

運用報告書 (全体版)

第9期<決算日2019年5月8日>

MHAM日本債券インデックスファンド

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	信託期間は無期限です。 (当初設定日は2010年11月19日です。)	
運用方針	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	MHAM日本債券インデックスファンド	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。
組入制限	MHAM日本債券インデックスファンド	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場動向等を勘案して決定します。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」は、2019年5月8日に第9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/>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債組入比率	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
5期(2015年5月8日)	10,675	0	1.9	362.38	2.4	99.7	-	126
6期(2016年5月9日)	11,364	0	6.5	387.68	7.0	99.6	-	148
7期(2017年5月8日)	11,074	0	△2.6	379.64	△2.1	99.5	-	221
8期(2018年5月8日)	11,085	0	0.1	381.90	0.6	99.2	-	228
9期(2019年5月8日)	11,221	0	1.2	388.40	1.7	99.5	-	245

(注1) 基準価額は1万円当たり(以下同じ)。

(注2) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

(注3) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、債券組入比率および債券先物比率は実質比率を記載しております(以下同じ)。

(注4) 債券先物比率は買建比率-売建比率(以下同じ)。

(注5) 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)。

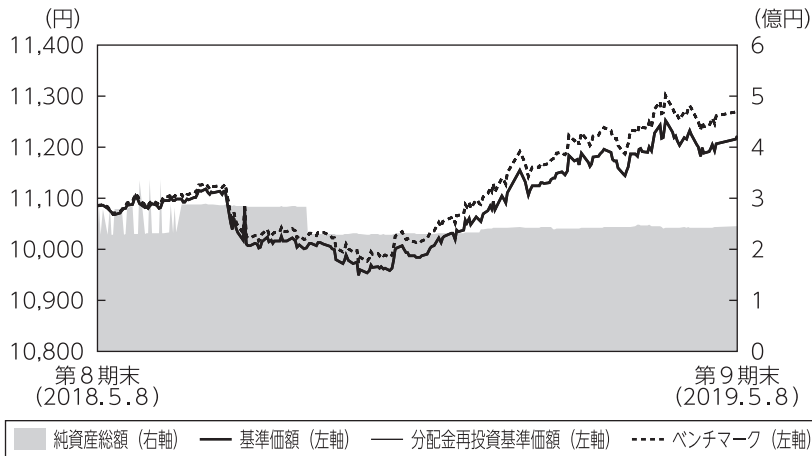
当期中の基準価額と市況推移

	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入比率	債券先物比率	
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
(期首)2018年5月8日	円	%		%	%	%	
	11,085	-	381.90	-	99.2	-	
第9期	5月末	11,097	0.1	382.50	0.2	98.8	-
	6月末	11,097	0.1	382.67	0.2	99.4	-
	7月末	11,073	△0.1	381.98	0.0	99.4	-
	8月末	11,009	△0.7	379.89	△0.5	99.1	-
	9月末	10,978	△1.0	378.99	△0.8	99.0	-
	10月末	10,993	△0.8	379.64	△0.6	99.3	-
	11月末	11,034	△0.5	381.24	△0.2	99.0	-
	12月末	11,111	0.2	384.13	0.6	99.7	-
	2019年1月末	11,153	0.6	385.58	1.0	99.6	-
	2月末	11,173	0.8	386.43	1.2	99.4	-
	3月末	11,247	1.5	389.14	1.9	99.7	-
	4月末	11,207	1.1	387.94	1.6	99.6	-
(期末)2019年5月8日	11,221	1.2	388.40	1.7	99.5	-	

(注) 騰落率は対期首比。

当期中の運用経過 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

基準価額等の推移



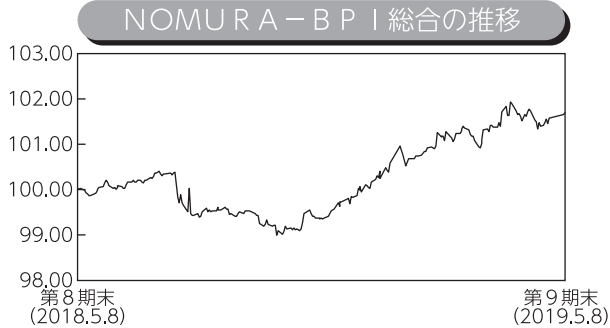
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまが利用するコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマーク (NOMURA-BPI総合) は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

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、市況が上昇 (金利は低下) したことが寄与し、基準価額は上昇しました。

投資環境

●国内債券市場

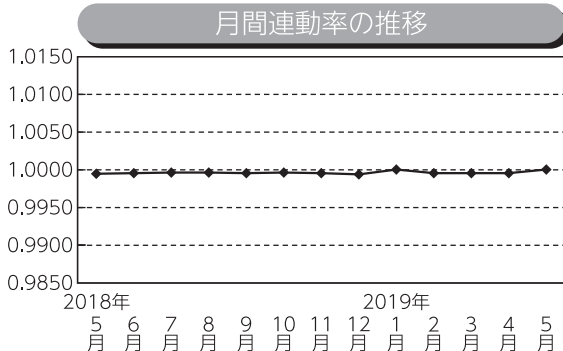


(注) 期首を100として指数化しています。

国内債券市場は、前期末対比で上昇しました。期首から6月にかけては、日銀が「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続するなか、海外の長期金利の動向等をにらみつつ、上昇基調で推移しました。7月から10月にかけては、日銀の大規模金融緩和の修正観測などを背景に下落に転じました。その後は、世界景気の減速懸念や米中貿易摩擦の悪化懸念、欧米の政治リスクの高まりなどを背景に、再び上昇に転じました。国内債券市場の好需給や、米連邦準備制度理事会（FRB）の金融引き締めに対する慎重姿勢なども上昇要因となり、期末にかけて上昇基調で推移しました。

ポートフォリオについて

●MHAM日本債券インデックスファンド



$$\text{月間連動率} = \frac{1 + \text{基準価額月間騰落率}}{1 + \text{ベンチマーク月間騰落率}}$$

(注) 月間連動率の2018年5月は対期首比、2019年5月は期末対2019年4月末比

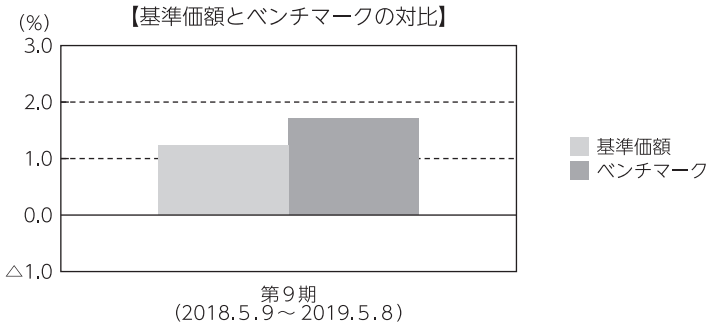
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●MHAM日本債券インデックスマザーファンド

当期の運用につきましては、当マザーファンドの運用方針に従い、NOMURA-BPI総合への連動性維持を目指した運用を行いました。

ベンチマークとの差異について

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、当ファンドの基準価額はベンチマークを0.5%程度下回りました。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
	2018年5月9日 ～2019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	1,431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。

