約付)	0.875	500,000	489,290	2030/10/30	
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	525,970	2026/6/1	
第26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	633,180	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	105,343	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	215,506	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	534,360	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	225,112	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	419,616	2026/9/11	
第23回日実蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	500,000	494,630	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	589,746	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	596,430	2032/9/17	
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	497,505	2026/6/19	
第27回S B Iホールディングス株式会社無担保社債	0.8	800,000	797,648	2024/12/23	
第11回株式会社三井住友フィナンシャルサービス株式会社無担保社債	0.3	800,000	796,544	2025/1/30	
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	199,374	2024/9/20	
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	692,811	2026/9/18	
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	500,245	2025/7/18	

銘柄	第123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32回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.55	800,000	760,368	2032/1/20
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	300,000	305,112	2026/9/18
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	598,902	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	596,118	2024/12/5
第171回オリックス株式会社無担保社債	1.126	20,000	20,053	2024/3/28
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	402,536	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	199,770	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	297,192	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	590,874	2028/8/3
第59回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.385	200,000	197,002	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	196,410	2028/7/12
第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.37	600,000	571,668	2031/12/1
第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.33	200,000	195,176	2029/1/24
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	199,524	2024/8/9
第5回野村ホールディングス無担保社債	0.75	800,000	795,848	2027/9/3
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	399,364	2024/7/31
第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	400,000	396,584	2026/11/13
第2回損害保険ジャパン株式会社無担保社債	0.749	300,000	298,113	2032/10/14
第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	111,279	2030/12/20
第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	109,643	2033/8/2
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	400,000	399,400	2026/3/13
第67回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	294,975	2029/4/13
第71回三井不動産株式会社無担保社債	0.31	600,000	582,432	2030/4/16
第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	222,674	2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	217,500	2027/9/17
第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.425	300,000	327,291	2027/10/29
第93回三菱地所株式会社無担保社債	2.555	200,000	221,484	2028/7/28
第113回三菱地所株式会社無担保社債	1.067	100,000	101,583	2024/12/27
第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	298,584	2026/12/18
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	297,189	2027/6/18
第130回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	700,000	681,597	2029/8/3
第96回住友不動産株式会社無担保社債	0.914	200,000	201,578	2024/3/18
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	200,000	201,662	2024/4/26
第98回住友不動産株式会社無担保社債	0.884	500,000	504,215	2024/6/10
第108回住友不動産株式会社無担保社債	0.4	500,000	498,060	2027/5/7
第8回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	1.99	300,000	331,623	2031/9/19
第11回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	1.25	200,000	208,184	2028/9/20
第13回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	1.09	200,000	206,122	2029/9/20
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	600,000	611,784	2026/6/17
第111回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	600,000	581,274	2031/9/5
第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	462,980	2036/12/5
第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	900,000	822,951	2037/9/11
第119回東武鉄道株式会社無担保社債	0.758	500,000	450,610	2038/5/24
第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	692,128	2039/7/22
第123回東武鉄道株式会社無担保社債	0.8	700,000	611,786	2040/4/20
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	302,154	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	589,290	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	682,703	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	675,857	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	386,104	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	196,448	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	659,610	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	609,518	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	686,672	2030/5/22
第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	680,600	2039/9/16

銘柄	第123期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	524,316	2040/6/8
第76回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.563	500,000	522,110	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	418,236	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	201,288	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	205,808	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	618,504	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	193,430	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	93,078	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	561,972	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	636,440	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	618,618	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	513,250	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	281,466	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	649,369	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	645,659	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	899,820	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	516,654	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	525,306	2040/6/11
第68回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.098	600,000	612,606	2030/6/12
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	462,545	2036/8/29
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	649,901	2037/5/29
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	551,682	2037/11/30
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	800,000	731,248	2038/8/30
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	700,000	684,530	2028/12/20
第83回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.209	400,000	386,288	2029/6/20
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	524,268	2039/6/10
第88回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.73	800,000	701,952	2040/4/23
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	108,358	2027/11/29
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	97,464	2031/3/10
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	494,405	2027/9/17
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	556,338	2037/9/18
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	0.295	100,000	98,508	2027/11/29
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	460,270	2037/11/27
第40回京王電鉄株式会社無担保社債	0.205	600,000	577,548	2030/1/30
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	351,728	2040/5/25
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	577,638	2031/6/20
第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	549,954	2038/9/7
第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	902,000	2039/3/8
第54回京成電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	349,724	2040/6/12
第57回京成電鉄株式会社無担保社債	0.7	400,000	346,652	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	115,276	2033/9/9
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	107,622	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	107,567	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	538,085	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	217,612	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	109,742	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	331,083	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	330,228	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	333,441	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	434,884	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	110,333	2030/12/20
第82回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	200,000	209,578	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	331,521	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	325,989	2032/12/27
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	419,420	2034/7/25

銘柄	利率	第123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106回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.981	100,000	98,610	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	462,505	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	277,050	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	636,874	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	674,312	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	217,058	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	109,634	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	329,583	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	219,836	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	222,396	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	881,560	2030/6/11	
第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	210,944	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	408,652	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	402,520	2035/8/31	
第41回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.816	200,000	190,690	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	495,785	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	642,453	2036/12/12	
第61回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.591	800,000	685,992	2040/5/21	
第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.31	300,000	325,176	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	326,004	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	219,296	2028/5/22	
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	800,000	873,264	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	220,598	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	110,045	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	332,490	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	218,958	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	215,728	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	541,315	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	628,176	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	106,540	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	720,538	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	692,356	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	100,733	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	101,735	2035/6/18	
第77回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.21	100,000	100,520	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	195,612	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	451,280	2036/4/14	
第2回東京地下鉄株式会社社債	2.36	100,000	102,926	2024/6/20	
第6回東京地下鉄株式会社社債	2.43	100,000	109,037	2027/9/17	
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	200,000	217,640	2027/12/20	
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	500,000	555,785	2030/3/19	
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	109,909	2032/5/25	
第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	108,853	2033/6/14	
第16回東京地下鉄株式会社社債	0.778	300,000	286,311	2036/3/11	
第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	627,620	2036/6/20	
第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	700,000	645,491	2037/6/19	
第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	551,232	2037/12/15	
第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	90,738	2038/5/24	
第38回東京地下鉄株式会社社債	0.445	600,000	507,906	2040/1/31	
第41回東京地下鉄株式会社社債	0.275	300,000	291,273	2030/6/12	
第49回東京地下鉄株式会社社債	0.574	300,000	255,591	2041/1/22	
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	583,020	2032/3/17	
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	481,780	2032/12/6	
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	683,578	2028/12/6	
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	700,000	691,033	2031/3/4	

銘柄	利率	第123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46回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.69	700,000	645,911	2036/9/9	
第47回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.903	700,000	658,595	2037/4/14	
第48回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.782	500,000	460,210	2037/9/4	
第50回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.395	700,000	688,989	2028/9/6	
第51回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.672	700,000	613,333	2039/5/30	
第99回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.8	500,000	481,490	2031/9/2	
第100回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.772	700,000	680,323	2032/7/27	
第106回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.505	700,000	688,249	2028/1/25	
第110回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.955	700,000	615,802	2033/7/26	
第112回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.47	800,000	771,424	2029/7/11	
第117回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.91	900,000	761,310	2040/1/30	
第47回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.202	500,000	516,325	2029/7/18	
第48回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.817	800,000	754,336	2036/12/15	
第51回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.789	700,000	640,094	2038/9/13	
第52回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.215	500,000	483,365	2029/11/21	
第54回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.486	800,000	679,312	2040/2/27	
第37回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.87	200,000	201,684	2024/7/29	
第40回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.841	600,000	594,156	2031/6/3	
第41回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.7	700,000	683,263	2031/12/8	
第42回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.647	600,000	588,756	2032/5/28	
第43回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.941	700,000	646,898	2037/11/30	
第44回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.878	800,000	727,488	2038/5/21	
第45回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.871	700,000	678,916	2033/12/6	
第46回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.69	500,000	430,405	2039/11/28	
第47回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.48	300,000	291,876	2030/6/4	
第29回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.34	600,000	598,830	2026/6/16	
第30回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.74	700,000	628,747	2038/7/16	
第31回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	200,000	197,120	2029/9/14	
第32回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.63	700,000	603,547	2039/12/16	
第50回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.857	200,000	202,748	2027/4/30	
第52回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.75	600,000	558,810	2036/8/29	
第53回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.85	600,000	577,266	2035/2/28	
第54回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.806	700,000	649,817	2037/5/29	
第55回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.79	600,000	550,836	2037/12/4	
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.748	600,000	543,342	2038/5/25	
第57回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.863	500,000	458,725	2038/9/10	
第58回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.725	800,000	711,416	2039/4/25	
第59回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.53	400,000	341,740	2039/9/5	
第63回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.69	300,000	259,131	2040/10/26	
第9回日本通運株式会社無担保社債	0.28	600,000	600,210	2026/2/25	
第11回日本通運株式会社無担保社債	0.2	300,000	298,731	2026/7/14	
第14回日本通運株式会社無担保社債	0.28	300,000	297,708	2027/6/16	
第7回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	0.28	400,000	387,084	2029/10/11	
第9回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	0.42	800,000	776,056	2030/9/18	
第7回株式会社日立物流無担保社債	0.405	600,000	587,094	2028/9/4	
第2回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.455	200,000	199,060	2027/2/23	
第3回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.39	400,000	394,160	2028/2/28	
第4回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.445	700,000	688,338	2028/12/14	
第5回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.43	800,000	772,576	2029/12/11	
第6回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.45	500,000	484,030	2030/9/17	
第8回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.75	200,000	198,166	2032/8/13	
第1回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.295	600,000	586,422	2029/3/7	
第3回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.23	300,000	289,767	2029/12/10	
第4回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.51	400,000	337,076	2039/12/9	
第6回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.29	400,000	386,300	2030/6/7	

銘柄		第123期末			
		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)		%	千円	千円	
第7回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.691	500,000	431,365	2040/6/8	
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.616	300,000	249,870	2041/12/9	
第1回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.26	500,000	483,265	2030/10/22	
第2回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.235	400,000	381,916	2031/11/18	
第2回日本貨物鉄道株式会社社債	0.849	300,000	262,632	2042/3/17	
第1回日本航空株式会社無担保社債	0.47	700,000	688,975	2026/12/18	
第3回日本航空株式会社無担保社債	0.399	500,000	481,315	2028/9/21	
第5回日本航空株式会社無担保社債	0.22	500,000	498,000	2024/3/19	
第7回日本航空株式会社無担保社債	0.28	800,000	750,952	2029/12/14	
第15回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.734	500,000	502,650	2024/3/12	
第17回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.34	500,000	495,440	2027/12/8	
第18回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.22	700,000	678,363	2029/12/5	
第19回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.61	400,000	346,872	2039/12/5	
第6回株式会社住友倉庫無担保社債	0.838	700,000	645,834	2038/3/26	
第7回株式会社住友倉庫無担保社債	0.08	200,000	199,350	2024/9/24	
第8回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	600,000	581,250	2029/9/21	
第10回株式会社住友倉庫無担保社債	0.27	300,000	288,933	2030/10/15	
第21回KDDI株式会社無担保社債	0.669	500,000	503,410	2024/9/20	
第22回KDDI株式会社無担保社債	0.31	700,000	690,683	2028/7/12	
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	400,000	395,372	2028/11/22	
第26回KDDI株式会社無担保社債	0.13	100,000	99,900	2024/4/26	
第27回KDDI株式会社無担保社債	0.23	700,000	697,564	2026/4/24	
第13回ソフトバンク無担保社債	0.52	800,000	750,328	2031/6/3	
第16回ソフトバンク無担保社債	0.52	700,000	659,463	2031/10/10	
第17回ソフトバンク無担保社債	0.51	700,000	680,176	2029/1/26	
第18回ソフトバンク無担保社債	0.62	600,000	568,770	2032/1/27	
第25回沖縄電力株式会社社債	0.25	700,000	691,845	2027/6/25	
第26回沖縄電力株式会社社債	0.28	700,000	684,082	2028/12/25	
第27回沖縄電力株式会社社債	0.19	800,000	770,120	2030/3/25	
第28回沖縄電力株式会社社債	0.24	300,000	286,911	2030/12/20	
第49回電源開発株式会社無担保社債	0.4	300,000	297,255	2027/5/20	
第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.31	100,000	95,787	2034/4/24	

銘柄		第123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32回東京電力パワーグリッド株式会社社債		1.28	100,000	94,895	2034/10/6
第26回東京瓦斯株式会社無担保社債		2.29	100,000	102,701	2024/5/27
第35回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.852	400,000	436,968	2031/12/26
第36回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.737	400,000	439,908	2032/5/25
第37回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.764	300,000	324,369	2033/9/26
第39回東京瓦斯株式会社無担保社債		1.554	700,000	739,214	2034/5/26
第41回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.57	700,000	639,807	2036/11/28
第43回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.67	700,000	645,561	2037/6/9
第46回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.58	700,000	624,155	2038/7/20
第48回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.704	300,000	270,861	2038/11/29
第52回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.486	1,000,000	862,650	2039/5/23
第55回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.28	800,000	660,664	2039/9/13
第68回東京瓦斯株式会社無担保社債		0.523	500,000	417,400	2041/7/12
第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債		1.606	400,000	425,032	2034/3/24
第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債		1.402	600,000	621,930	2034/10/24
第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債		0.576	200,000	168,946	2041/6/3
第45回大阪瓦斯株式会社無担保社債		0.942	800,000	715,440	2042/6/2
第36回東邦瓦斯株式会社無担保社債		1.628	300,000	314,394	2027/3/19
第44回東邦瓦斯株式会社無担保社債		0.835	700,000	611,905	2042/3/3
第13回広島ガス株式会社無担保社債		0.405	600,000	590,220	2028/9/13
第14回広島ガス株式会社無担保社債		0.35	800,000	766,496	2030/10/15
第16回西部瓦斯株式会社無担保社債		0.355	700,000	686,917	2028/12/13
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	894,546	2028/6/6
小	計		323,596,000	315,218,758	
合	計		493,372,991	481,707,717	

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

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

＜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(11,678,839千口)の内容です。

国内株式

銘柄	第117期末		第123期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
水産・農林業 (1.0%)				
マルハニチロ	—	16.2	39,285	
サカタのタネ	115.8	69.2	276,800	
鉱業 (0.2%)				
石油資源開発	—	15.3	64,642	
建設業 (4.5%)				
ショーボンドホールディングス	63.9	25.1	135,791	
コムシスホールディングス	102.1	108.1	258,359	
西松建設	209.5	114.8	458,626	
大豊建設	67.1	28.7	101,167	
奥村組	55.8	27.1	81,571	
ライト工業	—	27.4	51,484	
関電工	299.1	147.6	125,902	
エクシオグループ	191.1	—	—	
三機工業	127.2	67.4	102,650	
高砂熱学工業	137.2	46	82,018	
食料品 (5.7%)				
ニッポン	109.1	54.9	87,730	
カルビー	52.1	—	—	
明治ホールディングス	187.7	92.8	614,336	
日清オイリオグループ	51.7	25.9	81,067	
ニチレイ	119.8	65.6	176,201	
日清食品ホールディングス	128.8	60.6	603,576	
日本たばこ産業	235.2	90.3	239,204	
繊維製品 (0.6%)				
グンゼ	36.7	22	91,080	
ワコールホールディングス	109.2	—	—	
ホギメディカル	56.8	29.6	104,636	
パルプ・紙 (2.7%)				
王子ホールディングス	1,222.7	947	495,281	
大王製紙	221.8	—	—	
レンゴー	917.6	377.8	340,397	
化学 (8.2%)				
花王	178.4	108.4	568,666	
ライオン	860.4	435.3	616,384	
ノエビアホールディングス	35.4	19.1	106,960	
小林製薬	60.1	44.4	405,372	
アース製薬	29.5	5.8	28,826	

銘柄	第117期末		第123期末	
	株数	株数	評価額	
	千株	千株	千円	
エフビコ	171.6	76.8	268,416	
ユニ・チャーム	201.1	120.2	590,422	
医薬品 (3.2%)				
武田薬品工業	286.4	120.7	506,819	
科研製薬	123.8	64.8	247,860	
ロート製薬	—	19.3	44,197	
小野薬品工業	8.3	6.1	17,708	
持田製薬	59.2	25.6	86,272	
ツムラ	111.5	—	—	
栄研化学	144.8	68.4	111,081	
キョーリン製薬ホールディングス	89.1	—	—	
石油・石炭製品 (1.2%)				
ENEOSホールディングス	2,025.5	795.2	374,618	
ガラス・土石製品 (0.3%)				
日本カーボン	27.6	20.4	89,352	
金属製品 (—%)				
東洋製鐵グループホールディングス	120.3	—	—	
機械 (2.9%)				
タクマ	215.8	121.1	150,648	
サトーホールディングス	14.8	—	—	
技研製作所	58	—	—	
椿本チエイン	82.4	39.6	120,384	
フジテック	170.3	103.3	322,812	
アマノ	181.4	97.5	230,587	
スター精密	118.3	45.5	75,075	
電気機器 (14.9%)				
日清紡ホールディングス	—	299.1	284,145	
マブチモーター	218.1	103.2	379,260	
ダイヘン	0.9	—	—	
日東工業	88.5	76.7	183,159	
日本電気	166.4	—	—	
神電気工業	512.3	257.2	184,669	
E I Z O	60	27	95,715	
エレコム	296.2	144.2	192,507	
アンリツ	856	469.9	591,134	
富士通ゼネラル	—	14.9	54,236	
ホシデン	332.6	154.4	239,320	
ヒロセ電機	60.3	36.1	591,679	

