

運用報告書 (全体版)

第13期<決算日2021年5月10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、2021年5月10日に第13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
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
13期(2021年5月10日)	12,156	0	△0.7	386.71	△0.5	99.7	-	57,195

(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) 2020年5月8日	円 12,241	% -	388.67	% -	% 99.3	% -
5月末	12,220	△0.2	388.13	△0.1	99.7	-
6月末	12,168	△0.6	386.56	△0.5	99.6	-
7月末	12,209	△0.3	387.91	△0.2	99.1	-
8月末	12,149	△0.8	386.09	△0.7	99.4	-
9月末	12,183	△0.5	387.22	△0.4	99.3	-
10月末	12,162	△0.6	386.63	△0.5	103.2	-
11月末	12,176	△0.5	387.12	△0.4	99.5	-
12月末	12,177	△0.5	387.20	△0.4	99.6	-
2021年1月末	12,146	△0.8	386.25	△0.6	99.4	-
2月末	12,043	△1.6	383.06	△1.4	99.3	-
3月末	12,126	△0.9	385.72	△0.8	99.7	-
4月末	12,148	△0.8	386.44	△0.6	99.7	-
(期末) 2021年5月10日	円 12,156	% △0.7	386.71	% △0.5	% 99.7	% -

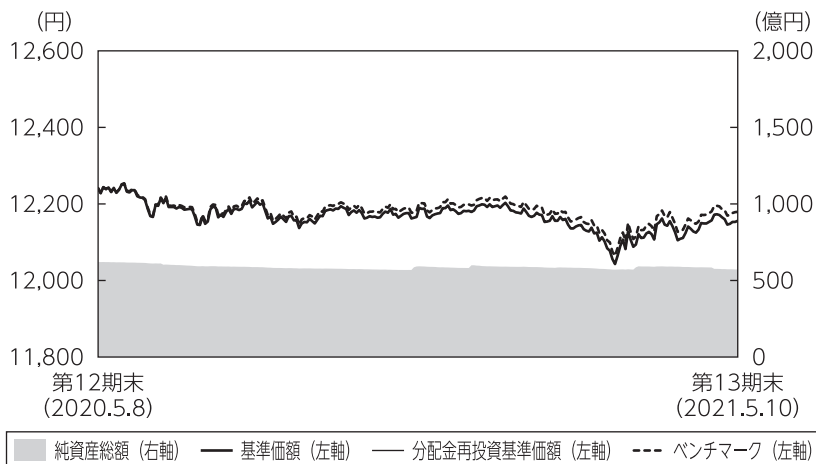
(注1) 騰落率は期首比です。

(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 (2020年5月9日から2021年5月10日まで)

基準価額等の推移



第13期首： 12,241円
第13期末： 12,156円
(既払分配金0円)
騰落率： △0.7%
(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、市況が下落（利回りは上昇）したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初から2020年12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から2021年2月にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に利回りは上昇しました。3月から期末にかけては日銀の黒田総裁が長期金利の変動幅拡大に否定的な見解を示したことや新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などから、上げ幅は縮小しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

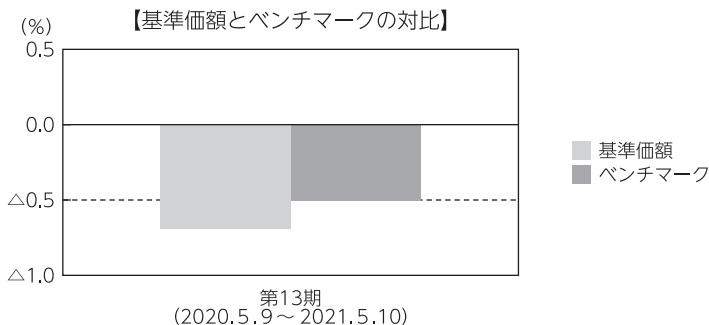
MHAM日本債券インデックスマザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●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0.5%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%と、信託報酬の影響を除くとベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。



(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
	2020年5月9日 ～2021年5月10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	2,156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13期		項目の概要
	(2020年5月9日 ～2021年5月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	19円	0.154%	(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12,168円です。 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
(投信会社)	(13)	(0.109)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(4)	(0.033)	
(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	19	0.155	