(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

- MHAM日本債券インデックスファンド

今後の運用につきましても、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

今後の運用につきましても、債券の組入比率を高位に保ち、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。

1 万口当たりの費用明細

項目	第9期 (2018年5月9日 ～2019年5月8日)		項目の概要
	金額	比率	
	(a) 信託報酬	52円	
(投信会社)	(24)	(0.216)	
(販売会社)	(24)	(0.216)	
(受託会社)	(4)	(0.032)	
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) 有価証券取引税	－	－	(c) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	0	0.002	(d) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(保管費用)	(－)	(－)	保管費用は、外国での資産の保管等に要する費用
(監査費用)	(0)	(0.002)	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
(その他)	(－)	(－)	その他は、信託事務の処理に要する諸費用
合計	52	0.466	

(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、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、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。

期中の売買及び取引の状況 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	635,535	783,747	624,954	770,330

(注) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

当期中における利害関係人との取引状況はありません。

【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】

(1) 当期中の利害関係人との取引状況

区 分	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 63,383	百万円 6,477	10.2	百万円 63,422	百万円 2,431	3.8

平均保有割合=0.2%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該子ファンドの親投資信託所有口数の割合。

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
公 社 債	百万円 -	百万円 100	百万円 -

*金額の単位未満は切捨て。

*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、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、みずほ銀行、みずほ証券です。

組入資産の明細

2019年5月8日現在

親投資信託残高

種 類	期首 (前期末)		当 期 末	
	□ 数	千円	□ 数	千円
MHAM日本債券インデックスマザーファンド		184,911		195,492
				245,049

(注) 単位未満は切捨て。

※当期末における親投資信託の組入資産の明細は、15～25頁をご参照ください。

投資信託財産の構成

2019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	245,049	99.7%
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	739	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	245,788	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

2019年5月8日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	245,788,649円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	739,168
MHAM日本債券インデックス マザーファンド(評価額)	245,049,481
(B) 負 債	734,943
未 払 解 約 金	178,581
未 払 信 託 報 酬	554,332
そ の 他 未 払 費 用	2,030
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	245,053,706
元 本	218,381,613
次 期 繰 越 損 益 金	26,672,093
(D) 受 益 権 総 口 数	218,381,613口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,221円

- (注1) 当期末における1口当たり純資産額 1,1221円
(注2) その他未払費用 監査費用等を計上しています。
(注3) 期首元本額 205,690,125円
期中追加設定元本額 805,849,844円
期中一部解約元本額 793,158,356円

損益の状況

(2018年5月9日から2019年5月8日まで)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△ 214円
支 払 利 息	△ 214
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	3,978,229
売 買 損 益	5,069,568
売 買 損 益	△ 1,091,339
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,165,505
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,812,510
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,397
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	23,850,186
(配 当 等 相 当 額)	(28,113,936)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 4,263,750)
(G) 計 (D+E+F)	26,672,093
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	26,672,093
追 加 信 託 差 損 益 金	23,850,186
(配 当 等 相 当 額)	(28,432,402)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 4,582,216)
分 配 準 備 積 立 金	2,821,907

- (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、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

※ 本運用報告書作成時点においては、当計算期間に係る当ファンドの監査は終了していません。

－ 運用報告書（全体版） －

MHAM日本債券インデックスマザーファンド

第11期

決算日：2019年5月8日

(計算期間：2018年5月9日～2019年5月8日)

「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」は、2019年5月8日に第11期決算を行いました。

ここに当マザーファンドの第11期の運用状況をご報告申し上げます。

■マザーファンドの仕組み

信託期間	信託期間は無期限です。 (当初設定日は2008年6月3日です。)
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。
投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な投資制限	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 総額
	期騰 落	中 率	期騰 落	中 率			
7期(2015年5月8日)	円	%		%	%	%	百万円
	11,704	2.3	362.38	2.4	99.7	-	58,344
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

(注1) 基準価額は1万口当たり(以下同じ)。

(注2) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

(注3) 債券先物比率は買建比率-売建比率(以下同じ)。

(注4) 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)。

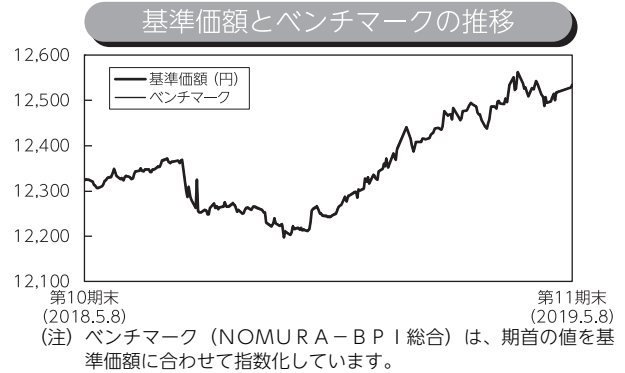
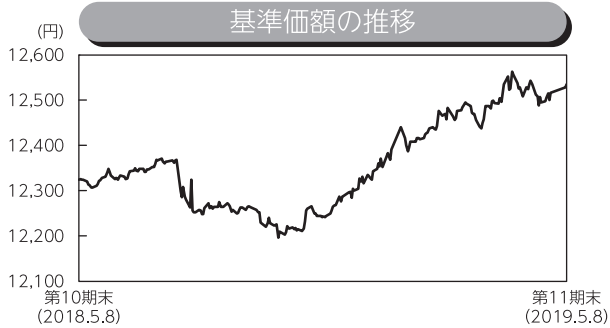
当期中の基準価額と市況推移

	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)2018年5月8日	円	%		%	%	%	
	12,324	-	381.90	-	99.3	-	
第 11 期	5月末	12,342	0.1	382.50	0.2	98.9	-
	6月末	12,347	0.2	382.67	0.2	99.4	-
	7月末	12,325	0.0	381.98	0.0	99.4	-
	8月末	12,258	△0.5	379.89	△0.5	99.1	-
	9月末	12,228	△0.8	378.99	△0.8	99.0	-
	10月末	12,250	△0.6	379.64	△0.6	99.3	-
	11月末	12,301	△0.2	381.24	△0.2	99.0	-
	12月末	12,391	0.5	384.13	0.6	99.7	-
	2019年1月末	12,443	1.0	385.58	1.0	99.6	-
	2月末	12,470	1.2	386.43	1.2	99.4	-
	3月末	12,557	1.9	389.14	1.9	99.7	-
4月末	12,517	1.6	387.94	1.6	99.6	-	
(期末)2019年5月8日	12,535	1.7	388.40	1.7	99.5	-	

(注) 騰落率は対期首比。

当期中の運用経過 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

【基準価額等の推移】



【基準価額の主な変動要因】

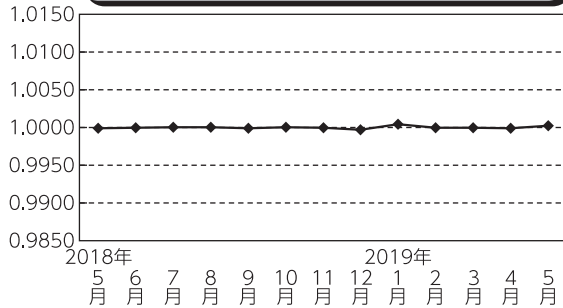
当ファンドでは、主として国内債券への投資を行った結果、市況が上昇（金利は低下）したことが影響し、基準価額は上昇しました。

