

Smart-i 国内債券インデックス

運用報告書（全体版）

第2期（決算日 2019年6月25日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。
「Smart-i 国内債券インデックス」は、2019年6月25日に第2期の決算を行いましたので、期中の運用状況ならびに決算のご報告を申し上げます。
今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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	2017年8月29日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要投資対象	RAM国内債券マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を主要投資対象とします。
主な投資制限	①株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限りません。）の行使等により取得したものに限りません。 株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ②投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ③外貨建資産への投資は、行いません。
分配方針	毎決算時に、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等を分配対象額とし、原則として基準価額の水準、市況動向等を勘案して分配金額を決定します。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。

<照会先>

電話番号：0120-223351

（委託会社の営業日の午前9時～午後5時）

ホームページ：<https://www.resona-am.co.jp/>

りそなアセットマネジメント 株式会社

東京都江東区木場1丁目5番65号

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			NOMURA-BPI総合		債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率		
(設定日)	円	円	%		%	%	百万円
2017年8月29日	10,000	—	—	380.422	—	—	0.1
1期(2018年6月25日)	10,033	0	0.3	382.659	0.6	99.0	1
2期(2019年6月25日)	10,281	0	2.5	392.920	2.7	99.7	237

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

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

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 「NOMURA-BPI総合」は、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。野村證券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
(期首)	円	%		%	%
2018年6月25日	10,033	—	382.659	—	99.0
6月末	10,032	△0.0	382.669	0.0	98.9
7月末	10,013	△0.2	381.979	△0.2	98.7
8月末	9,957	△0.8	379.893	△0.7	99.4
9月末	9,932	△1.0	378.986	△1.0	99.4
10月末	9,948	△0.8	379.645	△0.8	99.4
11月末	9,988	△0.4	381.238	△0.4	99.5
12月末	10,060	0.3	384.131	0.4	99.4
2019年1月末	10,100	0.7	385.580	0.8	99.5
2月末	10,118	0.8	386.427	1.0	99.5
3月末	10,188	1.5	389.143	1.7	99.6
4月末	10,155	1.2	387.945	1.4	99.5
5月末	10,217	1.8	390.322	2.0	99.5
(期末)					
2019年6月25日	10,281	2.5	392.920	2.7	99.7

(注) 騰落率は期首比です。

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

○運用経過

(2018年6月26日～2019年6月25日)

期中の基準価額等の推移



期首：10,033円

期末：10,281円（既払分配金（税引前）：0円）

騰落率： 2.5%（分配金再投資ベース）

- (注) 分配金再投資基準価額は、分配金（税引前）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注) 分配金を再投資するかどうかについてはお客様がご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびNOMURA-BPI総合は、期首（2018年6月25日）の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) NOMURA-BPI総合は当ファンドのベンチマークです。
- (注) NOMURA-BPI総合は、野村証券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村証券株式会社に帰属しています。野村証券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、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。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。

○基準価額の変動要因

マザーファンドを通じて投資を行った結果、当ファンドの基準価額は前期末10,033円から当期末10,281円となり、248円の値上がりとなりました。

国内債券の市況（NOMURA-BPI総合）の上昇により、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内債券市況

国内長期金利は、前期末と比較して低下（債券価格は上昇）しました。期初は、日銀の金融政策決定会合における金利変動幅の拡大容認や海外金利の上昇を受けて国内長期金利も上昇基調で推移しましたが、米中貿易摩擦問題への警戒感やFRB（米連邦準備制度理事会）の政策に対する不透明感を背景とした世界景気の減速懸念からリスク回避の姿勢が強まり、国内長期金利は低下に転じました。期末にかけては米国の経済指標の不振を背景としたFRBによる利下げ観測を受けて低下幅を拡大しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RAM国内債券マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行いました。

RAM国内債券マザーファンド

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+2.5%となり、ベンチマークの+2.7%を0.2%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

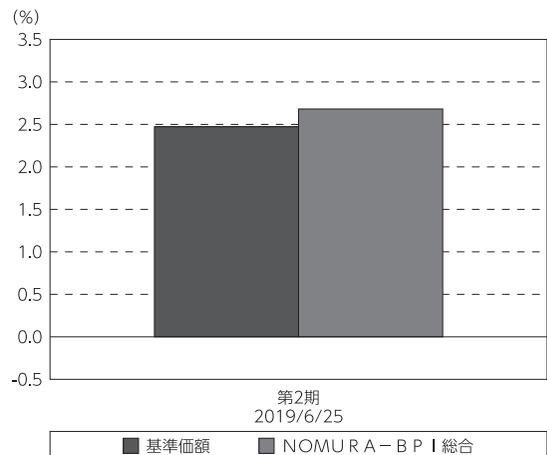
（マイナス要因）

- ・信託報酬などの諸費用が生じたこと
- ・コスト負担（取引費用などのコスト）が生じたこと

（その他の要因）

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



（注）基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額の水準、市況動向等を勘案した上で、分配を見送りとさせていただきます。収益分配にあてなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、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