銘柄	第117期末		第123期末	
	株数	千株	株数	評価額
マクセル	131.1	69.5	99,315	
アズビル	289.4	137.3	481,236	
日本セラミック	—	30	71,100	
図研	43.4	—	—	
京セラ	180.2	88.4	579,992	
キャノン	412.5	224.7	644,439	
輸送用機器 (4.9%)				
トヨタ紡織	56	66.8	124,314	
豊田自動織機	30.1	—	—	
東海理化電機製作所	181.3	82	117,424	
トヨタ自動車	602.8	305.6	577,278	
NOK	425.5	121.6	144,096	
アイシン	—	4	14,460	
エクセディ	176.6	92.9	152,727	
エフ・シー・シー	197.3	80.6	111,792	
シマノ	11.4	—	—	
ティ・エス テック	377.7	182.6	280,291	
精密機器 (0.8%)				
ニプロ	506.3	235.2	242,726	
その他製品 (3.4%)				
パラマウントベッドホールディングス	70.4	40.5	100,440	
ビジョン	288.7	287.8	579,917	
リンテック	152.7	85.9	186,746	
任天堂	12.6	10.8	59,778	
コクヨ	161.4	79	142,279	
電気・ガス業 (3.6%)				
中部電力	950.1	476	601,188	
沖縄電力	20	—	—	
東京瓦斯	403.5	119.3	299,085	
大阪瓦斯	21.9	106.6	215,971	
陸運業 (3.2%)				
東武鉄道	—	56.3	168,900	
相鉄ホールディングス	138.2	102.5	223,655	
西日本鉄道	22.7	—	—	
南海電気鉄道	30.2	115.3	323,647	
センコーグループホールディングス	363.3	169.7	165,627	
九州旅客鉄道	83.9	39.9	114,912	
倉庫・運輸関連業 (0.9%)				
住友倉庫	241.4	147.7	287,128	
情報・通信業 (8.9%)				
NECネットエスアイ	171.6	127	221,234	
コーエーテクモホールディングス	74.5	165	390,885	
アルテリア・ネットワークス	168	70.4	87,648	

銘柄	第117期末		第123期末	
	株数	千株	株数	評価額
トレンドマイクロ	152.5	—	—	
伊藤忠テクノソリューションズ	331.8	181.9	558,433	
大塚商会	76.1	—	—	
スカパーJ S A Tホールディングス	36	19.6	9,721	
日本電信電話	339.4	151.4	579,862	
KDDI	301.2	144.4	580,632	
ソフトバンク	127.9	65.7	97,170	
D T S	61.6	—	—	
カブコン	—	9	37,035	
T K C	53.4	26.8	93,666	
N S D	115.3	61	139,568	
卸売業 (8.3%)				
アルフレッサ ホールディングス	159.7	282.2	454,059	
T O K A I ホールディングス	246.3	141.6	119,652	
シップヘルスケアホールディングス	188.3	4.9	12,470	
コマダホールディングス	204.6	94.3	225,659	
伊藤忠商事	85.8	—	—	
キャノンマーケティングジャパン	133.5	95.1	281,400	
菱洋エレクトロ	191.9	98.9	235,480	
サンゲツ	—	68.8	153,217	
伊藤忠エネクス	164.4	—	—	
モスフードサービス	94.7	54.3	165,615	
P A L T A C	101.5	39.3	183,138	
オートバックスセブン	323.2	160.2	226,683	
イエローハット	122.8	54.9	94,373	
因幡電機産業	94.8	48.3	130,361	
スズケン	172.7	99.3	331,662	
小売業 (7.2%)				
ローソン	11.6	5.6	28,504	
サンエー	48.9	28.4	116,724	
カワチ薬品	105.2	43.5	97,701	
エービーシー・マート	31.6	23.3	160,770	
エディオン	170.2	91.6	117,339	
D C Mホールディングス	438.7	220.8	259,219	
ウエルシアホールディングス	3.2	—	—	
ジョイフル本田	191.2	75.3	144,576	
日本瓦斯	312.6	—	—	
コメリ	59.4	59.8	157,692	
フジ	131.4	94.5	174,352	
ヤオコー	66	30.7	205,076	
ケーズホールディングス	201	110	124,520	
王将フードサービス	26.6	15.2	90,136	
アークス	120.6	58.4	124,508	

銘柄	第117期末	第123期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
サンドラッグ	168.3	127.9	462,998
銀行業 (3.9%)			
三井住友トラスト・ホールディングス	96.3	—	—
群馬銀行	—	350.5	172,446
八十二銀行	853.8	593.9	329,020
山陰合同銀行	318	131.9	102,882
セブン銀行	1,950.7	1,054.6	276,305
山口フィナンシャルグループ	718.7	388.9	338,731
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
松井証券	632.4	316.9	244,963
保険業 (3.2%)			
SOMPOホールディングス	175.1	69.8	395,556
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	247.6	147.9	616,151

銘柄	第117期末	第123期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
その他金融業 (0.4%)			
リコーリース	59.2	32.5	122,362
サービス業 (5.1%)			
MIXI	299	119.3	297,772
H. U. グループホールディングス	208.9	114.9	321,949
ダスキン	94.5	48.5	145,209
日本管財	65.1	33.3	83,782
セコム	148.2	79.4	606,933
イオンディライト	89.7	44	134,860
合計	株数・金額	31,703	16,713
	銘柄数＜比率＞	145	133
			31,343,242
			<96.9%>

(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(12,928,246千口)の内容です。

国内投資信託証券

銘柄	第117期末		第123期末		
	口数	口数	評価額	比率	
	口	口	千円	%	
サンケイリアルエステート投資法人	1,260	100	8,830	0.0	
SOS i LA物流リート投資法人	2,057	1,880	246,092	0.7	
日本アコモデーションファンド投資法人	1,516	540	310,500	0.8	
森ヒルズリート投資法人	5,331	1,200	178,920	0.5	
産業ファンド投資法人	9,774	11,950	1,724,385	4.6	
アドバンス・レジデンス投資法人	5,503	1,700	552,500	1.5	
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	5,327	1,490	293,232	0.8	
アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,889	900	349,200	0.9	
GLP投資法人	20,080	12,250	1,744,400	4.7	
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	2,627	1,600	467,200	1.3	
日本プロロジスリート投資法人	9,314	3,094	884,265	2.4	
星野リゾート・リート投資法人	1,275	150	112,050	0.3	
One リート投資法人	1,583	100	24,180	0.1	
イオンリート投資法人	9,155	2,600	378,300	1.0	
ヒューリックリート投資法人	7,019	900	139,320	0.4	
日本リート投資法人	2,770	180	59,670	0.2	
積水ハウス・リート投資法人	20,518	3,200	228,160	0.6	
ケネディクス商業リート投資法人	3,064	1,150	282,785	0.8	
ヘルスケア & メディカル投資法人	240	100	16,950	0.0	
サムティ・レジデンシャル投資法人	1,820	300	33,540	0.1	
野村不動産マスターファンド投資法人	20,813	8,200	1,250,500	3.4	
ラサールロジポート投資法人	7,808	10,694	1,658,639	4.5	
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2,789	3,754	1,666,776	4.5	
投資法人みらい	9,332	3,500	154,525	0.4	
森トラスト・ホテルリート投資法人	2,185	600	79,740	0.2	
三菱地所物流リート投資法人	1,932	611	244,400	0.7	
CRE ロジスティクスファンド投資法人	1,615	2,068	369,344	1.0	
タカラレーベン不動産投資法人	1,065	200	19,700	0.1	
アドバンス・ロジスティクス投資法人	4,067	2,850	394,440	1.1	
日本ビルファンド投資法人	6,282	7,945	4,457,145	12.0	
ジャパンリアルエステイト投資法人	5,278	1,300	721,500	1.9	
日本都市ファンド投資法人	29,682	11,486	1,137,114	3.1	
オリックス不動産投資法人	12,171	4,840	849,904	2.3	
日本プライムリアルティ投資法人	3,786	795	281,827	0.8	
N T T都市開発リート投資法人	5,314	6,773	909,613	2.5	
東急リアル・エステート投資法人	2,717	100	19,980	0.1	
グローバル・ワン不動産投資法人	6,291	200	21,320	0.1	
ユナイテッド・アーバン投資法人	14,545	6,380	957,000	2.6	
森トラスト総合リート投資法人	2,366	300	43,200	0.1	
インヴィンシブル投資法人	24,730	17,700	968,190	2.6	
フロンティア不動産投資法人	985	200	99,800	0.3	
平和不動産リート投資法人	4,717	500	75,600	0.2	

銘 柄	第117期末	第123期末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	口	口	千円	%
日本ロジスティクスファンド投資法人	3,850	4,450	1,325,655	3.6
福岡リート投資法人	4,480	300	49,830	0.1
ケネディクス・オフィス投資法人	2,150	1,100	342,100	0.9
いちごオフィスリート投資法人	8,679	10,220	868,700	2.3
大和証券オフィス投資法人	1,979	400	249,200	0.7
阪急阪神リート投資法人	3,482	100	14,310	0.0
スターツプロシード投資法人	1,242	100	22,530	0.1
大和ハウスリート投資法人	10,784	11,860	3,311,312	8.9
ジャパン・ホテル・リート投資法人	—	20,000	1,686,000	4.5
大和証券リビング投資法人	10,374	6,700	728,290	2.0
ジャパンエクセレント投資法人	7,620	5,000	625,000	1.7
合 計	口 数 ・ 金 額	196,610	33,637,665	
	銘 柄 数<比 率>	53	<90.6%>	

(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13期（決算日 2022年9月26日）

（計算期間 2021年9月25日～2022年9月26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
		騰 落 中 率		騰 落 中 率		
	円	%		%	%	百万円
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
12期(2021年9月24日)	12,323	0.8	183.425	0.1	99.6	639,453
13期(2022年9月26日)	11,940	△3.1	177.978	△3.0	99.1	528,752

○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	券 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首)	円	%		%		%
2021年9月24日	12,323	—	183.425	—	99.6	99.6
9月末	12,309	△0.1	183.217	△0.1	99.5	99.5
10月末	12,291	△0.3	182.865	△0.3	99.4	99.4
11月末	12,332	0.1	183.473	0.0	98.7	98.7
12月末	12,308	△0.1	183.021	△0.2	99.7	99.7
2022年1月末	12,226	△0.8	181.615	△1.0	98.6	98.6
2月末	12,181	△1.2	180.919	△1.4	99.3	99.3
3月末	12,156	△1.4	180.524	△1.6	98.5	98.5
4月末	12,130	△1.6	180.135	△1.8	99.4	99.4
5月末	12,116	△1.7	180.008	△1.9	99.3	99.3
6月末	12,020	△2.5	178.657	△2.6	99.1	99.1
7月末	12,104	△1.8	180.217	△1.7	99.5	99.5
8月末	12,054	△2.2	179.677	△2.0	99.4	99.4
(期 末)						
2022年9月26日	11,940	△3.1	177.978	△3.0	99.1	99.1

(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

(2021年9月25日～2022年9月26日)

■期中の基準価額等の推移

期首：12,323円

期末：11,940円

騰落率：△3.1%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・保有する債券の利息収入

マイナス要因

- ・10年国債利回りの上昇に伴い社債利回りが上昇（債券価格は下落）したこと

■投資環境

【国債市場】

当期の10年国債利回りは上昇しました。

期初、0.06%程度水準であった10年国債利回りは、新型コロナウイルスの感染状況や米国債利回りの動向に左右されながらおおむね0.05%から0.10%程度水準で推移しました。2022年に入ると、ロシアのウクライナ侵攻により投資家のリスク回避姿勢が強まる局面はありましたが、米国のインフレ率高騰を受けた米国債利回りの上昇を背景に、10年国債利回りは日銀のイールドカーブ・コントロール政策のレンジ上限である0.25%程度まで上昇しました。その後、日銀が金融緩和姿勢を堅持したことや米国の景気減速懸念などから10年国債利回りは一時に0.20%を下回る水準まで低下（債券価格は上昇）しましたが、期末にかけては、米国債利回りの上昇などを背景に上昇し、0.29%程度水準で期を終えました。

【社債市場】

社債市場は、期初から旺盛な投資需要を背景に堅調に推移しました。2022年に入ると、ウクライナ情勢や海外の主要中央銀行による金融政策正常化の加速を受けて、慎重な姿勢の投資家が増加したことなどにより、社債利回りは前期末対比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

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、地方債なども保有しました。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3.1%下落しました。



(注) 参考指数は、期首(2021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/Ladder20年です。

○今後の運用方針

欧米中央銀行の利上げやウクライナ情勢などに伴う不透明感は依然として強いものの、日銀は引き続き国債利回りの過度な上昇を抑制する姿勢を示していることから、国債利回りは低水準で推移すると予想します。

社債市場については、短期的にはボラティリティ（変動性）に留意が必要ですが、相対的に高い利回りを求めて運用資金が流入する構図が継続し、社債スプレッド（社債と国債の利回り格差）はおおむね安定的に推移すると考えます。

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考え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

(2021年9月25日～2022年9月26日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2021年9月25日～2022年9月26日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	—	20,200,254
	地方債証券	—	19,260,823
			(503,163)
	特殊債券	—	8,613,341
	社債券（投資法人債券を含む）	36,878,616	57,056,397
			(21,701,000)

(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。

○利害関係人との取引状況等

(2021年9月25日～2022年9月26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

(2022年9月26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	21,600,000	22,966,711	4.3	—	4.3	—	—
地方債証券	134,082,876	135,352,120	25.6	—	25.4	0.1	0.1
	(134,082,876)	(135,352,120)	(25.6)	(—)	(25.4)	(0.1)	(0.1)
特殊債券 (除く金融債)	23,600,000	23,633,080	4.5	—	4.5	—	—
	(23,600,000)	(23,633,080)	(4.5)	(—)	(4.5)	(—)	(—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	345,596,000	342,279,617	64.7	—	42.1	15.5	7.1
	(345,596,000)	(342,279,617)	(64.7)	(—)	(42.1)	(15.5)	(7.1)
合 計	524,878,876	524,231,529	99.1	—	76.4	15.5	7.3
	(503,278,876)	(501,264,818)	(94.8)	(—)	(72.0)	(15.5)	(7.3)

(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22回利付国債 (30年)	2.5	500,000	621,940	2036/3/20	第161回利付国債 (20年)	0.6	700,000	690,186	2037/6/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	500,000	622,865	2036/6/20	第162回利付国債 (20年)	0.6	700,000	688,170	2037/9/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	500,000	623,745	2036/9/20	第163回利付国債 (20年)	0.6	700,000	686,112	2037/12/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	500,000	611,040	2036/12/20	第164回利付国債 (20年)	0.5	700,000	673,862	2038/3/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	500,000	618,230	2037/3/20	第165回利付国債 (20年)	0.5	700,000	672,063	2038/6/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	500,000	626,275	2037/9/20	第166回利付国債 (20年)	0.7	700,000	690,564	2038/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	500,000	626,985	2038/3/20	第167回利付国債 (20年)	0.5	700,000	667,436	2038/12/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	500,000	620,385	2038/9/20	第168回利付国債 (20年)	0.4	700,000	654,472	2039/3/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	500,000	613,650	2039/3/20	第169回利付国債 (20年)	0.3	700,000	641,263	2039/6/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	500,000	606,005	2039/9/20	第170回利付国債 (20年)	0.3	700,000	638,603	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	500,000	614,055	2040/3/20	第171回利付国債 (20年)	0.3	700,000	635,922	2039/12/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	500,000	589,680	2040/9/20	第172回利付国債 (20年)	0.4	700,000	644,707	2040/3/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	500,000	606,820	2041/3/20	第173回利付国債 (20年)	0.4	700,000	642,551	2040/6/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	500,000	590,115	2041/9/20	小 計		21,600,000	22,966,711	
第36回利付国債 (30年)	2.0	500,000	590,655	2042/3/20	地方債証券				
第37回利付国債 (30年)	1.9	500,000	581,720	2042/9/20	第6回東京都公募公債 (30年)	2.58	100,000	124,625	2037/9/18
第38回利付国債 (30年)	1.8	500,000	571,870	2043/3/20	第7回東京都公募公債 (30年)	2.51	100,000	123,952	2038/9/17
第39回利付国債 (30年)	1.9	500,000	580,750	2043/6/20	第27回東京都公募公債 (20年)	1.68	300,000	335,910	2032/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	700,000	680,841	2036/3/20	第28回東京都公募公債 (20年)	1.59	100,000	111,177	2033/3/18
第157回利付国債 (20年)	0.2	700,000	660,709	2036/6/20	第30回東京都公募公債 (20年)	1.508	400,000	441,280	2034/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	700,000	686,539	2036/9/20	第31回東京都公募公債 (20年)	1.238	400,000	428,724	2034/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	700,000	694,085	2036/12/20	第32回東京都公募公債 (20年)	1.293	600,000	645,666	2035/6/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	700,000	701,841	2037/3/20	第33回東京都公募公債 (20年)	0.18	700,000	650,636	2036/6/20

