

Smart-i 国内債券インデックス

運用報告書（全体版）

第3期（決算日 2020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、2020年6月25日に第3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 組 入 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 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
3期(2020年6月25日)	10,113	0	△1.6	387.109	△1.5	99.2	793

(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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	
(期首)	円	%		%	%
2019年6月25日	10,281	—	392.920	—	99.7
6月末	10,277	△0.0	392.695	△0.1	99.6
7月末	10,288	0.1	393.155	0.1	99.6
8月末	10,424	1.4	398.496	1.4	99.4
9月末	10,312	0.3	394.271	0.3	99.3
10月末	10,270	△0.1	392.608	△0.1	99.7
11月末	10,234	△0.5	391.325	△0.4	99.1
12月末	10,203	△0.8	390.136	△0.7	99.3
2020年1月末	10,245	△0.4	391.771	△0.3	99.2
2月末	10,322	0.4	394.745	0.5	99.1
3月末	10,153	△1.2	388.450	△1.1	99.5
4月末	10,186	△0.9	389.790	△0.8	99.4
5月末	10,141	△1.4	388.127	△1.2	99.1
(期末)					
2020年6月25日	10,113	△1.6	387.109	△1.5	99.2

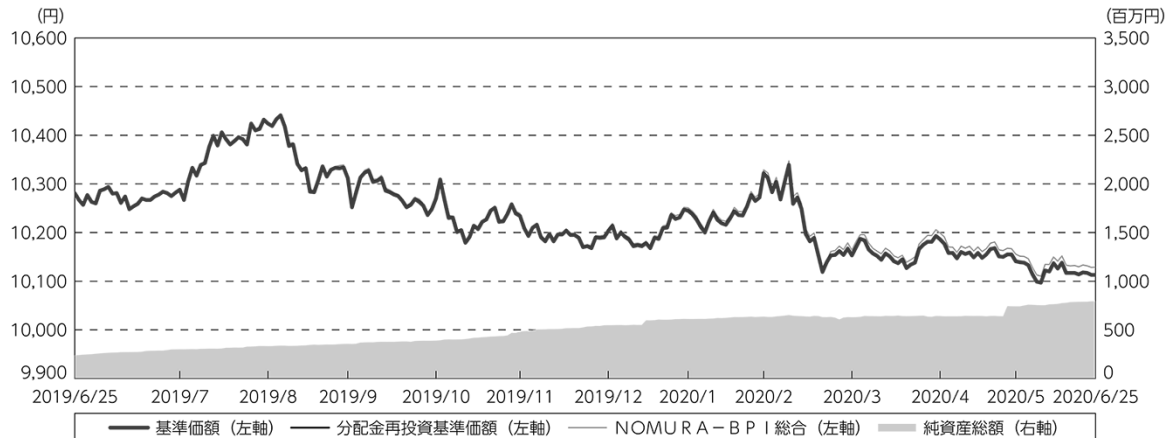
(注) 騰落率は期首比です。

(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

(2019年6月26日～2020年6月25日)

期中の基準価額等の推移



期首：10,281円

期末：10,113円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：△ 1.6% (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(2019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10,281円から当期末10,113円となり、168円の値下がりとなりました。

国内債券の市況(NOMURA-BPI総合)の下落により、基準価額は下落しました。

投資環境

国内債券市況

国内長期金利は、前期末と比較して小幅上昇（価格は下落）しました。2019年8月頃までの期間中は、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念から、長期金利は低下（債券価格は上昇）基調となりました。FRB（米連邦準備制度理事会）による利下げ等を受け、国内長期金利にも一層の低下圧力がかかりましたが、9月頃からは世界的な製造業の調整一巡を反映し、上昇に転じました。2020年2月頃からは新型肺炎問題による世界経済への影響が懸念され、投資家のリスク回避の動きに伴う債券買いや各国中央銀行の緊急利下げが見られた一方、各国政府による経済対策期待や投資家の現金化需要等による債券売りも交錯し、国内長期金利は変動率の高い展開となりました。その後、金融市場が落ち着きを取り戻すなか、日銀による資金繰り支援策を中心に金融緩和策の強化決定などを受けて、国内長期金利は0%前後で推移しました。

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-1.6%となり、ベンチマークの-1.5%を0.2%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

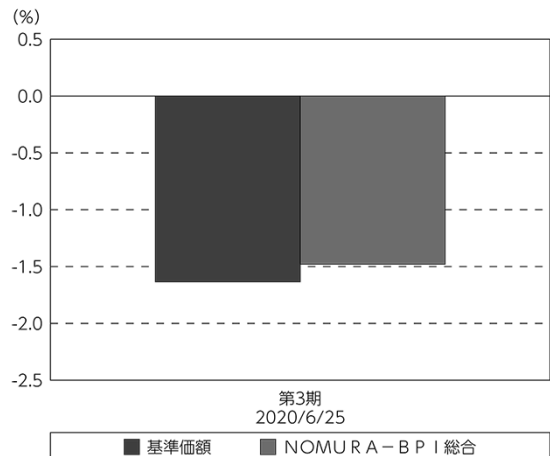
（マイナス要因）

- ・ 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3期
	2019年6月26日～ 2020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	278

