

東京海上・円資産バランスファンド (年1回決算型)

＜愛称 円奏会(年1回決算型)＞

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	無期限(2014年11月10日設定)	
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 (年1回決算型)	「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 (年1回決算型)	・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	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。	

第6期 運用報告書(全体版)

(決算日 2020年7月27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(年1回決算型)＜愛称 円奏会(年
1回決算型)＞」は、このたび、第6期
の決算を行いましたので、期中の運用
状況を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5期の運用実績

決算期	基準 (分配落)	価額		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 組入比率	純資 産額
		税金 込配 分	騰落 率				
	円	円	%	%	%	%	百万円
2期(2016年7月25日)	10,832	0	3.9	3.1	68.6	3.1	13,751
3期(2017年7月24日)	10,804	0	△0.3	14.0	69.7	13.6	45,835
4期(2018年7月23日)	11,035	0	2.1	14.4	69.8	14.6	79,068
5期(2019年7月23日)	11,305	0	2.4	14.6	69.2	15.0	193,084
6期(2020年7月27日)	10,734	0	△5.1	3.8	68.6	3.8	288,504

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準 額	騰落率		株式 組入比率	債券 組入比率	投資信託 組入比率
		騰落率	騰落率			
(期首) 2019年7月23日	円 11,305	% —	% —	% 14.6	% 69.2	% 15.0
7月末	11,320	0.1	0.1	14.5	69.4	14.8
8月末	11,416	1.0	0.9	14.6	69.6	14.7
9月末	11,542	2.1	1.1	14.9	68.6	14.9
10月末	11,644	3.0	2.0	15.1	68.3	14.8
11月末	11,634	2.9	1.9	14.7	68.5	14.4
12月末	11,572	2.4	1.4	14.8	68.3	14.5
2020年1月末	11,635	2.9	2.0	14.5	67.7	14.9
2月末	11,362	0.5	-2.4	13.7	69.8	13.7
3月末	10,746	△4.9	-5.4	5.7	66.3	6.5
4月末	10,732	△5.1	-5.6	3.4	67.7	3.7
5月末	10,756	△4.9	-5.4	3.7	67.7	3.9
6月末	10,723	△5.1	-5.6	3.7	68.3	3.8
(期末) 2020年7月27日	10,734	△5.1	-5.6	3.8	68.6	3.8

(注) 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。

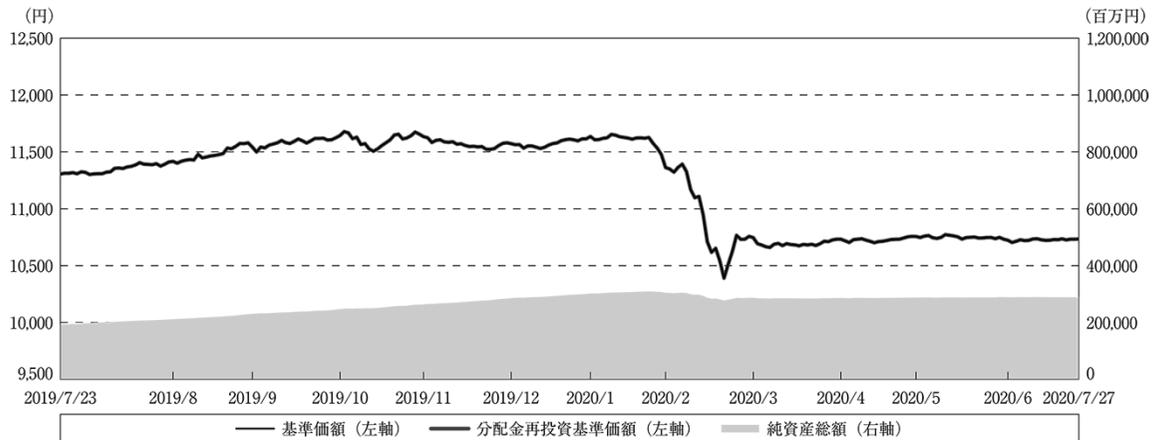
(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」は実質比率を記載しています。

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。

○運用経過

(2019年7月24日～2020年7月27日)

■期中の基準価額等の推移



期首：11,305円

期末：10,734円(既払分配金(税込み)：0円)

騰落率：△ 5.1%(分配金再投資ベース)

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額は、期首(2019年7月23日)の値が基準価額と同一となるように指数化しています。

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

【日本債券】

- ・新型コロナウイルスの感染拡大に対応した各国中央銀行による緩和的な金融政策

【日本株式・REIT】

- ・米中貿易協議の進展や英国のEU(欧州連合)離脱の期限延長に関する合意などによる世界的な政治リスクの後退
- ・新型コロナウイルスの感染拡大に対応した各国の政府・中央銀行による大規模な財政・金融政策
- ・緊急事態宣言解除に伴う経済活動の正常化への期待

【日本REIT】

- ・J-REITのグローバル株価指数への組み入れが正式に発表され、良好な需給環境が期待されたこと

マイナス要因

【日本債券】

- ・米中貿易協議の進展や英国のEU離脱の期限延長に関する合意などを背景に国内長期金利(10年国債利回り)が上昇(債券価格は下落)したこと
- ・超長期金利の過度な低下を牽制した日銀総裁の発言や、日銀が超長期国債の買い入れ額を減額するなど、日銀の追加金融緩和に対する期待が後退したこと

- ・新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて、社債の信用スプレッド（国債に対する上乘せ利回り）が拡大したことや、リスク回避の現金化に伴う債券売却の動きが広がったこと

【日本株式・REIT】

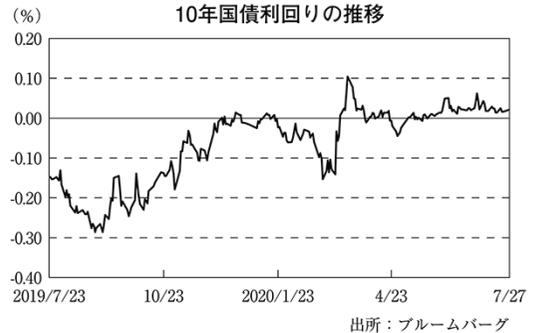
- ・新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う経済の減速懸念の高まりから、日本株式およびREIT市場が急落したこと

■投資環境

【日本債券市場】

当期の10年国債利回りは-0.15%程度の水準で始まりまして。米中貿易摩擦の激化などを受けて、10年国債利回りは2019年8月下旬にかけて-0.29%程度まで低下しました。9月初旬、超長期金利の過度な低下を牽制した日銀総裁の発言などから長期金利は上昇に転じ、年末には0%程度となりました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による経済の減速懸念を受けて、10年国債利回りは-0.15%程度まで低下した後、リスク回避の現金化に伴う債券売却の動きから0.10%程度まで上昇するなどボラティリティ（変動性）の高い展開となりましたが、各国中央銀行が緩和的な金融政策を講じると、期末にかけて0.02%程度まで上昇幅を縮小して当期を終えました。

社債の信用スプレッドは、期前半はより高い利回りを求める資金の流入により縮小しましたが、期後半は新型コロナウイルスの世界的な感染拡大に伴う経済の減速を受けて拡大に転じ、前期末対比拡大した水準で当期を終えました。



【日本株式市場】

期初、トランプ米大統領による対中追加関税の発表を受けて世界的な景気後退への懸念が高まり、日本株式市場は下落しました。その後、英国のEU離脱期限の延長に関する合意や米中貿易協議の進展などが好感され、日本株式市場は上昇に転じました。

期後半に入ると、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて世界的に株式市場が下落するなか、国内では緊急事態宣言による経済の減速が嫌気され、日本株式市場も下落しました。その後、緊急事態宣言解除に伴う経済活動の正常化への期待や、各国の政府・中央銀行による経済対策が下支えとなり、日本株式市場は上昇に転じ、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）は前期末対比上昇した水準で当期を終えました。



【日本REIT市場】

期初から2020年2月にかけては、FOMC（米連邦公開市場委員会）での追加利下げへの期待や、J-REITのグローバル株価指数への組み入れが9月から開始することが正式発表されたことも追い風となり、日本REIT市場は上昇基調で推移しました。その後、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受けて3月に大きく下落した後、各国の財政・金融政策や経済活動の正常化への期待などから、日本REIT市場は反発したものの、賃貸市況の悪化が懸念されるホテルや商業施設等のセクターが重石となり、前期末対比下落した水準で当期を終えました。



■ポートフォリオについて

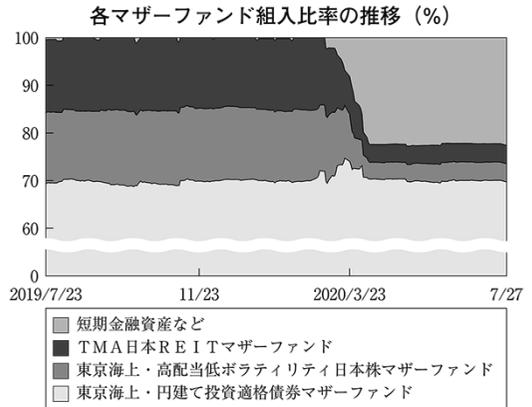
＜東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)＞

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。

期前半、市場環境が比較的落ち着いていたことにより、リスク資産(日本株式と日本REITの合計)の配分比率は、おおむね基本資産配分比率を維持しました。

期後半は基準価額変動リスクが高まったことから、2020年3月から4月にかけてリスク資産の配分比率を段階的に引き下げました。

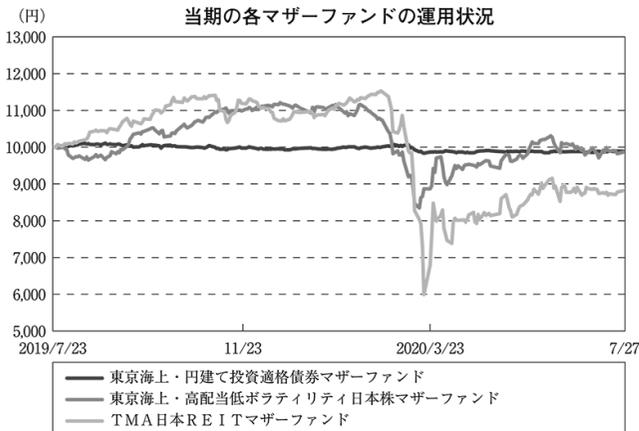
以上の運用の結果、主に日本株式と日本REITの下落がマイナス寄与し、当ファンドの基準価額は、5.1%下落しました。



※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期の運用経過は以下の通りです。



※各マザーファンドは2019年7月23日を10,000円として指数化したものです。

期中の騰落率(%)

東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド	△ 1.1
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	△ 1.3
TMA日本REITマザーファンド	△11.7

＜東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド＞

当期は、ポートフォリオ回りの維持・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。

また、流動性確保の観点から国債や政府保証債、地方債などの組み入れを維持しました。さらに、今後の運用の持続性を維持するため、コマーシャル・ペーパー*の組み入れを行いました。

なお、当期末のポートフォリオの平均残存期間は10年程度、平均格付は「AA-」で前期末と変化ありません。

以上の運用の結果、当期中において社債利回りが上昇したことから、基準価額は1.1%下落しました。

*信用力の高い企業が無担保で短期資金を調達するために発行する、期間が1年未満の短期社債。

＜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、価格変動リスクが低くなるようなポートフォリオを構築しました。

当期の日本株式市場は、当ファンドで多く保有する高配当株や価格変動リスクが相対的に低い低ボラティリティ株のパフォーマンスが相対的に劣れました。その結果、基準価額は1.3%下落し、参考指数であるTOPIX（配当込み）の騰落率（+3.1%）を下回りました。なお、価格変動リスクはTOPIXよりも低い水準を維持しました。

＜TMA日本REITマザーファンド＞

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

以上の運用の結果、当期は日本REIT市場全体の下落を受けて基準価額は11.7%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

当期中においては、市況動向や運用の効率性などを勘案して、収益分配を行わないこととしました。収益分配に充てなかった収益については信託財産内に留保し、当ファンドの運用方針に基づいて運用を行います。

◇分配原資の内訳

（単位：円、1万円当たり、税込み）

項 目	第6期
	2019年7月24日～ 2020年7月27日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	733

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

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

○今後の運用方針

〈東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)〉

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。

今後も基準価額の変動リスクを一定の水準に抑制することを目標として、日本株式と日本REITの資産配分比率をコントロールする方針です。

各マザーファンドにおける今後の運用方針は以下の通りです。

〈東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド〉

国債市場については、新型コロナウイルスの感染再拡大が懸念されるなか、日銀は今後も緩和的な金融政策を維持することが予想されるため、国内長期金利は低水準で推移すると予想しています。

社債市場については、新型コロナウイルスの感染拡大による企業業績の動向を注視する必要がありますが、各国中央銀行が緩和的な金融政策を継続することが期待されるなか、相対的に利回りの高い社債への投資ニーズは強く、良好な需給環境が続くと考えています。

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

〈東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド〉

新型コロナウイルスの感染再拡大や、米中関係の悪化などの懸念材料はあるものの、世界の主要各国が打ち出す大規模な金融緩和政策や財政支援策などの対応が経済を下支えし、日本株式市場は緩やかな回復基調で推移すると予想します。

このような環境下、今後も日本の株式を主要投資対象とし、流動性や信用リスクなどを勘案して選定した銘柄に投資します。ポートフォリオ全体の配当利回りを高める戦略と価格変動リスクを低く抑える戦略を組み合わせることで、ポートフォリオ全体の価格変動リスクをTOPIX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〉

日本REIT市場は、新型コロナウイルスの感染拡大によるホテルや商業施設等への影響に注意が必要なものの、その他のセクターは安定した賃料収入が期待できることや、J-REIT各社のバランスシートは健全であることなどから、底堅い展開になると想定します。

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

(2019年7月24日～2020年7月27日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	105	0.934	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(51)	(0.456)	* 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 ）	(51)	(0.456)	* 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 ）	(3)	(0.022)	* 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	0.008	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 * 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
（ 株 式 ）	(0)	(0.001)	
（ 投 資 信 託 証 券 ）	(1)	(0.007)	
(c) そ の 他 費 用	0	0.000	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	(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	106	0.942	
期中の平均基準価額は、11,256円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 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。

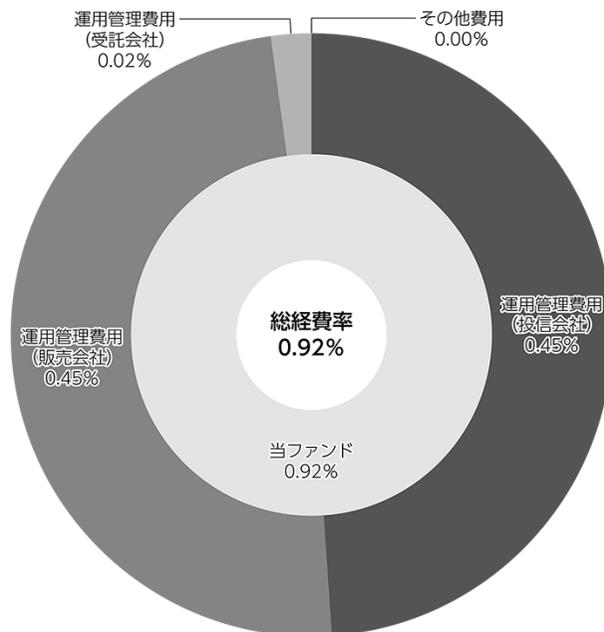
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、当ファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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）を期中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

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（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

(2019年7月24日～2020年7月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	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	95,699,868	117,908,169	38,890,354	47,783,070
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	9,301,196	25,219,877	16,136,478	38,643,545
TMA日本REITマザーファンド	7,841,819	23,162,999	13,914,245	32,795,136

○株式売買比率

(2019年7月24日～2020年7月27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	
	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) 期中の株式売買金額	216,865,550千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	104,824,527千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.06	

(注) (b)は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c)は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2019年7月24日～2020年7月27日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2020年7月27日現在)

親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 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	108,863,994	165,673,508	202,071,978
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	11,188,109	4,352,827	11,061,840
TMA日本REITマザーファンド	10,730,946	4,658,520	11,262,438

○投資信託財産の構成

(2020年7月27日現在)

項 目	当 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	202,071,978	69.6
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	11,061,840	3.8
TMA日本REITマザーファンド	11,262,438	3.9
コール・ローン等、その他	66,119,253	22.7
投資信託財産総額	290,515,509	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年7月27日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	290,515,509,118
コール・ローン等	64,555,246,384
東京海上・円建て投資適格債券マザーファンド(評価額)	202,071,978,089
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)	11,061,840,703
TMA日本REITマザーファンド(評価額)	11,262,438,790
未収入金	1,564,005,152
(B) 負債	2,011,086,513
未払解約金	643,802,218
未払信託報酬	1,366,878,014
未払利息	76,281
その他未払費用	330,000
(C) 純資産総額(A-B)	288,504,422,605
元本	268,785,703,605
次期繰越損益金	19,718,719,000
(D) 受益権総口数	268,785,703.605口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,734円

(注) 当ファンドの期首元本額は170,799,059,068円、期中追加設定元本額は137,306,288,206円、期中一部解約元本額は39,319,643,669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 (2019年7月24日～2020年7月27日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 11,468,279
受取利息	276,539
支払利息	△ 11,744,818
(B) 有価証券売買損益	△14,613,092,564
売買益	1,397,417,517
売買損	△16,010,510,081
(C) 信託報酬等	△ 2,485,711,588
(D) 当期損益金(A+B+C)	△17,110,272,431
(E) 前期繰越損益金	3,726,950,272
(F) 追加信託差損益金	33,102,041,159
(配当等相当額)	(10,154,261,306)
(売買損益相当額)	(22,947,779,853)
(G) 計(D+E+F)	19,718,719,000
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	19,718,719,000
追加信託差損益金	33,102,041,159
(配当等相当額)	(10,230,756,454)
(売買損益相当額)	(22,871,284,705)
分配準備積立金	4,651,897,539
繰越損益金	△18,035,219,698

(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) (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	当 期
a. 配当等収益(費用控除後)	924,947,267円
b. 有価証券等損益額(費用控除後)	0円
c. 信託約款に規定する収益調整金	15,066,821,461円
d. 信託約款に規定する分配準備積立金	3,726,950,272円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	19,718,719,000円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	733円
g. 分配金	0円
h. 分配金(1万口当たり)	0円

○お知らせ

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

○ (参考情報) 親投資信託の組入資産の明細

(2020年7月27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(586,505,959千円)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	当 期		期 末		残存期間別組入比率		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	38,300,000	45,052,738	6.3	—	6.3	—	—
地方債証券	170,721,245	183,069,558	25.6	—	25.5	0.1	—
	(170,721,245)	(183,069,558)	(25.6)	(—)	(25.5)	(0.1)	(—)
特殊債券 (除く金融債)	34,900,000	38,375,277	5.4	—	5.4	—	—
	(34,900,000)	(38,375,277)	(5.4)	(—)	(5.4)	(—)	(—)
金融債券	600,000	600,034	0.1	—	—	0.0	0.1
	(600,000)	(600,034)	(0.1)	(—)	(—)	(0.0)	(0.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	427,307,000	433,819,029	60.6	—	38.2	15.6	6.8
	(427,307,000)	(433,819,029)	(60.6)	(—)	(38.2)	(15.6)	(6.8)
合 計	671,828,245	700,916,636	98.0	—	75.3	15.7	6.9
	(633,528,245)	(655,863,898)	(91.7)	(—)	(69.1)	(15.7)	(6.9)

(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	当 期 末				銘 柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第357回利付国債(10年)	0.1	400,000	404,136	2029/12/20	第25回利付国債(30年)	2.3	500,000	658,855	2036/12/20
第8回利付国債(30年)	1.8	500,000	601,250	2032/11/22	第26回利付国債(30年)	2.4	500,000	668,565	2037/3/20
第9回利付国債(30年)	1.4	500,000	577,120	2032/12/20	第27回利付国債(30年)	2.5	500,000	680,505	2037/9/20
第10回利付国債(30年)	1.1	500,000	558,940	2033/3/20	第28回利付国債(30年)	2.5	500,000	683,750	2038/3/20
第11回利付国債(30年)	1.7	500,000	597,665	2033/6/20	第29回利付国債(30年)	2.4	500,000	678,375	2038/9/20
第12回利付国債(30年)	2.1	500,000	624,905	2033/9/20	第30回利付国債(30年)	2.3	500,000	672,405	2039/3/20
第13回利付国債(30年)	2.0	500,000	619,855	2033/12/20	第31回利付国債(30年)	2.2	500,000	666,590	2039/9/20
第14回利付国債(30年)	2.4	500,000	648,245	2034/3/20	第32回利付国債(30年)	2.3	500,000	679,205	2040/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	500,000	656,810	2034/6/20	第33回利付国債(30年)	2.0	500,000	653,425	2040/9/20
第16回利付国債(30年)	2.5	500,000	658,675	2034/9/20	第34回利付国債(30年)	2.2	500,000	675,485	2041/3/20
第17回利付国債(30年)	2.4	500,000	653,480	2034/12/20	第35回利付国債(30年)	2.0	500,000	657,910	2041/9/20
第18回利付国債(30年)	2.3	500,000	648,000	2035/3/20	第36回利付国債(30年)	2.0	500,000	660,010	2042/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	500,000	649,530	2035/6/20	第37回利付国債(30年)	1.9	500,000	651,925	2042/9/20
第20回利付国債(30年)	2.5	500,000	666,140	2035/9/20	第38回利付国債(30年)	1.8	500,000	643,335	2043/3/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	652,940	2035/12/20	第39回利付国債(30年)	1.9	500,000	655,250	2043/6/20
第22回利付国債(30年)	2.5	500,000	669,870	2036/3/20	第137回利付国債(20年)	1.7	500,000	593,350	2032/6/20
第23回利付国債(30年)	2.5	500,000	671,480	2036/6/20	第138回利付国債(20年)	1.5	500,000	581,605	2032/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	500,000	673,565	2036/9/20	第139回利付国債(20年)	1.6	500,000	587,475	2032/6/20

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)＜愛称 円奏会(年1回決算型)＞

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		地方債証券	%	千円	千円	
第140回利付国債 (20年)	1.7	500,000	594,230	2032/9/20	平成28年度第3回北海道公募債 (20年)	0.363	700,000	694,638	2036/6/30
第141回利付国債 (20年)	1.7	500,000	595,410	2032/12/20	平成29年度第11回北海道公募債 (20年)	0.635	200,000	205,970	2037/12/25
第142回利付国債 (20年)	1.8	500,000	601,505	2032/12/20	平成30年度第4回北海道公募債 (20年)	0.569	600,000	610,806	2038/6/25
第143回利付国債 (20年)	1.6	500,000	590,325	2033/3/20	平成30年度第5回北海道公募債 (20年)	0.391	664,160	676,759	2038/6/25
第144回利付国債 (20年)	1.5	500,000	584,115	2033/3/20	平成30年度第9回北海道公募債 (20年)	0.654	500,000	516,250	2038/9/24
第145回利付国債 (20年)	1.7	500,000	597,665	2033/6/20	平成30年度第10回北海道公募債 (20年)	0.426	474,400	485,458	2038/9/24
第146回利付国債 (20年)	1.7	500,000	598,765	2033/9/20	平成30年度第15回北海道公募債 (20年)	0.291	664,160	671,625	2038/9/24
第147回利付国債 (20年)	1.6	500,000	593,265	2033/12/20	令和元年度第4回北海道公募債 (20年)	0.323	700,000	679,140	2039/6/24
第148回利付国債 (20年)	1.5	500,000	587,495	2034/3/20	令和元年度第5回北海道公募債 (20年)	0.2	700,000	701,435	2039/6/24
第149回利付国債 (20年)	1.5	500,000	588,275	2034/6/20	令和元年度第9回北海道公募債 (20年)	0.2	200,000	189,166	2039/9/22
第150回利付国債 (20年)	1.4	500,000	582,150	2034/9/20	第4回1号宮城県公募債 (20年)	0.434	370,000	379,035	2038/8/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	600,000	682,530	2034/12/20	第4回2号宮城県公募債 (20年)	0.244	475,000	478,063	2039/2/18
第152回利付国債 (20年)	1.2	600,000	682,932	2035/3/20	第5回1号宮城県公募債 (20年)	0.17	487,500	486,568	2039/8/19
第153回利付国債 (20年)	1.3	600,000	691,962	2035/6/20	第5回2号宮城県公募債 (20年)	0.188	390,000	399,120	2039/12/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	600,000	683,688	2035/9/20	第5回3号宮城県公募債 (20年)	0.158	400,000	390,230	2040/2/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	600,000	665,730	2035/12/20	第15回神奈川県公募債 (20年)	1.94	100,000	118,151	2030/11/12
第156回利付国債 (20年)	0.4	700,000	712,586	2036/3/20	第17回神奈川県公募債 (20年)	1.975	200,000	238,824	2031/7/11
第157回利付国債 (20年)	0.2	700,000	689,899	2036/6/20	第19回神奈川県公募債 (20年)	1.818	300,000	354,819	2032/1/30
第158回利付国債 (20年)	0.5	700,000	722,113	2036/9/20	第20回神奈川県公募債 (20年)	1.706	500,000	586,470	2032/6/18
第159回利付国債 (20年)	0.6	700,000	732,242	2036/12/20	第21回神奈川県公募債 (20年)	1.732	200,000	235,468	2032/9/17
第160回利付国債 (20年)	0.7	700,000	743,204	2037/3/20	第22回神奈川県公募債 (20年)	1.802	200,000	237,612	2032/12/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	700,000	731,416	2037/6/20	第23回神奈川県公募債 (20年)	1.804	100,000	119,260	2033/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	700,000	731,262	2037/9/20	第25回神奈川県公募債 (20年)	1.578	400,000	467,012	2033/12/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	700,000	730,492	2037/12/20	第26回神奈川県公募債 (20年)	1.477	600,000	694,152	2034/6/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	700,000	718,039	2038/3/20	第27回神奈川県公募債 (20年)	1.398	600,000	688,512	2034/9/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	700,000	717,073	2038/6/20	第28回神奈川県公募債 (20年)	1.941	300,000	324,978	2034/12/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	700,000	741,174	2038/9/20	第29回神奈川県公募債 (20年)	1.289	600,000	679,698	2035/6/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	700,000	715,673	2038/12/20	第30回神奈川県公募債 (20年)	1.161	100,000	111,590	2035/9/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	700,000	702,436	2039/3/20	第31回神奈川県公募債 (20年)	1.002	200,000	218,578	2035/12/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	700,000	688,912	2039/6/20	第32回神奈川県公募債 (20年)	0.18	200,000	193,300	2036/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	700,000	688,156	2039/9/20	第33回神奈川県公募債 (20年)	0.64	500,000	518,060	2036/12/19
第171回利付国債 (20年)	0.3	700,000	687,393	2039/12/20	第34回神奈川県公募債 (20年)	0.654	100,000	103,690	2037/6/19
第172回利付国債 (20年)	0.4	700,000	700,000	2040/3/20	第36回神奈川県公募債 (20年)	0.625	100,000	103,154	2037/12/18
小 計		38,300,000	45,052,738		第37回神奈川県公募債 (20年)	0.53	200,000	202,644	2038/6/18
地方債証券					第40回神奈川県公募債 (20年)	0.2	800,000	763,120	2039/6/20
第1回東京都公募債 (30年)	2.21	400,000	497,620	2033/6/20	第42回神奈川県公募債 (20年)	0.34	500,000	489,415	2039/9/20
第6回東京都公募債 (30年)	2.58	100,000	135,532	2037/9/18	第5回大阪府公募債 (20年)	2.16	350,000	419,226	2030/5/28
第7回東京都公募債 (30年)	2.51	100,000	135,932	2038/9/17	第6回大阪府公募債 (20年)	1.98	200,000	236,522	2030/9/13
第22回東京都公募債 (20年)	1.92	200,000	235,224	2030/6/20	第7回大阪府公募債 (20年)	1.84	620,000	731,854	2031/9/26
第23回東京都公募債 (20年)	2.12	100,000	120,116	2030/12/20	第8回大阪府公募債 (20年)	1.83	600,000	709,044	2031/12/22
第24回東京都公募債 (20年)	1.98	100,000	119,238	2031/6/20	第9回大阪府公募債 (20年)	1.83	100,000	118,383	2032/3/12
第25回東京都公募債 (20年)	1.8	200,000	235,916	2031/12/19	第10回大阪府公募債 (20年)	1.72	530,000	622,644	2032/9/24
第26回東京都公募債 (20年)	1.74	600,000	706,128	2032/6/18	第11回大阪府公募債 (20年)	1.693	500,000	589,685	2033/9/27
第27回東京都公募債 (20年)	1.68	300,000	352,011	2032/12/20	第12回大阪府公募債 (20年)	1.453	540,000	622,933	2034/9/26
第28回東京都公募債 (20年)	1.59	100,000	116,423	2033/3/18	第13回大阪府公募債 (20年)	1.203	700,000	784,343	2035/9/28
第30回東京都公募債 (20年)	1.508	400,000	464,424	2034/6/20	第14回大阪府公募債 (20年)	0.54	300,000	305,910	2036/9/29
第31回東京都公募債 (20年)	1.238	400,000	450,024	2034/9/20	第15回大阪府公募債 (20年)	0.721	600,000	627,648	2037/3/30
第32回東京都公募債 (20年)	1.293	600,000	680,040	2035/6/20	第17回大阪府公募債 (20年)	0.668	700,000	725,627	2038/9/27
第33回東京都公募債 (20年)	0.18	700,000	676,550	2036/6/20	平成22年度第3回京都府公募債	2.0	600,000	712,854	2030/11/22
第34回東京都公募債 (20年)	0.668	500,000	519,555	2037/6/19	平成23年度第5回京都府公募債 (20年)	1.79	400,000	470,588	2031/10/17
第35回東京都公募債 (20年)	0.525	700,000	708,673	2038/6/18	平成24年度第3回京都府公募債 (20年)	1.63	600,000	698,850	2032/8/13
第37回東京都公募債 (20年)	0.444	800,000	797,632	2040/6/20	平成26年度第5回京都府公募債 (20年)	1.455	600,000	692,868	2034/8/10
平成25年度第12回北海道公募債 (20年)	1.635	400,000	468,844	2033/12/27	平成27年度第2回京都府公募債 (15年)	0.729	600,000	635,550	2030/4/26
平成26年度第4回北海道公募債 (20年)	1.569	200,000	233,264	2034/6/27	平成27年度第8回京都府公募債 (15年)	0.78	600,000	637,986	2030/10/11
平成26年度第12回北海道公募債 (20年)	1.303	200,000	226,318	2034/12/26	平成28年度第2回京都府公募債 (15年)	0.21	200,000	200,622	2031/4/22
平成27年度第4回北海道公募債 (20年)	1.357	600,000	684,648	2035/6/29	平成28年度第5回京都府公募債 (20年)	0.327	600,000	593,412	2036/8/15
平成27年度第12回北海道公募債 (20年)	1.156	200,000	222,602	2035/12/25	平成29年度第2回京都府公募債 (15年)	0.391	500,000	509,770	2032/4/23

