

運用報告書

第9期<決算日2012年2月14日>

DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信 国内／債券（インデックス型）	
信託期間	信託期間は2002年12月3日から無期限です。	
運用方針	主として国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。	
主要運用対象	DIAM国内債券 インデックスファンド <DC年金>	国内債券パッシブ・ ファンド・マザー ファンド受益証券を 主要投資対象としま す。
	国内債券パッシブ・ ファンド・マザーファ ンド	わが国の公社債を主 要投資対象としま す。
投資制限	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。 外貨建資産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。	
分配方針	決算日（原則として2月14日）に経費控除後の利子、配当収入および売買益（評価益を含みます。）より、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。	

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>」は、2012年2月14日に第9期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-506-860

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客様のお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

DIAMアセットマネジメント

東京都千代田区丸の内3-3-1

(URL) <http://www.diam.co.jp>

D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配)	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
	円	円	%	ポイント	%	%	%	%	百万円
5期(2008年2月14日)	10,330	0	2.7	309.10	3.0	98.7	—	—	4,343
6期(2009年2月16日)	10,575	0	2.4	316.89	2.5	99.1	—	—	5,647
7期(2010年2月15日)	10,725	0	1.4	322.75	1.9	99.0	—	—	6,943
8期(2011年2月14日)	10,844	0	1.1	327.28	1.4	99.4	—	—	8,293
9期(2012年2月14日)	11,142	0	2.7	337.57	3.1	99.3	—	—	10,287

(注1) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(出所) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率			
(期首)	円	%	ポイント	%	%	%	%
2011年2月14日	10,844	—	327.28	—	99.4	—	—
2月 末	10,886	0.4	328.54	0.4	99.4	—	—
3月 末	10,881	0.3	328.52	0.4	99.7	—	—
4月 末	10,915	0.7	329.80	0.8	99.6	—	—
5月 末	10,953	1.0	331.05	1.2	99.5	—	—
6月 末	10,981	1.3	332.09	1.5	99.8	—	—
7月 末	11,021	1.6	333.38	1.9	99.4	—	—
8月 末	11,051	1.9	334.34	2.2	99.3	—	—
9月 末	11,089	2.3	335.57	2.5	99.7	—	—
10月 末	11,066	2.0	334.96	2.3	99.6	—	—
11月 末	11,061	2.0	334.89	2.3	99.5	—	—
12月 末	11,127	2.6	336.99	3.0	99.6	—	—
2012年1月 末	11,144	2.8	337.61	3.2	99.4	—	—
(期末)							
2012年2月14日	11,142	2.7	337.57	3.1	99.3	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

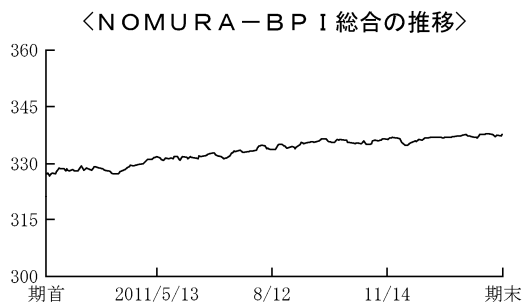
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2011年2月15日から2012年2月14日まで）



期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 2. 14	2012. 2. 3	2011. 2. 16	2012. 2. 14
10,844円	11,152円	10,826円	11,142円



基準価額の騰落要因

欧州債務問題の深刻化を受けたリスク回避の動きや景気減速懸念などから金利が低下したこと、また、保有する債券から利息収入を得たことなどを主因として基準価額は上昇しました。

ベンチマークの推移

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、3.15%上昇しました。

ベンチマークとの差異およびその要因

当ファンドはベンチマークを0.40%下回りました。信託報酬要因を除くと、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

収益分配金

当期の収益分配金につきましては、基準価額水準等を勘案して無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

《今後の運用方針》

引き続き、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果が得られるよう、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券の高位組入れを維持します。

《投資環境》

当期の長期金利（10年国債利回り）は、0.9%台半ばから1.3%台半ばの範囲で推移し、前期末の1.300%から0.960%へと低下（債券価格は上昇）しました。

期初の2011年2月16日に長期金利は一時1.345%まで上昇しましたが、これが当期の最高水準となり、その後は、3月11日に発生した東日本大震災による経済活動への影響や復旧補正予算による国債の増発懸念等をにらみつつ、揉み合う展開となりました。

5月以降は、ギリシャを始めとする欧州諸国の財政懸念が再び高まり、リスク回避姿勢が強まったことなどから、債券価格は上昇しました。7月以降も、為替市場で円高傾向となり日銀による追加金融緩和への期待が高まったことや、欧州債務問題の深刻化、世界的な景気減速懸念から各国で株式市場が急落したことなどを受けて、債券価格は上昇基調で推移しました。8月に長期金利は1.0%を割り込む水準まで低下し、その後は欧州債務問題への対応策等をにらみつつ、2011年末まで長期金利は1.0%を挟んで揉み合いが続きました。2012年以降は、欧州債務問題が引き続き意識された中、債券価格は概ね堅調に推移し、1月16日には10年国債利回りが一時0.935%と、約1年2ヵ月ぶりの水準まで低下（価格は上昇）しました。

《運用経過》

当ファンドの主要投資対象は国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券であり、組入比率については期を通じてほぼ100%となるよう運用を行いました。

基準価額の推移

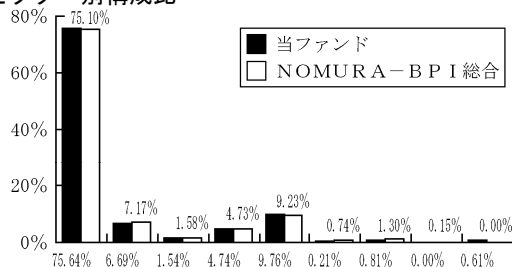
当期末の基準価額は11,142円となり、前期末に比べ2.75%上昇しました。

【D I A M国内債券インデックスファンド〈DC年金〉の運用状況】

(注) 組入比率は純資産総額比です。また、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを通じた実質組入比率です。

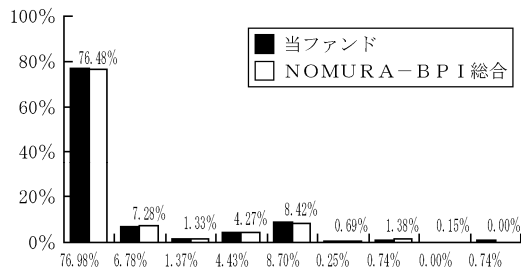
期首（前期末）

セクター別構成比



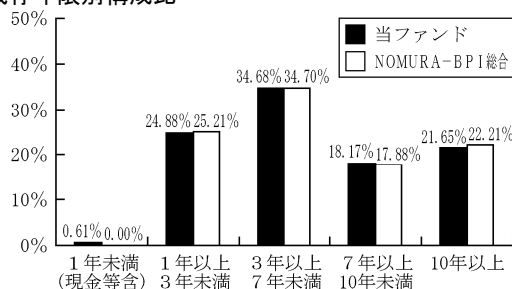
国債 地方債 金融債 政保債 事業債 円建外債 MBS ABS 現金等

期末

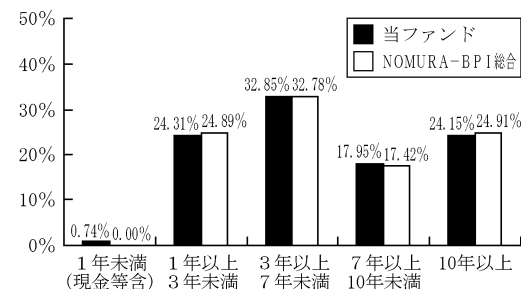


国債 地方債 金融債 政保債 事業債 円建外債 MBS ABS 現金等

残存年限別構成比



1年未満 (現金等含) 1年以上 3年未満 3年以上 7年未満 7年以上 10年未満 10年以上



1年未満 (現金等含) 1年以上 3年未満 3年以上 7年未満 7年以上 10年未満 10年以上

■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項	目	当	期
(a)	信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)		29円 (13) (13) (3)
(b)	保管費用等		0
	合計		29

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。なお、保管費用等は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率

(b) 保管費用等 = $\frac{\text{期中の保管費用等}}{\text{期中の平均受益権口数}}$

(注2) 保管費用等には、監査報酬等が含まれております。

(注3) 各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

■ 親投資信託受益証券の設定、解約状況（2011年2月15日から2012年2月14日まで）

	設		解		約		
	口	数	金	額	口	数	
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド		千口		千円		千口	千円
	2,021,843		2,285,300		494,372		555,850

■利害関係人との取引状況等（2011年2月15日から2012年2月14日まで）

期中の利害関係人との取引はありません。

（注）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。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首（前期末）		当 期 末	
	口	数	口	数
		千口		千口
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド		7,484,227		9,011,698
				評 価 額
				千円
				10,287,754

（注）親投資信託合計の受益権口数は358,048,514千口です。

■投資信託財産の構成

2012年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10,287,754	99.7
コーラル・ローン等、その他	35,668	0.3
投資信託財産総額	10,323,422	100.0