(単位：円、1万口当たり・税込み)

項 目	第2期
	2018年6月26日～ 2019年6月25日
当期分配金	—
(対基準価額比率)	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	281

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

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

○今後の運用方針

当ファンド

引き続き、RAM国内債券マザーファンド受益証券を高位に組入れて運用を行う方針です。

RAM国内債券マザーファンド

引き続き、主としてNOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2018年6月26日～2019年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円	%	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投 信 会 社)	(5)	(0.054)	委託した資金の運用の対価
(販 売 会 社)	(5)	(0.054)	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、購入後の 情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(2)	(0.022)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.011	(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)	(1)	(0.011)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	14	0.141	
期中の平均基準価額は、10,059円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2018年6月26日～2019年6月25日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
RAM国内債券マザーファンド	千口 225,909	千円 237,373	千口 4,949	千円 5,184

○利害関係人との取引状況等

(2018年6月26日～2019年6月25日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2018年6月26日～2019年6月25日)

該当事項はございません。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2018年6月26日～2019年6月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2019年6月25日現在)

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
RAM国内債券マザーファンド		千口 1,427	千口 222,388	千円 237,577

○投資信託財産の構成

(2019年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RAM国内債券マザーファンド	千円 237,577	% 99.7
コール・ローン等、その他	618	0.3
投資信託財産総額	238,195	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2018年6月26日～2019年6月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年6月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	238,195,546
コール・ローン等	618,106
RAM国内債券マザーファンド(評価額)	237,577,440
(B) 負債	449,091
未払解約金	353,003
未払信託報酬	89,156
未払利息	1
その他未払費用	6,931
(C) 純資産総額(A-B)	237,746,455
元本	231,243,221
次期繰越損益金	6,503,234
(D) 受益権総口数	231,243,221口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,281円

(注) 当ファンドの期首元本額は1,482,225円、期中追加設定元本額は246,419,822円、期中一部解約元本額は16,658,826円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0281円です。

○損益の状況 (2018年6月26日～2019年6月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 103
支払利息	△ 103
(B) 有価証券売買損益	3,762,631
売買益	3,973,535
売買損	△ 210,904
(C) 信託報酬等	△ 110,549
(D) 当期損益金(A+B+C)	3,651,979
(E) 前期繰越損益金	2,358
(F) 追加信託差損益金	2,848,897
(配当等相当額)	(1,488,855)
(売買損益相当額)	(1,360,042)
(G) 計(D+E+F)	6,503,234
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	6,503,234
追加信託差損益金	2,848,897
(配当等相当額)	(1,633,913)
(売買損益相当額)	(1,214,984)
分配準備積立金	3,654,337

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(716,492円)、費用控除後の有価証券等損益額(2,934,244円)、信託約款に規定する収益調整金(2,848,897円)および分配準備積立金(3,601円)より分配対象収益は6,503,234円(1万口当たり281円)ですが、当期に分配した金額はありません。

○分配金のお知らせ

1万口当たり分配金(税込み)	0円
----------------	----

○お知らせ

・信託報酬率の引き下げを行うため、約款に所要の変更を行いました。(2019年3月26日)

RAM国内債券マザーファンド

運用報告書

第3期（決算日 2019年1月25日）
（2018年1月26日～2019年1月25日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2015年12月11日から無期限です。
運用方針	①主として、NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、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。なお、NOMURA-BPI総合への連動性を高めるため、国内債券を対象とした債券先物取引を活用することがあります。 ②債券の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。
主要投資対象	・ NOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券
主な投資制限	・ 株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権（転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。）の行使等により取得したものに限りま す。 ・ 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・ 外貨建資産への投資は、行いません。

りそなアセットマネジメント 株式会社

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)			債 組 入 比	券 率	純 資 産 額
	騰 落	率	騰 落	率	率			
(設定日)	円	%		%		%	百万円	
2015年12月11日	10,000	—	367.259	—	—	—	195	
1期(2017年1月25日)	10,300	3.0	378.473	3.1	99.5		15,275	
2期(2018年1月25日)	10,328	0.3	379.684	0.3	99.3		46,026	
3期(2019年1月25日)	10,483	1.5	385.440	1.5	99.7		64,555	