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34回東京都公募公債 (20年)	0.668	500,000	491,285	2037/6/19	第26回兵庫県公募公債 (20年)	0.665	300,000	298,164	2036/3/7
第35回東京都公募公債 (20年)	0.525	700,000	666,113	2038/6/18	第28回兵庫県公募公債 (20年)	0.273	700,000	659,176	2036/6/20
第37回東京都公募公債 (20年)	0.444	800,000	729,768	2040/6/20	第30回兵庫県公募公債 (20年)	0.607	300,000	294,099	2036/12/19
平成25年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.635	400,000	446,444	2033/12/27	第32回兵庫県公募公債 (20年)	0.621	400,000	391,136	2037/5/1
平成26年度第4回北海道公募公債 (20年)	1.569	200,000	221,772	2034/6/27	第35回兵庫県公募公債 (20年)	0.578	600,000	575,820	2038/5/28
平成26年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.303	200,000	215,554	2034/12/26	第37回兵庫県公募公債 (20年)	0.472	500,000	467,415	2039/2/18
平成27年度第4回北海道公募公債 (20年)	1.357	600,000	649,518	2035/6/29	第38回兵庫県公募公債 (20年)	0.352	300,000	273,495	2039/6/20
平成27年度第12回北海道公募公債 (20年)	1.156	200,000	211,068	2035/12/25	第2回静岡県公募公債 (30年)	2.54	300,000	373,131	2038/9/17
平成28年度第3回北海道公募公債 (20年)	0.363	700,000	664,895	2036/6/30	第14回静岡県公募公債 (20年)	1.736	500,000	563,870	2032/6/18
平成29年度第11回北海道公募公債 (20年)	0.635	200,000	194,072	2037/12/25	第15回静岡県公募公債 (20年)	1.701	450,000	505,170	2032/10/15
平成30年度第4回北海道公募公債 (20年)	0.569	600,000	573,390	2038/6/25	第18回静岡県公募公債 (20年)	1.473	600,000	659,490	2034/7/10
平成30年度第9回北海道公募公債 (20年)	0.654	500,000	482,125	2038/9/24	第19回静岡県公募公債 (20年)	1.253	300,000	321,210	2035/7/27
令和元年度第4回北海道公募公債 (20年)	0.323	700,000	633,353	2039/6/24	第22回静岡県公募公債 (20年)	0.443	200,000	192,192	2036/9/19
令和元年度第9回北海道公募公債 (20年)	0.2	200,000	176,350	2039/9/22	第23回静岡県公募公債 (20年)	0.626	100,000	97,702	2037/6/19
第4回2号宮城県公募公債 (20年)	0.244	412,500	404,196	2039/2/18	第24回静岡県公募公債 (20年)	0.63	200,000	195,408	2037/9/18
第5回1号宮城県公募公債 (20年)	0.17	425,000	413,457	2039/8/19	第25回静岡県公募公債 (20年)	0.53	600,000	571,368	2038/6/18
第5回2号宮城県公募公債 (20年)	0.188	350,000	340,924	2039/12/20	第26回静岡県公募公債 (20年)	0.711	600,000	585,408	2038/9/17
第5回3号宮城県公募公債 (20年)	0.158	350,000	339,983	2040/2/20	第28回静岡県公募公債 (20年)	0.31	700,000	631,197	2039/9/20
第22回神奈川県公募公債 (20年)	1.802	200,000	226,440	2032/12/20	平成24年度第4回愛知県公募公債 (20年)	1.687	200,000	224,572	2032/6/11
第23回神奈川県公募公債 (20年)	1.804	100,000	113,453	2033/6/20	平成24年度第17回愛知県公募公債 (20年)	1.829	400,000	454,183	2033/2/8
第25回神奈川県公募公債 (20年)	1.578	400,000	444,424	2033/12/20	平成25年度第3回愛知県公募公債 (20年)	1.509	200,000	220,800	2033/5/13
第26回神奈川県公募公債 (20年)	1.477	600,000	659,874	2034/6/20	平成25年度第11回愛知県公募公債 (20年)	1.77	100,000	113,140	2033/9/13
第27回神奈川県公募公債 (20年)	1.398	600,000	654,210	2034/9/20	平成26年度第4回愛知県公募公債 (20年)	1.542	100,000	110,694	2034/5/15
第28回神奈川県公募公債 (20年)	0.941	300,000	310,929	2034/12/20	平成26年度第13回愛知県公募公債 (20年)	1.363	600,000	651,918	2034/11/14
第29回神奈川県公募公債 (20年)	1.289	600,000	645,384	2035/6/20	平成27年度第3回愛知県公募公債 (20年)	1.115	700,000	738,297	2035/5/8
第30回神奈川県公募公債 (20年)	1.161	100,000	105,860	2035/9/20	平成27年度第14回愛知県公募公債 (20年)	1.129	200,000	210,886	2035/11/19
第31回神奈川県公募公債 (20年)	1.002	200,000	207,570	2035/12/20	平成28年度第2回愛知県公募公債 (20年)	0.387	100,000	95,743	2036/5/12
第32回神奈川県公募公債 (20年)	0.18	200,000	185,896	2036/6/20	平成28年度第12回愛知県公募公債 (20年)	0.429	300,000	287,097	2036/11/18
第33回神奈川県公募公債 (20年)	0.64	500,000	492,290	2036/12/19	平成29年度第12回愛知県公募公債 (20年)	0.606	400,000	387,944	2037/11/20
第34回神奈川県公募公債 (20年)	0.654	100,000	98,072	2037/6/19	平成30年度第2回愛知県公募公債 (20年)	0.54	100,000	95,460	2038/4/30
第36回神奈川県公募公債 (20年)	0.625	100,000	97,168	2037/12/18	平成30年度第12回愛知県公募公債 (20年)	0.706	300,000	292,014	2038/11/15
第37回神奈川県公募公債 (20年)	0.53	200,000	190,456	2038/6/18	令和元年度第5回愛知県公募公債 (20年)	0.288	400,000	360,316	2039/7/12
第40回神奈川県公募公債 (20年)	0.2	800,000	710,720	2039/6/20	平成23年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.83	100,000	112,385	2031/9/22
第42回神奈川県公募公債 (20年)	0.34	500,000	453,040	2039/9/20	平成24年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.7	600,000	673,884	2032/9/14
第2回大阪府公募公債 (20年)	0.285	300,000	283,644	2035/12/25	平成25年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.75	300,000	338,796	2033/9/13
第9回大阪府公募公債 (20年)	1.83	100,000	113,244	2032/3/12	平成26年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.41	600,000	654,930	2034/9/12
第10回大阪府公募公債 (20年)	1.72	530,000	596,101	2032/9/24	平成27年度第1回広島県公募公債 (20年)	1.212	500,000	532,370	2035/9/25
第11回大阪府公募公債 (20年)	1.693	500,000	561,020	2033/9/27	平成28年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.414	200,000	191,326	2036/9/26
第12回大阪府公募公債 (20年)	1.453	540,000	591,834	2034/9/26	平成29年度第2回広島県公募公債 (20年)	0.597	700,000	679,105	2037/9/25
第13回大阪府公募公債 (20年)	1.203	700,000	743,687	2035/9/28	平成30年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.568	700,000	670,866	2038/5/17
第14回大阪府公募公債 (20年)	0.54	300,000	291,597	2036/9/29	平成30年度第2回広島県公募公債 (20年)	0.668	600,000	581,382	2038/9/17
第15回大阪府公募公債 (20年)	0.721	600,000	594,606	2037/3/30	平成31年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.419	700,000	647,276	2039/4/19
第17回大阪府公募公債 (20年)	0.668	700,000	677,292	2038/9/27	令和元年度第2回広島県公募公債 (20年)	0.2	300,000	265,308	2039/9/20
平成26年度第5回京都府公募公債 (20年)	1.455	600,000	658,296	2034/8/10	令和2年度第1回広島県公募公債 (20年)	0.315	800,000	714,968	2040/4/17
平成28年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.327	600,000	567,978	2036/8/15	第8回埼玉県公募公債 (15年)	0.367	400,000	382,296	2036/4/18
平成29年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.63	100,000	97,538	2037/8/14	第12回埼玉県公募公債 (20年)	1.73	100,000	112,617	2032/5/24
平成30年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.658	600,000	581,454	2038/8/13	第13回埼玉県公募公債 (20年)	1.599	600,000	667,986	2033/10/20
令和元年度第5回京都府公募公債 (20年)	0.2	400,000	354,208	2039/8/19	第14回埼玉県公募公債 (20年)	1.546	600,000	664,716	2034/5/8
第16回兵庫県公募公債 (20年)	1.7	100,000	112,217	2032/11/19	第15回埼玉県公募公債 (20年)	1.166	400,000	424,880	2035/2/16
第19回兵庫県公募公債 (20年)	1.57	100,000	110,993	2033/12/9	第16回埼玉県公募公債 (20年)	1.216	200,000	213,186	2035/8/14
第20回兵庫県公募公債 (20年)	1.53	200,000	221,244	2034/3/10	第18回埼玉県公募公債 (20年)	0.323	500,000	474,705	2036/5/20
第21回兵庫県公募公債 (20年)	1.54	300,000	332,166	2034/5/9	第20回埼玉県公募公債 (20年)	0.626	300,000	293,340	2037/5/15
第22回兵庫県公募公債 (20年)	1.4	500,000	545,175	2034/9/8	第21回埼玉県公募公債 (20年)	0.625	500,000	485,850	2037/12/11
第24回兵庫県公募公債 (20年)	1.23	200,000	213,890	2035/3/23	第22回埼玉県公募公債 (20年)	0.568	600,000	575,016	2038/5/21

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	
地方債証券	%	千円	千円			地方債証券	%	千円	千円		
第23回埼玉県公募公債 (20年)	0.626	300,000	288,153	2038/12/17	令和元年度第2回島根県公募公債	0.2	400,000	353,744	2039/9/20		
第24回埼玉県公募公債 (20年)	0.431	100,000	92,544	2039/5/17	令和2年度第2回島根県公募公債	0.459	800,000	729,064	2040/9/21		
第25回埼玉県公募公債 (20年)	0.32	450,000	404,676	2039/12/20	平成30年度第1回栃木県公募公債	0.421	495,000	492,767	2038/10/22		
平成30年度第2回福岡県公募公債 (15年)	0.542	600,000	600,648	2033/10/17	令和元年度第1回栃木県公募公債	0.14	437,500	424,663	2039/10/24		
令和元年度第1回福岡県公募公債 (15年)	0.254	600,000	577,518	2034/6/14	令和元年度第1回奈良県公募公債	0.15	255,000	247,564	2039/9/20		
令和元年度第2回福岡県公募公債 (15年)	0.269	400,000	383,552	2034/12/13	第17回大阪市公募公債 (20年)	1.721	200,000	224,748	2032/12/21		
平成24年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.734	100,000	112,642	2032/5/21	第18回大阪市公募公債 (20年)	1.262	700,000	751,401	2035/2/27		
平成25年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.599	300,000	333,993	2033/5/20	第19回大阪市公募公債 (20年)	1.138	600,000	634,728	2035/4/24		
平成25年度第2回福岡県公募公債 (20年)	1.787	100,000	113,274	2033/8/12	第20回大阪市公募公債 (20年)	1.184	200,000	212,344	2035/8/31		
平成26年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.542	250,000	276,782	2034/5/26	第21回大阪市公募公債 (20年)	0.97	300,000	310,092	2036/1/29		
平成26年度第2回福岡県公募公債 (20年)	1.451	300,000	328,896	2034/9/22	第22回大阪市公募公債 (20年)	0.347	700,000	666,197	2036/5/30		
平成26年度第4回福岡県公募公債 (20年)	1.249	200,000	214,374	2035/2/23	第24回大阪市公募公債 (20年)	0.655	200,000	196,596	2037/4/21		
平成27年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.285	500,000	537,700	2035/5/22	第26回大阪市公募公債 (20年)	0.635	500,000	487,250	2037/10/23		
平成28年度第1回福岡県公募公債 (20年)	0.308	500,000	473,460	2036/5/23	第27回大阪市公募公債 (20年)	0.544	200,000	191,174	2038/4/20		
平成28年度第4回福岡県公募公債 (20年)	0.744	600,000	598,380	2037/2/13	第1回名古屋市公募公債 (30年)	2.53	500,000	611,825	2035/3/20		
平成29年度第1回福岡県公募公債 (20年)	0.626	100,000	97,775	2037/5/29	第3回名古屋市公募公債 (30年)	2.5	100,000	123,546	2037/9/18		
令和元年度第1回福岡県公募公債 (20年)	0.359	600,000	544,008	2039/11/25	第6回名古屋市公募公債 (30年)	2.45	100,000	123,313	2039/12/20		
第12回千葉県公募公債 (20年)	1.839	400,000	454,304	2032/4/16	第15回名古屋市公募公債 (20年)	1.712	300,000	337,575	2033/9/9		
第13回千葉県公募公債 (20年)	1.701	550,000	617,430	2032/10/15	第16回名古屋市公募公債 (20年)	1.52	200,000	220,868	2034/6/9		
第14回千葉県公募公債 (20年)	1.137	700,000	745,745	2033/4/15	第17回名古屋市公募公債 (20年)	1.203	500,000	523,615	2035/5/28		
第15回千葉県公募公債 (20年)	1.604	100,000	111,380	2033/10/14	第18回名古屋市公募公債 (20年)	1.139	700,000	738,948	2035/11/20		
第16回千葉県公募公債 (20年)	1.555	600,000	665,412	2034/4/14	第19回名古屋市公募公債 (20年)	0.323	300,000	284,883	2036/4/28		
第17回千葉県公募公債 (20年)	1.403	600,000	654,738	2034/10/13	第20回名古屋市公募公債 (20年)	0.645	600,000	588,156	2037/7/25		
第18回千葉県公募公債 (20年)	1.138	600,000	634,656	2035/4/13	第21回名古屋市公募公債 (20年)	0.568	700,000	670,859	2038/5/18		
第19回千葉県公募公債 (20年)	1.166	100,000	105,934	2035/10/15	第22回名古屋市公募公債 (20年)	0.431	700,000	647,787	2039/5/20		
第23回千葉県公募公債 (20年)	0.63	300,000	292,353	2037/10/15	第10回京都市公募公債 (20年)	1.803	200,000	225,382	2031/11/21		
第24回千葉県公募公債 (20年)	0.559	200,000	191,592	2038/4/15	第11回京都市公募公債 (20年)	1.701	100,000	112,226	2032/11/19		
第25回千葉県公募公債 (20年)	0.701	700,000	681,436	2038/10/15	第13回京都市公募公債 (20年)	1.359	300,000	325,674	2034/11/24		
第27回千葉県公募公債 (20年)	0.251	800,000	713,144	2039/10/14	第14回京都市公募公債 (20年)	1.139	400,000	422,260	2035/11/22		
平成29年度第1回新潟県公募公債	0.616	700,000	681,464	2037/8/14	第15回京都市公募公債 (20年)	0.487	500,000	482,180	2036/11/28		
平成30年度第1回新潟県公募公債	0.653	700,000	677,376	2038/8/20	第16回京都市公募公債 (20年)	0.611	600,000	582,306	2037/11/27		
令和元年度第1回新潟県公募公債	0.2	800,000	708,416	2039/8/19	第17回京都市公募公債 (20年)	0.683	700,000	678,566	2038/11/26		
令和2年度第1回新潟県公募公債	0.435	800,000	727,032	2040/8/17	第18回京都市公募公債 (20年)	0.355	400,000	362,472	2039/11/18		
令和2年度第2回長野県公募公債	0.14	200,000	195,926	2030/10/16	平成23年度第4回神戸市公募公債 (20年)	1.913	150,000	169,596	2031/9/12		
令和3年度第1回長野県公募公債	0.19	400,000	392,568	2031/4/16	平成24年度第3回神戸市公募公債 (20年)	1.635	500,000	558,600	2032/8/13		
令和元年度第2回茨城県公募公債	0.19	500,000	487,355	2039/7/29	平成24年度第12回神戸市公募公債 (20年)	1.711	500,000	561,585	2032/12/17		
令和2年度第2回茨城県公募公債	0.356	300,000	297,903	2040/7/31	平成25年度第12回神戸市公募公債 (20年)	1.52	100,000	110,461	2034/2/17		
第2回群馬県公募公債 (20年)	0.2	340,000	331,846	2039/6/17	平成26年度第3回神戸市公募公債 (20年)	1.482	300,000	330,069	2034/7/14		
第3回群馬県公募公債 (20年)	1.687	600,000	674,280	2032/6/25	平成27年度第9回神戸市公募公債 (20年)	1.007	100,000	103,814	2036/1/25		
第4回群馬県公募公債 (20年)	1.667	100,000	111,988	2033/6/17	平成28年度第9回神戸市公募公債 (20年)	0.645	400,000	393,796	2037/7/23		
第5回群馬県公募公債 (20年)	1.529	600,000	663,270	2034/6/16	平成29年度第5回神戸市公募公債 (20年)	0.597	200,000	194,034	2037/9/18		
第6回群馬県公募公債 (20年)	1.267	600,000	643,758	2035/6/11	平成30年度第6回神戸市公募公債 (20年)	0.668	300,000	290,691	2038/9/17		
第7回群馬県公募公債 (20年)	0.313	700,000	663,138	2036/6/13	令和元年度第6回神戸市公募公債 (20年)	2	400,000	353,744	2039/9/20		
第9回群馬県公募公債 (20年)	0.554	400,000	382,260	2038/6/11	第1回横浜市公募公債 (30年)	2.63	500,000	615,605	2034/9/20		
第10回群馬県公募公債 (20年)	0.338	500,000	454,835	2039/6/17	第2回横浜市公募公債 (30年)	2.49	500,000	609,500	2035/3/20		
第11回群馬県公募公債 (20年)	0.416	400,000	363,236	2040/6/12	第4回横浜市公募公債 (30年)	2.54	210,000	259,803	2036/12/19		
令和元年度第1回大分県公募公債	0.19	600,000	585,384	2039/7/15	第25回横浜市公募公債 (20年)	1.72	400,000	450,428	2032/7/16		
令和2年度第1回大分県公募公債	0.281	540,000	530,544	2040/7/10	第26回横浜市公募公債 (20年)	1.776	300,000	338,955	2033/1/28		
平成24年度第1回堺市公募公債	1.732	600,000	675,006	2032/11/12	第27回横浜市公募公債 (20年)	1.599	300,000	333,993	2033/5/20		
平成30年度第2回長崎県公募公債	0.491	470,590	471,286	2038/8/20	第28回横浜市公募公債 (20年)	1.586	300,000	333,621	2033/11/11		
令和元年度第2回長崎県公募公債	0.18	400,000	389,440	2039/8/26	第29回横浜市公募公債 (20年)	1.528	200,000	221,120	2034/5/26		
平成28年度第2回島根県公募公債 (20年)	0.506	100,000	96,890	2036/9/30	第30回横浜市公募公債 (20年)	1.376	550,000	598,554	2034/10/20		
平成29年度第2回島根県公募公債	0.583	700,000	677,810	2037/9/18	第31回横浜市公募公債 (20年)	1.18	300,000	318,819	2035/4/20		
平成30年度第2回島根県公募公債	0.668	700,000	678,279	2038/9/17	第35回横浜市公募公債 (20年)	0.443	100,000	95,951	2036/10/28		