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
平成29年度第5回京都府公募債(20年)	0.63	100,000	103,339	2037/8/14	令和元年度第5回愛知県公募債(20年)	0.288	400,000	388,320	2039/7/12
平成30年度第5回京都府公募債(20年)	0.658	600,000	622,374	2038/8/13	令和元年度第12回愛知県公募債(20年)	0.156	292,500	291,631	2039/11/18
平成30年度第8回京都府公募債(20年)	0.435	462,500	474,104	2038/10/15	平成23年度第1回広島県公募債(20年)	1.83	100,000	118,043	2031/9/22
令和元年度第5回京都府公募債(20年)	0.2	400,000	381,416	2039/8/19	平成24年度第1回広島県公募債(20年)	1.7	600,000	704,070	2032/9/14
第1回兵庫県公募債(18年)	1.26	400,000	447,940	2032/8/6	平成25年度第1回広島県公募債(20年)	1.75	300,000	356,277	2033/9/13
第12回兵庫県公募債(15年)	0.781	200,000	212,442	2030/12/6	平成26年度第1回広島県公募債(20年)	1.41	600,000	689,346	2034/9/12
第14回兵庫県公募債(15年)	0.428	200,000	204,440	2032/5/26	平成27年度第1回広島県公募債(20年)	1.212	500,000	561,670	2035/9/25
第6回兵庫県公募債(20年)	0.436	681,590	697,443	2038/9/10	平成28年度第1回広島県公募債(20年)	0.414	200,000	200,420	2036/9/26
第13回兵庫県公募債(20年)	1.83	500,000	591,660	2032/3/16	平成29年度第2回広島県公募債(20年)	0.597	700,000	719,243	2037/9/25
第15回兵庫県公募債(20年)	1.64	600,000	698,700	2032/7/23	平成30年度第1回広島県公募債(20年)	0.568	700,000	714,189	2038/5/17
第16回兵庫県公募債(20年)	1.7	100,000	117,388	2032/11/19	平成30年度第2回広島県公募債(20年)	0.668	600,000	622,974	2038/9/17
第19回兵庫県公募債(20年)	1.57	100,000	116,464	2033/12/9	平成31年度第1回広島県公募債(20年)	0.419	700,000	694,421	2039/4/19
第20回兵庫県公募債(20年)	1.53	200,000	232,166	2034/3/10	令和元年度第2回広島県公募債(20年)	0.2	400,000	381,336	2039/9/20
第21回兵庫県公募債(20年)	1.54	300,000	348,975	2034/5/9	令和2年度第1回広島県公募債(20年)	0.315	800,000	777,576	2040/4/17
第22回兵庫県公募債(20年)	1.4	500,000	572,945	2034/9/8	平成20年度第2回埼玉県公募債(15年)	0.869	100,000	107,273	2030/5/27
第24回兵庫県公募債(20年)	1.23	200,000	224,536	2035/3/23	第3回埼玉県公募債(15年)	0.43	500,000	512,340	2032/1/30
第26回兵庫県公募債(20年)	0.665	300,000	312,135	2036/3/7	平成22年度第10回埼玉県公募債(20年)	1.94	500,000	590,755	2030/11/12
第28回兵庫県公募債(20年)	0.273	700,000	685,258	2036/6/20	平成21年度第11回埼玉県公募債(20年)	2.0	200,000	238,904	2031/6/20
第30回兵庫県公募債(20年)	0.607	300,000	308,601	2036/12/19	第12回埼玉県公募債(20年)	1.73	100,000	117,540	2032/5/24
第32回兵庫県公募債(20年)	0.621	400,000	411,936	2037/5/1	第13回埼玉県公募債(20年)	1.599	600,000	700,026	2033/5/20
第35回兵庫県公募債(20年)	0.578	600,000	612,156	2038/5/28	第14回埼玉県公募債(20年)	1.546	600,000	699,330	2034/5/8
第37回兵庫県公募債(20年)	0.472	500,000	500,180	2039/2/18	第15回埼玉県公募債(20年)	1.166	400,000	446,152	2035/2/16
第38回兵庫県公募債(20年)	0.352	300,000	293,076	2039/6/20	第16回埼玉県公募債(20年)	1.216	200,000	224,752	2035/8/14
第10回静岡県公募債(20年)	0.355	378,960	385,106	2038/6/18	第18回埼玉県公募債(20年)	0.323	500,000	494,310	2036/6/20
第12回静岡県公募債(20年)	0.257	600,000	604,524	2039/3/18	第20回埼玉県公募債(20年)	0.626	300,000	309,693	2037/5/15
第2回静岡県公募債(30年)	2.54	300,000	409,320	2038/9/17	第21回埼玉県公募債(20年)	0.625	500,000	516,170	2037/12/11
第10回静岡県公募債(20年)	2.072	300,000	357,381	2030/6/14	第22回埼玉県公募債(20年)	0.568	600,000	612,168	2038/11/5
第11回静岡県公募債(20年)	1.841	350,000	409,822	2030/10/18	第23回埼玉県公募債(20年)	0.626	300,000	309,012	2038/12/17
第12回静岡県公募債(20年)	2.003	230,000	274,813	2031/6/20	第24回埼玉県公募債(20年)	0.431	100,000	99,322	2039/5/17
第14回静岡県公募債(20年)	1.736	500,000	588,210	2032/6/18	第25回埼玉県公募債(20年)	0.32	450,000	438,363	2039/12/20
第15回静岡県公募債(20年)	1.701	450,000	528,327	2032/10/15	平成27年度第1回福岡県公募債(15年)	0.784	500,000	531,705	2030/11/25
第18回静岡県公募債(20年)	1.473	600,000	693,744	2034/7/10	平成29年度第1回福岡県公募債(15年)	0.419	400,000	407,804	2032/11/22
第19回静岡県公募債(20年)	1.253	300,000	338,829	2035/7/27	平成30年度第2回福岡県公募債(15年)	0.542	600,000	619,176	2033/10/17
第22回静岡県公募債(20年)	0.443	200,000	201,300	2036/9/19	令和元年度第1回福岡県公募債(15年)	0.254	600,000	594,246	2034/6/14
第23回静岡県公募債(20年)	0.626	100,000	103,167	2037/6/19	令和元年度第2回福岡県公募債(15年)	0.269	400,000	395,824	2034/12/13
第24回静岡県公募債(20年)	0.63	200,000	206,548	2037/9/18	平成22年度第2回福岡県公募債(20年)	2.116	100,000	120,337	2031/2/21
第25回静岡県公募債(20年)	0.53	600,000	607,932	2038/6/18	平成23年度第2回福岡県公募債(20年)	1.806	100,000	117,694	2031/8/18
第26回静岡県公募債(20年)	0.711	600,000	627,306	2038/9/17	平成24年度第1回福岡県公募債(20年)	1.734	100,000	117,575	2032/5/21
第28回静岡県公募債(20年)	0.31	700,000	681,485	2039/9/20	平成24年度第2回福岡県公募債(20年)	1.635	600,000	699,264	2032/8/16
平成22年度第4回愛知県公募債(20年)	2.072	100,000	119,127	2030/6/14	平成25年度第1回福岡県公募債(20年)	1.599	300,000	350,013	2033/5/20
平成22年度第14回愛知県公募債(20年)	2.087	350,000	419,310	2030/12/13	平成25年度第2回福岡県公募債(20年)	1.787	100,000	119,180	2033/8/12
平成23年度第5回愛知県公募債(20年)	1.988	100,000	119,324	2031/6/20	平成26年度第1回福岡県公募債(20年)	1.542	250,000	291,202	2034/5/26
平成23年度第16回愛知県公募債(20年)	1.8	100,000	118,053	2032/1/26	平成26年度第2回福岡県公募債(20年)	1.451	300,000	346,428	2034/9/22
平成24年度第4回愛知県公募債(20年)	1.687	200,000	234,094	2032/6/11	平成26年度第4回福岡県公募債(20年)	1.249	200,000	225,412	2035/2/23
平成24年度第17回愛知県公募債(20年)	1.829	400,000	477,072	2033/2/8	平成27年度第1回福岡県公募債(20年)	1.285	500,000	566,220	2035/5/22
平成25年度第3回愛知県公募債(20年)	1.509	200,000	230,922	2033/5/13	平成28年度第1回福岡県公募債(20年)	0.308	500,000	493,190	2036/5/23
平成25年度第11回愛知県公募債(20年)	1.77	100,000	119,013	2033/9/13	平成28年度第4回福岡県公募債(20年)	0.744	600,000	631,056	2037/2/12
平成26年度第4回愛知県公募債(20年)	1.542	100,000	116,524	2034/5/15	平成29年度第1回福岡県公募債(20年)	0.626	100,000	103,238	2037/5/29
平成26年度第13回愛知県公募債(20年)	1.363	600,000	685,596	2034/11/14	令和元年度第1回福岡県公募債(20年)	0.359	600,000	589,212	2039/11/25
平成27年度第3回愛知県公募債(20年)	1.115	700,000	775,754	2035/5/8	第9回千葉県公募債(20年)	0.416	462,500	473,299	2038/10/15
平成27年度第14回愛知県公募債(20年)	1.129	200,000	222,326	2035/11/19	第9回千葉県公募債(20年)	1.84	400,000	468,200	2030/10/11
平成28年度第2回愛知県公募債(20年)	0.387	100,000	99,887	2036/5/12	第10回千葉県公募債(20年)	1.8	300,000	352,887	2031/8/18
平成28年度第12回愛知県公募債(20年)	0.429	300,000	300,864	2036/11/18	第11回千葉県公募債(20年)	1.87	100,000	118,708	2031/12/12
平成29年度第12回愛知県公募債(20年)	0.606	400,000	411,668	2037/11/20	第12回千葉県公募債(20年)	1.839	400,000	474,812	2032/4/16
平成30年度第2回愛知県公募債(20年)	0.54	100,000	101,561	2038/4/30	第13回千葉県公募債(20年)	1.701	550,000	645,733	2032/10/15
平成30年度第12回愛知県公募債(20年)	0.706	300,000	313,281	2038/11/15	第14回千葉県公募債(20年)	1.137	700,000	775,558	2033/4/15
平成30年度第14回愛知県公募債(20年)	0.291	555,000	561,396	2038/12/14	第15回千葉県公募債(20年)	1.604	100,000	116,938	2033/10/14

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)＜愛称 円奏会(年1回決算型)＞

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16回千葉県公債券(20年)	1.555	600,000	699,588	2034/4/14	第1回名古屋市政公債券(20年)	0.17	300,000	299,427	2039/8/19
第17回千葉県公債券(20年)	1.403	600,000	688,830	2034/10/13	第2回名古屋市政公債券(20年)	0.156	292,500	291,628	2039/11/18
第18回千葉県公債券(20年)	1.138	600,000	667,074	2035/4/13	第1回名古屋市公債券(30年)	2.53	500,000	655,100	2035/3/20
第19回千葉県公債券(20年)	1.166	100,000	111,712	2035/10/15	第3回名古屋市公債券(30年)	2.5	100,000	134,135	2037/9/18
第23回千葉県公債券(20年)	0.63	300,000	309,861	2037/10/15	第6回名古屋市公債券(30年)	2.45	100,000	136,918	2039/12/20
第24回千葉県公債券(20年)	0.559	200,000	203,906	2038/4/15	第14回名古屋市公債券(20年)	1.648	500,000	583,375	2032/8/10
第25回千葉県公債券(20年)	0.701	700,000	730,835	2038/10/15	第15回名古屋市公債券(20年)	1.712	300,000	354,786	2033/9/9
第27回千葉県公債券(20年)	0.251	800,000	769,752	2039/10/14	第16回名古屋市公債券(20年)	1.52	200,000	232,464	2034/6/9
平成29年度第1回新潟県公債券	0.616	700,000	721,812	2037/8/14	第17回名古屋市公債券(20年)	1.203	500,000	560,500	2035/5/28
平成30年度第1回新潟県公債券	0.653	700,000	724,934	2038/8/20	第18回名古屋市公債券(20年)	1.139	700,000	779,177	2035/11/20
令和元年度第1回新潟県公債券	0.2	800,000	762,832	2039/8/19	第19回名古屋市公債券(20年)	0.323	300,000	296,808	2036/4/28
平成30年度第2回茨城県公債券	0.386	500,000	509,700	2038/7/30	第20回名古屋市公債券(20年)	0.645	600,000	621,210	2037/5/25
令和元年度第2回茨城県公債券	0.19	500,000	498,485	2039/7/29	第21回名古屋市公債券(20年)	0.568	700,000	714,189	2038/5/18
令和2年度第2回茨城県公債券	0.356	300,000	300,054	2040/7/31	第22回名古屋市公債券(20年)	0.431	700,000	695,254	2039/5/20
第2回群馬県公債券(20年)	0.2	380,000	380,429	2039/6/17	第1回京都市公債券(15年)	0.781	100,000	106,353	2030/12/20
第1回群馬県公債券(20年)	1.841	250,000	292,730	2030/10/18	第2回京都市公債券(20年)	0.331	540,000	547,182	2038/7/16
第2回群馬県公債券(20年)	2.019	100,000	119,920	2031/7/18	第3回京都市公債券(20年)	0.244	665,000	669,289	2039/2/18
第3回群馬県公債券(20年)	1.687	600,000	703,008	2032/6/25	第4回京都市公債券(20年)	0.18	285,000	284,649	2039/7/15
第4回群馬県公債券(20年)	1.667	100,000	117,539	2033/6/17	第9回京都市公債券(20年)	2.143	200,000	240,794	2030/12/17
第5回群馬県公債券(20年)	1.529	600,000	698,244	2034/6/16	第10回京都市公債券(20年)	1.803	200,000	235,878	2031/11/21
第6回群馬県公債券(20年)	1.267	600,000	678,198	2035/6/11	第11回京都市公債券(20年)	1.701	100,000	117,471	2032/11/19
第7回群馬県公債券(20年)	0.313	700,000	690,984	2036/6/13	第13回京都市公債券(20年)	1.359	300,000	342,714	2034/11/24
第9回群馬県公債券(20年)	0.554	400,000	407,208	2038/6/11	第14回京都市公債券(20年)	1.139	400,000	445,256	2035/11/22
第10回群馬県公債券(20年)	0.338	500,000	488,100	2039/6/17	第15回京都市公債券(20年)	0.487	500,000	505,885	2036/11/28
第11回群馬県公債券(20年)	0.416	400,000	395,696	2040/6/12	第16回京都市公債券(20年)	0.611	600,000	618,006	2037/11/27
平成30年度第1回大分県公債券	0.38	300,000	305,670	2038/7/16	第17回京都市公債券(20年)	0.683	700,000	728,322	2038/11/26
令和元年度第1回大分県公債券	0.19	600,000	598,704	2039/7/15	第18回京都市公債券(20年)	0.355	400,000	392,532	2039/11/18
令和2年度第1回大分県公債券	0.281	600,000	604,782	2040/7/10	平成22年度第4回神戸市公債券(20年)	1.895	100,000	117,530	2030/9/13
平成23年度第1回堺市公債券(20年)	1.8	500,000	588,220	2031/11/21	平成22年度第9回神戸市公債券(20年)	2.09	350,000	419,737	2031/1/24
平成24年度第1回堺市公債券(20年)	1.732	600,000	705,618	2032/11/12	平成23年度第4回神戸市公債券(20年)	1.913	150,000	178,357	2031/9/12
平成30年度第2回堺市公債券(20年)	0.386	647,500	660,676	2038/11/15	平成23年度第14回神戸市公債券(20年)	1.794	200,000	235,990	2032/2/13
令和元年度第2回堺市公債券(20年)	0.21	585,000	586,327	2039/11/18	平成24年度第3回神戸市公債券(20年)	1.635	500,000	582,665	2032/8/13
平成30年度第2回長崎県公債券	0.491	500,000	514,920	2038/8/20	平成24年度第12回神戸市公債券(20年)	1.711	500,000	588,495	2032/12/17
令和元年度第2回長崎県公債券	0.18	400,000	398,176	2039/8/26	平成25年度第12回神戸市公債券(20年)	1.52	100,000	116,039	2034/2/17
平成28年度第2回島根県公債券(20年)	0.506	100,000	101,608	2036/9/30	平成26年度第3回神戸市公債券(20年)	1.482	300,000	347,271	2034/7/14
平成29年度第2回島根県公債券	0.583	700,000	717,661	2037/9/18	平成27年度第9回神戸市公債券(20年)	1.007	100,000	109,338	2036/1/25
平成30年度第2回島根県公債券	0.668	700,000	726,803	2038/9/17	平成28年度第9回神戸市公債券(20年)	0.645	400,000	414,516	2037/1/23
令和元年度第2回島根県公債券	0.2	400,000	381,336	2039/9/20	平成29年度第5回神戸市公債券(20年)	0.597	200,000	205,494	2037/9/18
平成30年度第1回栃木県公債券	0.421	555,000	568,081	2038/10/22	平成30年度第6回神戸市公債券(20年)	0.668	300,000	311,487	2038/9/17
令和元年度第1回栃木県公債券	0.14	487,500	484,677	2039/10/24	令和元年度第6回神戸市公債券(20年)	0.2	500,000	476,670	2039/9/20
平成30年度第1回奈良県公債券	0.396	277,500	283,016	2038/9/17	第1回横浜市公債券(30年)	2.63	500,000	658,330	2034/9/20
令和元年度第1回奈良県公債券	0.15	292,500	291,628	2039/9/20	第2回横浜市公債券(30年)	2.49	500,000	652,300	2035/3/30
第11回大阪市公債券(20年)	2.25	100,000	120,533	2030/3/26	第4回横浜市公債券(30年)	2.54	210,000	280,686	2036/12/19
第13回大阪市公債券(20年)	2.08	550,000	655,627	2030/6/14	第21回横浜市公債券(20年)	1.969	100,000	118,233	2030/7/19
第14回大阪市公債券(20年)	1.97	300,000	355,353	2030/10/30	第22回横浜市公債券(20年)	1.895	100,000	117,530	2030/9/13
第15回大阪市公債券(20年)	2.12	250,000	300,742	2031/1/24	第25回横浜市公債券(20年)	1.72	400,000	469,976	2032/7/16
第17回大阪市公債券(20年)	1.721	200,000	235,670	2032/12/21	第26回横浜市公債券(20年)	1.776	300,000	355,737	2033/1/28
第18回大阪市公債券(20年)	1.262	700,000	790,272	2035/2/27	第27回横浜市公債券(20年)	1.599	300,000	350,013	2033/5/20
第19回大阪市公債券(20年)	1.138	600,000	666,726	2035/4/24	第28回横浜市公債券(20年)	1.586	300,000	350,406	2033/11/11
第20回大阪市公債券(20年)	1.184	200,000	223,914	2035/8/31	第29回横浜市公債券(20年)	1.528	200,000	232,592	2034/5/26
第21回大阪市公債券(20年)	0.97	300,000	326,403	2036/1/29	平成30年度第3回札幌市公債券(20年)	1.376	400,000	457,824	2034/10/20
第22回大阪市公債券(20年)	0.347	700,000	694,533	2036/5/30	第31回横浜市公債券(20年)	1.18	300,000	335,109	2035/4/20
第24回大阪市公債券(20年)	0.655	200,000	207,508	2037/4/21	第35回横浜市公債券(20年)	0.443	100,000	100,577	2036/10/28
第26回大阪市公債券(20年)	0.635	500,000	516,860	2037/10/23	第40回横浜市公債券(20年)	0.559	700,000	713,671	2038/4/16
第27回大阪市公債券(20年)	0.544	200,000	203,416	2038/4/20	第2回札幌市公債券(20年)	1.944	600,000	714,594	2031/7/29
第28回大阪市公債券(20年)	0.381	450,000	458,361	2038/5/28	平成24年度第1回札幌市公債券	1.79	600,000	708,624	2032/4/23
第29回大阪市公債券(20年)	0.218	665,000	666,948	2039/5/27					

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)＜愛称 円奏会(年1回決算型)＞

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円		地方債証券	%	千円	千円	
平成24年度第4回札幌市公債(20年)	1.635	200,000	233,066	2032/8/13	平成29年度第1回仙台市公債	0.616	700,000	721,448	2037/10/19
平成24年度第11回札幌市公債(20年)	1.794	100,000	118,924	2033/2/28	平成30年度第1回仙台市公債	0.426	555,000	567,504	2038/8/20
平成25年度第1回札幌市公債(20年)	1.72	200,000	236,380	2033/6/14	平成30年度第2回仙台市公債	0.729	700,000	734,160	2038/10/18
平成25年度第10回札幌市公債(20年)	1.53	300,000	348,771	2034/3/17	令和元年度第1回仙台市公債	0.17	390,000	389,251	2039/8/19
平成26年度第1回札幌市公債(20年)	1.524	500,000	581,210	2034/5/26	令和元年度第2回仙台市公債	0.15	700,000	693,980	2039/10/14
平成26年度第10回札幌市公債(20年)	1.267	400,000	452,056	2035/3/20	平成24年度第2回福井県公債	1.711	100,000	117,714	2032/12/21
平成27年度第3回札幌市公債(20年)	1.211	200,000	224,546	2035/7/31	平成25年度第1回福井県公債	1.667	100,000	117,553	2033/6/7/21
平成29年度第5回札幌市公債(20年)	0.597	600,000	616,482	2037/9/18	平成26年度第1回福井県公債	1.482	100,000	115,769	2033/4/7/18
平成30年度第1回札幌市公債(20年)	0.366	360,000	366,199	2038/5/21	平成27年度第1回福井県公債	1.28	600,000	679,818	2035/7/17
平成30年度第8回札幌市公債(20年)	0.626	700,000	721,042	2038/12/20	平成28年度第1回福井県公債	0.18	700,000	676,361	2036/7/29
令和元年度第4回札幌市公債(20年)	0.15	300,000	298,914	2039/9/20	平成29年度第1回福井県公債	0.659	100,000	103,871	2037/7/24
第11回川崎市公債(20年)	1.84	150,000	175,623	2030/10/18	平成30年度第1回福井県公債	0.535	500,000	507,910	2038/7/30
第14回川崎市公債(20年)	1.79	100,000	118,025	2032/3/19	平成30年度第4回福井県公債	0.386	462,500	471,911	2038/11/15
第15回川崎市公債(20年)	1.727	300,000	353,022	2032/9/17	令和元年度第1回福井県公債	0.286	400,000	387,816	2039/7/29
第18回川崎市公債(20年)	1.541	600,000	698,406	2034/3/17	令和元年度第4回福井県公債	0.21	292,500	292,877	2039/11/18
第20回川崎市公債(20年)	1.133	200,000	222,130	2035/3/20	令和2年度第1回福井県公債	0.249	600,000	601,554	2040/7/13
第21回川崎市公債(20年)	1.11	200,000	221,712	2035/9/20	令和2年度第3回福井県公債	0.449	600,000	587,694	2040/8/3
第22回川崎市公債(20年)	0.377	600,000	598,416	2036/4/22	平成30年度第1回徳島県公債	0.331	370,000	374,928	2038/7/30
第23回川崎市公債(20年)	0.549	300,000	306,774	2036/9/19	令和元年度第1回徳島県公債	0.18	390,000	389,672	2039/7/29
第24回川崎市公債(20年)	0.683	100,000	104,190	2037/4/17	令和2年度第1回徳島県公債	0.282	400,000	399,854	2040/7/31
第27回川崎市公債(20年)	0.559	300,000	305,859	2038/4/16	令和元年度第1回岡山県公債	0.351	437,500	444,272	2037/12/22
第28回川崎市公債(20年)	0.422	370,000	378,763	2038/10/29	平成30年度第1回岡山県公債	0.29	647,500	653,813	2038/12/21
第29回川崎市公債(20年)	0.223	570,000	572,428	2039/4/22	令和元年度第1回岡山県公債	0.192	390,000	390,616	2039/12/20
第30回川崎市公債(20年)	0.2	600,000	570,852	2039/6/20	令和元年度第1回神奈川県住宅供給公社債券	0.709	600,000	608,508	2038/4/23
第31回川崎市公債(20年)	0.14	390,000	387,936	2039/10/21	第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	400,000	397,608	2029/4/23
第6回北九州市公債(20年)	0.18	680,960	679,815	2039/7/22	第7回神奈川県住宅供給公社債券	0.534	300,000	296,663	2039/4/22
第10回北九州市公債(20年)	2.09	250,000	299,350	2031/1/24	第1回川崎市土地開発公社債券	0.02	700,000	696,185	2024/6/25
第11回北九州市公債(20年)	2.019	500,000	598,310	2031/7/18	第2回公営企業債券(30年)	2.39	100,000	127,079	2033/12/20
第13回北九州市公債(20年)	1.706	400,000	468,232	2032/7/16	第3回公営企業債券(30年)	2.59	300,000	389,229	2033/12/20
第14回北九州市公債(20年)	1.732	600,000	705,618	2032/11/12	第8回地方公共団体金融機構債券(30年)	2.5	200,000	261,518	2035/9/21
第15回北九州市公債(20年)	1.667	100,000	117,246	2033/6/17	第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	119,681	2030/12/27
第16回北九州市公債(20年)	1.604	100,000	116,630	2033/10/11	第13回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.132	100,000	120,193	2031/1/28
第17回北九州市公債(20年)	1.529	600,000	696,456	2034/6/20	第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	110,103	2031/9/26
第18回北九州市公債(20年)	1.376	200,000	228,290	2034/10/20	第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	100,000	118,039	2031/12/26
第19回北九州市公債(20年)	1.312	600,000	680,196	2035/6/19	第21回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.812	100,000	118,038	2032/4/28
第20回北九州市公債(20年)	1.111	100,000	110,538	2035/10/26	第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	500,000	585,720	2032/9/28
平成23年度第4回福岡市公債(20年)	1.89	300,000	355,833	2031/8/19	第32回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	100,000	116,942	2033/10/28
平成24年度第2回福岡市公債(20年)	1.702	400,000	469,196	2032/7/20	第33回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.668	500,000	588,200	2033/12/28
平成24年度第6回福岡市公債(20年)	1.696	300,000	351,924	2032/9/17	第35回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.569	300,000	349,494	2034/3/28
平成25年度第1回福岡市公債(20年)	1.808	100,000	119,425	2033/7/19	第37回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.535	200,000	232,364	2034/6/28
平成25年度第6回福岡市公債(20年)	1.511	400,000	463,684	2034/2/17	第40回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.381	600,000	685,366	2034/10/27
平成26年度第2回福岡市公債(20年)	1.49	600,000	695,196	2034/6/20	第42回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.999	100,000	108,882	2035/1/26
平成26年度第6回福岡市公債(20年)	1.371	200,000	228,772	2034/9/20	第44回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.298	300,000	339,330	2035/6/28
平成27年度第6回福岡市公債(20年)	1.121	100,000	111,102	2035/12/18	第46回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.189	100,000	111,527	2035/9/28
平成28年度第6回福岡市公債(20年)	0.429	700,000	702,016	2036/11/25	第51回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.377	400,000	397,472	2036/4/28
平成30年度第7回福岡市公債(20年)	0.701	700,000	730,863	2038/10/19	第67回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.564	200,000	203,438	2038/6/28
平成30年度第8回福岡市公債(20年)	0.416	460,000	473,195	2038/10/19	第77回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.2	500,000	474,970	2039/9/28
平成31年度第2回福岡市公債(20年)	0.225	584,615	587,216	2039/4/22	第79回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.345	400,000	390,040	2039/12/28
平成31年度第3回福岡市公債(20年)	0.419	600,000	595,218	2039/4/22	第80回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.354	500,000	488,300	2040/1/27
2019年度第5回福岡市公債(20年)	0.286	300,000	290,862	2039/7/29	第83回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.44	400,000	397,468	2040/6/28
2019年度第7回福岡市公債(20年)	0.271	500,000	482,840	2039/10/24	第11回広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.763	300,000	310,653	2037/2/27
平成29年度第2回広島市公債(20年)	0.616	200,000	206,236	2037/8/18	第10回大阪府住宅供給公社債券	0.395	300,000	302,844	2027/6/18
平成29年度第4回広島市公債(20年)	0.62	600,000	618,858	2037/11/20	第12回大阪府住宅供給公社債券	0.34	500,000	502,510	2028/6/20
平成30年度第2回広島市公債(20年)	0.639	700,000	723,296	2038/8/20	第13回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.514	500,000	508,255	2032/2/27
平成30年度第4回広島市公債(20年)	0.706	700,000	731,010	2038/11/19	第136回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.768	400,000	414,508	2037/2/27
令和元年度第2回広島市公債(20年)	0.2	800,000	762,832	2039/8/19	第151回愛知県・名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.32	500,000	476,675	2040/2/28
令和元年度第4回広島市公債(20年)	0.355	400,000	392,528	2039/11/21	第121回福岡北九州高速道路債券	2.31	400,000	475,432	2029/12/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第147回福岡北九州高速道路債	0.502	500,000	507,625	2032/3/19
第148回福岡北九州高速道路債	0.731	500,000	514,965	2037/3/19
第150回福岡北九州高速道路債	0.396	600,000	598,980	2033/3/18
第13回東京都住宅供給公社債券	2.4	400,000	480,420	2030/5/24
第24回東京都住宅供給公社債券	0.519	500,000	494,395	2036/9/12
第26回東京都住宅供給公社債券	0.697	600,000	606,660	2037/9/11
第29回東京都住宅供給公社債券	0.749	200,000	204,534	2038/9/17
第30回東京都住宅供給公社債券	0.496	185,000	188,872	2038/9/17
第32回東京都住宅供給公社債券	0.341	300,000	282,972	2039/9/26
第33回東京都住宅供給公社債券	0.25	292,500	290,622	2039/9/26
第35回東京都住宅供給公社債券	0.251	500,000	498,165	2029/12/24
第36回東京都住宅供給公社債券	0.416	400,000	394,412	2034/12/22
小 計		170,721,245	183,069,558	
特殊債券(除く金融債)				
第61回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	139,417	2038/6/30
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	300,000	358,362	2030/4/30
第114回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	300,000	353,352	2030/7/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	117,956	2030/9/30
第121回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	500,000	585,160	2030/10/31
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	500,000	601,585	2030/12/27
第128回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	300,000	358,200	2031/1/31
第130回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	500,000	597,380	2031/2/28
第134回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	241,548	2031/4/30
第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	118,810	2031/6/30
第141回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	300,000	356,862	2031/7/31
第143回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	235,866	2031/8/29
第146回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	236,016	2031/9/30
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	118,142	2031/10/31
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	500,000	591,260	2031/12/26
第160回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	118,476	2032/3/19
第169回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	200,000	233,764	2032/7/30
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	500,000	580,275	2032/8/31
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.641	300,000	351,159	2032/9/30
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.645	200,000	234,424	2032/10/29
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.68	500,000	588,425	2032/11/30
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	400,000	473,660	2033/1/31
第185回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.757	400,000	475,340	2033/2/28
第187回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.662	600,000	706,434	2033/3/18
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	500,000	572,470	2033/4/28
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.779	500,000	597,755	2033/7/29
第199回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.702	600,000	711,768	2033/8/31
第203回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.556	100,000	116,830	2033/10/31
第205回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.532	500,000	583,105	2033/11/30
第208回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.577	600,000	703,332	2033/12/28
第210回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.547	200,000	233,738	2034/1/31
第212回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	500,000	581,720	2034/2/28
第219回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.478	400,000	464,748	2034/5/31
第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.466	500,000	580,990	2034/6/30
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.427	500,000	578,465	2034/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	500,000	576,435	2034/8/31
第228回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.396	500,000	576,880	2034/9/29
第230回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.338	500,000	572,960	2034/10/31
第233回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.315	500,000	571,385	2034/11/30
第235回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.224	500,000	565,050	2034/12/28
第237回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.97	500,000	546,985	2035/1/31
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	500,000	560,515	2035/2/28
第242回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.216	500,000	564,775	2035/3/30

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第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	665,994	2035/4/27
第246回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.178	300,000	337,164	2035/5/31
第250回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.278	600,000	683,262	2035/6/29
第252回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	700,000	793,331	2035/7/31
第255回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.22	100,000	113,041	2035/8/31
第257回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.187	100,000	112,629	2035/9/28
第262回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.109	700,000	780,801	2035/11/30
第264回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.113	200,000	223,148	2035/12/28
第272回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.461	700,000	711,550	2036/3/31
第270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	490,825	2036/5/30
第284回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.149	500,000	483,685	2036/7/31
第293回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.397	500,000	502,645	2036/10/31
第298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	204,838	2036/11/28
第298回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.547	500,000	513,690	2036/12/26
第301回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.618	600,000	623,148	2037/1/30
第304回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.737	700,000	740,145	2037/2/27
第307回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.681	100,000	104,802	2037/3/31
第314回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.59	600,000	619,932	2037/5/29
第316回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.569	100,000	102,922	2037/6/30
第322回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	600,000	616,338	2037/8/31
第325回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.549	100,000	102,475	2037/9/30
第328回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.585	600,000	618,408	2037/10/30
第331回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.566	700,000	718,830	2037/11/30
第343回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.562	100,000	102,503	2038/3/31
第349回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.538	700,000	714,287	2038/5/31
第352回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.543	100,000	102,133	2038/6/30
第358回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	500,000	512,122	2038/8/31
第361回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.625	500,000	517,310	2038/9/30
第364回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	700,000	732,095	2038/10/29
第367回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.676	100,000	104,284	2038/11/30
第370回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.6	700,000	720,412	2038/12/28
第373回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.522	700,000	710,479	2039/1/31
第376回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	700,000	702,408	2039/2/28
第379回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.419	700,000	696,836	2039/3/31
第21回政府保証民間都市開発債券	0.618	300,000	309,669	2038/12/27
第22回政府保証民間都市開発債券	0.245	1,000,000	960,440	2040/2/28
第23回政府保証民間都市開発債券	0.397	800,000	789,392	2040/6/29
第54回政府保証関西国際空港債券	2.4	500,000	593,725	2028/6/23
小 計		34,900,000	38,375,277	
金融債券				
イ、第830号商工債	0.11	100,000	100,019	2024/7/26
第211号商工債(3年)	0.07	500,000	500,015	2020/8/27
小 計		600,000	600,034	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第497回中部電力株式会社社債	0.986	700,000	701,477	2020/10/23
第501回中部電力株式会社社債	0.803	200,000	205,362	2024/9/25
第503回中部電力株式会社社債	0.584	200,000	203,686	2025/3/25
第508回中部電力株式会社社債	0.18	200,000	200,386	2023/4/25
第511回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	99,911	2026/7/24
第513回中部電力株式会社社債	0.14	300,000	300,228	2023/8/25
第518回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,223	2023/1/25
第520回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,227	2023/3/24
第522回中部電力株式会社社債	0.13	200,000	200,120	2022/4/25
第530回中部電力株式会社社債	0.274	600,000	599,418	2029/6/25
第531回関西電力株式会社社債	0.41	600,000	602,502	2027/9/17
第512回関西電力株式会社社債	0.32	400,000	401,768	2024/10/25
第515回関西電力株式会社社債	0.435	600,000	602,478	2028/4/25

