

運用報告書 (全体版)

第12期<決算日2020年5月8日>

MHAM日本債券インデックスファンド (ファンドラップ)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/債券/インデックス型	
信託期間	2008年6月3日から無期限です。	
運用方針	主としてわが国の公社債を主要投資対象として、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要投資対象	MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	MHAM日本債券インデックスマザーファンドを通じてわが国の公社債に投資を行います。公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。	
組入制限	MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	外貨建資産への投資は行いません。
	MHAM日本債券インデックスマザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎年原則として5月8日に決算を行い、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。)等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)」は、2020年5月8日に第12期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された

販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
8期(2016年5月9日)	12,319	0	6.7	387.68	7.0	99.6	-	71,483
9期(2017年5月8日)	12,035	0	△2.3	379.64	△2.1	99.5	-	70,363
10期(2018年5月8日)	12,078	0	0.4	381.90	0.6	99.3	-	79,402
11期(2019年5月8日)	12,259	0	1.5	388.40	1.7	99.5	-	76,535
12期(2020年5月8日)	12,241	0	△0.1	388.67	0.1	99.3	-	62,130

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません（以下同じ）。

(注4) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首)	円	%		%	%	%
2019年5月8日	12,259	-	388.40	-	99.5	-
5月末	12,317	0.5	390.32	0.5	99.5	-
6月末	12,390	1.1	392.69	1.1	99.7	-
7月末	12,401	1.2	393.15	1.2	99.6	-
8月末	12,567	2.5	398.50	2.6	99.5	-
9月末	12,432	1.4	394.27	1.5	99.7	-
10月末	12,381	1.0	392.61	1.1	99.7	-
11月末	12,336	0.6	391.33	0.8	99.7	-
12月末	12,296	0.3	390.14	0.4	99.2	-
2020年1月末	12,346	0.7	391.77	0.9	99.6	-
2月末	12,440	1.5	394.74	1.6	99.6	-
3月末	12,237	△0.2	388.45	0.0	101.2	-
4月末	12,276	0.1	389.79	0.4	99.3	-
(期末)						
2020年5月8日	12,241	△0.1	388.67	0.1	99.3	-

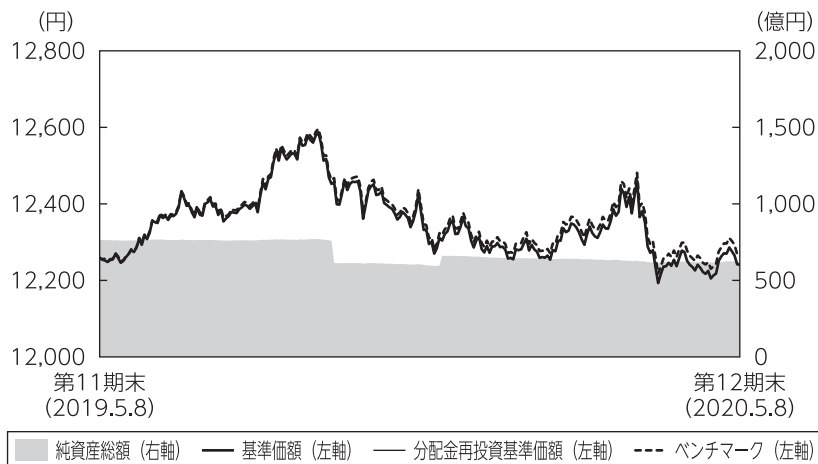
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

基準価額等の推移



第12期首： 12,259円
第12期末： 12,241円
(既払分配金0円)
騰落率： △0.1%
(分配金再投資ベース)

- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を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2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さま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。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク (NOMURA-BPI総合) は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内債券への投資を行った結果、市況が概ね横ばいとなり、基準価額もわずかに下落しました。

投資環境

10年国債利回りは上昇しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念などを背景に、利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から2020年1月中旬にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きなどから上昇に転じました。その後新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念などから上昇幅を縮めましたが、3月中旬には、日本の大型経済対策に伴う国債増発懸念などを背景に再び上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

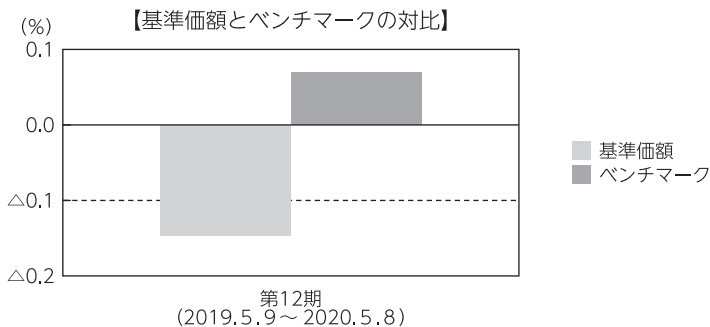
当ファンドの運用方針に従い、MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●MHAM日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で0.1%上昇しました。当ファンドの基準価額はベンチマークを0.2%程度下回りましたが、この差異は主に信託報酬などの諸費用によるものです。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2019年5月9日 ～2020年5月8日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	2,241円