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40回横浜市公募公債（20年）	0.559	700,000	670,565	2038/4/16	令和元年度第2回仙台市公募公債	0.15	700,000	679,147	2039/10/14
平成24年度第1回札幌市公募公債（20年）	1.79	600,000	678,918	2032/4/23	平成24年度第2回福井県公募公債	1.711	100,000	112,277	2032/12/21
平成24年度第4回札幌市公募公債（20年）	1.635	200,000	223,440	2032/8/13	平成25年度第1回福井県公募公債	1.667	100,000	112,000	2033/6/21
平成24年度第11回札幌市公募公債（20年）	1.794	100,000	113,211	2033/2/28	平成26年度第1回福井県公募公債	1.482	100,000	110,031	2034/7/18
平成25年度第1回札幌市公募公債（20年）	1.72	200,000	225,154	2033/6/14	平成27年度第1回福井県公募公債	1.28	600,000	644,244	2035/7/17
平成25年度第10回札幌市公募公債（20年）	1.53	300,000	331,740	2034/3/17	平成28年度第1回福井県公募公債	0.18	700,000	649,432	2036/7/29
平成26年度第1回札幌市公募公債（20年）	1.524	500,000	552,580	2034/5/26	平成29年度第1回福井県公募公債	0.659	100,000	98,062	2037/7/24
平成26年度第10回札幌市公募公債（20年）	1.267	400,000	429,480	2035/3/20	平成30年度第1回福井県公募公債	0.535	500,000	475,670	2038/7/30
平成27年度第3回札幌市公募公債（20年）	1.211	200,000	213,154	2035/7/31	令和元年度第1回福井県公募公債	0.286	400,000	360,104	2039/7/29
平成29年度第5回札幌市公募公債（20年）	0.597	600,000	582,102	2037/9/18	令和2年度第1回福井県公募公債	0.249	553,846	542,586	2040/7/13
平成30年度第8回札幌市公募公債（20年）	0.626	700,000	672,350	2038/12/20	令和2年度第3回福井県公募公債	0.449	600,000	547,062	2040/8/3
令和元年度第4回札幌市公募公債（20年）	0.15	268,440	260,612	2039/9/20	令和元年度第1回徳島県公募公債	0.18	340,000	331,129	2039/7/29
令和2年度第5回札幌市公募公債（20年）	0.445	700,000	636,734	2040/10/12	令和2年度第1回徳島県公募公債	0.281	360,000	353,959	2040/7/31
第14回川崎市公募公債（20年）	1.79	100,000	113,162	2032/3/19	令和元年度第1回岡山県公募公債	0.192	350,000	341,043	2039/12/20
第15回川崎市公募公債（20年）	1.727	300,000	337,563	2032/9/17	第5回神奈川県住宅供給公社債券	0.709	600,000	573,684	2038/4/23
第18回川崎市公募公債（20年）	1.541	600,000	664,194	2034/3/17	第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	400,000	393,472	2029/4/23
第20回川崎市公募公債（20年）	1.133	200,000	211,510	2035/3/20	第7回神奈川県住宅供給公社債券	0.534	300,000	275,217	2039/4/22
第21回川崎市公募公債（20年）	1.11	200,000	210,500	2035/9/20	第1回川崎市土地開発公社債券	0.02	700,000	697,914	2024/6/25
第22回川崎市公募公債（20年）	0.377	600,000	574,170	2036/4/22	第2回営企業債券（30年）	2.39	100,000	119,597	2033/12/20
第23回川崎市公募公債（20年）	0.549	300,000	292,509	2036/9/19	第3回営企業債券（30年）	2.59	300,000	365,154	2033/12/20
第24回川崎市公募公債（20年）	0.683	100,000	98,666	2037/4/17	第8回地方公共団体金融機構債券（30年）	2.5	200,000	243,924	2035/9/21
第27回川崎市公募公債（20年）	0.559	300,000	287,385	2038/4/16	第21回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.812	100,000	112,960	2032/4/28
第30回川崎市公募公債（20年）	0.2	600,000	533,040	2039/6/20	第24回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.702	500,000	560,706	2032/9/28
第33回川崎市公募公債（20年）	0.44	600,000	546,966	2040/6/20	第32回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.624	100,000	111,394	2033/10/28
第13回北九州市公募公債（20年）	1.706	400,000	449,896	2032/7/16	第33回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.668	500,000	559,230	2033/12/28
第14回北九州市公募公債（20年）	1.732	600,000	675,336	2032/11/12	第35回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.569	300,000	332,349	2034/3/28
第15回北九州市公募公債（20年）	1.667	100,000	111,931	2033/6/17	第37回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.535	200,000	220,782	2034/6/28
第16回北九州市公募公債（20年）	1.604	100,000	111,256	2033/10/11	第40回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.381	600,000	651,522	2034/10/27
第17回北九州市公募公債（20年）	1.529	600,000	662,580	2034/6/20	第42回地方公共団体金融機構債券（20年）	0.999	100,000	103,978	2035/1/26
第18回北九州市公募公債（20年）	1.376	200,000	217,410	2034/10/20	第44回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.298	300,000	321,906	2035/6/28
第19回北九州市公募公債（20年）	1.312	600,000	646,236	2035/6/19	第46回地方公共団体金融機構債券（20年）	1.189	100,000	105,882	2035/9/28
第20回北九州市公募公債（20年）	1.111	100,000	105,088	2035/10/26	第51回地方公共団体金融機構債券（20年）	0.377	400,000	381,104	2036/4/28
平成24年度第2回福岡市公募公債（20年）	1.702	400,000	449,764	2032/7/20	第67回地方公共団体金融機構債券（20年）	0.564	200,000	190,592	2038/6/28
平成24年度第6回福岡市公募公債（20年）	1.696	300,000	336,672	2032/9/17	第77回地方公共団体金融機構債券（20年）	0.2	500,000	440,185	2039/9/28
平成25年度第1回福岡市公募公債（20年）	1.808	100,000	113,472	2033/7/19	第79回地方公共団体金融機構債券（20年）	0.345	400,000	359,552	2039/12/28
平成25年度第6回福岡市公募公債（20年）	1.511	400,000	441,460	2034/2/17	第80回地方公共団体金融機構債券（20年）	0.354	500,000	449,590	2040/1/27
平成26年度第2回福岡市公募公債（20年）	1.49	600,000	660,732	2034/6/20	第83回地方公共団体金融機構債券（20年）	0.44	400,000	362,960	2040/6/28
平成26年度第6回福岡市公募公債（20年）	1.371	200,000	217,464	2034/9/20	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	295,305	2037/2/27
平成27年度第6回福岡市公募公債（20年）	1.121	100,000	105,295	2035/12/18	第12回大阪府住宅供給公社債券	0.395	300,000	300,486	2027/6/18
平成28年度第6回福岡市公募公債（20年）	0.429	700,000	669,858	2036/11/25	第12回大阪府住宅供給公社債券	0.34	500,000	497,215	2028/6/20
平成30年度第7回福岡市公募公債（20年）	0.701	700,000	681,429	2038/10/19	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	503,575	2032/2/27
平成31年度第3回福岡市公募公債（20年）	0.419	600,000	554,790	2039/4/22	第13回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.768	400,000	393,996	2037/2/27
2019年度第5回福岡市公募公債（20年）	0.286	300,000	270,078	2039/7/29	第15回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.32	400,000	351,512	2040/2/28
2019年度第7回福岡市公募公債（20年）	0.271	500,000	447,105	2039/10/24	第121回福岡北九州高速道路債券	2.31	400,000	451,228	2029/12/20
平成29年度第2回広島市公募公債	0.616	200,000	194,700	2037/8/18	第147回福岡北九州高速道路債券	0.502	500,000	503,035	2032/3/19
平成29年度第4回広島市公募公債	0.62	600,000	583,050	2037/11/20	第148回福岡北九州高速道路債券	0.731	500,000	489,770	2037/3/19
平成30年度第2回広島市公募公債	0.639	700,000	676,004	2038/8/20	第150回福岡北九州高速道路債券	0.396	600,000	587,238	2033/3/18
平成30年度第4回広島市公募公債	0.706	700,000	681,352	2038/11/19	第24回東京都住宅供給公社債券	0.519	500,000	474,775	2036/9/12
令和元年度第2回広島市公募公債	0.2	800,000	708,416	2039/8/19	第26回東京都住宅供給公社債券	0.697	600,000	576,252	2037/9/11
令和2年度第2回広島市公募公債	0.355	400,000	362,460	2039/11/21	第29回東京都住宅供給公社債券	0.749	200,000	191,358	2038/9/17
令和2年度第2回広島市公募公債	0.435	500,000	454,375	2040/8/21	第30回東京都住宅供給公社債券	0.496	160,000	158,654	2038/9/17
平成29年度第1回仙台市公募公債	0.616	700,000	680,372	2037/10/19	第32回東京都住宅供給公社債券	0.341	300,000	264,300	2039/9/26
平成30年度第2回仙台市公募公債	0.729	700,000	684,677	2038/10/18	第33回東京都住宅供給公社債券	0.25	255,000	246,811	2039/9/26
令和元年度第1回仙台市公募公債	0.17	340,000	330,571	2039/8/19	第36回東京都住宅供給公社債券	0.416	400,000	382,352	2034/12/22

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		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第37回東京都住宅供給公社債券	0.435	200,000	190,458	2035/9/21	第530回中部電力株式会社社債	0.274	600,000	580,848	2029/6/25
小 計		134,082,876	135,352,120		第554回中部電力株式会社社債	0.463	100,000	96,832	2032/2/25
特殊債券(除く金融債)					第556回中部電力株式会社社債	0.544	800,000	779,792	2032/4/23
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	127,576	2038/6/30	第511回関西電力株式会社社債	0.41	600,000	593,334	2027/9/17
第19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	441,532	2034/5/31	第515回関西電力株式会社社債	0.435	600,000	591,546	2028/4/25
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	551,220	2034/6/30	第518回関西電力株式会社社債	0.44	300,000	295,539	2028/6/20
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	549,065	2034/7/31	第541回関西電力株式会社社債	0.37	800,000	758,384	2031/9/19
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	546,995	2034/8/31	第544回関西電力株式会社社債	0.34	500,000	473,390	2031/10/24
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	547,280	2034/9/29	第548回関西電力株式会社社債	0.574	900,000	872,298	2032/4/23
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	543,915	2034/10/31	第551回関西電力株式会社社債	0.664	800,000	780,648	2032/5/25
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	542,490	2034/11/30	第378回中国電力株式会社社債	1.004	300,000	302,640	2023/10/25
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	536,845	2034/12/28	第398回中国電力株式会社社債	0.425	400,000	396,956	2027/7/23
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	522,145	2035/1/31	第404回中国電力株式会社社債	0.355	100,000	98,426	2028/4/25
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	532,680	2035/2/28	第416回中国電力株式会社社債	0.355	300,000	292,272	2029/5/25
第42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	535,825	2035/3/30	第434回中国電力株式会社社債	0.463	500,000	484,160	2032/2/25
第45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	632,832	2035/4/27	第436回中国電力株式会社社債	0.534	300,000	292,026	2032/4/23
第46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	320,016	2035/5/31	第443回中国電力株式会社社債	0.59	800,000	796,368	2028/8/25
第50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	646,986	2035/6/29	第311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	202,540	2027/9/24
第52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	751,576	2035/7/31	第314回北陸電力株式会社社債	0.36	100,000	99,731	2026/2/25
第55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	107,049	2035/8/31	第318回北陸電力株式会社社債	0.26	450,000	445,338	2026/12/25
第57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	106,689	2035/9/28	第321回北陸電力株式会社社債	0.365	300,000	297,627	2027/4/23
第62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	739,585	2035/11/30	第322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	495,955	2027/6/25
第64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	211,318	2035/12/28	第342回北陸電力株式会社社債	0.3	100,000	95,328	2031/4/25
第72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	681,023	2036/3/31	第349回北陸電力株式会社社債	0.544	600,000	584,844	2032/4/23
第78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	471,065	2036/5/30	第491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	596,856	2027/2/25
第84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	464,255	2036/7/31	第492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	397,196	2027/4/23
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	478,955	2036/10/31	第496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	296,427	2027/9/24
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	194,644	2036/11/28	第517回東北電力株式会社社債	0.31	100,000	96,248	2030/2/25
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	487,860	2036/12/26	第536回東北電力株式会社社債	0.29	400,000	379,532	2031/9/25
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	590,502	2037/1/30	第538回東北電力株式会社社債	0.33	700,000	668,444	2031/11/25
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	699,748	2037/2/27	第541回東北電力株式会社社債	0.35	700,000	668,584	2032/1/23
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	99,097	2037/3/31	第543回東北電力株式会社社債	0.34	700,000	693,063	2027/4/23
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	586,128	2037/5/29	第544回東北電力株式会社社債	0.574	700,000	681,156	2032/4/23
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	97,266	2037/6/30	第281回四国電力株式会社社債	1.111	500,000	504,630	2023/9/25
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	581,916	2037/8/31	第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	99,014	2026/11/25
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	96,759	2037/9/30	第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	197,988	2027/11/25
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	583,014	2037/10/30	第307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	288,816	2029/9/25
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	677,390	2037/11/30	第309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	483,590	2030/5/24
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	96,308	2038/3/31	第317回四国電力株式会社社債	0.6	200,000	176,922	2041/10/25
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	670,698	2038/5/31	第320回四国電力株式会社社債	0.534	200,000	194,684	2032/4/23
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	95,801	2038/6/30	第323回四国電力株式会社社債	0.659	800,000	786,480	2032/6/25
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	677,446	2038/8/31	第465回九州電力株式会社社債	0.38	500,000	491,404	2028/7/25
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	483,135	2038/9/30	第489回九州電力株式会社社債	0.44	400,000	387,184	2030/5/24
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	682,724	2038/10/29	第502回九州電力株式会社社債	0.493	500,000	483,360	2032/2/25
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	97,252	2038/11/30	第504回九州電力株式会社社債	0.589	700,000	683,291	2032/4/23
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	671,650	2038/12/28	第507回九州電力株式会社社債	0.644	800,000	782,352	2032/5/25
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	662,774	2039/1/31	第321回北海道電力株式会社社債	0.886	11,000	11,133	2032/12/25
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	655,949	2039/2/28	第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	198,654	2027/6/25
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	650,692	2039/3/31	第372回北海道電力株式会社社債	0.33	200,000	189,944	2031/12/25
第211回政府保証民間都市開発債券	0.618	300,000	288,828	2038/12/27	第15回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.89	600,000	585,528	2030/7/24
第22回政府保証民間都市開発債券	0.245	1,000,000	889,270	2040/2/28	第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	600,000	594,126	2029/10/9
第23回政府保証民間都市開発債券	0.397	800,000	727,312	2040/6/29	第40回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.37	500,000	491,380	2035/7/13
小 計		23,600,000	23,633,080		第45回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.8	800,000	771,856	2031/4/22