【投資環境】

3頁をご参照ください。

【ポートフォリオ】

月間連動率の推移



3頁をご参照ください。

$$\text{月間連動率} = \frac{1 + \text{基準価額月間騰落率}}{1 + \text{ベンチマーク月間騰落率}}$$

(注) 月間連動率の2018年5月は対期首比、2019年5月は期末対2019年4月末比

【ベンチマークとの差異】

当ファンドの基準価額とベンチマークであるNOMURA-BPI総合を比較しますと、NOMURA-BPI総合の騰落率が+1.7%であるのに対し、当ファンドは+1.7%とベンチマークと同程度となりました。

今後の運用方針

5頁をご参照ください。

1 万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	(2018年5月9日~2019年5月8日)		
	金額 (円)	比率 (%)	
平均基準価額	12,369	-	-
(a) 売買委託手数料 (先物・オプション)	0 (0)	0.000 (0.000)	(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、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
合計	0	0.000	

(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。

(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。

期中の売買及び取引の状況 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

(1) 公社債

	買付額	売付額
国内	千円	千円
国債証券	59,317,393	60,599,554
地方債証券	1,035,819	608,245
特殊債証券	1,266,331	1,008,987 (111,434)
社債券(投資法人債券を含む)	1,764,204	1,205,713

(注1) 金額は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注2) 単位未満は切捨て。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 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)は含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種類別	買建		売建	
	新規買付額	決済額	新規売付額	決済額
国内	百万円	百万円	百万円	百万円
債券先物取引	5,575	5,576	-	-

(注) 単位未満は切捨て。

利害関係人との取引状況等 (2018年5月9日から2019年5月8日まで)

(1) 当期中の利害関係人との取引状況

区 分	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 63,383	百万円 6,477	10.2	百万円 63,422	百万円 2,431	3.8

(注) 公社債には現先などによるものを含まません。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当		期
	買 付 額	売 付 額	当期末保有額
公 社 債	百万円 -	百万円 100	百万円 -

*金額の単位未満は切捨て。

*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係る利害関係人とは、みずほ銀行、みずほ証券です。

組入資産の明細

2019年5月8日現在

国内（邦貨建）公社債

A 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	119,175,000	130,316,654	85.0	—	54.7	21.1	9.2
地 方 債 証 券	7,435,330	7,894,879	5.1	—	3.3	1.3	0.6
特 殊 債 券(除く金融債)	7,753,418	8,313,234	5.4	—	4.1	1.1	0.2
金 融 債 券	400,000	400,592	0.3	—	—	0.2	0.1
普通社債券(含む投資法人債券)	5,510,000	5,708,106	3.7	—	1.7	1.5	0.5
合 計	140,273,748	152,633,465	99.5	—	63.7	25.2	10.6

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

(注3) —印は組入れなし。

(注4) 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 個別銘柄開示

銘 柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
国 債 証 券	第391回 利付国債（2年）	0.1	750,000	752,445	2020/8/1
	第392回 利付国債（2年）	0.1	950,000	953,315	2020/9/1
	第393回 利付国債（2年）	0.1	500,000	501,855	2020/10/1
	第394回 利付国債（2年）	0.1	400,000	401,572	2020/11/1
	第395回 利付国債（2年）	0.1	430,000	431,784	2020/12/1
	第398回 利付国債（2年）	0.1	600,000	602,832	2021/3/1
	第124回 利付国債（5年）	0.1	1,370,000	1,374,055	2020/6/20
	第125回 利付国債（5年）	0.1	1,230,000	1,234,464	2020/9/20
	第126回 利付国債（5年）	0.1	1,360,000	1,365,834	2020/12/20
	第127回 利付国債（5年）	0.1	960,000	964,752	2021/3/20
	第128回 利付国債（5年）	0.1	1,280,000	1,287,193	2021/6/20
	第129回 利付国債（5年）	0.1	1,560,000	1,569,812	2021/9/20
	第130回 利付国債（5年）	0.1	1,250,000	1,258,700	2021/12/20
	第131回 利付国債（5年）	0.1	1,340,000	1,350,210	2022/3/20
	第132回 利付国債（5年）	0.1	1,160,000	1,169,802	2022/6/20
	第133回 利付国債（5年）	0.1	1,360,000	1,372,661	2022/9/20
	第134回 利付国債（5年）	0.1	1,390,000	1,403,900	2022/12/20
	第135回 利付国債（5年）	0.1	1,410,000	1,425,072	2023/3/20
	第136回 利付国債（5年）	0.1	1,000,000	1,011,390	2023/6/20
	第137回 利付国債（5年）	0.1	1,010,000	1,021,988	2023/9/20
	第138回 利付国債（5年）	0.1	1,000,000	1,012,560	2023/12/20
第139回 利付国債（5年）	0.1	350,000	354,630	2024/3/20	
第1回 利付国債（40年）	2.4	110,000	165,852	2048/3/20	