(注1) 「当期の収益」および「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これらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

引き続き、MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持します。

●MHAM日本債券インデックスマザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第12期		項目の概要
	(2019年5月9日 ～2020年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	26円	0.207%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,351円です。
(投信会社)	(20)	(0.164)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(1)	(0.011)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(4)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.001 (0.001)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	26	0.208	

(注1) 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・解約によって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。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

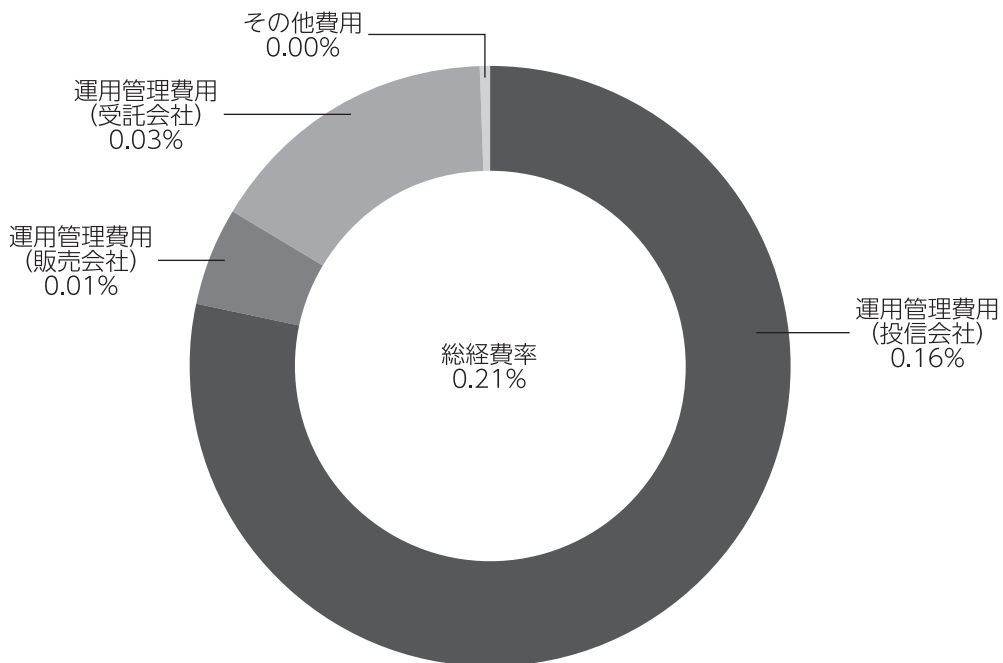
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」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0.21%です。



(注1) 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2) 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3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 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異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2019年5月9日から2020年5月8日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	千口 7,094,517	千円 8,944,310	千口 18,624,332	千円 23,653,090

■利害関係人との取引状況等（2019年5月9日から2020年5月8日まで）

【MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【MHAM日本債券インデックスマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
公 社 債	百万円 75,219	百万円 5,656	% 7.5	百万円 69,798	百万円 5,356	% 7.7

平均保有割合 49.2%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	千口 61,057,155	千口 49,527,340	千円 62,122,143

■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	千円 62,122,143	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	161,378	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	62,283,522	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	62,283,522,553円
コール・ローン等	75,958,757
MHAM日本債券インデックス マザーファンド(評価額)	62,122,143,796
未 収 入 金	85,420,000
(B) 負 債	153,155,327
未 払 解 約 金	86,888,025
未 払 信 託 報 酬	65,910,053
そ の 他 未 払 費 用	357,249
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	62,130,367,226
元 本	50,754,193,586
次 期 繰 越 損 益 金	11,376,173,640
(D) 受 益 権 総 口 数	50,754,193,586口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,241円

(注) 期首における元本額は62,430,938,507円、当期中における追加設定元本額は10,064,792,342円、同解約元本額は21,741,537,263円です。

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△30,919円
受 取 利 息	2,820
支 払 利 息	△33,739
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△6,564,207
売 買 益 損	293,222,483
売 買 損 益	△299,786,690
(C) 信 託 報 酬 等	△140,804,536
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△147,399,662
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,700,134,444
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,823,438,858
(配 当 等 相 当 額)	(7,482,363,815)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,341,075,043)
(G) 合 計(D+E+F)	11,376,173,640
次 期 繰 越 損 益 金(G)	11,376,173,640
追 加 信 託 差 損 益 金	9,823,438,858
(配 当 等 相 当 額)	(7,487,984,285)
(売 買 損 益 相 当 額)	(2,335,454,573)
分 配 準 備 積 立 金	2,690,986,402
繰 越 損 益 金	△1,138,251,620

