

Smart-i 国内債券インデックス

運用報告書（全体版）

第4期（決算日 2021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、2021年6月25日に第4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	RM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 (分配落)	騰落率		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債組入比率	純資産総額
		円	%	円	%		
(設定日) 2017年8月29日	10,000	円	%	380.422	%	%	百万円 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
4期(2021年6月25日)	10,098	0	△0.1	387.222	0.0	99.3	1,412

(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。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債組入比率
		円	%	円	%	
(期首) 2020年6月25日	10,113	円	%	387.109	%	%
6月末	10,099	△0.1		386.558	△0.1	99.2
7月末	10,131	0.2		387.913	0.2	99.0
8月末	10,084	△0.3		386.087	△0.3	99.2
9月末	10,111	△0.0		387.219	0.0	98.9
10月末	10,094	△0.2		386.633	△0.1	99.2
11月末	10,106	△0.1		387.118	0.0	99.2
12月末	10,106	△0.1		387.203	0.0	99.1
2021年1月末	10,080	△0.3		386.252	△0.2	99.1
2月末	9,995	△1.2		383.056	△1.0	99.2
3月末	10,063	△0.5		385.724	△0.4	99.2
4月末	10,081	△0.3		386.440	△0.2	99.0
5月末	10,084	△0.3		386.621	△0.1	98.9
(期末) 2021年6月25日	10,098	△0.1		387.222	0.0	99.3

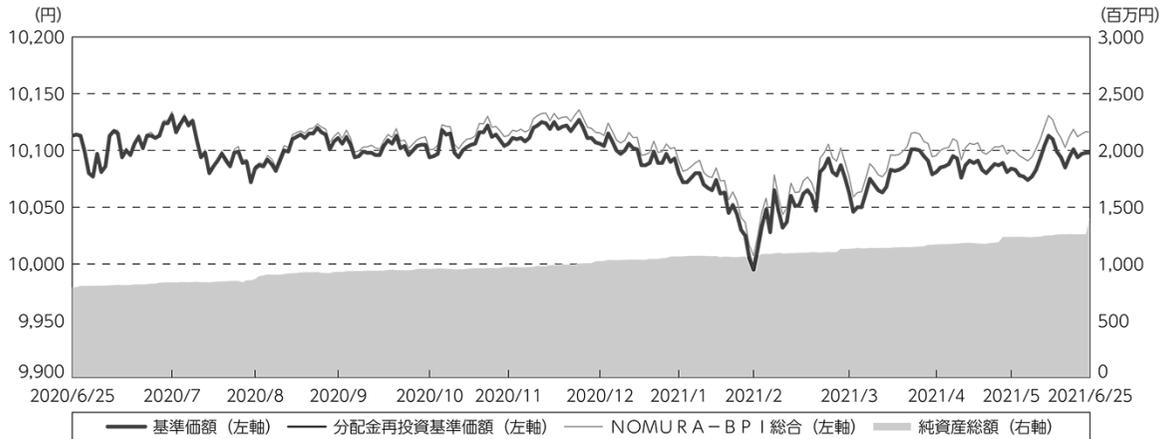
(注) 騰落率は期首比です。

(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

(2020年6月26日～2021年6月25日)

期中の基準価額等の推移



期首：10,113円

期末：10,098円 (既払分配金(税引前)：0円)

騰落率：△ 0.1% (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(2020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。

○基準価額の主な変動要因

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10,113円から当期末10,098円となり、15円の値下がりとなりました。

国内債券の市況(NOMURA-BPI総合)は僅かに上昇しましたが、信託報酬などの諸費用の負担が生じたこと等により基準価額は下落しました。

投資環境

国内債券市況

国内の長期金利は、前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。新型コロナウイルス問題に伴う先行きの不透明感が続くなか、日銀による資金繰り支援策強化等の大規模な金融緩和策が奏功し、国内の長期金利は概ね0%近傍で推移しました。2021年1月以降、新型コロナウイルスワクチンの普及に伴う経済活動正常化への期待から先進国で金利上昇が見られたことに加え、日銀による金融政策の調整観測が強まり、国内の長期金利も上昇基調となりましたが、期末にかけては緊急事態宣言の再発令や国内におけるワクチン普及ペースの伸び悩みから経済活動正常化の後ずれ等が意識され、国内の長期金利は徐々に下落しました。

当ファンドのポートフォリオ

当ファンド

RM国内債券マザーファンド受益証券を高位に組み入れて運用を行いました。

RM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-0.1%となり、ベンチマークの+0.0%を0.2%下回りました。主な差異要因は以下の通りです。

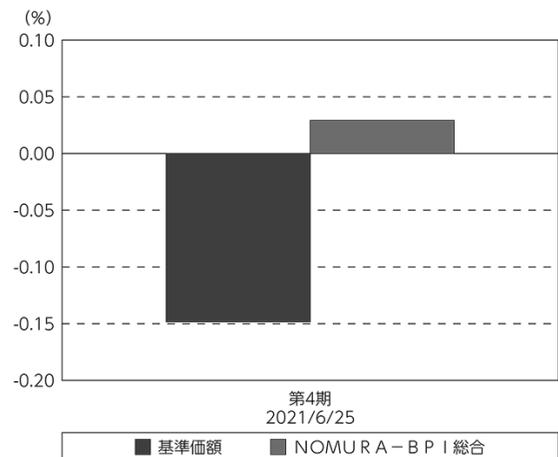
(マイナス要因)

- ・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4期
	2020年6月26日～ 2021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	323

(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、RM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。

RM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

(2020年6月26日～2021年6月25日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 13	% 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	0.009	(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	14	0.141	
期中の平均基準価額は、10,086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。