(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

(2019年6月26日～2020年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 14	% 0.132	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(6)	(0.055)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(6)	(0.055)	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	0.010	(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)	(0.009)	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	15	0.142	
期中の平均基準価額は、10,254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。

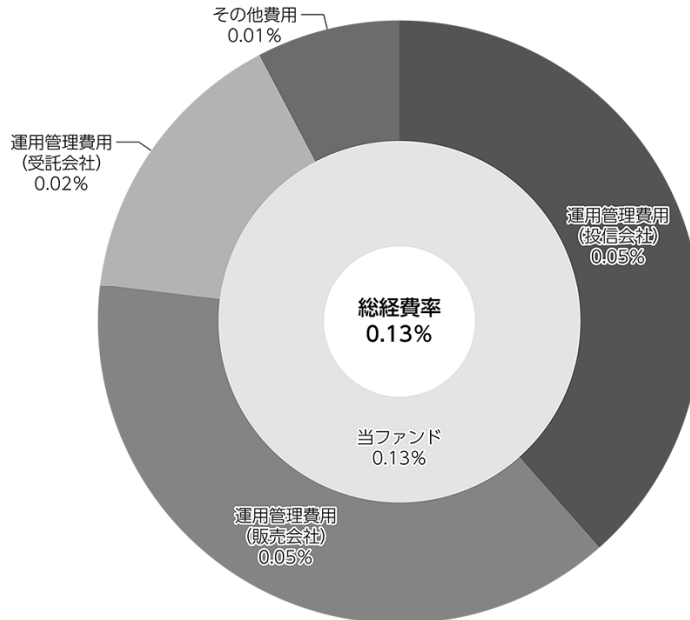
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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。

(参考情報)

○総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）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0.13%です。



(注) 当ファンドの費用は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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 当ファンドの費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注) 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は異なります。

○売買及び取引の状況

(2019年6月26日～2020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 636,646	千円 676,320	千口 105,283	千円 111,650

○利害関係人との取引状況等

(2019年6月26日～2020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 (2019年6月26日～2020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

(2019年6月26日～2020年6月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020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
	千口	千口	千円
RAM国内債券マザーファンド	222,388	753,751	793,173

○投資信託財産の構成

(2020年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
RAM国内債券マザーファンド	793,173	99.7
コール・ローン等、その他	2,479	0.3
投資信託財産総額	795,652	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

(2019年6月26日～2020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 (2020年6月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	795,652,632
コール・ローン等	2,479,540
RAM国内債券マザーファンド(評価額)	793,173,092
(B) 負債	1,925,688
未払解約金	1,472,264
未払信託報酬	423,480
未払利息	6
その他未払費用	29,938
(C) 純資産総額(A-B)	793,726,944
元本	784,845,682
次期繰越損益金	8,881,262
(D) 受益権総口数	784,845,682口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,113円

(注) 当ファンドの期首元本額は231,243,221円、期中追加設定元本額は800,635,988円、期中一部解約元本額は247,033,527円です。

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0113円です。

○損益の状況 (2019年6月26日～2020年6月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1,171
支払利息	△ 1,171
(B) 有価証券売買損益	△ 7,736,508
売買益	1,305,290
売買損	△ 9,041,798
(C) 信託報酬等	△ 709,361
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 8,447,040
(E) 前期繰越損益金	2,248,662
(F) 追加信託差損益金	15,079,640
(配当等相当額)	(15,698,390)
(売買損益相当額)	(△ 618,750)
(G) 計(D+E+F)	8,881,262
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	8,881,262
追加信託差損益金	15,079,640
(配当等相当額)	(16,093,031)
(売買損益相当額)	(△ 1,013,391)
分配準備積立金	5,727,788
繰越損益金	△11,926,166

(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(3,479,126円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(16,093,031円)および分配準備積立金(2,248,662円)より分配対象収益は21,820,819円(1万口当たり278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

該当事項はございません。

RAM国内債券マザーファンド

運用報告書

第4期（決算日 2020年1月27日）
（2019年1月26日～2020年1月27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)			債組入比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(設定日) 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	
4期(2020年1月27日)	10,645	1.5	391.374	1.5	99.3	80,324	

(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、野村証券株式会社が公表する、日本の公券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。

○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)			債組入比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率	
(期首) 2019年1月25日	10,483	—	385.440	—	99.7	
1月末	10,488	0.0	385.580	0.0	99.6	
2月末	10,509	0.2	386.427	0.3	99.6	
3月末	10,583	1.0	389.143	1.0	99.6	
4月末	10,549	0.6	387.945	0.6	99.5	
5月末	10,615	1.3	390.322	1.3	99.6	
6月末	10,679	1.9	392.695	1.9	99.7	
7月末	10,691	2.0	393.155	2.0	99.6	
8月末	10,834	3.3	398.496	3.4	99.5	
9月末	10,719	2.3	394.271	2.3	99.4	
10月末	10,677	1.9	392.608	1.9	99.8	
11月末	10,640	1.5	391.325	1.5	99.1	
12月末	10,609	1.2	390.136	1.2	99.4	
(期末) 2020年1月27日	10,645	1.5	391.374	1.5	99.3	