(注1) (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2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	360,978,288円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	8,685,187,238
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,330,008,114
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	11,376,173,640
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	2,241.43
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額の水準および市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第12期（決算日 2020年5月8日）

（計算期間 2019年5月9日～2020年5月8日）

MHAM日本債券インデックスマザーファンドの第12期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2008年6月3日から無期限です。
運用方針	主としてわが国の公社債を主要投資対象として、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債券組入比率	債券先物比率	純資産額
	円	騰落率	円	騰落率			
8期(2016年5月9日)	12,518	7.0	387.68	7.0	99.6	-	135,853
9期(2017年5月8日)	12,255	△2.1	379.64	△2.1	99.5	-	104,764
10期(2018年5月8日)	12,324	0.6	381.90	0.6	99.3	-	152,614
11期(2019年5月8日)	12,535	1.7	388.40	1.7	99.5	-	153,384
12期(2020年5月8日)	12,543	0.1	388.67	0.1	99.3	-	158,088

(注1) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注2) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

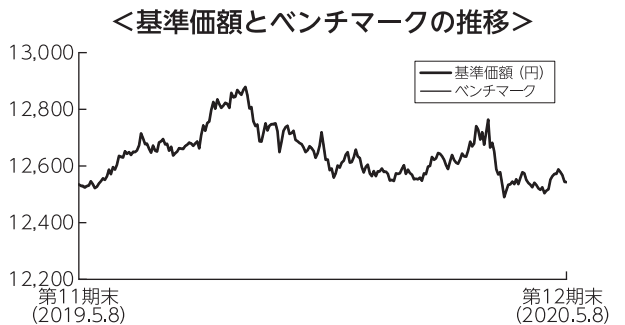
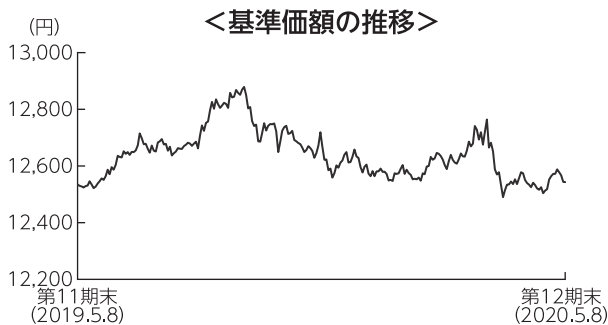
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2019年 5 月 8 日	円	%		%	%	%
	12,535	-	388.40	-	99.5	-
5 月 末	12,596	0.5	390.32	0.5	99.5	-
6 月 末	12,672	1.1	392.69	1.1	99.7	-
7 月 末	12,686	1.2	393.15	1.2	99.6	-
8 月 末	12,858	2.6	398.50	2.6	99.5	-
9 月 末	12,722	1.5	394.27	1.5	99.7	-
10 月 末	12,672	1.1	392.61	1.1	99.7	-
11 月 末	12,628	0.7	391.33	0.8	99.7	-
12 月 末	12,590	0.4	390.14	0.4	99.3	-
2020年 1 月 末	12,643	0.9	391.77	0.9	99.6	-
2 月 末	12,741	1.6	394.74	1.6	99.6	-
3 月 末	12,536	0.0	388.45	0.0	101.2	-
4 月 末	12,578	0.3	389.79	0.4	99.3	-
(期 末) 2020年 5 月 8 日	12,543	0.1	388.67	0.1	99.3	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)



(注) ベンチマーク (NOMURA-BPI総合) は、期首の値を基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の推移

当ファンドの基準価額は12,543円となり、前期末比で0.1%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内債券への投資を行った結果、市況が概ね横ばいとなったことから、基準価額も概ね横ばいとなりました。

投資環境

10年国債利回りは上昇しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念などを背景に、利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から2020年1月中旬にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きなどから上昇に転じました。その後新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界景気の悪化懸念などから上昇幅を縮めましたが、3月中旬には、日本の大型経済対策に伴う国債増発懸念などを背景に再び上昇しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で0.1%上昇しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

今後の運用方針

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はございません。

■ 売買及び取引の状況 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	74,690,717	67,263,852 (-)
	地方債証券	323,611	910,158 (-)
	特殊債証券	-	522,524 (131,473)
	社債証券	205,282	1,102,390 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2019年5月9日から2020年5月8日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決算期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況 B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況 D	$\frac{D}{C}$
区分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	75,219	5,656	7.5	69,798	5,356	7.7