■資産、負債、元本および基準価額の状況

（2012年2月14日）現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,323,422,848円
コーラル・ローン等	19,667,932
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド（評価額）	10,287,754,916
未 収 入 金	16,000,000
(B) 負 債	35,554,604
未 払 解 約 金	22,890,166
未 払 信 託 報 酬	12,545,343
そ の 他 未 払 費 用	119,095
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	10,287,868,244
元 本	9,233,383,982
次 期 繰 越 損 益 金	1,054,484,262
(D) 受 益 権 総 口 数	9,233,383,982口
1万口当たり基準価額 (C / D)	11,142円

<注記事項>

※ 期首元本額	7,648,172,888円
期中追加設定元本額	2,735,732,180円
期中一部解約元本額	1,150,521,086円

■損益の状況

当期 自2011年2月15日 至2012年2月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	10,149円
受 取 利 息	10,149
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	248,319,549
売 買 損 益	265,090,396
売 買 損 益	△ 16,770,847
(C) 信 託 報 酬 等	△ 24,011,150
(D) 当 期 繰 越 損 益 金 (A + B + C)	224,318,548
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	233,077,378
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	597,088,336
(配 当 等 相 当 額)	(391,368,686)
(売 買 損 益 相 当 額)	(205,719,650)
(G) 計 (D + E + F)	1,054,484,262
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	1,054,484,262
追 加 信 託 差 損 益 金	597,088,336
(配 当 等 相 当 額)	(391,368,686)
(売 買 損 益 相 当 額)	(205,719,650)
分 配 準 備 積 立 金	457,395,926

（注1）(B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

（注2）(C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

（注3）(F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

（注4）分配金の計算過程
 計算期末における費用控除後の配当等収益（10,149円）、費用控除後、繰越欠損金を補填した有価証券売買等損益（224,308,399円）、信託約款に規定される収益調整金（597,088,336円）及び分配準備積立金（233,077,378円）より分配対象収益は1,054,484,262円（1万口当たり1,142.03円）ですが、分配を行っておりません。

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、基準価額水準等を勘案して無分配とさせていただきます。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第9期（決算日 2012年2月14日）

（計算期間 2011年2月15日～2012年2月14日）

「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」は、「D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>」が投資対象とする親投資信託で、信託財産の実質的な運用を行っております。

以下、法令・諸規則に基づき、当親投資信託の第9期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	信託期間は2002年12月3日から無期限です。
運用方針	主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指して運用を行います。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	<ul style="list-style-type: none"> ・株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 ・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、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入比率	新株予約権付社債(転換社債)比率	債券先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	ポイント	期中騰落率				
5期(2008年2月14日)	10,473	3.0	309.10	3.0	98.7	—	—	209,758
6期(2009年2月16日)	10,750	2.6	316.89	2.5	99.1	—	—	240,660
7期(2010年2月15日)	10,931	1.7	322.75	1.9	99.0	—	—	428,782
8期(2011年2月14日)	11,081	1.4	327.28	1.4	99.4	—	—	427,794
9期(2012年2月14日)	11,416	3.0	337.57	3.1	99.3	—	—	408,731

(注) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(出所) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している指数で、その知的財産権は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、対象インデックスの正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、対象インデックスを用いて行われる事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率	新株予約債(転換社債)比率	債券先物率
		騰落率		騰落率			
(期首) 2011年2月14日	円	%	ポイント	%	%	%	%
2月14日	11,081	—	327.28	—	99.4	—	—
2月末	11,125	0.4	328.54	0.4	99.4	—	—
3月末	11,123	0.4	328.52	0.4	99.7	—	—
4月末	11,160	0.7	329.80	0.8	99.6	—	—
5月末	11,201	1.1	331.05	1.2	99.5	—	—
6月末	11,232	1.4	332.09	1.5	99.7	—	—
7月末	11,276	1.8	333.38	1.9	99.4	—	—
8月末	11,309	2.1	334.34	2.2	99.3	—	—
9月末	11,350	2.4	335.57	2.5	99.6	—	—
10月末	11,329	2.2	334.96	2.3	99.6	—	—
11月末	11,327	2.2	334.89	2.3	99.4	—	—
12月末	11,397	2.9	336.99	3.0	99.6	—	—
2012年1月末	11,417	3.0	337.61	3.2	99.4	—	—
(期末) 2012年2月14日	11,416	3.0	337.57	3.1	99.3	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過 (2011年2月15日から2012年2月14日まで)



期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 2. 14	2012. 2. 3	2011. 2. 16	2012. 2. 14
11,081円	11,425円	11,063円	11,416円

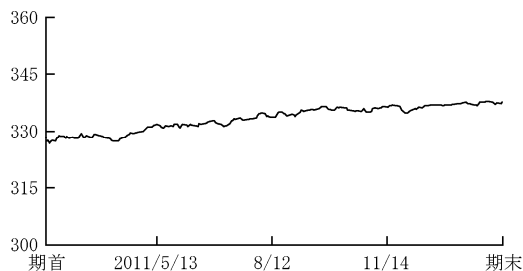
《投資環境》

当期の長期金利(10年国債利回り)は、0.9%台半ばから1.3%台半ばの範囲で推移し、前期末の1.300%から0.960%へと低下(債券価格は上昇)しました。

期初の2011年2月16日に長期金利は一時1.345%まで上昇しましたが、これが当期の最高水準となり、その後は、3月11日に発生した東日本大震災による経済活動への影響や復旧補正予算による国債の増発懸念等をにらみつつ、揉み合う展開となりました。

5月以降は、ギリシャを始めとする欧州諸国の財政懸念が再び高まり、リスク回避姿勢が強まったことなどから、債券価格は上昇しました。7月以降も、為替市場で円高傾向となり日銀による追加金融緩和への期待が高まったことや、欧州債務問題の深刻化、世界的な景気減速懸念から各国で株式市場が急落し

〈NOMURA-BPI総合の推移〉



たことなどを受けて、債券価格は上昇基調で推移しました。8月に長期金利は1.0%を割り込む水準まで低下し、その後は欧州債務問題への対応策等をにらみつつ、2011年末まで長期金利は1.0%を挟んでの揉み合いが続きました。2012年以降は、欧州債務問題が引き続き意識された中、債券価格は概ね堅調に推移し、1月16日には10年国債利回りが一時0.935%と、約1年2ヵ月ぶりの水準まで低下（価格は上昇）しました。

《運用経過》

基準価額の推移

当期末の基準価額は11,416円となり、前期末に比べ3.02%上昇しました。

基準価額の騰落要因

欧州債務問題の深刻化を受けたリスク回避の動きや景気減速懸念などから金利が低下したこと、また、保有する債券から利息収入を得たことなどを主因として基準価額は上昇しました。

ベンチマークの推移

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、3.15%上昇しました。

ベンチマークとの差異およびその要因

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で▲0.12%と、ベンチマークにほぼ連動した運用成果となりました。

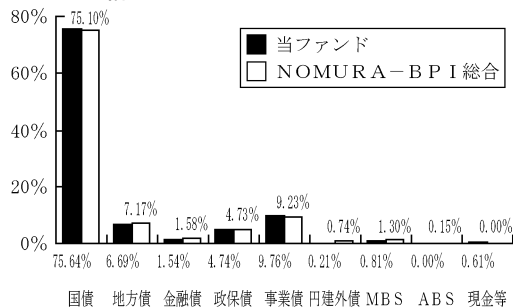
《今後の運用方針》

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力近づけることにより、NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目指した運用を行います。

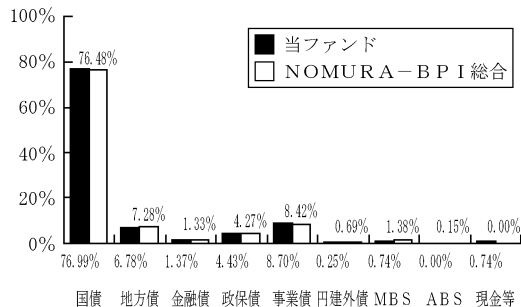
【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】（注）組入比率は純資産総額比です。

期首（前期末）

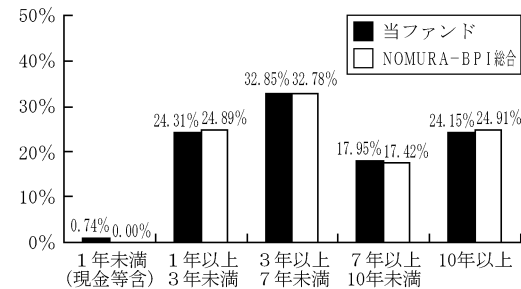
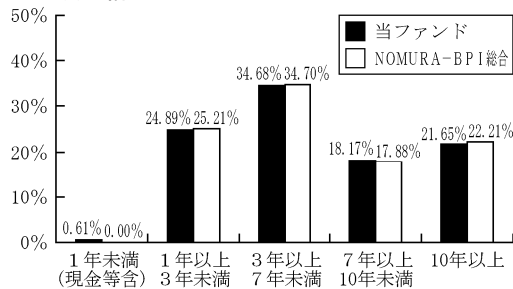
セクター別構成比



期末



残存年限別構成比



■ 1 万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 保 管 費 用 等	－円
合 計	－

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む。）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、下記の簡便法により算出した結果です。