(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。

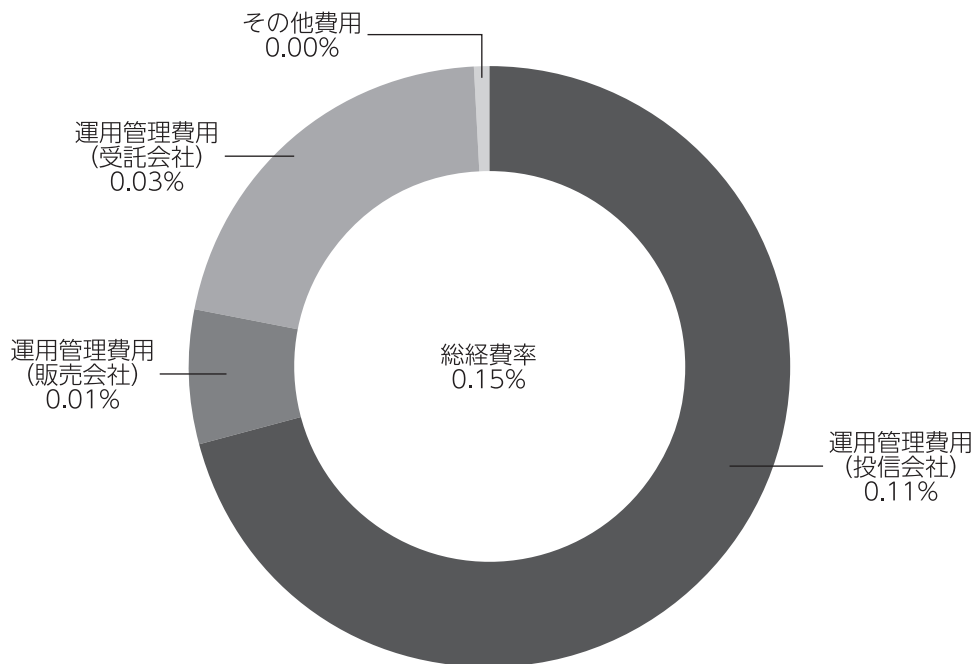
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.15%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（2020年5月9日から2021年5月10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 5,379,095	千円 6,701,362	千口 9,059,248	千円 11,307,032

■利害関係人との取引状況等（2020年5月9日から2021年5月10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 33,561	百万円 942	% 2.8	百万円 56,148	百万円 2,634	% 4.7

平均保有割合 43.8%

(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 49,527,340	千口 45,847,187	千円 57,194,366

■投資信託財産の構成

2021年5月10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 57,194,366	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	154,762	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	57,349,129	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

(2021年5月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	57,349,129,458円
コール・ローン等	38,329,480
MHAM日本債券インデックス マザーファンド(評価額)	57,194,366,978
未 収 入 金	116,433,000
(B) 負 債	153,133,134
未 払 解 約 金	118,957,547
未 払 信 託 報 酬	33,846,854
そ の 他 未 払 費 用	328,733
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	57,195,996,324
元 本	47,050,497,080
次 期 繰 越 損 益 金	10,145,499,244
(D) 受 益 権 総 口 数	47,050,497,080口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,156円

(注) 期首における元本額は50,754,193,586円、当期中における追加設定元本額は7,089,886,377円、同解約元本額は10,793,582,883円です。

■損益の状況

当期 自2020年5月9日 至2021年5月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△11,962円
受 取 利 息	1,774
支 払 利 息	△13,736
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△249,035,200
売 買 益 損	57,404,048
売 買 損 益	△306,439,248
(C) 信 託 報 酬 等	△90,916,617
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△339,963,779
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,242,068,961
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	9,243,394,062
(配 当 等 相 当 額)	(7,283,614,730)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,959,779,332)
(G) 合 計(D+E+F)	10,145,499,244
次 期 繰 越 損 益 金(G)	10,145,499,244
追 加 信 託 差 損 益 金	9,243,394,062
(配 当 等 相 当 額)	(7,288,524,706)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,954,869,356)
分 配 準 備 積 立 金	2,505,171,827
繰 越 損 益 金	△1,603,066,645

(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	352,588,693円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	7,640,327,417
(d) 分 配 準 備 積 立 金	2,152,583,134
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	10,145,499,244
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	2,156.30
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

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。

《お知らせ》

■信託報酬を年率0.105% (税込み0.1155%) に引き下げる所要の約款変更を行いました。

(2020年10月1日)

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第13期（決算日 2021年5月10日）

（計算期間 2020年5月9日～2021年5月10日）

MHAM日本債券インデックスマザーファンドの第13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			
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
13期(2021年5月10日)	12,475	△0.5	386.71	△0.5	99.7	—	132,895