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 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	126,395,000	137,044,197	86.7	—	56.6	21.7	8.4
地 方 債 証 券	6,735,330	7,147,889	4.5	3.9	2.8	1.4	0.3
特 殊 債 証 券	7,304,945	7,809,776	4.9	0.1	3.5	1.3	0.2
金 融 債 証 券	300,000	300,099	0.2	—	—	0.1	0.1
普 通 社 債 証 券	4,610,000	4,749,522	3.0	0.1	1.4	1.2	0.4
合 計	145,345,275	157,051,485	99.3	4.1	64.2	25.7	9.5

(注1) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

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	
1 2 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	680,000	682,114	2021/06/20
3 1 5 回 利付国庫債券 (10年)	1.2000	830,000	842,682	2021/06/20
3 1 6 回 利付国庫債券 (10年)	1.1000	480,000	486,801	2021/06/20
4 0 2 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	250,000	250,797	2021/07/01
4 0 3 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	400,000	401,372	2021/08/01
1 2 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,160,000	1,164,350	2021/09/20
3 1 7 回 利付国庫債券 (10年)	1.1000	410,000	417,134	2021/09/20
3 1 8 回 利付国庫債券 (10年)	1.0000	850,000	863,625	2021/09/20
4 0 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	500,000	502,090	2021/10/01
4 0 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	700,000	703,003	2021/11/01
4 0 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	500,000	502,225	2021/12/01
1 3 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,050,000	1,054,662	2021/12/20
3 1 9 回 利付国庫債券 (10年)	1.1000	480,000	489,926	2021/12/20
3 2 0 回 利付国庫債券 (10年)	1.0000	1,260,000	1,284,015	2021/12/20
4 0 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	200,000	200,922	2022/01/01
4 0 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	350,000	351,697	2022/02/01
4 1 0 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	700,000	703,549	2022/03/01
1 3 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,050,000	1,055,470	2022/03/20
3 2 1 回 利付国庫債券 (10年)	1.0000	840,000	858,471	2022/03/20
3 2 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.9000	500,000	510,060	2022/03/20
1 3 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,160,000	1,166,867	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.9000	560,000	572,863	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	750,000	765,645	2022/06/20
1 3 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,660,000	1,671,022	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	2,100,000	2,148,804	2022/09/20

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	
134回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,390,000	1,400,202	2022/12/20
326回 利付国庫債券 (10年)	0.7000	520,000	531,934	2022/12/20
327回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	1,170,000	1,199,916	2022/12/20
59回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	10,000	10,493	2022/12/20
135回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,500,000	1,511,835	2023/03/20
328回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,790,000	1,829,827	2023/03/20
136回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,100,000	1,109,449	2023/06/20
329回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	1,480,000	1,524,873	2023/06/20
137回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,010,000	1,019,211	2023/09/20
330回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	910,000	939,838	2023/09/20
331回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	500,000	513,015	2023/09/20
64回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	30,000	32,094	2023/09/20
138回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,350,000	1,362,987	2023/12/20
332回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,420,000	1,459,447	2023/12/20
65回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	64,488	2023/12/20
139回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,530,000	1,545,728	2024/03/20
333回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,580,000	1,626,910	2024/03/20
67回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	50,000	53,997	2024/03/20
140回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,350,000	1,364,512	2024/06/20
334回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,460,000	1,505,887	2024/06/20
70回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	50,000	55,283	2024/06/20
71回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	40,000	43,896	2024/06/20
141回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,050,000	1,061,518	2024/09/20
335回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	1,310,000	1,347,374	2024/09/20
72回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	120,839	2024/09/20
142回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,310,000	1,324,580	2024/12/20
336回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	440,000	453,173	2024/12/20
337回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	1,170,000	1,193,891	2024/12/20
73回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	43,972	2024/12/20
74回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	44,158	2024/12/20
143回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	250,000	252,872	2025/03/20
338回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,200,000	1,231,992	2025/03/20
75回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	44,382	2025/03/20
76回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	76,983	2025/03/20
77回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	44,186	2025/03/20
339回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,320,000	1,356,682	2025/06/20
78回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	66,282	2025/06/20
79回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	55,492	2025/06/20
80回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	100,349	2025/06/20
340回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,660,000	1,708,422	2025/09/20
81回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	160,000	178,448	2025/09/20
82回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	156,898	2025/09/20
341回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	1,260,000	1,291,348	2025/12/20
83回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	78,845	2025/12/20
84回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	190,519	2025/12/20
342回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,350,000	1,368,724	2026/03/20

