

償還 運用報告書 (全体版)

<償還日 2019年9月24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 | 2010年11月19日から2019年9月24日（当初無期限）までです。 | |
| 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。 | |
| 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。 |
| 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 | 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。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、この度、信託約款の規定に基づき、繰上償還の運びとなりました。

ここに、運用経過と償還内容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

■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 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 | 純 資 産 額 |
|---------------------|---------------------|----------------------------|-----------------------|--------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|------------------|
| | (分配落) | 税 込 み 配 分 金 | 期 中 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 期 中 騰 落 率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| (償還日) 2019年9月24日 | (償還価額) 11,400.51 | 0 | 1.6 | 394.84 | 1.7 | - | - | 168 |

(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」、「債券先物組入比率」は実質比率を記載しています。

(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 (ベンチマーク) | | 債 組 入 比 率 | 債 先 物 比 率 |
|---------------------|---------------------|-------------|--------------------------|-------------|-----------------------|-----------------------|
| | | 騰 落 率 | (ベンチマーク) | 騰 落 率 | | |
| (期首) 2019年5月8日 | 円 11,221 | % - | 388.40 | % - | % 99.5 | % - |
| 5月末 | 11,273 | 0.5 | 390.32 | 0.5 | 99.5 | - |
| 6月末 | 11,337 | 1.0 | 392.69 | 1.1 | 99.7 | - |
| 7月末 | 11,344 | 1.1 | 393.15 | 1.2 | 99.6 | - |
| 8月末 | 11,494 | 2.4 | 398.50 | 2.6 | 99.5 | - |
| (償還日) 2019年9月24日 | (償還価額) 11,400.51 | 1.6 | 394.84 | 1.7 | - | - |

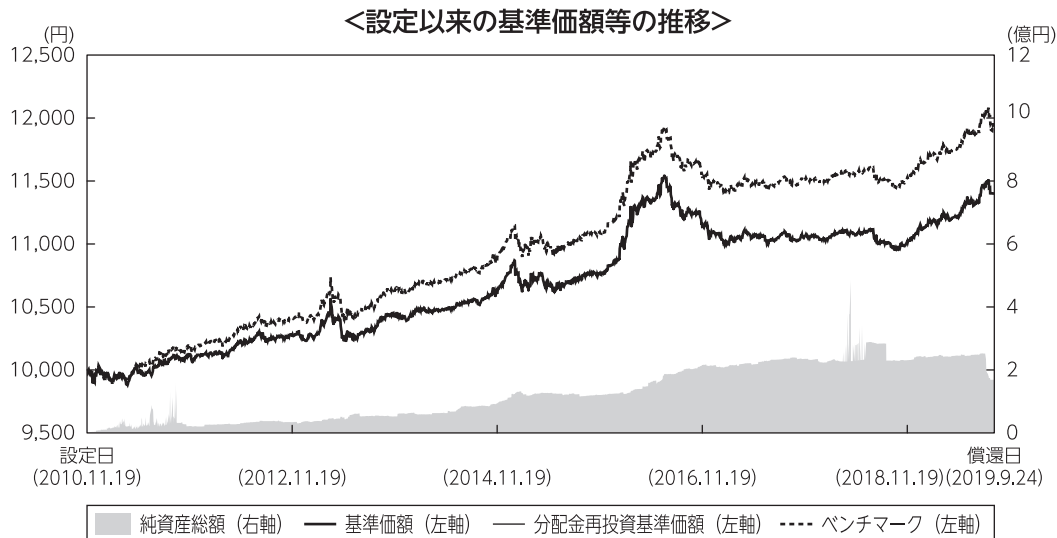
(注1) 騰落率は期首比です。

(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」、「債券先物組入比率」は実質比率を記載しています。

(注3) 「債券先物比率」は、買建比率-売建比率です。

■設定以来の運用経過 (2010年11月19日から2019年9月24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、設定日の基準価額に合わせて指数化しています。ただし、設定日の基準価額は設定当初の金額、純資産総額は設定当初の元本額を表示しております。

<設定日～第9期 (2010年11月19日から2019年5月8日まで)>

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

●国内債券市況

国内債券市場は、上昇しました。2013年3月に黒田東彦氏が日銀総裁に就任以降、日銀は次々と追加金融緩和政策を打ち出しました。2013年4月の「量的・質的金融緩和」や2016年1月の「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」などによる需給の引き締めなどを背景に、概ね上昇基調で推移しました。2016年7月発表の追加金融緩和政策が市場期待を下回ったことで日銀の金融政策の限界が意識されると、上げ幅は縮小しました。2018年10月には米中貿易摩擦が激化したことなどにより再び上昇基調を取り戻し、設定日対比では上昇となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