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518回関西電力株式会社社債	0.44	300,000	301,263	2028/6/20	第34回日本政策投資銀行債券	2.67	200,000	271,502	2037/3/19
第527回関西電力株式会社社債	0.28	500,000	501,765	2024/4/25	第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	133,724	2035/9/20
第369回中国電力株式会社社債	0.976	800,000	801,640	2020/10/23	第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	200,000	264,708	2035/12/20
第378回中国電力株式会社社債	1.004	300,000	308,475	2023/10/25	第40回日本高速道路保有・債務返済機構債券(指定金融機関等限)	0.5	700,000	702,898	2038/9/17
第381回中国電力株式会社社債	0.953	100,000	103,009	2024/4/25	第69回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.19	100,000	120,934	2031/3/20
第383回中国電力株式会社社債	0.764	400,000	410,020	2024/10/25	第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	500,000	594,350	2032/3/19
第398回中国電力株式会社社債	0.425	400,000	404,388	2027/7/23	第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	500,000	589,000	2032/9/17
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,338	2024/10/25	第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.55	500,000	579,935	2034/3/17
第404回中国電力株式会社社債	0.355	100,000	100,492	2028/4/25	第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.133	100,000	110,525	2035/3/20
第311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	207,742	2027/9/24	第191回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.661	200,000	206,970	2037/12/18
第314回北陸電力株式会社社債	0.36	100,000	100,661	2026/2/25	第194回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.64	500,000	515,315	2037/12/18
第318回北陸電力株式会社社債	0.26	450,000	449,856	2026/12/25	第210回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.677	700,000	725,417	2038/9/17
第321回北陸電力株式会社社債	0.365	300,000	301,683	2027/4/23	第9回道路債	2.9	100,000	130,639	2032/5/20
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	503,215	2027/6/25	第21回道路債	2.75	100,000	130,742	2033/6/20
第475回東北電力株式会社社債	0.809	500,000	513,105	2024/9/25	第28回道路債	2.83	500,000	662,070	2033/12/20
第476回東北電力株式会社社債	0.57	100,000	101,672	2025/1/24	第33回道路債	2.91	100,000	134,279	2034/6/20
第491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	605,820	2027/2/25	第43回道路債	2.66	200,000	263,714	2034/12/20
第492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	403,572	2027/4/23	第18回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	120,721	2031/5/9
第496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	301,365	2027/9/24	第121回都市再生債券	0.482	700,000	720,790	2031/2/20
第517回東北電力株式会社社債	0.31	100,000	99,632	2030/2/25	第124回都市再生債券	0.273	300,000	293,025	2036/6/20
第281回四国電力株式会社社債	1.111	500,000	515,700	2023/9/25	第128回都市再生債券	0.39	500,000	497,340	2036/9/19
第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	100,155	2026/11/25	第131回都市再生債券	0.487	500,000	504,335	2036/11/25
第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	201,724	2027/11/25	第133回都市再生債券	0.767	200,000	210,098	2037/2/20
第307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	298,122	2029/9/25	第141回都市再生債券	0.63	100,000	103,012	2038/2/19
第309回四国電力株式会社社債	0.4	500,000	503,580	2030/5/24	第145回都市再生債券	0.584	300,000	306,396	2038/6/18
第429回九州電力株式会社社債	0.909	300,000	308,847	2024/9/25	第150回都市再生債券	0.716	500,000	521,230	2038/11/19
第437回九州電力株式会社社債	0.685	600,000	614,142	2026/1/23	第156回都市再生債券	0.343	400,000	389,476	2039/6/17
第465回九州電力株式会社社債	0.38	500,000	501,945	2028/7/25	第157回都市再生債券	0.2	400,000	380,008	2039/9/16
第489回九州電力株式会社社債	0.44	400,000	402,280	2030/5/24	第160回都市再生債券	0.335	600,000	584,010	2039/12/19
第290回北海道電力株式会社社債	2.09	300,000	304,422	2021/4/23	第6回関西国際空港株式会社社債	2.7	200,000	231,268	2026/9/16
第298回北海道電力株式会社社債	1.82	500,000	501,385	2020/9/25	第17回関西国際空港株式会社社債	2.46	500,000	596,075	2028/12/20
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	300,000	301,986	2021/12/24	第11回独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	113,966	2026/3/20
第321回北海道電力株式会社社債	0.886	111,000	114,308	2024/12/25	第62回独立行政法人福祉医療機構債券	0.18	400,000	400,580	2030/6/20
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	400,000	410,856	2025/12/25	第4回中部国際空港株式会社社債	0.305	600,000	606,642	2027/2/22
第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	201,620	2027/6/25	第6回中部国際空港株式会社社債	0.206	500,000	501,730	2029/2/22
第346回北海道電力株式会社社債	0.31	700,000	703,381	2024/12/25	第52回一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	118,157	2030/7/16
第355回北海道電力株式会社社債	0.14	100,000	100,035	2021/12/24	第69回一般担保住宅金融支援機構債券	2.31	500,000	611,425	2031/4/18
第7回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.46	200,000	201,116	2022/10/24	第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	210,000	251,720	2031/6/13
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.81	500,000	502,480	2027/10/22	第81回一般担保住宅金融支援機構債券	1.926	100,000	118,659	2031/9/12
第10回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.45	100,000	100,558	2023/1/25	第88回一般担保住宅金融支援機構債券	1.863	100,000	118,132	2031/11/18
第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.44	500,000	502,910	2023/4/19	第94回一般担保住宅金融支援機構債券	1.882	500,000	592,935	2032/2/13
第30回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.58	600,000	605,706	2024/10/9	第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	118,874	2032/3/12
第31回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.98	600,000	602,904	2029/10/9	第106回一般担保住宅金融支援機構債券	1.794	100,000	117,904	2032/6/18
第6回新関西国際空港株式会社社債	1.445	300,000	331,368	2028/9/15	第109回一般担保住宅金融支援機構債券	1.787	200,000	235,726	2032/7/16
第9回新関西国際空港株式会社社債	1.231	300,000	327,402	2028/12/20	第115回一般担保住宅金融支援機構債券	1.811	500,000	591,180	2032/9/14
第12回新関西国際空港株式会社社債	1.067	400,000	431,556	2029/9/20	第118回一般担保住宅金融支援機構債券	1.814	100,000	118,326	2032/10/15
第14回新関西国際空港株式会社社債	1.318	600,000	676,386	2034/12/20	第120回一般担保住宅金融支援機構債券	1.836	400,000	474,524	2032/11/12
第16回新関西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	334,239	2035/9/20	第125回一般担保住宅金融支援機構債券	1.898	100,000	119,611	2033/1/25
第18回新関西国際空港株式会社社債	0.675	500,000	513,165	2037/12/18	第127回一般担保住宅金融支援機構債券	1.923	300,000	360,051	2033/2/18
第23回新関西国際空港株式会社社債	0.512	700,000	698,565	2038/12/20	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	235,680	2032/12/20
第79回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.396	700,000	710,563	2032/6/18	第159回一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	300,000	331,773	2035/5/18
第95回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.04	100,000	99,984	2023/9/20	第166回一般担保住宅金融支援機構債券	1.221	100,000	111,981	2035/8/20
第97回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.536	700,000	708,806	2038/7/12	第211回一般担保住宅金融支援機構債券	0.406	500,000	505,125	2032/6/18
第108回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.439	700,000	694,449	2039/4/11	第220回一般担保住宅金融支援機構債券	0.616	200,000	208,470	2037/10/20
第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.253	400,000	382,868	2039/7/11	第223回一般担保住宅金融支援機構債券	0.403	200,000	202,668	2032/11/19
第125回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.379	700,000	685,979	2040/4/24	第239回一般担保住宅金融支援機構債券	0.393	300,000	302,859	2033/6/20
第130回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.479	500,000	501,415	2040/7/20	第255回一般担保住宅金融支援機構債券	0.548	200,000	202,498	2039/1/20

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
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第27回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	300,000	300,615	2034/2/20	第8回西松建設株式会社無担保社債	0.18	800,000	795,888	2024/9/20
第279回一般担保住宅金融支援機構債券	0.285	800,000	789,064	2034/12/20	第10回西松建設株式会社無担保社債	0.33	500,000	500,195	2025/7/18
第283回一般担保住宅金融支援機構債券	0.274	400,000	393,592	2035/2/20	第23回前田建設工業株式会社無担保社債	0.28	400,000	399,640	2023/7/28
第18回成田国際空港株式会社社債	0.556	100,000	102,252	2025/10/30	第26回前田建設工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	297,735	2024/9/12
第20回成田国際空港株式会社社債	0.105	300,000	299,457	2026/8/21	第3回戸田建設株式会社無担保社債	0.27	400,000	399,760	2022/12/14
第21回成田国際空港株式会社社債	0.427	500,000	496,795	2036/8/22	第3回戸田建設株式会社無担保社債	0.68	500,000	502,385	2021/7/30
第23回成田国際空港株式会社社債	0.677	700,000	721,483	2036/12/16	第4回五洋建設株式会社無担保社債	0.14	700,000	699,895	2020/9/15
第25回成田国際空港株式会社社債	0.671	300,000	307,710	2037/12/18	第3回住友林業株式会社無担保社債	0.33	600,000	600,264	2026/6/17
第27回成田国際空港株式会社社債	0.657	600,000	614,742	2038/3/12	第4回住友林業株式会社無担保社債	0.25	400,000	399,432	2025/3/7
第30回成田国際空港株式会社社債	0.77	700,000	727,965	2038/10/22	第5回住友林業株式会社無担保社債	0.35	400,000	398,440	2028/3/7
第35回成田国際空港株式会社社債	0.27	100,000	94,816	2039/9/16	第8回住友林業株式会社無担保社債	0.38	500,000	497,395	2029/3/6
第36回成田国際空港株式会社社債	0.2	400,000	399,804	2030/1/29	第9回住友林業株式会社無担保社債	0.28	700,000	687,589	2029/12/6
第37回成田国際空港株式会社社債	0.424	300,000	293,583	2040/1/27	第12回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.07	700,000	698,446	2022/6/1
第6回沖縄振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	109,698	2025/6/20	第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	99,613	2027/6/1
第7回国際協力機構債券	1.991	100,000	119,068	2031/6/13	第19回積水ハウス株式会社無担保社債	0.04	500,000	499,580	2021/7/20
第15回国際協力機構債券	1.724	300,000	351,462	2032/9/17	第21回積水ハウス株式会社無担保社債	0.2	800,000	795,656	2026/7/17
第19回国際協力機構債券	1.725	100,000	117,759	2033/6/20	第2回協和エクシオ株式会社無担保社債	0.15	200,000	199,730	2022/2/24
第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	118,057	2033/9/20	第4回協和エクシオ株式会社無担保社債	0.12	500,000	496,005	2024/10/25
第25回国際協力機構債券	1.52	600,000	694,356	2034/6/20	第5回協和エクシオ株式会社無担保社債	0.19	200,000	197,592	2026/10/23
第27回国際協力機構債券	1.451	400,000	459,700	2034/9/20	第5回日揮株式会社無担保社債	0.2	400,000	399,292	2022/10/13
第33回国際協力機構債券	1.13	100,000	110,752	2035/12/20	第1回高砂熱学工業株式会社無担保社債	0.37	200,000	200,072	2024/4/19
第36回国際協力機構債券	0.313	100,000	98,271	2036/6/20	第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	0.2	600,000	591,264	2029/7/13
第39回国際協力機構債券	0.744	400,000	418,776	2037/2/20	第1回パールホールディングス株式会社無担保社債	0.088	700,000	699,685	2021/6/14
第43回国際協力機構債券	0.625	700,000	719,747	2037/12/18	第13回森永乳業株式会社無担保社債	0.84	500,000	511,485	2024/5/8
第45回国際協力機構債券	0.559	600,000	609,804	2038/6/18	第14回森永乳業株式会社無担保社債	0.774	100,000	102,386	2025/12/10
第49回国際協力機構債券	0.333	300,000	291,585	2039/6/20	第15回森永乳業株式会社無担保社債	0.37	700,000	701,533	2027/7/23
第54回国際協力機構債券	0.445	600,000	596,736	2040/6/26	第16回森永乳業株式会社無担保社債	0.395	200,000	200,350	2028/9/14
第58回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.81	600,000	713,826	2033/8/19	第17回森永乳業株式会社無担保社債	0.24	400,000	391,692	2029/9/6
第60回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.56	400,000	464,548	2034/2/27	第17回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	300,000	299,688	2024/9/13
第69回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.441	500,000	573,655	2034/8/4	第3回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.12	400,000	399,348	2023/1/30
第75回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.157	200,000	221,786	2035/2/26	第1回雪印メグミルク株式会社無担保社債	0.45	800,000	800,464	2028/12/25
第78回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.801	100,000	106,210	2030/5/28	第10回日本ハム株式会社無担保社債	0.15	200,000	199,362	2024/2/20
第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.221	200,000	223,948	2035/8/17	第11回日本ハム株式会社無担保社債	0.25	700,000	697,235	2026/2/20
第90回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2	500,000	499,175	2031/5/30	第12回日本ハム株式会社無担保社債	0.36	600,000	597,870	2029/2/20
第96回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.274	700,000	702,968	2031/11/28	第2回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.614	400,000	400,612	2020/12/4
第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.739	500,000	523,105	2037/2/27	第30回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.331	300,000	300,330	2020/9/10
第102回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.428	500,000	509,635	2032/5/28	第32回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.15	300,000	299,610	2022/6/1
第106回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.616	500,000	513,970	2037/8/25	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	592,932	2026/9/4
第113回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.63	200,000	206,030	2038/2/26	第30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	491,805	2029/9/5
第115回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.395	100,000	101,039	2033/5/30	第10回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.17	800,000	799,992	2022/6/13
第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.663	400,000	413,548	2038/8/27	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	698,922	2027/6/11
第121回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.515	500,000	511,745	2033/11/28	第9回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.239	600,000	607,926	2021/9/24
第127回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.292	600,000	594,918	2034/5/30	第10回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.603	500,000	508,100	2025/2/28
第36回大成建設株式会社無担保社債	0.14	400,000	399,760	2022/7/22	第11回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.12	300,000	299,547	2023/12/6
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	200,000	204,402	2023/5/9	第12回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	497,040	2024/9/5
第22回株式会社大林組無担保社債	0.385	600,000	601,524	2028/9/13	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	787,504	2029/9/5
第23回株式会社大林組無担保社債	0.13	500,000	498,870	2023/10/25	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	99,973	2030/6/1
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.25	800,000	800,472	2024/8/2	第14回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.1	500,000	499,300	2022/4/25
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	200,000	199,746	2027/11/30	第15回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	400,000	399,628	2024/4/25
第25回清水建設株式会社無担保社債	0.27	200,000	196,544	2029/9/3	第16回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.315	200,000	199,764	2027/4/23
第26回清水建設株式会社無担保社債	0.11	300,000	297,396	2024/12/12	第6回サントリホールディングス株式会社無担保社債	0.22	800,000	798,504	2026/6/2
第11回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.524	700,000	705,936	2028/11/1	第3回ココ・コーラウエスト株式会社無担保社債	0.524	500,000	503,710	2022/6/17
第12回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.35	600,000	591,360	2029/7/19	第1回ココ・コーポラトラーズジャパンホールディングス社債	0.1	800,000	797,848	2024/9/19
第13回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.24	500,000	500,685	2025/7/11	第2回ココ・コーポラトラーズジャパンホールディングス社債	0.2	800,000	796,496	2026/9/18
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	500,580	2030/7/12	第3回ココ・コーポラトラーズジャパンホールディングス社債	0.27	600,000	593,232	2029/9/19
第44回鹿島建設株式会社無担保社債	0.3	300,000	299,253	2026/7/22	第3回サンリール食品インターナショナル株式会社無担保社債	0.001	500,000	499,280	2021/7/26
第46回鹿島建設株式会社無担保社債	0.11	300,000	298,212	2025/2/28	第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	600,000	598,722	2024/2/23

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第10回清オリオグループ株式会社無担保社債	0.769	300,000	306,288	2024/9/10
第11回清オリオグループ株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,824	2024/12/4
第12回清オリオグループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	299,616	2027/12/3
第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債	0.456	200,000	201,040	2022/12/9
第2回株式会社J-オイルミルズ無担保社債	0.37	600,000	600,684	2027/5/28
第33回双日株式会社無担保社債	0.519	400,000	401,836	2024/3/8
第35回双日株式会社無担保社債	0.605	300,000	297,771	2028/3/8
第7回キッコーマン株式会社無担保社債	1.312	400,000	406,344	2021/12/15
第24回味の素株式会社無担保社債	0.19	500,000	499,550	2024/3/8
第25回味の素株式会社無担保社債	0.355	700,000	702,261	2027/3/9
第3回キューピー株式会社無担保社債	0.23	700,000	697,620	2026/2/13
第21回株式会社ニチレイ無担保社債	0.659	100,000	100,045	2020/9/4
第22回株式会社ニチレイ無担保社債	0.36	600,000	601,590	2021/10/22
第23回株式会社ニチレイ無担保社債	0.19	600,000	599,418	2023/10/25
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	700,000	698,348	2025/8/29
第11回日本たばこ産業株式会社社債	0.599	100,000	101,862	2025/7/15
第12回日本たばこ産業株式会社社債	0.11	700,000	699,020	2023/9/8
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	300,000	307,431	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	695,660	2026/6/25
第4回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.468	300,000	300,951	2022/8/5
第5回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.16	500,000	498,490	2022/8/4
第6回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.435	700,000	696,073	2027/8/4
第4回株式会社三越伊勢丹ホールディングス無担保社債	1.071	300,000	306,723	2023/9/1
第42回東洋紡株式会社無担保社債	0.23	500,000	495,405	2026/12/11
第4回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,598	2024/12/20
第5回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.33	300,000	300,045	2027/9/17
第3回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.924	300,000	309,054	2025/5/30
第8回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.19	300,000	300,291	2021/6/2
第12回森ビル株式会社無担保社債	0.8	500,000	500,860	2020/11/5
第14回森ビル株式会社無担保社債	0.861	300,000	305,934	2024/8/14
第17回森ビル株式会社無担保社債	0.523	100,000	100,331	2021/8/13
第20回森ビル株式会社無担保社債	0.12	500,000	499,345	2021/10/25
第21回森ビル株式会社無担保社債	0.44	600,000	599,514	2027/2/16
第8回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	300,000	300,186	2021/12/16
第3回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.41	500,000	499,395	2027/7/30
第10回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.514	300,000	302,007	2022/6/20
第12回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.781	400,000	409,748	2025/6/20
第28回東レ株式会社無担保社債	0.925	200,000	202,762	2022/7/20
第29回東レ株式会社無担保社債	1.012	100,000	102,242	2023/7/14
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	700,000	697,389	2027/7/16
第31回東レ株式会社無担保社債	0.25	600,000	599,286	2024/7/19
第33回東レ株式会社無担保社債	0.38	400,000	397,532	2028/7/18
第7回株式会社クラレ無担保社債	0.19	500,000	497,970	2025/4/25
第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	598,062	2028/4/25
第10回旭化成株式会社無担保社債	0.1	400,000	398,660	2023/12/6
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	496,940	2024/9/6
第12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	491,640	2029/9/6
第15回旭化成株式会社無担保社債	0.28	500,000	500,235	2030/6/19
第33回王子製紙株式会社無担保社債	0.28	700,000	700,119	2025/1/24
第34回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	200,982	2028/1/26
第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	301,263	2028/11/29
第40回王子ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	700,000	699,811	2030/7/17
第25回北越紀州製紙株式会社無担保社債	0.17	600,000	600,048	2021/6/17
第26回北越紀州製紙株式会社無担保社債	0.18	500,000	499,820	2021/12/20
第27回北越コーポレーション株式会社無担保社債	0.22	600,000	597,846	2024/3/13
第20回レンゴー株式会社無担保社債	0.498	400,000	402,660	2022/9/2
第21回レンゴー株式会社無担保社債	0.28	600,000	601,500	2023/12/8

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22回レンゴー株式会社無担保社債	0.39	700,000	702,506	2026/12/8
第25回レンゴー株式会社無担保社債	0.415	200,000	199,630	2028/12/13
第27回レンゴー株式会社無担保社債	0.3	800,000	787,936	2029/12/12
第1回株式会社マクロミル無担保社債	0.27	200,000	199,908	2021/7/27
第49回住友化学株式会社無担保社債	0.944	100,000	102,574	2024/4/25
第54回住友化学株式会社無担保社債	0.2	500,000	499,690	2023/9/1
第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	700,105	2027/9/13
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,792	2024/9/13
第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	99,679	2028/4/17
第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	398,392	2029/4/16
第6回株式会社クレハ無担保社債	0.14	600,000	599,370	2022/9/1
第8回セントラル硝子株式会社無担保社債	0.39	600,000	599,784	2024/2/23
第21回デンカ株式会社無担保社債	0.28	600,000	597,582	2025/4/23
第22回デンカ株式会社無担保社債	0.23	500,000	495,415	2026/12/4
第10回イビデン株式会社無担保社債	0.11	600,000	595,464	2024/9/12
第2回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.271	400,000	400,016	2020/9/3
第3回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	398,884	2028/2/29
第4回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.405	600,000	599,634	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	399,892	2030/5/31
第13回大陽日酸株式会社無担保社債	0.14	700,000	699,461	2021/12/15
第14回大陽日酸株式会社無担保社債	0.39	400,000	400,184	2022/12/15
第16回大陽日酸株式会社無担保社債	0.19	400,000	395,196	2026/10/16
第7回株式会社カネカ無担保社債	0.11	200,000	198,488	2024/9/12
第8回株式会社カネカ無担保社債	0.24	200,000	196,010	2029/9/12
第42回三井化学株式会社無担保社債	1.354	100,000	101,220	2021/7/28
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	300,000	300,057	2024/7/24
第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	100,082	2027/7/23
第50回三井化学株式会社無担保社債	0.27	500,000	491,130	2029/12/5
第1回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.433	200,000	201,156	2022/6/3
第1回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.476	300,000	302,394	2022/12/2
第2回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.32	600,000	601,998	2026/6/9
第2回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.42	600,000	603,042	2028/12/19
第3回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.23	700,000	696,710	2027/2/26
第3回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.28	1,000,000	988,200	2030/2/28
第11回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.14	500,000	499,145	2022/9/15
第12回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.23	600,000	598,644	2024/9/13
第6回積水化学工業株式会社無担保社債	0.28	700,000	699,496	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	490,850	2029/9/13
第7回日本セゾン株式会社無担保社債	0.559	200,000	201,018	2022/6/22
第13回宇都興産株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,085	2022/5/25
第4回日本化薬株式会社無担保社債	0.13	400,000	397,548	2024/12/20
第3回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.25	600,000	598,824	2026/9/16
第4回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.34	600,000	600,768	2028/3/23
第6回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.24	500,000	493,015	2029/9/27
第2回株式会社電通無担保社債	0.24	700,000	697,753	2025/10/24
第3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	702,583	2028/10/25
第1回株式会社ADEKA無担保社債	0.18	300,000	298,596	2024/3/15
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	500,000	499,710	2024/5/31
第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	598,884	2027/6/2
第7回テルモ株式会社無担保社債	0.17	400,000	399,672	2023/4/19
第6回テルモ株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,410	2026/4/17
第9回テルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	996,180	2027/4/26
第2回みちかホールディングス株式会社無担保社債	0.15	400,000	397,308	2024/10/25
第1回沢井製薬株式会社無担保社債	0.594	300,000	301,920	2022/6/10
第4回第一三共株式会社無担保社債	0.846	600,000	611,700	2023/9/15
第1回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.12	200,000	199,426	2024/3/7
第2回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.26	300,000	299,301	2026/3/6

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)＜愛称 円奏会(年1回決算型)＞

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第3回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.375	1,000,000	1,001,020	2029/3/7
第37回D I C株式会社無担保社債	1.0	100,000	103,353	2025/9/18
第41回D I C株式会社無担保社債	0.15	600,000	599,646	2022/7/12
第12回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.373	800,000	802,848	2022/3/18
第14回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.23	500,000	498,585	2026/1/23
第15回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.305	700,000	694,659	2029/1/25
第5回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	0.108	500,000	499,610	2021/12/6
第2回住友三井オートサービス株式会社無担保社債	0.23	800,000	799,216	2023/10/31
第4回住友三井オートサービス株式会社無担保社債	0.15	800,000	795,600	2024/10/31
第11回楽々株式会社無担保社債	0.25	200,000	197,776	2024/6/25
第9回富士アルムホールディングス株式会社無担保社債	0.882	700,000	711,578	2022/12/2
第7回富士アルムホールディングス株式会社無担保社債	0.25	300,000	298,590	2027/3/3
第10回富士アルムホールディングス株式会社無担保社債	0.24	200,000	199,660	2025/12/5
第13回富士アルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	497,325	2024/7/26
第15回富士アルムホールディングス株式会社無担保社債	0.12	500,000	496,785	2025/3/5
第6回ニコニコホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	700,280	2024/12/13
第4回荒川化学工業株式会社無担保社債	0.2	500,000	497,810	2024/12/19
第4回出光興産株式会社無担保社債	0.541	400,000	401,572	2021/8/4
第5回出光興産株式会社無担保社債	0.2	200,000	200,164	2022/12/5
第6回出光興産株式会社無担保社債	0.27	700,000	697,445	2025/9/19
第8回出光興産株式会社無担保社債	0.09	200,000	198,478	2024/9/20
第9回出光興産株式会社無担保社債	0.18	400,000	394,780	2026/9/18
第6回J Xホールディングス株式会社無担保社債	1.119	300,000	307,977	2023/7/19
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	102,098	2024/6/4
第13回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	698,663	2026/7/28
第2回J X T Gホールディングス株式会社無担保社債	0.405	700,000	700,819	2027/8/3
第13回横濱ゴム株式会社無担保社債	0.25	100,000	100,116	2023/12/8
第9回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.08	500,000	499,735	2022/4/21
第10回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.2	500,000	500,925	2024/4/19
第11回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.295	800,000	799,584	2027/4/21
第13回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.23	200,000	200,314	2026/4/17
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	1,001,450	2029/4/19
第22回住友ゴム工業株式会社無担保社債	1.378	100,000	101,128	2021/6/28
第3回バンドー化学株式会社無担保社債	0.4	200,000	200,412	2024/1/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	601,002	2027/5/28
第1回AGC株式会社無担保社債	0.23	700,000	699,097	2025/10/10
第15回住友大阪セメント株式会社無担保社債	0.24	600,000	599,994	2023/8/30
第25回太平洋セメント株式会社無担保社債	0.63	200,000	200,918	2021/9/10
第9回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.37	800,000	798,600	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	398,220	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	492,600	2029/6/20
第1回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.28	400,000	396,464	2026/9/18
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.22	500,000	500,660	2024/5/20
第4回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.375	100,000	99,551	2027/5/20
第5回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.23	400,000	399,464	2024/12/20
第70回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.951	100,000	101,516	2022/6/20
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	687,827	2029/6/20
第2回ジェンエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.703	600,000	607,782	2024/9/19
第25回ジェンエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.26	500,000	495,365	2025/5/21
第28回ジェンエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.26	500,000	492,710	2026/5/27
第29回ジェンエフイーホールディングス株式会社無担保社債	0.365	600,000	588,036	2029/5/25
第29回住友金属鉱山株式会社無担保社債	1.257	400,000	404,732	2021/8/31
第30回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.02	400,000	399,200	2021/9/17
第31回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.1	700,000	694,519	2024/12/13
第32回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.25	800,000	784,336	2029/12/13
第5回DOWAホールディングス株式会社無担保社債	0.11	500,000	496,000	2024/9/18
第4回DOWAホールディングス株式会社無担保社債	0.14	500,000	497,975	2023/9/14

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第26回住友電気工業株式会社無担保社債	0.3	700,000	698,068	2027/3/1
第13回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.37	600,000	599,526	2026/12/16
第14回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.29	600,000	590,280	2029/10/25
第9回L I X I Lグループ無担保社債	0.08	500,000	499,260	2021/8/31
第1回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	0.09	700,000	698,810	2022/3/9
第2回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	0.22	600,000	599,568	2024/3/8
第19回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.109	200,000	202,174	2021/9/17
第29回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.08	500,000	493,335	2026/6/19
第2回ナブテスコ株式会社無担保社債	0.14	600,000	599,622	2021/12/13
第4回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.17	700,000	699,356	2023/3/15
第5回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.13	500,000	497,255	2024/7/24
第6回住友重機械工業株式会社無担保社債	0.29	400,000	395,508	2030/1/24
第17回日立建機株式会社無担保社債	0.16	500,000	498,990	2022/12/13
第9回株式会社荏原製作所無担保社債	0.18	100,000	99,843	2022/10/24
第19回ダイキン工業株式会社無担保社債	1.204	200,000	205,116	2022/12/12
第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	99,802	2026/9/30
第23回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.13	600,000	595,572	2026/10/9
第24回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.18	600,000	591,540	2029/10/11
第6回株式会社タダノ無担保社債	0.25	800,000	793,640	2026/12/11
第1回ブラザー工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	100,007	2020/11/26
第6回ローリー株式会社無担保社債	0.15	500,000	497,585	2023/12/6
第43回日本精工株式会社無担保社債	0.769	100,000	102,096	2024/9/10
第44回日本精工株式会社無担保社債	0.12	300,000	299,730	2022/3/14
第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	299,082	2022/12/7
第49回日本精工株式会社無担保社債	0.29	700,000	698,817	2025/11/28
第51回日本精工株式会社無担保社債	0.19	300,000	296,820	2026/9/2
第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.345	400,000	398,880	2028/3/8
第9回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	500,000	492,920	2029/11/28
第10回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.21	600,000	594,510	2026/11/27
第5回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	600,000	600,498	2023/12/8
第12回T H K株式会社無担保社債	0.27	500,000	499,415	2025/2/7
第14回T H K株式会社無担保社債	0.29	700,000	698,397	2026/2/6
第16回株式会社日工製作所無担保社債	0.813	600,000	613,998	2023/12/13
第28回富士電機株式会社無担保社債	0.381	400,000	400,040	2020/9/4
第29回富士電機株式会社無担保社債	0.28	500,000	500,305	2023/8/31
第30回富士電機株式会社無担保社債	0.395	100,000	99,683	2027/5/21
第3回日本電産株式会社無担保社債	0.956	600,000	610,104	2022/9/20
第8回日本電産株式会社無担保社債	0.1	800,000	796,056	2024/7/19
第9回日本電産株式会社無担保社債	0.02	800,000	797,104	2022/11/28
第10回日本電産株式会社無担保社債	0.09	800,000	794,816	2024/11/28
第50回日本電気株式会社無担保社債	0.29	500,000	500,420	2022/6/15
第53回日本電気株式会社無担保社債	0.26	600,000	599,670	2023/9/21
第15回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.34	300,000	300,858	2026/9/18
第16回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.26	400,000	400,892	2024/9/6
第21回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.36	700,000	700,105	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	800,928	2030/7/16
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	600,000	604,446	2022/3/18
第15回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	500,000	500,540	2021/9/17
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	400,000	402,584	2026/9/18
第19回パナソニック株式会社無担保社債	0.37	600,000	592,152	2030/3/5
第31回ソニー株式会社無担保社債	0.23	500,000	500,340	2021/9/17
第32回ソニー株式会社無担保社債	0.28	100,000	100,109	2023/9/20
第33回ソニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	300,447	2026/9/18
第35回ソニー株式会社無担保社債	0.18	400,000	394,432	2026/10/9
第36回ソニー株式会社無担保社債	0.3	700,000	686,749	2029/10/10
第6回TDK株式会社無担保社債	0.31	200,000	199,962	2027/7/28
第7回TDK株式会社無担保社債	0.43	800,000	799,784	2030/7/26

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) <愛称 円奏会(年1回決算型)>

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	0.609	700,000	700,630	2020/10/30
第5回株式会社堀場製作所無担保社債	0.18	700,000	689,493	2026/10/16
第6回株式会社堀場製作所無担保社債	0.27	600,000	587,166	2029/10/17
第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	1,000,000	995,940	2027/6/18
第5回スタンレー電気株式会社無担保社債	0.15	500,000	498,425	2024/4/19
第1回株式会社村田製作所無担保社債	0.08	700,000	699,419	2022/1/24
第2回株式会社村田製作所無担保社債	0.15	700,000	699,020	2024/1/24
第3回株式会社村田製作所無担保社債	0.06	800,000	795,248	2024/9/10
第1回東海理化電機製作所無担保社債	0.34	300,000	299,139	2027/6/7
第26回三菱重工工業株式会社無担保社債	0.877	600,000	611,502	2023/9/4
第31回三菱重工工業株式会社無担保社債	0.63	100,000	101,479	2025/9/2
第40回三菱重工工業株式会社無担保社債	0.988	200,000	205,058	2023/12/15
第42回回崎重工工業株式会社無担保社債	0.791	100,000	102,029	2024/7/18
第45回回崎重工工業株式会社無担保社債	0.1	300,000	299,868	2021/7/15
第47回回崎重工工業株式会社無担保社債	0.15	500,000	499,895	2022/7/20
第51回回崎重工工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	298,530	2024/7/12
第40回株式会社 I H I 無担保社債	0.592	300,000	300,990	2021/6/17
第43回株式会社 I H I 無担保社債	0.2	400,000	397,492	2024/10/17
第6回 J A 三井リース株式会社無担保社債	0.2	300,000	300,021	2022/1/27
第7回 J A 三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	99,935	2022/9/15
第8回 J A 三井リース株式会社無担保社債	0.31	200,000	199,794	2024/9/13
第15回 J A 三井リース株式会社無担保社債	0.22	600,000	595,860	2025/1/24
第4回昭和リース株式会社無担保社債	0.3	800,000	792,920	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	495,780	2029/9/4
第1回B号明治安田生命2016基金特定目的会社特定社債	0.28	400,000	399,256	2021/8/9
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	0.304	300,000	299,541	2021/8/2
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	600,000	598,194	2022/8/4
第4回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス無担保社債	0.23	700,000	698,873	2023/10/25
第13回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス無担保社債	0.14	800,000	793,944	2024/10/25
第14回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.963	100,000	102,388	2023/3/20
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	600,000	594,282	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	794,856	2025/3/5
第14回本田技研工業株式会社無担保社債	0.15	800,000	790,800	2027/3/5
第1回株式会社 S U B A R U 無担保社債	0.12	600,000	596,850	2024/12/17
第2回株式会社 S U B A R U 無担保社債	0.21	700,000	694,407	2026/12/17
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	400,000	399,428	2025/3/13
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	700,000	695,961	2023/9/25
第5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	793,688	2024/8/1
第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	0.29	800,000	793,384	2024/8/2
第2回楽天カード株式会社無担保社債	0.3	600,000	596,628	2024/12/12
第3回株式会社 トヨタ 無担保社債	0.3	500,000	500,440	2025/6/24
第4回大日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	792,512	2029/7/19
第1回株式会社 アシックス 無担保社債	0.14	700,000	699,853	2021/12/7
第2回株式会社 アシックス 無担保社債	0.2	600,000	599,136	2024/3/13
第4回株式会社 ニフコ 無担保社債	0.25	500,000	497,025	2025/5/8
第5回株式会社 ニフコ 無担保社債	0.385	500,000	497,450	2028/5/8
第6回株式会社 ニフコ 無担保社債	0.28	700,000	686,084	2029/9/11
第59回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.378	200,000	202,192	2021/6/4
第67回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.964	100,000	101,763	2022/9/9
第87回丸紅株式会社無担保社債	1.29	200,000	202,662	2021/10/15
第102回丸紅株式会社無担保社債	0.756	300,000	305,217	2024/7/25
第5回長瀬産業株式会社無担保社債	0.539	200,000	201,084	2022/6/16
第6回長瀬産業株式会社無担保社債	0.15	400,000	396,364	2024/12/12
第7回長瀬産業株式会社無担保社債	0.29	600,000	588,822	2029/12/12
第16回豊田通商株式会社無担保社債	1.35	300,000	305,013	2021/12/8
第17回豊田通商株式会社無担保社債	0.81	100,000	102,018	2023/12/5
第18回豊田通商株式会社無担保社債	1.014	200,000	207,672	2025/12/5