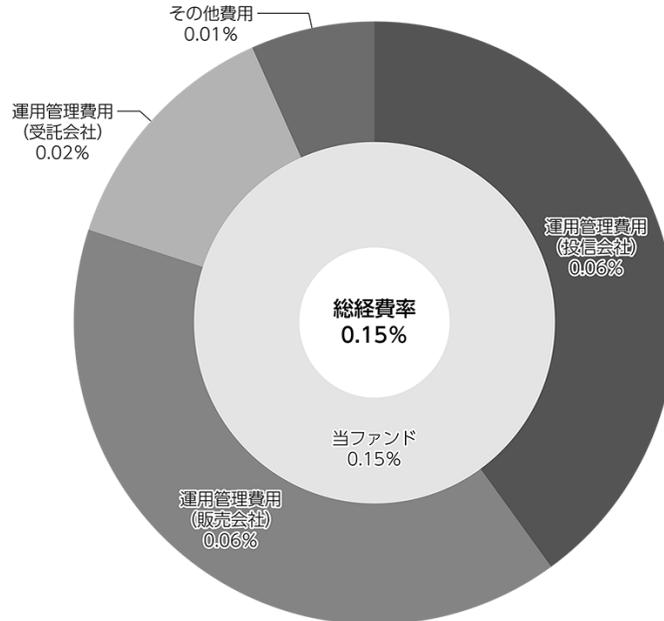
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.15%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

(2020年6月26日～2021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
		千口	千円	千口	千円
RM国内債券マザーファンド		687,379	722,410	99,946	104,990

○利害関係人との取引状況等

(2020年6月26日～2021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 (2020年6月26日～2021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

(2020年6月26日～2021年6月25日)

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021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
RM国内債券マザーファンド	千口 753,751	千口 1,341,184	千円 1,411,194

○投資信託財産の構成

(2021年6月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
RM国内債券マザーファンド	千円 1,411,194	% 99.7
コール・ローン等、その他	4,163	0.3
投資信託財産総額	1,415,357	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

(2020年6月26日～2021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 (2021年6月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,415,357,572
コール・ローン等	4,163,185
RM国内債券マザーファンド(評価額)	1,411,194,387
(B) 負債	3,176,563
未払解約金	2,388,264
未払信託報酬	740,248
未払利息	11
その他未払費用	48,040
(C) 純資産総額(A-B)	1,412,181,009
元本	1,398,469,466
次期繰越損益金	13,711,543
(D) 受益権総口数	1,398,469,466口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,098円

(注) 当ファンドの期首元本額は784,845,682円、期中追加設定元本額は881,047,145円、期中一部解約元本額は267,423,361円です。
(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0098円です。

○損益の状況 (2020年6月26日～2021年6月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 2,553
支払利息	△ 2,553
(B) 有価証券売買損益	1,122,296
売買益	3,060,849
売買損	△ 1,938,553
(C) 信託報酬等	△ 1,426,382
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 306,639
(E) 前期繰越損益金	△ 4,768,413
(F) 追加信託差損益金	18,786,595
(配当等相当額)	(34,473,690)
(売買損益相当額)	(△15,687,095)
(G) 計(D+E+F)	13,711,543
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	13,711,543
追加信託差損益金	18,786,595
(配当等相当額)	(34,809,764)
(売買損益相当額)	(△16,023,169)
分配準備積立金	10,485,847
繰越損益金	△15,560,899

(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(6,079,438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(34,809,764円)および分配準備積立金(4,406,409円)より分配対象収益は45,295,611円(1万口当たり323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

・投資する親投資信託の名称変更に伴い、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

<当ファンドが投資対象とするRM国内債券マザーファンドは以下の約款変更を行いました。>

・ファンド名称の冒頭部分の「RAM」を「RM」に変更するため、約款に所要の変更を行いました。(2021年4月24日)

RAM国内債券マザーファンド

運用報告書

第5期（決算日 2021年1月25日）
（2020年1月28日～2021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)		債組入比率	純資産総額
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(設定日) 2015年12月11日	10,000	—	367.259	—	—	百万円 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
5期(2021年1月25日)	10,506	△1.3	386.571	△1.2	99.3	82,199

(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。

○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	
(期首) 2020年1月27日	10,645	—	391.374	—	99.3
1月末	10,654	0.1	391.771	0.1	99.2
2月末	10,736	0.9	394.745	0.9	99.2
3月末	10,561	△0.8	388.450	△0.7	99.5
4月末	10,597	△0.5	389.790	△0.4	99.5
5月末	10,551	△0.9	388.127	△0.8	99.2
6月末	10,508	△1.3	386.558	△1.2	99.3
7月末	10,543	△1.0	387.913	△0.9	99.0
8月末	10,495	△1.4	386.087	△1.4	99.3
9月末	10,525	△1.1	387.219	△1.1	99.0
10月末	10,508	△1.3	386.633	△1.2	99.3
11月末	10,522	△1.2	387.118	△1.1	99.3
12月末	10,523	△1.1	387.203	△1.1	99.2
(期末) 2021年1月25日	10,506	△1.3	386.571	△1.2	99.3

(注) 騰落率は期首比です。

○運用経過

(2020年1月28日～2021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10,645円から当期末10,506円となり、139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。



(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

国内の長期金利は前期末と比較して上昇（債券価格は下落）しました。2020年3月には新型コロナウイルスの感染拡大に伴う不確実性の高まりが金融市場の混乱に繋がり、国内長期金利は乱高下しました。その後、日銀による資金繰り支援策等の金融緩和策強化等が奏功し、国内長期金利は概ね0%近傍で推移しました。他方、超長期年限の国債利回りは、大規模な補正予算や2021年度予算案編成を受けて、国債発行額の増加や財政健全化の一時棚上げを懸念する動きが見られ、小幅に上昇しました。