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46回東京電力パワーグリッド株式会社社債		1.05	700,000	663,957	2036/4/22	第166回一般担保住宅金融支援機構債券		1.221	100,000	106,155	2035/8/20
第48回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.88	800,000	738,800	2036/8/29	第220回一般担保住宅金融支援機構債券		0.616	200,000	193,350	2037/10/20
第50回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.94	800,000	776,344	2032/4/26	第239回一般担保住宅金融支援機構債券		0.393	300,000	295,470	2033/6/20
第14回新関西国際空港株式会社社債		1.318	600,000	639,960	2034/12/20	第255回一般担保住宅金融支援機構債券		0.548	200,000	188,368	2039/1/20
第16回新関西国際空港株式会社社債		1.249	300,000	316,566	2035/9/20	第257回一般担保住宅金融支援機構債券		0.362	300,000	292,179	2034/2/20
第18回新関西国際空港株式会社社債		0.675	500,000	479,780	2037/12/18	第279回一般担保住宅金融支援機構債券		0.285	800,000	764,128	2034/12/20
第23回新関西国際空港株式会社社債		0.512	700,000	645,855	2038/12/20	第283回一般担保住宅金融支援機構債券		0.274	400,000	380,672	2035/2/20
第97回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.536	700,000	662,445	2038/7/12	第308回一般担保住宅金融支援機構債券		0.306	400,000	378,308	2035/12/20
第108回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.439	700,000	645,631	2039/4/11	第315回一般担保住宅金融支援機構債券		0.362	500,000	474,620	2036/4/18
第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.253	400,000	355,972	2039/7/11	第21回成田国際空港株式会社社債		0.427	500,000	471,535	2036/8/22
第125回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.379	700,000	628,922	2040/4/24	第23回成田国際空港株式会社社債		0.677	700,000	680,687	2036/12/16
第130回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.479	500,000	455,815	2040/7/20	第25回成田国際空港株式会社社債		0.671	300,000	287,709	2037/12/18
第135回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.35	500,000	476,875	2035/10/15	第27回成田国際空港株式会社社債		0.657	600,000	572,340	2038/3/12
第147回株式会社日本政策投資銀行無担保社債		0.443	200,000	179,104	2041/7/12	第30回成田国際空港株式会社社債		0.77	700,000	674,408	2038/10/22
第34回日本政策投資銀行債券		2.67	200,000	249,952	2037/3/19	第35回成田国際空港株式会社社債		0.27	100,000	87,482	2039/9/16
第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.7	100,000	124,279	2035/9/20	第36回成田国際空港株式会社社債		0.2	400,000	391,680	2030/1/29
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.59	200,000	246,022	2035/12/20	第37回成田国際空港株式会社社債		0.424	300,000	267,903	2040/1/27
第6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	657,160	2038/9/17	第39回成田国際空港株式会社社債		0.409	600,000	570,240	2035/10/26
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.9	500,000	568,250	2032/3/19	第40回成田国際空港株式会社社債		0.529	500,000	463,750	2038/10/28
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.773	500,000	562,920	2032/9/17	第41回成田国際空港株式会社社債		0.575	600,000	544,644	2040/10/26
第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.55	500,000	551,590	2034/3/17	第15回国際協力機構債券		1.724	300,000	336,348	2032/9/17
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.133	100,000	105,206	2035/3/20	第19回国際協力機構債券		1.725	100,000	112,245	2033/6/20
第191回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.661	200,000	194,256	2037/12/18	第21回国際協力機構債券		1.734	100,000	112,318	2033/9/20
第194回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.64	500,000	483,900	2037/12/18	第25回国際協力機構債券		1.52	600,000	659,802	2034/6/20
第210回日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.677	700,000	675,836	2038/9/17	第27回国際協力機構債券		1.451	400,000	436,556	2034/9/20
第9回道路債		2.9	100,000	123,096	2032/5/20	第33回国際協力機構債券		1.13	100,000	104,830	2035/12/20
第21回道路債		2.75	100,000	122,800	2033/6/20	第36回国際協力機構債券		0.313	100,000	94,138	2036/6/20
第28回道路債		2.83	500,000	620,655	2033/12/20	第39回国際協力機構債券		0.744	400,000	396,592	2037/2/20
第33回道路債		2.91	100,000	125,553	2034/6/20	第43回国際協力機構債券		0.625	700,000	676,046	2037/12/18
第43回道路債		2.66	200,000	246,170	2034/12/20	第45回国際協力機構債券		0.559	600,000	570,216	2038/6/18
第124回都市再生債券		0.273	300,000	280,746	2036/6/20	第49回国際協力機構債券		0.333	300,000	270,906	2039/6/20
第128回都市再生債券		0.39	500,000	474,405	2036/9/19	第54回国際協力機構債券		0.445	600,000	544,092	2040/6/26
第131回都市再生債券		0.487	500,000	479,720	2036/11/25	第56回国際協力機構債券		0.459	700,000	635,040	2040/9/20
第133回都市再生債券		0.767	200,000	198,890	2037/2/20	第58回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		1.81	600,000	678,750	2033/8/19
第141回都市再生債券		0.63	100,000	96,405	2038/2/19	第63回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		1.56	400,000	441,764	2034/2/27
第145回都市再生債券		0.584	300,000	286,338	2038/6/18	第69回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		1.441	500,000	545,320	2034/8/4
第150回都市再生債券		0.716	500,000	484,635	2038/11/19	第75回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		1.157	200,000	211,036	2035/2/26
第156回都市再生債券		0.343	400,000	362,060	2039/6/17	第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		1.221	200,000	212,302	2035/8/17
第157回都市再生債券		0.2	400,000	351,716	2039/9/16	第96回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.274	700,000	690,403	2031/11/28
第160回都市再生債券		0.335	600,000	537,726	2039/12/19	第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.739	500,000	495,410	2037/2/27
第167回都市再生債券		0.43	300,000	269,631	2040/12/20	第102回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.428	500,000	499,605	2032/5/28
第6回中部国際空港株式会社社債		0.206	500,000	493,610	2029/2/22	第106回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.616	500,000	484,150	2037/8/25
第88回一般担保住宅金融支援機構債券		1.863	100,000	112,706	2031/11/18	第113回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.63	200,000	192,800	2038/2/26
第94回一般担保住宅金融支援機構債券		1.882	500,000	566,295	2032/2/13	第115回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.395	100,000	98,568	2033/5/30
第97回一般担保住宅金融支援機構債券		1.903	100,000	113,652	2032/3/12	第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.663	400,000	385,456	2038/8/27
第106回一般担保住宅金融支援機構債券		1.794	100,000	112,736	2032/6/18	第121回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.515	500,000	496,490	2033/11/28
第109回一般担保住宅金融支援機構債券		1.787	200,000	225,414	2032/7/16	第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.292	600,000	577,926	2034/5/30
第115回一般担保住宅金融支援機構債券		1.811	500,000	564,720	2032/9/14	第3回I N P E X株式会社無担保社債		0.25	600,000	584,526	2031/10/15
第118回一般担保住宅金融支援機構債券		1.814	100,000	113,023	2032/10/15	第22回株式会社大林組無担保社債		0.385	600,000	596,340	2028/9/13
第120回一般担保住宅金融支援機構債券		1.836	400,000	452,944	2032/11/12	第23回株式会社大林組無担保社債		0.13	500,000	499,915	2033/10/25
第125回一般担保住宅金融支援機構債券		1.898	100,000	113,898	2033/1/25	第23回清水建設株式会社無担保社債		0.25	800,000	801,200	2024/8/2
第127回一般担保住宅金融支援機構債券		1.923	300,000	342,525	2033/2/18	第24回清水建設株式会社無担保社債		0.365	200,000	199,164	2027/11/30
第130回一般担保住宅金融支援機構債券		1.763	200,000	225,014	2032/12/20	第25回清水建設株式会社無担保社債		0.27	200,000	196,070	2029/9/3
第159回一般担保住宅金融支援機構債券		1.125	300,000	315,132	2035/5/18	第26回清水建設株式会社無担保社債		0.11	300,000	299,523	2024/12/12

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	699,930	2028/11/1	第43回東洋紡株式会社無担保社債	0.25	400,000	393,840	2028/12/7
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	590,814	2029/7/19	第4回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,718	2024/12/20
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	499,750	2025/7/11	第5回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.33	300,000	297,639	2027/9/17
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	492,715	2030/7/12	第14回森ビル株式会社無担保社債	0.861	300,000	303,441	2024/8/14
第44回鹿島建設株式会社無担保社債	0.3	300,000	299,079	2026/7/22	第21回森ビル株式会社無担保社債	0.44	600,000	599,628	2027/2/16
第46回鹿島建設株式会社無担保社債	0.11	300,000	298,920	2025/2/28	第130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	498,310	2027/7/30
第8回西松建設株式会社無担保社債	0.18	800,000	798,744	2024/9/20	第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	700,000	699,118	2027/7/16
第10回西松建設株式会社無担保社債	0.33	500,000	500,025	2025/7/18	第31回東レ株式会社無担保社債	0.25	600,000	600,744	2024/7/19
第26回前田建設工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	299,301	2024/9/12	第33回東レ株式会社無担保社債	0.38	400,000	397,412	2028/7/18
第3回住友林業株式会社無担保社債	0.33	600,000	599,766	2026/6/17	第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	595,302	2028/4/25
第5回住友林業株式会社無担保社債	0.35	400,000	396,536	2028/3/7	第10回旭化成株式会社無担保社債	0.1	400,000	400,072	2023/12/6
第8回住友林業株式会社無担保社債	0.38	500,000	494,185	2029/3/6	第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	499,405	2024/9/6
第9回住友林業株式会社無担保社債	0.28	700,000	683,123	2029/12/6	第12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	490,255	2029/9/16
第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	99,652	2027/6/1	第15回旭化成株式会社無担保社債	0.28	500,000	490,310	2030/6/19
第21回積水ハウス株式会社無担保社債	0.2	800,000	797,248	2026/7/17	第33回王子製紙株式会社無担保社債	0.28	700,000	701,323	2025/1/24
第4回協和エクスオ株式会社無担保社債	0.12	500,000	498,185	2024/10/25	第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	199,916	2028/1/26
第5回協和エクスオ株式会社無担保社債	0.19	200,000	197,972	2026/10/23	第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	299,445	2028/11/29
第1回高砂熱学工業株式会社無担保社債	0.37	200,000	200,248	2024/4/19	第90回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	700,000	688,422	2030/7/17
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	586,290	2029/7/13	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	600,090	2024/3/13
第13回森永乳業株式会社無担保社債	0.884	500,000	505,495	2024/5/8	第25回レンゴー株式会社無担保社債	0.415	200,000	198,030	2028/12/13
第14回森永乳業株式会社無担保社債	0.774	100,000	101,419	2025/12/10	第27回レンゴー株式会社無担保社債	0.3	800,000	782,856	2029/12/12
第15回森永乳業株式会社無担保社債	0.37	700,000	696,654	2027/7/23	第49回住友化学株式会社無担保社債	0.944	100,000	101,233	2024/4/25
第16回森永乳業株式会社無担保社債	0.395	200,000	198,034	2028/9/14	第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	698,068	2027/9/13
第17回森永乳業株式会社無担保社債	0.24	400,000	388,724	2029/9/6	第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,276	2028/4/17
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	300,150	2024/9/13	第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	396,264	2029/4/16
第1回雪印メグミルク株式会社無担保社債	0.45	800,000	792,464	2028/12/25	第22回デンカ株式会社無担保社債	0.23	500,000	495,300	2026/12/4
第10回日本ハム株式会社無担保社債	0.15	200,000	199,958	2024/2/20	第10回イビデン株式会社無担保社債	0.11	600,000	598,368	2024/9/12
第11回日本ハム株式会社無担保社債	0.25	700,000	698,159	2026/2/20	第3回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	397,600	2028/2/29
第12回日本ハム株式会社無担保社債	0.36	600,000	592,872	2029/2/20	第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	600,000	596,712	2028/8/31
第3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	594,252	2026/9/4	第6回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.38	400,000	392,636	2030/5/31
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	486,125	2029/9/5	第8回株式会社サネカ無担保社債	0.24	200,000	194,674	2029/9/12
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	698,033	2027/6/11	第23回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	0.34	400,000	392,804	2030/9/3
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	504,445	2025/2/28	第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	300,000	300,447	2024/7/24
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	782,656	2029/9/5	第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	99,805	2027/7/23
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	98,155	2030/6/4	第50回三井化学株式会社無担保社債	0.27	500,000	489,800	2029/12/5
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	400,216	2024/4/25	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	597,600	2028/12/19
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	198,742	2027/4/23	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	976,150	2030/2/28
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	797,224	2026/6/2	第17回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.5	200,000	197,544	2030/12/13
第10回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.519	800,000	790,776	2032/6/8	第6回積水化学工業株式会社無担保社債	0.28	700,000	701,015	2026/6/12
第3回コカ・コーポラトーズジャパンホールディングス株式会社	0.27	600,000	586,950	2029/9/19	第7回積水化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	489,760	2029/9/13
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	600,000	599,286	2024/2/23	第4回日本化薬株式会社無担保社債	0.13	400,000	398,428	2024/12/20
第12回清オリエントグループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	297,837	2027/12/3	第3回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.25	600,000	597,588	2026/9/16
第2回株式会社J・オイルミルズ無担保社債	0.37	600,000	596,556	2027/5/28	第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	600,000	596,352	2028/3/23
第33回双日株式会社無担保社債	0.519	400,000	401,408	2024/3/8	第6回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.24	500,000	498,065	2029/9/27
第35回双日株式会社無担保社債	0.605	300,000	299,235	2028/3/8	第3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	697,459	2028/10/25
第24回味の素株式会社無担保社債	0.19	500,000	500,430	2024/3/8	第1回株式会社ADEKA無担保社債	0.18	300,000	299,433	2024/3/15
第25回味の素株式会社無担保社債	0.355	700,000	700,441	2027/3/9	第16回武田薬品工業株式会社無担保社債	0.4	1,000,000	965,050	2031/10/14
第3回キュービー株式会社無担保社債	0.23	700,000	697,935	2026/2/13	第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	500,000	499,735	2024/5/31
第23回株式会社ニチレイ無担保社債	0.19	600,000	600,324	2023/10/25	第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	595,176	2027/6/2
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	700,000	699,307	2025/8/29	第7回テルモ株式会社無担保社債	0.24	200,000	198,828	2026/4/17
第25回株式会社ニチレイ無担保社債	0.24	300,000	297,438	2027/8/31	第9回テルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	994,360	2027/4/26
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	300,000	303,240	2024/4/24	第3回みちろホールディングス株式会社無担保社債	0.15	400,000	398,052	2024/10/25
第8回ヒューリック株式会社無担保社債	0.3	700,000	697,004	2026/6/25	第4回第一三共株式会社無担保社債	0.846	600,000	604,572	2023/9/15
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	695,156	2027/8/4	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	199,914	2024/9/7

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	300,015	2026/3/6	第7回株式会社ジェイテック無担保社債	0.345	400,000	395,588	2028/3/8
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	993,620	2029/3/7	第9回株式会社ジェイテック無担保社債	0.28	500,000	486,645	2029/11/28
第37回D I C株式会社無担保社債	1.0	100,000	102,218	2025/9/18	第5回株式会社ジェイテック無担保社債	0.28	600,000	600,648	2026/12/8
第14回株式会社オリエントラランズ無担保社債	0.23	500,000	500,120	2026/1/23	第14回T H K株式会社無担保社債	0.29	700,000	698,880	2026/2/6
第15回株式会社オリエントラランズ無担保社債	0.305	700,000	693,686	2029/1/25	第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	600,000	605,148	2023/12/13
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	800,088	2023/10/31	第30回富士電機株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,227	2027/5/21
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	796,904	2024/10/31	第8回日本電産株式会社無担保社債	0.1	800,000	798,296	2024/7/19
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	299,217	2027/3/3	第53回日本電気株式会社無担保社債	0.26	300,000	300,369	2023/9/21
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	200,276	2025/12/5	第15回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.34	300,000	300,087	2026/9/18
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	499,470	2024/7/26	第17回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.36	700,000	697,060	2027/9/6
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	499,400	2025/3/5	第22回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.45	800,000	787,424	2030/7/16
第9回荒川化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	498,700	2024/12/19	第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	400,000	402,156	2026/9/18
第9回出光興産株式会社無担保社債	0.18	400,000	397,368	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	588,672	2030/3/5
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	101,091	2024/6/4	第32回ソニー株式会社無担保社債	0.28	100,000	100,201	2023/9/20
第13回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	699,426	2026/7/28	第33回ソニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	301,542	2026/9/18
第2回J X T Oホールディングス株式会社無担保社債	0.405	700,000	698,460	2027/8/3	第35回ソニー株式会社無担保社債	0.18	400,000	397,984	2026/10/9
第4回E N E O Sホールディングス株式会社無担保社債	0.834	400,000	399,404	2032/6/15	第36回ソニー株式会社無担保社債	0.3	700,000	687,799	2029/10/10
第13回横浜ゴム株式会社無担保社債	0.25	100,000	100,108	2023/12/8	第6回T D K株式会社無担保社債	0.31	200,000	198,568	2027/7/28
第16回横浜ゴム株式会社無担保社債	0.58	800,000	790,904	2032/6/4	第7回T D K株式会社無担保社債	0.43	800,000	785,600	2030/7/26
第10回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.2	500,000	500,465	2024/4/19	第5回株式会社堀場製作所無担保社債	0.18	700,000	691,558	2026/10/16
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	800,000	798,016	2027/4/21	第6回株式会社堀場製作所無担保社債	0.27	600,000	582,252	2029/10/17
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	200,000	199,970	2026/4/17	第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	1,000,000	996,270	2027/6/18
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	994,110	2029/4/19	第5回スタンレー電気株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,220	2024/4/19
第3回パンドー化学株式会社無担保社債	0.4	200,000	200,104	2024/1/19	第2回株式会社村田製作所無担保社債	0.15	700,000	699,629	2024/1/24
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	599,202	2027/5/28	第3回株式会社村田製作所無担保社債	0.06	800,000	797,208	2024/9/10
第1回A G C株式会社無担保社債	0.23	700,000	700,014	2025/10/10	第1回東海理化電機製作所無担保社債	0.34	300,000	296,967	2027/6/7
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.37	800,000	793,808	2028/6/14	第43回株式会社I H I 無担保社債	0.2	400,000	398,728	2024/10/17
第10回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.11	400,000	399,224	2024/6/20	第4回昭和リース株式会社無担保社債	0.3	800,000	794,680	2024/12/18
第11回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.27	500,000	490,325	2029/6/20	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	497,180	2029/9/4
第1回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.28	400,000	399,960	2026/9/18	第7回コンコルディア・フィナンシャルグループ(劣後)	0.6	500,000	497,960	2030/9/3
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.22	500,000	500,770	2024/5/20	第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	600,000	595,320	2026/9/25
第4回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,815	2027/5/20	第13回本田技研工業株式会社無担保社債	0.12	800,000	798,656	2025/3/5
第5回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.23	400,000	400,692	2024/12/20	第14回本田技研工業株式会社無担保社債	0.15	800,000	791,976	2027/3/5
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	687,309	2029/6/20	第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	400,000	399,416	2025/3/13
第22回ジェイアールホールディングス株式会社無担保社債	0.703	600,000	606,078	2024/9/19	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	699,545	2023/9/25
第28回ジェイアールホールディングス株式会社無担保社債	0.26	500,000	498,910	2026/5/27	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	798,704	2024/8/1
第29回ジェイアールホールディングス株式会社無担保社債	0.365	600,000	591,990	2029/5/25	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	797,088	2024/8/2
第32回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.25	800,000	778,464	2029/12/13	第1回日本生命2021基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	0.28	400,000	397,324	2026/8/3
第26回住友電気工業株式会社無担保社債	0.3	700,000	696,059	2027/3/1	第3回株式会社トプコン無担保社債	0.3	500,000	498,610	2025/6/14
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	597,546	2026/12/16	第4回大日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	788,736	2029/7/19
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	584,190	2029/10/25	第2回株式会社アシックス無担保社債	0.2	600,000	599,478	2024/3/13
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	600,258	2024/3/8	第4回株式会社ニフコ無担保社債	0.25	500,000	499,400	2025/5/8
第29回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.08	500,000	497,500	2026/6/19	第5回株式会社ニフコ無担保社債	0.385	500,000	496,615	2028/5/8
第5回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.13	500,000	499,110	2024/7/24	第6回株式会社ニフコ無担保社債	0.28	700,000	685,293	2029/9/11
第6回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.29	400,000	390,592	2030/1/24	第102回丸紅株式会社無担保社債	0.756	300,000	302,883	2024/7/25
第15回株式会社クボタ無担保社債	0.514	600,000	595,818	2032/6/2	第7回長瀬産業株式会社無担保社債	0.29	600,000	584,298	2029/12/12
第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,652	2026/9/30	第8回長瀬産業株式会社無担保社債	0.64	400,000	385,294	2032/6/9
第23回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.13	600,000	595,980	2026/10/9	第17回豊田通商株式会社無担保社債	0.81	100,000	100,809	2023/12/5
第24回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.18	600,000	586,554	2029/10/11	第18回豊田通商株式会社無担保社債	1.014	200,000	204,570	2025/12/5
第27回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.26	300,000	293,412	2030/9/18	第19回豊田通商株式会社無担保社債	0.954	100,000	102,292	2026/7/10
第6回株式会社タダノ無担保社債	0.25	800,000	790,656	2026/12/11	第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.24	800,000	800,616	2024/2/22
第1回グローリー株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,105	2023/12/6	第63回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	217,974	2027/4/23
第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	298,665	2027/12/7	第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	800,000	786,528	2029/7/11
第51回日本精工株式会社無担保社債	0.19	300,000	298,458	2026/9/2	第75回三井物産株式会社無担保社債	0.23	700,000	682,752	2029/12/12