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額（元本＝10,000円）です。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

(注) 「NOMURA-BPI総合」は、野村證券株式会社が公表する、日本の公募債券流通市場全体の動向を表す投資収益指数で一定の組入基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPI総合の知的財産権とその他の一切の権利は野村證券株式会社に帰属しています。野村證券株式会社は、NOMURA-BPI総合指数の正確性、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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)			債 組 入 比	券 率
	騰 落	率	騰 落	率	率		
(期首)	円	%		%		%	
2018年1月25日	10,328	—	379.684	—	99.3		
1月末	10,333	0.0	379.850	0.0	99.0		
2月末	10,372	0.4	381.295	0.4	99.2		
3月末	10,388	0.6	381.911	0.6	99.3		
4月末	10,380	0.5	381.638	0.5	99.3		
5月末	10,404	0.7	382.498	0.7	98.7		
6月末	10,408	0.8	382.669	0.8	98.9		
7月末	10,390	0.6	381.979	0.6	98.8		
8月末	10,333	0.0	379.893	0.1	99.4		
9月末	10,308	△0.2	378.986	△0.2	99.4		
10月末	10,326	△0.0	379.645	△0.0	99.5		
11月末	10,369	0.4	381.238	0.4	99.6		
12月末	10,445	1.1	384.131	1.2	99.5		
(期末)							
2019年1月25日	10,483	1.5	385.440	1.5	99.7		

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2018年1月26日～2019年1月25日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の変動要因

基準価額は前期末10,328円から当期末10,483円となり、155円の値上がりとなりました。

国内債券の市況（NOMURA-BPI総合）の上昇により、基準価額は上昇しました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一となるよう指数化しています。

投資環境

国内債券市況

国内長期金利は、前期末と比較して低下（債券価格は上昇）しました。期初は米中貿易摩擦問題を懸念した世界的なリスク回避の強まりから低下基調で推移しました。2018年7月末に開催された日銀金融政策決定会合において金利変動幅の拡大が容認されると、国内長期金利は大幅上昇に転じ、その後も海外金利の上昇につれて強含みで推移しました。その後期末にかけて、米中貿易摩擦問題への警戒感やFRB（米連邦準備制度理事会）の政策に対する不透明感を背景とした世界的な株安・長期金利低下を受けて、国内長期金利も低下に転じ、年末年始には一時マイナスとなる場面も見られました。

当ファンドのポートフォリオ

国内の債券を主要投資対象とし、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指してファンドの特性値（満期構成やデュレーション（金利感応度））をベンチマークに概ね一致させたポートフォリオを構築しました。債券組入比率は期を通じて高位に維持しました。

当ファンドのベンチマークとの差異

当期の基準価額の騰落率は+1.5%となり、ベンチマークの+1.5%と同等のリターンとなりました。主な差異要因は以下の通りです。

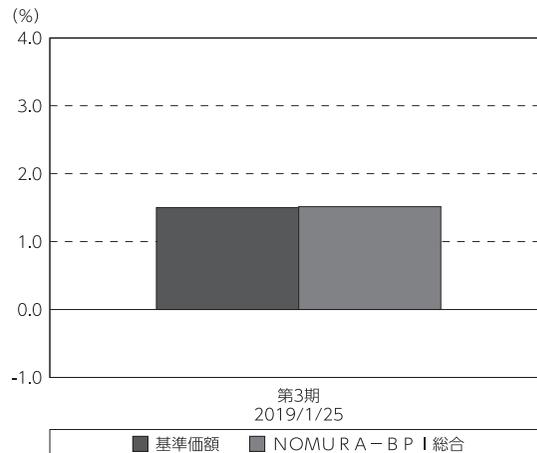
(マイナス要因)

- ・コスト負担(債券等に係る取引費用)が生じたこと

(その他の要因)

- ・ベンチマークとファンドで評価に用いる債券時価が異なったこと

基準価額とベンチマークの対比 (期別騰落率)



○今後の運用方針

引き続き、主としてNOMURA-BPI総合に採用されている国内の債券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目指して運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2018年1月26日～2019年1月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 (そ の 他)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、ファンドの運営管理にかかる費用等
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は、10,371円です。			

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

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2018年1月26日～2019年1月25日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	32,795,363	17,906,648
	地方債証券	1,327,662	507,976
	特殊債券	1,911,843	201,692
	社債券（投資法人債券を含む）	1,000,000	(34,435)
			100,274

(注) 金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

(注) ()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) 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。

○利害関係人との取引状況等

(2018年1月26日～2019年1月25日)