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2019年1月26日～2020年1月27日)

期中の基準価額等の推移

○基準価額の主な変動要因

基準価額は前期末10,483円から当期末10,645円となり、162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、前期末と比較して横ばいでした。期の前半は、米中貿易摩擦問題への警戒感や世界景気の減速懸念からリスク回避の姿勢が強まり、長期金利は低下（債券価格は上昇）基調となりました。期の後半はFRB（米連邦準備制度理事会）による利下げ等を受け世界的に金利が低下し、国内長期金利にも一層の低下圧力がかかりました。期末にかけては、世界的な製造業の調整一巡を反映し、国内長期金利は上昇基調に転じました。

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%とほぼ同水準となりました。

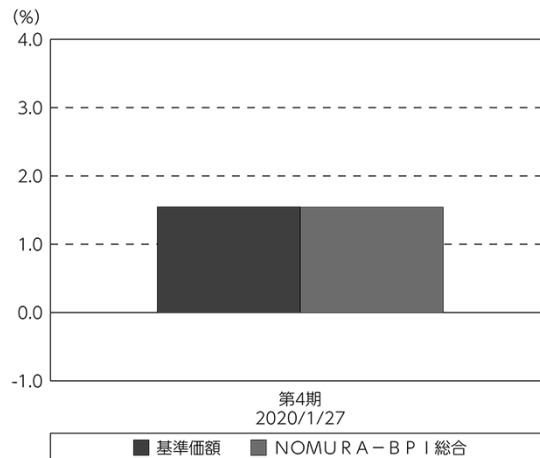
(マイナス要因)

- ・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

(2019年1月26日～2020年1月27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、10,632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

(2019年1月26日～2020年1月27日)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	49,598,015	36,119,092
	地方債証券	842,833	201,623
	特殊債券	779,021	501,953
	社債券（投資法人債券を含む）	799,610	(77,221)
		301,806	

(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

(2019年1月26日～2020年1月27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（2019年1月26日～2020年1月27日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2020年1月27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	61,478,000	67,879,350	84.5	—	55.6	19.4	9.5
	(580,000)	(629,939)	(0.8)	(—)	(0.8)	(—)	(—)
地方債証券	4,130,000	4,251,702	5.3	—	3.4	1.9	—
	(4,130,000)	(4,251,702)	(5.3)	(—)	(3.4)	(1.9)	(—)
特殊債券 (除く金融債)	4,145,866	4,312,593	5.4	—	3.9	1.1	0.4
	(4,145,866)	(4,312,593)	(5.4)	(—)	(3.9)	(1.1)	(0.4)
金融債券	200,000	200,502	0.2	—	—	0.2	—
	(200,000)	(200,502)	(0.2)	(—)	(—)	(0.2)	(—)
普通社債券 (含む投資法人債券)	3,100,000	3,135,485	3.9	—	1.6	1.8	0.5
	(3,100,000)	(3,135,485)	(3.9)	(—)	(1.6)	(1.8)	(0.5)
合 計	73,053,866	79,779,633	99.3	—	64.4	24.5	10.4
	(12,155,866)	(12,530,222)	(15.6)	(—)	(9.7)	(5.0)	(0.9)

(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	利 率	当 期 末		
		額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	%	千円	千円	
第397回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,496	2021/2/1
第398回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,532	2021/3/1
第399回利付国債 (2年)	0.1	240,000	240,688	2021/4/1
第400回利付国債 (2年)	0.1	160,000	160,491	2021/5/1
第401回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,656	2021/6/1
第402回利付国債 (2年)	0.1	500,000	501,745	2021/7/1
第403回利付国債 (2年)	0.1	130,000	130,479	2021/8/1
第404回利付国債 (2年)	0.1	170,000	170,663	2021/9/1
第405回利付国債 (2年)	0.1	380,000	381,561	2021/10/1
第406回利付国債 (2年)	0.1	330,000	331,425	2021/11/1
第407回利付国債 (2年)	0.1	200,000	200,904	2021/12/1
第136回利付国債 (5年)	0.1	550,000	554,873	2023/6/20
第137回利付国債 (5年)	0.1	740,000	747,044	2023/9/20
第138回利付国債 (5年)	0.1	880,000	888,958	2023/12/20
第139回利付国債 (5年)	0.1	700,000	707,434	2024/3/20
第140回利付国債 (5年)	0.1	740,000	748,177	2024/6/20
第141回利付国債 (5年)	0.1	730,000	738,358	2024/9/20
第127回利付国債 (5年)	0.1	350,000	350,976	2021/3/20
第128回利付国債 (5年)	0.1	470,000	471,602	2021/6/20
第129回利付国債 (5年)	0.1	450,000	451,813	2021/9/20
第130回利付国債 (5年)	0.1	560,000	562,604	2021/12/20
第131回利付国債 (5年)	0.1	510,000	512,733	2022/3/20
第132回利付国債 (5年)	0.1	630,000	633,855	2022/6/20
第133回利付国債 (5年)	0.1	890,000	896,141	2022/9/20
第134回利付国債 (5年)	0.1	970,000	977,323	2022/12/20
第135回利付国債 (5年)	0.1	620,000	625,084	2023/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	40,000	61,958	2048/3/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	70,000	105,639	2049/3/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	110,000	167,305	2050/3/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	130,000	199,773	2051/3/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	170,000	253,599	2052/3/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	170,000	250,478	2053/3/20
第7回利付国債 (40年)	1.7	160,000	227,256	2054/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	180,000	239,889	2055/3/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	300,000	300,948	2056/3/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	280,000	328,991	2057/3/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	210,000	239,780	2058/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	140,000	144,982	2059/3/20
第313回利付国債 (10年)	1.3	320,000	325,257	2021/3/20
第314回利付国債 (10年)	1.1	130,000	131,839	2021/3/20
第315回利付国債 (10年)	1.2	295,000	300,510	2021/6/20
第316回利付国債 (10年)	1.1	300,000	305,187	2021/6/20
第317回利付国債 (10年)	1.1	460,000	469,397	2021/9/20
第318回利付国債 (10年)	1.0	366,000	372,873	2021/9/20