(a) 保管費用等 = $\frac{\text{期中の保管費用等}}{\text{期中の平均受益権口数}}$

(注2) 各項目ごとに円未満は四捨五入しております。

■ 売買及び取引の状況（2011年2月15日から2012年2月14日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内		千円	千円
	国 債 証 券	103,356,490	119,930,384
	地 方 債 証 券	907,731	2,096,551
	特 殊 債 券	1,928,859	6,247,357 (475,994)
	社 債 券	6,814,265	10,609,273

(注1) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債（転換社債）は含まれておりません。

■ 主要な売買銘柄（2011年2月15日から2012年2月14日まで）

国内公社債

買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
第313回 利付国庫債券（10年）	7,080,330	第 63 回 利付国庫債券（5年）	7,579,275
第315回 利付国庫債券（10年）	6,591,785	第 64 回 利付国庫債券（5年）	7,301,880
第 97 回 利付国庫債券（5年）	6,014,710	第 66 回 利付国庫債券（5年）	5,758,368
第 93 回 利付国庫債券（5年）	5,502,402	第 69 回 利付国庫債券（5年）	3,830,856
第312回 利付国庫債券（10年）	5,212,662	第312回 利付国庫債券（10年）	3,078,165
第 99 回 利付国庫債券（5年）	5,004,325	第295回 利付国庫債券（2年）	3,002,460
第317回 利付国庫債券（10年）	4,522,160	第297回 利付国庫債券（2年）	2,999,520
第319回 利付国庫債券（10年）	3,039,570	第306回 利付国庫債券（10年）	2,599,400
第 96 回 利付国庫債券（5年）	3,011,320	第291回 利付国庫債券（2年）	2,501,275
第305回 利付国庫債券（2年）	3,003,350	第296回 利付国庫債券（2年）	2,499,675

(注) 金額は受渡代金です（経過利子分は含まれておりません）。

■利害関係人との取引状況等（2011年2月15日から2012年2月14日まで）

期中の利害関係人との取引はありません。

（注）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。

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

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	301,170,000	314,676,901	77.0	—	47.1	19.3	10.6	
地方債証券	26,513,110	27,693,167	6.8	—	2.0	4.0	0.8	
特殊債証券 (除く金融債)	27,970,162	29,331,067	7.2	—	3.2	3.4	0.6	
金融債証券	5,520,000	5,605,406	1.3	—	—	0.9	0.4	
普通社債証券	27,602,000	28,409,778	7.0	—	1.6	4.3	1.1	
合計	388,775,272	405,716,320	99.3	—	53.9	31.9	13.5	

（注）組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第302回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,001,800	2013/03/15
第303回 利付国庫債券(2年)	0.200	1,500,000	1,501,470	2013/04/15
第304回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,100	2013/05/15
第305回 利付国庫債券(2年)	0.200	3,000,000	3,003,360	2013/06/15
第306回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,380	2013/07/15
第307回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,200,000	2,202,772	2013/08/15
第308回 利付国庫債券(2年)	0.100	1,500,000	1,499,640	2013/09/15
第309回 利付国庫債券(2年)	0.100	1,500,000	1,499,625	2013/10/15
第310回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,940	2013/11/15
第70回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,900,000	4,936,358	2013/03/20
第72回 利付国庫債券(5年)	1.500	4,200,000	4,277,616	2013/06/20
第75回 利付国庫債券(5年)	1.100	4,600,000	4,671,852	2013/09/20
第78回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,500,000	3,550,400	2013/12/20
第81回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,500,000	4,563,630	2014/03/20
第83回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,400,000	3,460,588	2014/06/20
第85回 利付国庫債券(5年)	0.700	3,500,000	3,550,085	2014/09/20
第87回 利付国庫債券(5年)	0.500	3,800,000	3,835,948	2014/12/20
第88回 利付国庫債券(5年)	0.500	3,500,000	3,533,810	2015/03/20
第89回 利付国庫債券(5年)	0.400	4,500,000	4,529,070	2015/06/20
第91回 利付国庫債券(5年)	0.400	1,700,000	1,710,591	2015/09/20
第92回 利付国庫債券(5年)	0.300	3,000,000	3,008,010	2015/09/20
第93回 利付国庫債券(5年)	0.500	5,000,000	5,048,450	2015/12/20