該当事項はございません。

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

○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況（2018年1月26日～2019年1月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2019年1月25日現在)

国内公社債

(A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末						
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うちBB格以下 組 入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	48,939,000	53,797,568	83.3	—	53.0	20.3	10.0
	(450,000)	(436,627)	(0.7)	(—)	(0.7)	(—)	(—)
地方債証券	3,530,000	3,612,073	5.6	—	3.8	1.4	0.3
	(3,530,000)	(3,612,073)	(5.6)	(—)	(3.8)	(1.4)	(0.3)
特殊債券 (除く金融債)	3,865,087	4,026,083	6.2	—	4.8	0.8	0.6
	(3,865,087)	(4,026,083)	(6.2)	(—)	(4.8)	(0.8)	(0.6)
金融債券	300,000	300,455	0.5	—	—	0.3	0.2
	(300,000)	(300,455)	(0.5)	(—)	(—)	(0.3)	(0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	2,600,000	2,626,014	4.1	—	1.9	1.7	0.5
	(2,600,000)	(2,626,014)	(4.1)	(—)	(1.9)	(1.7)	(0.5)
合 計	59,234,087	64,362,194	99.7	—	63.5	24.6	11.6
	(10,745,087)	(11,001,252)	(17.0)	(—)	(11.2)	(4.3)	(1.6)

(注) ()内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(注) 格付のない債券については、BB格以下組入比率に含まれておりません。

(B)国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第385回利付国債 (2年)		0.1	210,000	210,638	2020/2/15
第386回利付国債 (2年)		0.1	200,000	200,654	2020/3/15
第387回利付国債 (2年)		0.1	300,000	301,035	2020/4/15
第388回利付国債 (2年)		0.1	300,000	301,107	2020/5/15
第389回利付国債 (2年)		0.1	320,000	321,222	2020/6/1
第390回利付国債 (2年)		0.1	350,000	351,396	2020/7/1
第391回利付国債 (2年)		0.1	200,000	200,846	2020/8/1
第392回利付国債 (2年)		0.1	300,000	301,338	2020/9/1
第393回利付国債 (2年)		0.1	150,000	150,691	2020/10/1
第394回利付国債 (2年)		0.1	160,000	160,776	2020/11/1
第395回利付国債 (2年)		0.1	150,000	150,747	2020/12/1
第123回利付国債 (5年)		0.1	395,000	396,260	2020/3/20
第124回利付国債 (5年)		0.1	305,000	306,168	2020/6/20
第125回利付国債 (5年)		0.1	271,000	272,227	2020/9/20
第136回利付国債 (5年)		0.1	370,000	374,417	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)		0.1	540,000	546,820	2023/9/20
第126回利付国債 (5年)		0.1	380,000	381,983	2020/12/20
第127回利付国債 (5年)		0.1	350,000	352,065	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)		0.1	470,000	473,045	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)		0.1	310,000	312,222	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)		0.1	120,000	120,942	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)		0.1	540,000	544,600	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)		0.1	360,000	363,315	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)		0.1	460,000	464,549	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)		0.1	530,000	535,607	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)		0.1	480,000	485,400	2023/3/20
第1回利付国債 (40年)		2.4	40,000	58,584	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)		2.2	70,000	99,474	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)		2.2	80,000	114,333	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)		2.2	130,000	186,797	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)		2.0	130,000	180,310	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)		1.9	130,000	177,134	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)		1.7	130,000	169,774	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)		1.4	150,000	182,122	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)		0.4	230,000	205,125	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)		0.9	220,000	231,501	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)		0.8	140,000	142,332	2058/3/20
第306回利付国債 (10年)		1.4	480,000	488,659	2020/3/20
第307回利付国債 (10年)		1.3	250,000	254,225	2020/3/20
第308回利付国債 (10年)		1.3	180,000	183,702	2020/6/20
第309回利付国債 (10年)		1.1	120,000	122,133	2020/6/20
第310回利付国債 (10年)		1.0	130,000	132,518	2020/9/20
第311回利付国債 (10年)		0.8	200,000	203,214	2020/9/20
第312回利付国債 (10年)		1.2	770,000	790,027	2020/12/20