銘柄	利率	当 期 末				銘柄	利率	当 期 末			
		額面金額	評 価 額	償還年月日				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36回株式会社丸井グループ無担保社債	0.25	300,000	296,451	2026/10/16		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	539,590	2027/4/27	
第48回株式会社クレディセゾン無担保社債	1.038	200,000	201,792	2023/10/20		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	228,794	2029/9/28	
第6回株式会社新生銀行無担保社債	0.24	700,000	698,733	2023/12/13		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	422,724	2026/9/11	
第10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	695,660	2030/1/15		第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	500,000	495,185	2026/12/11	
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	100,758	2024/6/26		第3回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	0.529	600,000	597,366	2031/12/19	
第20回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.25	700,000	693,189	2027/11/4		第5回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	0.489	600,000	593,124	2032/9/17	
第3回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.42	600,000	579,318	2032/11/4		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	499,060	2026/6/19	
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	207,034	2030/6/18		第27回S B Iホールディングス株式会社無担保社債	0.8	800,000	799,784	2024/12/23	
第7回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ	0.71	700,000	690,837	2033/6/9		第33回リコリース株式会社無担保社債	0.19	600,000	599,946	2023/9/7	
第20回株式会社リソナホールディングス無担保社債	0.27	500,000	498,695	2025/7/23		第11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	796,688	2025/1/30	
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	201,144	2024/9/5		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	399,624	2024/5/28	
第2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	430,094	2026/2/27		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	199,410	2024/9/20	
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	793,792	2027/6/8		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	693,126	2026/9/18	
第15回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.53	600,000	596,766	2030/9/2		第17回株式会社ジャックス無担保社債	0.37	200,000	200,044	2024/6/7	
第16回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.4	1,000,000	986,530	2031/12/22		第9回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.54	500,000	500,720	2025/7/18	
第19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	722,056	2026/12/18		第32回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.55	800,000	769,928	2032/1/20	
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	660,564	2027/7/27		第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	300,000	305,985	2026/9/18	
第88回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	200,000	218,016	2027/4/20		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	598,842	2023/10/13	
第25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	684,552	2029/10/16		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	595,950	2024/12/5	
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	441,256	2030/9/27		第17回オリックス株式会社無担保社債	1.126	20,000	20,123	2023/4/28	
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	208,628	2025/11/12		第175回オリックス株式会社無担保社債	1.064	100,000	101,042	2023/11/24	
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	105,237	2026/1/20		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	403,384	2024/8/5	
第30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	105,945	2026/6/9		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	199,904	2024/9/13	
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	403,184	2024/9/12		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	298,227	2028/2/8	
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	824,224	2030/5/29		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	593,388	2028/8/3	
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	485,616	2025/10/15		第59回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.385	200,000	197,760	2028/5/26	
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	238,893	2026/6/15		第13回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.35	200,000	197,202	2028/7/12	
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	129,658	2026/9/15		第3回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.37	600,000	578,676	2031/12/1	
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	704,447	2028/3/16		第5回三菱HCキャピタル株式会社無担保社債	0.33	200,000	196,146	2029/1/24	
第24回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	500,000	534,575	2026/12/22		第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.34	200,000	199,376	2024/8/9	
第12回株式会社リソナ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.464	800,000	858,176	2027/3/15		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	699,349	2023/9/4	
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	603,672	2024/8/29		第5回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.75	800,000	797,264	2027/9/3	
第4回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.48	800,000	797,600	2029/4/26		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	399,792	2024/7/31	
第5回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.37	800,000	795,104	2029/11/26		第7回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.19	400,000	397,988	2026/11/13	
第6回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.49	800,000	795,760	2031/10/29		第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	113,621	2030/12/20	
第7回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.95	300,000	302,790	2032/9/27		第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	113,340	2033/8/2	
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	104,301	2025/10/28		第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	400,000	400,704	2026/3/13	
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	644,442	2026/4/27		第67回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	298,431	2029/4/13	
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	430,312	2027/5/10		第71回三井不動産株式会社無担保社債	0.31	600,000	588,870	2030/4/16	
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	318,126	2026/6/15		第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	227,582	2032/12/20	
第21回三井住友信託銀行株式会社無担保社債	0.15	700,000	693,105	2026/11/6		第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	220,166	2027/9/17	
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	500,000	503,595	2024/12/20		第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.425	300,000	331,452	2027/10/29	
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	499,590	2027/9/17		第93回三菱地所株式会社無担保社債	2.555	200,000	224,670	2028/7/28	
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	597,252	2026/6/19		第113回三菱地所株式会社無担保社債	1.067	100,000	102,007	2024/12/27	
第3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	498,330	2027/1/26		第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	300,141	2026/12/18	
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	297,723	2027/6/21		第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	299,010	2026/6/18	
第19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)	0.538	300,000	290,229	2029/10/30		第130回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	700,000	690,991	2029/8/3	
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	790,720	2030/6/24		第94回住友不動産株式会社無担保社債	0.968	300,000	303,075	2023/12/12	
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	797,056	2030/6/24		第96回住友不動産株式会社無担保社債	0.914	200,000	202,218	2024/3/18	
第23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)	0.875	500,000	493,360	2030/10/30		第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	200,000	202,312	2024/4/26	
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	529,460	2026/6/1		第98回住友不動産株式会社無担保社債	0.884	500,000	505,965	2024/6/10	
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	637,176	2026/12/18		第108回住友不動産株式会社無担保社債	0.4	500,000	500,220	2027/5/7	
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	106,103	2026/1/30		第8回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	1.99	300,000	335,499	2031/9/19	
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	217,370	2026/11/6		第8回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	1.25	200,000	209,390	2028/9/20	

銘柄	利率	当 期 末				銘柄	利率	当 期 末			
		額面金額	評 価 額	償還年月日				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13回NTTファイナンス株式会社無担保社債	1.09	200,000	207,986	2029/9/20		第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	570,786	2038/9/7	
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	600,000	615,090	2026/6/17		第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	940,420	2039/3/8	
第111回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	600,000	589,026	2031/9/5		第54回京成電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	366,992	2040/6/12	
第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	476,940	2036/12/5		第57回京成電鉄株式会社無担保社債	0.7	400,000	364,104	2040/8/31	
第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	900,000	849,555	2037/9/11		第29回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.47	100,000	118,966	2033/9/20	
第119回東武鉄道株式会社無担保社債	0.758	500,000	466,740	2038/5/24		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	108,448	2026/7/17	
第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	722,872	2039/7/22		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	108,411	2026/9/18	
第123回東武鉄道株式会社無担保社債	0.8	700,000	642,264	2040/4/20		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	542,415	2027/4/16	
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	303,342	2026/1/28		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	219,426	2027/9/17	
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	597,030	2031/6/27		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	110,874	2028/7/25	
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	695,142	2032/1/30		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	334,647	2028/12/12	
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	685,874	2033/3/4		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	333,999	2029/12/21	
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	393,816	2033/9/20		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	336,822	2030/3/22	
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	198,396	2029/1/25		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	441,412	2030/9/27	
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	672,700	2034/6/20		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	112,071	2030/12/20	
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	634,837	2039/10/25		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	210,728	2026/12/22	
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	692,580	2030/5/22		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	333,756	2032/7/23	
第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	714,752	2039/9/16		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	333,966	2032/12/27	
第4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	551,508	2040/6/8		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	434,312	2034/7/25	
第76回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.563	500,000	526,440	2027/6/7		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	102,308	2035/1/29	
第78回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.528	400,000	422,864	2028/6/12		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	484,745	2037/1/27	
第79回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.709	200,000	201,776	2024/4/26		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	290,532	2037/7/27	
第80回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.211	200,000	208,044	2029/4/27		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	669,683	2038/1/26	
第82回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.307	600,000	628,332	2033/6/3		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	717,064	2039/12/23	
第83回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.459	200,000	195,732	2031/4/22		第15回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	200,000	218,964	2027/12/20	
第84回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.662	100,000	95,784	2036/4/22		第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	110,740	2028/3/17	
第85回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	579,516	2036/9/26		第21回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.247	300,000	333,351	2029/3/21	
第88回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.723	700,000	661,066	2038/5/28		第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.175	200,000	222,462	2029/9/18	
第38回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.291	600,000	625,926	2028/12/11		第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.262	200,000	224,722	2030/3/12	
第39回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.222	500,000	519,810	2029/6/12		第28回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.111	800,000	891,768	2030/6/11	
第40回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.804	300,000	289,803	2036/12/1		第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	218,402	2034/6/20	
第41回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.751	700,000	667,303	2037/6/12		第38回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.288	400,000	423,832	2034/12/12	
第42回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.77	700,000	665,504	2037/12/4		第40回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.21	400,000	418,676	2035/8/31	
第43回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.676	1,000,000	931,420	2038/7/12		第41回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.816	200,000	198,814	2036/2/26	
第44回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.576	600,000	540,630	2039/11/28		第44回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.175	500,000	496,300	2026/12/11	
第45回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.73	600,000	550,494	2040/6/11		第45回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.604	700,000	672,959	2036/12/12	
第68回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.098	600,000	619,248	2030/6/12		第61回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.591	800,000	731,192	2040/5/21	
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	476,215	2036/8/29		第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.31	300,000	327,648	2027/9/17	
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	671,650	2037/5/29		第34回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.3	300,000	328,977	2027/12/20	
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	570,810	2037/11/30		第37回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	221,366	2028/5/22	
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	800,000	761,520	2038/8/30		第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	800,000	882,272	2029/1/29	
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	700,000	690,872	2028/12/20		第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.312	200,000	223,018	2029/4/24	
第83回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.209	400,000	390,168	2029/6/20		第46回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.157	100,000	111,338	2029/12/18	
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	549,906	2039/6/20		第51回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.212	300,000	336,297	2030/4/23	
第88回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.73	800,000	739,736	2040/4/23		第58回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.895	200,000	224,310	2031/12/16	
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	109,598	2027/11/29		第63回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.725	200,000	222,082	2033/5/24	
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	98,597	2031/3/10		第65回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.786	500,000	558,105	2033/9/13	
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	496,910	2027/9/17		第69回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	600,000	650,790	2034/7/28	
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	574,536	2037/9/18		第70回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.309	100,000	106,095	2032/9/30	
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	0.295	100,000	99,153	2037/11/29		第72回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.362	700,000	747,005	2034/11/28	
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	475,655	2037/11/27		第73回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.014	700,000	717,941	2035/1/26	
第40回京王電鉄株式会社無担保社債	0.205	600,000	582,066	2030/1/30		第75回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.196	100,000	104,567	2035/4/20	
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	369,740	2040/5/25		第76回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.297	100,000	105,967	2035/6/18	
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	584,778	2031/6/20		第77回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.221	100,000	104,546	2035/8/31	

銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第78回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.018	200,000	203,776	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	470,725	2036/4/14
第2回東京地下鉄株式会社社債	2.36	100,000	103,680	2024/6/20
第6回東京地下鉄株式会社社債	2.43	100,000	109,882	2027/9/17
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	200,000	219,476	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	500,000	560,620	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	111,219	2032/5/25
第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	111,730	2033/6/14
第16回東京地下鉄株式会社社債	0.778	300,000	298,290	2036/3/11
第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	655,046	2036/6/20
第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	700,000	676,844	2037/6/19
第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	576,096	2037/12/15
第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	95,089	2038/5/24
第38回東京地下鉄株式会社社債	0.445	600,000	539,160	2040/1/31
第41回東京地下鉄株式会社社債	0.275	300,000	293,001	2030/6/12
第49回東京地下鉄株式会社社債	0.574	300,000	272,562	2041/1/22
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	590,994	2032/3/17
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	483,725	2032/12/6
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	686,896	2028/12/6
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	700,000	697,172	2031/3/4
第46回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.69	700,000	664,804	2036/9/9
第47回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.903	700,000	679,686	2037/4/14
第48回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.782	500,000	475,265	2037/9/4
第50回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.395	700,000	693,147	2028/9/6
第51回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.672	700,000	640,801	2039/5/30
第99回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.8	500,000	486,025	2031/9/2
第102回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.772	700,000	677,103	2032/7/27
第106回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.505	700,000	690,907	2028/1/25
第111回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.955	700,000	636,615	2038/7/26
第112回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.47	800,000	776,288	2029/7/11
第117回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.91	900,000	792,441	2040/1/30
第46回阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.819	600,000	604,680	2023/10/25
第47回阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.202	500,000	520,105	2029/7/18
第49回阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.817	800,000	777,400	2036/12/15
第51回阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.789	700,000	665,791	2038/9/13
第52回阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.215	500,000	486,455	2029/11/21
第54回阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.486	800,000	711,120	2040/2/27
第37回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.87	200,000	202,238	2024/7/29
第40回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.841	600,000	599,886	2031/6/3
第41回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.7	700,000	692,244	2031/12/8
第42回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.647	600,000	590,136	2032/5/28
第43回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.941	700,000	668,444	2037/11/30
第44回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.878	800,000	753,448	2038/5/21
第45回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.871	700,000	690,662	2033/12/6
第46回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.69	500,000	448,410	2039/11/28
第47回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.48	300,000	293,649	2030/6/4
第28回京阪電気鉄道株式会社無担保社債	0.725	800,000	810,136	2025/9/1
第29回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.34	600,000	599,436	2026/6/16
第30回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.74	700,000	650,972	2038/7/16
第31回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.455	200,000	198,210	2029/1/24
第32回京阪ホールディングス株式会社無担保社債	0.63	700,000	628,775	2039/12/16
第50回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.857	200,000	203,708	2027/4/30
第52回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.75	600,000	574,596	2036/8/29
第53回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.85	600,000	590,388	2035/2/28