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-1.3%となり、ベンチマークの-1.2%を0.1%下回りました。

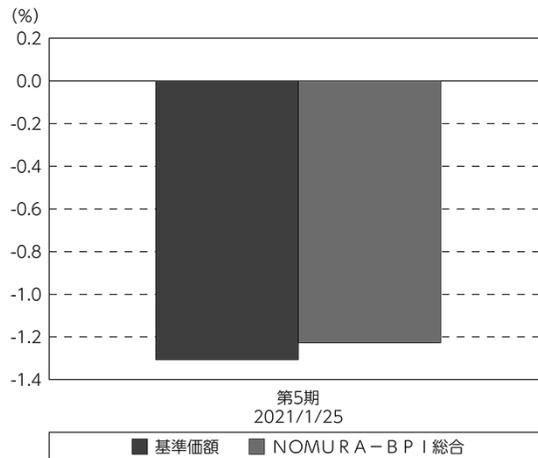
(マイナス要因)

- ・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

(2020年1月28日～2021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、10,560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

(2020年1月28日～2021年1月25日)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	66,300,402	64,472,432
	地方債証券	542,875	304,497
	特殊債券	1,568,381	302,436
	社債券（投資法人債券を含む）	1,001,529	(107,200)
			602,082

(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

(2020年1月28日～2021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（2020年1月28日～2021年1月25日）

該当事項はございません。

○組入資産の明細

(2021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	63,185,000	67,987,913	82.7	—	54.9	18.3	9.5
	(590,000)	(584,991)	(0.7)	(—)	(0.7)	(—)	(—)
地方債証券	4,330,000	4,457,575	5.4	—	3.1	1.6	0.7
	(4,330,000)	(4,457,575)	(5.4)	(—)	(3.1)	(1.6)	(0.7)
特殊債券 (除く金融債)	5,090,666	5,321,815	6.5	—	4.3	2.1	0.1
	(5,090,666)	(5,321,815)	(6.5)	(—)	(4.3)	(2.1)	(0.1)
金融債券	300,000	300,110	0.4	—	—	0.2	0.1
	(300,000)	(300,110)	(0.4)	(—)	(—)	(0.2)	(0.1)
普通社債券 (含む投資法人債券)	3,500,000	3,517,641	4.3	—	2.1	2.1	0.1
	(3,500,000)	(3,517,641)	(4.3)	(—)	(2.1)	(2.1)	(0.1)
合 計	76,405,666	81,585,056	99.3	—	64.3	24.3	10.6
	(13,810,666)	(14,182,133)	(17.3)	(—)	(10.1)	(6.0)	(1.1)

(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		評 価 額	償 還 年 月 日
		額 面 金 額	末		
国債証券	%	千円	千円		
第409回利付国債(2年)	0.1	30,000	30,071	2022/2/1	
第410回利付国債(2年)	0.1	410,000	411,074	2022/3/1	
第412回利付国債(2年)	0.1	330,000	330,999	2022/5/1	
第413回利付国債(2年)	0.1	550,000	551,776	2022/6/1	
第414回利付国債(2年)	0.1	430,000	431,474	2022/7/1	
第415回利付国債(2年)	0.1	240,000	240,854	2022/8/1	
第416回利付国債(2年)	0.1	120,000	120,451	2022/9/1	
第417回利付国債(2年)	0.1	350,000	351,414	2022/10/1	
第418回利付国債(2年)	0.1	440,000	441,984	2022/11/1	
第136回利付国債(5年)	0.1	910,000	915,141	2023/6/20	
第137回利付国債(5年)	0.1	710,000	714,430	2023/9/20	
第138回利付国債(5年)	0.1	700,000	704,781	2023/12/20	
第139回利付国債(5年)	0.1	1,020,000	1,027,568	2024/3/20	
第140回利付国債(5年)	0.1	670,000	675,373	2024/6/20	
第141回利付国債(5年)	0.1	330,000	332,841	2024/9/20	
第142回利付国債(5年)	0.1	480,000	484,420	2024/12/20	
第143回利付国債(5年)	0.1	560,000	565,482	2025/3/20	
第144回利付国債(5年)	0.1	500,000	505,195	2025/6/20	
第145回利付国債(5年)	0.1	450,000	454,837	2025/9/20	
第131回利付国債(5年)	0.1	360,000	360,946	2022/3/20	
第132回利付国債(5年)	0.1	40,000	40,131	2022/6/20	
第133回利付国債(5年)	0.1	1,280,000	1,284,966	2022/9/20	
第134回利付国債(5年)	0.1	830,000	833,710	2022/12/20	
第135回利付国債(5年)	0.1	1,000,000	1,004,940	2023/3/20	
第1回利付国債(40年)	2.4	40,000	57,819	2048/3/20	
第2回利付国債(40年)	2.2	100,000	140,214	2049/3/20	
第3回利付国債(40年)	2.2	110,000	155,200	2050/3/20	
第4回利付国債(40年)	2.2	150,000	212,896	2051/3/20	
第5回利付国債(40年)	2.0	170,000	233,680	2052/3/20	
第6回利付国債(40年)	1.9	170,000	230,486	2053/3/20	
第7回利付国債(40年)	1.7	150,000	195,888	2054/3/20	
第8回利付国債(40年)	1.4	190,000	232,088	2055/3/20	
第9回利付国債(40年)	0.4	300,000	274,227	2056/3/20	
第10回利付国債(40年)	0.9	290,000	310,764	2057/3/20	
第11回利付国債(40年)	0.8	220,000	228,846	2058/3/20	
第12回利付国債(40年)	0.5	250,000	234,945	2059/3/20	
第13回利付国債(40年)	0.5	190,000	178,322	2060/3/20	
第321回利付国債(10年)	1.0	241,000	244,123	2022/3/20	
第322回利付国債(10年)	0.9	220,000	222,598	2022/3/20	
第323回利付国債(10年)	0.9	340,000	344,899	2022/6/20	
第324回利付国債(10年)	0.8	183,000	185,380	2022/6/20	
第325回利付国債(10年)	0.8	330,000	335,072	2022/9/20	
第326回利付国債(10年)	0.7	280,000	284,421	2022/12/20	
第327回利付国債(10年)	0.8	387,000	393,849	2022/12/20	