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国 債 証 券	第2回 利付国債 (40年)	2.2	230,000	336,400	2049/3/20
	第3回 利付国債 (40年)	2.2	250,000	368,557	2050/3/20
	第4回 利付国債 (40年)	2.2	300,000	445,680	2051/3/20
	第5回 利付国債 (40年)	2.0	310,000	445,646	2052/3/20
	第6回 利付国債 (40年)	1.9	310,000	438,860	2053/3/20
	第7回 利付国債 (40年)	1.7	320,000	435,292	2054/3/20
	第8回 利付国債 (40年)	1.4	360,000	457,135	2055/3/20
	第9回 利付国債 (40年)	0.4	500,000	471,235	2056/3/20
	第10回 利付国債 (40年)	0.9	530,000	588,130	2057/3/20
	第11回 利付国債 (40年)	0.8	340,000	365,459	2058/3/20
	第308回 利付国債 (10年)	1.3	360,000	365,889	2020/6/20
	第309回 利付国債 (10年)	1.1	1,000,000	1,014,130	2020/6/20
	第310回 利付国債 (10年)	1.0	820,000	833,087	2020/9/20
	第311回 利付国債 (10年)	0.8	350,000	354,627	2020/9/20
	第312回 利付国債 (10年)	1.2	1,290,000	1,318,534	2020/12/20
	第313回 利付国債 (10年)	1.3	940,000	965,643	2021/3/20
	第314回 利付国債 (10年)	1.1	670,000	685,771	2021/3/20
	第315回 利付国債 (10年)	1.2	830,000	854,045	2021/6/20
	第316回 利付国債 (10年)	1.1	480,000	492,883	2021/6/20
	第317回 利付国債 (10年)	1.1	410,000	422,324	2021/9/20
	第318回 利付国債 (10年)	1.0	850,000	873,528	2021/9/20
	第319回 利付国債 (10年)	1.1	480,000	495,955	2021/12/20
	第320回 利付国債 (10年)	1.0	1,360,000	1,401,629	2021/12/20
	第321回 利付国債 (10年)	1.0	590,000	609,770	2022/3/20
	第322回 利付国債 (10年)	0.9	500,000	515,315	2022/3/20
	第323回 利付国債 (10年)	0.9	560,000	578,760	2022/6/20
	第324回 利付国債 (10年)	0.8	750,000	772,777	2022/6/20
	第325回 利付国債 (10年)	0.8	1,480,000	1,528,603	2022/9/20
	第326回 利付国債 (10年)	0.7	520,000	536,458	2022/12/20
	第327回 利付国債 (10年)	0.8	1,220,000	1,263,053	2022/12/20
	第328回 利付国債 (10年)	0.6	1,390,000	1,431,616	2023/3/20
	第329回 利付国債 (10年)	0.8	1,430,000	1,487,471	2023/6/20
	第330回 利付国債 (10年)	0.8	1,060,000	1,105,230	2023/9/20
	第331回 利付国債 (10年)	0.6	500,000	516,935	2023/9/20
第332回 利付国債 (10年)	0.6	1,420,000	1,470,864	2023/12/20	
第333回 利付国債 (10年)	0.6	1,480,000	1,535,870	2024/3/20	
第334回 利付国債 (10年)	0.6	1,410,000	1,466,019	2024/6/20	
第335回 利付国債 (10年)	0.5	1,270,000	1,316,088	2024/9/20	
第336回 利付国債 (10年)	0.5	640,000	664,313	2024/12/20	
第337回 利付国債 (10年)	0.3	920,000	944,518	2024/12/20	
第338回 利付国債 (10年)	0.4	1,220,000	1,261,175	2025/3/20	
第339回 利付国債 (10年)	0.4	1,370,000	1,418,251	2025/6/20	
第340回 利付国債 (10年)	0.4	1,310,000	1,357,618	2025/9/20	
第341回 利付国債 (10年)	0.3	1,260,000	1,299,186	2025/12/20	
第342回 利付国債 (10年)	0.1	1,400,000	1,425,746	2026/3/20	
第343回 利付国債 (10年)	0.1	1,390,000	1,416,006	2026/6/20	

銘柄		当 期 末				
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
国債証券	第344回	利付国債 (10年)	0.1	1,310,000	1,334,890	2026/9/20
	第345回	利付国債 (10年)	0.1	1,130,000	1,151,763	2026/12/20
	第346回	利付国債 (10年)	0.1	1,160,000	1,182,596	2027/3/20
	第347回	利付国債 (10年)	0.1	1,220,000	1,243,521	2027/6/20
	第348回	利付国債 (10年)	0.1	1,030,000	1,049,590	2027/9/20
	第349回	利付国債 (10年)	0.1	1,160,000	1,181,703	2027/12/20
	第350回	利付国債 (10年)	0.1	1,520,000	1,547,861	2028/3/20
	第351回	利付国債 (10年)	0.1	1,160,000	1,180,253	2028/6/20
	第352回	利付国債 (10年)	0.1	960,000	976,300	2028/9/20
	第353回	利付国債 (10年)	0.1	770,000	782,666	2028/12/20
	第354回	利付国債 (10年)	0.1	200,000	203,074	2029/3/20
	第1回	利付国債 (30年)	2.8	10,000	12,916	2029/9/20
	第11回	利付国債 (30年)	1.7	50,000	61,007	2033/6/20
	第12回	利付国債 (30年)	2.1	30,000	38,389	2033/9/20
	第13回	利付国債 (30年)	2.0	50,000	63,411	2033/12/20
	第14回	利付国債 (30年)	2.4	50,000	66,452	2034/3/20
	第15回	利付国債 (30年)	2.5	60,000	80,899	2034/6/20
	第16回	利付国債 (30年)	2.5	90,000	121,677	2034/9/20
	第17回	利付国債 (30年)	2.4	70,000	93,817	2034/12/20
	第18回	利付国債 (30年)	2.3	80,000	106,238	2035/3/20
	第19回	利付国債 (30年)	2.3	80,000	106,476	2035/6/20
	第20回	利付国債 (30年)	2.5	130,000	177,667	2035/9/20
	第21回	利付国債 (30年)	2.3	110,000	147,149	2035/12/20
	第22回	利付国債 (30年)	2.5	70,000	96,106	2036/3/20
	第23回	利付国債 (30年)	2.5	150,000	206,578	2036/6/20
	第24回	利付国債 (30年)	2.5	80,000	110,419	2036/9/20
	第25回	利付国債 (30年)	2.3	130,000	175,262	2036/12/20
	第26回	利付国債 (30年)	2.4	220,000	301,136	2037/3/20
	第27回	利付国債 (30年)	2.5	200,000	278,534	2037/9/20
	第28回	利付国債 (30年)	2.5	290,000	405,710	2038/3/20
	第29回	利付国債 (30年)	2.4	300,000	415,692	2038/9/20
	第30回	利付国債 (30年)	2.3	410,000	562,659	2039/3/20
	第31回	利付国債 (30年)	2.2	360,000	489,409	2039/9/20
	第32回	利付国債 (30年)	2.3	440,000	609,787	2040/3/20
	第33回	利付国債 (30年)	2.0	520,000	691,948	2040/9/20
	第34回	利付国債 (30年)	2.2	520,000	716,097	2041/3/20
	第35回	利付国債 (30年)	2.0	500,000	670,435	2041/9/20
	第36回	利付国債 (30年)	2.0	550,000	740,536	2042/3/20
	第37回	利付国債 (30年)	1.9	580,000	770,854	2042/9/20
	第38回	利付国債 (30年)	1.8	370,000	484,951	2043/3/20
	第39回	利付国債 (30年)	1.9	300,000	400,731	2043/6/20
	第40回	利付国債 (30年)	1.8	280,000	368,261	2043/9/20
	第41回	利付国債 (30年)	1.7	280,000	362,381	2043/12/20
	第42回	利付国債 (30年)	1.7	280,000	362,723	2044/3/20
第43回	利付国債 (30年)	1.7	300,000	389,007	2044/6/20	
第44回	利付国債 (30年)	1.7	370,000	480,774	2044/9/20	