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

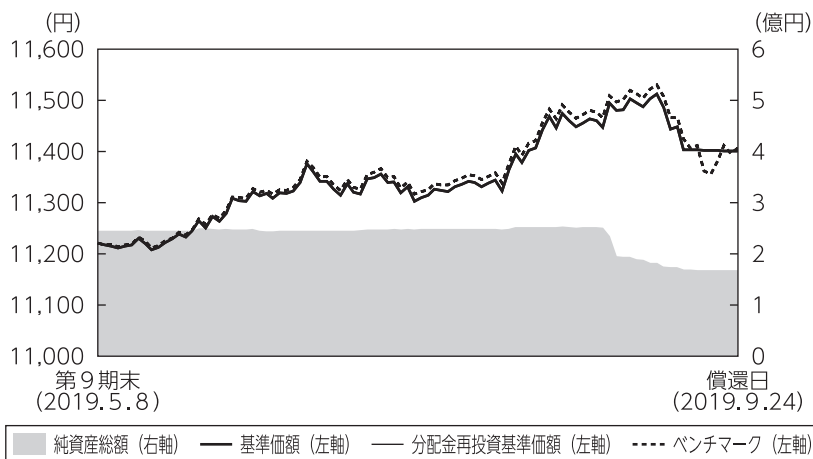
当期の運用につきましては、当マザーファンドの運用方針に従い、NOMUR A-BPI 総合への連動性維持を目指した運用を行いました。

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5.6%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。

<第10期 (2019年5月9日から2019年9月24日まで)>

基準価額等の推移



第10期首： 11,221円
 償還日： 11,400.51円
 (既払分配金0円)
 騰落率： 1.6%
 (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

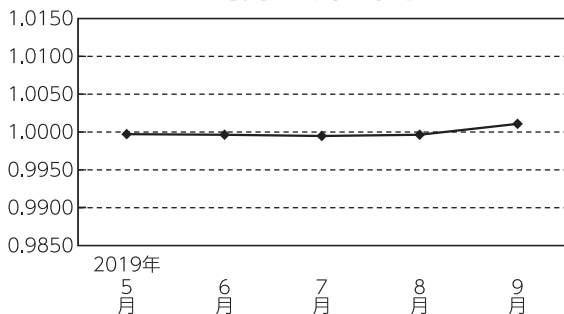
●国内債券市況

国内債券市場は、上昇しました。期初から8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧中銀の金融緩和観測などを背景に、概ね上昇基調で推移しました。9月には、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げ幅は縮小しましたが、前期末対比では上昇となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

＜月間連動率の推移＞



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

(注) 月間連動率の2019年5月は対期首比、2019年9月は償還日対2019年8月末比

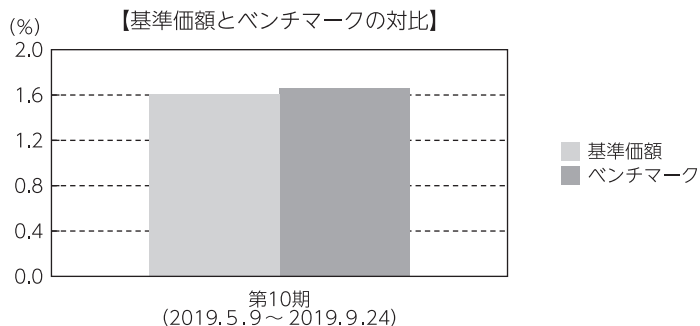
当期の運用につきましては、当ファンドの運用方針に従い、MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●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0.1%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。

このたび償還を迎えるにあたりまして、当ファンドへのご愛顧に心より感謝申し上げますとともに、今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

■ 1万口当たりの費用明細

| 項目 | 第10期 | | 項目の概要 |
|---------------------|----------------------------|------------------|--|
| | (2019年5月9日 ～2019年9月24日) | | |
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 信託報酬 | 20円 | 0.177% | (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11,351円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、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種書類の送付、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) | (9) | (0.083) | |
| (販売会社) | (9) | (0.083) | |
| (受託会社) | (1) | (0.012) | |
| (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 | 20 | 0.178 | |