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	
国債証券		%	千円	千円	
第328回利付国債 (10年)		0.6	411,000	417,452	2023/3/20
第329回利付国債 (10年)		0.8	297,000	303,640	2023/6/20
第330回利付国債 (10年)		0.8	257,000	263,317	2023/9/20
第331回利付国債 (10年)		0.6	90,000	91,746	2023/9/20
第332回利付国債 (10年)		0.6	532,000	543,299	2023/12/20
第333回利付国債 (10年)		0.6	225,000	230,186	2024/3/20
第334回利付国債 (10年)		0.6	261,000	267,501	2024/6/20
第335回利付国債 (10年)		0.5	345,000	352,969	2024/9/20
第336回利付国債 (10年)		0.5	210,000	215,182	2024/12/20
第337回利付国債 (10年)		0.3	170,000	172,862	2024/12/20
第338回利付国債 (10年)		0.4	631,000	644,932	2025/3/20
第339回利付国債 (10年)		0.4	385,000	394,109	2025/6/20
第340回利付国債 (10年)		0.4	934,000	957,153	2025/9/20
第341回利付国債 (10年)		0.3	440,000	449,213	2025/12/20
第342回利付国債 (10年)		0.1	210,000	212,389	2026/3/20
第343回利付国債 (10年)		0.1	560,000	566,692	2026/6/20
第344回利付国債 (10年)		0.1	570,000	576,965	2026/9/20
第345回利付国債 (10年)		0.1	690,000	698,597	2026/12/20
第346回利付国債 (10年)		0.1	820,000	830,389	2027/3/20
第347回利付国債 (10年)		0.1	230,000	232,960	2027/6/20
第348回利付国債 (10年)		0.1	340,000	344,433	2027/9/20
第349回利付国債 (10年)		0.1	480,000	486,326	2027/12/20
第350回利付国債 (10年)		0.1	520,000	526,723	2028/3/20
第351回利付国債 (10年)		0.1	100,000	101,301	2028/6/20
第352回利付国債 (10年)		0.1	680,000	688,622	2028/9/20
第353回利付国債 (10年)		0.1	650,000	658,248	2028/12/20
第354回利付国債 (10年)		0.1	460,000	465,639	2029/3/20
第355回利付国債 (10年)		0.1	440,000	445,187	2029/6/20
第356回利付国債 (10年)		0.1	840,000	849,466	2029/9/20
第357回利付国債 (10年)		0.1	630,000	636,451	2029/12/20
第358回利付国債 (10年)		0.1	600,000	605,760	2030/3/20
第359回利付国債 (10年)		0.1	720,000	726,422	2030/6/20
第360回利付国債 (10年)		0.1	660,000	665,082	2030/9/20
第1回利付国債 (30年)		2.8	60,000	74,659	2029/9/20
第7回利付国債 (30年)		2.3	40,000	49,899	2032/5/20
第11回利付国債 (30年)		1.7	50,000	59,541	2033/6/20
第12回利付国債 (30年)		2.1	40,000	49,713	2033/9/20
第13回利付国債 (30年)		2.0	90,000	110,997	2033/12/20
第14回利付国債 (30年)		2.4	60,000	77,302	2034/3/20
第15回利付国債 (30年)		2.5	160,000	208,969	2034/6/20
第16回利付国債 (30年)		2.5	100,000	130,994	2034/9/20
第17回利付国債 (30年)		2.4	50,000	64,962	2034/12/20
第18回利付国債 (30年)		2.3	60,000	77,332	2035/3/20
第19回利付国債 (30年)		2.3	100,000	129,207	2035/6/20
第20回利付国債 (30年)		2.5	100,000	132,451	2035/9/20
第21回利付国債 (30年)		2.3	90,000	116,836	2035/12/20

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額
国債証券		%	千円	千円
第22回利付国債 (30年)		2.5	50,000	66,562
第23回利付国債 (30年)		2.5	160,000	213,532
第24回利付国債 (30年)		2.5	100,000	133,784
第25回利付国債 (30年)		2.3	100,000	130,945
第26回利付国債 (30年)		2.4	145,000	192,632
第27回利付国債 (30年)		2.5	215,000	290,465
第28回利付国債 (30年)		2.5	110,000	149,218
第29回利付国債 (30年)		2.4	70,000	94,166
第30回利付国債 (30年)		2.3	190,000	253,213
第31回利付国債 (30年)		2.2	130,000	171,502
第32回利付国債 (30年)		2.3	215,000	288,927
第33回利付国債 (30年)		2.0	290,000	374,868
第34回利付国債 (30年)		2.2	255,000	340,570
第35回利付国債 (30年)		2.0	316,000	411,258
第36回利付国債 (30年)		2.0	295,000	385,143
第37回利付国債 (30年)		1.9	320,000	412,755
第38回利付国債 (30年)		1.8	160,000	203,497
第39回利付国債 (30年)		1.9	190,000	245,803
第40回利付国債 (30年)		1.8	175,000	222,871
第41回利付国債 (30年)		1.7	155,000	194,413
第42回利付国債 (30年)		1.7	190,000	238,533
第43回利付国債 (30年)		1.7	80,000	100,529
第44回利付国債 (30年)		1.7	180,000	226,398
第45回利付国債 (30年)		1.5	190,000	230,806
第46回利付国債 (30年)		1.5	240,000	291,705
第47回利付国債 (30年)		1.6	230,000	285,013
第48回利付国債 (30年)		1.4	233,000	278,101
第49回利付国債 (30年)		1.4	180,000	214,918
第50回利付国債 (30年)		0.8	250,000	263,515
第51回利付国債 (30年)		0.3	210,000	196,331
第52回利付国債 (30年)		0.5	230,000	225,639
第53回利付国債 (30年)		0.6	220,000	220,741
第54回利付国債 (30年)		0.8	230,000	241,486
第55回利付国債 (30年)		0.8	120,000	125,899
第56回利付国債 (30年)		0.8	180,000	188,703
第57回利付国債 (30年)		0.8	230,000	240,931
第58回利付国債 (30年)		0.8	350,000	366,338
第59回利付国債 (30年)		0.7	190,000	194,012
第60回利付国債 (30年)		0.9	190,000	203,275
第61回利付国債 (30年)		0.7	180,000	183,205
第62回利付国債 (30年)		0.5	160,000	154,472
第63回利付国債 (30年)		0.4	210,000	196,942
第64回利付国債 (30年)		0.4	180,000	168,519
第65回利付国債 (30年)		0.4	190,000	177,579
第66回利付国債 (30年)		0.4	200,000	186,832
第67回利付国債 (30年)		0.6	200,000	197,288