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	
85回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	150,000	169,743	2026/03/20
86回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	137,211	2026/03/20
87回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	136,502	2026/03/20
343回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,670,000	1,694,164	2026/06/20
88回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	240,000	275,916	2026/06/20
89回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	11,434	2026/06/20
344回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,360,000	1,380,060	2026/09/20
90回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	170,000	195,345	2026/09/20
91回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	127,105	2026/09/20
345回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,330,000	1,350,388	2026/12/20
92回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	290,000	333,009	2026/12/20
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,370,000	1,391,317	2027/03/20
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	120,000	137,589	2027/03/20
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	220,000	253,770	2027/03/20
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,270,000	1,290,497	2027/06/20
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	200,000	234,706	2027/06/20
96回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	139,102	2027/06/20
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,160,000	1,178,942	2027/09/20
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	160,000	187,499	2027/09/20
98回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	186,312	2027/09/20
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,300,000	1,321,450	2027/12/20
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	300,000	350,886	2027/12/20
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,660,000	1,686,958	2028/03/20
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	230,000	271,894	2028/03/20
101回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	130,000	155,738	2028/03/20
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,140,000	1,158,160	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	140,000	168,477	2028/06/20
103回 利付国債 (20年)	2.3000	160,000	191,238	2028/06/20
104回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	129,679	2028/06/20
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,170,000	1,188,216	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	240,000	284,042	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	150,000	178,788	2028/09/20
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,370,000	1,390,769	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	200,000	237,598	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	290,000	339,491	2028/12/20
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,040,000	1,054,809	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	130,000	152,621	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	131,099	2029/03/20
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,190,000	1,205,779	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	170,000	204,909	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	190,000	227,278	2029/06/20
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,110,000	1,123,542	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	10,000	12,644	2029/09/20
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	479,984	2029/09/20
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,100,000	1,112,166	2029/12/20
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	270,000	324,961	2029/12/20

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	
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	160,000	194,110	2029/12/20
358回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	200,000	202,070	2030/03/20
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	210,000	255,666	2030/03/20
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	520,000	627,952	2030/03/20
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	245,000	294,237	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	270,000	318,807	2030/06/20
120回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	420,000	487,443	2030/06/20
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	400,000	477,756	2030/09/20
122回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	370,000	438,098	2030/09/20
123回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	670,417	2030/12/20
124回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	360,000	435,013	2030/12/20
125回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	240,000	296,040	2031/03/20
126回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	250,000	302,970	2031/03/20
127回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	220,000	264,235	2031/03/20
128回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	430,000	517,887	2031/06/20
129回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	320,000	381,868	2031/06/20
130回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	510,000	610,138	2031/09/20
131回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	290,000	343,667	2031/09/20
132回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	310,000	368,196	2031/12/20
133回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	520,000	623,610	2031/12/20
134回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	400,000	480,812	2032/03/20
135回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	190,000	226,153	2032/03/20
136回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	220,000	259,278	2032/03/20
137回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	250,000	298,215	2032/06/20
138回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	260,000	303,914	2032/06/20
139回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	270,000	318,837	2032/06/20
140回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	750,000	896,527	2032/09/20
141回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	470,000	562,951	2032/12/20
142回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	330,000	399,366	2032/12/20
143回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	520,000	617,448	2033/03/20
144回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	430,000	505,133	2033/03/20
11回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	50,000	60,118	2033/06/20
145回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	640,000	769,516	2033/06/20
12回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	30,000	37,737	2033/09/20
146回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	600,000	722,766	2033/09/20
13回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	50,000	62,379	2033/12/20
147回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	750,000	895,057	2033/12/20
14回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	50,000	65,227	2034/03/20
148回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	600,000	708,996	2034/03/20
15回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	60,000	79,372	2034/06/20
149回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	720,000	852,530	2034/06/20
16回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	90,000	119,482	2034/09/20
150回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	730,000	855,275	2034/09/20
17回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	70,000	92,188	2034/12/20
151回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	730,000	835,404	2034/12/20
18回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	80,000	104,466	2035/03/20

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	
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	680,000	778,674	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	80,000	104,792	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	700,000	812,931	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	130,000	174,691	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	660,000	757,231	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	110,000	144,859	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	740,000	827,112	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	70,000	94,600	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	610,000	624,908	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	150,000	203,367	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	580,000	575,505	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	80,000	108,720	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	660,000	685,396	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	130,000	172,915	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	580,000	611,395	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	220,000	296,751	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	530,000	566,744	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	590,000	620,821	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	274,420	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	520,000	546,644	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	600,000	630,636	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	400,171	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	770,000	795,425	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	570,000	588,564	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	300,000	411,069	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	480,000	512,520	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	630,000	649,914	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	421,782	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	560,000	567,459	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	500,000	497,300	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	260,000	351,036	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	520,000	517,160	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	480,000	476,904	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	420,000	577,966	2040/03/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	650,000	861,211	2040/09/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	480,000	658,372	2041/03/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	560,000	748,860	2041/09/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	620,000	832,784	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	570,000	756,361	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	350,000	458,377	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	310,000	413,614	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	340,000	446,947	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	380,000	491,875	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	360,000	466,495	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	330,000	428,571	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	310,000	403,037	2044/09/20