銘柄		当 期 末				
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
国債証券	第45回	利付国債 (30年)	1.5	360,000	450,964	2044/12/20
	第46回	利付国債 (30年)	1.5	430,000	538,966	2045/3/20
	第47回	利付国債 (30年)	1.6	390,000	498,888	2045/6/20
	第48回	利付国債 (30年)	1.4	400,000	492,468	2045/9/20
	第49回	利付国債 (30年)	1.4	420,000	517,297	2045/12/20
	第50回	利付国債 (30年)	0.8	430,000	464,950	2046/3/20
	第51回	利付国債 (30年)	0.3	390,000	372,262	2046/6/20
	第52回	利付国債 (30年)	0.5	400,000	401,932	2046/9/20
	第53回	利付国債 (30年)	0.6	370,000	380,826	2046/12/20
	第54回	利付国債 (30年)	0.8	440,000	475,772	2047/3/20
	第55回	利付国債 (30年)	0.8	430,000	464,658	2047/6/20
	第56回	利付国債 (30年)	0.8	400,000	431,956	2047/9/20
	第57回	利付国債 (30年)	0.8	370,000	399,285	2047/12/20
	第58回	利付国債 (30年)	0.8	490,000	528,406	2048/3/20
	第59回	利付国債 (30年)	0.7	330,000	346,773	2048/6/20
	第60回	利付国債 (30年)	0.9	330,000	364,267	2048/9/20
	第61回	利付国債 (30年)	0.7	300,000	314,664	2048/12/20
	第62回	利付国債 (30年)	0.5	50,000	49,613	2049/3/20
	第46回	利付国債 (20年)	2.2	40,000	41,064	2020/6/22
	第59回	利付国債 (20年)	1.7	10,000	10,680	2022/12/20
	第64回	利付国債 (20年)	1.9	30,000	32,724	2023/9/20
	第65回	利付国債 (20年)	1.9	60,000	65,763	2023/12/20
	第67回	利付国債 (20年)	1.9	50,000	55,048	2024/3/20
	第70回	利付国債 (20年)	2.4	50,000	56,615	2024/6/20
	第71回	利付国債 (20年)	2.2	40,000	44,880	2024/6/20
	第72回	利付国債 (20年)	2.1	110,000	123,491	2024/9/20
	第73回	利付国債 (20年)	2.0	40,000	44,909	2024/12/20
	第74回	利付国債 (20年)	2.1	40,000	45,136	2024/12/20
	第75回	利付国債 (20年)	2.1	40,000	45,363	2025/3/20
	第76回	利付国債 (20年)	1.9	70,000	78,557	2025/3/20
	第77回	利付国債 (20年)	2.0	40,000	45,126	2025/3/20
	第78回	利付国債 (20年)	1.9	60,000	67,653	2025/6/20
	第79回	利付国債 (20年)	2.0	50,000	56,687	2025/6/20
	第80回	利付国債 (20年)	2.1	90,000	102,591	2025/6/20
	第81回	利付国債 (20年)	2.0	160,000	182,230	2025/9/20
	第82回	利付国債 (20年)	2.1	140,000	160,351	2025/9/20
	第83回	利付国債 (20年)	2.1	70,000	80,579	2025/12/20
	第84回	利付国債 (20年)	2.0	170,000	194,554	2025/12/20
	第85回	利付国債 (20年)	2.1	150,000	173,463	2026/3/20
	第86回	利付国債 (20年)	2.3	120,000	140,434	2026/3/20
	第87回	利付国債 (20年)	2.2	120,000	139,603	2026/3/20
	第88回	利付国債 (20年)	2.3	240,000	282,285	2026/6/20
第89回	利付国債 (20年)	2.2	10,000	11,690	2026/6/20	
第90回	利付国債 (20年)	2.2	170,000	199,685	2026/9/20	
第91回	利付国債 (20年)	2.3	110,000	130,027	2026/9/20	
第92回	利付国債 (20年)	2.1	290,000	340,007	2026/12/20	

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
国債証券	第93回 利付国債 (20年)	2.0	120,000	140,360	2027/3/20
	第94回 利付国債 (20年)	2.1	220,000	259,076	2027/3/20
	第95回 利付国債 (20年)	2.3	200,000	239,760	2027/6/20
	第96回 利付国債 (20年)	2.1	120,000	141,889	2027/6/20
	第97回 利付国債 (20年)	2.2	160,000	191,292	2027/9/20
	第98回 利付国債 (20年)	2.1	160,000	189,940	2027/9/20
	第99回 利付国債 (20年)	2.1	300,000	357,516	2027/12/20
	第100回 利付国債 (20年)	2.2	230,000	277,179	2028/3/20
	第101回 利付国債 (20年)	2.4	130,000	158,990	2028/3/20
	第102回 利付国債 (20年)	2.4	140,000	171,957	2028/6/20
	第103回 利付国債 (20年)	2.3	160,000	195,054	2028/6/20
	第104回 利付国債 (20年)	2.1	110,000	132,078	2028/6/20
	第105回 利付国債 (20年)	2.1	240,000	289,240	2028/9/20
	第106回 利付国債 (20年)	2.2	150,000	182,190	2028/9/20
	第107回 利付国債 (20年)	2.1	200,000	241,900	2028/12/20
	第108回 利付国債 (20年)	1.9	390,000	464,158	2028/12/20
	第109回 利付国債 (20年)	1.9	280,000	334,283	2029/3/20
	第110回 利付国債 (20年)	2.1	360,000	436,932	2029/3/20
	第111回 利付国債 (20年)	2.2	170,000	208,780	2029/6/20
	第112回 利付国債 (20年)	2.1	390,000	475,004	2029/6/20
	第113回 利付国債 (20年)	2.1	600,000	733,284	2029/9/20
	第114回 利付国債 (20年)	2.1	400,000	490,476	2029/12/20
	第115回 利付国債 (20年)	2.2	160,000	197,894	2029/12/20
	第116回 利付国債 (20年)	2.2	210,000	260,610	2030/3/20
	第117回 利付国債 (20年)	2.1	370,000	455,144	2030/3/20
	第118回 利付国債 (20年)	2.0	295,000	360,779	2030/6/20
	第119回 利付国債 (20年)	1.8	280,000	336,204	2030/6/20
	第120回 利付国債 (20年)	1.6	250,000	294,622	2030/6/20
	第121回 利付国債 (20年)	1.9	390,000	473,959	2030/9/20
	第122回 利付国債 (20年)	1.8	330,000	397,293	2030/9/20
	第123回 利付国債 (20年)	2.1	380,000	471,876	2030/12/20
	第124回 利付国債 (20年)	2.0	200,000	246,036	2030/12/20
	第125回 利付国債 (20年)	2.2	330,000	414,892	2031/3/20
	第126回 利付国債 (20年)	2.0	300,000	370,080	2031/3/20
	第127回 利付国債 (20年)	1.9	220,000	268,789	2031/3/20
	第128回 利付国債 (20年)	1.9	450,000	551,245	2031/6/20
	第129回 利付国債 (20年)	1.8	250,000	303,230	2031/6/20
	第130回 利付国債 (20年)	1.8	400,000	486,336	2031/9/20
第131回 利付国債 (20年)	1.7	310,000	373,097	2031/9/20	
第132回 利付国債 (20年)	1.7	350,000	422,138	2031/12/20	
第133回 利付国債 (20年)	1.8	350,000	426,520	2031/12/20	
第134回 利付国債 (20年)	1.8	420,000	512,954	2032/3/20	
第135回 利付国債 (20年)	1.7	190,000	229,626	2032/3/20	
第136回 利付国債 (20年)	1.6	260,000	310,910	2032/3/20	
第137回 利付国債 (20年)	1.7	250,000	302,760	2032/6/20	
第138回 利付国債 (20年)	1.5	260,000	308,115	2032/6/20	