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	
第313回利付国債 (10年)		1.3	520,000	536,411	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)		1.1	130,000	133,545	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)		1.2	375,000	387,337	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)		1.1	300,000	309,147	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)		1.1	180,000	186,069	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)		1.0	366,000	377,371	2021/9/20
第319回利付国債 (10年)		1.1	490,000	508,090	2021/12/20
第320回利付国債 (10年)		1.0	352,000	363,971	2021/12/20
第321回利付国債 (10年)		1.0	291,000	301,697	2022/3/20
第322回利付国債 (10年)		0.9	120,000	124,033	2022/3/20
第323回利付国債 (10年)		0.9	340,000	352,348	2022/6/20
第324回利付国債 (10年)		0.8	183,000	189,022	2022/6/20
第325回利付国債 (10年)		0.8	470,000	486,623	2022/9/20
第326回利付国債 (10年)		0.7	280,000	289,489	2022/12/20
第327回利付国債 (10年)		0.8	387,000	401,632	2022/12/20
第328回利付国債 (10年)		0.6	461,000	475,696	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)		0.8	557,000	580,778	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)		0.8	257,000	268,603	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)		0.6	90,000	93,221	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)		0.6	312,000	323,771	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)		0.6	445,000	462,524	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)		0.6	481,000	500,879	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)		0.5	135,000	140,073	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)		0.5	230,000	239,029	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	150,000	154,104	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	621,000	642,561	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)		0.4	205,000	212,412	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)		0.4	534,000	553,891	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)		0.3	240,000	247,608	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	240,000	244,418	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)		0.1	220,000	224,109	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)		0.1	340,000	346,303	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)		0.1	410,000	417,519	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	430,000	437,774	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	310,000	315,378	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	290,000	294,799	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	370,000	375,794	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	510,000	517,257	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)		0.1	280,000	283,561	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)		0.1	510,000	515,910	2028/9/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	10,000	12,911	2029/9/20
第11回利付国債 (30年)		1.7	10,000	12,106	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	40,000	50,812	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	90,000	113,183	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	20,000	26,388	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	100,000	133,844	2034/6/20

銘	柄	当期			償還年月日
		利率	額面金額	評価額	
国債証券		%	千円	千円	
第16回利付国債 (30年)		2.5	20,000	26,835	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	110,000	146,150	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	120,000	157,918	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	100,000	131,865	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	60,000	81,182	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	90,000	119,132	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)		2.5	50,000	67,931	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)		2.5	160,000	217,822	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)		2.5	100,000	136,521	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)		2.3	100,000	133,284	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)		2.4	225,000	304,452	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)		2.5	105,000	144,383	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)		2.5	150,000	207,106	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)		2.4	140,000	191,343	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)		2.3	190,000	257,043	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)		2.2	150,000	200,721	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)		2.3	175,000	238,645	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)		2.0	240,000	313,677	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)		2.2	195,000	263,706	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)		2.0	226,000	297,070	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)		2.0	235,000	309,713	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)		1.9	260,000	338,036	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)		1.8	160,000	204,801	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)		1.9	70,000	91,305	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)		1.8	195,000	250,342	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)		1.7	145,000	182,911	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)		1.7	130,000	164,287	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)		1.7	140,000	177,053	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)		1.7	150,000	189,834	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)		1.5	150,000	182,919	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)		1.5	150,000	182,985	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)		1.6	220,000	273,867	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)		1.4	183,000	218,891	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)		1.4	170,000	203,376	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)		0.8	190,000	198,867	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)		0.3	180,000	165,542	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)		0.5	160,000	155,102	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)		0.6	190,000	188,871	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)		0.8	190,000	198,430	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)		0.8	80,000	83,476	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)		0.8	150,000	156,376	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)		0.8	170,000	177,063	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)		0.8	270,000	280,953	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)		0.7	180,000	182,444	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)		0.9	140,000	149,255	2048/9/20
第46回利付国債 (20年)		2.2	10,000	10,333	2020/6/22