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	
45回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	390,000	489,407	2044/12/20
46回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	400,000	502,892	2045/03/20
47回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	450,000	577,165	2045/06/20
48回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	480,000	593,251	2045/09/20
49回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	380,000	469,911	2045/12/20
50回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	370,000	403,732	2046/03/20
51回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	380,000	367,969	2046/06/20
52回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	410,000	416,793	2046/09/20
53回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	400,000	416,732	2046/12/20
54回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	400,000	436,684	2047/03/20
55回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	390,000	425,548	2047/06/20
56回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	410,000	447,683	2047/09/20
57回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	390,000	425,610	2047/12/20
1回 利付国債 (40年)	2.4000	110,000	166,182	2048/03/20
58回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	490,000	535,099	2048/03/20
59回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	390,000	415,884	2048/06/20
60回 利付国庫債券 (30年)	0.9000	370,000	413,959	2048/09/20
61回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	360,000	383,785	2048/12/20
2回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	150,000	220,708	2049/03/20
62回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	330,000	334,214	2049/03/20
63回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	400,000	394,344	2049/06/20
64回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	360,000	354,870	2049/09/20
65回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	370,000	364,686	2049/12/20
3回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	210,000	312,068	2050/03/20
66回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	70,000	68,987	2050/03/20
4回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	340,000	510,200	2051/03/20
5回 利付国庫債券 (40年)	2.0000	330,000	480,552	2052/03/20
6回 利付国庫債券 (40年)	1.9000	300,000	431,937	2053/03/20
7回 利付国庫債券 (40年)	1.7000	360,000	499,550	2054/03/20
8回 利付国庫債券 (40年)	1.4000	390,000	506,980	2055/03/20
9回 利付国庫債券 (40年)	0.4000	570,000	557,750	2056/03/20
10回 利付国庫債券 (40年)	0.9000	520,000	595,857	2057/03/20
11回 利付国庫債券 (40年)	0.8000	440,000	490,604	2058/03/20
12回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	400,000	404,604	2059/03/20
小 計	-	126,395,000	137,044,197	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
100回 共同発行市場公募地方債	1.2100	100,000	101,431	2021/07/23
23年度2回 堺市公募公債	1.0600	100,000	101,641	2021/12/17
23年度1回 新潟市公募公債 10年	1.0600	100,000	101,689	2021/12/22
105回 共同発行市場公募地方債	1.0700	100,000	101,711	2021/12/24
23年度5回 横浜市公募公債	1.0110	100,000	101,713	2022/01/28
115回 共同発行市場公募地方債	0.8000	100,000	101,947	2022/10/25
118回 共同発行市場公募地方債	0.8400	100,000	102,255	2023/01/25
368回 大阪府公募公債 10年	0.8300	100,000	102,211	2023/01/30
719回 東京都公募公債	0.8600	200,000	204,870	2023/03/20
1回 東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	104,771	2023/06/20

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	
25年度6回 千葉県公募公債	0.8000	100,000	102,653	2023/09/25
29回1号 宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	102,296	2023/10/25
127回 共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	102,296	2023/10/25
25年度2回 島根県公募公債	0.6700	106,000	108,452	2023/11/27
25年度8回 埼玉県公募公債	0.7030	100,000	102,479	2023/12/25
25年度2回 新潟県公募公債	0.6700	100,000	102,474	2024/02/28
132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	102,480	2024/03/25
26年度4回 札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	102,139	2024/06/20
26年度4回 神戸市公募公債	0.6060	100,000	102,455	2024/07/18
26年度1回 相模原市公募公債	0.5290	100,000	102,221	2024/09/20
26年度1回 長崎県公募公債	0.5540	100,000	102,345	2024/09/30
26年度1回 静岡県公募公債	0.5150	100,000	102,250	2024/11/25
26年度1回 三重県公募公債	0.4560	100,000	102,017	2024/12/25
26年度1回 浜松市公募公債	0.3350	100,000	101,482	2025/01/23
26年度3回 広島市公募公債	0.4290	100,000	101,962	2025/02/25
213回 神奈川県公募公債	0.5340	100,000	102,496	2025/03/19
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	200,000	205,056	2025/05/23
7回 東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	111,292	2025/09/19
27年度15回 愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	102,332	2025/11/27
153回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	102,353	2025/12/25
27年度9回 千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,263	2026/03/25
157回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,213	2026/04/24
159回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,934	2026/06/25
28年度6回 北海道公募公債	0.0700	100,000	99,787	2026/08/31
760回 東京都公募公債	0.0450	100,000	99,779	2026/09/18
413回 大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,524	2026/10/28
28年度8回 福岡県公募公債	0.2400	100,000	101,081	2027/02/24
419回 大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,699	2027/04/27
2回 静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	109,323	2027/06/25
5回 兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	104,138	2027/07/07
174回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	100,403	2027/09/24
24年度1回 福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	109,304	2027/11/29
178回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	101,072	2028/01/25
29年度13回 京都府公募公債	0.2000	109,330	110,266	2028/03/16
4回 静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	109,933	2028/06/23
30年度3回 広島県公募公債	0.2540	100,000	101,238	2028/09/25
6回 大阪府公募公債 20年	2.2100	200,000	235,954	2028/12/20
6回 北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	116,192	2028/12/20
189回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,898	2028/12/25
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	100,000	100,555	2028/12/28
18回 東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	118,568	2029/03/19
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	119,627	2029/12/20
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	120,251	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	99,516	2030/02/25
13回 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	116,660	2033/05/20
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	116,534	2034/05/26