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68回利付国債 (30年)		0.6	230,000	226,577	2050/9/20
第55回利付国債 (20年)		2.0	100,000	102,448	2022/3/21
第56回利付国債 (20年)		2.0	10,000	10,298	2022/6/20
第57回利付国債 (20年)		1.9	110,000	113,125	2022/6/20
第58回利付国債 (20年)		1.9	100,000	103,355	2022/9/20
第59回利付国債 (20年)		1.7	40,000	41,393	2022/12/20
第60回利付国債 (20年)		1.4	30,000	30,873	2022/12/20
第61回利付国債 (20年)		1.0	50,000	51,215	2023/3/20
第62回利付国債 (20年)		0.8	80,000	81,788	2023/6/20
第63回利付国債 (20年)		1.8	60,000	62,784	2023/6/20
第64回利付国債 (20年)		1.9	120,000	126,458	2023/9/20
第65回利付国債 (20年)		1.9	380,000	402,385	2023/12/20
第67回利付国債 (20年)		1.9	20,000	21,282	2024/3/20
第68回利付国債 (20年)		2.2	90,000	96,622	2024/3/20
第69回利付国債 (20年)		2.1	60,000	64,225	2024/3/20
第70回利付国債 (20年)		2.4	110,000	119,496	2024/6/20
第71回利付国債 (20年)		2.2	100,000	107,950	2024/6/20
第72回利付国債 (20年)		2.1	210,000	227,169	2024/9/20
第73回利付国債 (20年)		2.0	180,000	195,022	2024/12/20
第75回利付国債 (20年)		2.1	100,000	109,271	2025/3/20
第76回利付国債 (20年)		1.9	100,000	108,437	2025/3/20
第77回利付国債 (20年)		2.0	20,000	21,770	2025/3/20
第78回利付国債 (20年)		1.9	50,000	54,476	2025/6/20
第79回利付国債 (20年)		2.0	20,000	21,879	2025/6/20
第80回利付国債 (20年)		2.1	90,000	98,853	2025/6/20
第81回利付国債 (20年)		2.0	30,000	32,981	2025/9/20
第82回利付国債 (20年)		2.1	170,000	187,688	2025/9/20
第83回利付国債 (20年)		2.1	10,000	11,093	2025/12/20
第84回利付国債 (20年)		2.0	120,000	132,535	2025/12/20
第85回利付国債 (20年)		2.1	150,000	167,196	2026/3/20
第86回利付国債 (20年)		2.3	100,000	112,499	2026/3/20
第87回利付国債 (20年)		2.2	90,000	100,783	2026/3/20
第88回利付国債 (20年)		2.3	185,000	209,262	2026/6/20
第89回利付国債 (20年)		2.2	120,000	135,086	2026/6/20
第90回利付国債 (20年)		2.2	170,000	192,322	2026/9/20
第91回利付国債 (20年)		2.3	80,000	90,959	2026/9/20
第92回利付国債 (20年)		2.1	255,000	288,371	2026/12/20
第93回利付国債 (20年)		2.0	80,000	90,387	2027/3/20
第94回利付国債 (20年)		2.1	140,000	159,044	2027/3/20
第95回利付国債 (20年)		2.3	185,000	213,586	2027/6/20
第96回利付国債 (20年)		2.1	70,000	79,914	2027/6/20
第97回利付国債 (20年)		2.2	130,000	149,913	2027/9/20
第98回利付国債 (20年)		2.1	70,000	80,254	2027/9/20
第99回利付国債 (20年)		2.1	85,000	97,887	2027/12/20
第100回利付国債 (20年)		2.2	151,000	175,676	2028/3/20
第101回利付国債 (20年)		2.4	20,000	23,555	2028/3/20