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国 債 証 券	第139回 利付国債 (20年)	1.6	270,000	323,473	2032/6/20
	第140回 利付国債 (20年)	1.7	640,000	776,608	2032/9/20
	第141回 利付国債 (20年)	1.7	440,000	534,930	2032/12/20
	第142回 利付国債 (20年)	1.8	380,000	467,092	2032/12/20
	第143回 利付国債 (20年)	1.6	490,000	590,092	2033/3/20
	第144回 利付国債 (20年)	1.5	240,000	285,746	2033/3/20
	第145回 利付国債 (20年)	1.7	710,000	866,306	2033/6/20
	第146回 利付国債 (20年)	1.7	630,000	770,042	2033/9/20
	第147回 利付国債 (20年)	1.6	580,000	701,788	2033/12/20
	第148回 利付国債 (20年)	1.5	620,000	742,226	2034/3/20
	第149回 利付国債 (20年)	1.5	570,000	683,224	2034/6/20
	第150回 利付国債 (20年)	1.4	750,000	888,817	2034/9/20
	第151回 利付国債 (20年)	1.2	640,000	739,718	2034/12/20
	第152回 利付国債 (20年)	1.2	620,000	716,974	2035/3/20
	第153回 利付国債 (20年)	1.3	690,000	809,121	2035/6/20
	第154回 利付国債 (20年)	1.2	660,000	763,989	2035/9/20
	第155回 利付国債 (20年)	1.0	590,000	664,298	2035/12/20
	第156回 利付国債 (20年)	0.4	560,000	574,985	2036/3/20
	第157回 利付国債 (20年)	0.2	650,000	644,663	2036/6/20
	第158回 利付国債 (20年)	0.5	630,000	655,666	2036/9/20
第159回 利付国債 (20年)	0.6	620,000	654,955	2036/12/20	
第160回 利付国債 (20年)	0.7	580,000	622,496	2037/3/20	
第161回 利付国債 (20年)	0.6	480,000	506,044	2037/6/20	
第162回 利付国債 (20年)	0.6	500,000	526,570	2037/9/20	
第163回 利付国債 (20年)	0.6	600,000	631,176	2037/12/20	
第164回 利付国債 (20年)	0.5	630,000	650,745	2038/3/20	
第165回 利付国債 (20年)	0.5	490,000	505,430	2038/6/20	
第166回 利付国債 (20年)	0.7	500,000	533,675	2038/9/20	
第167回 利付国債 (20年)	0.5	500,000	514,235	2038/12/20	
第168回 利付国債 (20年)	0.4	100,000	100,834	2039/3/20	
小 計			119,175,000	130,316,654	
地 方 債 証 券	第1回 東京都公募公債 (20年)	1.54	100,000	106,299	2023/6/20
	第7回 東京都公募公債 (20年)	2.16	100,000	113,609	2025/9/19
	第18回 東京都公募公債 (20年)	2.22	100,000	120,823	2029/3/19
	第21回 東京都公募公債 (20年)	2.19	100,000	121,775	2029/12/20
	第687回 東京都公募公債	1.12	100,000	101,514	2020/9/18
	第719回 東京都公募公債	0.86	200,000	206,568	2023/3/20
	第760回 東京都公募公債	0.045	100,000	100,110	2026/9/18
	平成28年度第6回 北海道公募公債	0.07	100,000	100,255	2026/8/31
	平成30年度第14回 北海道公募公債	0.195	100,000	100,858	2028/12/28
	第29回 1号宮城県公募公債 (10年)	0.68	100,000	102,989	2023/10/25
	第3回 神奈川県公募公債 (30年)	2.62	100,000	137,572	2037/3/19
	第176回 神奈川県公募公債	1.16	100,000	101,569	2020/9/18
	第213回 神奈川県公募公債	0.534	100,000	103,010	2025/3/19
	第13回 大阪府公募公債 (20年)	1.203	100,000	112,697	2035/9/28
	第368回 大阪府公募公債 (10年)	0.83	100,000	102,981	2023/1/30

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413回 大阪府公募公債 (10年)	0.021	100,000	99,858	2026/10/28
	第419回 大阪府公募公債 (10年)	0.196	100,000	101,118	2027/4/27
	平成29年度第13回 京都府公募公債	0.2	109,330	110,580	2028/3/16
	第2回 兵庫県公募公債 (30年)	2.36	100,000	135,256	2040/3/19
	第5回 兵庫県公募公債 (12年)	0.687	100,000	105,136	2027/7/7
	第2回 静岡県公募公債 (15年)	1.406	100,000	111,116	2027/6/25
	第4回 静岡県公募公債 (15年)	1.338	100,000	111,397	2028/6/23
	平成24年度第12回 愛知県公募公債 (30年)	2.12	100,000	133,326	2042/9/19
	平成27年度第15回 愛知県公募公債 (10年)	0.471	100,000	102,885	2025/11/27
	平成30年度第3回 広島県公募公債	0.254	100,000	101,525	2028/9/25
	第13回 埼玉県公募公債 (20年)	1.599	100,000	118,056	2033/5/20
	第15回 埼玉県公募公債 (20年)	1.166	100,000	112,545	2035/2/16
	平成25年度第8回 埼玉県公募公債	0.703	100,000	103,209	2023/12/25
	平成24年度第1回 福岡県公募公債 (15年)	1.329	100,000	110,903	2027/11/29
	平成28年度第8回 福岡県公募公債	0.24	100,000	101,634	2027/2/24
	第21回 千葉県公募公債 (20年)	0.424	100,000	100,148	2036/10/15
	平成25年度第6回 千葉県公募公債	0.8	100,000	103,459	2023/9/25
	平成27年度第9回 千葉県公募公債	0.095	100,000	100,446	2026/3/25
	平成25年度第2回 新潟県公募公債	0.67	100,000	103,173	2024/2/28
	第7回 群馬県公募公債 (10年)	1.08	100,000	101,659	2020/11/25
	第87回 共同発行市場公募地方債	1.29	100,000	101,449	2020/6/25
	第94回 共同発行市場公募地方債	1.24	100,000	102,113	2021/1/25
	第97回 共同発行市場公募地方債	1.38	100,000	102,683	2021/4/23
	第100回 共同発行市場公募地方債	1.21	100,000	102,649	2021/7/23
	第105回 共同発行市場公募地方債	1.07	100,000	102,788	2021/12/24
	第115回 共同発行市場公募地方債	0.8	100,000	102,737	2022/10/25
	第118回 共同発行市場公募地方債	0.84	100,000	103,084	2023/1/25
	第127回 共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,989	2023/10/25
	第132回 共同発行市場公募地方債	0.66	100,000	103,170	2024/3/25
	第146回 共同発行市場公募地方債	0.553	200,000	206,432	2025/5/23
	第153回 共同発行市場公募地方債	0.469	100,000	102,906	2025/12/25
	第157回 共同発行市場公募地方債	0.08	120,000	120,416	2026/4/24
第159回 共同発行市場公募地方債	0.07	200,000	200,568	2026/6/25	
第174回 共同発行市場公募地方債	0.145	100,000	100,792	2027/9/24	
第178回 共同発行市場公募地方債	0.23	100,000	101,430	2028/1/25	
平成23年度第2回 堺市公募公債	1.06	100,000	102,742	2021/12/17	
平成26年度第1回 長崎県公募公債	0.554	100,000	102,879	2024/9/30	
平成25年度第2回 島根県公募公債	0.67	106,000	109,185	2023/11/27	
平成22年度第1回 栃木県公募公債	1.05	100,000	101,627	2020/11/30	
平成23年度第1回 新潟市公募公債 (10年)	1.06	100,000	102,757	2021/12/22	
平成27年度第1回 奈良県公募公債	0.101	100,000	100,142	2020/11/30	
平成26年度第1回 静岡市公募公債	0.515	100,000	102,746	2024/11/25	
平成26年度第1回 浜松市公募公債	0.335	100,000	101,799	2025/1/23	
第6回 大阪市公募公債 (20年)	2.21	200,000	240,320	2028/12/20	
第16回 名古屋市公募公債 (20年)	1.52	100,000	117,690	2034/6/9	