(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）。

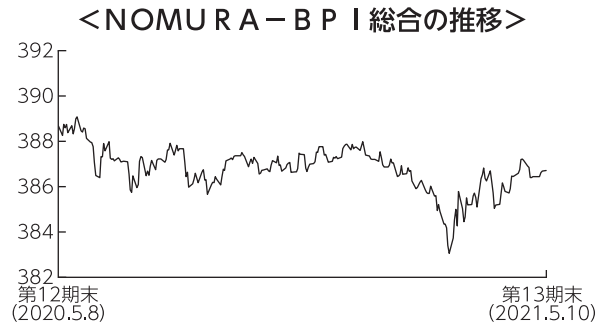
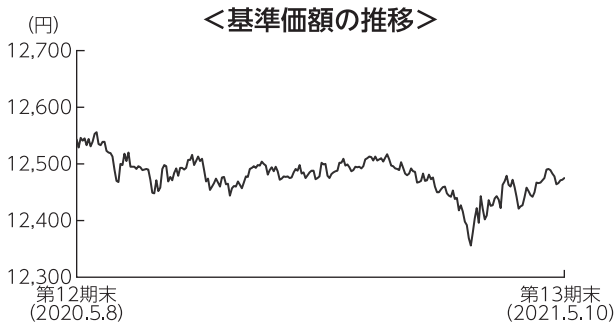
■当期中の基準価額と市況の推移

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	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年 5 月 8 日	円	%		%	%	%
	12,543	-	388.67	-	99.3	-
5 月 末	12,523	△0.2	388.13	△0.1	99.7	-
6 月 末	12,472	△0.6	386.56	△0.5	99.6	-
7 月 末	12,516	△0.2	387.91	△0.2	99.1	-
8 月 末	12,457	△0.7	386.09	△0.7	99.4	-
9 月 末	12,494	△0.4	387.22	△0.4	99.4	-
10 月 末	12,473	△0.6	386.63	△0.5	103.2	-
11 月 末	12,489	△0.4	387.12	△0.4	99.5	-
12 月 末	12,491	△0.4	387.20	△0.4	99.6	-
2021年 1 月 末	12,460	△0.7	386.25	△0.6	99.4	-
2 月 末	12,356	△1.5	383.06	△1.4	99.3	-
3 月 末	12,442	△0.8	385.72	△0.8	99.7	-
4 月 末	12,466	△0.6	386.44	△0.6	99.7	-
(期 末) 2021年 5 月 10 日	12,475	△0.5	386.71	△0.5	99.7	-

(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（2020年5月9日から2021年5月10日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は12,475円となり、前期末比で0.5%下落しました。

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、市況が下落（利回りは上昇）したことから、基準価額は下落しました。

投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初から2020年12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から2021年2月にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に利回りは上昇しました。3月から期末にかけては日銀の黒田総裁が長期金利の変動幅拡大に否定的な見解を示したことや新型コロナウイルスの感染再拡大への懸念などから、上げ幅は縮小しました。

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0.5%下落しました。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ありません。

■ 売買及び取引の状況 (2020年5月9日から2021年5月10日まで)

公社債

		買付額	売付額
国内	国債証券	31,716,283	54,231,414 (-)
	地方債証券	438,659	505,764 (-)
	特殊債証券	304,573	504,329 (118,497)
	社債証券	1,101,950	907,075 (-)

(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 (2020年5月9日から2021年5月10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	$\frac{D}{C}$
公社債	百万円 33,561	百万円 942	% 2.8	百万円 56,148	百万円 2,634	% 4.7

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	105,595,000	112,834,262	84.9	—	55.1	20.1	9.7
地 方 債 証 券	6,635,330	7,034,535	5.3	4.5	3.0	1.9	0.4
特殊債券（除く金融債券）	6,986,448	7,420,768	5.6	0.1	3.7	1.3	0.6
金 融 債 券	300,000	300,342	0.2	—	—	0.2	0.1
普 通 社 債 券	4,810,000	4,946,717	3.7	0.2	2.0	1.3	0.4
合 計	124,326,778	132,536,626	99.7	4.7	63.9	24.7	11.2