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54回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.806	700,000	670,124	2037/5/29
第55回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.79	600,000	569,028	2037/12/4
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.748	600,000	562,998	2038/5/25
第57回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.863	500,000	475,420	2038/9/10
第58回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.725	800,000	739,504	2039/4/25
第59回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.53	500,000	537,036	2039/9/5
第63回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.69	300,000	270,657	2040/10/26
第9回日本通運株式会社無担保社債	0.28	600,000	600,642	2026/2/25
第11回日本通運株式会社無担保社債	0.2	300,000	298,971	2026/7/14
第14回日本通運株式会社無担保社債	0.28	300,000	298,458	2027/6/16
第7回ニコソホールディングス株式会社無担保社債	0.28	400,000	389,644	2029/10/11
第9回ニコソホールディングス株式会社無担保社債	0.42	800,000	783,224	2030/9/18
第7回株式会社日立物流無担保社債	0.405	600,000	590,394	2028/9/4
第2回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.455	200,000	199,702	2027/2/23
第3回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.39	400,000	396,348	2028/2/28
第4回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.445	700,000	691,782	2028/12/14
第5回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.3	800,000	777,216	2029/12/11
第6回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.45	500,000	487,145	2030/9/17
第8回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.75	200,000	198,158	2032/8/13
第1回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.295	600,000	590,394	2029/3/7
第3回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.23	300,000	292,731	2029/12/10
第4回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.51	400,000	358,152	2039/12/9
第6回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.29	400,000	390,112	2030/6/7
第7回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.691	500,000	458,605	2040/6/8
第10回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.616	300,000	267,855	2041/12/9
第1回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.26	500,000	486,625	2030/10/22
第2回東京臨海高速鉄道株式会社無担保社債	0.235	400,000	386,352	2031/11/18
第2回日本貨物鉄道株式会社社債	0.849	300,000	282,123	2042/3/17
第1回日本航空株式会社無担保社債	0.47	700,000	691,852	2026/12/18
第3回日本航空株式会社無担保社債	0.399	500,000	483,680	2028/9/21
第5回日本航空株式会社無担保社債	0.22	500,000	498,605	2024/3/19
第7回日本航空株式会社無担保社債	0.28	800,000	757,584	2029/12/14
第15回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.734	500,000	503,735	2024/3/12
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,724	2024/12/6
第17回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.34	500,000	497,010	2027/12/8
第18回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.22	700,000	682,591	2029/12/5
第19回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.61	400,000	361,540	2039/12/5
第4回株式会社住友倉庫無担保社債	0.639	300,000	303,861	2025/12/17
第6回株式会社住友倉庫無担保社債	0.838	700,000	669,410	2038/3/26
第7回株式会社住友倉庫無担保社債	0.08	200,000	199,524	2024/9/24
第8回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	600,000	587,286	2029/9/21
第10回株式会社住友倉庫無担保社債	0.27	300,000	293,241	2030/10/15
第20回KDD I 株式会社無担保社債	0.803	700,000	705,796	2023/12/20
第21回KDD I 株式会社無担保社債	0.669	500,000	504,485	2024/9/20
第22回KDD I 株式会社無担保社債	0.31	700,000	693,504	2028/7/12
第24回KDD I 株式会社無担保社債	0.25	700,000	699,209	2025/11/21
第25回KDD I 株式会社無担保社債	0.395	400,000	397,468	2028/11/22
第26回KDD I 株式会社無担保社債	0.13	100,000	99,952	2024/4/26
第27回KDD I 株式会社無担保社債	0.23	700,000	698,033	2026/4/24
第13回ソフトバンク無担保社債	0.52	800,000	762,624	2031/6/3
第16回ソフトバンク無担保社債	0.52	700,000	665,770	2031/10/10
第17回ソフトバンク無担保社債	0.51	700,000	683,543	2029/1/26
第18回ソフトバンク無担保社債	0.62	600,000	576,054	2032/1/27
第25回沖縄電力株式会社社債	0.25	700,000	692,825	2027/6/25

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
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回沖縄電力株式会社社債	0.28	700,000	687,295	2028/12/25	第68回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.523	500,000	447,355	2041/7/12
第27回沖縄電力株式会社社債	0.19	800,000	769,528	2030/3/25	第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.606	400,000	440,180	2034/3/24
第28回沖縄電力株式会社社債	0.24	300,000	287,982	2030/12/20	第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.402	600,000	646,356	2034/10/24
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	300,000	302,796	2023/12/20	第42回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.576	200,000	180,940	2041/6/3
第39回電源開発株式会社無担保社債	0.929	200,000	201,912	2024/2/20	第45回大阪瓦斯株式会社無担保社債	0.942	800,000	767,576	2042/6/2
第49回電源開発株式会社無担保社債	0.4	300,000	297,615	2027/5/20	第36回東邦瓦斯株式会社無担保社債	1.628	300,000	316,482	2027/3/19
第26回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.31	100,000	98,709	2034/4/24	第44回東邦瓦斯株式会社無担保社債	0.835	700,000	656,999	2042/3/3
第32回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.28	100,000	97,997	2034/10/6	第13回広島ガス株式会社無担保社債	0.405	600,000	592,734	2028/9/13
第26回東京瓦斯株式会社無担保社債	2.29	100,000	103,434	2024/5/27	第14回広島ガス株式会社無担保社債	0.35	800,000	777,304	2030/10/15
第35回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.852	400,000	447,860	2031/12/26	第16回西部瓦斯株式会社無担保社債	0.355	700,000	690,291	2028/12/13
第36回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.737	400,000	446,372	2032/5/25	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	811,824	2025/12/18
第37回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.764	300,000	335,499	2033/9/26	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	897,291	2028/6/6
第39回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.554	700,000	767,487	2034/5/26	小 計		345,596,000	342,279,617	
第41回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.57	700,000	672,133	2036/11/28	合 計		524,878,876	524,231,529	
第43回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.67	700,000	677,705	2037/6/9					
第46回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.58	700,000	658,441	2038/7/20					
第48回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.704	300,000	286,218	2038/11/29					
第52回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.486	1,000,000	914,790	2039/5/23					
第55回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.28	800,000	702,536	2039/9/13					

(注) 株式、新株予約権証券および株式の性質を有するオプション証券等の組み入れはありません。
(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

○投資信託財産の構成

(2022年9月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	524,231,529	98.7
コール・ローン等、その他	7,043,380	1.3
投資信託財産総額	531,274,909	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年9月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	531,274,909,941
コール・ローン等	6,155,260,177
公社債(評価額)	524,231,529,553
未収利息	886,837,101
前払費用	1,283,110
(B) 負債	2,521,936,970
未払解約金	2,521,925,270
未払利息	11,700
(C) 純資産総額(A－B)	528,752,972,971
元本	442,830,342,239
次期繰越損益金	85,922,630,732
(D) 受益権総口数	442,830,342,239口
1万口当たり基準価額(C／D)	11,940円

(注) 当親ファンドの期首元本額は518,912,552,897円、期中追加設定元本額は33,516,787,508円、期中一部解約元本額は109,598,998,166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) 288,557,385,436円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) 129,887,950,192円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型) 20,276,487,125円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(年2回決算型) 3,944,707,571円
TMA債券バランスファンド<適格機関投資家限定> 163,811,915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 (2021年9月25日～2022年9月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,061,252,824
受取利息	4,062,559,209
支払利息	△ 1,306,385
(B) 有価証券売買損益	△ 22,043,141,142
売買益	92,987,482
売買損	△ 22,136,128,624
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 17,981,888,318
(D) 前期繰越損益金	120,540,501,903
(E) 追加信託差損益金	7,334,947,604
(F) 解約差損益金	△ 23,970,930,457
(G) 計(C＋D＋E＋F)	85,922,630,732
次期繰越損益金(G)	85,922,630,732

(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。

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10期（決算日 2022年5月30日）

（計算期間 2021年5月29日～2022年5月30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		期 騰 落 中 率		
	円	%		%	%	百万円
6期(2018年5月28日)	28,649	13.3	2,601.87	15.1	96.9	96,585
7期(2019年5月28日)	25,745	△10.1	2,334.11	△10.3	97.0	107,652
8期(2020年5月28日)	26,104	1.4	2,437.16	4.4	96.1	37,394
9期(2021年5月28日)	27,192	4.2	3,071.22	26.0	98.0	107,201
10期(2022年5月30日)	27,003	△0.7	3,103.72	1.1	96.0	92,333

○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		騰 落 率	
(期 首)	円	%		%	%
2021年5月28日	27,192	—	3,071.22	—	98.0
5月末	26,893	△1.1	3,034.76	△1.2	98.0
6月末	27,416	0.8	3,070.81	△0.0	98.5
7月末	27,001	△0.7	3,003.91	△2.2	98.2
8月末	27,579	1.4	3,099.08	0.9	98.1
9月末	28,466	4.7	3,234.08	5.3	98.3
10月末	27,862	2.5	3,188.28	3.8	97.6
11月末	26,605	△2.2	3,073.26	0.1	96.8
12月末	27,488	1.1	3,179.28	3.5	98.3
2022年1月末	26,482	△2.6	3,025.69	△1.5	97.6
2月末	26,557	△2.3	3,012.57	△1.9	97.3
3月末	26,821	△1.4	3,142.06	2.3	98.2
4月末	26,907	△1.0	3,066.68	△0.1	97.9
(期 末)					
2022年5月30日	27,003	△0.7	3,103.72	1.1	96.0

(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の指数値およびTOPIXに係る標章または商標は、J P X総研またはJ P X総研の関連会社（以下、J P X）の知的財産であり、指数値の算出・公表、利用等、TOPIXに関するすべての権利・ノウハウおよびTOPIXに係る標章または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、TOPIXの指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○運用経過

(2021年5月29日～2022年5月30日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：27,192円

期 末：27,003円

騰落率：△0.7%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・菅首相の退陣表明を受けて新政権への期待が高まったこと
- ・新型コロナウイルスの新規感染者の減少で経済活動の再開が期待されたこと

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの新たな変異株（オミクロン株）の感染拡大
- ・ロシアのウクライナ軍事侵攻で地政学的リスクが高まったこと



(注) 参考指数は、期首(2021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前期末対比おおむね横ばいとなりました。

期初、国内で新型コロナウイルスの感染が再拡大したことにより緊急事態宣言が断続的に発令されたことで、先行き不透明感から国内株式市場は方向感がないもみ合い相場となりました。2021年9月に菅首相の退陣表明を受けて新政権への期待が高まったことから国内株式市場は上昇する局面もありましたが、岸田新政権の政策に対する期待が後退したことなどから上昇の勢いを失いました。その後は、新型コロナウイルスワクチン接種が進展し、新規感染者数の減少や経済活動再開への期待が高まったことなどから、国内株式市場はおおむね上昇基調となりました。

2022年に入り、オミクロン株の感染拡大や米国の金融引き締めの前倒し観測が株式市場の上値を抑えたほか、ロシアのウクライナへの軍事侵攻による地政学的リスクへの警戒感から国内株式市場は急落しましたが、3月にかけては地政学的リスクに対する過度な懸念が後退して株式市場は値を戻しました。4月以降は、海外株式市場の軟調な動きに影響され、国内株式市場も上値の重い展開となりました。

■ポートフォリオについて

ポートフォリオ全体の配当利回りを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。

当ファンドで多く保有する中小型銘柄のパフォーマンスが相対的に劣化したことや、株価上昇の勢いが強い銘柄の保有を抑制していたことがマイナス要因となり、当期の基準価額は0.7%下落し、参考指数である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より低い水準を維持しました。

○今後の運用方針

原油価格上昇などの交易条件の悪化や地政学的リスクの高まりに伴う景気悪化懸念など、国内企業を取り巻く環境は厳しい状況が続いており、今年度の企業業績見通しの内容に対する警戒感が高まることが予想されることから、国内株式市場は当面やや軟調な展開となることを想定しています。

当ファンドは、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

(2021年5月29日～2022年5月30日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 0 (0)	% 0.001 (0.001)	(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
合 計	0	0.001	
期中の平均基準価額は、27,173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

(2021年5月29日～2022年5月30日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 33,529 (1,086)	千円 63,508,931 (—)	千株 35,359	千円 76,368,397

(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

(2021年5月29日～2022年5月30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	139,877,329千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	108,155,479千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.29

(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

(2021年5月29日～2022年5月30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

(2022年5月30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 (0.7%)			
雪国まいたけ	365	—	—
サカタのタネ	117	132	581,460
建設業 (4.5%)			
ショーボンドホールディングス	—	108.6	624,450
西松建設	56	300.2	1,251,834
大豊建設	—	49.8	220,863
奥村組	76	70.9	202,490
N I P P O	279	—	—
積水ハウス	264	—	—
関電工	533.5	420.4	341,785
きんでん	32	—	—
エクシオグループ	475.6	341.9	713,887
九電工	175	55.8	149,320
三機工業	298	175	250,425
高砂熱学工業	233	149.1	235,279
食料品 (5.9%)			
ニッポン	175	141.7	227,286
江崎グリコ	18	—	—
カルビー	200	209.8	506,457
明治ホールディングス	194	201.1	1,297,095
日清オイリオグループ	102	73.4	221,668
ニチレイ	421	48.4	110,206
東洋水産	314	205.5	986,400
日清食品ホールディングス	25	129.4	1,096,018
日本たばこ産業	407	330.7	780,452

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
繊維製品 (0.7%)			
グンゼ	—	74.7	273,775
日本毛織	—	123	115,005
ホギメディカル	121	78.5	243,350
パルプ・紙 (1.4%)			
大王製紙	416	266.7	378,180
レンゴー	1,251	1,210	853,050
化学 (8.3%)			
アイカ工業	24	—	—
花王	199	341.8	1,796,500
ライオン	1,042	1,297.8	1,824,706
ノエビアホールディングス	78	56.6	315,828
小林製薬	185	115	1,012,000
タカラバイオ	15	—	—
アース製薬	128	29.5	152,810
エフビコ	236	273.5	750,210
ユニ・チャーム	464	323.5	1,455,426
医薬品 (4.6%)			
協和キリン	275	72.8	203,621
武田薬品工業	419	405.8	1,519,315
中外製薬	220	90	316,260
科研製薬	182	168.2	612,248
持田製薬	—	68.8	214,312
ツムラ	210	152.9	452,431
栄研化学	153	230.6	392,942
キョーリン製薬ホールディングス	430	207.2	351,618

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大幸薬品	99	—	—
石油・石炭製品 (1.8%)			
E N E O Sホールディングス	2,366	3,116.3	1,612,373
ガラス・土石製品 (0.3%)			
日本カーボン	70	38.7	164,475
フジミインコーポレーテッド	35	10	57,300
機械 (2.9%)			
三浦工業	132	61.7	180,410
タクマ	374	380.2	547,868
サトーホールディングス	—	14.8	28,208
技研製作所	56	112.9	410,956
フジテック	226	249.6	656,198
アマノ	292	226.4	560,566
スター精密	82	130.9	220,435
電気機器 (15.9%)			
マブチモーター	143	331.8	1,182,867
日新電機	97.8	—	—
日本電気	169	194.5	1,023,070
富士通	43	—	—
沖電気工業	746	699.5	528,122
E I Z O	—	94.2	329,229
エレコム	404	434.6	678,410
アンリツ	909	1,223.2	1,766,300
ホシデン	—	429.3	535,337
ヒロセ電機	101	89	1,580,640
アズビル	469	343.5	1,288,125
キーエンス	5	—	—
シスメックス	177	—	—
浜松ホトニクス	293	172.8	1,045,440
京セラ	314	259.3	1,905,595
キヤノン	—	580.1	1,895,186
東京エレクトロン	—	5	298,750
輸送用機器 (5.8%)			
豊田自動織機	69	30.1	249,830
トヨタ自動車	241	787.3	1,674,193
N O K	—	405.1	475,182
エクセディ	40	279.5	467,603

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
エフ・シー・シー	—	275.4	366,282
シマノ	76	52.3	1,201,069
ティ・エス テック	399	563.9	739,272
精密機器 (0.3%)			
H O Y A	47	—	—
メニコン	14	26.1	71,696
ニプロ	—	191.5	198,394
その他製品 (3.1%)			
ローランド	—	32.6	152,405
ビジョン	38	259.6	488,048
リンテック	227	178.3	425,602
任天堂	33	21.9	1,277,427
コクヨ	264	224.4	376,767
電気・ガス業 (3.7%)			
中部電力	1,579	1,286.4	1,687,756
沖縄電力	21	28.8	34,704
東京瓦斯	714	605.9	1,556,557
大阪瓦斯	97	—	—
陸運業 (1.3%)			
名古屋鉄道	50	—	—
センコーグループホールディングス	496	496.4	423,925
丸和運輸機関	430	268.4	422,730
九州旅客鉄道	150	120.4	313,882
倉庫・運輸関連業 (0.4%)			
住友倉庫	48	172.8	380,851
情報・通信業 (11.0%)			
N E C ネットエスアイ	113	167.5	313,392
コーエーテクモホールディングス	250.6	149.8	683,088
インフォコム	277	—	—
アルテリア・ネットワークス	345	220.9	275,683
トレンドマイクロ	191	160.9	1,224,449
伊藤忠テクノソリューションズ	558	548	1,761,820
大塚商会	135	160	664,000
エイベックス	380	—	—
スカパー J S A Tホールディングス	5	57.6	26,841
日本電信電話	738	460.1	1,835,338
K D D I	565	409.3	1,862,315