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	平成26年度第4回 神戸市公募公債	0.606	100,000	103,040	2024/7/18
	平成23年度第5回 横浜市公募公債	1.011	100,000	102,728	2022/1/28
	第29回 横浜市公募公債(20年)	1.528	100,000	117,762	2034/5/26
	平成26年度第4回 札幌市公募公債(10年)	0.54	100,000	102,658	2024/6/20
	第6回 北九州市公募公債(20年)	2.03	100,000	118,331	2028/12/20
	平成26年度第3回 広島市公募公債	0.429	100,000	102,371	2025/2/25
	第8回 さいたま市公募公債	1.21	100,000	101,956	2020/12/24
	平成26年度第1回 相模原市公募公債	0.529	100,000	102,730	2024/9/20
	平成26年度第1回 三重県公募公債	0.456	100,000	102,455	2024/12/25
	第7回 広島県・広島市半保証広島高速道路債券	0.694	100,000	102,696	2024/2/28
小 計			7,435,330	7,894,879	
特殊債券 (除く金融債)	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	100,000	121,320	2029/12/28
	第116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	126,004	2040/8/31
	第124回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.2	101,000	103,064	2020/12/28
	第133回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	116,000	119,089	2021/4/30
	第142回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	102,421	2021/8/31
	第147回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.0	100,000	102,591	2021/10/29
	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	100,000	120,164	2031/12/26
	第170回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.801	100,000	102,808	2022/8/31
	第177回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.805	100,000	103,034	2022/11/30
	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	100,000	115,923	2033/4/28
	第195回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.911	100,000	104,050	2023/7/31
	第202回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.699	105,000	108,507	2023/10/31
	第211回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.66	100,000	103,398	2024/2/29
	第218回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.66	100,000	103,577	2024/5/31
	第220回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	200,000	207,098	2024/6/28
	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	100,000	115,158	2035/6/29
	第254回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.44	100,000	103,068	2025/8/29
	第268回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.28	100,000	117,285	2046/1/31
	第300回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.115	100,000	101,240	2027/1/29
	第337回 政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.591	100,000	103,509	2038/1/29
	第19回 政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.668	100,000	102,751	2023/3/15
	第40回 政府保証日本政策金融公庫債券	0.02	103,000	103,459	2026/3/13
	第24回 政府保証地方公共団体金融機構債券	1.1	100,000	102,345	2021/5/25
	第36回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.901	100,000	102,871	2022/5/20
	第38回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.839	100,000	102,819	2022/7/15
	第71回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.391	100,000	102,607	2025/4/25
	第91回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.085	100,000	100,991	2026/12/14
	第98回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	101,601	2027/7/16
	第103回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.155	100,000	101,509	2027/12/17
	第113回 政府保証地方公共団体金融機構債券	0.219	100,000	101,923	2028/10/16
第21回 政府保証中部国際空港債券	0.45	100,000	102,907	2025/3/17	
第78回 日本政策投資銀行社債	0.225	100,000	101,142	2027/4/13	
第28回 道路債券	2.83	100,000	135,707	2033/12/20	
第75回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.96	100,000	120,877	2031/9/19	
第101回 日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.781	200,000	205,504	2022/12/20	

銘柄		当 期 末				
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
特 殊 債 券 (除く金融債)	第124回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.55	100,000	117,607	2034/3/17
	第139回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.5	100,000	102,382	2024/9/20
	第155回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.3	100,000	114,420	2035/6/20
	第159回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.607	100,000	122,319	2045/6/20
	第162回	日本高速道路保有・債務返済機構債券	1.861	100,000	131,169	2055/3/19
	第1回	地方公共団体金融機構債券(20年)	2.266	100,000	121,261	2029/6/28
	第13回	地方公共団体金融機構債券(20年)	2.132	100,000	122,281	2031/1/28
	第15回	地方公共団体金融機構債券	1.093	100,000	101,401	2020/8/28
	第23回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.68	100,000	118,230	2032/7/28
	第29回	地方公共団体金融機構債券	1.025	100,000	102,486	2021/10/28
	第36回	地方公共団体金融機構債券(20年)	1.566	100,000	117,882	2034/4/28
	第40回	地方公共団体金融機構債券	0.825	100,000	102,728	2022/9/28
	第44回	地方公共団体金融機構債券	0.791	100,000	102,868	2023/1/27
	第59回	地方公共団体金融機構債券(20年)	0.669	100,000	104,249	2037/4/28
	第147回	地方公共団体金融機構債券	1.291	200,000	219,096	2027/3/19
	第23回	国際協力銀行債券	2.09	100,000	113,490	2025/12/19
	第93回	都市再生債券	1.102	100,000	109,488	2029/6/20
	第4回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.29	15,779	16,639	2042/8/10
	第27回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.05	26,086	28,086	2044/8/10
	第38回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.61	36,551	38,839	2045/7/10
	第44回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3	14,847	15,678	2041/7/10
	第49回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.76	33,874	36,159	2046/6/10
	第52回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	40,290	42,782	2046/9/10
	第53回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	41,815	44,392	2046/10/10
	第60回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	49,289	52,226	2047/5/10
	第64回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.16	106,204	111,641	2047/9/10
	第76回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.21	46,490	48,903	2048/9/10
	第82回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0	54,787	57,153	2049/3/10
	第84回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	56,431	58,900	2049/5/10
	第86回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0	59,852	62,468	2049/7/10
	第90回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.87	62,561	64,886	2049/11/10
	第93回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6	67,926	69,476	2050/2/10
	第96回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.74	76,739	79,134	2050/5/10
	第99回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	77,946	81,069	2050/8/10
	第117回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	91,121	92,438	2052/2/10
	第118回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	91,369	92,759	2052/3/10
	第119回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	91,426	92,752	2052/4/10
	第124回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.428	100,000	111,253	2027/12/20
	第130回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	191,020	193,440	2053/3/10
	第137回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.47	196,142	199,276	2053/10/10
第142回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.32	99,873	100,258	2054/3/10	
第159回	一般担保住宅金融支援機構債券	1.125	100,000	111,691	2035/5/18	
第172回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.501	100,000	102,670	2025/11/20	
第233回	一般担保住宅金融支援機構債券	0.583	100,000	102,414	2038/4/20	
第18回	国際協力機構債券	0.868	100,000	103,488	2023/6/20	
第78回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.801	100,000	106,674	2030/5/28	
小 計			7,753,418	8,313,234		
金 融 債 券	い第785号 商工債	0.23	100,000	100,264	2020/10/27	