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19回豊田通商株式会社無担保社債	0.954	100,000	103,780	2026/7/10
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.14	200,000	199,700	2022/2/22
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.24	800,000	798,016	2024/2/22
第63回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	228,106	2027/4/23
第73回三井物産株式会社無担保社債	2.29	800,000	798,944	2029/7/11
第75回三井物産株式会社無担保社債	0.23	700,000	694,197	2029/12/12
第6回日本紙ハルバ商事株式会社無担保社債	0.19	400,000	396,032	2024/12/12
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	102,550	2022/3/16
第46回住友商事株式会社無担保社債	0.884	100,000	101,702	2022/12/12
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	101,003	2021/5/24
第78回三菱商事株式会社無担保社債	1.155	100,000	101,677	2022/3/9
第79回三菱商事株式会社無担保社債	1.022	100,000	101,632	2022/5/20
第30回阪和興業株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,050	2023/6/13
第26回株式会社丸井グループ無担保社債	0.562	200,000	200,574	2021/6/4
第29回株式会社丸井グループ無担保社債	0.13	500,000	499,390	2021/8/17
第31回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	500,000	499,085	2022/5/25
第34回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	800,000	796,400	2023/10/25
第79回株式会社丸井グループ無担保社債	0.25	300,000	294,096	2026/10/16
第48回株式会社クレディセゾン無担保社債	1.038	200,000	204,758	2023/10/20
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	102,121	2024/4/24
第79回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.22	500,000	496,975	2025/1/31
第81回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.2	400,000	400,748	2025/7/15
第4回株式会社新生銀行無担保社債	0.25	600,000	600,630	2021/10/27
第5回株式会社新生銀行無担保社債	0.21	400,000	399,528	2023/7/13
第6回株式会社新生銀行無担保社債	0.24	700,000	698,593	2023/12/13
第13回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.1	700,000	700,049	2020/9/8
第14回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.19	100,000	100,094	2022/9/8
第15回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.11	700,000	700,182	2020/12/8
第20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	692,902	2030/1/15
第21回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.61	800,000	777,720	2029/12/12
第1回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	0.94	100,000	101,494	2024/6/26
第7回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	1.393	200,000	202,958	2030/6/11
第12回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.12	500,000	499,660	2022/1/24
第18回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.06	600,000	599,286	2021/7/23
第20回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.27	500,000	498,475	2025/7/23
第23回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.06	600,000	598,290	2022/12/13
第1回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.857	200,000	201,332	2024/9/5
第3回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.66	430,000	430,180	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	789,160	2027/6/8
第4回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.62	725,000	721,331	2026/12/18
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	2.54	600,000	687,306	2027/7/27
第7回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	2.34	200,000	228,052	2027/4/20
第20回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.91	600,000	714,552	2029/10/16
第20回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.27	400,000	457,868	2030/9/27
第20回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.95	200,000	214,906	2025/11/12
第20回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.16	100,000	108,833	2026/1/20
第30回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.62	1,100,000	1,114,168	2021/6/9
第1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	109,096	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	403,520	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	832,240	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	486,489	2025/10/15
第9回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.469	240,000	236,834	2026/6/15
第10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	128,794	2026/9/15
第1回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.585	710,000	701,394	2023/3/16
第8回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.878	100,000	101,444	2021/6/1
第9回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	500,000	558,445	2026/12/22
第1回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.78	200,000	204,792	2022/3/15

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
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	892,128	2027/3/15
第1回株式会社千葉銀行無担保社債(劣後特約付)	0.911	600,000	603,108	2024/8/29
第4回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.48	800,000	794,308	2029/4/26
第5回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.37	800,000	789,156	2029/11/26
第8回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.92	100,000	107,260	2025/10/28
第6回日立信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.78	600,000	676,386	2026/4/27
第8回日立信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.49	400,000	447,756	2027/5/10
第18回日立信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	2.341	300,000	329,832	2026/6/15
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	1.62	100,000	102,371	2022/3/22
第10回株式会社セブン銀行無担保社債	0.803	500,000	509,005	2023/3/20
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	700,000	710,850	2024/12/20
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	505,520	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	596,004	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	498,360	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	297,675	2027/6/21
第21回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.895	800,000	799,424	2030/6/24
第22回みずほフィナンシャルグループ無担保社債(劣後)	0.56	800,000	800,196	2030/6/24
第20回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.43	300,000	300,636	2020/9/28
第23回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.61	100,000	100,578	2020/12/17
第24回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.6	200,000	202,460	2021/6/1
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.1	500,000	545,400	2026/6/1
第28回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.17	600,000	655,890	2026/12/18
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.4	100,000	100,053	2020/8/7
第5回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後)	0.49	100,000	110,308	2026/1/30
第7回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.87	200,000	226,754	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)	3.52	500,000	558,560	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)	2.03	200,000	238,466	2029/9/28
第18回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.14	400,000	434,540	2026/9/11
第20回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.49	400,000	409,140	2022/6/3
第14回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.19	100,000	99,981	2022/5/30
第15回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.33	500,000	500,630	2024/12/6
第17回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.21	500,000	499,185	2023/11/2
第23回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.29	500,000	496,960	2026/12/11
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	605,976	2031/12/19
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	601,176	2032/9/17
第45回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.07	500,000	488,965	2022/6/20
第24回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.32	200,000	199,616	2025/4/11
第25回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.2	500,000	498,245	2023/10/13
第44回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.08	500,000	498,820	2022/9/20
第49回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	500,000	497,660	2025/6/19
第52回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.2	700,000	696,381	2025/9/19
第56回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.09	600,000	596,178	2024/6/19
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	500,000	496,025	2026/6/19
第27回リコーリース株式会社無担保社債	0.16	600,000	599,520	2022/7/20
第33回リコーリース株式会社無担保社債	0.19	600,000	598,512	2023/9/7
第11回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	793,776	2025/1/30
第6回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	399,468	2024/5/28
第8回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	199,140	2024/9/20
第9回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	692,202	2026/9/18
第9回株式会社ジャックス無担保社債	0.79	300,000	300,912	2021/1/22
第12回株式会社ジャックス無担保社債	0.545	100,000	100,458	2021/12/3
第13回株式会社ジャックス無担保社債	0.644	200,000	201,352	2022/2/25
第17回株式会社ジャックス無担保社債	0.37	200,000	200,228	2024/6/7
第20回株式会社ジャックス無担保社債	0.36	300,000	298,827	2025/6/13
第9回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.46	500,000	502,360	2023/7/22
第19回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.54	500,000	499,830	2025/7/18
第53回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.815	100,000	102,040	2024/3/19

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	300,000	310,737	2026/9/18
第86回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.26	500,000	499,900	2024/6/20
第5回株式会社アプラスフィナンシャル無担保社債	0.25	600,000	593,562	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	589,950	2024/12/5
第171回オリックス株式会社無担保社債	1.126	220,000	225,700	2023/4/28
第175回オリックス株式会社無担保社債	1.064	100,000	102,840	2023/11/24
第180回オリックス株式会社無担保社債	0.797	500,000	511,630	2024/9/4
第181回オリックス株式会社無担保社債	0.812	100,000	102,422	2024/9/26
第197回オリックス株式会社無担保社債	0.19	300,000	299,882	2025/1/30
第11回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.411	500,000	501,460	2021/8/5
第12回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.426	400,000	408,152	2024/8/5
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.25	200,000	200,202	2024/9/13
第17回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.45	300,000	302,028	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	601,500	2028/8/3
第14回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.15	400,000	399,544	2023/10/25
第59回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.385	200,000	200,338	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	199,724	2028/7/12
第77回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.29	600,000	601,926	2023/4/7
第27回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.508	500,000	501,185	2021/2/24
第36回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.655	200,000	200,652	2022/1/21
第16回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.187	400,000	401,572	2021/5/21
第22回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.397	300,000	300,021	2020/8/12
第30回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.22	100,000	99,958	2022/8/26
第14回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.723	100,000	100,328	2021/2/25
第50回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	200,000	199,998	2022/8/10
第51回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.34	200,000	200,038	2024/8/9
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	698,488	2023/9/4
第3回ユーフィナンシャルホールディングス株式会社無担保社債	0.11	400,000	399,384	2022/12/7
第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	399,360	2024/7/31
第13回N E Cキャピタルソリューション株式会社無担保社債	0.29	600,000	598,236	2023/7/13
第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	118,078	2030/12/20
第43回三井不動産株式会社無担保社債	1.272	100,000	101,018	2021/6/18
第45回三井不動産株式会社無担保社債	0.967	300,000	304,566	2022/5/24
第46回三井不動産株式会社無担保社債	0.964	100,000	101,677	2022/8/30
第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	117,497	2033/8/2
第56回三井不動産株式会社無担保社債	0.2	400,000	399,752	2024/8/28
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	400,000	399,508	2026/3/13
第47回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	300,054	2029/4/13
第71回三井不動産株式会社無担保社債	0.31	600,000	592,296	2030/4/16
第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	234,684	2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	248,956	2027/9/17
第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.245	300,000	334,970	2027/10/29
第93回三菱地所株式会社無担保社債	2.555	200,000	234,648	2028/7/28
第113回三菱地所株式会社無担保社債	1.067	100,000	103,703	2024/12/27
第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	299,760	2026/12/18
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	298,524	2027/6/18
第125回三菱地所株式会社無担保社債	0.19	700,000	698,677	2025/3/14
第130回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	700,000	692,811	2029/8/3
第94回住友不動産株式会社無担保社債	0.968	300,000	307,575	2023/12/12
第96回住友不動産株式会社無担保社債	0.914	200,000	204,644	2024/3/18
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	200,000	204,704	2024/4/26
第98回住友不動産株式会社無担保社債	0.884	500,000	511,760	2024/6/10
第104回住友不動産株式会社無担保社債	0.826	100,000	102,266	2025/4/28
第108回住友不動産株式会社無担保社債	0.4	500,000	500,565	2027/5/7
第16回イオンモール株式会社無担保社債	0.37	300,000	298,740	2025/7/3
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	350,079	2031/9/19
第10回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	0.75	400,000	407,524	2023/9/20

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) <愛称 円奏会(年1回決算型)>

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第11回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	1.25	200,000	215,670	2028/9/20
第12回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	0.61	800,000	814,328	2024/9/20
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	213,734	2029/9/20
第102森トラスト総合リート投資法人無担保社債	0.1	700,000	696,514	2023/2/20
第100回東武鉄道株式会社無担保社債	1.1	200,000	204,828	2023/4/25
第102回東武鉄道株式会社無担保社債	1.36	300,000	316,131	2025/10/23
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	600,000	625,410	2026/6/17
第111回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	600,000	601,104	2031/9/15
第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	501,925	2036/12/5
第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	900,000	898,317	2037/9/11
第119回東武鉄道株式会社無担保社債	0.758	500,000	496,320	2038/5/24
第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	773,840	2039/7/22
第123回東武鉄道株式会社無担保社債	0.8	700,000	694,694	2040/4/20
第30回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.61	400,000	401,456	2021/4/22
第31回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.97	500,000	513,230	2024/4/22
第32回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.58	100,000	101,285	2025/1/28
第33回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.43	300,000	301,680	2023/1/27
第34回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.68	300,000	305,724	2026/1/28
第35回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.733	600,000	611,784	2031/6/27
第36回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.7	700,000	708,134	2032/1/30
第37回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.681	700,000	702,793	2033/3/4
第38回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.778	400,000	404,656	2033/9/20
第39回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.495	200,000	201,846	2029/1/25
第40回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.619	700,000	691,831	2034/6/20
第41回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.71	700,000	678,748	2039/10/25
第42回回鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.6	700,000	709,352	2030/5/22
第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	764,432	2039/9/16
第4回東急株式会社無担保社債	0.7	600,000	596,898	2040/6/8
第64回東京急行電鉄株式会社無担保社債	2.7	100,000	107,185	2023/6/6
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	101,536	2022/6/7
第76回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.563	500,000	545,115	2027/6/7
第78回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.528	400,000	439,736	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	203,900	2024/4/26
第80回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.211	200,000	216,038	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	657,552	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	201,370	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	100,448	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	610,584	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	701,967	2038/5/28
第38回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.291	600,000	647,640	2028/12/11
第39回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	1.222	500,000	538,105	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	306,351	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	707,476	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	708,092	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	992,970	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	580,902	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	599,502	2040/6/11
第60回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.846	100,000	101,578	2022/10/18
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	500,000	518,420	2025/12/12
第68回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.098	600,000	646,380	2030/6/12
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	501,785	2036/8/29
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	712,838	2037/5/29
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	608,472	2037/11/30
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	800,000	815,328	2038/8/30
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	700,000	705,894	2028/12/20
第83回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.209	400,000	398,996	2029/6/20
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	590,784	2039/6/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第88回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.73	800,000	802,792	2040/4/23
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	115,483	2027/11/29
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	1.199	400,000	404,460	2021/7/28
第34回京王電鉄株式会社無担保社債	0.32	300,000	302,214	2026/3/10
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	102,149	2031/3/10
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	504,125	2027/9/17
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	612,126	2037/9/18
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	0.295	100,000	100,594	2027/11/29
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	507,860	2037/11/27
第40回京王電鉄株式会社無担保社債	0.205	600,000	596,778	2030/1/30
第42回京王電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	401,056	2040/5/25
第48回京成電鉄株式会社無担保社債	1.004	200,000	204,602	2038/7/25
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	595,764	2031/6/20
第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	608,412	2038/9/7
第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	1,003,570	2039/3/8
第54回京成電鉄株式会社無担保社債	0.73	400,000	399,668	2040/6/12
第28回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.47	100,000	125,617	2033/9/20
第45回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.55	100,000	114,175	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	114,032	2026/9/18
第49回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.26	500,000	569,445	2027/4/16
第51回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	231,092	2027/9/17
第55回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.357	100,000	116,975	2028/7/25
第57回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.376	300,000	353,508	2028/12/12
第58回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.149	300,000	353,127	2029/12/21
第67回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.249	300,000	356,727	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	464,724	2030/9/27
第74回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.098	100,000	118,196	2030/12/20
第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.633	200,000	218,612	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	346,701	2032/7/23
第91回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.751	300,000	348,354	2032/12/27
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.757	300,000	307,059	2024/1/30
第103回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	400,000	454,176	2034/7/25
第106回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.981	100,000	106,651	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	507,905	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	306,165	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	707,728	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	770,880	2039/12/23
第15回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	200,000	230,214	2027/12/20
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	116,801	2028/3/17
第21回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.247	300,000	351,771	2029/3/21
第23回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.175	200,000	234,952	2029/9/18
第26回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.262	200,000	238,180	2030/3/12
第28回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.111	800,000	943,496	2030/6/11
第35回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.836	300,000	307,074	2023/9/27
第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	228,408	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	442,876	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	438,928	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	208,232	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	500,310	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	704,067	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	792,360	2040/5/21
第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	101,000	104,625	2022/2/15
第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.31	300,000	345,066	2027/9/17
第34回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.3	300,000	346,326	2027/12/20
第37回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	200,000	233,726	2028/5/22
第41回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.166	800,000	930,840	2029/1/29
第42回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.312	200,000	235,792	2029/4/24

東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型) <愛称 円奏会(年1回決算型)>

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46回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.157	100,000	117,713	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	355,995	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	233,836	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	231,888	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	584,580	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	681,312	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	110,738	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	782,313	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	749,658	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	109,620	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	110,956	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	109,732	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	214,130	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	490,315	2036/4/14
第2回東京地下鉄株式会社社債	2.36	100,000	108,798	2024/6/20
第6回東京地下鉄株式会社社債	2.43	100,000	115,869	2027/9/17
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	200,000	230,944	2027/12/20
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	500,000	593,855	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	115,095	2032/5/25
第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	116,437	2033/6/14
第16回東京地下鉄株式会社社債	0.778	300,000	310,503	2036/3/11
第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	678,888	2036/6/20
第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	700,000	709,247	2037/6/19
第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	606,114	2037/12/15
第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	100,446	2038/5/24
第38回東京地下鉄株式会社社債	0.445	600,000	578,154	2040/1/31
第41回東京地下鉄株式会社社債	0.275	300,000	300,867	2030/6/12
第1回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.758	600,000	607,200	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	499,610	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	702,107	2028/12/6
第4回株式会社西武ホールディングス無担保社債	0.27	600,000	589,866	2029/12/12
第2回株式会社鴻池運輸無担保社債	0.18	300,000	299,688	2022/3/2
第44回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.345	600,000	601,410	2026/3/4
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	700,000	716,191	2031/3/4
第46回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.69	700,000	698,418	2036/9/9
第47回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.903	700,000	719,061	2037/4/14
第48回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.782	500,000	503,160	2037/9/4
第50回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.395	700,000	701,225	2028/9/6
第51回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.672	700,000	686,448	2039/5/30
第9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	502,695	2031/9/2
第10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	698,082	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	702,394	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	688,352	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	792,648	2029/7/11
第116回近鉄グループホールディングス株式会社無担保社債	0.22	400,000	397,672	2025/1/30
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	870,453	2040/1/30
第40回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.43	100,000	100,182	2020/9/18
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.819	600,000	612,270	2023/10/25
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	540,705	2029/7/18
第49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	819,720	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	710,577	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	496,695	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	765,256	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	204,754	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	616,464	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	706,531	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	599,664	2032/5/28

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43回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.941	700,000	707,987	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	799,104	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	712,761	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	481,125	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	300,912	2030/6/4
第24回京阪電気鉄道株式会社無担保社債	1.7	300,000	310,575	2022/12/9
第25回京阪電気鉄道株式会社無担保社債	1.34	100,000	101,150	2021/7/20
第28回京阪電気鉄道株式会社無担保社債	0.725	800,000	816,784	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	599,916	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	695,652	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	200,528	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	677,194	2039/12/16
第50回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.857	200,000	206,862	2027/4/30
第52回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.75	600,000	602,976	2036/8/29
第53回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.85	600,000	615,918	2035/2/28
第54回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.806	700,000	706,867	2037/5/29
第55回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.79	600,000	603,192	2037/12/4
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.748	600,000	597,438	2038/5/25
第57回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.863	500,000	506,980	2038/9/10
第58回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.725	800,000	789,568	2039/4/25
第59回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.53	400,000	381,152	2039/9/5
第7回日本通運株式会社無担保社債	1.09	100,000	101,137	2021/10/20
第9回日本通運株式会社無担保社債	0.28	600,000	598,938	2026/2/25
第10回日本通運株式会社無担保社債	0.12	300,000	298,938	2023/7/14
第11回日本通運株式会社無担保社債	0.2	300,000	297,762	2026/7/14
第14回日本通運株式会社無担保社債	0.28	300,000	300,855	2027/6/16
第5回ニッコンホールディングス株式会社無担保社債	0.614	700,000	701,190	2020/12/18
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	392,500	2029/10/11
第3回株式会社日立物流無担保社債	0.1	600,000	598,980	2021/9/28
第7回株式会社日立物流無担保社債	0.405	600,000	596,820	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	201,056	2027/2/23
第3回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.29	400,000	399,916	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	702,107	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	787,936	2029/12/11
第1回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.295	600,000	601,122	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	298,416	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	385,728	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	399,316	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	496,205	2040/6/8
第1回日本航空株式会社無担保社債	0.47	700,000	673,141	2026/12/18
第2回日本航空株式会社無担保社債	0.17	600,000	594,348	2021/12/20
第3回日本航空株式会社無担保社債	0.399	500,000	471,375	2028/9/21
第5回日本航空株式会社無担保社債	0.22	500,000	487,485	2024/3/19
第7回日本航空株式会社無担保社債	1.28	800,000	734,640	2029/12/14
第9回ANAホールディングス株式会社無担保社債	0.2	700,000	696,906	2026/9/18
第15回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.734	500,000	508,690	2024/3/12
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	300,000	299,085	2024/12/6
第17回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.34	500,000	499,900	2027/8/8
第18回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.22	700,000	688,765	2029/12/5
第19回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.61	400,000	386,940	2039/12/15
第3回株式会社住友倉庫無担保社債	0.366	500,000	501,550	2022/12/16
第4回株式会社住友倉庫無担保社債	0.639	300,000	304,875	2025/12/17
第5回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	400,000	397,952	2025/3/26
第6回株式会社住友倉庫無担保社債	0.838	700,000	707,924	2038/3/26
第7回株式会社住友倉庫無担保社債	0.08	200,000	198,392	2024/9/24
第8回株式会社住友倉庫無担保社債	0.21	600,000	587,448	2029/9/21
第1回朝日放送グループホールディングス株式会社無担保社債	0.16	200,000	198,904	2024/9/2

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63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	500,000	506,195	2023/3/20	第52回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.486	1,000,000	974,070	2039/5/23
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	700,000	715,582	2023/12/20	第55回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.28	800,000	749,568	2039/9/13
第21回KDDI株式会社無担保社債	0.669	500,000	510,380	2024/9/20	第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.606	400,000	459,448	2034/3/24
第22回KDDI株式会社無担保社債	0.31	700,000	699,573	2028/7/12	第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.402	600,000	673,764	2034/10/24
第24回KDDI株式会社無担保社債	0.25	700,000	701,022	2025/11/21	第31回東邦瓦斯株式会社無担保社債	2.06	600,000	619,014	2023/3/18
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	400,000	402,016	2028/11/22	第36回東邦瓦斯株式会社無担保社債	1.628	300,000	326,700	2027/3/19
第26回KDDI株式会社無担保社債	0.13	100,000	99,869	2024/4/26	第38回東邦瓦斯株式会社無担保社債	0.933	500,000	511,455	2023/7/12
第27回KDDI株式会社無担保社債	0.23	700,000	697,928	2026/4/24	第13回広島ガス株式会社無担保社債	0.405	600,000	600,810	2028/9/13
第29回KDDI株式会社無担保社債	0.02	800,000	798,032	2022/11/29	第16回西部瓦斯株式会社無担保社債	0.355	700,000	700,406	2028/12/13
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	400,000	406,380	2023/9/20	第3回東京都競馬株式会社無担保社債	0.18	700,000	698,362	2023/7/5
第22回沖繩電力株式会社社債	0.996	300,000	305,268	2022/6/24	第2回日本空港ビルデング株式会社無担保社債	0.27	600,000	592,356	2030/3/5
第23回沖繩電力株式会社社債	0.469	200,000	203,046	2025/3/25	第5回SCSK株式会社無担保社債	0.14	500,000	499,545	2021/12/15
第25回沖繩電力株式会社社債	0.25	700,000	702,618	2027/6/25	第6回SCSK株式会社無担保社債	0.14	600,000	598,692	2022/7/21
第26回沖繩電力株式会社社債	0.28	700,000	702,303	2028/12/25	第1回日鉄住金物産株式会社無担保社債	0.15	400,000	398,912	2023/3/3
第27回沖繩電力株式会社社債	0.19	800,000	792,920	2030/3/25	第3回日鉄住金物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	198,786	2025/6/13
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	300,000	308,559	2023/12/20	第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	600,000	604,074	2022/12/16
第39回電源開発株式会社無担保社債	0.929	200,000	205,494	2024/2/20	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	818,104	2025/12/18
第40回電源開発株式会社無担保社債	0.889	200,000	205,528	2024/6/20	第5回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.11	300,000	298,806	2023/6/6
第49回電源開発株式会社無担保社債	0.4	300,000	302,148	2027/5/20	第6回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.22	400,000	398,528	2025/6/6
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.85	200,000	201,648	2027/8/31	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	899,460	2028/6/6
第26回東京瓦斯株式会社無担保社債	2.29	100,000	108,383	2024/5/27	小計		427,307,000	433,819,029	
第35回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.852	400,000	465,940	2031/12/26	合計		671,828,245	700,916,636	
第36回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.737	400,000	461,968	2032/5/25					
第37回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.764	300,000	350,055	2033/9/26					
第39回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.554	700,000	800,534	2034/5/26					
第41回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.57	700,000	700,497	2036/11/28					
第43回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.67	700,000	710,199	2037/6/9					
第46回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.58	700,000	695,436	2038/7/20					
第48回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.704	300,000	303,927	2038/11/29					

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

(注) 永久債は、実質的な償還日を記載しています。

国内その他有価証券

区 分	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コマーシャル・ペーパー	10,997,176	1.5

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

＜東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド＞

下記は、東京海上・高配当低ボラティリティ日本株マザーファンド全体(14,491,568千口)の内容です。

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (－%)			
ホクト	104	－	－
建設業 (9.4%)			
ミライト・ホールディングス	484	180	287,640
安藤・間	1,680	547	328,747
東急建設	733	320	173,440
長谷工コーポレーション	360	－	－
三井住友建設	－	570	261,060
奥村組	244	71	183,819
東鉄工業	109	－	－
熊谷組	203	125	323,750
大東建託	46	－	－
前田道路	240	－	－
日本国土開発	－	100	56,000
ライト工業	382	120	183,360
積水ハウス	751	348	732,018
関電工	816	271	242,274
協和エクシオ	－	177	464,625
九電工	－	28	89,740
三機工業	－	32	40,416
高砂熱学工業	－	22	33,550
食料品 (23.3%)			
日本製粉	251	65	110,305
三井製糖	125	－	－
森永製菓	－	103	408,395
江崎グリコ	328	95	477,850
山崎製パン	－	108	196,236
カルビー	512	187	577,830
明治ホールディングス	279	88	742,720
日本ハム	75	－	－
アサヒグループホールディングス	－	110	397,100
サントリー食品インターナショナル	502	172	711,220
ダイドーグループホールディングス	81	－	－
伊藤園	－	45	283,050

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日清オイリオグループ	146	48	160,560
味の素	480	386	668,359
キュービー	671	219	426,174
ハウス食品グループ本社	－	119	399,245
カゴメ	－	40	125,600
ニチレイ	－	219	638,604
東洋水産	438	113	715,290
日清食品ホールディングス	－	79	751,290
フジッコ	53	－	－
日本たばこ産業	965	332	629,970
繊維製品 (0.9%)			
東洋紡	410	－	－
帝人	410	－	－
ワコールホールディングス	190	115	225,515
ホギメディカル	－	26	85,150
パルプ・紙 (1.2%)			
大王製紙	－	120	172,440
レンゴー	－	320	266,560
化学 (1.4%)			
ノエビアホールディングス	12	38	173,660
アース製薬	72	－	－
エフピコ	－	40	340,800
医薬品 (3.8%)			
武田薬品工業	617	174	662,418
田辺三菱製薬	369.8	－	－
科研製薬	167	54	269,190
日医工	435	40	51,680
沢井製薬	230	－	－
キョーリン製薬ホールディングス	449	190	381,900
石油・石炭製品 (1.0%)			
ENEOSホールディングス	－	900	353,520
ゴム製品 (2.0%)			
ブリヂストン	550	208	713,024
住友ゴム工業	492	－	－

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (－%)			
黒崎播磨	32	—	—
非鉄金属 (0.6%)			
アサヒホールディングス	365	67	210,715
機械 (－%)			
技研製作所	172	—	—
平和	100	—	—
SANKYO	35	—	—
電気機器 (2.9%)			
日新電機	282	—	—
沖電気工業	887	294	319,284
ウシオ電機	70	—	—
カシオ計算機	697	—	—
キャノン	747	344	721,884
輸送用機器 (0.5%)			
日産自動車	900	—	—
SUBARU	717	80	179,680
精密機器 (－%)			
シチズン時計	630	—	—
その他製品 (0.5%)			
バラマウントベッドホールディングス	64	—	—
リンテック	—	64	164,672
コクヨ	—	20	24,520
電気・ガス業 (7.4%)			
中部電力	820	542	728,719
沖縄電力	215	60	104,220
東京瓦斯	902	291	784,245
大阪瓦斯	1,210	350	756,000
東邦瓦斯	164	59	307,980
陸運業 (3.7%)			
相鉄ホールディングス	—	45	126,675
西日本旅客鉄道	262	—	—
近鉄グループホールディングス	313	—	—
名古屋鉄道	347	70	202,510
センコーグループホールディングス	840	200	162,400
九州旅客鉄道	689.5	243	572,994
S Gホールディングス	—	77	285,285

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
空運業 (－%)			
日本航空	682	—	—
ANAホールディングス	577	—	—
情報・通信業 (11.9%)			
NECネットエスアイ	153	108	238,896
コーエーテックモホールディングス	214	97	331,740
ティーガイア	211	—	—
アルテリア・ネットワークス	—	134	268,000
フジ・メディア・ホールディングス	300	—	—
トレンドマイクロ	—	109	675,800
マーベラス	7	—	—
エイベックス	—	138	125,028
スカパーJ S A Tホールディングス	1,104	324	136,080
コネクシオ	24	—	—
日本電信電話	462	290	740,225
KDD I	806	224	753,536
NTTドコモ	919	247	741,000
東宝	—	20	66,900
NSD	142	109	223,232
卸売業 (10.9%)			
TOKAIホールディングス	570	135	134,595
シップヘルスケアホールディングス	—	20	91,400
コマダホールディングス	453	151	273,763
第一興商	170	—	—
アズワン	—	13	147,550
伊藤忠商事	1,119	311	737,381
丸紅	830	—	—
三井物産	1,311	448	737,184
住友商事	1,436	314	393,285
三菱商事	—	135	304,155
菱洋エレクトロ	—	50	159,500
岩谷産業	219	73	277,765
サンゲツ	189	65	100,295
伊藤忠エネクス	26	—	—
リョーサン	105	—	—
日鉄物産	105	33	113,685
オートバックスセブン	434	176	235,664
イエローハット	—	41	61,787

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
因幡電機産業	75	73	181,040
小売業 (11.8%)			
ローソン	250	22	122,760
エービーシー・マート	267	98	597,800
エディオン	1,010	261	281,358
アルペン	42	—	—
ジンスホールディングス	8	14	106,260
DCMホールディングス	834	231	305,151
ドトール・日レスホールディングス	246	87	135,024
すかいらくホールディングス	1,245	—	—
セブン&アイ・ホールディングス	470	71	245,873
LIXILピバ	225	—	—
西松屋チェーン	332	—	—
ユナイテッドアローズ	21	—	—
日本瓦斯	—	11	55,770
島忠	272	109	321,114
リンガーハット	150	64	147,328
AOKIホールディングス	220	—	—
青山商事	298	—	—
ヤオコー	—	31	258,540
ケーズホールディングス	1,190	430	607,590
ヤマダ電機	2,707.4	962	466,570
吉野家ホールディングス	489	215	449,135
王将フードサービス	74	29	168,490
ブレナス	197	—	—
バローホールディングス	62	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
サンドラッグ	40	—	—
銀行業 (1.0%)			
ゆうちょ銀行	2,137	125	103,625
あおぞら銀行	540	83	158,862
三井住友フィナンシャルグループ	—	30	90,810
みずほフィナンシャルグループ	2,720	—	—
池田泉州ホールディングス	760	—	—
保険業 (2.0%)			
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	540	250	711,000
その他金融業 (0.7%)			
オリックス	1,158	210	254,205
不動産業 (0.2%)			
野村不動産ホールディングス	57	—	—
タカラレーベン	1,147	220	78,100
サービス業 (2.9%)			
H. U. グループホールディングス	530	140	344,120
りらいあコミュニケーションズ	330	—	—
ユー・エス・エス	200	193	327,328
セコム	—	23	215,418
メイテック	184	33	177,210
合 計	株 数・金 額 60,517	18,250	36,146,804
	銘柄数<比率>	111	<98.2%>

(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(15,491,114千口)の内容です。

国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	口 数	評 価 額	比 率
				千円	%
SOSiLA物流リート投資法人	—	—	2,023	296,167	0.8
日本アコモデーションファンド投資法人	4,491	4,491	1,014	696,618	1.9
MCUBS MidCity投資法人	21,860	21,860	7,431	528,344	1.4
森ヒルズリート投資法人	10,249	10,249	3,491	485,947	1.3
産業ファンド投資法人	7,160	7,160	3,397	663,773	1.8
アドバンス・レジデンス投資法人	10,511	10,511	4,502	1,557,692	4.2
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	10,282	10,282	3,129	620,167	1.7
アクティビア・プロパティーズ投資法人	6,895	6,895	2,800	970,200	2.6
GLP投資法人	35,222	35,222	13,495	2,292,800	6.1
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	4,164	4,164	2,360	801,220	2.1
日本プロロジスリート投資法人	17,980	17,980	6,551	2,302,676	6.1
星野リゾート・リート投資法人	2,848	2,848	587	249,475	0.7
Oneリート投資法人	3,498	3,498	448	108,012	0.3
イオンリート投資法人	6,883	6,883	3,191	357,392	1.0
ヒューリックリート投資法人	13,061	13,061	5,010	618,735	1.7
日本リート投資法人	4,296	4,296	1,028	327,418	0.9
インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	118,284	118,284	40,600	517,244	1.4
積水ハウス・リート投資法人	30,732	30,732	13,893	975,288	2.6
ケネディクス商業リート投資法人	3,859	3,859	2,554	487,814	1.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	—	—	760	76,836	0.2
野村不動産マスターファンド投資法人	42,190	42,190	16,118	2,092,116	5.6
ラサールロジポート投資法人	14,916	14,916	2,978	549,143	1.5
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1,595	1,595	1,400	758,800	2.0
投資法人みらい	2,950	2,950	5,334	188,290	0.5
森トラスト・ホテルリート投資法人	4,470	4,470	1,060	96,884	0.3
三菱地所物流リート投資法人	2,732	2,732	948	430,392	1.1
CREロジスティクスファンド投資法人	—	—	1,970	314,609	0.8
タカラレーベン不動産投資法人	—	—	800	69,680	0.2
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	—	—	1,894	300,956	0.8
日本ビルファンド投資法人	10,117	10,117	3,467	2,087,134	5.6
ジャパンリアルエステイト投資法人	11,825	11,825	3,732	2,063,796	5.5
日本リテールファンド投資法人	26,187	26,187	9,277	1,225,491	3.3
オリックス不動産投資法人	26,504	26,504	9,162	1,257,026	3.4
日本プライムリアルティ投資法人	5,597	5,597	2,821	827,681	2.2
プレミア投資法人	13,054	13,054	6,145	722,652	1.9
東急リアル・エステート投資法人	9,404	9,404	3,924	537,195	1.4
グローバル・ワン不動産投資法人	10,624	10,624	4,400	432,080	1.2
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,325	23,325	9,134	931,668	2.5
森トラスト総合リート投資法人	12,260	12,260	4,057	504,285	1.3
インヴェンシブル投資法人	50,407	50,407	—	—	—
フロンティア不動産投資法人	2,386	2,386	766	234,396	0.6
平和不動産リート投資法人	5,359	5,359	3,807	418,389	1.1