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319回利付国債	(10年)	1.1	140,000	143,294	2021/12/20
第320回利付国債	(10年)	1.0	352,000	359,613	2021/12/20
第321回利付国債	(10年)	1.0	391,000	400,606	2022/3/20
第322回利付国債	(10年)	0.9	220,000	224,932	2022/3/20
第323回利付国債	(10年)	0.9	340,000	348,568	2022/6/20
第324回利付国債	(10年)	0.8	183,000	187,172	2022/6/20
第325回利付国債	(10年)	0.8	470,000	481,848	2022/9/20
第326回利付国債	(10年)	0.7	280,000	286,955	2022/12/20
第327回利付国債	(10年)	0.8	387,000	397,739	2022/12/20
第328回利付国債	(10年)	0.6	461,000	471,981	2023/3/20
第329回利付国債	(10年)	0.8	477,000	492,531	2023/6/20
第330回利付国債	(10年)	0.8	257,000	265,992	2023/9/20
第331回利付国債	(10年)	0.6	90,000	92,489	2023/9/20
第332回利付国債	(10年)	0.6	312,000	321,225	2023/12/20
第333回利付国債	(10年)	0.6	445,000	458,995	2024/3/20
第334回利付国債	(10年)	0.6	421,000	435,052	2024/6/20
第335回利付国債	(10年)	0.5	175,000	180,360	2024/9/20
第336回利付国債	(10年)	0.5	180,000	185,812	2024/12/20
第337回利付国債	(10年)	0.3	340,000	347,626	2024/12/20
第338回利付国債	(10年)	0.4	741,000	762,303	2025/3/20
第339回利付国債	(10年)	0.4	335,000	345,106	2025/6/20
第340回利付国債	(10年)	0.4	674,000	695,291	2025/9/20
第341回利付国債	(10年)	0.3	370,000	380,012	2025/12/20
第342回利付国債	(10年)	0.1	220,000	223,476	2026/3/20
第343回利付国債	(10年)	0.1	610,000	619,839	2026/6/20
第344回利付国債	(10年)	0.1	750,000	762,577	2026/9/20
第345回利付国債	(10年)	0.1	660,000	671,490	2026/12/20
第346回利付国債	(10年)	0.1	470,000	478,304	2027/3/20
第347回利付国債	(10年)	0.1	220,000	223,942	2027/6/20
第348回利付国債	(10年)	0.1	440,000	447,986	2027/9/20
第349回利付国債	(10年)	0.1	420,000	427,530	2027/12/20
第350回利付国債	(10年)	0.1	560,000	569,889	2028/3/20
第351回利付国債	(10年)	0.1	400,000	406,940	2028/6/20
第352回利付国債	(10年)	0.1	380,000	386,456	2028/9/20
第353回利付国債	(10年)	0.1	500,000	508,285	2028/12/20
第354回利付国債	(10年)	0.1	470,000	477,567	2029/3/20
第355回利付国債	(10年)	0.1	360,000	365,612	2029/6/20
第356回利付国債	(10年)	0.1	720,000	730,814	2029/9/20
第1回利付国債	(30年)	2.8	60,000	76,533	2029/9/20
第11回利付国債	(30年)	1.7	10,000	12,186	2033/6/20
第12回利付国債	(30年)	2.1	40,000	51,042	2033/9/20
第13回利付国債	(30年)	2.0	90,000	113,899	2033/12/20
第14回利付国債	(30年)	2.4	20,000	26,524	2034/3/20
第15回利付国債	(30年)	2.5	100,000	134,527	2034/6/20
第16回利付国債	(30年)	2.5	70,000	94,451	2034/9/20
第17回利付国債	(30年)	2.4	110,000	147,342	2034/12/20