(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 3 2 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	1,160,000	1,162,900	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券（10年）	0.8000	750,000	757,702	2022/06/20
4 1 4 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	400,000	401,092	2022/07/01
4 1 6 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	500,000	501,570	2022/09/01
1 3 3 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	1,310,000	1,314,008	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券（10年）	0.8000	900,000	911,349	2022/09/20
4 1 7 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	600,000	602,004	2022/10/01
4 1 8 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	400,000	401,420	2022/11/01
4 1 9 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	800,000	802,992	2022/12/01
1 3 4 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	940,000	943,487	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券（10年）	0.7000	520,000	526,921	2022/12/20
3 2 7 回 利付国庫債券（10年）	0.8000	770,000	781,496	2022/12/20
5 9 回 利付国庫債券（20年）	1.7000	10,000	10,294	2022/12/20
4 2 0 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	600,000	602,322	2023/01/01
4 2 1 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	500,000	502,035	2023/02/01
4 2 2 回 利付国庫債券（2年）	0.1000	300,000	301,329	2023/03/01
1 3 5 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	1,200,000	1,205,244	2023/03/20
3 2 8 回 利付国庫債券（10年）	0.6000	1,140,000	1,155,492	2023/03/20
1 3 6 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	1,100,000	1,105,467	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券（10年）	0.8000	1,180,000	1,203,340	2023/06/20
1 3 7 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	1,010,000	1,015,736	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券（10年）	0.8000	910,000	930,265	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券（10年）	0.6000	500,000	508,765	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券（20年）	1.9000	30,000	31,446	2023/09/20
1 3 8 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	850,000	855,457	2023/12/20

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	
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,420,000	1,447,533	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	60,000	63,199	2023/12/20
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	830,000	835,834	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,380,000	1,409,490	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	50,000	52,918	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	700,000	705,243	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,310,000	1,340,274	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	50,000	53,958	2024/06/20
7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	40,000	42,916	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,050,000	1,058,326	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	1,160,000	1,184,870	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	110,000	118,301	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	910,000	917,589	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	440,000	450,054	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	770,000	782,012	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	40,000	43,090	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	40,000	43,236	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	700,000	706,237	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	1,100,000	1,122,594	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	40,000	43,449	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	70,000	75,494	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	40,000	43,294	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,050,000	1,059,975	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	1,070,000	1,093,422	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	60,000	65,018	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	50,000	54,388	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	90,000	98,271	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	950,000	959,367	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	1,060,000	1,084,401	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	160,000	174,872	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	153,626	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	900,000	908,757	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,110,000	1,131,345	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	70,000	77,169	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	170,000	186,622	2025/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	1,000,000	1,009,760	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	150,000	166,066	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	120,000	134,024	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	120,000	133,438	2026/03/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	1,220,000	1,231,895	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	240,000	269,443	2026/06/20
8 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	10,000	11,175	2026/06/20
3 4 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	1,010,000	1,020,059	2026/09/20
9 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	170,000	190,921	2026/09/20
9 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	110,000	124,130	2026/09/20
3 4 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	1,080,000	1,090,951	2026/12/20

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	
92回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	290,000	325,632	2026/12/20
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,270,000	1,283,068	2027/03/20
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	120,000	134,649	2027/03/20
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	220,000	248,151	2027/03/20
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	820,000	828,552	2027/06/20
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	200,000	229,082	2027/06/20
96回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	135,976	2027/06/20
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	910,000	919,591	2027/09/20
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	160,000	183,148	2027/09/20
98回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	182,128	2027/09/20
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	970,000	980,291	2027/12/20
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	300,000	343,008	2027/12/20
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,210,000	1,222,898	2028/03/20
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	230,000	265,700	2028/03/20
101回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	130,000	151,967	2028/03/20
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	940,000	949,381	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	140,000	164,354	2028/06/20
103回 利付国債 (20年)	2.3000	160,000	186,692	2028/06/20
104回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	126,782	2028/06/20
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	920,000	928,822	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	240,000	277,716	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	150,000	174,678	2028/09/20
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,070,000	1,079,779	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	200,000	232,318	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	290,000	332,441	2028/12/20
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	840,000	847,266	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	130,000	149,524	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	128,251	2029/03/20
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	990,000	998,019	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	170,000	200,329	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	190,000	222,357	2029/06/20
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	760,000	765,707	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	10,000	12,320	2029/09/20
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	469,844	2029/09/20
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,000,000	1,006,870	2029/12/20
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	270,000	318,276	2029/12/20
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	160,000	189,982	2029/12/20
358回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	950,000	955,871	2030/03/20
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	210,000	250,254	2030/03/20
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	420,000	496,801	2030/03/20
359回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,050,000	1,055,229	2030/06/20
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	245,000	288,583	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	170,000	197,155	2030/06/20
120回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	270,000	308,229	2030/06/20
360回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,050,000	1,054,399	2030/09/20
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	293,095	2030/09/20