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数		口 数	評 価 額	比 率
	口	金 額	口	千円	%
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,425		2,238	712,803	1.9
福岡リート投資法人	3,987		1,207	151,478	0.4
ケネディクス・オフィス投資法人	4,889		1,664	1,005,056	2.7
いちごオフィスリート投資法人	10,927		6,256	434,166	1.2
大和証券オフィス投資法人	3,191		758	445,704	1.2
阪急阪神リート投資法人	7,500		1,972	230,329	0.6
スターツプロシード投資法人	—		130	26,936	0.1
大和ハウスリート投資法人	16,108		5,175	1,433,992	3.8
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,044		—	—	—
大和証券リビング投資法人	24,771		7,784	820,433	2.2
ジャパンエクセレント投資法人	12,375		5,452	623,708	1.7
合 計		706,394	244,094	36,861,097	
	銘 柄 数 < 比 率 >	47	51	< 98.4% >	

(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、別銘柄として記載しています。

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

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10期 (決算日 2019年9月24日)

(計算期間 2018年9月26日～2019年9月24日)

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

東京海上アセットマネジメント

原則、各表の数量、金額の単位未満は切り捨て、比率は四捨五入で表記していますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値と一致しない場合があります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

また、一印は組み入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数			債組入比率	純資産額
	円	騰落率	騰落	騰落	中率		
6期(2015年9月24日)	11,472	2.5	172.012	3.1	95.3	129,016	
7期(2016年9月23日)	12,012	4.7	181.508	5.5	98.4	240,404	
8期(2017年9月25日)	11,981	△0.3	180.167	△0.7	99.5	347,397	
9期(2018年9月25日)	11,929	△0.4	179.225	△0.5	99.8	423,906	
10期(2019年9月24日)	12,407	4.0	186.800	4.2	99.3	650,697	

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数			債組入比率	券率
	円	騰落率	騰落	騰落	率		
(期首) 2018年9月25日	11,929	—	179.225	—	99.8	—	
9月末	11,939	0.1	179.327	0.1	99.8	—	
10月末	11,962	0.3	179.595	0.2	99.2	—	
11月末	12,018	0.7	180.397	0.7	99.3	—	
12月末	12,083	1.3	181.853	1.5	99.8	—	
2019年1月末	12,136	1.7	182.432	1.8	99.8	—	
2月末	12,158	1.9	182.802	2.0	99.2	—	
3月末	12,238	2.6	184.108	2.7	99.8	—	
4月末	12,196	2.2	183.530	2.4	99.8	—	
5月末	12,271	2.9	184.539	3.0	99.6	—	
6月末	12,331	3.4	185.525	3.5	99.8	—	
7月末	12,350	3.5	185.789	3.7	99.8	—	
8月末	12,425	4.2	188.033	4.9	99.6	—	
(期末) 2019年9月24日	12,407	4.0	186.800	4.2	99.3	—	

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

○運用経過

(2018年9月26日～2019年9月24日)

■期中の基準価額等の推移

期首：11,929円

期末：12,407円

騰落率：4.0%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・主要中央銀行の金融政策の変更に伴い、長期金利（10年国債利回り）が低下（債券価格は上昇）し、社債利回りも低下したこと

マイナス要因

- ・海外金利の上昇などを背景に10年国債利回りが上昇する局面があったこと

■投資環境

【国債市場の概況】

期初0.1%台前半で推移していた10年国債利回りは、主に海外金利の上昇などを受けて、一時0.16%程度水準まで上昇しました。しかし、2018年10月下旬以降、世界経済の減速懸念を背景とした投資家のリスク回避姿勢の鮮明化や、FRB（米連邦準備制度理事会）高官による利上げ局面の早期終了を示唆する発言をきっかけとした米国長期金利の低下を背景に10年国債利回りは低下基調に転じ、2019年3月末には-0.09%程度まで低下しました。その後、2019年4月中旬にかけて0%に迫る水準まで上昇する局面もありましたが、4月下旬以降、米中貿易摩擦の激化や、ECB（欧州中央銀行）による追加金融緩和への期待、米国での利下げ観測の台頭などを背景に10年国債利回りは低下に転じました。その後も、トランプ米大統領による第4弾となる対中制裁関税の発表や、香港情勢の悪化による地政学的リスクの高まり、英国の合意なきEU（欧州連合）離脱の可能性が高まったことなどから低下基調は続き、8月末には-0.28%程度水準まで低下しました。9月以降、超長期金利の過度な低下を牽制した日銀総裁の発言を契機に10年国債利回りは上昇に転じましたが、前期末よりも低下した-0.23%程度水準で当期を終えました。

【社債市場の概況】

国内社債市場については、国債利回りが一段と低下するなか、相対的に高い利回りを求めて資金が流入したことにより良好な需給環境が継続し、社債利回りは低下しました。ただし、社債利回りは、国債利回りの低下に完全には追従できず、社債スプレッド（国債に対する上乗せ利回り）はやや拡大しました。

個別銘柄では、日産自動車のカルロス・ゴーン前会長が有価証券報告書の虚偽記載および特別背任の疑いで逮捕されたことで、日産自動車および同社の金融子会社である日産フィナンシャルサービスの社債価格が下落しました。



(注) 参考指数は、期首（2018年9月25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。

■ポートフォリオについて

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

当期は、ポートフォリオの利回り向上を意識して、社債（金融機関劣後債、生保基金債などを含む）を中心とした組み入れを維持しました。組み入れにあたっては、個別企業の信用リスクが変動した際の影響を可能な限り回避するよう業種分散を図るとともに、信用力の程度に応じた残存年限を選択しました。また、流動性確保の観点から、国債や政府保証債、地方債などにも投資しました。当期末のポートフォリオの平均残存期間は10年程度、平均格付は「AA-」（格付が取得できない債券を除く）を維持しました。国債利回りが低下するなか、社債利回りも低下したことで、基準価額は4.0%上昇しました。

なお、前述の日産フィナンシャルサービス債はマザーファンドで少額保有していますが、ファンド全体に占める保有割合は0.2%程度と僅かであり、収益に与える影響は軽微でした。今後の動向について注視しますが、現時点で債務の返済能力に特段の懸念はないと考えています。

○今後の運用方針

国債市場については、世界経済の減速などを受けて欧米の中央銀行の金融政策がこれまでよりも緩和的な姿勢に移行するなか、日銀は今後もイールドカーブ・コントロール政策を維持することが予想されるため、国内長期金利は狭いレンジ内で推移すると考えます。

国内社債市場については、企業業績の動向を注視するの必要はありますが、プラスの利回りを求めて運用資金が流入する構図が継続し、社債利回り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思われる銘柄でポートフォリオを構成し、安定運用を行います。

なお、足元の国内社債市場には、マイナスの利回りを回避するために多額の運用資金が流入しており、特に残存年限が5年未満のゾーンで十分な量の社債を購入することが徐々に難しくなる可能性があります。当ファンドでは、今後の運用の持続性を維持するため、コマーシャル・ペーパー*の組み入れを検討しています。

*信用力の高い企業が、無担保で短期資金を調達するために発行する、期間が1年未満の短期社債。

○1万口当たりの費用明細

(2018年9月26日～2019年9月24日)

該当事項はございません。

○売買及び取引の状況

(2018年9月26日～2019年9月24日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	17,002,054	11,256,291
	地方債証券	65,783,286	—
内	特殊債券	3,877,330	—
	社債券（投資法人債券を含む）	139,453,801	1,909,337
			(351,700) (5,200,000)

(注) 金額は受渡代金です。(経過利子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

(2018年9月26日～2019年9月24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

(2019年9月24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	27,800,000	33,864,362	5.2	—	5.2	—	—
地方債証券	157,580,800	176,569,662	27.1	—	26.9	0.3	—
	(157,580,800)	(176,569,662)	(27.1)	(—)	(26.9)	(0.3)	(—)
特殊債券 (除く金融債)	23,700,000	27,920,611	4.3	—	4.3	—	—
	(23,700,000)	(27,920,611)	(4.3)	(—)	(4.3)	(—)	(—)
金融債券	5,960,000	5,975,450	0.9	—	—	0.8	0.1
	(5,960,000)	(5,975,450)	(0.9)	(—)	(—)	(0.8)	(0.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	386,656,000	401,928,125	61.8	—	39.5	16.6	5.7
	(386,656,000)	(401,928,125)	(61.8)	(—)	(39.5)	(16.6)	(5.7)
合 計	601,696,800	646,258,210	99.3	—	75.9	17.7	5.8
	(573,896,800)	(612,393,848)	(94.1)	(—)	(70.7)	(17.7)	(5.8)

(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			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第12回利付国債(30年)	2.1	300,000	390,297	2033/9/20
第13回利付国債(30年)	2.0	500,000	645,110	2033/12/20
第14回利付国債(30年)	2.4	500,000	675,740	2034/3/20
第15回利付国債(30年)	2.5	500,000	685,185	2034/6/20
第16回利付国債(30年)	2.5	500,000	687,325	2034/9/20
第17回利付国債(30年)	2.4	500,000	681,785	2034/12/20
第18回利付国債(30年)	2.3	500,000	675,950	2035/3/20
第19回利付国債(30年)	2.3	500,000	677,740	2035/6/20
第20回利付国債(30年)	2.5	500,000	695,930	2035/9/20
第21回利付国債(30年)	2.3	500,000	681,725	2035/12/20
第22回利付国債(30年)	2.5	500,000	700,255	2036/3/20
第23回利付国債(30年)	2.5	500,000	702,125	2036/6/20
第24回利付国債(30年)	2.5	500,000	704,545	2036/9/20
第25回利付国債(30年)	2.3	500,000	689,295	2036/12/20
第26回利付国債(30年)	2.4	500,000	699,390	2037/3/20
第29回利付国債(30年)	2.4	500,000	709,645	2038/9/20
第30回利付国債(30年)	2.3	500,000	703,485	2039/3/20
第134回利付国債(20年)	1.8	500,000	620,470	2032/3/20
第135回利付国債(20年)	1.7	100,000	122,829	2032/3/20
第136回利付国債(20年)	1.6	500,000	607,820	2032/3/20
第137回利付国債(20年)	1.7	500,000	615,685	2032/6/20
第138回利付国債(20年)	1.5	500,000	602,795	2032/6/20
第139回利付国債(20年)	1.6	500,000	609,240	2032/6/20
第140回利付国債(20年)	1.7	500,000	617,195	2032/9/20
第141回利付国債(20年)	1.7	500,000	618,230	2032/12/20
第142回利付国債(20年)	1.8	500,000	624,910	2032/12/20
第143回利付国債(20年)	1.6	500,000	612,810	2033/3/20
第144回利付国債(20年)	1.5	500,000	606,015	2033/3/20
第145回利付国債(20年)	1.7	500,000	621,005	2033/6/20
第146回利付国債(20年)	1.7	500,000	622,365	2033/9/20
第147回利付国債(20年)	1.6	500,000	616,515	2033/12/20
第148回利付国債(20年)	1.5	500,000	610,380	2034/3/20
第149回利付国債(20年)	1.5	500,000	611,405	2034/6/20
第150回利付国債(20年)	1.4	500,000	604,900	2034/9/20
第151回利付国債(20年)	1.2	600,000	708,612	2034/12/20
第152回利付国債(20年)	1.2	600,000	709,272	2035/3/20
第153回利付国債(20年)	1.3	600,000	719,328	2035/6/20
第154回利付国債(20年)	1.2	600,000	710,556	2035/9/20
第155回利付国債(20年)	1.0	600,000	691,794	2035/12/20
第156回利付国債(20年)	0.4	600,000	633,294	2036/3/20
第157回利付国債(20年)	0.2	600,000	612,900	2036/6/20
第158回利付国債(20年)	0.5	600,000	642,768	2036/9/20
第159回利付国債(20年)	0.6	600,000	652,488	2036/12/20
第160回利付国債(20年)	0.7	600,000	662,418	2037/3/20
第161回利付国債(20年)	0.6	600,000	651,702	2037/6/20
第162回利付国債(20年)	0.6	600,000	651,276	2037/9/20
第163回利付国債(20年)	0.6	600,000	650,808	2037/12/20
第164回利付国債(20年)	0.5	600,000	639,486	2038/3/20
第165回利付国債(20年)	0.5	600,000	638,844	2038/6/20
第166回利付国債(20年)	0.7	600,000	660,918	2038/9/20
第167回利付国債(20年)	0.5	600,000	638,064	2038/12/20
第168回利付国債(20年)	0.4	600,000	626,022	2039/3/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第169回利付国債(20年)	0.3	600,000	613,716	2039/6/20
小 計		27,800,000	33,864,362	
地方債証券				
第1回東京都公募公債(30年)	2.21	400,000	512,972	2033/6/20
第6回東京都公募公債(30年)	2.58	100,000	142,518	2037/9/18
第16回東京都公募公債(20年)	2.01	300,000	355,518	2028/12/20
第17回東京都公募公債(20年)	2.09	200,000	238,488	2028/12/20
第18回東京都公募公債(20年)	2.22	200,000	241,964	2029/3/19
第19回東京都公募公債(20年)	2.13	300,000	361,971	2029/6/20
第21回東京都公募公債(20年)	2.19	100,000	121,682	2029/12/20
第22回東京都公募公債(20年)	1.92	200,000	239,694	2030/6/20
第23回東京都公募公債(20年)	2.12	100,000	122,928	2030/12/20
第24回東京都公募公債(20年)	1.98	100,000	122,308	2031/6/20
第25回東京都公募公債(20年)	1.8	200,000	242,128	2031/12/19
第26回東京都公募公債(20年)	1.74	300,000	363,450	2032/6/18
第27回東京都公募公債(20年)	1.68	300,000	360,993	2032/12/20
第28回東京都公募公債(20年)	1.59	100,000	119,502	2033/3/18
第30回東京都公募公債(20年)	1.508	300,000	360,258	2034/6/20
第31回東京都公募公債(20年)	1.238	100,000	116,451	2034/9/20
第32回東京都公募公債(20年)	1.293	600,000	708,732	2035/6/20
第34回東京都公募公債(20年)	0.668	500,000	544,715	2037/6/19
第35回東京都公募公債(20年)	0.525	700,000	742,399	2038/6/18
平成25年度第12回北海道公募公債(20年)	1.635	300,000	362,196	2033/12/27
平成26年度第4回北海道公募公債(20年)	1.569	200,000	241,120	2034/6/27
平成26年度第12回北海道公募公債(20年)	1.303	200,000	234,402	2034/12/26
平成27年度第4回北海道公募公債(20年)	1.357	600,000	712,086	2035/6/29
平成27年度第12回北海道公募公債(20年)	1.156	100,000	115,327	2035/12/25
平成28年度第3回北海道公募公債(20年)	0.363	200,000	205,788	2036/6/30
平成29年度第11回北海道公募公債(20年)	0.635	100,000	107,959	2037/12/25
平成30年度第4回北海道公募公債(20年)	0.569	600,000	639,420	2038/6/25
平成30年度第5回北海道公募公債(20年)	0.391	700,000	719,771	2038/6/25
平成30年度第9回北海道公募公債(20年)	0.654	500,000	541,530	2038/9/24
平成30年度第10回北海道公募公債(20年)	0.426	500,000	516,510	2038/9/24
平成30年度第15回北海道公募公債(20年)	0.291	700,000	714,388	2038/9/24
令和元年度第4回北海道公募公債(20年)	0.323	700,000	711,501	2039/6/24
令和元年度第5回北海道公募公債(20年)	0.2	700,000	706,023	2039/6/24
第4回1号宮城県公募公債(20年)	0.434	380,000	392,855	2038/8/20
第4回2号宮城県公募公債(20年)	0.244	487,500	494,902	2039/2/18
第5回1号宮城県公募公債(20年)	0.17	500,000	503,070	2039/8/19
第15回1号宮城県公募公債(5年)	0.01	100,000	100,123	2024/6/27
第11回神奈川県公募公債(20年)	2.08	200,000	240,544	2029/7/20
第13回神奈川県公募公債(20年)	2.21	100,000	121,700	2029/12/20
第14回神奈川県公募公債(20年)	1.969	400,000	481,224	2030/7/19
第15回神奈川県公募公債(20年)	1.94	100,000	120,532	2030/11/12
第16回神奈川県公募公債(20年)	2.09	200,000	245,158	2031/1/24
第17回神奈川県公募公債(20年)	1.975	200,000	244,286	2031/7/11
第19回神奈川県公募公債(20年)	1.818	300,000	363,771	2032/1/30
第20回神奈川県公募公債(20年)	1.706	500,000	602,845	2032/6/18
第21回神奈川県公募公債(20年)	1.732	200,000	242,466	2032/9/17
第22回神奈川県公募公債(20年)	1.802	200,000	243,366	2032/12/20
第23回神奈川県公募公債(20年)	1.804	100,000	122,759	2033/6/20
第25回神奈川県公募公債(20年)	1.578	200,000	240,828	2033/12/20
第26回神奈川県公募公債(20年)	1.477	100,000	119,638	2034/6/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第27回神奈川県公募債 (20年)	1.398	500,000	594,025	2034/9/20
第28回神奈川県公募債 (20年)	0.941	300,000	336,882	2034/12/20
第29回神奈川県公募債 (20年)	1.289	600,000	708,360	2035/6/20
第30回神奈川県公募債 (20年)	1.161	100,000	116,337	2035/9/20
第33回神奈川県公募債 (20年)	0.64	500,000	541,140	2036/12/19
第34回神奈川県公募債 (20年)	0.654	100,000	108,701	2037/6/19
第40回神奈川県公募債 (20年)	0.2	800,000	795,328	2039/6/20
第1回大阪府公募債 (20年)	2.19	100,000	121,663	2029/9/14
第5回大阪府公募債 (20年)	2.16	350,000	427,056	2030/5/28
第6回大阪府公募債 (20年)	1.98	200,000	241,218	2030/9/13
第7回大阪府公募債 (20年)	1.84	220,000	265,892	2031/9/26
第8回大阪府公募債 (20年)	1.83	600,000	726,888	2031/12/22
第9回大阪府公募債 (20年)	1.83	100,000	121,520	2032/3/12
第10回大阪府公募債 (20年)	1.72	530,000	641,453	2032/9/24
第11回大阪府公募債 (20年)	1.693	500,000	607,525	2033/9/27
第12回大阪府公募債 (20年)	1.453	540,000	645,089	2034/9/26
第13回大阪府公募債 (20年)	1.203	600,000	701,010	2035/9/28
第15回大阪府公募債 (20年)	0.721	600,000	656,190	2037/3/30
第17回大阪府公募債 (20年)	0.668	700,000	759,955	2038/9/27
平成22年度第3回京都府公募債	2.0	500,000	607,230	2030/11/22
平成23年度第5回京都府公募債 (20年)	1.79	400,000	482,600	2031/10/17
平成24年度第3回京都府公募債 (20年)	1.63	600,000	720,024	2032/8/13
平成26年度第3回京都府公募債 (15年)	1.071	400,000	440,848	2029/4/27
平成26年度第5回京都府公募債 (20年)	1.455	600,000	716,994	2034/8/10
平成27年度第2回京都府公募債 (15年)	0.729	600,000	642,318	2030/4/26
平成27年度第8回京都府公募債 (15年)	0.78	600,000	647,148	2030/10/11
平成28年度第2回京都府公募債 (15年)	0.21	200,000	203,366	2031/4/22
平成28年度第5回京都府公募債 (20年)	0.327	100,000	102,915	2036/8/15
平成29年度第2回京都府公募債 (15年)	0.391	500,000	520,405	2032/4/23
平成29年度第5回京都府公募債 (20年)	0.63	100,000	108,357	2037/8/14
平成30年度第5回京都府公募債 (20年)	0.658	600,000	650,574	2038/8/13
平成30年度第8回京都府公募債 (20年)	0.435	487,500	504,350	2038/10/15
令和元年度第5回京都府公募債 (20年)	0.2	400,000	398,456	2039/8/19
第1回兵庫県公募債 (18年)	1.26	200,000	229,928	2032/8/6
第11回兵庫県公募債 (15年)	0.718	500,000	533,685	2030/5/10
第12回兵庫県公募債 (15年)	0.781	100,000	107,734	2030/12/6
第14回兵庫県公募債 (15年)	0.428	200,000	208,626	2032/5/26
第6回兵庫県公募債 (20年)	0.436	700,000	723,023	2038/9/10
第8回兵庫県公募債 (20年)	2.14	500,000	604,105	2029/7/13
第9回兵庫県公募債 (20年)	2.25	100,000	121,861	2029/11/19
第13回兵庫県公募債 (20年)	1.83	300,000	364,617	2032/3/16
第15回兵庫県公募債 (20年)	1.64	500,000	598,680	2032/7/23
第19回兵庫県公募債 (20年)	1.57	100,000	120,092	2033/12/9
第20回兵庫県公募債 (20年)	1.53	100,000	119,870	2034/3/10
第21回兵庫県公募債 (20年)	1.54	200,000	240,454	2034/5/9
第22回兵庫県公募債 (20年)	1.4	500,000	593,100	2034/9/8
第24回兵庫県公募債 (20年)	1.23	100,000	116,712	2035/3/23
第32回兵庫県公募債 (20年)	0.621	400,000	430,812	2037/5/1
第35回兵庫県公募債 (20年)	0.578	600,000	640,236	2038/5/28
第37回兵庫県公募債 (20年)	0.472	500,000	523,445	2039/2/18
第38回兵庫県公募債 (20年)	0.352	100,000	102,284	2039/6/20
第5回静岡県公募債 (15年)	1.087	100,000	109,849	2028/11/20
第7回静岡県公募債 (15年)	0.966	100,000	108,963	2029/10/15
第10回静岡県公募債 (20年)	0.355	400,000	409,932	2038/6/18
第12回静岡県公募債 (20年)	0.257	600,000	609,618	2039/3/18

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第2回静岡県公募債 (30年)	2.54	300,000	431,022	2038/9/17
第5回静岡県公募債 (20年)	2.29	100,000	118,310	2027/9/21
第9回静岡県公募債 (20年)	2.227	200,000	244,128	2029/9/20
第10回静岡県公募債 (20年)	2.072	300,000	363,723	2030/6/14
第11回静岡県公募債 (20年)	1.841	350,000	417,630	2030/10/18
第12回静岡県公募債 (20年)	2.003	230,000	281,432	2031/6/18
第14回静岡県公募債 (20年)	1.736	500,000	604,735	2032/6/18
第15回静岡県公募債 (20年)	1.701	450,000	540,715	2032/10/15
第18回静岡県公募債 (20年)	1.473	400,000	478,604	2034/7/10
第19回静岡県公募債 (20年)	1.253	300,000	352,845	2035/7/27
第24回静岡県公募債 (20年)	0.63	100,000	108,400	2037/9/18
第25回静岡県公募債 (20年)	0.53	400,000	424,588	2038/6/18
第26回静岡県公募債 (20年)	0.711	600,000	657,840	2038/9/17
平成20年度第8回愛知県公募債 (20年)	2.04	500,000	593,635	2028/12/20
平成21年度第5回愛知県公募債 (20年)	2.28	100,000	122,057	2029/6/20
平成21年度第16回愛知県公募債 (20年)	2.218	100,000	121,782	2029/12/20
平成22年度第4回愛知県公募債 (20年)	2.072	100,000	121,241	2030/6/14
平成22年度第14回愛知県公募債 (20年)	2.087	350,000	428,113	2030/12/13
平成23年度第16回愛知県公募債 (20年)	1.8	100,000	121,019	2032/1/26
平成24年度第17回愛知県公募債 (20年)	1.829	400,000	489,028	2033/2/8
平成25年度第3回愛知県公募債 (20年)	1.509	200,000	236,794	2033/5/13
平成25年度第11回愛知県公募債 (20年)	1.77	100,000	122,672	2033/9/13
平成26年度第4回愛知県公募債 (20年)	1.542	100,000	120,449	2034/5/15
平成26年度第11回愛知県公募債 (15年)	0.961	200,000	217,830	2029/10/16
平成26年度第13回愛知県公募債 (20年)	1.363	600,000	710,886	2034/11/14
平成27年度第2回愛知県公募債 (15年)	0.74	300,000	321,000	2030/4/26
平成27年度第3回愛知県公募債 (20年)	1.115	600,000	691,572	2035/5/8
平成27年度第14回愛知県公募債 (20年)	1.129	200,000	230,894	2035/11/19
平成28年度第2回愛知県公募債 (20年)	0.387	100,000	103,844	2036/5/12
平成28年度第12回愛知県公募債 (20年)	0.429	300,000	313,989	2036/11/18
平成30年度第2回愛知県公募債 (20年)	0.54	100,000	106,380	2038/4/4
平成30年度第12回愛知県公募債 (20年)	0.706	300,000	326,769	2038/11/15
平成30年度第14回愛知県公募債 (20年)	0.291	585,000	597,287	2038/12/14
令和元年度第5回愛知県公募債 (20年)	0.288	400,000	404,336	2039/7/12
平成22年度第1回広島県公募債 (20年)	2.07	500,000	606,605	2030/5/28
平成23年度第1回広島県公募債 (20年)	1.83	100,000	121,009	2031/9/22
平成24年度第1回広島県公募債 (20年)	1.7	600,000	726,252	2032/9/14
平成25年度第1回広島県公募債 (20年)	1.75	300,000	367,191	2033/9/13
平成26年度第1回広島県公募債 (20年)	1.41	600,000	713,730	2034/9/12
平成27年度第1回広島県公募債 (20年)	1.212	300,000	351,453	2035/9/25
平成28年度第1回広島県公募債 (20年)	0.414	200,000	208,752	2036/9/26
平成29年度第2回広島県公募債 (20年)	0.597	600,000	645,864	2037/9/25
平成30年度第1回広島県公募債 (20年)	0.568	700,000	748,293	2038/5/17
平成30年度第2回広島県公募債 (20年)	0.668	600,000	653,112	2038/9/17
平成31年度第1回広島県公募債 (20年)	0.419	700,000	725,865	2039/4/19
令和元年度第2回広島県公募債 (20年)	0.2	400,000	397,716	2039/9/20
第2回埼玉県公募債 (15年)	0.869	100,000	108,409	2030/5/22
第3回埼玉県公募債 (15年)	0.43	500,000	521,475	2032/1/30
第7回埼玉県公募債 (20年)	2.29	500,000	610,825	2029/6/12
第8回埼玉県公募債 (20年)	2.19	400,000	486,780	2029/9/20
第9回埼玉県公募債 (20年)	2.15	500,000	609,760	2030/5/24
平成22年度第10回埼玉県公募債 (20年)	1.94	500,000	602,660	2030/11/12
第11回埼玉県公募債 (20年)	2.0	200,000	244,654	2031/6/20
第12回埼玉県公募債 (20年)	1.73	100,000	120,761	2032/5/24
第13回埼玉県公募債 (20年)	1.599	600,000	717,768	2033/5/20

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
	%	千円	千円		%	千円	千円		
地方債証券					地方債証券				
第14回埼玉県公募公債 (20年)	1.546	600,000	722,892	2034/5/8	平成30年度第1回大分県公募公債	0.38	300,000	308,161	2038/7/16
第15回埼玉県公募公債 (20年)	1.166	400,000	463,276	2035/2/16	令和元年度第1回大分県公募公債	0.19	600,000	603,171	2039/7/15
第16回埼玉県公募公債 (20年)	1.216	200,000	234,186	2035/8/14	平成23年度第1回堺市公募公債 (20年)	1.8	500,000	604,665	2031/11/21
第18回埼玉県公募公債 (20年)	0.323	500,000	514,050	2036/5/20	平成24年度第1回堺市公募公債	1.732	600,000	725,292	2032/11/12
第22回埼玉県公募公債 (20年)	0.568	600,000	640,842	2038/5/21	平成30年度第2回堺市公募公債	0.386	682,500	702,906	2038/11/15
平成26年度第1回福岡県公募公債 (15年)	0.92	100,000	108,712	2039/11/26	平成30年度第2回長崎県公募公債	0.491	500,000	519,597	2038/8/20
平成27年度第1回福岡県公募公債 (15年)	0.784	500,000	539,930	2030/11/25	令和元年度第2回長崎県公募公債	0.18	400,000	400,108	2039/8/26
平成29年度第1回福岡県公募公債 (15年)	0.419	300,000	311,730	2032/11/22	平成28年度第2回島根県公募公債 (20年)	0.506	100,000	105,904	2036/9/30
平成30年度第2回福岡県公募公債 (15年)	0.542	600,000	635,082	2033/10/17	平成29年度第2回島根県公募公債	0.583	700,000	751,730	2037/9/18
令和元年度第1回福岡県公募公債 (15年)	0.254	600,000	611,634	2034/6/14	平成30年度第2回島根県公募公債	0.668	700,000	761,964	2038/9/17
平成20年度第2回福岡県公募公債 (20年)	2.05	400,000	475,492	2028/12/20	令和元年度第2回島根県公募公債	0.2	400,000	397,716	2039/9/20
平成22年度第2回福岡県公募公債 (20年)	2.116	100,000	123,234	2031/2/21	平成30年度第2回福島県公募公債	0.02	200,000	200,310	2024/2/26
平成23年度第2回福岡県公募公債 (20年)	1.806	100,000	120,559	2031/8/18	平成30年度第1回栃木県公募公債	0.421	585,000	604,430	2038/10/22
平成24年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.734	100,000	120,949	2032/5/21	令和元年度第1回熊本県公募公債 (5年)	0.005	100,000	100,099	2024/7/31
平成24年度第2回福岡県公募公債 (20年)	1.635	500,000	600,405	2032/8/16	平成30年度第1回奈良県公募公債	0.396	285,000	293,249	2038/9/17
平成25年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.599	300,000	358,884	2033/5/20	令和元年度第1回奈良県公募公債	0.15	300,000	300,060	2039/9/20
平成25年度第2回福岡県公募公債 (20年)	1.787	100,000	122,764	2033/8/12	第6回大阪市公募公債 (20年)	2.21	100,000	120,349	2028/12/20
平成26年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.542	250,000	301,222	2034/5/26	第8回大阪市公募公債 (20年)	2.27	200,000	244,680	2029/8/14
平成26年度第2回福岡県公募公債 (20年)	1.451	300,000	358,776	2034/9/22	第10回大阪市公募公債 (20年)	2.22	100,000	122,195	2030/1/25
平成26年度第4回福岡県公募公債 (20年)	1.249	200,000	234,188	2035/2/23	第11回大阪市公募公債 (20年)	2.25	100,000	122,855	2030/3/26
平成27年度第1回福岡県公募公債 (20年)	1.285	400,000	471,636	2035/5/22	第13回大阪市公募公債 (20年)	2.08	550,000	668,360	2030/6/14
平成28年度第1回福岡県公募公債 (20年)	0.308	100,000	102,568	2036/5/23	第14回大阪市公募公債 (20年)	1.97	300,000	362,991	2030/10/30
平成28年度第4回福岡県公募公債 (20年)	0.744	600,000	660,360	2037/2/13	第15回大阪市公募公債 (20年)	2.12	250,000	307,807	2031/1/24
第9回千葉県公募公債 (20年)	0.416	487,500	503,460	2038/10/15	第17回大阪市公募公債 (20年)	1.721	200,000	241,740	2032/12/21
第6回千葉県公募公債 (20年)	2.26	200,000	242,988	2029/4/20	第18回大阪市公募公債 (20年)	1.262	600,000	703,818	2035/2/27
第7回千葉県公募公債 (20年)	2.16	100,000	120,940	2029/10/26	第19回大阪市公募公債 (20年)	1.138	500,000	577,880	2035/4/24
第9回千葉県公募公債 (20年)	1.84	400,000	477,120	2030/10/11	第21回大阪市公募公債 (20年)	0.97	300,000	339,258	2036/1/29
第10回千葉県公募公債 (20年)	1.8	100,000	120,276	2031/8/18	第22回大阪市公募公債 (20年)	0.347	700,000	722,435	2036/5/30
第11回千葉県公募公債 (20年)	1.87	100,000	121,658	2031/12/12	第24回大阪市公募公債 (20年)	0.655	100,000	108,641	2037/4/21
第12回千葉県公募公債 (20年)	1.839	400,000	487,484	2032/4/16	第26回大阪市公募公債 (20年)	0.635	500,000	541,265	2037/10/23
第13回千葉県公募公債 (20年)	1.701	550,000	660,874	2032/10/15	第27回大阪市公募公債 (20年)	0.544	100,000	106,442	2038/4/20
第14回千葉県公募公債 (20年)	1.137	500,000	566,730	2033/4/15	第28回大阪市公募公債 (20年)	0.381	475,000	487,962	2038/5/28
第15回千葉県公募公債 (20年)	1.604	100,000	120,514	2033/10/14	第29回大阪市公募公債 (20年)	0.218	700,000	707,987	2039/5/27
第16回千葉県公募公債 (20年)	1.555	500,000	602,620	2034/4/14	第2回名古屋市公募公債 (15年)	0.905	100,000	108,537	2029/11/16
第17回千葉県公募公債 (20年)	1.403	600,000	713,766	2034/10/13	第1回名古屋市公募公債 (20年)	0.17	300,000	301,663	2039/8/19
第18回千葉県公募公債 (20年)	1.138	400,000	462,188	2035/4/13	第1回名古屋市公募公債 (30年)	2.53	500,000	683,150	2035/3/20
第19回千葉県公募公債 (20年)	1.166	100,000	115,937	2035/10/15	第3回名古屋市公募公債 (30年)	2.5	100,000	141,119	2037/9/18
第23回千葉県公募公債 (20年)	0.63	200,000	216,308	2037/10/15	第11回名古屋市公募公債 (20年)	2.13	100,000	121,039	2029/12/14
第25回千葉県公募公債 (20年)	0.701	700,000	761,551	2038/10/15	第12回名古屋市公募公債 (20年)	1.81	400,000	475,516	2030/8/9
平成29年度第1回新潟県公募公債	0.616	700,000	756,133	2037/8/14	第14回名古屋市公募公債 (20年)	1.648	500,000	601,105	2032/8/10
平成30年度第1回新潟県公募公債	0.653	700,000	758,422	2038/8/20	第15回名古屋市公募公債 (20年)	1.712	300,000	365,574	2033/9/9
令和元年度第1回新潟県公募公債	0.2	800,000	795,392	2039/8/19	第16回名古屋市公募公債 (20年)	1.52	200,000	240,442	2034/6/9
平成30年度第2回茨城県公募公債	0.386	500,000	514,055	2038/7/30	第17回名古屋市公募公債 (20年)	1.203	500,000	583,335	2035/5/28
令和元年度第2回茨城県公募公債	0.19	500,000	500,802	2039/7/29	第18回名古屋市公募公債 (20年)	1.139	600,000	693,462	2035/11/20
第20回群馬県公募公債 (10年)	0.06	400,000	401,700	2029/8/20	第19回名古屋市公募公債 (20年)	0.323	100,000	102,800	2036/4/28
第2回群馬県公募公債 (20年)	0.2	400,000	403,808	2039/6/17	第20回名古屋市公募公債 (20年)	0.645	600,000	651,084	2037/5/25
第1回群馬県公募公債 (20年)	1.841	250,000	298,307	2030/10/18	第21回名古屋市公募公債 (20年)	0.568	700,000	748,300	2038/5/18
第2回群馬県公募公債 (20年)	2.019	100,000	122,694	2031/7/18	第22回名古屋市公募公債 (20年)	0.431	700,000	728,644	2039/5/20
第3回群馬県公募公債 (20年)	1.687	600,000	721,710	2032/6/25	第1回京都市公募公債 (15年)	0.781	100,000	108,000	2030/12/20
第4回群馬県公募公債 (20年)	1.667	100,000	120,896	2033/6/17	第2回京都市公募公債 (20年)	0.331	570,000	582,750	2038/7/16
第5回群馬県公募公債 (20年)	1.529	500,000	601,880	2034/6/16	第3回京都市公募公債 (20年)	0.244	682,500	692,891	2039/2/18
第6回群馬県公募公債 (20年)	1.267	600,000	706,158	2035/6/11	第4回京都市公募公債 (20年)	0.18	300,000	302,158	2039/7/15
第7回群馬県公募公債 (20年)	0.313	700,000	718,606	2036/6/13	第4回京都市公募公債 (20年)	2.51	100,000	117,563	2026/9/18
第9回群馬県公募公債 (20年)	0.554	400,000	426,296	2038/6/11	第5回京都市公募公債 (20年)	2.36	200,000	234,284	2026/12/18
第10回群馬県公募公債 (20年)	0.338	500,000	510,595	2039/6/17	第6回京都市公募公債 (20年)	2.38	500,000	595,145	2027/9/17