銘柄名	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 利付国庫債券(5年)	0.600	2,000,000	2,027,060	2016/03/20
第96回 利付国庫債券(5年)	0.500	1,500,000	1,514,235	2016/03/20
第97回 利付国庫債券(5年)	0.400	4,500,000	4,522,140	2016/06/20
第99回 利付国庫債券(5年)	0.400	5,000,000	5,020,350	2016/09/20
第101回 利付国庫債券(5年)	0.400	2,000,000	2,007,140	2016/12/20
第2回 利付国庫債券(40年)	2.200	600,000	616,362	2049/03/20
第3回 利付国庫債券(40年)	2.200	1,000,000	1,021,160	2050/03/20
第4回 利付国庫債券(40年)	2.200	700,000	711,207	2051/03/20
第247回 利付国庫債券(10年)	0.800	700,000	705,194	2013/03/20
第250回 利付国庫債券(10年)	0.500	2,060,000	2,070,567	2013/06/20
第254回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,700,000	2,755,026	2013/09/20
第256回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,500,000	2,558,925	2013/12/20
第258回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,000,000	1,024,540	2014/03/20
第260回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,100,000	2,171,904	2014/06/20
第263回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,700,000	2,801,304	2014/09/20
第266回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,700,000	3,829,611	2014/12/20
第269回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,500,000	1,551,540	2015/03/20
第270回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,400,000	1,451,044	2015/06/20
第272回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,100,000	2,187,843	2015/09/20
第274回 利付国庫債券(10年)	1.500	2,400,000	2,515,008	2015/12/20
第277回 利付国庫債券(10年)	1.600	3,000,000	3,162,480	2016/03/20
第280回 利付国庫債券(10年)	1.900	2,800,000	2,994,348	2016/06/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第282回 利付国庫債券 (10年)	1.700	3,400,000	3,615,458	2016/09/20
第284回 利付国庫債券 (10年)	1.700	3,100,000	3,304,600	2016/12/20
第285回 利付国庫債券 (10年)	1.700	4,900,000	5,234,376	2017/03/20
第286回 利付国庫債券 (10年)	1.800	3,500,000	3,764,880	2017/06/20
第288回 利付国庫債券 (10年)	1.700	3,600,000	3,858,984	2017/09/20
第289回 利付国庫債券 (10年)	1.500	4,100,000	4,353,544	2017/12/20
第290回 利付国庫債券 (10年)	1.400	3,200,000	3,381,024	2018/03/20
第293回 利付国庫債券 (10年)	1.800	5,000,000	5,410,850	2018/06/20
第296回 利付国庫債券 (10年)	1.500	4,000,000	4,255,120	2018/09/20
第297回 利付国庫債券 (10年)	1.400	3,200,000	3,382,592	2018/12/20
第299回 利付国庫債券 (10年)	1.300	3,100,000	3,256,302	2019/03/20
第301回 利付国庫債券 (10年)	1.500	3,800,000	4,044,606	2019/06/20
第303回 利付国庫債券 (10年)	1.400	2,800,000	2,957,220	2019/09/20
第305回 利付国庫債券 (10年)	1.300	4,300,000	4,503,390	2019/12/20
第306回 利付国庫債券 (10年)	1.400	4,500,000	4,741,020	2020/03/20
第308回 利付国庫債券 (10年)	1.300	1,800,000	1,879,146	2020/06/20
第309回 利付国庫債券 (10年)	1.100	2,000,000	2,055,720	2020/06/20
第310回 利付国庫債券 (10年)	1.000	4,500,000	4,576,005	2020/09/20
第312回 利付国庫債券 (10年)	1.200	4,700,000	4,847,157	2020/12/20
第313回 利付国庫債券 (10年)	1.300	6,500,000	6,743,815	2021/03/20
第315回 利付国庫債券 (10年)	1.200	5,000,000	5,131,400	2021/06/20
第317回 利付国庫債券 (10年)	1.100	4,500,000	4,567,320	2021/09/20
第318回 利付国庫債券 (10年)	1.000	1,200,000	1,206,864	2021/09/20
第319回 利付国庫債券 (10年)	1.100	3,000,000	3,039,120	2021/12/20
第1回 利付国庫債券 (30年)	2.800	100,000	117,276	2029/09/20
第2回 利付国庫債券 (30年)	2.400	100,000	111,028	2030/02/20
第3回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	218,694	2030/05/20
第4回 利付国庫債券 (30年)	2.900	200,000	237,852	2030/11/20
第5回 利付国庫債券 (30年)	2.200	200,000	215,284	2031/05/20
第6回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	221,852	2031/11/20
第7回 利付国庫債券 (30年)	2.300	300,000	327,609	2032/05/20
第8回 利付国庫債券 (30年)	1.800	500,000	502,275	2032/11/22
第11回 利付国庫債券 (30年)	1.700	400,000	393,528	2033/06/20
第12回 利付国庫債券 (30年)	2.100	300,000	316,203	2033/09/20
第13回 利付国庫債券 (30年)	2.000	300,000	310,866	2033/12/20
第14回 利付国庫債券 (30年)	2.400	500,000	554,415	2034/03/20
第15回 利付国庫債券 (30年)	2.500	200,000	225,354	2034/06/20
第16回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	450,388	2034/09/20
第17回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	221,392	2034/12/20
第18回 利付国庫債券 (30年)	2.300	820,000	893,414	2035/03/20
第19回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	217,864	2035/06/20
第20回 利付国庫債券 (30年)	2.500	300,000	337,566	2035/09/20
第21回 利付国庫債券 (30年)	2.300	500,000	543,060	2035/12/20
第22回 利付国庫債券 (30年)	2.500	470,000	528,378	2036/03/20
第23回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	449,668	2036/06/20
第24回 利付国庫債券 (30年)	2.500	600,000	674,460	2036/09/20
第25回 利付国庫債券 (30年)	2.300	600,000	650,376	2036/12/20
第26回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,000,000	1,102,730	2037/03/20
第27回 利付国庫債券 (30年)	2.500	900,000	1,011,258	2037/09/20
第28回 利付国庫債券 (30年)	2.500	800,000	900,200	2038/03/20
第29回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,300,000	1,436,383	2038/09/20
第30回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,500,000	1,626,195	2039/03/20
第31回 利付国庫債券 (30年)	2.200	1,200,000	1,274,388	2039/09/20
第32回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,600,000	1,731,456	2040/03/20
第33回 利付国庫債券 (30年)	2.000	1,800,000	1,828,260	2040/09/20
第34回 利付国庫債券 (30年)	2.200	2,000,000	2,116,360	2041/03/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第35回 利付国庫債券 (30年)	2.000	2,300,000	2,328,129	2041/09/20
第37回 利付国庫債券 (20年)	3.100	600,000	689,688	2017/09/20
第39回 利付国庫債券 (20年)	2.600	400,000	451,604	2018/03/20
第40回 利付国庫債券 (20年)	2.300	720,000	802,663	2018/09/20
第42回 利付国庫債券 (20年)	2.600	800,000	913,392	2019/03/20
第43回 利付国庫債券 (20年)	2.900	860,000	1,004,299	2019/09/20
第45回 利付国庫債券 (20年)	2.400	900,000	1,019,412	2020/03/20
第46回 利付国庫債券 (20年)	2.200	500,000	558,015	2020/06/22
第47回 利付国庫債券 (20年)	2.200	950,000	1,060,751	2020/09/21
第48回 利付国庫債券 (20年)	2.500	500,000	570,655	2020/12/21
第50回 利付国庫債券 (20年)	1.900	780,000	850,184	2021/03/22
第51回 利付国庫債券 (20年)	2.000	600,000	658,560	2021/06/21
第52回 利付国庫債券 (20年)	2.100	550,000	608,542	2021/09/21
第54回 利付国庫債券 (20年)	2.200	700,000	781,186	2021/12/20
第55回 利付国庫債券 (20年)	2.000	810,000	888,699	2022/03/21
第57回 利付国庫債券 (20年)	1.900	830,000	901,670	2022/06/20
第58回 利付国庫債券 (20年)	1.900	600,000	651,702	2022/09/20
第60回 利付国庫債券 (20年)	1.400	990,000	1,023,709	2022/12/20
第61回 利付国庫債券 (20年)	1.000	800,000	792,872	2023/03/20
第62回 利付国庫債券 (20年)	0.800	1,000,000	966,350	2023/06/20
第64回 利付国庫債券 (20年)	1.900	800,000	865,336	2023/09/20
第65回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,100,000	1,188,429	2023/12/20
第67回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,402,700	2024/03/20
第70回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,250,000	1,418,037	2024/06/20
第72回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,250,000	1,373,037	2024/09/20
第73回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,390,000	1,508,664	2024/12/20
第75回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,340,000	1,468,077	2025/03/20
第78回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,550,000	1,657,585	2025/06/20
第81回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,400,000	1,513,176	2025/09/20
第83回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,600,000	1,746,016	2025/12/20
第85回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,750,000	1,907,570	2026/03/20
第88回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,892,848	2026/06/20
第90回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,600,000	1,759,328	2026/09/20
第92回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,700,000	1,843,922	2026/12/20
第93回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,000,000	1,068,730	2027/03/20
第94回 利付国庫債券 (20年)	2.100	800,000	865,968	2027/06/20
第95回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,883,651	2027/09/20
第97回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,500,000	1,638,870	2027/12/20
第99回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,600,000	1,722,848	2028/03/20
第100回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,800,000	1,959,462	2028/06/20
第102回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,600,000	1,785,424	2028/09/20
第105回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,800,000	1,928,088	2028/12/20
第107回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,139,740	2029/03/20
第109回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,000,000	2,077,700	2029/06/20
第111回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,200,000	2,380,752	2029/09/20
第113回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,200,000	2,344,540	2029/12/20
第114回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,128,420	2029/03/20
第116回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,600,000	2,803,660	2030/06/20
第118回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,200,000	1,255,584	2030/09/20
第119回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,500,000	1,522,020	2030/12/20
第121回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,200,000	2,263,734	2031/03/20
第123回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,200,000	2,332,220	2031/06/20
第125回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,400,000	2,582,208	2031/09/20
第128回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,200,000	1,231,332	2031/12/20
第129回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,000,000	1,010,140	2032/03/20
第130回 利付国庫債券 (20年)	1.800	2,500,000	2,523,750	2032/06/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
第132回 利付国庫債券(20年)	1.700	700,000	693,819	2031/12/20
小計	—	301,170,000	314,676,901	—
(地方債証券)				
第602回 東京都公債	1.400	148,000	151,060	2013/10/25
第611回 東京都公債	1.830	200,000	207,680	2014/06/20
第612回 東京都公債	1.710	161,500	167,249	2014/06/20
第614回 東京都公債	1.480	200,000	206,606	2014/09/19
第616回 東京都公債	1.410	100,000	103,348	2014/12/19
第617回 東京都公債	1.400	200,000	206,638	2014/12/19
第619回 東京都公債	1.530	200,000	207,920	2015/03/20
第620回 東京都公債	1.350	200,000	206,814	2015/03/20
第622回 東京都公債	1.280	106,800	110,406	2015/06/19
第623回 東京都公債	1.310	200,000	206,952	2015/06/19
第627回 東京都公債	1.520	100,000	104,427	2015/09/18
第628回 東京都公債	1.590	100,000	104,938	2015/12/18
第629回 東京都公債	1.450	494,000	515,770	2015/12/18
第632回 東京都公債	2.000	115,300	123,140	2016/03/18
第633回 東京都公債	1.970	100,000	106,679	2016/03/18
第634回 東京都公債	1.860	200,000	213,064	2016/06/20
第638回 東京都公債	1.900	200,000	213,978	2016/09/20
第640回 東京都公債	1.790	150,000	160,138	2016/12/20
第641回 東京都公債	1.820	100,000	106,902	2016/12/20
第659回 東京都公債	1.620	203,500	217,183	2018/06/20
第664回 東京都公債	1.400	300,000	315,987	2018/12/20
第667回 東京都公債	1.570	300,000	319,467	2019/03/20
第680回 東京都公債	1.390	200,000	209,604	2020/03/19
第685回 東京都公債	1.130	500,000	512,710	2020/06/19
第688回 東京都公債	0.940	200,000	201,512	2020/09/18
15年度2回 北海道公債	1.100	203,000	205,466	2013/07/29
16年度11回 北海道公債	1.300	250,000	257,350	2015/02/25
18年度4回 北海道公債	2.000	190,500	203,425	2016/06/30
18年度6回 北海道公債	2.100	100,000	107,417	2016/08/31
19年度4回 北海道公債	1.980	300,000	323,304	2017/06/29
21年度6回 北海道公債	1.600	200,000	212,046	2019/08/28
第125回 神奈川県公債	1.400	100,000	102,569	2014/03/31
第126回 神奈川県公債	1.500	178,870	184,014	2014/04/30
第127回 神奈川県公債	1.800	100,000	103,895	2014/07/30
第128回 神奈川県公債	1.500	100,000	103,353	2014/09/30
第130回 神奈川県公債	1.400	156,200	161,512	2015/01/28
第135回 神奈川県公債	1.600	200,000	209,592	2015/10/28
第136回 神奈川県公債	1.500	100,000	104,569	2015/12/28
第166回 神奈川県公債	1.360	300,000	314,508	2019/09/20
第261回 大阪府公債	1.500	129,000	131,997	2013/12/25
第278回 大阪府公債	1.300	200,000	206,292	2015/05/29
第285回 大阪府公債	1.500	100,000	104,301	2015/12/25
第286回 大阪府公債	1.500	200,000	208,730	2016/01/29
第289回 大阪府公債	1.800	200,000	211,558	2016/04/27
第293回 大阪府公債	2.100	200,000	214,920	2016/08/30
第301回 大阪府公債	1.830	100,000	106,895	2017/04/26
第310回 大阪府公債	1.620	240,000	254,740	2018/01/30
第336回 大阪府公債	1.460	200,000	209,508	2020/03/30
第1回 大阪府公債 7年	1.800	500,000	511,880	2013/08/28
15年度3回 京都府公債	1.500	219,300	224,659	2013/12/24
16年度2回 京都府公債	1.500	100,000	103,332	2014/09/24
18年度1回 京都府公債	1.700	100,000	106,287	2016/12/22
15年度1回 兵庫県公債	0.700	100,000	100,552	2013/04/25