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102回利付国債	(20年)	2.4	145,000	171,630	2028/6/20
第103回利付国債	(20年)	2.3	100,000	117,622	2028/6/20
第104回利付国債	(20年)	2.1	10,000	11,613	2028/6/20
第105回利付国債	(20年)	2.1	12,000	13,991	2028/9/20
第106回利付国債	(20年)	2.2	40,000	46,946	2028/9/20
第107回利付国債	(20年)	2.1	80,000	93,676	2028/12/20
第108回利付国債	(20年)	1.9	220,000	254,119	2028/12/20
第109回利付国債	(20年)	1.9	80,000	92,758	2029/3/20
第110回利付国債	(20年)	2.1	195,000	229,286	2029/3/20
第111回利付国債	(20年)	2.2	50,000	59,436	2029/6/20
第112回利付国債	(20年)	2.1	205,000	241,961	2029/6/20
第113回利付国債	(20年)	2.1	85,000	100,699	2029/9/20
第114回利付国債	(20年)	2.1	160,000	190,152	2029/12/20
第115回利付国債	(20年)	2.2	100,000	119,736	2029/12/20
第116回利付国債	(20年)	2.2	140,000	168,243	2030/3/20
第117回利付国債	(20年)	2.1	225,000	268,332	2030/3/20
第118回利付国債	(20年)	2.0	131,000	155,546	2030/6/20
第119回利付国債	(20年)	1.8	150,000	175,290	2030/6/20
第120回利付国債	(20年)	1.6	200,000	229,962	2030/6/20
第121回利付国債	(20年)	1.9	205,000	242,115	2030/9/20
第122回利付国債	(20年)	1.8	190,000	222,569	2030/9/20
第123回利付国債	(20年)	2.1	265,000	318,980	2030/12/20
第124回利付国債	(20年)	2.0	200,000	238,766	2030/12/20
第125回利付国債	(20年)	2.2	120,000	146,115	2031/3/20
第126回利付国債	(20年)	2.0	100,000	119,743	2031/3/20
第127回利付国債	(20年)	1.9	130,000	154,352	2031/3/20
第128回利付国債	(20年)	1.9	225,000	267,914	2031/6/20
第129回利付国債	(20年)	1.8	180,000	212,472	2031/6/20
第130回利付国債	(20年)	1.8	180,000	213,028	2031/9/20
第131回利付国債	(20年)	1.7	70,000	82,103	2031/9/20
第132回利付国債	(20年)	1.7	170,000	199,862	2031/12/20
第133回利付国債	(20年)	1.8	245,000	290,685	2031/12/20
第134回利付国債	(20年)	1.8	45,000	53,520	2032/3/20
第135回利付国債	(20年)	1.7	40,000	47,132	2032/3/20
第136回利付国債	(20年)	1.6	170,000	198,434	2032/3/20
第137回利付国債	(20年)	1.7	170,000	200,763	2032/6/20
第138回利付国債	(20年)	1.5	90,000	104,256	2032/6/20
第139回利付国債	(20年)	1.6	180,000	210,544	2032/6/20
第140回利付国債	(20年)	1.7	300,000	355,068	2032/9/20
第141回利付国債	(20年)	1.7	185,000	219,417	2032/12/20
第142回利付国債	(20年)	1.8	210,000	251,533	2032/12/20
第143回利付国債	(20年)	1.6	245,000	288,232	2033/3/20
第144回利付国債	(20年)	1.5	190,000	221,253	2033/3/20
第145回利付国債	(20年)	1.7	375,000	446,557	2033/6/20
第146回利付国債	(20年)	1.7	370,000	441,465	2033/9/20
第147回利付国債	(20年)	1.6	395,000	467,178	2033/12/20