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
地方債証券				
第9回京都市公募債(20年)	2.143	200,000	246,336	2030/12/17
第10回京都市公募債(20年)	1.803	200,000	241,938	2031/11/21
第11回京都市公募債(20年)	1.701	100,000	120,504	2032/11/19
第13回京都市公募債(20年)	1.359	300,000	355,368	2034/11/24
第14回京都市公募債(20年)	1.139	400,000	462,452	2035/11/22
第15回京都市公募債(20年)	0.487	500,000	528,205	2036/11/28
第16回京都市公募債(20年)	0.611	600,000	646,710	2037/11/27
第17回京都市公募債(20年)	0.683	700,000	762,398	2038/11/26
平成18年度第3回神戸市公募債(20年)	2.54	300,000	351,408	2026/6/19
平成20年度第24回神戸市公募債(20年)	2.08	500,000	595,755	2028/12/20
平成21年度第11回神戸市公募債(20年)	2.233	300,000	367,056	2030/1/29
平成22年度第4回神戸市公募債(20年)	1.895	100,000	119,946	2030/9/13
平成22年度第9回神戸市公募債(20年)	2.09	350,000	429,751	2031/1/24
平成23年度第14回神戸市公募債(20年)	1.794	200,000	242,502	2032/2/13
平成24年度第3回神戸市公募債(20年)	1.635	500,000	600,340	2032/8/13
平成24年度第12回神戸市公募債(20年)	1.711	500,000	603,625	2032/12/17
平成25年度第12回神戸市公募債(20年)	1.52	100,000	119,821	2034/2/17
平成26年度第3回神戸市公募債(20年)	1.482	300,000	359,391	2034/7/14
平成27年度第9回神戸市公募債(20年)	1.007	100,000	113,667	2036/1/25
平成28年度第9回神戸市公募債(20年)	0.645	300,000	325,071	2037/1/23
平成29年度第5回神戸市公募債(20年)	0.597	200,000	215,270	2037/9/18
平成30年度第6回神戸市公募債(20年)	0.668	300,000	326,556	2038/9/17
令和元年度第6回神戸市公募債(20年)	0.2	500,000	495,250	2039/9/20
第1回横浜市公募債(30年)	2.63	500,000	684,665	2034/9/20
第2回横浜市公募債(30年)	2.49	500,000	680,115	2035/3/20
第4回横浜市公募債(30年)	2.54	210,000	294,262	2036/12/19
第15回横浜市公募債(20年)	2.2	100,000	119,756	2028/9/12
第16回横浜市公募債(20年)	2.35	300,000	363,168	2028/9/21
第17回横浜市公募債(20年)	2.07	500,000	595,300	2028/12/20
第21回横浜市公募債(20年)	1.969	100,000	120,500	2030/7/19
第22回横浜市公募債(20年)	1.895	100,000	119,946	2030/9/13
第25回横浜市公募債(20年)	1.72	400,000	484,100	2032/7/16
第26回横浜市公募債(20年)	1.776	200,000	243,506	2033/1/28
第27回横浜市公募債(20年)	1.599	200,000	239,738	2033/5/20
第28回横浜市公募債(20年)	1.586	300,000	361,122	2033/11/11
第29回横浜市公募債(20年)	1.528	200,000	240,574	2034/5/26
第30回横浜市公募債(20年)	1.376	400,000	474,344	2034/10/20
第31回横浜市公募債(20年)	1.18	200,000	232,414	2035/4/20
第40回横浜市公募債(20年)	0.559	500,000	533,535	2038/4/16
第42回横浜市公募債(20年)	0.47	393,300	408,729	2038/12/17
平成23年度第3回札幌市公募債(20年)	1.944	600,000	731,232	2031/7/29
平成24年度第1回札幌市公募債(20年)	1.79	600,000	727,764	2032/4/23
平成24年度第4回札幌市公募債(20年)	1.635	200,000	239,678	2032/8/13
平成25年度第1回札幌市公募債(20年)	1.72	200,000	243,198	2033/6/14
平成25年度第5回札幌市公募債(15年)	1.31	100,000	111,654	2028/8/18
平成25年度第10回札幌市公募債(20年)	1.53	200,000	240,134	2034/3/17
平成26年度第1回札幌市公募債(20年)	1.524	400,000	480,920	2034/5/26
平成26年度第5回札幌市公募債(15年)	0.961	500,000	547,240	2029/9/20
平成26年度第10回札幌市公募債(20年)	1.267	300,000	352,326	2035/3/20
平成27年度第3回札幌市公募債(20年)	1.211	200,000	233,948	2035/7/31
平成29年度第5回札幌市公募債(20年)	0.597	600,000	646,938	2037/9/18
平成30年度第1回札幌市公募債(20年)	0.366	380,000	389,781	2038/5/21
平成30年度第8回札幌市公募債(20年)	0.626	700,000	752,430	2038/12/20
令和元年度第4回札幌市公募債(20年)	0.15	300,000	300,259	2039/9/20
第2回川崎市公募債(20年)	2.27	300,000	350,913	2027/3/19

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
	%	千円	千円	
地方債証券				
第3回川崎市公募債(20年)	2.21	100,000	117,660	2027/9/21
第6回川崎市公募債(20年)	2.21	100,000	121,224	2029/5/25
第9回川崎市公募債(20年)	2.15	550,000	670,736	2030/5/24
第10回川崎市公募債(20年)	1.88	400,000	476,920	2030/6/20
第11回川崎市公募債(20年)	1.84	150,000	178,968	2030/10/18
第14回川崎市公募債(20年)	1.79	100,000	121,134	2032/3/19
第15回川崎市公募債(20年)	1.727	300,000	363,507	2032/9/17
第18回川崎市公募債(20年)	1.541	500,000	601,115	2034/3/17
第20回川崎市公募債(20年)	1.133	200,000	230,812	2035/3/20
第21回川崎市公募債(20年)	1.11	200,000	231,076	2035/9/20
第22回川崎市公募債(20年)	0.377	600,000	622,020	2036/4/22
第24回川崎市公募債(20年)	0.683	100,000	109,114	2037/4/17
第27回川崎市公募債(20年)	0.559	300,000	320,121	2038/4/16
第28回川崎市公募債(20年)	0.422	390,000	403,008	2038/10/29
第29回川崎市公募債(20年)	0.223	600,000	607,962	2039/4/22
第30回川崎市公募債(20年)	0.2	400,000	397,664	2039/6/20
第56回川崎市公募債(5年)	0.005	470,000	470,465	2024/7/31
第6回北九州市公募債(20年)	0.18	700,000	704,634	2039/7/22
第1回北九州市公募債(15年)	0.936	200,000	217,578	2029/10/22
第5回北九州市公募債(20年)	2.27	500,000	600,315	2028/7/21
第6回北九州市公募債(20年)	2.03	300,000	356,070	2028/12/20
第10回北九州市公募債(20年)	2.09	250,000	306,965	2031/1/24
第11回北九州市公募債(20年)	2.019	500,000	614,545	2031/7/18
第13回北九州市公募債(20年)	1.706	400,000	483,392	2032/7/16
第14回北九州市公募債(20年)	1.732	400,000	483,528	2032/11/12
第15回北九州市公募債(20年)	1.667	100,000	120,896	2033/6/17
第16回北九州市公募債(20年)	1.604	100,000	120,502	2033/10/11
第17回北九州市公募債(20年)	1.529	600,000	722,340	2034/6/20
第18回北九州市公募債(20年)	1.376	200,000	237,172	2034/10/20
第19回北九州市公募債(20年)	1.312	600,000	710,472	2035/6/19
第20回北九州市公募債(20年)	1.111	100,000	115,103	2035/10/26
平成18年度第1回福岡市公募債(20年)	2.45	300,000	349,581	2026/6/19
平成23年度第4回福岡市公募債(20年)	1.89	300,000	364,665	2031/8/19
平成24年度第2回福岡市公募債(20年)	1.702	400,000	483,260	2032/7/20
平成24年度第6回福岡市公募債(20年)	1.696	300,000	363,012	2032/9/17
平成25年度第6回福岡市公募債(20年)	1.511	400,000	478,772	2034/2/17
平成26年度第2回福岡市公募債(20年)	1.49	600,000	718,956	2034/6/20
平成26年度第6回福岡市公募債(20年)	1.371	200,000	236,816	2034/9/20
平成27年度第6回福岡市公募債(20年)	1.121	100,000	115,395	2035/12/18
平成28年度第6回福岡市公募債(20年)	0.429	700,000	732,676	2036/11/25
平成30年度第7回福岡市公募債(20年)	0.701	700,000	761,586	2038/10/19
平成30年度第8回福岡市公募債(20年)	0.416	487,500	503,458	2038/10/19
平成31年度第2回福岡市公募債(20年)	0.225	600,000	607,917	2039/4/22
平成31年度第3回福岡市公募債(20年)	0.419	600,000	622,158	2039/4/22
平成29年度第5回福岡市公募債(20年)	0.286	300,000	303,444	2039/7/29
平成29年度第2回広島市公募債(20年)	0.616	200,000	215,860	2037/8/18
平成29年度第4回広島市公募債(20年)	0.62	600,000	647,604	2037/11/20
平成30年度第2回広島市公募債(20年)	0.639	700,000	756,637	2038/8/20
平成30年度第4回広島市公募債(20年)	0.706	700,000	762,496	2038/11/19
令和元年度第1回広島市公募債(5年)	0.01	100,000	100,123	2024/6/25
令和元年度第2回広島市公募債(20年)	0.2	800,000	795,392	2039/8/19
平成29年度第1回仙台市公募債(20年)	0.616	700,000	755,398	2037/10/19
平成30年度第1回仙台市公募債(20年)	0.426	570,000	587,917	2038/8/20
平成30年度第2回仙台市公募債(20年)	0.729	700,000	765,163	2038/10/18
令和元年度第1回仙台市公募債(20年)	0.17	400,000	402,396	2039/8/19

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
平成24年度第2回福井県公債	1.711	100,000	120,504	2032/12/21
平成25年度第1回福井県公債	1.667	100,000	120,913	2033/6/21
平成27年度第1回福井県公債	1.28	600,000	708,024	2035/7/17
平成28年度第1回福井県公債	0.18	700,000	703,458	2036/7/29
平成28年度第2回福井県公債	0.06	500,000	502,055	2026/10/27
平成29年度第1回福井県公債	0.659	100,000	108,834	2037/7/24
平成30年度第1回福井県公債	0.535	500,000	530,890	2038/7/30
平成30年度第4回福井県公債	0.386	487,500	502,071	2038/11/15
令和元年度第1回福井県公債	0.286	400,000	404,592	2039/7/29
平成30年度第1回徳島県公債	0.331	380,000	388,487	2038/7/30
令和元年度第1回徳島県公債	0.18	400,000	402,850	2039/7/29
平成28年度第1回岡山県公債(10年)	0.18	600,000	608,298	2027/1/29
平成29年度第1回岡山県公債	0.352	462,500	473,891	2037/12/22
平成30年度第1回岡山県公債	0.29	682,500	695,286	2038/12/21
第5回神奈川県住宅供給公社債券	0.709	600,000	619,236	2038/4/23
第6回神奈川県住宅供給公社債券	0.215	400,000	404,960	2029/4/23
第7回神奈川県住宅供給公社債券	0.534	300,000	306,909	2039/4/22
第1回川崎市土地開発公社債券	0.02	700,000	699,531	2024/6/25
第2回営企業債券(30年)	2.39	100,000	132,889	2033/12/20
第1回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.266	100,000	121,553	2029/6/28
第7回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.202	400,000	490,912	2030/4/26
第12回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.092	100,000	122,860	2030/12/27
第13回地方公共団体金融機構債券(20年)	2.132	100,000	123,350	2031/1/28
第17回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.87	100,000	121,576	2031/9/26
第19回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.84	100,000	121,582	2031/12/26
第21回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.812	100,000	121,819	2032/4/28
第24回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.702	500,000	605,610	2032/9/28
第1回地方公共団体金融機構債券(15年)	1.334	100,000	110,807	2028/1/28
第32回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.624	100,000	121,858	2033/10/28
第33回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.668	500,000	613,250	2033/12/28
第35回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.569	300,000	364,320	2034/3/28
第37回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.535	200,000	242,242	2034/6/28
第40回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.381	600,000	714,222	2034/10/27
第44回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.298	300,000	354,672	2035/6/28
第46回地方公共団体金融機構債券(20年)	1.189	100,000	116,616	2035/9/28
第51回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.377	400,000	412,360	2036/4/28
第77回地方公共団体金融機構債券(20年)	0.2	500,000	495,250	2039/9/28
第21回営企業債券(20年)	2.43	400,000	474,168	2027/6/18
第24回営企業債券(20年)	2.29	500,000	596,445	2028/4/25
第25回営企業債券(20年)	2.5	100,000	121,459	2028/6/20
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	318,261	2037/2/27
第10回大阪府住宅供給公社債券	0.395	300,000	307,608	2027/6/18
第12回大阪府住宅供給公社債券	0.34	500,000	511,315	2028/6/20
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	521,960	2032/2/27
第135回愛知県、名古屋折半保証名古屋高速道路債券	0.768	400,000	427,460	2037/2/27
第121回福岡北九州高速道路債券	2.31	400,000	489,372	2029/12/20
第147回福岡北九州高速道路債券	0.502	500,000	520,405	2032/3/19
第148回福岡北九州高速道路債券	0.731	500,000	530,510	2037/3/19
第150回福岡北九州高速道路債券	0.396	600,000	615,114	2033/3/18
第13回東京都住宅供給公社債券	2.4	400,000	494,980	2030/5/24
第24回東京都住宅供給公社債券	0.519	500,000	509,065	2036/9/12
第26回東京都住宅供給公社債券	0.697	600,000	623,094	2037/9/11
第29回東京都住宅供給公社債券	0.749	200,000	211,942	2038/9/17
第30回東京都住宅供給公社債券	0.496	190,000	195,439	2038/9/17
第32回東京都住宅供給公社債券	0.341	300,000	300,909	2039/9/26

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
地方債証券	%	千円	千円	
第33回東京都住宅供給公社債券	0.25	300,000	300,057	2039/9/26
小 計		157,580,800	176,569,662	
特殊債(除く金融債)				
第70回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	500,000	602,265	2028/11/28
第63回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	500,000	600,180	2028/7/31
第90回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	500,000	606,340	2029/9/28
第92回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	100,000	121,461	2029/10/31
第94回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	100,000	122,658	2029/11/30
第97回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	300,000	365,406	2029/12/28
第99回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.2	500,000	615,175	2030/1/31
第106回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	300,000	367,539	2030/4/30
第114回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	300,000	361,380	2030/7/31
第118回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	120,739	2030/9/30
第121回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	500,000	598,945	2030/10/31
第125回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	500,000	617,165	2030/12/27
第127回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	300,000	367,003	2031/1/31
第130回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.0	500,000	613,265	2031/2/28
第134回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.1	200,000	248,280	2031/4/30
第138回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	100,000	122,138	2031/6/30
第141回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	300,000	366,894	2031/7/31
第143回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	242,512	2031/8/29
第146回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	200,000	242,824	2031/9/30
第148回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	121,563	2031/10/31
第153回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	500,000	609,180	2031/12/26
第160回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.8	100,000	121,934	2032/3/19
第169回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.634	200,000	240,448	2032/7/30
第171回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.56	500,000	596,685	2032/8/31
第174回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.641	300,000	362,430	2032/9/30
第176回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.645	200,000	241,764	2032/10/29
第178回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.68	500,000	606,845	2032/11/30
第183回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.726	400,000	488,608	2033/1/31
第185回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.757	400,000	490,436	2033/2/28
第187回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.662	400,000	485,688	2033/3/18
第188回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.4	500,000	589,945	2033/4/28
第196回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.779	500,000	616,740	2033/7/29
第199回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.702	500,000	611,765	2033/8/31
第209回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.556	100,000	120,752	2033/10/31
第205回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.532	500,000	602,675	2033/11/30
第208回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.577	600,000	727,164	2033/12/28
第210回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.547	200,000	241,640	2034/1/31
第212回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.5	500,000	601,295	2034/2/28
第216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	480,412	2034/3/31
第221回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.466	500,000	599,745	2034/6/30
第223回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.427	500,000	597,020	2034/7/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.39	500,000	594,845	2034/8/31
第226回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.396	500,000	595,355	2034/9/29
第230回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.338	500,000	592,940	2034/10/31
第233回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.315	500,000	591,305	2034/11/30
第235回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.224	500,000	584,940	2034/12/28
第237回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.97	500,000	565,390	2035/1/31
第239回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.16	500,000	580,125	2035/2/28
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	200,000	232,940	2035/5/31
第250回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.278	500,000	590,500	2035/6/29
第252回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.24	100,000	117,516	2035/7/31
第262回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.109	600,000	694,794	2035/11/30

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
特殊債券(除く金融債)	%	千円	千円	
第36回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.113	100,000	115,842	2035/12/28
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	500,000	525,895	2036/3/31
第27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	507,080	2036/5/30
第28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	499,925	2036/7/31
第29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	520,585	2036/10/31
第30回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.618	500,000	539,090	2037/1/30
第304回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.737	500,000	549,350	2037/2/27
第32回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.56	500,000	533,455	2037/8/31
第21回政府保証民間都市開発債券	0.618	300,000	323,541	2038/12/27
第54回政府保証関西国際空港債券	2.4	500,000	607,795	2028/6/23
小 計		23,700,000	27,920,611	
金融債券				
い第797号商工債	0.03	200,000	200,104	2021/10/27
い第802号商工債	0.06	200,000	200,278	2022/3/25
い第820号商工債	0.18	600,000	603,600	2023/9/27
い第830号商工債	0.11	100,000	100,389	2024/7/26
い第820号農林債	0.09	460,000	461,104	2023/9/27
い第822号農林債	0.09	100,000	100,253	2023/11/27
第611回あおぞら債(5年)	0.26	100,000	100,052	2020/1/27
第337回信金中金債(5年)	0.11	600,000	602,142	2022/12/27
第342回信金中金債(5年)	0.11	600,000	602,418	2023/5/26
第343回信金中金債(5年)	0.11	600,000	602,478	2023/6/27
第356回信金中金債(5年)	0.02	600,000	600,594	2024/7/26
第357回信金中金債(5年)	0.02	700,000	700,693	2024/8/27
第209号商工債(3年)	0.04	300,000	300,090	2020/6/26
第210号商工債(3年)	0.06	200,000	200,100	2020/7/27
第216号商工債(3年)	0.12	100,000	100,155	2021/1/27
第231号商工債(3年)	0.08	500,000	501,000	2022/4/27
小 計		5,960,000	5,975,450	
普通社債券(含む投資法人債券)				
第501回中部電力株式会社社債	0.803	200,000	207,202	2024/9/25
第503回中部電力株式会社社債	0.584	200,000	205,460	2025/3/25
第508回中部電力株式会社社債	0.18	200,000	201,108	2023/4/25
第511回中部電力株式会社社債	0.21	100,000	100,650	2026/7/24
第513回中部電力株式会社社債	0.14	300,000	301,230	2023/8/25
第518回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,584	2023/1/25
第520回中部電力株式会社社債	0.19	100,000	100,593	2023/3/24
第522回中部電力株式会社社債	0.13	200,000	200,632	2022/4/25
第530回中部電力株式会社社債	0.274	600,000	603,954	2029/6/25
第511回関西電力株式会社社債	0.41	600,000	606,612	2027/9/17
第512回関西電力株式会社社債	0.32	400,000	403,536	2024/10/25
第515回関西電力株式会社社債	0.435	600,000	607,344	2028/4/25
第518回関西電力株式会社社債	0.44	300,000	303,864	2028/6/20
第527回関西電力株式会社社債	0.28	500,000	503,655	2024/4/25
第378回中国電力株式会社社債	1.004	300,000	311,478	2023/10/25
第381回中国電力株式会社社債	0.953	100,000	104,010	2024/4/25
第383回中国電力株式会社社債	0.764	400,000	413,540	2024/10/25
第398回中国電力株式会社社債	0.425	400,000	407,572	2027/7/23
第402回中国電力株式会社社債	0.25	100,000	100,785	2024/10/25
第404回中国電力株式会社社債	0.355	100,000	101,402	2028/4/25
第311回北陸電力株式会社社債	0.847	200,000	210,530	2027/9/24
第314回北陸電力株式会社社債	0.36	100,000	101,365	2026/2/25
第318回北陸電力株式会社社債	0.26	450,000	453,411	2026/12/25
第321回北陸電力株式会社社債	0.365	300,000	304,488	2027/4/23
第322回北陸電力株式会社社債	0.38	500,000	507,835	2027/6/25

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第475回東北電力株式会社社債	0.809	500,000	517,250	2024/9/25
第476回東北電力株式会社社債	0.57	100,000	102,304	2025/1/24
第491回東北電力株式会社社債	0.42	600,000	609,054	2027/2/25
第492回東北電力株式会社社債	0.405	400,000	406,876	2027/4/23
第496回東北電力株式会社社債	0.355	300,000	302,853	2027/9/24
第267回四国電力株式会社社債	1.89	700,000	700,028	2019/9/25
第281回四国電力株式会社社債	1.111	500,000	521,290	2023/9/25
第289回四国電力株式会社社債	0.26	100,000	100,956	2026/11/25
第296回四国電力株式会社社債	0.385	200,000	203,644	2027/11/25
第307回四国電力株式会社社債	0.23	300,000	300,798	2029/9/25
第429回九州電力株式会社社債	0.909	300,000	311,688	2024/9/25
第437回九州電力株式会社社債	0.685	600,000	618,684	2026/1/23
第465回九州電力株式会社社債	0.38	500,000	504,560	2028/7/25
第290回北海道電力株式会社社債	2.09	300,000	309,723	2021/4/23
第298回北海道電力株式会社社債	1.82	500,000	509,075	2020/9/25
第320回北海道電力株式会社社債	0.585	300,000	303,603	2021/12/24
第326回北海道電力株式会社社債	0.789	400,000	414,188	2025/12/25
第342回北海道電力株式会社社債	0.455	200,000	202,656	2027/6/25
第346回北海道電力株式会社社債	0.31	400,000	403,764	2024/12/25
第355回北海道電力株式会社社債	0.14	100,000	100,202	2021/12/24
第7回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.46	200,000	201,260	2022/10/24
第8回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.81	500,000	506,215	2027/10/22
第10回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.45	100,000	100,518	2023/1/25
第12回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.44	500,000	502,075	2023/4/19
第6回新関西国際空港株式会社社債	1.445	300,000	337,500	2028/9/15
第9回新関西国際空港株式会社社債	1.231	300,000	332,730	2028/12/20
第12回新関西国際空港株式会社社債	1.067	400,000	439,608	2029/9/20
第14回新関西国際空港株式会社社債	1.318	600,000	709,182	2034/12/20
第16回新関西国際空港株式会社社債	1.249	300,000	352,599	2035/9/20
第18回新関西国際空港株式会社社債	0.675	500,000	533,880	2037/12/18
第23回新関西国際空港株式会社社債	0.512	700,000	729,652	2038/12/20
第2回独立行政法人大学改革支援・学位授与機構債券	0.06	400,000	400,972	2023/3/20
第3回独立行政法人大学改革支援・学位授与機構債券	0.03	400,000	400,716	2024/3/19
第31回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.781	100,000	102,364	2022/9/20
第47回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	1.027	600,000	658,662	2029/9/20
第79回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.842	700,000	760,291	2030/9/20
第79回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.996	700,000	729,813	2032/6/18
第95回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.04	100,000	100,199	2023/9/20
第97回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.536	700,000	737,261	2038/7/12
第101回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.309	700,000	716,975	2028/10/12
第113回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	0.253	400,000	398,672	2039/7/11
第34回日本政策投資銀行債券	2.67	200,000	284,824	2037/3/19
第42回日本政策投資銀行債券	2.25	400,000	472,508	2027/12/10
第2回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.7	100,000	104,465	2035/9/20
第4回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.59	200,000	278,222	2035/12/20
第23回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	100,000	118,443	2027/7/20
第27回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.34	200,000	237,086	2027/10/20
第34回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.39	200,000	239,686	2028/3/17
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.42	500,000	603,290	2028/6/20
第39回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.37	200,000	241,804	2028/9/20
第89回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.19	100,000	124,156	2031/3/20
第83回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.9	500,000	612,840	2032/3/19
第95回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.773	500,000	609,580	2032/9/17
第124回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.55	500,000	605,630	2034/3/17
第150回日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.133	100,000	115,494	2035/3/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
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191回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.661	200,000	216,058	2037/12/18	第130回一般担保住宅金融支援機構債券	1.763	200,000	244,256	2032/12/20
第194回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.64	500,000	535,480	2037/12/18	第139回一般担保住宅金融支援機構債券	1.384	200,000	223,710	2028/7/20
第9回道路債券	2.9	100,000	135,820	2032/5/20	第141回一般担保住宅金融支援機構債券	1.325	100,000	111,548	2028/9/20
第21回道路債券	2.75	100,000	136,180	2033/6/20	第159回一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	300,000	346,323	2035/5/18
第28回道路債券	2.83	500,000	695,485	2033/12/20	第166回一般担保住宅金融支援機構債券	1.221	100,000	117,997	2035/8/20
第33回道路債券	2.91	100,000	141,192	2034/6/20	第211回一般担保住宅金融支援機構債券	0.406	500,000	521,925	2032/6/18
第43回道路債券	2.66	200,000	276,832	2034/12/20	第223回一般担保住宅金融支援機構債券	0.403	200,000	208,620	2032/11/19
第15回水資源債券	0.001	200,000	200,028	2020/12/18	第239回一般担保住宅金融支援機構債券	0.393	300,000	312,159	2033/6/20
第10回株式会社日本政策金融公庫社債	2.167	570,000	695,838	2030/3/19	第257回一般担保住宅金融支援機構債券	0.362	300,000	312,309	2034/2/20
第15回株式会社日本政策金融公庫社債	1.911	600,000	722,850	2030/10/29	第9回農林漁業金融公庫債券	2.66	300,000	353,481	2026/6/19
第18回株式会社日本政策金融公庫社債	2.157	100,000	124,060	2031/5/9	第12回農林漁業金融公庫債券	2.24	600,000	698,646	2027/3/19
第23回国際協力銀行債券	2.09	500,000	566,005	2025/12/19	第18回成田国際空港株式会社社債	0.556	100,000	103,143	2025/10/30
第85回都市再生債券	1.167	300,000	330,981	2028/11/20	第20回成田国際空港株式会社社債	0.105	300,000	301,674	2026/8/21
第89回都市再生債券	1.102	300,000	329,859	2029/2/20	第21回成田国際空港株式会社社債	0.427	500,000	515,615	2036/8/22
第93回都市再生債券	1.102	100,000	110,342	2029/6/20	第23回成田国際空港株式会社社債	0.677	700,000	751,205	2036/12/16
第97回都市再生債券	1.017	600,000	658,068	2029/9/20	第25回成田国際空港株式会社社債	0.671	300,000	320,121	2037/12/18
第101回都市再生債券	0.935	300,000	326,385	2029/11/20	第27回成田国際空港株式会社社債	0.657	600,000	638,592	2038/3/12
第109回都市再生債券	0.918	500,000	546,415	2030/6/20	第30回成田国際空港株式会社社債	0.77	700,000	759,346	2038/10/22
第113回都市再生債券	0.851	400,000	434,844	2030/9/20	第35回成田国際空港株式会社社債	0.27	300,000	99,063	2039/9/16
第117回都市再生債券	0.804	400,000	433,032	2030/11/20	第6回沖繩振興開発金融公庫債券	2.04	100,000	111,608	2025/6/20
第121回都市再生債券	0.482	300,000	314,034	2031/2/20	第23回沖繩振興開発金融公庫債券	0.08	600,000	602,862	2026/6/19
第128回都市再生債券	0.39	500,000	516,880	2036/9/19	第25回沖繩振興開発金融公庫債券	0.22	600,000	609,018	2027/6/18
第131回都市再生債券	0.487	500,000	524,250	2036/11/25	第26回沖繩振興開発金融公庫債券	0.23	200,000	203,412	2028/6/20
第141回都市再生債券	0.63	100,000	107,255	2038/2/19	第27回沖繩振興開発金融公庫債券	0.03	500,000	500,865	2032/12/20
第145回都市再生債券	0.584	300,000	318,780	2038/6/18	第28回沖繩振興開発金融公庫債券	0.064	700,000	701,288	2029/6/20
第150回都市再生債券	0.716	500,000	543,560	2038/11/19	第2回国際協力機構債券	2.341	400,000	488,936	2029/6/20
第156回都市再生債券	0.343	400,000	405,412	2039/6/17	第3回国際協力機構債券	2.134	500,000	604,645	2029/12/20
第157回都市再生債券	0.2	400,000	395,448	2039/9/16	第4回国際協力機構債券	2.079	200,000	243,342	2030/6/20
第6回関西国際空港株式会社社債	2.7	200,000	236,952	2026/9/18	第5回国際協力機構債券	1.918	500,000	601,640	2030/9/13
第17回関西国際空港株式会社社債	2.46	500,000	609,345	2028/12/20	第6回国際協力機構債券	2.098	500,000	613,565	2030/12/13
第11回独立行政法人福祉医療機構債券	2.57	100,000	116,585	2026/3/20	第7回国際協力機構債券	1.991	100,000	122,328	2031/6/13
第43回独立行政法人福祉医療機構債券	0.558	500,000	514,990	2025/6/20	第15回国際協力機構債券	1.724	300,000	363,858	2032/9/17
第46回独立行政法人福祉医療機構債券	0.08	300,000	301,431	2026/6/19	第19回国際協力機構債券	1.725	100,000	122,187	2033/6/20
第48回独立行政法人福祉医療機構債券	0.175	700,000	708,638	2026/12/18	第21回国際協力機構債券	1.734	100,000	122,544	2033/9/20
第54回独立行政法人福祉医療機構債券	0.225	700,000	711,018	2028/6/20	第25回国際協力機構債券	1.52	300,000	362,616	2034/6/20
第56回独立行政法人福祉医療機構債券	0.225	300,000	305,130	2028/12/20	第27回国際協力機構債券	1.451	400,000	480,104	2034/9/20
第58回独立行政法人福祉医療機構債券	0.075	600,000	601,746	2029/6/20	第33回国際協力機構債券	1.13	100,000	115,725	2035/12/20
第4回中部国際空港株式会社社債	0.305	600,000	611,142	2027/2/22	第36回国際協力機構債券	0.313	100,000	101,996	2036/6/20
第6回中部国際空港株式会社社債	0.206	500,000	505,695	2029/2/22	第39回国際協力機構債券	0.744	400,000	436,220	2037/2/20
第39回一般担保住宅金融支援機構債券	2.15	100,000	120,936	2029/9/20	第43回国際協力機構債券	0.625	600,000	643,812	2037/12/18
第49回一般担保住宅金融支援機構債券	2.11	200,000	243,982	2030/6/18	第45回国際協力機構債券	0.559	600,000	634,872	2038/6/18
第52回一般担保住宅金融支援機構債券	2.01	100,000	121,056	2030/7/16	第49回国際協力機構債券	0.333	300,000	303,489	2039/6/20
第59回一般担保住宅金融支援機構債券	1.95	100,000	120,870	2030/10/22	第58回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.81	600,000	741,186	2033/8/19
第69回一般担保住宅金融支援機構債券	2.31	200,000	251,394	2031/4/18	第63回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.56	400,000	485,136	2034/2/27
第75回一般担保住宅金融支援機構債券	2.066	210,000	258,568	2031/6/13	第69回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.441	500,000	598,990	2034/8/4
第81回一般担保住宅金融支援機構債券	1.926	100,000	121,956	2031/9/12	第72回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.905	200,000	217,018	2031/11/27
第94回一般担保住宅金融支援機構債券	1.882	500,000	610,905	2032/2/13	第75回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.157	200,000	231,596	2035/2/26
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	122,571	2032/3/12	第78回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.801	100,000	107,188	2030/5/28
第106回一般担保住宅金融支援機構債券	1.794	100,000	121,985	2032/6/18	第81回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	1.221	200,000	234,976	2035/8/17
第109回一般担保住宅金融支援機構債券	1.787	200,000	244,062	2032/7/16	第84回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.804	400,000	433,088	2030/11/27
第115回一般担保住宅金融支援機構債券	1.811	500,000	611,950	2032/9/14	第96回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.734	500,000	512,090	2031/11/28
第118回一般担保住宅金融支援機構債券	1.814	100,000	122,551	2032/10/15	第99回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.279	500,000	545,820	2037/2/27
第120回一般担保住宅金融支援機構債券	1.836	400,000	491,764	2032/11/12	第102回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.428	500,000	523,210	2032/5/28
第125回一般担保住宅金融支援機構債券	1.898	100,000	124,154	2033/1/25	第113回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.63	200,000	214,522	2038/2/26
第127回一般担保住宅金融支援機構債券	1.923	300,000	373,566	2033/2/18	第115回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.395	100,000	104,063	2033/5/30