銘柄	利	当期		
		率	額面金額	評価額
	%	千円	千円	償還年月日
国債証券				
第18回利付国債 (30年)	2.3	120,000	159,372	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)	2.3	100,000	133,247	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)	2.5	60,000	82,053	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)	2.3	90,000	120,692	2035/12/20
第22回利付国債 (30年)	2.5	50,000	68,786	2036/3/20
第23回利付国債 (30年)	2.5	160,000	220,859	2036/6/20
第24回利付国債 (30年)	2.5	100,000	138,497	2036/9/20
第25回利付国債 (30年)	2.3	100,000	135,646	2036/12/20
第26回利付国債 (30年)	2.4	225,000	309,852	2037/3/20
第27回利付国債 (30年)	2.5	215,000	301,586	2037/9/20
第28回利付国債 (30年)	2.5	150,000	211,687	2038/3/20
第29回利付国債 (30年)	2.4	140,000	196,063	2038/9/20
第30回利付国債 (30年)	2.3	190,000	264,037	2039/3/20
第31回利付国債 (30年)	2.2	130,000	179,142	2039/9/20
第32回利付国債 (30年)	2.3	215,000	302,115	2040/3/20
第33回利付国債 (30年)	2.0	250,000	338,207	2040/9/20
第34回利付国債 (30年)	2.2	275,000	384,989	2041/3/20
第35回利付国債 (30年)	2.0	276,000	376,717	2041/9/20
第36回利付国債 (30年)	2.0	255,000	349,717	2042/3/20
第37回利付国債 (30年)	1.9	310,000	420,518	2042/9/20
第38回利付国債 (30年)	1.8	170,000	227,886	2043/3/20
第39回利付国債 (30年)	1.9	180,000	245,905	2043/6/20
第40回利付国債 (30年)	1.8	165,000	222,093	2043/9/20
第41回利付国債 (30年)	1.7	185,000	245,202	2043/12/20
第42回利付国債 (30年)	1.7	160,000	212,574	2044/3/20
第43回利付国債 (30年)	1.7	190,000	252,755	2044/6/20
第44回利付国債 (30年)	1.7	150,000	200,025	2044/9/20
第45回利付国債 (30年)	1.5	210,000	270,249	2044/12/20
第46回利付国債 (30年)	1.5	210,000	270,488	2045/3/20
第47回利付国債 (30年)	1.6	220,000	289,185	2045/6/20
第48回利付国債 (30年)	1.4	203,000	257,089	2045/9/20
第49回利付国債 (30年)	1.4	220,000	279,149	2045/12/20
第50回利付国債 (30年)	0.8	190,000	212,767	2046/3/20
第51回利付国債 (30年)	0.3	240,000	238,250	2046/6/20
第52回利付国債 (30年)	0.5	210,000	219,011	2046/9/20
第53回利付国債 (30年)	0.6	240,000	256,322	2046/12/20
第54回利付国債 (30年)	0.8	230,000	257,567	2047/3/20
第55回利付国債 (30年)	0.8	80,000	89,557	2047/6/20
第56回利付国債 (30年)	0.8	180,000	201,430	2047/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	240,000	268,809	2047/12/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	380,000	425,436	2048/3/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	180,000	196,777	2048/6/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	210,000	241,008	2048/9/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	170,000	185,855	2048/12/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	200,000	207,658	2049/3/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	200,000	202,126	2049/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第64回利付国債 (30年)	0.4	250,000	252,340	2049/9/20
第49回利付国債 (20年)	2.1	30,000	30,772	2021/3/22
第50回利付国債 (20年)	1.9	150,000	153,517	2021/3/22
第51回利付国債 (20年)	2.0	90,000	92,697	2021/6/21
第52回利付国債 (20年)	2.1	190,000	197,039	2021/9/21
第53回利付国債 (20年)	2.1	20,000	20,852	2021/12/20
第54回利付国債 (20年)	2.2	180,000	188,011	2021/12/20
第55回利付国債 (20年)	2.0	100,000	104,609	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)	2.0	10,000	10,516	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)	1.9	110,000	115,412	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)	1.9	100,000	105,455	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)	1.7	40,000	42,162	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)	1.4	30,000	31,360	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)	1.0	50,000	51,830	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)	0.8	80,000	82,618	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)	1.8	60,000	64,010	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)	1.9	120,000	129,060	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	380,000	410,582	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	20,000	21,712	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	90,000	98,830	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)	2.1	60,000	65,637	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	110,000	122,400	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)	2.2	100,000	110,389	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	210,000	232,094	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	180,000	199,076	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	100,000	111,654	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	100,000	110,618	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	20,000	22,227	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)	1.9	50,000	55,571	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	20,000	22,337	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)	2.1	180,000	202,014	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)	2.0	30,000	33,671	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	170,000	191,771	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)	2.1	10,000	11,337	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)	2.0	120,000	135,339	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)	2.1	150,000	170,913	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)	2.3	100,000	115,182	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	90,000	103,105	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	185,000	214,250	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)	2.2	120,000	138,199	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	90,000	104,193	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	10,000	11,644	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	215,000	248,692	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	90,000	103,926	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	90,000	104,576	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	185,000	218,714	2027/6/20