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148回利付国債 (20年)	1.5	335,000	392,539	2034/3/20
第149回利付国債 (20年)	1.5	380,000	445,907	2034/6/20
第150回利付国債 (20年)	1.4	340,000	394,995	2034/9/20
第151回利付国債 (20年)	1.2	445,000	505,172	2034/12/20
第152回利付国債 (20年)	1.2	400,000	454,396	2035/3/20
第153回利付国債 (20年)	1.3	270,000	310,691	2035/6/20
第154回利付国債 (20年)	1.2	128,000	145,594	2035/9/20
第155回利付国債 (20年)	1.0	380,000	421,237	2035/12/20
第156回利付国債 (20年)	0.4	370,000	377,270	2036/3/20
第157回利付国債 (20年)	0.2	280,000	276,693	2036/6/20
第158回利付国債 (20年)	0.5	160,000	165,152	2036/9/20
第159回利付国債 (20年)	0.6	290,000	303,429	2036/12/20
第160回利付国債 (20年)	0.7	320,000	339,449	2037/3/20
第161回利付国債 (20年)	0.6	310,000	323,773	2037/6/20
第162回利付国債 (20年)	0.6	220,000	229,554	2037/9/20
第163回利付国債 (20年)	0.6	330,000	343,985	2037/12/20
第164回利付国債 (20年)	0.5	430,000	440,431	2038/3/20
第165回利付国債 (20年)	0.5	330,000	337,563	2038/6/20
第166回利付国債 (20年)	0.7	440,000	464,437	2038/9/20
第167回利付国債 (20年)	0.5	280,000	285,630	2038/12/20
第168回利付国債 (20年)	0.4	260,000	260,218	2039/3/20
第169回利付国債 (20年)	0.3	280,000	274,730	2039/6/20
第170回利付国債 (20年)	0.3	370,000	362,318	2039/9/20
第171回利付国債 (20年)	0.3	270,000	264,095	2039/12/20
第172回利付国債 (20年)	0.4	280,000	278,513	2040/3/20
第173回利付国債 (20年)	0.4	320,000	317,993	2040/6/20
第174回利付国債 (20年)	0.4	200,000	198,372	2040/9/20
小計		63,185,000	67,987,913	
地方債証券				
第14回東京都公募公債	2.31	100,000	115,831	2028/3/17
第705回東京都公募公債	1.06	100,000	101,200	2022/3/18
第723回東京都公募公債	0.76	100,000	101,987	2023/9/20
第746回東京都公募公債	0.499	100,000	102,173	2025/6/20
第761回東京都公募公債	0.075	100,000	100,112	2026/9/18
平成28年度第8回北海道公募公債	0.06	100,000	99,959	2026/10/28
平成29年度第6回北海道公募公債	0.01	100,000	99,976	2022/7/28
第211回神奈川県公募公債	0.438	100,000	101,688	2024/12/20
第220回神奈川県公募公債	0.08	100,000	100,128	2026/3/19
第164回大阪府公募公債	0.001	100,000	99,933	2024/7/30
第376回大阪府公募公債	0.82	110,000	112,333	2023/9/27
第451回大阪府公募公債	0.063	100,000	99,313	2029/12/26
平成27年度第13回京都府公募公債	0.11	100,000	100,282	2026/3/17
平成29年度第4回京都府公募公債	0.19	100,000	100,764	2027/6/21
平成29年度第1回兵庫県公募公債	0.187	100,000	100,672	2027/5/21
平成26年度第6回静岡県公募公債	0.566	100,000	102,010	2024/8/26
平成30年度第14回静岡県公募公債	0.15	100,000	100,431	2028/12/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
地方債証券		%	千円	千円	
平成24年度第5回愛知県公募公債		0.886	100,000	101,245	2022/6/28
平成28年度第8回愛知県公募公債		0.065	100,000	100,055	2026/8/26
平成29年度第11回愛知県公募公債		0.225	100,000	101,007	2027/10/27
平成29年度第3回広島県公募公債		0.15	100,000	100,531	2027/9/27
平成30年度第1回広島県公募公債		0.2	100,000	100,874	2028/5/25
第8回埼玉県公募公債		2.19	100,000	117,873	2029/9/20
第16回埼玉県公募公債		1.216	100,000	112,617	2035/8/14
平成26年度第6回埼玉県公募公債		0.554	100,000	102,014	2024/9/26
平成27年度第1回福岡県公募公債		0.578	100,000	102,530	2025/6/26
第19回千葉県公募公債		1.166	100,000	111,890	2035/10/15
平成29年度第6回千葉県公募公債		0.245	100,000	101,148	2028/1/25
第117回共同発行市場公募地方債		0.72	100,000	101,354	2022/12/22
第123回共同発行市場公募地方債		0.87	100,000	102,070	2023/6/23
第133回共同発行市場公募地方債		0.689	100,000	102,220	2024/4/25
第156回共同発行市場公募地方債		0.1	100,000	100,231	2026/3/25
第169回共同発行市場公募地方債		0.205	100,000	100,838	2027/4/23
平成27年度第1回静岡市公募公債		0.476	100,000	102,279	2025/11/25
第17回名古屋市公募公債		1.203	100,000	112,424	2035/5/28
第26回横浜市公募公債		1.776	100,000	118,273	2033/1/28
平成26年度第5回福岡市公募公債		0.539	100,000	102,005	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	102,259	2025/12/25
平成29年度第3回千葉市公募公債		0.215	120,000	121,156	2027/12/28
平成29年度第1回鹿児島県公募公債		0.02	100,000	100,017	2022/10/31
平成29年度第5回福井県公募公債		0.19	100,000	100,793	2028/4/27
平成29年度第2回岡山県公募公債		0.235	100,000	101,081	2028/1/31
小	計		4,330,000	4,457,575	
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	129,392	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	101,813	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	146,016	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	114,394	2028/8/15
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	116,492	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	129,518	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	101,807	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	102,119	2025/6/30
第251回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.557	103,000	105,564	2025/7/31
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	135,104	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	100,570	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	100,888	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	101,167	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	100,615	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	101,837	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	101,250	2028/9/19
第31回国際協力機構債券		0.53	100,000	102,297	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	112,229	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16回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.7	100,000	134,159	2036/9/19
第27回道路債券		2.42	100,000	107,533	2024/3/20
第37回日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.42	150,000	175,305	2028/6/20
第1回地方公共団体金融機構債券		1.864	100,000	125,425	2044/6/28
第13回公営企業債券		2.16	100,000	109,407	2025/6/20
F 82回地方公共団体金融機構債券		1.381	100,000	105,214	2024/11/20
第97回地方公共団体金融機構債券		0.205	200,000	201,404	2027/6/28
F 132回地方公共団体金融機構債券		1.09	100,000	104,820	2025/7/30
F 228回地方公共団体金融機構債券		1.269	100,000	110,852	2031/3/20
F 305回地方公共団体金融機構債券		1.33	100,000	114,610	2040/10/26
第66回株式会社日本政策金融公庫社債		0.03	100,000	100,021	2022/3/11
第2回一般担保住宅金融公庫債券		2.54	100,000	113,279	2026/6/19
第6回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.06	85,539	85,249	2034/2/10
第7回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.14	91,410	91,388	2034/2/10
第18回一般担保住宅金融支援機構債券		2.15	100,000	105,645	2023/9/20
第97回一般担保住宅金融支援機構債券		1.903	100,000	118,342	2032/3/12
第117回一般担保住宅金融支援機構債券		1.438	100,000	108,830	2027/9/17
第123回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.46	85,224	86,250	2052/8/10
第125回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	85,350	86,142	2052/10/10
第127回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.4	86,606	87,272	2052/12/10
第128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.42	86,048	86,834	2053/1/10
第135回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.39	89,167	89,753	2053/8/10
第137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.47	90,196	91,355	2053/10/10
第150回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.21	95,055	94,279	2054/11/10
第154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.3	96,978	96,890	2055/3/10
第161回貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.35	99,243	99,503	2055/10/10
第1回貸付債権担保T種住宅金融支援機構債券		0.16	59,790	59,739	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	61,950	61,938	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	66,110	66,141	2033/1/10
第29回西日本高速道路株式会社社債		0.31	100,000	101,184	2026/2/12
第52回西日本高速道路株式会社社債		0.03	100,000	99,922	2024/12/20
第116回鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.04	100,000	100,051	2023/9/20
小	計		5,090,666	5,321,815	
金融債券					
第327回信金中金債		0.06	100,000	100,040	2022/2/25
第340回信金中金債		0.11	100,000	100,162	2023/3/27
第358回信金中金債(5年)		0.01	100,000	99,908	2024/9/27
小	計		300,000	300,110	
普通社債券(含む投資法人債券)					
第543回中部電力株式会社社債		0.12	100,000	99,999	2025/7/25
第413回中国電力株式会社社債		0.4	100,000	101,107	2029/2/22
第338回北陸電力株式会社社債		0.3	100,000	99,861	2030/8/23
第289回四国電力株式会社社債		0.26	100,000	100,498	2026/11/25
第462回九州電力株式会社社債		0.42	100,000	101,150	2028/5/25
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	98,780	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	99,704	2024/9/19