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
16年度4回 兵庫県公債	1.600	251,970	259,707	2014/05/27
16年度8回 兵庫県公債	1.900	111,500	116,088	2014/08/25
17年度2回 兵庫県公債	1.400	200,000	206,880	2015/04/27
17年度9回 兵庫県公債	1.600	306,000	320,311	2015/11/30
17年度13回 兵庫県公債	1.700	105,000	110,597	2016/03/23
18年度1回 兵庫県公債	1.800	120,000	126,987	2016/04/27
15年度3回 静岡県公債	1.400	116,130	118,532	2013/10/28
18年度5回 静岡県公債	1.850	129,800	138,666	2016/10/26
21年度5回 静岡県公債	1.350	197,000	206,251	2019/10/18
15年度1回 愛知県公債	1.400	303,600	309,881	2013/10/28
16年度2回 愛知県公債	1.600	200,000	207,402	2014/10/27
18年度2回 愛知県公債	2.000	160,300	171,706	2016/06/27
20年度4回 愛知県公債	1.600	100,000	106,594	2018/09/25
22年度6回 愛知県公債	1.178	200,000	205,496	2020/07/30
16年度2回 広島県公債	1.500	200,000	207,612	2015/03/25
22年度1回 広島県公債	1.370	200,000	208,692	2020/05/27
15年度3回 埼玉県公債	1.600	100,000	102,285	2013/09/26
17年度2回 埼玉県公債	1.300	200,000	206,716	2015/05/27
18年度1回 埼玉県公債	1.800	200,000	212,128	2016/04/27
21年度4回 埼玉県公債	1.460	440,000	464,666	2019/07/29
23年度2回 埼玉県公債	1.190	200,000	204,176	2021/05/25
16年度3回 福岡県公債	1.300	131,040	135,193	2015/02/24
17年度1回 福岡県公債	1.400	100,000	103,912	2015/08/26
17年度5回 福岡県公債	1.500	100,000	104,624	2016/01/27
18年度1回 福岡県公債	2.100	104,000	112,082	2016/08/30
21年度3回 福岡県公債	1.550	200,000	212,464	2019/08/27
15年度4回 千葉県公債	1.400	100,000	102,355	2014/01/24
16年度3回 千葉県公債	1.900	100,000	104,259	2014/08/25
16年度8回 千葉県公債	1.300	200,000	206,344	2015/02/25
17年度2回 千葉県公債	1.300	200,000	206,852	2015/06/25
19年度5回 千葉県公債	1.850	300,000	323,127	2017/10/25
21年度6回 千葉県公債	1.410	200,000	210,336	2019/09/25
18年度2回 新潟県公債	1.870	169,000	180,755	2016/11/29
第2回 共同発行市場公募地方債	0.600	100,000	100,532	2013/05/24
第3回 共同発行市場公募地方債	0.500	100,000	100,433	2013/06/25
第8回 共同発行市場公募地方債	1.600	400,000	410,028	2013/11/25
第9回 共同発行市場公募地方債	1.500	210,000	215,119	2013/12/25
第11回 共同発行市場公募地方債	1.300	300,000	306,786	2014/02/25
第12回 共同発行市場公募地方債	1.400	130,000	133,328	2014/03/25
第13回 共同発行市場公募地方債	1.500	221,000	227,342	2014/04/25
第18回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	103,595	2014/09/25
第19回 共同発行市場公募地方債	1.600	130,000	134,797	2014/10/24
第20回 共同発行市場公募地方債	1.500	100,000	103,519	2014/11/25
第21回 共同発行市場公募地方債	1.400	300,000	309,927	2014/12/25
第23回 共同発行市場公募地方債	1.300	100,000	103,172	2015/02/25
第25回 共同発行市場公募地方債	1.400	304,000	314,974	2015/04/24
第28回 共同発行市場公募地方債	1.300	200,000	206,978	2015/07/24
第29回 共同発行市場公募地方債	1.400	200,000	207,818	2015/08/25
第31回 共同発行市場公募地方債	1.500	200,000	208,828	2015/10/23
第32回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	209,712	2015/11/25
第33回 共同発行市場公募地方債	1.600	300,000	314,823	2015/12/25
第35回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	210,186	2016/02/25
第36回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	105,146	2016/03/25
第37回 共同発行市場公募地方債	1.800	150,000	159,084	2016/04/25
第38回 共同発行市場公募地方債	2.000	170,000	181,888	2016/05/25
第39回 共同発行市場公募地方債	1.900	146,000	155,744	2016/06/24

銘 柄 名	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
第40回 共同発行市場公募地方債	2.100	150,000	161,479	2016/07/25
第47回 共同発行市場公募地方債	1.800	161,600	172,789	2017/02/24
第55回 共同発行市場公募地方債	1.850	200,000	215,418	2017/10/25
第57回 共同発行市場公募地方債	1.650	200,000	213,334	2017/12/25
第61回 共同発行市場公募地方債	1.550	300,000	318,534	2018/04/24
第65回 共同発行市場公募地方債	1.620	100,000	106,703	2018/08/24
第75回 共同発行市場公募地方債	1.640	500,000	534,755	2019/06/25
第80回 共同発行市場公募地方債	1.540	700,000	742,546	2019/11/25
第94回 共同発行市場公募地方債	1.240	100,000	102,773	2021/01/25
17年度3回 大阪市公募債	1.300	100,000	103,236	2015/07/28
17年度7回 大阪市公募債	1.400	200,000	207,434	2015/09/29
17年度8回 大阪市公募債	1.600	200,000	209,012	2015/10/27
17年度11回 大阪市公募債	1.600	100,000	104,774	2016/02/23
18年度2回 大阪市公募債	2.000	100,000	106,751	2016/06/22
18年度3回 大阪市公募債	2.100	150,000	160,965	2016/07/27
19年度5回 大阪市公募債	1.990	135,000	145,623	2017/07/19
第12回さ号 名古屋公募債	0.600	100,000	100,536	2013/05/28
第12回ひ号 名古屋公募債	1.300	200,000	206,962	2015/07/21
第12回せ号 名古屋公募債	1.400	359,500	373,786	2015/09/28
17年度11回 京都市公募債	1.400	100,000	103,818	2015/08/25
18年度3回 京都市公募債	1.900	101,700	109,120	2017/02/27
16年度5回 神戸市公募債	1.400	200,000	206,494	2014/12/24
17年度13回 神戸市公募債	1.600	103,000	108,131	2016/02/23
15年度5回 横浜市公募債	1.300	200,000	204,524	2014/02/25
16年度1回 横浜市公募債	1.600	200,000	205,920	2014/03/20
17年度1回 横浜市公募債	1.300	300,000	309,666	2015/03/20
22年度5回 横浜市公募債	1.265	200,000	206,222	2020/12/11
14年度7回 札幌市公募債	0.700	100,000	100,604	2013/04/24
16年度7回 札幌市公募債	1.500	100,000	103,822	2015/03/25
第2回 川崎市公募債 15年	1.630	100,000	106,372	2020/06/22
第19回 川崎市公募債 5年	1.410	100,000	101,636	2013/06/20
18年度4回 福岡市公募債	1.800	100,000	106,530	2016/10/27
16年度1回 広島市公募債	1.400	100,000	103,247	2014/12/24
16年度2回 千葉市公募債	1.400	100,000	103,353	2015/01/27
小 計	—	26,513,110	27,693,167	—
(特殊債券(除く金融債))				
第8回 政保日本政策投資銀行債券	1.800	102,000	106,136	2014/08/27
第13回 政保日本政策投資銀行債券	2.000	121,000	129,952	2016/08/25
第16回 日本政策投資銀行債券	1.520	100,000	103,167	2014/09/19
第9回 日本政策投資銀行債券	1.580	100,000	102,108	2013/09/20
第13回 日本政策投資銀行債券	1.590	100,000	102,779	2014/03/20
第27回 日本政策投資銀行債券	1.980	200,000	213,880	2016/09/20
第46回 日本政策投資銀行債券	1.690	200,000	213,062	2018/03/20
第34回 日本道路・機構承継債	1.630	200,000	206,922	2014/09/22
第319回 政保道路債	0.900	132,000	133,488	2013/08/22
第322回 政保道路債	1.500	106,000	108,529	2013/11/28
第323回 政保道路債	1.500	200,000	204,934	2013/12/20
第324回 政保道路債	1.400	200,000	204,808	2014/01/24
第328回 政保道路債	1.500	200,000	206,070	2014/05/28
第329回 政保道路債	1.600	100,000	103,355	2014/06/27
第333回 政保道路債	1.600	300,000	311,325	2014/10/28
第335回 政保道路債	1.400	237,000	245,008	2014/12/24
第338回 政保道路債	1.500	264,000	274,404	2015/03/27
第339回 政保道路債	1.400	301,000	312,155	2015/04/28
第15回 高速道路機構債	2.050	400,000	429,020	2016/09/20
第25回 高速道路機構債	1.820	300,000	321,120	2017/09/20