銘柄	利率	当 期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第118回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.663	400,000	431,004	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	531,660	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	617,568	2034/5/30
第36回大成建設株式会社無担保社債	0.14	400,000	401,472	2022/7/22
第20回株式会社大林組無担保社債	0.97	200,000	206,896	2023/5/9
第22回株式会社大林組無担保社債	0.385	600,000	608,328	2028/9/13
第23回株式会社大林組無担保社債	0.13	500,000	502,130	2023/10/25
第21回清水建設株式会社無担保社債	0.39	500,000	503,875	2021/12/3
第23回清水建設株式会社無担保社債	0.25	800,000	807,648	2024/8/2
第24回清水建設株式会社無担保社債	0.365	200,000	203,342	2027/11/30
第25回清水建設株式会社無担保社債	0.27	200,000	200,182	2029/9/3
第9回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.44	700,000	700,238	2019/11/5
第10回株式会社長谷工コーポレーション無担保社債	0.412	300,000	300,879	2020/7/22
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	715,043	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	601,386	2029/7/19
第43回鹿島建設株式会社無担保社債	0.09	500,000	500,620	2021/7/22
第44回鹿島建設株式会社無担保社債	0.3	300,000	303,141	2026/7/22
第45回鹿島建設株式会社無担保社債	0.24	600,000	605,310	2024/9/20
第6回西松建設株式会社無担保社債	0.5	400,000	401,340	2020/7/24
第8回西松建設株式会社無担保社債	0.18	800,000	802,696	2024/9/20
第23回前田建設工業株式会社無担保社債	0.28	400,000	402,192	2023/7/28
第24回前田建設工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	300,264	2021/7/28
第26回前田建設工業株式会社無担保社債	0.15	300,000	300,264	2024/9/12
第3回戸田建設株式会社無担保社債	0.27	400,000	401,880	2022/12/14
第4回五洋建設株式会社無担保社債	0.14	300,000	300,354	2020/9/15
第3回住友林業株式会社無担保社債	0.33	600,000	607,590	2026/6/17
第4回住友林業株式会社無担保社債	0.25	400,000	403,328	2025/3/7
第5回住友林業株式会社無担保社債	0.35	400,000	405,564	2028/3/7
第8回住友林業株式会社無担保社債	0.38	500,000	505,935	2029/3/6
第12回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.07	700,000	700,658	2022/6/1
第13回大和ハウス工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	101,073	2027/6/1
第19回積水ハウス株式会社無担保社債	0.04	500,000	500,075	2021/7/20
第21回積水ハウス株式会社無担保社債	0.2	800,000	802,968	2026/7/17
第3回協和エンコシ株式会社無担保社債	0.15	200,000	200,384	2022/2/24
第5回日揮株式会社無担保社債	0.2	400,000	401,536	2022/10/13
第1回高砂熟字工業株式会社無担保社債	0.37	200,000	202,190	2024/4/19
第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債	0.2	600,000	600,240	2029/7/13
第1回三井製糖株式会社無担保社債	0.272	500,000	500,140	2019/12/9
第1回パーソルホールディングス株式会社無担保社債	0.08	700,000	700,399	2021/6/14
第13回森永乳業株式会社無担保社債	0.884	500,000	519,130	2024/5/8
第14回森永乳業株式会社無担保社債	0.774	100,000	104,283	2025/12/10
第15回森永乳業株式会社無担保社債	0.37	700,000	712,810	2027/7/23
第16回森永乳業株式会社無担保社債	0.395	200,000	203,668	2028/9/14
第17回森永乳業株式会社無担保社債	0.24	400,000	399,592	2029/9/6
第7回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	300,000	302,196	2024/9/13
第8回明治ホールディングス株式会社無担保社債	0.12	400,000	401,028	2023/1/30
第1回雪印メグミルク株式会社無担保社債	0.45	800,000	815,080	2028/12/25
第11回日本ハム株式会社無担保社債	0.25	700,000	705,992	2026/2/20
第12回日本ハム株式会社無担保社債	0.36	600,000	607,944	2029/2/20
第28回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.614	400,000	402,848	2020/12/4
第30回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.331	300,000	300,915	2020/9/10
第32回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.15	300,000	300,924	2022/6/1
第33回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.2	600,000	600,624	2026/9/4
第34回サッポロホールディングス株式会社無担保社債	0.3	500,000	499,975	2029/9/5
第7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	0.237	300,000	300,408	2020/5/28

銘柄	利率	当 期 末		
		額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第1回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.17	800,000	802,936	2022/6/13
第12回アサヒグループホールディングス株式会社無担保社債	0.33	700,000	709,940	2027/6/11
第7回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.639	600,000	601,014	2019/11/5
第9回キリンホールディングス株式会社無担保社債	1.239	600,000	614,484	2021/9/24
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	513,675	2025/2/28
第11回キリンホールディングス株式会社無担保社債	0.12	300,000	300,939	2023/12/6
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	800,728	2029/9/5
第14回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.1	500,000	500,965	2022/4/25
第15回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	400,000	402,764	2024/4/25
第16回宝ホールディングス株式会社無担保社債	0.315	200,000	202,716	2027/4/23
第6回サントリーホールディングス株式会社無担保社債	0.22	700,000	704,634	2026/6/2
第2回コカ・コーラウエスト株式会社無担保社債	1.483	100,000	100,320	2019/12/17
第3回コカ・コーラウエスト株式会社無担保社債	0.524	500,000	506,805	2022/6/17
第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	0.1	800,000	802,304	2024/9/19
第2回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	0.2	800,000	803,608	2026/9/19
第3回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債	0.27	600,000	601,428	2029/9/19
第2回コカ・コーラ イーストジャパン株式会社無担保社債	0.276	700,000	702,296	2020/12/14
第2回株式会社伊藤園無担保社債	0.22	600,000	604,248	2024/2/23
第10回日清オイログループ株式会社無担保社債	0.769	300,000	310,485	2024/9/10
第11回日清オイログループ株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,949	2024/12/4
第12回日清オイログループ株式会社無担保社債	0.365	300,000	306,006	2022/12/3
第5回不二製油グループ本社株式会社無担保社債	0.456	200,000	202,838	2022/12/9
第2回株式会社J-オーリズム無担保社債	0.37	600,000	610,296	2027/5/28
第33回双日株式会社無担保社債	0.519	400,000	405,824	2024/3/8
第35回双日株式会社無担保社債	0.605	300,000	305,334	2028/3/8
第7回キューコマーン株式会社無担保社債	1.312	400,000	411,348	2021/12/15
第24回味の素株式会社無担保社債	0.19	500,000	503,780	2024/3/8
第25回味の素株式会社無担保社債	0.355	700,000	714,028	2027/3/9
第3回キュービー株式会社無担保社債	0.23	700,000	704,634	2026/2/13
第21回株式会社ニチレイ無担保社債	0.659	100,000	100,611	2020/9/4
第22回株式会社ニチレイ無担保社債	0.36	600,000	604,032	2021/10/22
第23回株式会社ニチレイ無担保社債	0.19	600,000	603,528	2023/10/25
第24回株式会社ニチレイ無担保社債	0.25	700,000	705,523	2025/8/29
第9回日本たばこ産業株式会社社債	0.217	400,000	400,668	2020/7/15
第12回日本たばこ産業株式会社社債	0.599	100,000	102,944	2025/7/15
第11回日本たばこ産業株式会社社債	0.11	700,000	702,072	2023/9/8
第13回日本たばこ産業株式会社社債	0.355	700,000	711,431	2028/9/8
第5回ヒューリック株式会社無担保社債	0.949	300,000	311,418	2024/4/24
第8回ヒューリック株式会社無担保社債	0.43	700,000	704,193	2026/6/25
第9回ヒューリック株式会社無担保社債	0.4	500,000	502,320	2029/6/25
第4回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.468	300,000	303,762	2022/8/5
第5回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.16	500,000	501,860	2022/8/4
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	715,015	2027/8/4
第8回J.フロント リテイリング株式会社無担保社債	0.37	400,000	403,916	2029/5/22
第5回株式会社ニ越伊勢丹ホールディングス無担保社債	0.17	300,000	300,972	2022/8/31
第38回東洋紡績株式会社無担保社債	0.16	500,000	501,265	2019/9/14
第4回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.21	300,000	302,718	2024/12/20
第5回トヨタ紡織株式会社無担保社債	0.33	300,000	305,499	2027/9/17
第5回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.924	300,000	312,525	2025/5/30
第8回野村不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.19	300,000	300,570	2021/6/2
第14回森ビル株式会社無担保社債	0.861	300,000	310,761	2024/8/14
第17回森ビル株式会社無担保社債	0.523	100,000	100,878	2021/8/13
第20回森ビル株式会社無担保社債	0.12	500,000	500,560	2021/10/25
第21回森ビル株式会社無担保社債	0.44	600,000	610,752	2027/2/16
第5回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.19	500,000	501,305	2021/6/10

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第8回東急不動産ホールディングス株式会社無担保社債	0.18	300,000	300,894	2021/12/16
第18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	506,405	2027/7/30
第6回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	1.399	100,000	101,005	2020/6/19
第10回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.514	300,000	304,014	2022/6/20
第12回株式会社セブン&アイ・ホールディングス無担保社債	0.781	400,000	415,388	2025/6/20
第28回東レ株式会社無担保社債	0.925	200,000	205,242	2022/7/20
第29回東レ株式会社無担保社債	1.012	100,000	103,848	2023/7/14
第30回東レ株式会社無担保社債	0.375	700,000	711,893	2027/7/16
第31回東レ株式会社無担保社債	0.25	200,000	201,878	2024/7/19
第33回東レ株式会社無担保社債	0.38	400,000	406,436	2028/7/18
第7回株式会社クラレ無担保社債	0.19	500,000	502,880	2025/4/25
第8回株式会社クラレ無担保社債	0.305	600,000	608,004	2028/4/25
第10回旭化成株式会社無担保社債	0.1	400,000	401,272	2023/12/6
第11回旭化成株式会社無担保社債	0.07	500,000	500,865	2024/9/6
第12回旭化成株式会社無担保社債	0.21	500,000	498,915	2029/9/6
第33回王子製紙株式会社無担保社債	0.28	700,000	707,189	2025/1/24
第34回王子製紙株式会社無担保社債	0.425	200,000	204,648	2028/1/26
第35回王子製紙株式会社無担保社債	0.45	300,000	306,711	2028/11/29
第13回日本製紙株式会社無担保社債	0.962	300,000	312,405	2025/6/19
第25回北越製紙株式会社無担保社債	0.17	600,000	601,482	2021/6/17
第26回北越製紙株式会社無担保社債	0.18	500,000	501,610	2021/12/20
第27回北越コーポレーション株式会社無担保社債	0.22	600,000	603,762	2024/3/13
第20回レンゴウ株式会社無担保社債	0.498	400,000	405,504	2022/9/2
第21回レンゴウ株式会社無担保社債	0.28	600,000	605,658	2023/12/8
第22回レンゴウ株式会社無担保社債	0.39	700,000	712,257	2026/12/8
第25回レンゴウ株式会社無担保社債	0.415	200,000	203,126	2028/12/13
第26回昭和電工株式会社無担保社債	0.63	200,000	201,938	2021/6/4
第27回昭和電工株式会社無担保社債	0.734	200,000	203,584	2022/6/23
第30回昭和電工株式会社無担保社債	0.19	700,000	702,275	2024/4/23
第49回住友化学株式会社無担保社債	0.944	100,000	104,022	2024/4/25
第54回住友化学株式会社無担保社債	0.2	500,000	503,020	2023/9/1
第56回住友化学株式会社無担保社債	0.38	700,000	711,088	2027/9/13
第57回住友化学株式会社無担保社債	0.24	200,000	201,464	2024/9/13
第59回住友化学株式会社無担保社債	0.355	100,000	101,240	2028/4/17
第61回住友化学株式会社無担保社債	0.4	400,000	405,368	2029/4/16
第5回株式会社クレハ無担保社債	0.302	600,000	600,756	2020/3/6
第6回株式会社クレハ無担保社債	0.14	600,000	601,770	2022/9/1
第8回セントラル硝子株式会社無担保社債	0.39	600,000	607,668	2024/2/23
第19回デンカ株式会社無担保社債	0.312	600,000	600,744	2020/3/4
第21回デンカ株式会社無担保社債	0.28	600,000	604,770	2025/4/23
第10回イビデン株式会社無担保社債	0.11	600,000	600,528	2024/9/12
第2回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.271	400,000	400,892	2020/9/3
第3回エア・ウォーター株式会社無担保社債	0.355	400,000	406,056	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	610,680	2028/8/31
第13回大陽日酸株式会社無担保社債	0.14	700,000	701,463	2021/12/15
第14回大陽日酸株式会社無担保社債	0.39	400,000	406,440	2026/12/15
第7回株式会社カネカ無担保社債	0.11	200,000	200,276	2024/9/12
第8回株式会社カネカ無担保社債	0.24	200,000	199,892	2029/9/12
第21回三菱瓦斯化学株式会社無担保社債	0.572	600,000	604,062	2021/3/5
第42回三井化学株式会社無担保社債	1.354	100,000	102,433	2021/7/28
第45回三井化学株式会社無担保社債	0.26	300,000	302,559	2024/7/24
第46回三井化学株式会社無担保社債	0.37	100,000	101,516	2027/7/23
第16回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.433	200,000	202,140	2022/6/3
第19回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.476	300,000	304,227	2022/12/2
第10回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.12	500,000	500,795	2021/6/9

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2回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.32	600,000	607,974	2026/6/9
第20回株式会社三菱ケミカルホールディングス無担保社債	0.42	600,000	611,874	2028/12/19
第11回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.14	500,000	501,645	2022/9/15
第12回ダイセル化学工業株式会社無担保社債	0.23	600,000	604,692	2024/9/13
第6回積水化学工業株式会社無担保社債	0.28	700,000	709,814	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	499,730	2029/9/13
第7回日本ゼオン株式会社無担保社債	0.559	200,000	202,678	2022/6/22
第13回宇部興産株式会社無担保社債	0.15	500,000	501,530	2022/5/25
第10回日立化成工業株式会社無担保社債	0.375	500,000	508,355	2022/12/3
第3回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.25	600,000	606,030	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	609,930	2028/3/23
第6回株式会社野村総合研究所無担保社債	0.24	400,000	400,564	2029/9/27
第2回株式会社電通無担保社債	0.24	700,000	706,531	2025/10/24
第3回株式会社電通無担保社債	0.424	700,000	715,778	2028/10/25
第1回株式会社ADEKA無担保社債	0.18	300,000	301,215	2024/3/15
第1回株式会社ツムラ無担保社債	0.23	500,000	503,185	2024/5/31
第2回株式会社ツムラ無担保社債	0.345	600,000	608,712	2027/6/2
第6回テルモ株式会社無担保社債	0.17	200,000	200,944	2023/4/19
第7回テルモ株式会社無担保社債	0.24	200,000	201,558	2026/4/17
第9回テルモ株式会社無担保社債	0.255	1,000,000	1,008,330	2027/4/26
第4回第一三共株式会社無担保社債	0.846	600,000	619,284	2023/9/15
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	303,357	2026/3/6
第3回大塚ホールディングス株式会社無担保社債	0.375	1,000,000	1,017,040	2029/3/7
第37回D I C株式会社無担保社債	1.0	100,000	104,971	2025/9/18
第41回D I C株式会社無担保社債	0.15	600,000	602,016	2022/7/12
第11回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.232	400,000	400,396	2020/3/19
第12回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.373	800,000	806,888	2022/3/18
第14回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.23	500,000	503,915	2026/1/23
第15回株式会社オリエンタルランド無担保社債	0.305	700,000	707,931	2029/1/25
第5回株式会社フジ・メディア・ホールディングス無担保社債	0.108	500,000	500,900	2021/12/6
第3回ヤフー株式会社無担保社債	0.37	300,000	301,851	2024/2/28
第5回ヤフー株式会社無担保社債	0.2	500,000	501,860	2022/12/7
第11回ヤフー株式会社無担保社債	0.18	800,000	797,600	2024/7/31
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	804,392	2023/10/31
第4回楽天株式会社無担保社債	0.13	500,000	500,900	2021/6/25
第7回楽天株式会社無担保社債	0.22	500,000	502,470	2022/6/24
第3回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.882	700,000	718,914	2022/12/2
第4回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.05	100,000	99,988	2020/3/3
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	0.265	300,000	302,559	2027/3/3
第10回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.24	200,000	201,964	2025/12/5
第3回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.08	500,000	500,420	2024/7/26
第6回エコマイルホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	708,127	2024/12/13
第4回出光興産株式会社無担保社債	0.541	400,000	403,900	2021/8/4
第5回出光興産株式会社無担保社債	0.2	200,000	201,128	2022/12/5
第6回出光興産株式会社無担保社債	0.27	700,000	705,992	2025/9/19
第6回J Xホールディングス株式会社無担保社債	1.119	300,000	312,195	2023/7/19
第9回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.82	100,000	103,540	2024/6/4
第13回J Xホールディングス株式会社無担保社債	0.3	600,000	605,478	2026/7/28
第2回J X T Gホールディングス株式会社無担保社債	0.405	700,000	711,725	2027/8/3
第13回横浜ゴム株式会社無担保社債	0.25	100,000	100,860	2023/12/8
第9回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.08	500,000	500,705	2022/4/21
第10回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.2	500,000	503,675	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	810,872	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	201,822	2026/4/17
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	1,000,000	1,016,780	2029/4/19

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第22回住友ゴム工業株式会社無担保社債	1.378	100,000	102,339	2021/6/28
第24回住友ゴム工業株式会社無担保社債	0.755	100,000	103,228	2024/6/25
第25回住友ゴム工業株式会社無担保社債	0.335	400,000	405,848	2027/6/18
第2回バンドー化学株式会社無担保社債	0.24	400,000	401,664	2022/1/20
第3回バンドー化学株式会社無担保社債	0.4	200,000	202,278	2024/1/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	600,000	609,822	2027/5/28
第1回A G C株式会社無担保社債	0.23	700,000	707,203	2025/10/10
第14回住友大阪セメント株式会社無担保社債	0.332	400,000	400,528	2020/3/3
第15回住友大阪セメント株式会社無担保社債	0.24	600,000	604,320	2023/8/30
第25回太平洋セメント株式会社無担保社債	0.63	200,000	202,226	2021/9/10
第7回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.296	700,000	702,121	2020/10/27
第11回日本特殊陶業株式会社無担保社債	0.27	500,000	500,910	2029/6/20
第1回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.28	400,000	402,624	2026/9/18
第3回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.22	500,000	503,400	2024/5/20
第4回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.375	100,000	101,213	2027/5/20
第5回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.23	400,000	402,780	2024/12/20
第70回新日鐵住金株式会社無担保社債	0.951	100,000	102,519	2022/6/20
第1回日本製鉄株式会社無担保社債	0.14	600,000	601,614	2024/6/20
第3回日本製鉄株式会社無担保社債	0.279	700,000	699,216	2029/6/20
第2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	617,886	2024/9/19
第3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	502,910	2025/5/21
第8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	502,630	2026/5/27
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	604,458	2029/5/25
第12回大同特殊鋼株式会社無担保社債	0.15	500,000	501,095	2022/3/7
第3回愛知製鋼株式会社無担保社債	0.18	600,000	602,058	2021/12/16
第33回日立金属株式会社無担保社債	0.385	700,000	709,023	2028/12/6
第33回三菱マテリアル株式会社無担保社債	0.38	600,000	606,138	2027/8/30
第29回住友金属鉱山株式会社無担保社債	1.257	400,000	409,396	2021/8/31
第30回住友金属鉱山株式会社無担保社債	0.02	400,000	399,828	2021/9/17
第5回DOWAホールディングス株式会社無担保社債	0.11	500,000	501,440	2024/9/18
第4回DOWAホールディングス株式会社無担保社債	0.14	500,000	501,860	2023/9/14
第26回住友電気工業株式会社無担保社債	0.3	700,000	709,065	2027/3/1
第10回三和ホールディングス株式会社無担保社債	0.494	700,000	707,679	2022/2/25
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	608,808	2026/12/16
第9回L I X I Lグループ無担保社債	0.08	500,000	499,885	2021/8/31
第1回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	0.09	700,000	701,197	2022/3/9
第2回株式会社リクルートホールディングス無担保社債	0.22	600,000	604,284	2024/3/8
第19回株式会社豊田自動織機無担保社債	1.109	200,000	204,354	2021/9/17
第29回株式会社豊田自動織機無担保社債	0.08	500,000	499,200	2026/6/19
第2回ナブテスコ株式会社無担保社債	0.14	600,000	600,984	2021/12/13
第4回住友機械工業株式会社無担保社債	0.17	700,000	702,597	2023/3/15
第5回住友機械工業株式会社無担保社債	0.13	400,000	401,104	2024/7/24
第17回日立建機株式会社無担保社債	0.16	500,000	501,870	2022/12/13
第9回株式会社荏原製作所無担保社債	0.18	100,000	100,450	2022/10/24
第19回ダイキン工業株式会社無担保社債	1.204	200,000	207,588	2022/12/12
第22回ダイキン工業株式会社無担保社債	0.21	100,000	100,663	2026/9/30
第6回ブラザー工業株式会社無担保社債	0.285	100,000	100,325	2020/11/26
第1回グローリー株式会社無担保社債	0.15	500,000	500,725	2023/12/6
第43回日本精工株式会社無担保社債	0.769	100,000	103,495	2024/9/10
第44回日本精工株式会社無担保社債	0.12	300,000	300,738	2022/3/14
第47回日本精工株式会社無担保社債	0.38	300,000	304,404	2027/12/7
第49回日本精工株式会社無担保社債	0.29	700,000	708,134	2025/11/28
第51回日本精工株式会社無担保社債	0.19	300,000	300,516	2026/9/2
第13回N T N株式会社無担保社債	0.405	100,000	101,452	2025/3/7
第7回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.345	400,000	406,416	2028/3/8

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5回株式会社ジェイテクト無担保社債	0.28	600,000	605,658	2023/12/8
第12回T H K株式会社無担保社債	0.27	500,000	504,635	2025/2/7
第14回T H K株式会社無担保社債	0.29	700,000	706,384	2026/2/6
第16回株式会社日立製作所無担保社債	0.813	600,000	620,202	2023/12/13
第28回富士電機株式会社無担保社債	0.381	400,000	401,352	2020/9/4
第29回富士電機株式会社無担保社債	0.28	500,000	504,190	2028/8/31
第30回富士電機株式会社無担保社債	0.395	100,000	101,824	2027/5/21
第3回日本電産株式会社無担保社債	0.956	600,000	616,512	2022/9/20
第6回日本電産株式会社無担保社債	0.001	600,000	599,814	2020/5/26
第8回日本電産株式会社無担保社債	0.1	800,000	801,432	2024/7/19
第47回日本電気株式会社無担保社債	0.412	600,000	601,908	2020/7/17
第49回日本電気株式会社無担保社債	0.11	700,000	700,427	2020/6/15
第14回日本電気株式会社無担保社債	0.29	300,000	302,400	2022/6/15
第53回日本電気株式会社無担保社債	0.26	300,000	302,208	2023/9/21
第13回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.1	500,000	500,580	2021/9/21
第15回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.34	300,000	303,417	2026/9/18
第16回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.26	400,000	403,108	2024/9/6
第17回セイコーエプソン株式会社無担保社債	0.36	700,000	709,408	2027/9/6
第13回パナソニック株式会社無担保社債	0.568	600,000	607,614	2022/3/18
第14回パナソニック株式会社無担保社債	0.934	700,000	730,772	2025/3/19
第15回パナソニック株式会社無担保社債	0.19	500,000	501,465	2021/9/17
第17回パナソニック株式会社無担保社債	0.47	400,000	408,424	2026/9/18
第31回ソニー株式会社無担保社債	0.23	500,000	502,180	2021/9/17
第32回ソニー株式会社無担保社債	0.28	100,000	100,935	2023/9/20
第33回ソニー株式会社無担保社債	0.42	300,000	305,934	2026/9/18
第4回株式会社堀場製作所無担保社債	0.609	700,000	704,466	2020/10/30
第15回株式会社デンソー無担保社債	0.245	900,000	911,052	2027/6/18
第5回スタンレー電気株式会社無担保社債	0.15	400,000	401,480	2024/4/19
第1回株式会社村田製作所無担保社債	0.08	700,000	701,295	2022/1/24
第2回株式会社村田製作所無担保社債	0.15	700,000	703,801	2024/1/24
第3回株式会社村田製作所無担保社債	0.06	800,000	801,496	2024/9/10
第1回東海理化電機製作所無担保社債	0.34	300,000	303,789	2027/6/7
第26回三菱重工株式会社無担保社債	0.877	100,000	103,234	2023/9/4
第29回三菱重工株式会社無担保社債	0.662	200,000	205,780	2024/9/3
第31回三菱重工株式会社無担保社債	0.63	100,000	103,073	2025/9/2
第40回川崎重工株式会社無担保社債	0.988	200,000	207,600	2023/12/15
第42回川崎重工株式会社無担保社債	0.791	100,000	103,345	2024/7/18
第45回川崎重工株式会社無担保社債	0.1	300,000	300,423	2021/7/15
第47回川崎重工株式会社無担保社債	0.15	500,000	501,410	2022/7/20
第51回川崎重工株式会社無担保社債	0.15	300,000	300,819	2024/7/12
第38回石川島播磨重工業株式会社無担保社債	1.11	400,000	402,896	2020/6/12
第40回株式会社I H I無担保社債	0.592	300,000	302,406	2021/6/17
第6回J A三井リース株式会社無担保社債	0.2	300,000	301,119	2022/1/27
第7回J A三井リース株式会社無担保社債	0.2	100,000	100,447	2022/9/15
第8回J A三井リース株式会社無担保社債	0.31	200,000	201,656	2024/9/13
第5回コンコルディア・フィナンシャルグループ(英)	0.37	500,000	499,385	2029/9/4
第1回B号明治安田生命2016基金特定目的会社特定社債	0.28	400,000	400,472	2021/8/9
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債	0.304	300,000	300,594	2021/8/2
第1回明治安田生命2017基金特定目的会社特定社債	0.35	600,000	601,794	2022/8/4
第4回三井住友トラスト・パナソニックファイナンス無担保社債	0.23	700,000	703,542	2023/10/25
第14回トヨタ自動車株式会社無担保社債	0.963	100,000	103,337	2023/3/20
第16回アイシン精機株式会社無担保社債	0.16	600,000	602,304	2026/9/25
第28回マツダ株式会社無担保社債	0.3	600,000	601,950	2024/12/6
第4回豊田合成株式会社無担保社債	0.24	400,000	403,120	2025/3/13
第1回明治安田生命2018基金特定目的会社特定社債	0.315	600,000	601,044	2023/9/25

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第1回日本生命2019基金流動化株式会社無担保社債(劣後)	0.25	800,000	800,480	2024/8/1
第1回明治安田生命2019基金特定目的会社特定社債	0.29	800,000	800,480	2024/8/2
第4回大日本印刷株式会社無担保社債	0.28	800,000	804,160	2029/7/19
第1回株式会社アシックス無担保社債	0.14	500,000	501,145	2021/12/7
第2回株式会社アシックス無担保社債	0.2	600,000	603,492	2024/3/13
第3回株式会社ニフコ無担保社債	0.7	700,000	700,329	2019/10/23
第4回株式会社ニフコ無担保社債	0.25	500,000	503,735	2025/5/8
第5回株式会社ニフコ無担保社債	0.385	500,000	507,730	2028/5/8
第6回株式会社ニフコ無担保社債	0.28	700,000	698,950	2029/9/11
第52回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.65	100,000	100,329	2019/12/10
第59回伊藤忠商事株式会社無担保社債	1.378	200,000	204,556	2021/6/4
第67回伊藤忠商事株式会社無担保社債	0.964	100,000	102,763	2022/9/9
第87回丸紅株式会社無担保社債	1.29	200,000	205,134	2021/10/15
第102回丸紅株式会社無担保社債	0.756	300,000	309,720	2024/7/25
第5回長瀬産業株式会社無担保社債	0.539	200,000	202,470	2022/6/16
第16回豊田通商株式会社無担保社債	1.35	300,000	308,688	2021/12/8
第17回豊田通商株式会社無担保社債	0.81	100,000	103,247	2023/12/5
第18回豊田通商株式会社無担保社債	1.014	200,000	211,246	2025/12/5
第19回豊田通商株式会社無担保社債	0.954	100,000	105,545	2026/7/10
第1回ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.14	200,000	200,576	2022/2/22
第2回ユニ・ファミリーマートホールディングス	0.24	800,000	806,008	2024/2/22
第63回三井物産株式会社無担保社債	2.37	200,000	234,028	2027/4/23
第73回三井物産株式会社無担保社債	0.29	800,000	804,944	2029/7/11
第39回住友商事株式会社無担保社債	1.708	100,000	104,147	2022/3/16
第46回住友商事株式会社無担保社債	0.884	100,000	102,732	2022/12/12
第76回三菱商事株式会社無担保社債	1.303	100,000	102,139	2021/5/24
第78回三菱商事株式会社無担保社債	1.155	100,000	102,809	2022/3/9
第79回三菱商事株式会社無担保社債	1.022	100,000	102,670	2022/5/20
第30回阪和興業株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,400	2023/6/13
第2回エネチー・ウォー リテイリング株式会社無担保社債	0.48	700,000	713,790	2028/12/21
第26回株式会社丸井グループ無担保社債	0.562	200,000	201,742	2021/6/4
第30回株式会社丸井グループ無担保社債	0.13	500,000	500,785	2021/8/17
第31回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	500,000	501,795	2022/5/25
第34回株式会社丸井グループ無担保社債	0.19	800,000	803,720	2023/10/25
第48回株式会社クレディセゾン無担保社債	1.038	200,000	207,390	2023/10/20
第50回株式会社クレディセゾン無担保社債	0.904	100,000	103,459	2024/4/24
第21回イオン株式会社無担保社債	0.472	400,000	401,104	2020/7/2
第5回株式会社新生銀行無担保社債	0.21	400,000	400,124	2023/7/13
第6回株式会社新生銀行無担保社債	0.24	700,000	701,169	2023/12/13
第14回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.19	100,000	100,134	2022/9/8
第17回株式会社あおぞら銀行無担保社債	0.1	600,000	599,760	2021/3/9
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	103,009	2024/6/26
第7回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ(劣後)	1.393	200,000	217,502	2030/6/18
第12回株式会社りそなホールディングス無担保社債	0.12	500,000	500,280	2022/1/24
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	502,420	2025/7/23
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	205,058	2024/9/5
第3回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.66	230,000	234,402	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	811,456	2027/6/8
第4回三井住友トラスト・ホールディングス無担保社債(劣後)	0.62	725,000	737,542	2026/12/18
第8回株式会社みずほコーポレート銀行無担保社債	2.54	300,000	357,354	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	234,244	2027/4/20
第20回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.91	600,000	745,680	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	477,156	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	221,748	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	112,531	2026/1/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第30回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.62	1,100,000	1,128,292	2021/6/9
第33回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	100,000	113,638	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	410,804	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	864,416	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	370,000	382,831	2025/10/15
第9回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.469	240,000	241,953	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	131,683	2026/9/15
第14回株式会社三井住友フィナンシャルグループ(劣後)	0.585	610,000	621,150	2028/3/16
第6回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.084	700,000	706,139	2020/3/4
第8回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.878	100,000	102,857	2021/6/1
第9回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.442	300,000	347,151	2026/12/22
第11回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	1.78	200,000	207,794	2022/3/15
第12回株式会社りそな銀行無担保社債(劣後特約付)	2.464	800,000	903,928	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	619,992	2024/8/29
第4回株式会社群馬銀行無担保社債(劣後)	0.48	500,000	505,317	2029/4/26
第8回三菱UFJ信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.92	100,000	110,445	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	701,304	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)	2.18	400,000	351,465	2027/5/10
第11回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.559	100,000	101,208	2020/7/23
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	342,930	2026/6/15
第15回住友信託銀行株式会社無担保社債(劣後特約付)	1.62	100,000	103,659	2022/3/22
第10回株式会社セブン銀行無担保社債	0.803	500,000	512,335	2023/3/20
第11回株式会社セブン銀行無担保社債	0.536	700,000	713,979	2024/12/20
第12回株式会社セブン銀行無担保社債	0.39	500,000	505,740	2027/9/17
第2回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.43	300,000	304,005	2020/9/28
第10回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.61	100,000	101,846	2020/12/17
第2回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	1.6	200,000	205,022	2021/6/1
第25回株式会社三井住友銀行無担保社債(劣後特約付)	2.21	500,000	566,825	2026/6/1
第20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	664,996	2026/12/18
第3回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	2.04	100,000	101,687	2020/8/7
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	114,316	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	237,050	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	585,625	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	249,856	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	453,128	2026/9/11
第20回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	1.49	400,000	414,640	2022/6/3
第14回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.19	100,000	100,334	2022/5/30
第15回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.33	500,000	505,775	2024/12/6
第17回芙蓉総合リース株式会社無担保社債	0.21	500,000	502,135	2023/11/2
第3回NTTファイナンス株式会社無担保社債	0.529	600,000	618,324	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	614,076	2032/9/19
第45回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.087	500,000	498,570	2022/6/20
第51回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債	0.2	600,000	597,366	2023/12/20
第21回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.29	600,000	605,688	2024/10/18
第24回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.32	200,000	202,022	2025/4/11
第25回東京センチュリー株式会社無担保社債	0.2	500,000	502,510	2025/10/13
第44回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.08	500,000	500,605	2022/9/20
第49回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	500,000	502,105	2025/6/19
第52回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.2	700,000	703,080	2025/9/19
第56回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.09	600,000	600,762	2024/6/19
第57回株式会社ホンダファイナンス無担保社債	0.19	500,000	501,665	2026/6/19
第27回リコーリース株式会社無担保社債	0.16	600,000	602,202	2022/7/20
第33回リコーリース株式会社無担保社債	0.19	600,000	603,162	2023/9/7
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	402,904	2024/5/28
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	702,639	2026/9/18