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第47回利付国債 (20年)		2.2	210,000	218,253	2020/9/21
第48回利付国債 (20年)		2.5	60,000	63,058	2020/12/21
第49回利付国債 (20年)		2.1	30,000	31,469	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)		1.9	150,000	156,702	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)		2.0	90,000	94,706	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)		2.1	190,000	201,491	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)		2.1	20,000	21,323	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)		2.2	180,000	192,430	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)		2.0	100,000	106,855	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)		2.0	10,000	10,738	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)		1.9	110,000	117,747	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)		1.9	100,000	107,570	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)		1.7	40,000	42,922	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	30,000	31,839	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	50,000	52,427	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)		0.8	80,000	83,415	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)		1.8	60,000	65,215	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)		1.9	120,000	131,564	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)		1.9	380,000	418,604	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	20,000	22,129	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)		2.2	90,000	100,980	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)		2.1	60,000	67,009	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)		2.4	110,000	125,281	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)		2.2	100,000	112,804	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)		2.1	150,000	169,258	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)		2.0	180,000	203,068	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	100,000	113,978	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)		1.9	100,000	112,738	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)		2.0	20,000	22,671	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)		1.9	50,000	56,633	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)		2.0	20,000	22,782	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)		2.1	180,000	206,202	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)		2.0	30,000	34,328	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)		2.1	170,000	195,668	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)		2.1	10,000	11,567	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	120,000	137,970	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	150,000	174,294	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)		2.3	100,000	117,639	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)		2.2	90,000	105,225	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)		2.3	185,000	218,714	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)		2.2	70,000	82,233	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	90,000	106,189	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	10,000	11,876	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	105,000	123,574	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)		2.0	20,000	23,465	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	90,000	106,335	2027/3/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券		%	千円	千円	
第95回利付国債 (20年)		2.3	35,000	42,108	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	70,000	83,032	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)		2.2	130,000	155,866	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)		2.1	70,000	83,318	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	205,000	244,808	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	151,000	182,193	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)		2.4	20,000	24,499	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)		2.4	145,000	178,268	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)		2.3	20,000	24,400	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)		2.1	10,000	12,011	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)		2.1	132,000	159,038	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)		2.2	40,000	48,580	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)		2.1	130,000	157,085	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)		1.9	130,000	154,511	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)		1.9	130,000	154,966	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)		2.1	115,000	139,415	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)		2.2	200,000	245,214	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)		2.1	55,000	66,863	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)		2.1	275,000	335,395	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)		2.1	210,000	256,918	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)		2.2	100,000	123,427	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)		2.2	140,000	173,248	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)		2.1	145,000	177,830	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)		2.0	261,000	318,109	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)		1.8	60,000	71,771	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)		1.6	40,000	46,942	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)		1.9	245,000	296,611	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)		1.8	20,000	23,982	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)		2.1	275,000	340,241	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)		2.0	50,000	61,273	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)		2.2	60,000	75,157	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)		2.0	100,000	122,862	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)		1.9	50,000	60,831	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)		1.9	285,000	347,366	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)		1.8	20,000	24,132	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)		1.8	250,000	302,310	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)		1.7	30,000	35,903	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)		1.7	190,000	227,680	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)		1.8	125,000	151,373	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)		1.8	85,000	103,138	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)		1.7	40,000	48,020	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)		1.6	80,000	95,008	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)		1.7	260,000	312,699	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)		1.5	50,000	58,822	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)		1.6	30,000	35,687	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)		1.7	290,000	349,397	2032/9/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第141回利付国債 (20年)	1.7	155,000	187,060	2032/12/20
第142回利付国債 (20年)	1.8	120,000	146,448	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)	1.6	355,000	424,214	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)	1.7	325,000	393,471	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)	1.7	280,000	339,511	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)	1.6	275,000	329,725	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)	1.5	365,000	432,817	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	260,000	308,625	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	340,000	398,864	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	205,000	234,230	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	180,000	205,729	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	240,000	278,148	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	298,000	340,515	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	250,000	277,467	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	290,000	292,815	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	160,000	155,809	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	240,000	245,572	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	210,000	218,103	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	150,000	158,278	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	250,000	259,007	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	270,000	279,366	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	180,000	185,995	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	250,000	253,317	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	250,000	252,905	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	300,000	314,385	2038/9/20
小計		48,939,000	53,797,568	
地方債証券				
第680回東京都公募公債	1.39	100,000	101,580	2020/3/19
第705回東京都公募公債	1.06	100,000	103,299	2022/3/18
第723回東京都公募公債	0.76	100,000	103,489	2023/9/20
第729回東京都公募公債	0.69	100,000	103,496	2024/3/19
第746回東京都公募公債	0.499	100,000	103,126	2025/6/20
第761回東京都公募公債	0.075	100,000	100,542	2026/9/18
平成28年度第8回北海道公募公債	0.06	100,000	100,085	2026/10/28
平成29年度第6回北海道公募公債	0.01	100,000	99,964	2022/7/28
第211回神奈川県公募公債	0.438	100,000	102,523	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債	0.08	100,000	100,499	2026/3/19
第376回大阪府公募公債	0.82	110,000	114,107	2023/9/27
平成29年度第4回京都府公募公債	0.19	100,000	101,128	2027/6/21
平成29年度第1回兵庫県公募公債	0.187	100,000	100,925	2027/5/21
平成27年度第4回静岡県公募公債	0.157	100,000	100,205	2020/6/19
平成24年度第5回愛知県公募公債	0.886	100,000	102,996	2022/6/28
平成28年度第8回愛知県公募公債	0.065	100,000	100,346	2026/8/26
平成29年度第11回愛知県公募公債	0.225	100,000	101,260	2027/10/27
平成29年度第3回広島県公募公債	0.15	100,000	100,646	2027/9/27
平成30年度第1回広島県公募公債	0.2	100,000	100,797	2028/5/25