銘 柄 名	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35回 高速道路機構債	1.650	400,000	425,184	2018/03/20
第48回 高速道路機構債	1.710	700,000	748,020	2019/03/20
第3回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	300,000	314,199	2016/01/29
第5回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.600	209,000	219,870	2016/02/26
第8回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.600	108,000	113,668	2016/03/24
第9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.900	100,000	108,597	2021/03/26
第16回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.000	301,000	323,442	2016/07/28
第17回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.000	122,000	131,089	2016/08/31
第19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.800	100,000	106,619	2016/09/29
第21回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.800	375,000	400,526	2016/11/30
第23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.700	300,000	319,227	2016/12/28
第29回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	200,000	205,460	2014/02/28
第30回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.700	300,000	319,863	2017/03/28
第33回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.700	297,000	316,875	2017/04/25
第36回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.900	344,000	371,103	2017/06/20
第40回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.900	331,000	357,526	2017/08/31
第47回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	200,000	211,876	2017/12/27
第56回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.400	200,000	210,850	2018/04/20
第66回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	162,000	171,882	2018/09/28
第67回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.600	401,000	428,099	2018/10/31
第71回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.400	600,000	632,454	2018/12/25
第78回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.400	200,000	210,830	2019/04/30
第82回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	100,000	106,124	2019/06/28
第89回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.300	300,000	313,596	2019/09/30
第26回 日本道路・機構承継債	1.680	200,000	205,238	2013/12/20
第41回 日本道路・機構承継債	1.520	300,000	310,977	2015/03/20
第832回 政保公営企業債券	1.400	298,000	304,255	2013/10/24
第834回 政保公営企業債券	1.500	207,000	212,156	2013/12/24
第837回 政保公営企業債券	1.400	432,000	443,275	2014/03/24
第838回 政保公営企業債券	1.500	600,000	617,490	2014/04/25
第839回 政保公営企業債券	1.500	260,000	267,841	2014/05/26
第843回 政保公営企業債券	1.500	100,000	103,417	2014/09/29
第847回 政保公営企業債券	1.400	200,000	206,948	2015/01/27
第848回 政保公営企業債券	1.300	200,000	206,494	2015/02/24
第849回 政保公営企業債券	1.500	261,000	271,220	2015/03/20
第852回 政保公営企業債券	1.300	300,000	310,518	2015/06/29
第853回 政保公営企業債券	1.200	204,000	210,566	2015/07/24
第854回 政保公営企業債券	1.400	304,000	316,038	2015/08/18
第856回 政保公営企業債券	1.500	200,000	208,998	2015/10/20
第859回 政保公営企業債券	1.500	207,000	216,811	2016/01/25
第862回 政保公営企業債券	1.800	239,000	253,688	2016/04/20
第863回 政保公営企業債券	2.000	200,000	214,230	2016/05/27
第867回 政保公営企業債券	1.800	200,000	213,178	2016/09/21
第868回 政保公営企業債券	1.800	101,000	107,771	2016/10/21
第869回 政保公営企業債券	1.800	102,000	108,933	2016/11/21
第875回 政保公営企業債券	1.700	482,000	514,578	2017/05/22
第8回 政保地方公営企業金融機構債券	1.500	651,000	690,847	2019/05/24
第3回 政保地方公共団体金融機構債券	1.500	101,000	107,139	2019/08/16
第5回 地方公共団体金融機構債券	1.395	500,000	523,670	2019/10/28
第8回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	300,000	313,056	2020/01/20
第10回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	500,000	521,135	2020/03/13
第15回 政保地方公共団体金融機構債券	1.000	200,000	202,934	2020/08/14
第20回 政保地方公共団体金融機構債券	1.200	300,000	308,208	2021/01/20
第12回 公営企業金融公庫債券	1.530	300,000	309,990	2014/09/24
第14回 公営企業金融公庫債券	1.450	100,000	103,584	2015/03/24
第15回 公営企業金融公庫債券	1.330	300,000	310,167	2015/06/19

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券(除金融債))	%	千円	千円	
第17回 公営企業金融公庫債券	1.570	100,000	104,458	2015/09/24
第20回 公営企業金融公庫債券	2.050	200,000	214,278	2016/06/20
第24回 公営企業金融公庫債券	1.940	300,000	321,729	2016/12/20
第191回 政保首都高道路債	1.800	113,000	117,468	2014/07/29
第142回 政保阪神高道路債	1.400	100,000	103,357	2014/12/17
第148回 政保阪神高道路債	1.300	107,000	110,954	2015/09/30
第5回 阪神高道路・機構承継債	1.790	100,000	103,195	2014/03/20
第176回 政保中小企業債券	1.600	100,000	102,274	2013/09/17
第180回 政保中小企業債券	1.800	142,000	147,553	2014/07/22
第186回 政保中小企業債券	1.300	104,000	107,819	2015/09/15
第26回 中小企業債券	1.990	400,000	409,384	2013/06/20
第15回 国際協力銀行債券	1.740	200,000	206,898	2014/06/20
第12回 国際協力銀行債券	1.600	200,000	205,642	2014/03/20
第2回 都市再生債券	2.150	100,000	104,259	2014/06/20
第19回 都市再生機構債券	2.040	200,000	216,606	2018/03/20
第23回 都市再生機構債券	1.280	200,000	203,484	2013/11/25
第2回 本州四国連絡・機構承継債	1.840	100,000	102,912	2013/12/20
第6回 政保中部国際空港債券	1.400	100,000	102,606	2014/03/26
第11回 住宅金融支援機構債券	1.660	200,000	212,512	2017/12/20
第32回 住宅金融支援機構債券	0.780	300,000	303,783	2014/09/19
第37回 住宅金融支援機構債券	1.400	300,000	313,677	2019/09/20
第6回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.260	121,869	129,550	2037/05/10
第8回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.150	84,274	89,021	2037/05/10
第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.190	126,555	134,224	2037/05/10
第2回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	2.270	147,279	156,034	2037/11/10
第10回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.960	65,127	68,683	2032/05/10
第14回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.700	333,785	348,047	2032/05/10
第4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.820	79,008	82,188	2036/12/10
第43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.280	60,374	64,208	2041/06/10
第44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.300	233,296	248,455	2041/07/10
第51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.210	186,405	196,851	2042/02/10
第1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.130	319,540	335,747	2042/05/10
第29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.950	410,050	428,375	2044/10/10
第36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.810	723,600	749,403	2045/05/10
第14回 政保国民生活債券	1.500	132,000	136,453	2014/09/17
第1回 政保東日本高道路債	1.600	101,000	105,983	2015/11/25
第2回 政保東日本高道路債	1.500	101,000	105,672	2015/12/21
第4回 政保中日本高道路債	1.600	170,000	178,887	2016/03/24
第8回 政保中日本高道路債	2.000	170,000	182,522	2016/08/12
第21回 政保中日本高道路債	1.700	300,000	321,762	2018/05/21
第5回 中日本高道路債	1.860	200,000	215,238	2018/09/20
第1回 政保西日本高道路債	1.600	201,000	210,917	2015/11/25
第5回 政保西日本高道路債	1.800	259,000	276,979	2017/01/25
第6回 政保西日本高道路債	1.800	117,000	125,237	2017/02/27
第2回 鉄道建設運輸施設債	1.920	300,000	311,607	2014/06/20
小計	—	27,970,162	29,331,067	—
(金融債券)				
704号 利附商工債	1.350	200,000	204,318	2014/01/27
706号 利付商工債	1.350	300,000	306,996	2014/03/27
714号 利付商工債	0.900	300,000	305,094	2014/11/27
723号 利付商工債	0.500	300,000	301,671	2015/08/27
732号 利付商工債	0.600	200,000	201,644	2016/05/27
695号 利附農林債	1.150	200,000	202,106	2013/04/26
698号 利附農林債	1.500	300,000	305,349	2013/07/26
701号 利附農林債	1.450	200,000	203,978	2013/10/25
709号 利附農林債	1.150	400,000	408,124	2014/06/27