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	
1 2 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	220,000	255,873	2030/09/20
3 6 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	1,000,000	1,002,860	2030/12/20
1 2 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	400,000	477,744	2030/12/20
1 2 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	210,000	248,810	2030/12/20
1 2 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	240,000	289,903	2031/03/20
1 2 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	170,000	202,021	2031/03/20
1 2 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	220,000	259,285	2031/03/20
1 2 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	350,000	413,672	2031/06/20
1 2 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	170,000	199,223	2031/06/20
1 3 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	330,000	387,730	2031/09/20
1 3 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	190,000	221,289	2031/09/20
1 3 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	310,000	361,884	2031/12/20
1 3 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	340,000	400,475	2031/12/20
1 3 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	270,000	318,786	2032/03/20
1 3 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	190,000	222,292	2032/03/20
1 3 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	220,000	255,032	2032/03/20
1 3 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	250,000	293,142	2032/06/20
1 3 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	260,000	299,171	2032/06/20
1 3 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	270,000	313,637	2032/06/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	500,000	587,890	2032/09/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	400,000	471,292	2032/12/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.8000	200,000	237,930	2032/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	320,000	374,054	2033/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	280,000	324,035	2033/03/20
1 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	1.7000	50,000	59,182	2033/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	540,000	639,165	2033/06/20
1 2 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.1000	30,000	37,054	2033/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.7000	530,000	628,553	2033/09/20
1 3 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.0000	50,000	61,296	2033/12/20
1 4 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.6000	600,000	705,492	2033/12/20
1 4 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.4000	50,000	63,989	2034/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	550,000	641,234	2034/03/20
1 5 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	60,000	77,827	2034/06/20
1 4 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.5000	570,000	665,509	2034/06/20
1 6 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	90,000	117,090	2034/09/20
1 5 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.4000	580,000	670,572	2034/09/20
1 7 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.4000	70,000	90,405	2034/12/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.2000	530,000	599,430	2034/12/20
1 8 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.3000	80,000	102,514	2035/03/20
1 5 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.2000	580,000	656,432	2035/03/20
1 9 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.3000	80,000	102,771	2035/06/20
1 5 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.3000	550,000	630,421	2035/06/20
2 0 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.5000	130,000	171,145	2035/09/20
1 5 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.2000	460,000	521,304	2035/09/20
2 1 回 利付国庫債券 (3 0 年)	2.3000	110,000	142,087	2035/12/20
1 5 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.0000	530,000	586,031	2035/12/20

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	
22回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	70,000	92,694	2036/03/20
156回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	510,000	519,465	2036/03/20
23回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	150,000	199,138	2036/06/20
157回 利付国庫債券 (20年)	0.2000	480,000	474,086	2036/06/20
24回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	80,000	106,470	2036/09/20
158回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	510,000	525,748	2036/09/20
25回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	130,000	169,530	2036/12/20
159回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	480,000	501,844	2036/12/20
26回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	220,000	291,035	2037/03/20
160回 利付国庫債券 (20年)	0.7000	430,000	455,688	2037/03/20
161回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	440,000	459,223	2037/06/20
27回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	269,042	2037/09/20
162回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	520,000	542,214	2037/09/20
163回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	450,000	468,760	2037/12/20
28回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	290,000	392,056	2038/03/20
164回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	620,000	635,307	2038/03/20
165回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	420,000	429,819	2038/06/20
29回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	300,000	402,303	2038/09/20
166回 利付国庫債券 (20年)	0.7000	380,000	401,109	2038/09/20
167回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	390,000	398,049	2038/12/20
30回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	310,000	412,290	2039/03/20
168回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	330,000	330,825	2039/03/20
169回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	400,000	393,244	2039/06/20
31回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	260,000	342,394	2039/09/20
170回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	370,000	363,047	2039/09/20
171回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	380,000	372,126	2039/12/20
32回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	360,000	482,475	2040/03/20
172回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	400,000	398,252	2040/03/20
173回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	500,000	496,910	2040/06/20
33回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	450,000	580,423	2040/09/20
174回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	450,000	446,787	2040/09/20
175回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	460,000	464,981	2040/12/20
34回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	380,000	506,293	2041/03/20
35回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	460,000	598,009	2041/09/20
36回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	520,000	678,210	2042/03/20
37回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	470,000	605,759	2042/09/20
38回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	290,000	369,010	2043/03/20
39回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	310,000	401,598	2043/06/20
40回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	240,000	306,136	2043/09/20
41回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	280,000	351,828	2043/12/20
42回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	260,000	327,017	2044/03/20
43回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	250,000	314,755	2044/06/20
44回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	290,000	365,469	2044/09/20
45回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	290,000	353,104	2044/12/20
46回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	420,000	511,702	2045/03/20
47回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	350,000	434,703	2045/06/20