銘柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
金 融 債 券	第326回 信金中金債 (5年)	0.05	100,000	100,014	2022/1/27
	第331回 信金中金債 (5年)	0.08	100,000	100,092	2022/6/27
	第342回 信金中金債 (5年)	0.11	100,000	100,222	2023/5/26
小 計			400,000	400,592	
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第527回 中部電力社債	0.806	100,000	102,490	2037/10/23
	第484回 関西電力社債	0.976	100,000	101,262	2020/10/23
	第497回 関西電力社債	1.002	100,000	104,061	2025/6/20
	第382回 中国電力社債	0.517	100,000	100,821	2021/5/25
	第311回 北陸電力社債	0.847	100,000	103,961	2027/9/24
	第488回 東北電力社債	0.29	100,000	99,636	2026/10/23
	第428回 九州電力社債	0.936	100,000	103,291	2024/7/25
	第321回 北海道電力社債	0.886	100,000	102,821	2024/12/25
	第344回 東京交通債券	1.67	100,000	106,173	2023/2/17
	第16回 成田国際空港社債	0.57	100,000	102,699	2024/10/28
	第37回 東日本高速道路社債	0.03	200,000	199,914	2021/6/18
	第56回 中日本高速道路社債	0.759	100,000	103,267	2023/12/20
	第26回 西日本高速道路社債	0.604	100,000	103,085	2025/5/21
	第22回 清水建設社債	0.337	100,000	100,385	2021/3/5
	第10回 キリンホールディングス社債	0.603	100,000	102,470	2025/2/28
	第9回 日本たばこ産業社債	0.217	100,000	100,209	2020/7/15
	第49回 住友化学社債	0.944	100,000	103,688	2024/4/25
	第65回 新日鐵住金社債	1.076	100,000	101,070	2020/6/19
	第23回 豊田自動織機社債	0.554	100,000	100,659	2020/9/18
	第36回 富士通社債	0.562	100,000	100,870	2021/6/11
	第17回 パナソニック社債	0.47	100,000	101,203	2026/9/18
	第29回 三菱重工業社債	0.662	100,000	102,298	2024/9/3
	第5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.494	100,000	101,014	2028/10/25
	第58回 日産自動車社債	0.779	100,000	101,935	2024/3/19
	第26回 豊田通商社債	0.897	100,000	102,980	2038/3/5
	第79回 三菱商事社債	1.022	100,000	102,803	2022/5/20
	第53回 クレディセゾン社債	0.435	100,000	100,660	2021/10/22
	第57回 三菱東京UFJ銀行社債	2.22	100,000	107,408	2022/10/27
	第88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.34	100,000	116,565	2027/4/20
	第12回 リソナ銀行社債	2.464	100,000	115,379	2027/3/15
	第31回 ホンダファイナンス社債	0.418	100,000	100,723	2021/6/18
	第81回 トヨタファイナンス社債	0.265	100,000	100,041	2027/10/22
	第56回 三菱UFJリース社債	0.455	100,000	101,160	2028/1/18
	第16回 大和証券グループ本社社債	0.687	100,000	100,956	2021/5/21
	第50回 野村ホールディングス社債	0.22	100,000	100,066	2022/8/10
	第112回 三菱地所社債	0.577	100,000	100,826	2020/12/25
第106回 住友不動産社債	0.4	100,000	100,427	2026/5/26	
第71回 東京急行電鉄社債	1.47	100,000	101,540	2020/6/11	
第65回 東日本旅客鉄道普通社債	2.149	100,000	119,780	2029/12/21	
第107回 東日本旅客鉄道普通社債	1.415	100,000	116,987	2045/1/27	
第21回 西日本旅客鉄道社債	2.247	100,000	119,578	2029/3/21	
第7回 東海旅客鉄道普通社債	2.2	100,000	106,547	2022/5/10	
第9回 東海旅客鉄道普通社債	1.74	110,000	116,371	2022/9/20	

銘 柄		当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
普 通 社 債 券 (含む投資法人債券)	第32回 東海旅客鉄道普通社債	2.31	100,000	117,449	2027/9/17
	第62回 日本電信電話電信電話債券	1.02	100,000	102,251	2021/9/17
	第54回 電源開発社債	0.38	100,000	99,811	2027/11/19
	第34回 東京瓦斯社債	1.064	100,000	102,478	2021/9/22
	第30回 大阪瓦斯社債	0.759	100,000	102,605	2022/12/14
	第27回 エヌ・ティ・ティ・データ社債	0.9	100,000	103,280	2023/6/20
	第5回 ファーストリテイリング社債	0.11	100,000	99,764	2023/6/6
	第26回 フランス相互信用連合銀行 (BFCM) 円貨社債 (2018)	0.443	100,000	100,666	2023/10/12
	第8回 ルディア・バンク・アツィエボラ・グループ・アブリクト円貨社債 (2015)	0.312	100,000	100,212	2020/6/4
	第2回 ピー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債 (2017)	0.367	100,000	99,804	2024/6/28
	第11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債 (2016)	0.4	100,000	99,707	2026/6/10
小 計			5,510,000	5,708,106	
合 計			140,273,748	152,633,465	

(注) 金額の単位未満は切捨て。

投資信託財産の構成

2019年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	152,633,465	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	771,118	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	153,404,583	100.0

(注) 金額の単位未満は切捨て。

資産、負債、元本及び基準価額の状況

2019年5月8日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	153,404,583,707円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	275,889,604
公 社 債 (評価額)	152,633,465,946
未 収 入 金	200,639,000
未 収 利 息	286,005,332
前 払 費 用	8,583,825
(B) 負 債	19,990,000
未 払 解 約 金	19,990,000
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	153,384,593,707
元 本	122,368,202,545
次 期 繰 越 損 益 金	31,016,391,162
(D) 受 益 権 総 口 数	122,368,202,545口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	12,535円

- (注1) 当期末における1口当たり純資産額 1.2535円
(注2) 期首元本額 123,838,085,315円
期中追加設定元本額 43,654,866,864円
期中一部解約元本額 45,124,749,634円
(注3) 元本の内訳
MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ) 61,057,155,338円
MHAM日本債券インデックスファンド 195,492,207円
MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定] 9,464,112,662円
MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定] 44,075,376,760円
コア資産形成ファンド 216,545,399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] 7,141,533,413円
動的パッケージファンド<DC年金> 217,986,766円

損益の状況

(2018年5月9日から2019年5月8日まで)

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	1,226,170,499円
受 取 利 息	1,227,232,050
支 払 利 息	△ 1,061,551
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	1,227,064,367
売 買 益	1,814,403,404
売 買 損	△ 587,339,037
(C) 先 物 取 引 等 取 引 損 益	1,822,028
取 引 益	1,822,028
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	2,455,056,894
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	28,776,781,398
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	10,296,864,836
(G) 解 約 差 損 益 金	△10,512,311,966
(H) 計 (D + E + F + G)	31,016,391,162
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	31,016,391,162

- (注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。
(注2) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定した価額から元本を差し引いた差額分をいいます。
(注3) (G)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。