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(金融債券)	%	千円	千円	
713号 利附農林債	0.800	300,000	303,972	2014/10/27
717号 利附農林債	0.750	300,000	303,741	2015/02/27
721号 利附農林債	0.600	120,000	120,954	2015/06/26
第222回 利附信金中金債	1.400	200,000	202,944	2013/05/27
第223回 利附信金中金債	1.500	300,000	305,118	2013/06/27
第226回 利附信金中金債	1.350	300,000	305,337	2013/09/27
第229回 利附信金中金債	1.400	400,000	408,580	2013/12/27
第233回 利附信金中金債	1.350	300,000	307,191	2014/04/25
第236回 利附信金中金債	0.900	300,000	304,620	2014/07/25
第241回 利附信金中金債	0.700	300,000	303,405	2014/12/26
139号 利附商工債(3年)	0.300	300,000	300,264	2014/08/27
小計	—	5,520,000	5,605,406	—
(普通社債券)				
第345回 東京地下鉄社債	0.610	100,000	100,475	2013/06/20
第9回 GEキャピタル円貨債	1.770	100,000	101,488	2014/06/02
第12回 GEキャピタル円貨債	1.545	100,000	101,154	2015/06/03
第14回 GEキャピタル円貨債	1.840	100,000	102,554	2015/11/20
第2回 JPMorgan・チェース劣後債	1.930	100,000	99,478	2015/11/10
第4回 ゴールドマン・サックス円貨債	1.980	100,000	100,919	2014/05/28
第16回 シティグループ円貨債	1.580	100,000	98,998	2015/09/16
第22回 シティグループ円貨債	2.130	200,000	201,894	2014/06/20
第7回 ウェストバンク銀行円貨債	1.070	100,000	99,644	2015/09/03
第1回 オーストラリア定期保証オーストラリア・ニュージールランド銀行円貨債	1.650	100,000	102,370	2014/02/10
第22回 中日本高道路債	1.036	300,000	302,037	2020/09/18
第7回 キリンホールディングス社債	1.639	100,000	105,857	2019/11/05
第5回 日本たばこ産業社債	1.128	100,000	101,936	2014/06/03
第25回 住友化学工業社債	1.620	100,000	102,225	2013/11/12
第41回 住友化学社債	1.640	100,000	105,184	2019/10/18
第34回 三井化学社債	1.840	100,000	105,298	2016/03/10
第2回 花王社債	1.910	100,000	102,189	2013/06/20
第24回 新日本石油社債	1.530	100,000	103,548	2015/06/12
第8回 旭硝子社債	0.670	100,000	100,536	2013/06/03
第29回 新日本製鐵社債	3.300	100,000	113,928	2017/03/17
第52回 新日本製鐵社債	1.670	100,000	102,914	2014/03/20
第64回 新日本製鐵社債	1.530	100,000	104,814	2020/03/19
第10回 ジェイエフイーホールディングス社債	0.927	100,000	101,508	2014/07/24
第10回 ジェイエフイーホールディングス社債	0.572	100,000	100,650	2015/05/27
第12回 日立製作所社債	0.720	100,000	100,566	2013/05/27
第25回 富士通社債	1.730	100,000	103,583	2014/09/25
第7回 パナソニック社債	1.404	200,000	204,550	2014/03/20
第10回 パナソニック社債	0.752	200,000	201,618	2016/03/18
第11回 パナソニック社債	1.081	100,000	101,800	2018/03/20
第24回 シャープ社債	0.846	200,000	202,136	2014/09/16
第17回 ソニー社債	1.570	100,000	103,634	2015/06/19
第3回 パナソニック電工社債	1.660	100,000	103,962	2015/06/19
第19回 三菱重工業社債	2.040	100,000	106,940	2016/09/07
第49回 日産自動車社債	1.931	100,000	103,882	2014/09/19
第51回 日産自動車社債	0.813	100,000	101,044	2015/04/28
第7回 トヨタ自動車社債	1.340	300,000	305,982	2013/12/20
第9回 トヨタ自動車社債	1.073	200,000	203,742	2014/06/20
第49回 伊藤忠商事社債	2.280	100,000	109,419	2018/06/20
第58回 伊藤忠商事社債	0.613	100,000	100,523	2016/06/06
第77回 丸紅社債	0.880	100,000	101,154	2015/05/25
第45回 三井物産社債	0.790	100,000	100,615	2013/05/07
第16回 三菱商事社債	3.000	100,000	105,286	2014/01/27

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
第14回 クレディセゾン社債	1.200	100,000	100,729	2013/06/14
第1回 みずほコーポレート銀行劣後社債	2.100	200,000	205,528	2014/02/12
第7回 みずほコーポレート銀行社債	2.080	100,000	107,681	2017/07/27
第13回 みずほコーポレート銀行社債	1.390	200,000	203,060	2013/07/19
第14回 みずほコーポレート銀行社債	1.520	100,000	102,178	2013/12/10
第15回 みずほコーポレート銀行社債	1.325	200,000	204,064	2014/02/27
第18回 みずほコーポレート銀行社債	0.830	200,000	202,494	2014/10/16
第20回 みずほコーポレート銀行社債	0.710	200,000	201,966	2015/04/20
第24回 みずほコーポレート銀行社債	0.595	200,000	201,080	2016/01/20
第100回 三菱東京UFJ銀行社債	1.370	200,000	203,174	2013/07/16
第106回 三菱東京UFJ銀行社債	0.905	300,000	304,614	2014/07/17
第112回 三菱東京UFJ銀行社債	0.660	200,000	202,074	2015/01/26
第114回 三菱東京UFJ銀行社債	0.670	200,000	202,172	2015/04/17
第3回2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	1.300	200,000	202,204	2013/06/26
第6回 東京三菱銀行劣後社債	1.730	100,000	103,269	2014/12/22
第8回 東京三菱銀行劣後社債	1.640	200,000	206,818	2015/07/22
第12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.160	200,000	213,590	2017/07/28
第28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.560	200,000	203,274	2021/01/20
第11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.280	200,000	213,580	2016/10/31
第4回 りそな銀行劣後社債	2.766	100,000	108,940	2019/06/20
第6回 りそな銀行劣後社債	2.084	100,000	103,847	2020/03/04
第4回 住友信託銀行劣後社債	1.670	100,000	102,838	2015/04/28
第7回 住友信託銀行劣後社債	1.950	100,000	104,819	2017/05/10
第5回 住友信託銀行劣後社債	2.250	100,000	105,612	2016/04/27
第45回 三井住友銀行社債	1.230	200,000	203,726	2014/01/20
第47回 三井住友銀行社債	0.910	200,000	203,036	2014/07/18
第50回 三井住友銀行社債	0.500	200,000	200,938	2015/07/17
第51回 三井住友銀行社債	0.350	200,000	199,814	2015/10/20
第6回 三井住友銀行劣後社債	1.710	100,000	101,745	2013/08/01
第7回 三井住友銀行劣後社債	2.010	100,000	102,883	2012/02/05
第8回 三井住友銀行劣後社債	1.950	100,000	103,613	2014/10/22
第9回 三井住友銀行劣後社債	1.750	100,000	103,747	2015/08/17
第11回 三井住友銀行劣後社債	2.170	200,000	213,730	2017/12/20
第20回 三井住友銀行劣後社債	2.210	200,000	214,942	2019/07/24
第1回 みずほ銀行劣後特約付社債	1.700	100,000	102,753	2015/02/03
第6回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.250	100,000	105,931	2016/11/04
第10回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.060	100,000	105,496	2018/01/26
第14回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.140	100,000	105,772	2019/09/27
第38回 NTTファイナンス社債	0.550	200,000	201,014	2015/06/19
第17回 ホンダファイナンス社債	0.465	100,000	99,942	2016/12/20
第19回 トヨタファイナンス社債	2.040	100,000	106,531	2016/03/18
第23回 トヨタファイナンス社債	1.970	300,000	320,397	2016/09/20
第40回 トヨタファイナンス社債	1.478	100,000	102,791	2014/06/20
第118回 オリックス社債	2.180	100,000	103,189	2014/07/30
第144回 オリックス社債	1.510	100,000	100,997	2017/12/22
第148回 オリックス社債	1.260	200,000	200,412	2017/02/24
第12回 三菱UFJリース社債	0.634	100,000	100,458	2016/01/21
第8回 野村ホールディングス社債	2.120	100,000	104,977	2017/08/14
第15回 野村ホールディングス社債	2.010	100,000	102,859	2014/06/13
第17回 野村ホールディングス社債	1.280	200,000	202,434	2014/11/27
第20回 野村ホールディングス社債	0.980	100,000	100,265	2015/03/17
第22回 野村ホールディングス社債	0.937	200,000	200,070	2015/06/24
第24回 三井不動産社債	1.650	100,000	104,648	2015/12/18
第31回 三井不動産社債	1.645	100,000	103,400	2014/09/19
第66回 三菱地所社債	0.785	100,000	100,672	2013/05/09
第79回 三菱地所社債	1.790	200,000	212,984	2017/03/17