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ソフトバンク	—	175.8	262,205
D T S	—	61.6	192,500
T K C	71	69.3	241,857
N S D	237	167.8	390,470
ミロク情報サービス	101	—	—
卸売業 (8.3%)			
T O K A I ホールディングス	422	339.7	296,558
シップヘルスケアホールディングス	404	337.1	782,409
コメダホールディングス	377	273.6	609,307
伊藤忠商事	146	195	725,595
三菱商事	662	52	233,948
キャノンマーケティングジャパン	—	207	629,280
菱洋エレクトロ	287	293.9	628,064
岩谷産業	10	—	—
伊藤忠エネクス	—	238.8	248,113
モスフードサービス	—	134.7	416,223
P A L T A C	136	135.7	604,543
オートバックスセブン	492	442.5	609,765
イエローハット	—	166.6	276,889
因幡電機産業	169	136.9	359,225
スズケン	—	275.6	974,246
小売業 (6.6%)			
ローソン	19	13	59,540
サンエー	12	70.2	279,747
カワチ薬品	104	167.5	345,050
エービーシー・マート	89	31.6	173,168
エディオン	46	230.4	280,396
D C Mホールディングス	825	633.5	680,379
ウエルシアホールディングス	28	178.7	463,369
ジョイフル本田	254	250.7	395,604
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	588	—	—
日本瓦斯	698	525.3	1,030,113
ライブコーポレーション	202	150.4	401,568
フジ	—	185	423,280

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ヤオコー	144	78.4	514,304
ケーズホールディングス	80	281.4	368,915
王将フードサービス	62	40.7	259,666
アークス	—	29.1	57,385
サンドラッグ	—	28.2	79,439
銀行業 (3.4%)			
三井住友トラスト・ホールディングス	—	160.5	627,234
三井住友フィナンシャルグループ	543	168.3	670,002
群馬銀行	54	—	—
八十二銀行	—	875.3	396,510
セブン銀行	3,452	2,766.2	674,952
山口フィナンシャルグループ	364	900.5	652,862
証券、商品先物取引業 (0.8%)			
野村ホールディングス	900	—	—
松井証券	—	881.5	733,408
保険業 (3.3%)			
S O M P Oホールディングス	201	268.7	1,536,157
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	628	355.4	1,426,220
その他金融業 (0.1%)			
日本取引所グループ	448	—	—
イー・ギャランティ	—	46.2	101,455
サービス業 (4.9%)			
ミクシィ	644	490.8	1,052,275
総合警備保障	99	98.2	351,065
H. U. グループホールディングス	281	235.2	620,457
ダスキン	120	142.1	387,080
ユー・エス・エス	82	—	—
セコム	40	189	1,596,294
イオンディライト	89	122.3	347,454
合 計	株 数 ・ 金 額	41,611	40,868
	銘柄数<比率>	136	140
			<96.0%>

(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、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

(2022年5月30日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	88,624,505	95.8
コール・ローン等、その他	3,874,380	4.2
投資信託財産総額	92,498,885	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月30日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	92,498,885,594
コール・ローン等	2,891,492,154
株式(評価額)	88,624,505,170
未収配当金	982,888,270
(B) 負債	165,294,846
未払解約金	165,293,121
未払利息	1,725
(C) 純資産総額(A－B)	92,333,590,748
元本	34,194,422,348
次期繰越損益金	58,139,168,400
(D) 受益権総口数	34,194,422,348口
1万口当たり基準価額(C／D)	27,003円

(注) 当親ファンドの期首元本額は39,424,088,274円、期中追加設定元本額は22,333,662,187円、期中一部解約元本額は27,563,328,113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) 23,672,476,793円

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) 10,521,945,555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 (2021年5月29日～2022年5月30日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,864,390,771
受取配当金	2,865,103,020
受取利息	1,132
その他収益金	27,206
支払利息	△ 740,587
(B) 有価証券売買損益	△ 3,582,730,294
売買益	8,017,027,593
売買損	△11,599,757,887
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 718,339,523
(D) 前期繰越損益金	67,777,084,703
(E) 追加信託差損益金	38,294,311,302
(F) 解約差損益金	△47,213,888,082
(G) 計(C＋D＋E＋F)	58,139,168,400
次期繰越損益金(G)	58,139,168,400

(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。

TMA日本REITマザーファンド
運用報告書 第11期（決算日 2022年7月11日）

（計算期間 2021年7月13日～2022年7月11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 証 券 率	純 資 産 額
	期 騰 落 率	中 率			
	円	%		%	百万円
7期(2018年7月10日)	23,145	11.2	3,456.85	98.4	71,950
8期(2019年7月10日)	27,259	17.8	4,064.84	98.2	120,486
9期(2020年7月10日)	23,933	△12.2	3,521.95	98.2	37,309
10期(2021年7月12日)	32,566	36.1	4,800.45	98.4	131,857
11期(2022年7月11日)	30,458	△6.5	4,485.26	98.0	51,251

○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 証 券 率
	騰 落 率	率		
	円	%		%
(期 首) 2021年7月12日	32,566	—	4,800.45	98.4
7月末	32,405	△0.5	4,767.40	98.2
8月末	32,401	△0.5	4,755.00	97.9
9月末	31,262	△4.0	4,605.71	98.1
10月末	31,581	△3.0	4,660.54	97.8
11月末	30,481	△6.4	4,470.13	98.1
12月末	31,618	△2.9	4,624.94	98.3
2022年1月末	29,893	△8.2	4,372.24	97.7
2月末	28,923	△11.2	4,243.65	97.6
3月末	30,841	△5.3	4,536.64	97.6
4月末	30,431	△6.6	4,483.12	97.9
5月末	30,938	△5.0	4,563.32	98.3
6月末	30,410	△6.6	4,487.40	98.1
(期 末) 2022年7月11日	30,458	△6.5	4,485.26	98.0

(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指数の指数値および東証REIT指数にかかる標準または商標は、J P X総研またはJ P X総研の関連会社（以下、J P X）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数にかかる標準または商標に関するすべての権利はJ P Xが有します。J P Xは、東証REIT指数の指数値の算出または公表の誤謬、遅延または中断に対し、責任を負いません。ファンドは、J P Xにより提供、保証または販売されるものではなく、ファンドの設定、販売および販売促進活動に起因するいかなる損害に対してもJ P Xは責任を負いません。

○運用経過

(2021年7月13日～2022年7月11日)

■期中の基準価額等の推移

期 首：32,566円

期 末：30,458円

騰落率：△6.5%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・日銀による長期金利上昇を抑制するための金融緩和策の継続

マイナス要因

- ・米国の金融引き締め強化への懸念による世界的な長期金利の上昇
- ・国内オフィスビルの賃貸市況の悪化



(注) 参考指数は、期首(2021年7月12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2021年12月にかけて、空室率の上昇基調が続く国内オフィスビルの賃貸市況の先行きの不透明感や新型コロナウイルスの新たな変異株(オミクロン株)への警戒感などから、日本REIT市場は下落しました。

2022年1月から3月中旬にかけては、物価上昇や良好な経済指標を受け、FRB(米連邦準備制度理事会)が早期に金融引き締めを行うとの見方から、世界的に長期金利が上昇したことや、ウクライナ情勢の緊迫化から投資家心理が悪化したことを受け、日本REIT市場は更に下落しました。

その後期末にかけては、日銀が金融緩和策として10年国債を無制限に買い入れる指値オペを連続して実施したことから、国内長期金利の更なる上昇懸念が後退し、日本REIT市場は小幅に反発しましたが、前期末対比下落して当期を終えました。

■ポートフォリオについて

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日本REITの銘柄を対象として、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、基準価額は6.5%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

今後の日本REIT市場は、コロナ禍後を見据えて宿泊や商業セクターなどに業績回復期待が高まりやすいことや、物流施設セクターや住宅セクターの銘柄の業績は堅調に推移していることから、底堅い展開を想定します。

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

(2021年 7 月13日～2022年 7 月11日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円 21	% 0.067	(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)	(21)	(0.067)	
合 計	21	0.067	
期中の平均基準価額は、30,932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

(2021年 7 月13日～2022年 7 月11日)

投資信託証券

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国 内	サンケイリアルエステート投資法人	1,740	188,332	800	78,092
	S O S i L A物流リート投資法人	950	150,222	5,456	878,094
	日本アコモデーションファンド投資法人	650	413,496	3,113	1,989,713
	森ヒルズリート投資法人	2,950	435,741	9,806	1,444,260
	産業ファンド投資法人	5,560	1,054,996	12,273	2,235,604
	アドバンス・レジデンス投資法人	2,190	756,920	8,811	3,089,108
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	2,320	492,731	7,362	1,531,080
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,194	1,371,375	4,105	1,645,761
	G L P投資法人	8,620	1,500,216	28,529	4,930,128
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1,460	483,262	3,503	1,137,194
	日本プロロジスリート投資法人	4,017	1,410,300	14,634	5,021,606
	星野リゾート・リート投資法人	735	484,668	1,372	901,447
	O n e リート投資法人	1,620	464,119	1,765	497,793
	イオンリート投資法人	5,582	835,520	15,138	2,265,212
	ヒューリックリート投資法人	2,770	445,484	10,921	1,780,392
	日本リート投資法人	1,945	730,593	2,923	1,114,978
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	—	—	38,300	868,695
	積水ハウス・リート投資法人	9,050	726,362	28,485	2,241,792
	ケネディクス商業リート投資法人	1,690	460,169	4,724	1,288,206
	ヘルスケア & メディカル投資法人	240	38,421	—	—

銘 柄		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
国	サムティ・レジデンシャル投資法人	1,680	210,069	3,670	456,552
	野村不動産マスターファンド投資法人	7,800	1,287,139	32,875	5,267,679
	ラサールロジポート投資法人	2,910	517,991	9,643	1,691,134
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,445	802,472	3,886	2,134,321
	投資法人みらい	4,380	222,949	16,502	826,801
	森トラスト・ホテルリート投資法人	940	121,954	2,825	345,925
	三菱地所物流リート投資法人	1,150 (213)	530,605 (86,683)	2,973	1,339,386
	三菱地所物流リート投資法人（新）	213 (△ 213)	86,683 (△ 86,683)	—	—
	CREロジスティクスファンド投資法人	1,770	361,067	6,495	1,302,254
	タカラレーベン不動産投資法人	1,660	186,340	955	110,255
	アドバンス・ロジスティクス投資法人	1,740	271,625	5,897	925,252
	日本ビルファンド投資法人	2,611	1,766,581	9,504	6,443,477
	ジャパンリアルエステイト投資法人	1,900	1,216,009	7,549	4,684,302
	日本都市ファンド投資法人	12,330	1,273,834	46,623	4,632,535
	オリックス不動産投資法人	4,800	877,256	17,301	2,989,303
	日本プライムリアルティ投資法人	2,010	792,727	6,435	2,530,968
	NTT都市開発リート投資法人	3,200	484,341	7,881	1,179,418
	東急リアル・エステート投資法人	2,880	532,040	10,202	1,947,022
	グローバル・ワン不動産投資法人	2,080	230,142	8,609	940,176
	ユナイテッド・アーバン投資法人	5,700	800,589	24,059	3,363,039
	森トラスト総合リート投資法人	1,040	147,436	5,051	708,535
	インヴィンシブル投資法人	14,330	546,826	—	—
	フロンティア不動産投資法人	620	306,774	1,668	833,597
	平和不動産リート投資法人	1,680 (931)	245,581 (128,397)	5,641	824,628
	平和不動産リート投資法人（新）	931 (△ 931)	128,397 (△ 128,397)	—	—
	日本ロジスティクスファンド投資法人	1,800	567,203	6,688	2,106,990
	福岡リート投資法人	3,640	612,148	6,437	1,046,555
	ケネディクス・オフィス投資法人	1,455	1,026,078	3,664	2,506,564
	いちごオフィスリート投資法人	3,770	319,562	12,077	997,757
	大和証券オフィス投資法人	895	648,399	2,789	1,954,372
	阪急阪神リート投資法人	1,640	242,445	6,950	1,083,253
	スターツプロシード投資法人	890	210,817	2,008	460,526
	大和ハウスリート投資法人	4,710	1,483,955	13,541	4,247,890
	大和証券リビング投資法人	4,730	537,959	17,480	1,992,125
	ジャパンエクセレント投資法人	2,830	356,393	10,182	1,289,414
合 計		165,443	32,395,340	520,080	98,101,185

(注) 金額は受渡金です。

(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、別銘柄として掲載しています。

○利害関係人との取引状況等

(2021年7月13日～2022年7月11日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2022年7月11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	%
サンケイリアルエステート投資法人	—	940	91,086	0.2
S O S i L A物流リート投資法人	6,123	1,617	243,843	0.5
日本アコモデーションファンド投資法人	3,614	1,151	786,133	1.5
森ヒルズリート投資法人	10,947	4,091	621,013	1.2
産業ファンド投資法人	14,187	7,474	1,359,520	2.7
アドバンス・レジデンス投資法人	10,814	4,193	1,534,638	3.0
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	9,239	4,197	921,241	1.8
アクティビア・プロパティーズ投資法人	3,900	2,989	1,201,578	2.3
G L P投資法人	35,189	15,280	2,541,064	5.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,060	2,017	677,712	1.3
日本プロロジスリート投資法人	17,741	7,124	2,436,408	4.8
星野リゾート・リート投資法人	1,647	1,010	629,230	1.2
O n e リート投資法人	1,378	1,233	329,827	0.6
イオンリート投資法人	16,601	7,045	1,065,908	2.1
ヒューリックリート投資法人	13,570	5,419	864,330	1.7
日本リート投資法人	3,098	2,120	768,500	1.5
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	38,300	—	—	—
積水ハウス・リート投資法人	35,453	16,018	1,265,422	2.5
ケネディクス商業リート投資法人	5,458	2,424	672,175	1.3
ヘルスケア & メディカル投資法人	—	240	39,672	0.1
サムティ・レジデンシャル投資法人	3,420	1,430	188,188	0.4
野村不動産マスターファンド投資法人	40,988	15,913	2,644,740	5.2
ラサールロジポート投資法人	12,761	6,028	1,030,788	2.0
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	4,600	2,159	1,135,634	2.2
投資法人みらい	19,234	7,112	347,776	0.7
森トラスト・ホテルリート投資法人	3,640	1,755	217,269	0.4
三菱地所物流リート投資法人	3,182	1,572	726,264	1.4
C R E ロジスティクスファンド投資法人	6,110	1,385	270,213	0.5
タカラレーベン不動産投資法人	—	705	80,440	0.2
アドバンス・ロジスティクス投資法人	7,344	3,187	484,424	0.9
日本ビルファンド投資法人	11,645	4,752	3,269,376	6.4
ジャパンリアルエステイト投資法人	9,697	4,048	2,554,288	5.0
日本都市ファンド投資法人	57,275	22,982	2,417,706	4.7
オリックス不動産投資法人	21,882	9,381	1,687,641	3.3

銘 柄		期首(前期末)	当 期 末		
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		口	口	千円	%
日本プライムリアルティ投資法人		7,261	2,836	1,115,966	2.2
N T T都市開発リート投資法人		8,525	3,844	552,767	1.1
東急リアル・エステート投資法人		9,404	2,082	404,532	0.8
グローバル・ワン不動産投資法人		11,590	5,061	533,429	1.0
ユナイテッド・アーバン投資法人		29,434	11,075	1,558,252	3.0
森トラスト総合リート投資法人		5,807	1,796	252,338	0.5
インヴィンシブル投資法人		—	14,330	538,808	1.1
フロンティア不動産投資法人		1,783	735	391,755	0.8
平和不動産リート投資法人		6,597	3,567	508,654	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人		7,888	3,000	955,500	1.9
福岡リート投資法人		6,227	3,430	568,694	1.1
ケネディクス・オフィス投資法人		3,929	1,720	1,198,840	2.3
いちごオフィスリート投資法人		14,936	6,629	557,498	1.1
大和証券オフィス投資法人		3,448	1,554	1,097,124	2.1
阪急阪神リート投資法人		7,962	2,652	389,313	0.8
スターツプロシード投資法人		2,110	992	242,643	0.5
大和ハウスリート投資法人		17,025	8,194	2,544,237	5.0
大和証券リビング投資法人		20,874	8,124	983,816	1.9
ジャパンエクセレント投資法人		13,222	5,870	710,857	1.4
合 計	口 数 ・ 金 額	611,119	256,482	50,209,081	
	銘 柄 数 < 比 率 >	49	52	< 98.0% >	

(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。

○投資信託財産の構成

(2022年7月11日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資証券	50,209,081	97.6
コール・ローン等、その他	1,228,812	2.4
投資信託財産総額	51,437,893	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年7月11日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	51,437,893,952
コール・ローン等	546,881,262
投資証券(評価額)	50,209,081,900
未収入金	153,664,172
未収配当金	528,266,618
(B) 負債	186,638,340
未払金	100,302,468
未払解約金	86,335,711
未払利息	161
(C) 純資産総額(A－B)	51,251,255,612
元本	16,826,893,723
次期繰越損益金	34,424,361,889
(D) 受益権総口数	16,826,893,723口
1万口当たり基準価額(C／D)	30,458円

(注) 当親ファンドの期首元本額は40,489,875,103円、期中追加設定元本額は11,565,787,019円、期中一部解約元本額は35,228,768,399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) 11,626,848,895円

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) 5,200,044,828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 (2021年7月13日～2022年7月11日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	3,771,545,384
受取配当金	3,772,123,197
受取利息	1,300
その他収益金	19
支払利息	△ 579,132
(B) 有価証券売買損益	△13,878,282,832
売買益	259,425,985
売買損	△14,137,708,817
(C) 当期損益金(A＋B)	△10,106,737,448
(D) 前期繰越損益金	91,367,689,724
(E) 追加信託差損益金	23,709,852,102
(F) 解約差損益金	△70,546,442,489
(G) 計(C＋D＋E＋F)	34,424,361,889
次期繰越損益金(G)	34,424,361,889

(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。