(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。

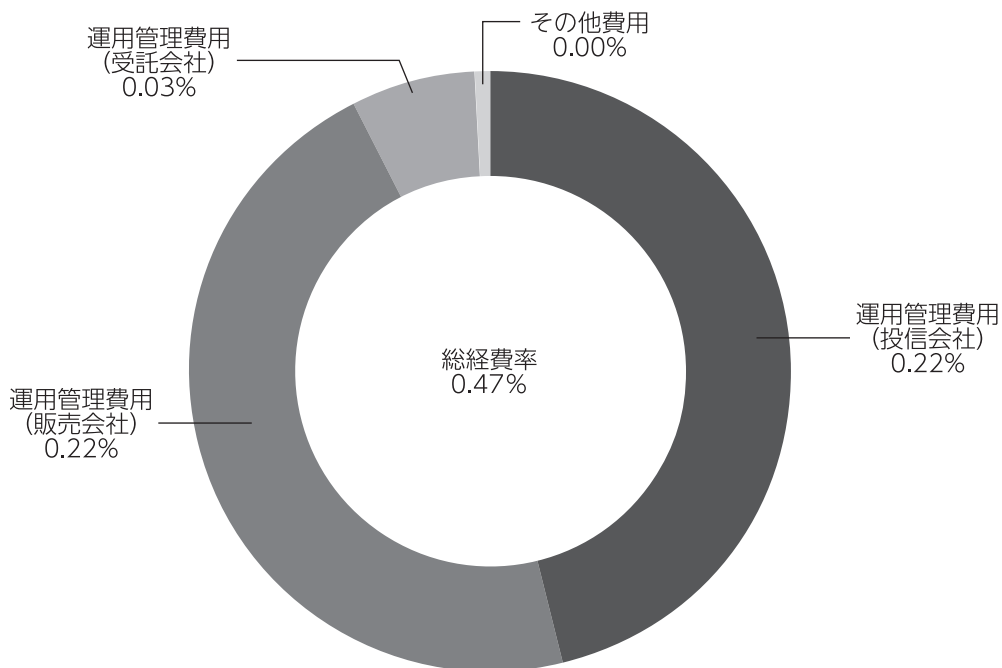
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.47%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2019年9月24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 11,305 | 千円 14,290 | 千口 206,797 | 千円 264,281 |

■利害関係人との取引状況等（2019年5月9日から2019年9月24日まで）

【MHAM日本債券インデックス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 18,820 | 百万円 1,893 | % 10.1 | 百万円 48,250 | 百万円 4,375 | % 9.1 |

平均保有割合 0.2%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存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係る利害関係人とは、みずほ証券です。

■組入資産の明細

償還時における有価証券の組入れはありません。前期末の組入れは以下の通りでした。

親投資信託残高

| | 期首 (前期末) | |
|-----------------------|----------|---------------|
| | □ | 数 |
| MHAM日本債券インデックスマザーファンド | | 千口 195,492 |

■投資信託財産の構成

2019年9月24日現在

| 項 目 | 償 還 時 | |
|-------------------------|---------------|------------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他 | 千円 168,987 | % 100.0 |
| 投 資 信 託 財 産 総 額 | 168,987 | 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

(2019年9月24日)現在

| 項 目 | 償 還 時 |
|--------------------|--------------|
| (A) 資 産 | 168,987,002円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等 | 168,987,002 |
| (B) 負 債 | 413,954 |
| 未 払 信 託 報 酬 | 413,611 |
| 未 払 利 息 | 343 |
| (C) 純 資 産 総 額(A-B) | 168,573,048 |
| 元 本 | 147,864,515 |
| 償 還 差 損 益 金 | 20,708,533 |
| (D) 受 益 権 総 口 数 | 147,864,515口 |
| 1万口当たり償還価額(C/D) | 11,400円51銭 |

(注) 期首における元本額は218,381,613円、当期中における追加設定元本額は16,067,291円、同解約元本額は86,584,389円です。

■損益の状況

当期 自2019年5月9日 至2019年9月24日

| 項 目 | 当 期 |
|----------------------|--------------|
| (A) 配 当 等 収 益 | △3,730円 |
| 支 払 利 息 | △3,730 |
| (B) 有 価 証 券 売 買 損 益 | 2,957,199 |
| 売 買 益 | 4,872,246 |
| 売 買 損 | △1,915,047 |
| (C) 信 託 報 酬 等 | △413,611 |
| (D) 当 期 損 益 金(A+B+C) | 2,539,858 |
| (E) 前 期 繰 越 損 益 金 | 1,773,871 |
| (F) 追 加 信 託 差 損 益 金 | 16,394,804 |
| (配 当 等 相 当 額) | (19,388,390) |
| (売 買 損 益 相 当 額) | (△2,993,586) |
| (G) 合 計(D+E+F) | 20,708,533 |
| 償 還 差 損 益 金(G) | 20,708,533 |