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円	
第96回利付国債 (20年)	2.1	70,000	81,711	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	130,000	153,384	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	70,000	82,051	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	205,000	241,264	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	151,000	179,647	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	20,000	24,123	2028/3/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	145,000	175,676	2028/6/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	20,000	24,062	2028/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	10,000	11,861	2028/6/20
第105回利付国債 (20年)	2.1	132,000	157,182	2028/9/20
第106回利付国債 (20年)	2.2	40,000	47,979	2028/9/20
第107回利付国債 (20年)	2.1	280,000	334,670	2028/12/20
第108回利付国債 (20年)	1.9	130,000	153,054	2028/12/20
第109回利付国債 (20年)	1.9	180,000	212,617	2029/3/20
第110回利付国債 (20年)	2.1	115,000	137,954	2029/3/20
第111回利付国債 (20年)	2.2	200,000	242,690	2029/6/20
第112回利付国債 (20年)	2.1	205,000	246,822	2029/6/20
第113回利付国債 (20年)	2.1	155,000	187,384	2029/9/20
第114回利付国債 (20年)	2.1	260,000	315,419	2029/12/20
第115回利付国債 (20年)	2.2	100,000	122,309	2029/12/20
第116回利付国債 (20年)	2.2	140,000	171,927	2030/3/20
第117回利付国債 (20年)	2.1	215,000	261,842	2030/3/20
第118回利付国債 (20年)	2.0	231,000	280,027	2030/6/20
第119回利付国債 (20年)	1.8	60,000	71,482	2030/6/20
第120回利付国債 (20年)	1.6	140,000	163,872	2030/6/20
第121回利付国債 (20年)	1.9	165,000	198,897	2030/9/20
第122回利付国債 (20年)	1.8	150,000	179,214	2030/9/20
第123回利付国債 (20年)	2.1	285,000	350,957	2030/12/20
第124回利付国債 (20年)	2.0	150,000	183,078	2030/12/20
第125回利付国債 (20年)	2.2	120,000	149,575	2031/3/20
第126回利付国債 (20年)	2.0	100,000	122,415	2031/3/20
第127回利付国債 (20年)	1.9	50,000	60,650	2031/3/20
第128回利付国債 (20年)	1.9	285,000	346,685	2031/6/20
第129回利付国債 (20年)	1.8	70,000	84,353	2031/6/20
第130回利付国債 (20年)	1.8	230,000	278,042	2031/9/20
第131回利付国債 (20年)	1.7	120,000	143,668	2031/9/20
第132回利付国債 (20年)	1.7	160,000	192,120	2031/12/20
第133回利付国債 (20年)	1.8	245,000	297,094	2031/12/20
第134回利付国債 (20年)	1.8	155,000	188,411	2032/3/20
第135回利付国債 (20年)	1.7	40,000	48,138	2032/3/20
第136回利付国債 (20年)	1.6	80,000	95,307	2032/3/20
第137回利付国債 (20年)	1.7	110,000	132,678	2032/6/20
第138回利付国債 (20年)	1.5	160,000	189,036	2032/6/20
第139回利付国債 (20年)	1.6	160,000	191,012	2032/6/20
第140回利付国債 (20年)	1.7	340,000	411,260	2032/9/20
第141回利付国債 (20年)	1.7	195,000	236,519	2032/12/20

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142回利付国債 (20年)		1.8	170,000	208,377	2032/12/20
第143回利付国債 (20年)		1.6	315,000	378,733	2033/3/20
第144回利付国債 (20年)		1.5	140,000	166,499	2033/3/20
第145回利付国債 (20年)		1.7	395,000	481,378	2033/6/20
第146回利付国債 (20年)		1.7	320,000	391,020	2033/9/20
第147回利付国債 (20年)		1.6	355,000	429,731	2033/12/20
第148回利付国債 (20年)		1.5	385,000	461,757	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)		1.5	370,000	444,751	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)		1.4	440,000	523,305	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)		1.2	345,000	400,983	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)		1.2	330,000	383,849	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)		1.3	320,000	377,635	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)		1.2	348,000	406,022	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)		1.0	370,000	420,449	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)		0.4	340,000	353,950	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)		0.2	270,000	272,157	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)		0.5	280,000	295,912	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)		0.6	300,000	321,975	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)		0.7	210,000	228,916	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)		0.6	340,000	364,694	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)		0.6	220,000	236,002	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)		0.6	270,000	289,656	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)		0.5	390,000	411,196	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)		0.5	280,000	295,162	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)		0.7	370,000	403,248	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)		0.5	320,000	336,860	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)		0.4	270,000	278,923	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)		0.3	260,000	263,621	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)		0.3	420,000	425,523	2039/9/20
小 計			61,478,000	67,879,350	
地方債証券					
第14回東京都公募公債		2.31	100,000	118,679	2028/3/17
第705回東京都公募公債		1.06	100,000	102,285	2022/3/18
第723回東京都公募公債		0.76	100,000	102,843	2023/9/20
第729回東京都公募公債		0.69	100,000	102,936	2024/3/19
第746回東京都公募公債		0.499	100,000	102,717	2025/6/20
第761回東京都公募公債		0.075	100,000	100,471	2026/9/18
平成28年度第8回北海道公募公債		0.06	100,000	100,310	2026/10/28
平成29年度第6回北海道公募公債		0.01	100,000	100,049	2022/7/28
第211回神奈川県公募公債		0.438	100,000	102,240	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債		0.08	100,000	100,466	2026/3/19
第164回大阪府公募公債		0.001	100,000	100,092	2024/7/30
第376回大阪府公募公債		0.82	110,000	113,385	2023/9/27
第435回大阪府公募公債		0.2	100,000	101,412	2028/8/30
第451回大阪府公募公債		0.063	100,000	99,881	2029/12/26
平成27年度第13回京都府公募公債		0.11	100,000	100,649	2026/3/17