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	
48回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	330,000	394,924	2045/09/20
49回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	360,000	430,999	2045/12/20
50回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	350,000	370,349	2046/03/20
51回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	330,000	310,427	2046/06/20
52回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	330,000	325,241	2046/09/20
53回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	300,000	302,349	2046/12/20
54回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	300,000	316,620	2047/03/20
55回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	370,000	390,224	2047/06/20
56回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	310,000	326,712	2047/09/20
57回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	310,000	326,473	2047/12/20
1回 利付国庫債券 (40年)	2.4000	110,000	159,485	2048/03/20
58回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	430,000	452,506	2048/03/20
59回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	340,000	349,146	2048/06/20
60回 利付国庫債券 (30年)	0.9000	270,000	290,401	2048/09/20
61回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	280,000	286,630	2048/12/20
2回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	150,000	211,060	2049/03/20
62回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	310,000	301,161	2049/03/20
63回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	330,000	311,500	2049/06/20
64回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	340,000	320,409	2049/09/20
65回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	300,000	282,246	2049/12/20
3回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	150,000	212,167	2050/03/20
66回 利付国庫債券 (30年)	0.4000	270,000	253,597	2050/03/20
67回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	360,000	356,464	2050/06/20
68回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	370,000	365,889	2050/09/20
69回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	370,000	375,524	2050/12/20
4回 利付国庫債券 (40年)	2.2000	270,000	383,759	2051/03/20
70回 利付国庫債券 (30年)	0.7000	50,000	50,688	2051/03/20
5回 利付国庫債券 (40年)	2.0000	240,000	330,060	2052/03/20
6回 利付国庫債券 (40年)	1.9000	290,000	392,929	2053/03/20
7回 利付国庫債券 (40年)	1.7000	280,000	365,537	2054/03/20
8回 利付国庫債券 (40年)	1.4000	290,000	354,287	2055/03/20
9回 利付国庫債券 (40年)	0.4000	510,000	467,782	2056/03/20
10回 利付国庫債券 (40年)	0.9000	420,000	451,189	2057/03/20
11回 利付国庫債券 (40年)	0.8000	330,000	344,206	2058/03/20
12回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	400,000	377,184	2059/03/20
13回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	390,000	367,294	2060/03/20
小 計	-	105,595,000	112,834,262	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
115回 共同発行市場公募地方債	0.8000	100,000	101,153	2022/10/25
118回 共同発行市場公募地方債	0.8400	100,000	101,421	2023/01/25
368回 大阪府公募公債 10年	0.8300	100,000	101,398	2023/01/30
719回 東京都公募公債	0.8600	200,000	203,162	2023/03/20
1回 東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	103,231	2023/06/20
25年度6回 千葉県公募公債	0.8000	100,000	101,880	2023/09/25
29回1号 宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	101,649	2023/10/25
127回 共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	101,649	2023/10/25

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2回 島根県公募公債	0.6700	106,000	107,786	2023/11/27
25年度8回 埼玉県公募公債	0.7030	100,000	101,823	2023/12/25
25年度2回 新潟県公募公債	0.6700	100,000	101,854	2024/02/28
132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	101,870	2024/03/25
26年度4回 札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	101,648	2024/06/20
26年度4回 神戸市公募公債	0.6060	100,000	101,900	2024/07/18
26年度1回 相模原市公募公債	0.5290	100,000	101,745	2024/09/20
26年度1回 長崎県公募公債	0.5540	100,000	101,843	2024/09/30
26年度1回 静岡県公募公債	0.5150	100,000	101,776	2024/11/25
26年度1回 三重県公募公債	0.4560	100,000	101,598	2024/12/25
26年度1回 浜松市公募公債	0.3350	100,000	101,184	2025/01/23
26年度3回 広島市公募公債	0.4290	100,000	101,568	2025/02/25
213回 神奈川県公募公債	0.5340	100,000	101,997	2025/03/19
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	200,000	204,366	2025/05/23
7回 東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	109,375	2025/09/19
27年度15回 愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	102,097	2025/11/27
153回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	102,123	2025/12/25
27年度9回 千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,414	2026/03/25
157回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,415	2026/04/24
159回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	200,306	2026/06/25
28年度6回 北海道公募公債	0.0700	100,000	100,105	2026/08/31
760回 東京都公募公債	0.0450	100,000	100,026	2026/09/18
413回 大阪府公募公債 10年	0.0210	100,000	99,841	2026/10/28
28年度8回 福岡県公募公債	0.2400	100,000	101,068	2027/02/24
419回 大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,778	2027/04/27
2回 静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	108,182	2027/06/25
5回 兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	103,751	2027/07/07
174回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	100,507	2027/09/24
24年度1回 福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	108,251	2027/11/29
178回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	101,102	2028/01/25
29年度13回 京都府公募公債	0.2000	109,330	110,335	2028/03/16
4回 静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	108,908	2028/06/23
30年度3回 広島県公募公債	0.2540	100,000	101,275	2028/09/25
6回 大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	232,138	2028/12/20
6回 北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	114,621	2028/12/20
189回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,864	2028/12/25
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	100,000	100,675	2028/12/28
18回 東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	116,584	2029/03/19
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	117,698	2029/12/20
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	118,351	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	99,695	2030/02/25
令和2年度 10回 静岡県公募公債	0.1350	100,000	99,815	2030/09/20
9回 京都市公募公債 20年	2.1430	200,000	237,856	2030/12/17
13回 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	116,090	2033/05/20
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	115,923	2034/05/26
16回 名古屋市公募公債 20年	1.5200	100,000	115,868	2034/06/09