(注1) (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。

■投資信託財産運用総括表

| 信託期間 | 投資信託契約締結日 | 2010年11月19日 | | 投資信託契約終了時の状況 | |
|----------|-------------|--------------|--------------|--------------|--------------|
| | 投資信託契約終了日 | 2019年9月24日 | | 資産総額 | 168,987,002円 |
| 区分 | 投資信託契約締結当初 | 投資信託契約終了時 | 差引増減又は追加信託 | 負債総額 | 413,954円 |
| | 受益権口数 | 1,000,000口 | 147,864,515口 | 146,864,515口 | 純資産総額 |
| 元本額 | 1,000,000円 | 147,864,515円 | 146,864,515円 | 受益権口数 | 147,864,515口 |
| 毎計算期末の状況 | | | | | |
| 計算期 | 元本額 | 純資産総額 | 基準価額 | 1万口当たり分配金 | |
| | | | | 金額 | 分配率 |
| 第1期 | 13,688,779円 | 13,700,791円 | 10,009円 | 0円 | 0.00% |
| 第2期 | 27,596,712 | 28,163,169 | 10,205 | 0 | 0.00 |
| 第3期 | 43,846,892 | 45,612,514 | 10,403 | 0 | 0.00 |
| 第4期 | 60,301,495 | 63,201,485 | 10,481 | 0 | 0.00 |
| 第5期 | 118,775,372 | 126,797,799 | 10,675 | 0 | 0.00 |
| 第6期 | 130,451,470 | 148,248,510 | 11,364 | 0 | 0.00 |
| 第7期 | 200,084,962 | 221,567,500 | 11,074 | 0 | 0.00 |
| 第8期 | 205,690,125 | 228,008,342 | 11,085 | 0 | 0.00 |
| 第9期 | 218,381,613 | 245,053,706 | 11,221 | 0 | 0.00 |

償還金のお知らせ

| | |
|----------------|------------|
| 1万口当たり償還金（税引前） | 11,400円51銭 |
|----------------|------------|

償還乗換えの優遇措置の適用について

当ファンドの償還金をもって他の証券投資信託をお求めになる場合には、購入時手数料のうち所定の額を返戻または割引く措置を受けられる場合があります。優遇措置の適用は販売会社によって異なりますので、詳しくは販売会社までお問い合わせください。

－ 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 | 落率 | 期騰 | 落率 | | | |
| 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)。

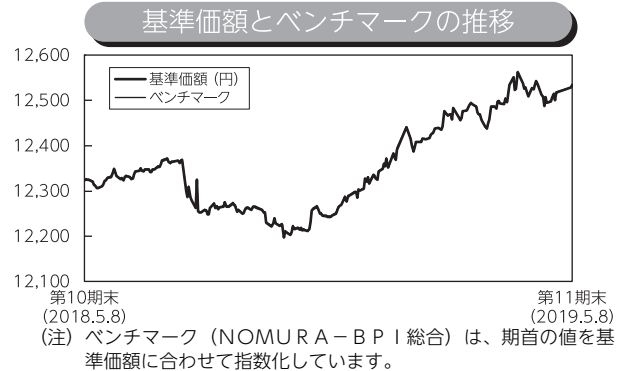
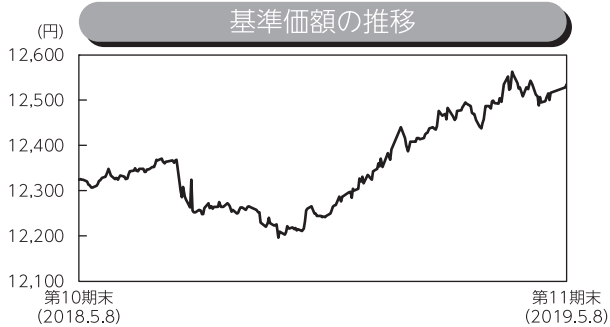
当期中の基準価額と市況推移

| | 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】

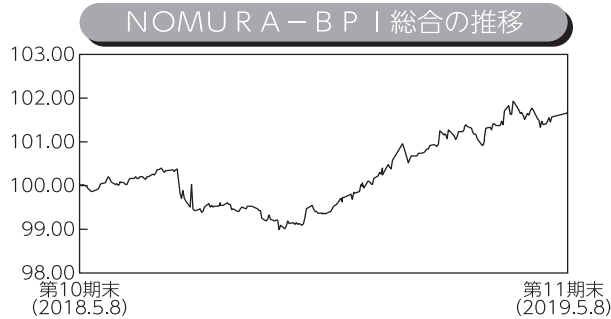


【基準価額の主な変動要因】

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】

●国内債券市況

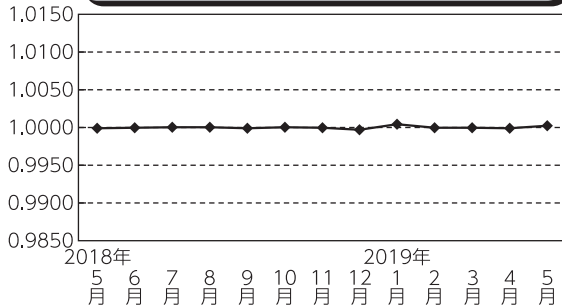


(注) 期首を100として指数化しています。

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】

月間連動率の推移



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

(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】

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

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 | 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 |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 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 |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| 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 | |
| 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。