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
第90回 三菱地所社債	1.650	100,000	106,190	2018/04/24
第73回 住友不動産社債	0.960	100,000	100,889	2015/04/30
第41回 小田急電鉄社債	2.240	100,000	107,724	2016/08/08
第2回 東日本旅客鉄道社債	4.900	200,000	227,486	2015/02/25
第7回 東日本旅客鉄道社債	3.300	100,000	114,991	2017/08/25
第19回 東日本旅客鉄道社債	2.360	100,000	111,489	2022/02/25
第31回 東日本旅客鉄道社債	1.580	200,000	205,444	2014/03/19
第41回 東日本旅客鉄道社債	1.560	100,000	104,217	2015/09/18
第3回 西日本旅客鉄道社債	3.450	100,000	114,225	2016/12/20
第10回 西日本旅客鉄道社債	2.040	100,000	107,840	2023/09/20
第1回 東海旅客鉄道社債	4.650	100,000	108,825	2014/02/21
第2回 東海旅客鉄道社債	3.950	200,000	229,220	2016/04/25
第6回 東海旅客鉄道社債	2.390	100,000	111,784	2022/02/15
第10回 東海旅客鉄道社債	1.420	190,000	199,082	2017/09/20
第23回 東海旅客鉄道社債	2.140	100,000	109,225	2018/04/25
第3回 東京地下鉄社債	1.900	100,000	106,579	2016/09/20
第48回 日本電信電話社債	1.610	400,000	413,592	2014/09/19
第50回 日本電信電話社債	1.580	100,000	104,325	2015/09/18
第51回 日本電信電話社債	2.060	200,000	213,998	2016/06/20
第58回 日本電信電話社債	1.000	100,000	101,689	2014/06/20
第5回 KDDI社債	3.200	100,000	113,527	2017/04/28
第16回 NTTドコモ社債	1.260	200,000	203,766	2013/12/20
第45回 東京電力社債	2.075	200,000	154,176	2018/10/23
第511回 東京電力社債	1.615	100,000	90,715	2014/05/28
第516回 東京電力社債	1.420	100,000	86,593	2015/04/27
第519回 東京電力社債	1.590	372,000	314,440	2015/12/28
第542回 東京電力社債	1.602	500,000	381,750	2018/04/25
第407回 中部電力社債	3.400	100,000	109,172	2015/07/24
第409回 中部電力社債	3.900	300,000	340,005	2016/06/24
第463回 中部電力社債	0.820	200,000	200,840	2013/04/25
第467回 中部電力社債	1.540	100,000	102,657	2014/12/25
第468回 中部電力社債	1.430	100,000	102,439	2015/02/25
第471回 中部電力社債	1.310	300,000	306,453	2015/06/25
第476回 中部電力社債	2.120	100,000	106,985	2018/06/25
第478回 中部電力社債	1.890	100,000	104,913	2016/09/23
第480回 中部電力社債	1.790	200,000	209,318	2017/01/25
第484回 中部電力社債	1.410	200,000	204,294	2014/09/25
第487回 中部電力社債	1.209	140,000	141,661	2013/11/25
第496回 中部電力社債	1.227	500,000	498,560	2020/07/24
第410回 関西電力社債	2.000	300,000	318,315	2018/11/22
第427回 関西電力社債	1.500	100,000	101,342	2013/06/25
第433回 関西電力社債	1.300	200,000	203,880	2014/11/25
第441回 関西電力社債	1.460	200,000	205,104	2015/04/24
第446回 関西電力社債	1.780	200,000	208,378	2016/03/18
第298回 中国電力社債	4.100	200,000	222,352	2015/05/25
第310回 中国電力社債	3.225	200,000	225,052	2017/07/25
第341回 中国電力社債	1.550	100,000	102,328	2014/06/25
第350回 中国電力社債	1.570	200,000	205,298	2014/10/24
第245回 北陸電力社債	3.800	200,000	220,882	2015/06/25
第260回 北陸電力社債	2.330	100,000	108,465	2020/05/25
第281回 北陸電力社債	1.970	200,000	211,992	2018/04/25
第289回 北陸電力社債	1.410	300,000	306,960	2014/12/25
第368回 東北電力社債	4.800	300,000	327,078	2014/04/25
第375回 東北電力社債	3.700	100,000	109,824	2015/06/25
第380回 東北電力社債	3.550	300,000	337,032	2016/11/25
第420回 東北電力社債	1.360	100,000	101,450	2014/02/25

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
第427回 東北電力社債	1.430	200,000	204,636	2015/09/25
第432回 東北電力社債	2.090	500,000	525,685	2016/05/25
第237回 四国電力社債	2.050	100,000	106,590	2018/11/22
第257回 四国電力社債	1.390	200,000	204,700	2015/02/25
第374回 九州電力社債	1.500	300,000	304,671	2013/09/25
第382回 九州電力社債	1.440	100,000	102,499	2015/02/25
第383回 九州電力社債	1.460	100,000	102,584	2015/04/24
第387回 九州電力社債	1.690	200,000	207,658	2016/03/25
第257回 北海道電力社債	3.850	200,000	225,378	2016/04/25
第282回 北海道電力社債	1.440	200,000	203,334	2013/12/25
第284回 北海道電力社債	1.480	500,000	514,585	2016/02/25
第286回 北海道電力社債	1.530	100,000	102,516	2014/10/24
第2回 電源開発社債	1.610	100,000	101,488	2013/06/20

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
第4回 電源開発社債	1.320	200,000	202,758	2013/12/20
第6回 電源開発社債	1.550	100,000	102,353	2014/09/19
第14回 電源開発社債	1.560	100,000	102,956	2015/09/18
第17回 電源開発社債	2.070	100,000	105,249	2016/06/20
第14回 東京ガス社債	5.100	100,000	111,685	2014/07/25
第24回 東京瓦斯社債	1.410	200,000	204,132	2013/12/02
第9回 大阪ガス社債	2.900	100,000	113,555	2018/01/30
第24回 大阪瓦斯社債	1.590	100,000	103,456	2014/10/24
第27回 大阪瓦斯社債	1.199	100,000	101,676	2013/11/27
第20回 NTTデータ社債	1.100	100,000	101,118	2013/06/20
小計	—	27,602,000	28,409,778	—
合計	—	388,775,272	405,716,320	—

■投資信託財産の構成

2012年2月14日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 405,716,320	% 99.2
コール・ローン等、その他	3,170,276	0.8
投資信託財産総額	408,886,596	100.0

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2012年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	408,886,596,211円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,537,619,999
社 債 (評価額)	405,716,320,698
公 未 収 入 利 息	1,576,289,817
前 払 費 用	56,365,697
(B) 負 債	154,844,000
未 払 解 約 金	154,844,000
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	408,731,752,211
元 次 期 繰 越 損 益 本 金	358,048,514,431
(D) 受 益 権 総 口 数	50,683,237,780
1 万 口 当 ち 基 準 価 額 (C/D)	358,048,514,431円
	11,416円

<注記事項>

※ 期首元本額	386,067,411,884円
期中追加設定元本額	44,575,377,961円
期中一部解約元本額	72,594,275,414円
※ 期末における元本の内訳	
D I AM国内債券バッシブ・ファンド	5,051,386,592円
D I AM国内債券インデックスファンド<DC年金>	9,011,698,420円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	2,756,667,651円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	4,242,134,327円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,648,530,293円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	1,167,016,274円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,150,779,054円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	143,628,591円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	185,885,146円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,063,373,182円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	7,094,544円
みずほエマージングボンドオープン	10,801,911円
D I AM高金利通貨ファンド	9,608,918円
D I AMエマージング債券ファンド	9,450,010円
D I AMロシア株式ファンド	10,126,042円
D I AM国内債券バッシブファンド(適格機関投資家向け)	19,679,663,802円
D I AM国内債券バッシブ私募ファンド(適格機関投資家限定)	110,129,562円
D I AMワールドバランス25V A(適格機関投資家限定)	763,698,419円
D I AMグローバル・バランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	11,464,702,786円
D I AMグローバル・バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	629,467,053円
D I AM国際分散バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	442,339,155円
D I AM国際分散バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	1,091,672,151円
D I AM国内重視バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	499,286,789円
D I AM国内重視バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	351,020,821円
D I AM世界バランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	27,275,725,818円
D I AM世界バランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	9,015,165,793円
D I AMバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	12,552,713,985円
D I AMバランスファンド37.5V A(適格機関投資家限定)	4,609,304,434円
D I AMバランスファンド50V A(適格機関投資家限定)	7,095,863,605円
D I AMグローバル・アセット・バランスV A(適格機関投資家限定)	1,653,839,149円
D I AMグローバル・アセット・バランスV A2(適格機関投資家限定)	5,999,053,623円
D I AM アクサ グローバル バランスファンド30V A(適格機関投資家限定)	7,328,147,724円
D I AM世界アセットバランスファンドV A(適格機関投資家向け)	13,705,000,617円
D I AMグローバルβ私募ファンド(適格機関投資家向け)	642,937,364円
D I AM世界バランスファンド55V A(適格機関投資家限定)	13,425,936,538円
D I AM7イェスジ-世界バランスファンド35V A(適格機関投資家限定)	6,699,998,806円
D I AMグローバル分散ファンドV A(適格機関投資家限定)	1,421,114,722円
D I AM世界アセットバランスファンド2V A(適格機関投資家限定)	101,836,124,630円
D I AM世界アセットバランスファンド40V A(適格機関投資家限定)	2,476,596,008円
D I AM世界アセットバランスファンド25V A(適格機関投資家限定)	9,425,482,038円
D I AM世界アセットバランスファンド3V A(適格機関投資家限定)	31,027,872,577円
D I AMバランス30V A(適格機関投資家限定)	2,157,459,565円
D I AMバランス50V A(適格機関投資家限定)	233,119円
D I AMバランス70V A(適格機関投資家限定)	143,218円
D I AM世界アセットバランスファンド4V A(適格機関投資家限定)	34,028,766,769円
D I AM世界バランス25V A(適格機関投資家限定)	904,283,666円
D I AM国内バランス30V A(適格機関投資家限定)	203,014,261円
D I AMバランス20V A(適格機関投資家限定)	2,063,045,236円
D I AMバランス40V A(適格機関投資家限定)	308,796円
D I AMバランス60V A(適格機関投資家限定)	220,877円
期末元本合計	358,048,514,431円

■損益の状況

当期 自2011年2月15日 至2012年2月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	5,810,207,317円
受 取 利 息	5,810,207,317
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	6,865,430,519
売 買 益	8,622,052,974
売 買 損	△ 1,756,622,455
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	12,675,637,836
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	41,726,734,586
(E) 解 約 差 損 益 金	△ 9,387,588,681
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	5,668,454,039
(G) 計 算 (C+D+E+F)	50,683,237,780
次 期 繰 越 損 益 金	50,683,237,780

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (E)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。

(注3) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。