銘柄	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
地方債証券	%	千円	千円	
平成26年度第6回埼玉県公募公債	0.554	100,000	103,081	2024/9/26
平成27年度第1回福岡県公募公債	0.578	100,000	103,641	2025/6/26
平成29年度第6回千葉県公募公債	0.245	100,000	101,428	2028/1/25
第120回共同発行市場公募地方債	0.68	100,000	102,789	2023/3/24
第123回共同発行市場公募地方債	0.87	100,000	103,793	2023/6/23
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	103,560	2024/4/25
第156回共同発行市場公募地方債	0.1	100,000	100,645	2026/3/25
第169回共同発行市場公募地方債	0.205	100,000	101,354	2027/4/23
平成27年度第1回静岡市公募公債	0.476	100,000	103,181	2025/11/25
第26回横浜市公募公債	1.776	100,000	119,287	2033/1/28
平成26年度第5回福岡市公募公債	0.539	100,000	103,042	2024/10/28
平成29年度第2回福岡市公募公債	0.01	100,000	99,999	2022/6/27
平成27年度第2回広島市公募公債	0.464	100,000	103,136	2025/12/25
平成29年度第3回千葉市公募公債	0.215	120,000	121,327	2027/12/28
平成29年度第1回鹿児島県公募公債	0.02	100,000	100,038	2022/10/31
平成29年度第5回福井県公募公債	0.19	100,000	100,759	2028/4/27
小 計		3,530,000	3,612,073	
特殊債券(除く金融債)				
第53回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.699	127,000	131,527	2023/10/13
第78回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.381	100,000	102,980	2025/11/18
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	101,000	104,096	2021/4/30
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	114,000	118,332	2024/6/28
第227回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.544	127,000	131,331	2024/9/30
第234回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.466	100,000	103,093	2024/12/27
第249回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.484	100,000	103,475	2025/6/30
第266回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.32	133,000	136,509	2026/1/30
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	101,208	2027/1/29
第339回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.195	100,000	101,541	2028/2/29
第345回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.12	100,000	100,717	2028/4/28
第57回政府保証関西国際空港債券	1.2	100,000	102,367	2020/12/14
第208回政府保証預金保険機構債	0.1	100,000	100,263	2020/10/6
第49回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.209	100,000	101,438	2028/9/19
第31回国際協力機構債券	0.53	100,000	103,317	2025/9/19
第8回日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.45	100,000	117,165	2026/3/19
第27回道路債券	2.42	100,000	112,282	2024/3/20
第13回公営企業債券	2.16	100,000	113,602	2025/6/20
F82回地方公共団体金融機構債券	1.381	100,000	107,814	2024/11/20
F228回地方公共団体金融機構債券	1.269	100,000	111,627	2031/3/20
第66回株式会社日本政策金融公庫社債	0.03	100,000	100,000	2022/3/11
第2回一般担保住宅金融公庫債券	2.54	100,000	118,342	2026/6/19
第97回一般担保住宅金融支援機構債券	1.903	100,000	119,870	2032/3/12
第117回一般担保住宅金融支援機構債券	1.438	100,000	111,364	2027/9/17
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.46	94,435	95,624	2052/8/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	94,978	95,884	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4	95,788	96,530	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.42	95,699	96,589	2053/1/10