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	
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	111,527	2035/02/16
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	112,066	2035/09/28
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	100,788	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	134,103	2037/03/19
2019年度5回 福岡市公募公債 20年	0.2860	100,000	96,997	2039/07/29
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	133,750	2040/03/19
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	131,765	2042/09/19
小 計	-	6,635,330	7,034,535	-
(特殊債券 (除く金融債券))	%	千円	千円	
38回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8390	100,000	101,007	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	101,068	2022/08/31
40回 地方公共団体金融機構債券	0.8250	100,000	101,129	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	101,278	2022/11/30
101回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.7810	200,000	202,490	2022/12/20
44回 地方公共団体金融機構債券	0.7910	100,000	101,341	2023/01/27
19回 政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	101,261	2023/03/15
18回 国際協力機構債券	0.8680	100,000	101,790	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	102,016	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	106,807	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	101,693	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	101,841	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	101,987	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	203,972	2024/06/28
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	101,596	2024/09/20
71回 鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	101,760	2024/11/27
21回 政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	101,671	2025/03/17
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,493	2025/04/25
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	102,427	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,850	2025/08/29
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	102,131	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	109,486	2025/12/19
40回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	103,049	2026/03/13
91回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	100,391	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	100,543	2027/01/29
F147回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	213,932	2027/03/19
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	100,000	100,736	2027/04/13
98回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	100,771	2027/07/16
103回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	100,757	2027/12/17
124回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	108,653	2027/12/20
113回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	101,137	2028/10/16
93回 都市再生債券	1.1020	100,000	107,630	2029/06/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	100,000	117,051	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	117,173	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	105,529	2030/05/28
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	118,648	2031/01/28
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	117,687	2031/09/19

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券 (除く金融債券))	%	千円	千円	
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	116,836	2031/12/26
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 2 0年	1.6800	100,000	115,670	2032/07/28
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	113,758	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	100,000	131,067	2033/12/20
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	115,397	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 2 0年	1.5660	100,000	115,657	2034/04/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	110,284	2035/05/18
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	112,699	2035/06/20
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	113,417	2035/06/29
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 2 0年	0.6690	100,000	103,570	2037/04/28
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	103,074	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	102,094	2038/04/20
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	123,977	2040/08/31
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	11,787	12,080	2041/07/10
4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	12,037	12,336	2042/08/10
2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	20,138	21,378	2044/08/10
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	120,322	2045/06/20
3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	26,566	28,061	2045/07/10
2 6 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	115,151	2046/01/31
4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	25,053	26,473	2046/06/10
5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	31,093	32,806	2046/09/10
5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	32,435	34,231	2046/10/10
6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	39,325	41,425	2047/05/10
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	86,532	90,573	2047/09/10
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	37,671	39,443	2048/09/10
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	44,105	45,832	2049/03/10
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	44,774	46,568	2049/05/10
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	48,738	50,691	2049/07/10
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	50,949	52,690	2049/11/10
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	56,492	57,619	2050/02/10
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	63,247	65,016	2050/05/10
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	65,496	67,857	2050/08/10
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	81,184	82,120	2052/02/10
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	81,148	82,142	2052/03/10
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	80,890	81,827	2052/04/10
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	171,072	172,784	2053/03/10
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	177,076	179,429	2053/10/10
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	90,640	90,901	2054/03/10
1 6 2 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	127,721	2055/03/19
小 計	-	6,986,448	7,420,768	-
(金融債券)	%	千円	千円	
3 3 1 回 利附信金中金債 (5年)	0.0800	100,000	100,061	2022/06/27
3 4 2 回 利附信金中金債 (5年)	0.1100	100,000	100,153	2023/05/26
い第8 4 3号 利付商工債	0.1200	100,000	100,128	2025/08/27
小 計	-	300,000	300,342	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 0 回 野村ホールディングス社債	0.2200	100,000	100,055	2022/08/10
9 回 東海旅客鉄道社債	1.7400	110,000	112,588	2022/09/20