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	
16回 名古屋市公募公債 20年	1.5200	100,000	116,481	2034/06/09
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	111,780	2035/02/16
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	112,458	2035/09/28
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	100,602	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	136,158	2037/03/19
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	136,730	2040/03/19
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	134,197	2042/09/19
小 計	-	6,735,330	7,147,889	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
142回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	100,000	101,361	2021/08/31
29回 地方公共団体金融機構債券	1.0250	100,000	101,499	2021/10/28
147回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	100,000	101,532	2021/10/29
36回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	100,000	101,851	2022/05/20
38回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8390	100,000	101,860	2022/07/15
170回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8010	100,000	101,886	2022/08/31
40回 地方公共団体金融機構債券	0.8250	100,000	101,989	2022/09/28
177回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8050	100,000	102,102	2022/11/30
101回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.7810	200,000	204,140	2022/12/20
44回 地方公共団体金融機構債券	0.7910	100,000	102,156	2023/01/27
19回 政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	101,948	2023/03/15
18回 国際協力機構債券	0.8680	100,000	102,693	2023/06/20
195回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	100,000	102,985	2023/07/31
202回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6990	105,000	107,583	2023/10/31
7回 広島県・広島市折半保証広島高速道路債券	0.6940	100,000	102,157	2024/02/28
211回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	102,533	2024/02/29
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	102,700	2024/05/31
220回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	205,370	2024/06/28
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	102,050	2024/09/20
21回 政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	102,209	2025/03/17
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,965	2025/04/25
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	102,281	2025/08/29
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	102,376	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	111,298	2025/12/19
40回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	103,059	2026/03/13
91回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	100,329	2026/12/14
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	100,536	2027/01/29
F147回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	216,160	2027/03/19
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	100,000	100,825	2027/04/13
98回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	100,896	2027/07/16
103回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	100,910	2027/12/17
124回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	109,915	2027/12/20
113回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	101,463	2028/10/16
93回 都市再生債券	1.1020	100,000	108,659	2029/06/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	100,000	119,181	2029/06/28
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	119,383	2029/12/28
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	106,199	2030/05/28

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券)	%	千円	千円	
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	120,607	2031/01/28
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	119,559	2031/09/19
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	118,731	2031/12/26
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	117,169	2032/07/28
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	114,882	2033/04/28
28回 日本道路・機構継債	2.8300	100,000	133,287	2033/12/20
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	116,557	2034/03/17
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	116,700	2034/04/28
159回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	111,302	2035/05/18
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	113,967	2035/06/20
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	114,414	2035/06/29
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	104,523	2037/04/28
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	103,417	2038/01/29
233回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	103,063	2038/04/20
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	126,671	2040/08/31
44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	13,141	13,689	2041/07/10
4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	13,623	14,180	2042/08/10
27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	22,917	24,575	2044/08/10
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	123,879	2045/06/20
38回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	31,547	33,341	2045/07/10
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	117,773	2046/01/31
49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	29,589	31,425	2046/06/10
52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	35,499	37,538	2046/09/10
53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	37,087	39,220	2046/10/10
60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	43,829	46,257	2047/05/10
64回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	95,090	99,728	2047/09/10
76回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	41,566	43,596	2048/09/10
82回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	49,185	51,224	2049/03/10
84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	49,443	51,535	2049/05/10
86回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	53,606	55,870	2049/07/10
90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	56,395	58,415	2049/11/10
93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	61,493	62,820	2050/02/10
96回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	69,531	71,595	2050/05/10
99回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	71,319	74,016	2050/08/10
117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	85,903	87,119	2052/02/10
118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	86,010	87,288	2052/03/10
119回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	86,072	87,294	2052/04/10
130回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	181,314	183,400	2053/03/10
137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	187,280	190,040	2053/10/10
142回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	95,506	95,825	2054/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	135,234	2055/03/19
小 計	-	7,304,945	7,809,776	-
(金融債券)	%	千円	千円	
326回 利附信中金債(5年)	0.0500	100,000	100,003	2022/01/27
331回 利附信中金債(5年)	0.0800	100,000	100,033	2022/06/27
342回 利附信中金債(5年)	0.1100	100,000	100,063	2023/05/26
小 計	-	300,000	300,099	-