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第8回株式会社ジャックス無担保社債	1.13	300,000	302,376	2020/6/19
第9回株式会社ジャックス無担保社債	0.79	300,000	302,997	2021/1/22
第12回株式会社ジャックス無担保社債	0.545	100,000	101,070	2021/12/3
第13回株式会社ジャックス無担保社債	0.644	200,000	202,724	2022/2/25
第17回株式会社ジャックス無担保社債	0.37	200,000	202,118	2024/6/7
第20回株式会社ジャックス無担保社債	0.36	300,000	302,778	2025/6/13
第2回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.45	100,000	100,104	2020/1/22
第4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	400,000	401,272	2020/7/24
第8回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.29	500,000	500,980	2021/7/22
第9回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.46	500,000	502,420	2023/7/22
第19回株式会社オリエントコーポレーション無担保社債	0.54	500,000	501,245	2025/7/18
第53回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.815	100,000	103,240	2024/3/19
第55回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.963	300,000	316,305	2026/9/18
第66回日立キャピタル株式会社無担保社債	0.26	500,000	503,935	2024/6/20
第5回株式会社アブラスフィナンシャル無担保社債	0.25	600,000	600,822	2023/10/13
第168回オリックス株式会社無担保社債	0.849	200,000	200,758	2020/3/6
第171回オリックス株式会社無担保社債	1.126	220,000	228,507	2023/4/28
第174回オリックス株式会社無担保社債	0.919	100,000	100,721	2020/7/17
第175回オリックス株式会社無担保社債	1.064	100,000	104,193	2023/11/24
第180回オリックス株式会社無担保社債	0.797	500,000	517,090	2024/9/4
第181回オリックス株式会社無担保社債	0.812	100,000	103,536	2024/9/26
第188回オリックス株式会社無担保社債	0.15	200,000	200,480	2022/2/25
第189回オリックス株式会社無担保社債	0.445	200,000	204,118	2027/2/26
第11回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.411	500,000	503,485	2021/8/5
第12回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.726	400,000	412,264	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	201,562	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	306,231	2028/2/8
第20回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債	0.41	600,000	609,522	2028/8/3
第44回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.15	400,000	401,212	2023/10/25
第59回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.385	200,000	203,282	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	202,554	2028/7/12
第27回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.508	500,000	503,445	2021/2/24
第36回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.355	200,000	201,508	2022/1/21
第14回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	1.252	200,000	201,598	2020/5/27
第16回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.687	400,000	404,032	2021/5/21
第22回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.397	300,000	300,864	2020/8/12
第30回株式会社大和証券グループ本社無担保社債	0.22	100,000	100,380	2022/8/26
第44回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.723	100,000	100,953	2021/2/25
第50回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.22	200,000	200,748	2022/8/10
第51回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.34	200,000	201,814	2024/8/9
第1回野村ホールディングス株式会社無担保社債	0.3	700,000	701,197	2023/9/4
第11回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	0.11	400,000	400,848	2022/12/7
第6回三井住友海上火災保険株式会社無担保社債	0.13	400,000	400,240	2024/7/31
第13回NECキャピタルソリューション株式会社無担保社債	0.29	600,000	601,998	2023/7/13
第39回三井不動産株式会社無担保社債	1.191	100,000	100,859	2020/6/19
第42回三井不動産株式会社無担保社債	2.302	100,000	122,265	2030/12/20
第43回三井不動産株式会社無担保社債	1.272	100,000	102,155	2021/6/18
第45回三井不動産株式会社無担保社債	0.997	300,000	307,842	2022/5/24
第46回三井不動産株式会社無担保社債	0.964	100,000	102,767	2022/8/30
第48回三井不動産株式会社無担保社債	2.045	100,000	122,354	2033/8/2
第56回三井不動産株式会社無担保社債	0.2	400,000	402,904	2024/8/28
第66回三井不動産株式会社無担保社債	0.28	400,000	404,484	2026/3/13
第67回三井不動産株式会社無担保社債	0.38	300,000	304,881	2029/4/13
第65回三菱地所株式会社無担保社債	2.04	200,000	243,762	2032/12/20
第83回三菱地所株式会社無担保社債	2.385	200,000	236,098	2027/9/17

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第86回三菱地所株式会社無担保社債	2.425	300,000	355,890	2027/10/29
第93回三菱地所株式会社無担保社債	2.555	200,000	242,420	2028/7/28
第113回三菱地所株式会社無担保社債	1.067	100,000	105,350	2024/12/27
第118回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	300,000	303,564	2026/12/18
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	300,000	303,135	2027/6/18
第125回三菱地所株式会社無担保社債	0.19	300,000	302,019	2025/3/14
第130回三菱地所株式会社無担保社債	0.27	700,000	704,340	2029/8/3
第22回東京建物株式会社無担保社債	0.26	400,000	401,276	2021/5/6
第96回住友不動産株式会社無担保社債	0.914	200,000	201,360	2024/3/18
第97回住友不動産株式会社無担保社債	0.904	200,000	207,400	2024/4/26
第98回住友不動産株式会社無担保社債	0.884	500,000	518,535	2024/6/10
第104回住友不動産株式会社無担保社債	0.826	100,000	103,654	2025/4/28
第108回住友不動産株式会社無担保社債	0.4	500,000	507,735	2027/5/7
第16回イオンモール株式会社無担保社債	0.37	300,000	303,150	2025/7/3
第1回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.19	300,000	359,187	2031/9/19
第14回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	0.75	400,000	411,536	2023/9/20
第15回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.25	200,000	219,460	2028/9/20
第17回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	0.61	800,000	822,616	2024/9/20
第1回エヌ・ティ・ティ都市開発株式会社無担保社債	1.09	200,000	217,086	2029/9/20
第87回東武鉄道株式会社無担保社債	1.82	400,000	404,188	2020/4/28
第100回東武鉄道株式会社無担保社債	1.1	200,000	207,456	2023/4/25
第102回東武鉄道株式会社無担保社債	1.36	300,000	323,013	2025/10/23
第105回東武鉄道株式会社無担保社債	1.081	600,000	638,466	2026/6/17
第111回東武鉄道株式会社無担保社債	0.58	600,000	616,818	2031/9/5
第112回東武鉄道株式会社無担保社債	0.792	500,000	525,825	2036/12/5
第116回東武鉄道株式会社無担保社債	0.783	600,000	625,782	2037/9/11
第119回東武鉄道株式会社無担保社債	0.758	500,000	517,495	2038/5/24
第121回東武鉄道株式会社無担保社債	0.65	800,000	808,392	2039/7/22
第120回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.91	100,000	100,656	2020/6/25
第30回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.61	100,000	100,878	2021/4/22
第31回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.97	500,000	520,430	2024/4/22
第32回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.58	100,000	102,516	2025/1/28
第33回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.43	300,000	303,771	2023/1/27
第34回相鉄ホールディングス株式会社無担保社債	0.68	300,000	310,566	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	622,716	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	722,925	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	718,571	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	415,012	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	204,814	2029/9/125
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	708,407	2034/6/20
第1回東急株式会社無担保社債	0.47	800,000	796,232	2039/9/16
第64回東京急行電鉄株式会社無担保社債	2.7	100,000	109,937	2023/6/6
第75回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.982	100,000	102,640	2022/6/7
第76回東京急行電鉄株式会社無担保社債	1.563	500,000	556,775	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	448,448	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	206,230	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	219,398	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	677,400	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	204,222	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	103,406	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	629,322	2036/9/26
第87回東京急行電鉄株式会社無担保社債	0.723	700,000	724,031	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	662,370	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	549,655	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	316,608	2036/12/1

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41回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.751	700,000	730,800	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	731,346	2037/12/4
第43回京浜急行電鉄株式会社無担保社債	0.676	900,000	922,275	2038/7/12
第60回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.846	100,000	102,518	2022/10/18
第63回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.905	500,000	527,115	2025/12/12
第68回小田急電鉄株式会社無担保社債	1.098	600,000	656,418	2030/6/12
第72回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.64	500,000	515,235	2036/8/29
第77回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.756	700,000	732,494	2037/5/29
第74回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.746	600,000	625,500	2037/11/30
第80回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.794	800,000	838,304	2038/8/30
第81回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.33	700,000	712,012	2028/12/20
第83回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.209	400,000	401,072	2029/6/20
第84回小田急電鉄株式会社無担保社債	0.608	600,000	606,630	2039/6/20
第26回京王電鉄株式会社無担保社債	2.36	100,000	118,585	2027/11/29
第30回京王電鉄株式会社無担保社債	1.412	100,000	100,281	2019/12/9
第31回京王電鉄株式会社無担保社債	1.199	400,000	408,592	2021/7/28
第34回京王電鉄株式会社無担保社債	0.32	300,000	305,301	2026/3/10
第35回京王電鉄株式会社無担保社債	0.542	100,000	103,528	2031/3/10
第36回京王電鉄株式会社無担保社債	0.325	500,000	510,180	2027/9/17
第37回京王電鉄株式会社無担保社債	0.761	600,000	627,756	2037/9/18
第38回京王電鉄株式会社無担保社債	0.295	100,000	101,762	2027/11/29
第39回京王電鉄株式会社無担保社債	0.736	500,000	520,405	2037/11/27
第48回京成電鉄株式会社無担保社債	1.004	200,000	207,364	2023/7/25
第50回京成電鉄株式会社無担保社債	0.449	600,000	612,150	2031/6/20
第52回京成電鉄株式会社無担保社債	0.833	600,000	630,618	2038/9/7
第53回京成電鉄株式会社無担保社債	0.787	1,000,000	1,040,500	2039/3/8
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	130,533	2033/9/20
第45回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.55	100,000	116,924	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	116,644	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	581,825	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	236,714	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	119,800	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	362,319	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	361,608	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	365,988	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	476,576	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	121,599	2030/12/20
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	222,682	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	358,395	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	360,105	2032/12/27
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.757	300,000	309,615	2024/1/30
第103回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.502	400,000	471,924	2034/7/25
第106回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	0.981	100,000	110,571	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	529,595	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	319,353	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	739,921	2038/1/26
第15回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.26	200,000	235,668	2027/12/20
第16回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.989	100,000	100,960	2020/3/19
第17回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	2.427	100,000	119,751	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	360,333	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	240,674	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	244,148	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	966,960	2030/6/11
第35回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	0.836	300,000	309,864	2023/9/27
第36回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.554	200,000	237,384	2034/6/20

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第38回西日本旅客鉄道株式会社無担保社債	1.288	400,000	460,888	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	456,432	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	216,326	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	504,145	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	732,438	2036/12/12
第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.39	101,000	106,754	2022/2/15
第32回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	2.31	300,000	353,169	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	354,483	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	100,000	119,800	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	952,552	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	241,722	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	120,601	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	365,184	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	241,478	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	240,410	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	606,140	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	400,000	471,964	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	114,221	2032/9/30
第73回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	1.014	600,000	666,306	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	113,676	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	115,332	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	114,108	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	222,894	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	509,150	2036/4/14
第2回東京地下鉄株式会社社債	2.36	100,000	111,048	2024/6/20
第6回東京地下鉄株式会社社債	2.43	100,000	118,675	2027/9/17
第8回東京地下鉄株式会社社債	2.31	200,000	236,486	2027/12/30
第10回東京地下鉄株式会社社債	2.23	500,000	608,915	2030/3/19
第13回東京地下鉄株式会社社債	1.702	100,000	118,851	2032/5/25
第14回東京地下鉄株式会社社債	1.76	100,000	120,675	2033/6/14
第16回東京地下鉄株式会社社債	0.778	300,000	322,743	2036/3/11
第18回東京地下鉄株式会社社債	0.343	700,000	703,696	2036/6/20
第23回東京地下鉄株式会社社債	0.661	700,000	738,815	2037/6/19
第26回東京地下鉄株式会社社債	0.665	600,000	633,024	2037/12/15
第29回東京地下鉄株式会社社債	0.638	100,000	104,954	2038/5/24
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	621,390	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	511,095	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	714,084	2028/12/6
第2回株式会社鴻池運輸無担保社債	1.18	300,000	300,726	2022/3/2
第44回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.345	600,000	610,362	2026/3/4
第45回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.717	700,000	735,448	2031/3/4
第46回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.619	600,000	620,598	2036/9/9
第47回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.903	700,000	746,529	2037/4/14
第48回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.782	500,000	522,240	2037/9/4
第50回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.395	700,000	714,063	2028/9/6
第51回西日本鉄道株式会社無担保社債	0.672	700,000	711,879	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	515,110	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	716,415	2032/7/27
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	715,911	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	600,000	604,488	2029/7/11
第38回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.47	300,000	300,429	2019/10/23
第40回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	1.83	100,000	101,377	2020/9/18
第46回阪急阪神ホールディングス株式会社無担保社債	0.819	600,000	618,918	2023/10/25
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	548,400	2029/7/18
第49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	844,024	2036/12/15

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
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	729,827	2038/9/13
第37回南海電気鉄道株式会社無担保社債	0.87	200,000	207,196	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	625,296	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	717,269	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	609,726	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	723,590	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	816,648	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	727,566	2033/12/6
第24回京阪電気鉄道株式会社無担保社債	1.7	300,000	316,020	2022/12/9
第25回京阪電気鉄道株式会社無担保社債	1.34	100,000	102,378	2021/7/20
第28回京阪電気鉄道株式会社無担保社債	0.725	400,000	415,340	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	609,612	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	723,135	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	204,830	2029/1/24
第50回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.857	200,000	211,030	2027/4/30
第52回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.75	500,000	521,830	2036/8/29
第53回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.85	600,000	638,148	2035/2/28
第54回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.806	700,000	734,615	2037/5/29
第55回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.79	600,000	626,784	2037/12/4
第56回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.748	600,000	621,030	2038/5/25
第57回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.863	500,000	527,200	2038/9/10
第58回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.725	800,000	821,688	2039/4/25
第59回名古屋鉄道株式会社無担保社債	0.53	400,000	396,020	2039/9/5
第7回日本通運株式会社無担保社債	1.09	100,000	102,202	2021/10/20
第9回日本通運株式会社無担保社債	0.28	600,000	608,232	2026/2/25
第10回日本通運株式会社無担保社債	0.12	300,000	301,119	2023/7/14
第11回日本通運株式会社無担保社債	0.2	300,000	302,535	2026/7/14
第3回株式会社日立物流無担保社債	0.1	600,000	600,828	2021/9/28
第2回株式会社日立物流無担保社債	0.405	600,000	610,428	2028/9/4
第51回横浜高速鉄道株式会社無担保社債	0.455	200,000	204,710	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	407,724	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	714,770	2028/12/14
第1回九州旅客鉄道株式会社無担保社債	0.295	600,000	606,894	2029/3/7
第1回日本航空株式会社無担保社債	0.47	700,000	713,251	2026/12/18
第2回日本航空株式会社無担保社債	0.17	600,000	601,398	2021/12/20
第3回日本航空株式会社無担保社債	0.399	500,000	505,795	2028/9/21
第5回日本航空株式会社無担保社債	0.22	500,000	502,700	2024/3/19
第29回全日本空輸株式会社無担保社債	1.22	500,000	524,805	2024/3/6
第30回ANAホールディングス株式会社無担保社債	1.2	700,000	749,231	2026/9/18
第15回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.734	500,000	515,705	2024/3/12
第16回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.21	300,000	302,856	2024/12/6
第17回三菱倉庫株式会社無担保社債	0.34	500,000	509,425	2027/12/8
第3回株式会社社友倉庫無担保社債	0.366	500,000	505,685	2022/12/16
第4回株式会社社友倉庫無担保社債	0.639	300,000	310,764	2025/12/17
第5回株式会社社友倉庫無担保社債	0.21	400,000	403,368	2025/3/26
第6回株式会社社友倉庫無担保社債	0.838	700,000	734,916	2038/3/26
第7回株式会社社友倉庫無担保社債	0.08	200,000	200,680	2024/9/24
第8回株式会社社友倉庫無担保社債	0.21	600,000	603,210	2029/9/21
第1回朝日放送グループホールディングス株式会社無担保社債	0.16	200,000	200,370	2024/9/2
第2回株式会社スカパーJ SATホールディングス無担保社債	0.312	200,000	200,370	2020/6/18
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	500,000	512,285	2023/3/20
第19回KDDI株式会社無担保社債	1.151	200,000	201,644	2020/6/19

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第20回KDDI株式会社無担保社債	0.803	700,000	723,051	2023/12/20
第21回KDDI株式会社無担保社債	0.669	500,000	515,605	2020/9/20
第22回KDDI株式会社無担保社債	0.31	700,000	710,199	2028/7/12
第24回KDDI株式会社無担保社債	0.25	700,000	708,127	2025/11/21
第25回KDDI株式会社無担保社債	0.395	400,000	408,232	2028/11/22
第26回KDDI株式会社無担保社債	0.13	100,000	100,418	2024/4/26
第27回KDDI株式会社無担保社債	0.23	700,000	706,398	2026/4/24
第20回株式会社NTTドコモ無担保社債	0.73	400,000	411,052	2023/9/20
第22回沖繩電力株式会社社債	0.996	300,000	308,169	2022/6/24
第23回沖繩電力株式会社社債	0.469	200,000	204,480	2025/3/25
第25回沖繩電力株式会社社債	0.25	700,000	708,344	2027/6/25
第26回沖繩電力株式会社社債	0.28	700,000	708,365	2028/12/25
第38回電源開発株式会社無担保社債	0.978	300,000	311,706	2023/12/20
第39回電源開発株式会社無担保社債	0.929	200,000	207,554	2024/2/20
第40回電源開発株式会社無担保社債	0.889	200,000	207,702	2024/6/20
第49回電源開発株式会社無担保社債	0.4	300,000	304,776	2027/5/20
第6回東京電力パワーグリッド株式会社社債	0.85	200,000	203,122	2027/8/31
第26回東京瓦斯株式会社無担保社債	2.29	100,000	110,567	2024/5/27
第35回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.852	400,000	480,784	2031/12/26
第36回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.737	400,000	477,136	2032/5/25
第37回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.764	300,000	362,454	2033/9/26
第39回東京瓦斯株式会社無担保社債	1.554	500,000	593,065	2034/5/26
第41回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.57	700,000	728,497	2036/11/28
第43回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.67	700,000	740,432	2037/6/9
第46回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.58	700,000	726,516	2038/7/20
第48回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.704	300,000	318,516	2038/11/29
第52回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.486	1,000,000	1,020,500	2039/5/23
第55回東京瓦斯株式会社無担保社債	0.28	600,000	588,576	2039/9/13
第32回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.606	400,000	476,892	2034/3/24
第33回大阪瓦斯株式会社無担保社債	1.402	600,000	699,930	2034/10/24
第31回東邦瓦斯株式会社無担保社債	2.06	600,000	630,336	2022/3/18
第36回東邦瓦斯株式会社無担保社債	1.628	300,000	334,512	2027/3/19
第38回東邦瓦斯株式会社無担保社債	0.933	500,000	517,410	2023/7/12
第13回広島ガス株式会社無担保社債	0.405	600,000	608,586	2028/9/13
第16回西部瓦斯株式会社無担保社債	0.355	700,000	709,072	2028/12/13
第3回東都競馬株式会社無担保社債	0.18	700,000	702,590	2023/7/5
第5回S C S K株式会社無担保社債	0.14	500,000	500,600	2021/12/15
第6回S C S K株式会社無担保社債	0.14	600,000	600,678	2022/7/21
第1回日鉄住金物産株式会社無担保社債	0.15	400,000	401,196	2023/3/3
第3回日鉄住金物産株式会社無担保社債	0.29	200,000	201,860	2025/6/13
第3回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.491	600,000	609,240	2022/12/16
第4回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.749	600,000	624,858	2025/12/16
第5回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.11	300,000	300,864	2023/6/6
第6回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.22	400,000	403,264	2025/6/6
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	0.405	900,000	918,324	2028/6/6
小 計		386,656,000	401,928,125	
合 計		601,696,800	646,258,210	

(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

(2019年9月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	646,258,210	98.4
コール・ローン等、その他	10,392,671	1.6
投資信託財産総額	656,650,881	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年9月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	656,650,881,292
コール・ローン等	9,257,652,106
公社債(評価額)	646,258,210,999
未収利息	1,101,382,624
前払費用	33,635,563
(B) 負債	5,953,777,051
未払金	2,106,700,000
未払解約金	3,847,059,568
未払利息	17,483
(C) 純資産総額(A-B)	650,697,104,241
元本	524,452,392,259
次期繰越損益金	126,244,711,982
(D) 受益権総口数	524,452,392,259口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,407円

(注) 当親ファンドの期首元本額は355,366,823,892円、期中追加設定元本額は265,847,627,503円、期中一部解約元本額は96,762,059,136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)	363,251,865,169円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)	125,108,950,739円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(毎月決算型)	32,689,850,620円
東京海上・円建て投資適格債券ファンド(年2回決算型)	3,161,712,350円
TMA債券バランスファンド<適格機関投資家限定>	240,013,381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 (2018年9月26日～2019年9月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	4,367,163,389
受取利息	4,371,716,756
支払利息	△ 4,553,367
(B) 有価証券売買損益	16,002,994,029
売買益	16,301,368,669
売買損	△ 298,374,640
(C) 当期損益金(A+B)	20,370,157,418
(D) 前期繰越損益金	68,539,421,442
(E) 追加信託差損益金	58,558,455,285
(F) 解約差損益金	△ 21,223,322,163
(G) 計(C+D+E+F)	126,244,711,982
次期繰越損益金(G)	126,244,711,982

(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8期(決算日 2020年5月28日)

(計算期間 2019年5月29日～2020年5月28日)

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

東京海上アセットマネジメント

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考指数	株組入比率	純資産額
	円	騰落率			
4期(2016年5月30日)	20,913	△ 2.1	1,924.64	97.5	36,426
5期(2017年5月29日)	25,278	20.9	2,259.91	97.6	89,988
6期(2018年5月28日)	28,649	13.3	2,601.87	96.9	96,585
7期(2019年5月28日)	25,745	△10.1	2,334.11	97.0	107,652
8期(2020年5月28日)	26,104	1.4	2,437.16	96.1	37,394

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考指数	株組入比率
	円	騰落率		
(期首) 2019年5月28日	25,745	—	2,334.11	97.0
5月末	25,175	△ 2.2	2,275.96	97.5
6月末	25,421	△ 1.3	2,338.89	97.6
7月末	25,598	△ 0.6	2,360.18	97.8
8月末	25,417	△ 1.3	2,280.58	98.9
9月末	26,665	3.6	2,418.29	95.8
10月末	27,832	8.1	2,539.02	96.9
11月末	28,296	9.9	2,588.40	96.2
12月末	28,474	10.6	2,625.91	97.1
2020年1月末	28,075	9.1	2,569.77	99.0
2月末	25,271	△ 1.8	2,305.76	99.1
3月末	24,460	△ 5.0	2,167.60	92.3
4月末	24,757	△ 3.8	2,261.88	95.4
(期末) 2020年5月28日	26,104	1.4	2,437.16	96.1

(注) 騰落率は期首比です。

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

○運用経過

(2019年5月29日～2020年5月28日)

■期中の基準価額等の推移

期首：25,745円
 期末：26,104円
 騰落率：1.4%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

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

マイナス要因

- ・新型コロナウイルスの世界的な感染拡大による経済の減速

■投資環境

当期の国内株式市場は小幅に上昇しました。

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

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

■ポートフォリオについて

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

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

以上の運用の結果、基準価額は1.4%上昇しました。

○今後の運用方針

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

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

(円) 基準価額と参考指数の推移



(注) 参考指数は、期首（2019年5月28日）の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、TOPIX（東証株価指数）（配当込み）です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年5月29日～2020年5月28日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

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

○ 売買及び取引の状況

(2019年5月29日～2020年5月28日)

株式

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

(注) 金額は受渡代金です。

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

○ 株式売買比率

(2019年5月29日～2020年5月28日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

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

(注) (b) は、各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

(注) (c) は、小数点以下2位未満を切り捨てています。

○利害関係人との取引状況等

(2019年5月29日～2020年5月28日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2020年5月28日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (一%)			
ホクト	182	—	—
建設業 (8.6%)			
ミライト・ホールディングス	353	185	283,790
安藤・間	1,650	454	319,616
東急建設	693	292	173,156
長谷工コーポレーション	430	—	—
三井住友建設	—	640	301,440
奥村組	234	75	199,725
東鉄工業	104	—	—
熊谷組	41	125	333,375
大東建託	51	—	—
前田道路	48	—	—
日本国土開発	—	45	25,425
ライト工業	352	120	176,280
積水ハウス	741	359	724,641
中電工	38	—	—
関電工	712	259	260,813
協和エクシオ	—	125	305,625
食料品 (21.2%)			
日本製粉	256	63	103,761
三井製糖	151	—	—
森永製菓	—	95	437,950
江崎グリコ	273	95	484,500
山崎製パン	—	108	200,016
カルビー	409	169	514,605

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

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

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

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

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

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率です。

(注) 合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

○投資信託財産の構成

(2020年5月28日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年5月28日現在)

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

(注) 当親ファンドの期首元本額は41,814,150,407円、期中追加設定元本額は29,482,688,529円、期中一部解約元本額は56,971,575,580円です。

<元本の内訳>

東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)	10,007,470,356円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)	4,283,779,490円
東京海上・安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定>	33,979,571円
年金安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定>	33,939円

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

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

○損益の状況 (2019年5月29日～2020年5月28日)

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

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

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

○お知らせ

- ・弊社ホームページアドレスを一部変更したことに伴い、2019年10月1日付で所要の約款変更を行いました。
- ・2019年10月24日付で、信託金の限度額を3,000億円とする約款変更を行いました。

TMA日本REITマザーファンド

運用報告書 第9期 (決算日 2020年7月10日)

(計算期間 2019年7月11日～2020年7月10日)

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

東京海上アセットマネジメント

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

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		参考	指数		投資信託 証券 組入比	純資産額
	円	%		騰落率	騰落率		
5期(2016年7月11日)	22,108	16.3	3,328.23	15.5	98.4	6,026	
6期(2017年7月10日)	20,806	△5.9	3,104.17	△6.7	97.5	54,693	
7期(2018年7月10日)	23,145	11.2	3,456.85	11.4	98.4	71,950	
8期(2019年7月10日)	27,259	17.8	4,064.84	17.6	98.2	120,486	
9期(2020年7月10日)	23,933	△12.2	3,521.95	△13.4	98.2	37,309	

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		参考	指数		投資信託 証券 組入比
	円	%		騰落率	騰落率	
(期首) 2019年7月10日	27,259	—	4,064.84	—	98.2	
7月末	27,636	1.4	4,120.33	1.4	96.6	
8月末	28,732	5.4	4,275.94	5.2	95.2	
9月末	30,103	10.4	4,477.77	10.2	95.7	
10月末	31,090	14.1	4,625.77	13.8	96.5	
11月末	30,840	13.1	4,584.30	12.8	96.8	
12月末	29,970	9.9	4,450.34	9.5	98.4	
2020年1月末	31,046	13.9	4,608.85	13.4	97.1	
2月末	28,531	4.7	4,218.40	3.8	97.0	
3月末	22,702	△16.7	3,343.59	△17.7	92.6	
4月末	22,441	△17.7	3,313.25	△18.5	95.6	
5月末	24,268	△11.0	3,586.37	△11.8	97.8	
6月末	23,928	△12.2	3,525.99	△13.3	98.1	
(期末) 2020年7月10日	23,933	△12.2	3,521.95	△13.4	98.2	

(注) 騰落率は期首比です。

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

○運用経過

(2019年7月11日～2020年7月10日)

■期中の基準価額等の推移

期首：27,259円

期末：23,933円

騰落率：△12.2%

◇基準価額の主な変動要因

プラス要因

- ・景気変動の影響を受けにくいREITの特性が市場で評価されたこと

マイナス要因

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

■投資環境

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

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

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

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

■ポートフォリオについて

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

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

○今後の運用方針

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

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



(注) 参考指数は、期首(2019年7月10日)の値が基準価額と同一となるように指数化したものです。

(注) 参考指数は、東証REIT指数(配当込み)です。

○ 1 万口当たりの費用明細

(2019年7月11日～2020年7月10日)

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入しています。

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

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2019年7月11日～2020年7月10日)

投資信託証券

銘 柄	買 付		売 付		
	口 数	金 額	口 数	金 額	
国 内	S O S i L A 物 流 リ ー ト 投 資 法 人	口 8,423	千円 1,013,768	口 6,400	千円 668,746
	日 本 ア コ モ デ ー シ ョ ン フ ァ ン ド 投 資 法 人	60	38,398	3,437	1,955,707
	M C U B S M i d C i t y 投 資 法 人	6,282	711,568	21,111	1,661,665
	森 ヒ ル ズ リ ー ト 投 資 法 人	2,550	443,311	9,058	1,182,105
	産 業 フ ァ ン ド 投 資 法 人	3,383	542,956	7,146	984,636
	ア ド バ ン ス ・ レ ジ デ ン ス 投 資 法 人	5,764	1,969,577	11,693	3,378,108
	ケ ネ デ ィ ク ス ・ レ ジ デ ン シ ョ ン ・ ネ ク ス ト 投 資 法 人	1,020	186,185	8,023	1,294,861
	ア ク テ ィ ビ ア ・ プ ロ バ テ ィ ー ズ 投 資 法 人	2,510	1,317,069	6,455	2,373,243
	G L P 投 資 法 人	9,350	1,253,480	28,977	3,390,483
	コ ン フ ォ リ ア ・ レ ジ デ ン シ ョ ン 投 資 法 人	2,790 (256)	951,719 (85,075)	4,850	1,383,846
	コ ン フ ォ リ ア ・ レ ジ デ ン シ ョ ン 投 資 法 人 (新)	256 (△ 256)	85,075 (△ 85,075)	—	—
	日 本 プ ロ ジ ュ ー ト リ ー ト 投 資 法 人	4,779	1,376,027	16,208	4,422,489
	星 野 リ ゴ ー ト ・ リ ー ト 投 資 法 人	—	—	2,261	765,739
	O n e リ ー ト 投 資 法 人	540	172,104	3,430	843,214
	イ オ ン リ ー ト 投 資 法 人	6,100	860,616	9,442	950,630
	ヒ ュ ー リ ッ ク リ ー ト 投 資 法 人	2,250	433,019	10,301	1,234,085
	日 本 リ ー ト 投 資 法 人	334	140,765	3,822	1,250,357
	イ ン ベ ス コ ・ オ フ ィ ス ・ ジ ェ イ リ ー ト 投 資 法 人	17,400	309,359	97,084	1,410,406
積 水 ハ ウ ス ・ リ ー ト 投 資 法 人	21,170	1,890,153	37,009	2,453,780	

○利害関係人との取引状況等

(2019年7月11日～2020年7月10日)

該当事項はございません。

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

○組入資産の明細

(2020年7月10日現在)

国内投資信託証券

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

銘 柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数		口 数	評 価 額	比 率	
	口	口	口	千円	%	
プレミア投資法人	13,054		6,145	701,144	1.9	
東急リアル・エステート投資法人	9,404		3,924	541,512	1.5	
グローバル・ワン不動産投資法人	10,144		4,650	453,840	1.2	
ユナイテッド・アーバン投資法人	23,325		9,134	1,002,913	2.7	
森トラスト総合リート投資法人	12,260		4,257	543,193	1.5	
インヴィンシブル投資法人	50,407		—	—	—	
フロンティア不動産投資法人	2,386		686	220,549	0.6	
平和不動産リート投資法人	5,359		3,807	374,608	1.0	
日本ロジスティクスファンド投資法人	5,625		2,238	687,066	1.8	
福岡リート投資法人	3,717		1,207	148,581	0.4	
ケネディクス・オフィス投資法人	4,789		1,774	1,060,852	2.8	
いちごオフィスリート投資法人	9,427		6,256	437,920	1.2	
大和証券オフィス投資法人	3,091		758	431,302	1.2	
阪急阪神リート投資法人	7,300		1,972	233,287	0.6	
スターツプロシード投資法人	—		130	27,794	0.1	
大和ハウスリート投資法人	16,108		5,175	1,426,747	3.8	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	29,044		—	—	—	
大和証券リビング投資法人	24,471		7,784	817,320	2.2	
ジャパンエクセレント投資法人	11,875		5,452	624,254	1.7	
合 計	口 数 ・ 金 額		697,674	242,634	36,628,049	
	銘 柄 数 < 比 率 >		47	51	< 98.2% >	

(注) 比率は、純資産総額に対する評価額の割合です。

(注) 銘柄ID等の変更があった銘柄は、別銘柄として記載しています。

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

○投資信託財産の構成

(2020年7月10日現在)

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

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2020年7月10日現在)

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

(注) 当親ファンドの期首元本額は44,200,648,126円、期中追加設定元本額は20,164,377,975円、期中一部解約元本額は48,775,635,533円です。

<元本の内訳>

東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)	10,881,160,584円
東京海上・円資産バランスファンド(年1回決算型)	4,690,549,315円
東京海上・安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定>	17,663,029円
年金安定収益追求型マルチアセットファンド<適格機関投資家限定>	17,640円

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

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

○損益の状況 (2019年7月11日～2020年7月10日)

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

(注) (B)有価証券売買損益は、期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (E)追加信託差損益金は、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分です。

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

○お知らせ

- ・弊社ホームページアドレスを一部変更したことに伴い、2019年10月1日付で所要の約款変更を行いました。
- ・2019年10月24日付で、追加信託金の限度額を3,000億円とする約款変更を行いました。