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(普通社債券)	%	千円	千円	
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	100,000	103,148	2022/10/27
30回 大阪瓦斯社債	0.7590	100,000	101,189	2022/12/14
344回 東京交通債券	1.6700	100,000	102,928	2023/02/17
5回 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	100,122	2023/06/06
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	101,675	2023/06/20
26回 フランス相互信用連合銀行 (BF CM) 円貨社債 (2018)	0.4430	100,000	100,280	2023/10/12
56回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	101,879	2023/12/20
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	102,378	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	100,109	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	102,772	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,740	2024/09/03
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	101,775	2024/10/28
321回 北海道電力社債	0.8860	100,000	102,840	2024/12/25
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,726	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	102,199	2025/05/21
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	102,886	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	103,651	2025/06/20
27回 首都高速道路社債	0.0600	100,000	100,022	2025/12/19
26回 トヨタ自動車	0.0500	100,000	100,048	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	100,000	100,035	2026/03/24
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,657	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	99,587	2026/06/10
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	101,309	2026/09/18
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	100,730	2026/10/23
12回 リソな銀行劣後社債	2.4640	100,000	110,514	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	112,441	2027/04/20
32回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	113,563	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	104,072	2027/09/24
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,904	2027/10/22
54回 電源開発社債	0.3800	100,000	101,048	2027/11/19
56回 三菱UFJリソース社債	0.4550	100,000	101,503	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	100,704	2028/10/25
21回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	115,992	2029/03/21
14回 プリヂェストン社債	0.3750	100,000	100,567	2029/04/19
65回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	116,508	2029/12/21
67回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	200,428	2030/01/31
425回 中国電力社債	0.3700	100,000	100,666	2030/06/25
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	200,000	201,976	2030/09/20
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	100,901	2036/06/02
527回 中部電力社債	0.8060	100,000	103,550	2037/10/23
26回 豊田通商社債	0.8970	100,000	102,638	2038/03/05
466回 九州電力社債	0.7200	100,000	101,633	2038/07/23
55回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	95,585	2039/09/13
107回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	114,196	2045/01/27
小 計	-	4,810,000	4,946,717	-
合 計	-	124,326,778	132,536,626	-

■投資信託財産の構成

2021年5月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 132,536,626	% 99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	474,996	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	133,011,622	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

(2021年5月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	133,011,622,675円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	235,199,048
公 社 債 (評価額)	132,536,626,110
未 収 利 息	232,229,542
前 払 費 用	7,567,975
(B) 負 債	116,433,000
未 払 解 約 金	116,433,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	132,895,189,675
元 本	106,529,046,220
次 期 繰 越 損 益 金	26,366,143,455
(D) 受 益 権 総 口 数	106,529,046,220口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額 (C / D)	12,475円

(注1) 期首元本額 126,035,115,497円
追加設定元本額 21,734,219,717円
一部解約元本額 41,240,288,994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> 272,696,151円
コア資産形成ファンド 217,703,694円
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ) 45,847,187,959円
MHAM動的パッケージファンド[適格機関投資家限定] 40,250,305,329円
MHAM日本債券パッシブファンド[適格機関投資家限定] 15,700,379,454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] 4,240,773,633円
期末元本合計 106,529,046,220円

■損益の状況

当期 自2020年5月9日 至2021年5月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,038,368,253円
受 取 利 息	1,038,717,982
支 払 利 息	△349,729
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,809,244,794
売 買 益	53,301,978
売 買 損	△1,862,546,772
(C) 当 期 損 益 金 (A + B)	△770,876,541
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	32,053,709,719
(E) 解 約 差 損 益 金	△10,273,900,006
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,357,210,283
(G) 合 計 (C + D + E + F)	26,366,143,455
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	26,366,143,455

(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。