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券		%	千円	千円	
平成29年度第4回京都市公募公債		0.19	100,000	101,411	2027/6/21
平成29年度第1回兵庫県公募公債		0.187	100,000	101,299	2027/5/21
平成30年度第14回静岡県公募公債		0.15	100,000	100,974	2028/12/20
平成24年度第5回愛知県公募公債		0.886	100,000	102,175	2022/6/28
平成28年度第8回愛知県公募公債		0.065	100,000	100,401	2026/8/26
平成29年度第11回愛知県公募公債		0.225	100,000	101,731	2027/10/27
平成29年度第3回広島県公募公債		0.15	100,000	101,151	2027/9/27
平成30年度第1回広島県公募公債		0.2	100,000	101,494	2028/5/25
第8回埼玉県公募公債		2.19	100,000	120,353	2029/9/20
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	100,000	102,673	2024/9/26
平成27年度第1回福岡県公募公債		0.578	100,000	103,154	2025/6/26
平成29年度第6回千葉県公募公債		0.245	100,000	101,876	2028/1/25
第120回共同発行市場公募地方債		0.68	100,000	102,204	2023/3/24
第123回共同発行市場公募地方債		0.87	100,000	103,029	2023/6/23
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	100,000	103,005	2024/4/25
第156回共同発行市場公募地方債		0.1	100,000	100,590	2026/3/25
第169回共同発行市場公募地方債		0.205	100,000	101,488	2027/4/23
平成27年度第1回静岡市公募公債		0.476	100,000	102,803	2025/11/25
第26回横浜市公募公債		1.776	100,000	120,664	2033/1/28
平成26年度第5回福岡市公募公債		0.539	100,000	102,652	2024/10/28
平成29年度第2回福岡市公募公債		0.01	100,000	100,057	2022/6/27
平成27年度第2回広島市公募公債		0.464	100,000	102,770	2025/12/25
平成29年度第3回千葉市公募公債		0.215	120,000	121,993	2027/12/28
平成29年度第1回鹿児島県公募公債		0.02	100,000	100,100	2022/10/31
平成29年度第5回福井県公募公債		0.19	100,000	101,440	2028/4/27
平成29年度第2回岡山県公募公債		0.235	100,000	101,799	2028/1/31
小	計		4,130,000	4,251,702	
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	130,535	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	102,451	2025/11/18
第97回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.13	145,000	146,886	2027/6/14
第111回政府保証地方公共団体金融機構債券		0.209	113,000	115,163	2028/8/15
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	102,756	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	117,504	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	130,531	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	102,543	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	102,846	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	135,884	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	101,110	2027/1/29
第330回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.16	100,000	101,582	2027/11/30
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	101,905	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	101,281	2028/4/28
第28回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債		0.45	100,000	102,514	2025/3/13
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	101,937	2028/9/19
第31回国際協力機構債券		0.53	100,000	102,879	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	114,724	2026/3/19