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(普通社債券)	%	千円	千円	
36回 富士通社債	0.5620	100,000	100,427	2021/06/11
37回 東日本高速道路社債	0.0300	200,000	200,032	2021/06/18
31回 ホンダファイナンス社債	0.4180	100,000	100,290	2021/06/18
62回 日本電信電話債券	1.0200	100,000	101,189	2021/09/17
34回 東京瓦斯社債	1.0640	100,000	101,338	2021/09/22
53回 クレディセゾン社債	0.4350	100,000	100,288	2021/10/22
7回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,192	2022/05/10
79回 三菱商事社債	1.0220	100,000	101,497	2022/05/20
50回 野村ホールディングス社債	0.2200	100,000	99,952	2022/08/10
9回 東海旅客鉄道社債	1.7400	110,000	114,222	2022/09/20
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	100,000	105,199	2022/10/27
30回 大阪瓦斯社債	0.7590	100,000	101,631	2022/12/14
344回 東京交通債券	1.6700	100,000	104,266	2023/02/17
5回 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	99,462	2023/06/06
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	102,029	2023/06/20
26回 フランス相互信用連合銀行 (BF C M) 円貨社債 (2018)	0.4430	100,000	99,438	2023/10/12
56回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	102,635	2023/12/20
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	102,623	2024/04/25
2回 B P C E S A円貨社債 (ソーシャルボンド)	0.3670	100,000	99,304	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	102,817	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,415	2024/09/03
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	102,412	2024/10/28
321回 北海道電力社債	0.8860	100,000	102,490	2024/12/25
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,364	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	102,473	2025/05/21
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	103,122	2025/06/20
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	99,826	2026/05/26
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 (2016)	0.4000	100,000	99,287	2026/06/10
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,128	2026/09/18
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,526	2026/10/23
12回 リゾナ銀行劣後社債	2.4640	100,000	111,322	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	114,550	2027/04/20
32回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	114,681	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	103,352	2027/09/24
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,274	2027/10/22
54回 電源開発社債	0.3800	100,000	99,389	2027/11/19
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	100,000	100,007	2028/01/18
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	99,154	2028/10/25
21回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	116,917	2029/03/21
14回 プリヂェストン社債	0.3750	100,000	99,664	2029/04/19
65回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	117,127	2029/12/21
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	100,783	2036/06/02
527回 中部電力社債	0.8060	100,000	102,282	2037/10/23
26回 豊田通商社債	0.8970	100,000	99,741	2038/03/05
107回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	116,405	2045/01/27
小 計	-	4,610,000	4,749,522	-
合 計	-	145,345,275	157,051,485	-

■投資信託財産の構成

2020年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 157,051,485	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,122,759	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	158,174,245	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2020年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	158,174,245,216円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	837,974,952
公 社 債 (評価額)	157,051,485,604
未 収 利 息	252,464,741
前 払 費 用	32,319,919
(B) 負 債	85,420,000
未 払 解 約 金	85,420,000
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	158,088,825,216
元 本	126,035,115,497
次 期 繰 越 損 益 金	32,053,709,719
(D) 受 益 権 総 口 数	126,035,115,497口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C/D)	12,543円

(注1) 期首元本額 122,368,202,545円
追加設定元本額 53,145,336,589円
一部解約元本額 49,478,423,637円

(注2) 期末における元本の内訳
動的パッケージファンド<DC年金> 320,665,733円
コア資産形成ファンド 282,593,795円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ) 49,527,340,984円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定] 59,079,266,829円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定] 10,006,058,043円
MHAM動的パッケージ4資産ファンド[適格機関投資家限定] 6,819,190,113円
期末元本合計 126,035,115,497円

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2020年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,090,446,870円
受 取 利 息	1,091,066,146
支 払 利 息	△619,276
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△871,192,022
売 買 益	771,928,500
売 買 損	△1,643,120,522
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	219,254,848
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	31,016,391,162
(E) 解 約 差 損 益 金	△13,343,006,602
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	14,161,070,311
(G) 合 計 (C+D+E+F)	32,053,709,719
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	32,053,709,719

(注1) (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2) (E)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。
(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。