銘	柄	当期			償還年月日
		利率	額面金額	評価額	
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	98,534	99,152	2053/8/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	99,037	100,266	2053/10/10
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	91,567	91,928	2032/5/10
第2回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.18	94,274	94,716	2032/5/10
第3回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	98,775	99,094	2033/1/10
第52回日本学生支援債券		0.001	100,000	100,002	2020/9/18
第36回東日本高速道路株式会社社債		0.06	100,000	100,096	2021/6/18
第39回東日本高速道路株式会社社債		0.03	100,000	99,942	2021/12/20
第61回中日本高速道路株式会社社債		0.262	100,000	100,347	2020/6/2
第29回西日本高速道路株式会社社債		0.31	100,000	101,647	2026/2/12
小	計		3,865,087	4,026,083	
金融債券					
第310回信金中金債		0.225	100,000	100,358	2020/9/25
第327回信金中金債		0.06	100,000	99,969	2022/2/25
第340回信金中金債		0.11	100,000	100,128	2023/3/27
小	計		300,000	300,455	
普通社債券(含む投資法人債券)					
第484回関西電力株式会社社債		0.976	100,000	101,612	2020/10/23
第521回関西電力株式会社社債		0.18	100,000	99,887	2023/9/20
第289回四国電力株式会社社債		0.26	100,000	100,047	2026/11/25
第12回日本たばこ産業株式会社社債		0.11	100,000	99,887	2023/9/8
第3回株式会社電通無担保社債		0.424	100,000	101,231	2028/10/25
第15回旭硝子株式会社無担保社債		0.31	100,000	101,026	2027/5/28
第26回株式会社豊田自動織機無担保社債		0.361	100,000	100,742	2021/9/17
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債		0.304	100,000	100,195	2021/8/2
第17回株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ無担保社債		0.535	100,000	99,299	2028/5/31
第124回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債		1.51	100,000	103,240	2021/4/16
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債		0.89	100,000	103,536	2023/7/24
第50回株式会社日産フィナンシャルサービス無担保社債		0.1	100,000	99,636	2021/12/20
第16回三井住友ファイナンス&リース株式会社無担保社債		0.25	100,000	100,096	2024/9/13
第49回野村ホールディングス株式会社無担保社債		0.437	100,000	100,515	2020/6/10
第58回三井不動産株式会社無担保社債		0.1	100,000	99,960	2023/2/24
第120回三菱地所株式会社無担保社債		0.24	100,000	99,914	2027/6/18
第98回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.757	100,000	103,380	2024/1/30
第112回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.41	100,000	101,979	2026/1/28
第125回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債		1.133	100,000	106,500	2047/7/26
第81回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債		0.02	100,000	100,018	2020/11/27
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券		0.69	100,000	102,546	2023/3/20
第22回KDDI株式会社無担保社債		0.31	100,000	100,375	2028/7/12
第14回東京電力パワーグリッド株式会社社債		0.43	100,000	99,740	2023/7/24
第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債		0.405	100,000	100,549	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行(BFCM)円貨社債		0.384	100,000	99,988	2024/10/11
第12回ウエストパック・バンキング・コーポレーション円貨社債		0.32	100,000	100,116	2023/7/6
小	計		2,600,000	2,626,014	
合	計		59,234,087	64,362,194	

○投資信託財産の構成

(2019年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	64,362,194	99.7
コール・ローン等、その他	220,364	0.3
投資信託財産総額	64,582,558	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○特定資産の価格等の調査

(2018年1月26日～2019年1月25日)

該当事項はございません。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2019年1月25日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	64,582,558,538	
コール・ローン等	83,773,419	
公社債(評価額)	64,362,194,537	
未収利息	133,413,879	
前払費用	3,176,703	
(B) 負債	27,157,336	
未払金	27,155,600	
未払利息	225	
その他未払費用	1,511	
(C) 純資産総額(A-B)	64,555,401,202	
元本	61,581,519,887	
次期繰越損益金	2,973,881,315	
(D) 受益権総口数	61,581,519,887口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,483円	

(注) 当ファンドの期首元本額は44,564,485,799円、期中追加設定元本額は30,827,391,731円、期中一部解約元本額は13,810,357,643円です。

(注) 2019年1月25日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・FWりそな国内債券インデックスファンド	44,234,131,174円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	15,753,351,837円
・りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	410,748,538円
・つみたてバランスファンド	320,278,614円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	295,853,528円
・DCりそな グローバルバランス	167,698,114円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	141,806,762円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	94,245,977円
・Smart-i 国内債券インデックス	77,864,040円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	27,774,230円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	21,630,565円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	16,027,772円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	13,332,955円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	3,582,995円
・グローバル9資産バランスファンド(適格機関投資家限定)	3,192,786円

(注) 1口当たり純資産額は1,0483円です。

○損益の状況 (2018年1月26日～2019年1月25日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	518,716,570	
受取利息	519,184,582	
支払利息	△ 468,012	
(B) 有価証券売買損益	359,088,327	
売買益	561,663,756	
売買損	△ 202,575,429	
(C) 保管費用等	△ 18,957	
(D) 当期損益金(A+B+C)	877,785,940	
(E) 前期繰越損益金	1,461,863,463	
(F) 追加信託差損益金	1,121,755,969	
(G) 解約差損益金	△ 487,524,057	
(H) 計(D+E+F+G)	2,973,881,315	
次期繰越損益金(H)	2,973,881,315	

(注) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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) 損益の状況の中で(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。

○お知らせ

該当事項はございません。