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
特殊債券(除く金融債)		%	千円	千円	
第27回道路債券		2.42	100,000	110,088	2024/3/20
第13回公営企業債券		2.16	100,000	111,496	2025/6/20
F 82回地方公共団体金融機構債券		1.381	100,000	106,723	2024/11/20
F 132回地方公共団体金融機構債券		1.09	100,000	105,882	2025/7/30
F 228回地方公共団体金融機構債券		1.269	100,000	112,325	2031/3/20
第66回株式会社日本政策金融公庫社債		0.03	100,000	100,085	2022/3/11
第2回一般担保住宅金融公庫債券		2.54	100,000	115,900	2026/6/19
第18回一般担保住宅金融支援機構債券		2.15	100,000	107,897	2023/9/20
第97回一般担保住宅金融支援機構債券		1.903	100,000	120,444	2032/3/12
第117回一般担保住宅金融支援機構債券		1.438	100,000	110,267	2027/9/17
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	90,172	91,793	2052/8/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	90,460	91,835	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	91,540	92,798	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	91,224	92,608	2053/1/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	94,350	95,585	2053/8/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	95,151	96,958	2053/10/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	99,371	99,207	2054/11/10
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	74,423	74,433	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	77,542	77,607	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	81,633	82,002	2033/1/10
第36回東日本高速道路株式会社社債		0.06	100,000	100,076	2021/6/18
第39回東日本高速道路株式会社社債		0.03	100,000	100,066	2021/12/20
第29回西日本高速道路株式会社社債		0.31	100,000	101,478	2026/2/12
小	計		4,145,866	4,312,593	
金融債券					
第327回信金中金債		0.06	100,000	100,123	2022/2/25
第340回信金中金債		0.11	100,000	100,379	2023/3/27
小	計		200,000	200,502	
普通社債券(含む投資法人債券)					
第521回関西電力株式会社社債		0.18	100,000	100,110	2023/9/20
第289回四国電力株式会社社債		0.26	100,000	100,242	2026/11/25
第1回株式会社日清製粉グループ本社無担保社債		0.2	100,000	99,518	2029/7/13
第1回コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス社債		0.1	100,000	99,958	2024/9/19
第12回日本たばこ産業株式会社社債		0.11	100,000	100,020	2023/9/8
第3回株式会社電通無担保社債		0.424	100,000	101,545	2028/10/25
第12回Zホールディングス株式会社無担保社債		0.37	100,000	99,448	2026/7/31
第12回富士フイルムホールディングス株式会社無担保社債		0.02	100,000	99,834	2022/7/26
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債		0.375	100,000	101,011	2029/4/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債		0.31	100,000	100,875	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	100,467	2021/9/17
第12回株式会社小松製作所無担保社債		0.11	100,000	99,982	2024/6/6
第1回日本生命2017基金特定目的会社特定社債		0.304	100,000	100,086	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	100,774	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	101,793	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	102,962	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	99,689	2021/12/20

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)	%	千円	千円	
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	100,279	2024/9/13
第75回三菱UFJリース株式会社無担保社債	0.22	100,000	100,158	2025/1/23
第58回三井不動産株式会社無担保社債	0.1	100,000	99,988	2023/2/24
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	100,000	100,290	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	102,724	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	101,730	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	115,029	2047/7/26
第63回日本電信電話株式会社電信電話債券	0.69	100,000	101,959	2023/3/20
第22回KDDI株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,549	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	100,630	2023/7/24
第28回東京電力パワーグリッド株式会社社債	1.01	100,000	102,052	2029/7/10
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	101,277	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	100,382	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	100,124	2023/7/6
小 計		3,100,000	3,135,485	
合 計		73,053,866	79,779,633	

○投資信託財産の構成

(2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	79,779,633	98.8
コール・ローン等、その他	951,748	1.2
投資信託財産総額	80,731,381	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

(2019年1月26日～2020年1月27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 (2020年1月27日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	80,731,381,445	
コール・ローン等	403,345,874	
公社債(評価額)	79,779,633,401	
未収入金	392,459,500	
未収利息	142,956,853	
前払費用	12,985,817	
(B) 負債	407,195,893	
未払金	96,864,800	
未払解約金	310,330,000	
未払利息	1,093	
(C) 純資産総額(A-B)	80,324,185,552	
元本	75,458,660,146	
次期繰越損益金	4,865,525,406	
(D) 受益権総口数	75,458,660,146口	
1万円当たり基準価額(C/D)	10,645円	

(注) 当ファンドの期首元本額は61,581,519,887円、期中追加設定元本額は47,499,596,095円、期中一部解約元本額は33,622,455,836円です。

(注) 2020年1月27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	40,338,229,354円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	6,168,912,518円
・りそなラップ型ファンド(安定型)	5,763,205,997円
・りそなFT 国内債券インデックス(適格機関投資家専用)	5,525,589,370円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	3,516,772,895円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	3,386,960,747円
・りそなラップ型ファンド(安定成長型)	2,783,463,760円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	2,572,261,983円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-03	1,110,535,002円
・つみたてバランスファンド	1,065,663,362円
・FWりそな円建債券アクティブファンド	956,561,505円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	715,977,238円
・Smart-i 国内債券インデックス	568,017,780円
・DCりそな グローバルバランス	314,264,624円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	215,813,232円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	150,529,612円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	141,846,285円
・りそなラップ型ファンド(成長型)	60,167,896円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	55,970,164円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	30,388,907円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	8,894,412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)	5,637,595円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	2,491,674円
・りそなFT RCバランスファンド(適格機関投資家専用)	305,467円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	190,120円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	8,647円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0645円です。

○損益の状況 (2019年1月26日～2020年1月27日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	585,596,831	
受取利息	586,160,833	
支払利息	△ 564,002	
(B) 有価証券売買損益	599,654,234	
売買益	1,037,971,425	
売買損	△ 438,317,191	
(C) 保管費用等	△ 13,915	
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,185,237,150	
(E) 前期繰越損益金	2,973,881,315	
(F) 追加信託差損益金	3,119,538,105	
(G) 解約差損益金	△2,413,131,164	
(H) 計(D+E+F+G)	4,865,525,406	
次期繰越損益金(H)	4,865,525,406	

(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。