銘柄	利 率	当 期 末		
		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12回日本たばこ産業株式会社社債	0.11	100,000	99,920	2023/9/8
第3回株式会社電通無担保社債	0.424	100,000	100,569	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	98,914	2026/7/31
第12回富士フィルムホールディングス株式会社無担保社債	0.02	100,000	99,913	2022/7/26
第10回株式会社資生堂無担保社債	0.08	100,000	99,586	2025/2/26
第14回株式会社ブリヂストン無担保社債	0.375	100,000	100,534	2029/4/19
第15回旭硝子株式会社無担保社債	0.31	100,000	100,436	2027/5/28
第12回株式会社小松製作所無担保社債	0.11	100,000	99,799	2024/6/6
第18回株式会社日立製作所無担保社債	0.06	100,000	99,873	2023/3/10
第17回J A 三井リース株式会社無担保社債	0.19	100,000	99,692	2025/9/4
第5回大日本印刷株式会社無担保社債	0.27	100,000	99,222	2030/3/8
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	99,622	2028/5/31
第147回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債	0.89	100,000	101,938	2023/7/24
第14回N T Tファイナンス株式会社無担保社債	0.001	100,000	99,913	2023/6/20
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	100,337	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	100,210	2025/1/23
第58回三井不動産株式会社無担保社債	0.1	100,000	99,900	2023/2/24
第120回三菱地所株式会社無担保社債	0.24	100,000	99,757	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	102,103	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	101,547	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	107,157	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	101,264	2023/3/20
第22回K D D I 株式会社無担保社債	0.31	100,000	99,937	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	100,652	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	102,652	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	100,729	2028/6/6
第24回フランス相互信用連合銀行(B F C M) 円貨社債	0.384	100,000	100,352	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	100,014	2023/7/6
小 計		3,500,000	3,517,641	
合 計		76,405,666	81,585,056	

○投資信託財産の構成

(2021年1月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 81,585,056	% 99.2
コール・ローン等、その他	624,476	0.8
投資信託財産総額	82,209,532	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

(2020年1月28日～2021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 (2021年1月25日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	82,209,532,727	
コール・ローン等	478,088,672	
公社債(評価額)	81,585,056,038	
未収利息	141,876,019	
前払費用	4,511,998	
(B) 負債	9,912,339	
未払解約金	9,911,000	
未払利息	1,295	
その他未払費用	44	
(C) 純資産総額(A-B)	82,199,620,388	
元本	78,237,277,839	
次期繰越損益金	3,962,342,549	
(D) 受益権総口数	78,237,277,839口	
1万口当たり基準価額(C/D)	10,506円	

(注) 当ファンドの期首元本額は75,458,660,146円、期中追加設定元本額は65,516,965,042円、期中一部解約元本額は62,738,347,349円です。

(注) 2021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	45,122,154,760円
・りそなFT 国内債券インデックス (適格機関投資家専用)	7,334,607,433円
・りそなラップ型ファンド (安定型)	5,764,666,983円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-06	2,624,064,867円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-09	2,606,166,309円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-03	2,310,078,109円
・つみたてバランスファンド	2,186,256,912円
・りそなラップ型ファンド (安定成長型)	2,035,496,686円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2030	1,608,319,407円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-10	1,520,894,120円
・Smart-i 国内債券インデックス	999,052,971円
・りそな・リスクコントロールファンド2019-12	907,358,174円
・Smart-i 8資産バランス 安定型	576,971,635円
・FWりそな円建債券アクティブファンド	520,309,132円
・DCりそな グローバルバランス	477,791,188円
・りそな・リスクコントロールファンド2020-06	386,002,233円
・Smart-i 8資産バランス 安定成長型	343,170,086円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2040	339,041,188円
・りそなラップ型ファンド (成長型)	136,725,623円
・Smart-i 8資産バランス 成長型	123,625,014円
・りそなFT RCバランスファンド (適格機関投資家専用)	110,530,907円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2050	78,699,745円
・リスクコントロール・オープン	52,766,504円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2035	44,967,763円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2045	13,676,255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)	11,456,412円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2055	1,904,899円
・りそなターゲット・イヤー・ファンド2060	522,524円

(注) 当期末の1口当たり純資産額は1.0506円です。

○損益の状況 (2020年1月28日～2021年1月25日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	621,447,684	
受取利息	622,287,583	
支払利息	△ 839,899	
(B) 有価証券売買損益	△1,819,116,773	
売買益	19,562,962	
売買損	△1,838,679,735	
(C) 保管費用等	△ 187,962	
(D) 当期損益金(A+B+C)	△1,197,857,051	
(E) 前期繰越損益金	4,865,525,406	
(F) 追加信託差損益金	3,678,576,958	
(G) 解約差損益金	△3,383,902,764	
(H) 計(D+E+F+G)	3,962,342,549	
次期繰越損益金(H)	3,962,342,549	

(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。