

## 運用報告書

第3期<決算日2011年10月12日>

### DIAM国内債券パッシブ・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信 国内／債券（インデックス型）	
信託期間	信託期間は2009年1月30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。	
主要運用対象	DIAM国内債券パッシブ・ファンド	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。
組入制限	<ul style="list-style-type: none"> <li>・マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。</li> <li>・株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以内とします。</li> <li>・外貨建資産への投資は行いません。</li> </ul>	
分配方針	決算日（原則として10月12日）に経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます）等の中から、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。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

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国内債券パッシブ・ファンド」は、2011年10月12日に第3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>

# DIAM国内債券パッシブ・ファンド

## ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	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) 円	税込み 分配 円	期 騰落 中率 %	期 騰落 中率 %	期 騰落 中率 %				
(設定日) 2009年1月30日	10,000	—	—	ポイント (1月29日) 316.83	—	—	—	—	百万円 —
1期(2009年10月13日)	10,096	0	1.0	321.18	1.4	99.8	—	—	1,434
2期(2010年10月12日)	10,443	0	3.4	334.13	4.0	99.4	—	—	3,168
3期(2011年10月12日)	10,435	0	△0.1	336.07	0.6	99.4	—	—	6,234

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の投資元本です。

(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。

(出所) NOMURA-BPI総合は、野村証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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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
	円	騰落率 %	ポイント	騰落率 %			
(期首) 2010年10月12日	10,443	—	334.13	—	99.4	—	—
10月 末	10,385	△0.6	332.38	△0.5	99.5	—	—
11月 末	10,266	△1.7	328.76	△1.6	99.5	—	—
12月 末	10,326	△1.1	330.80	△1.0	99.6	—	—
2011年1月 末	10,265	△1.7	329.03	△1.5	99.6	—	—
2月 末	10,247	△1.9	328.54	△1.7	99.5	—	—
3月 末	10,241	△1.9	328.52	△1.7	99.8	—	—
4月 末	10,271	△1.6	329.80	△1.3	99.6	—	—
5月 末	10,304	△1.3	331.05	△0.9	99.5	—	—
6月 末	10,328	△1.1	332.09	△0.6	99.8	—	—
7月 末	10,364	△0.8	333.38	△0.2	99.5	—	—
8月 末	10,389	△0.5	334.34	0.1	99.4	—	—
9月 末	10,422	△0.2	335.57	0.4	99.8	—	—
(期末) 2011年10月12日	10,435	△0.1	336.07	0.6	99.4	—	—

(注1) 騰落率は期首比です。

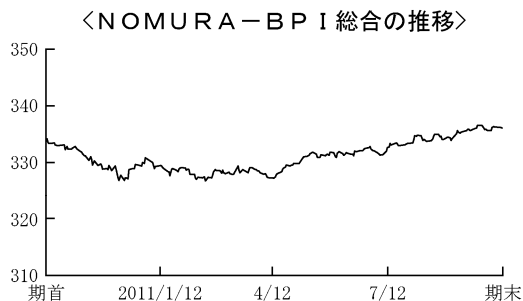
(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「新株予約権付社債(転換社債)比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(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（2010年10月13日から2011年10月12日まで）



期首	期中高値	期中安値	期末
2010. 10. 12	2011. 9. 22 2011. 9. 26	2011. 4. 12	2011. 10. 12
10,443円	10,453円	10,191円	10,435円



## 《投資環境》

当期の長期金利（10年国債利回り）は、0.8%台半ば～1.3%台半ばの範囲で推移し、前期末の0.850%から0.995%に上昇（価格は下落）しました。

期初から、海外で長期金利が上昇したことや、株式市場が上昇したことなどを受けて、長期金利は大幅に上昇し、2010年12月中旬には一時1.3%近くまで上昇しました。その後2011年4月にかけては、中東・北アフリカ情勢の緊迫化や、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、復興補正予算による国債の増発懸念等をにらみつつ、長期金利は1.1%から1.3%台半ばの水準での揉み合いとなりました。その後は、ギリシャを始めとする欧州諸国の財政懸念が再燃しリスク回避姿勢が強まったことなどから、5月中旬にかけて債券価格は大きく上昇（利回りは低下）しました。6月以降も、為替市場が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及び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。長期金利は8月に1.0%を下回る水準まで低下した後、期末まで概ね1.0%前後の狭い範囲で揉み合う展開となりました。

## 《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10,435円となり、前期末に比べ0.08%下落しました。

### 基準価額の騰落要因

期間：期初～2011年2月中旬

〔下落要因〕海外で長期金利が上昇したことや、景況感の改善から株式市場が上昇したことなどを受けて、金利が上昇したこと。

期間：2011年2月中旬～期末

〔上昇要因〕欧州の財政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、及び保有する債券から利息収入を得たこと。

## ベンチマークの推移

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末に比べ0.58%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0.66%下回り、信託報酬要因を除くと、概ねベンチマークに連動したパフォーマンスとなりました。

## 収益分配金

当期の収益分配金につきましては、運用実績等を勘案して無分配とさせていただきました。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。

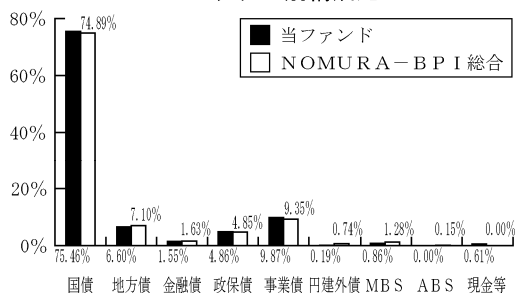
## 《今後の運用方針》

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。

## 【DIAM国内債券パッシブ・ファンドの運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

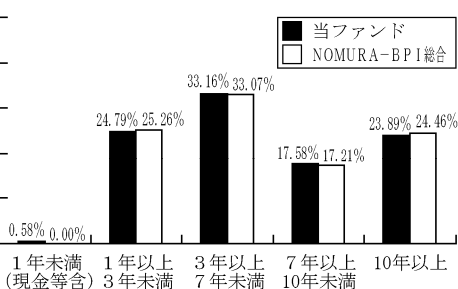
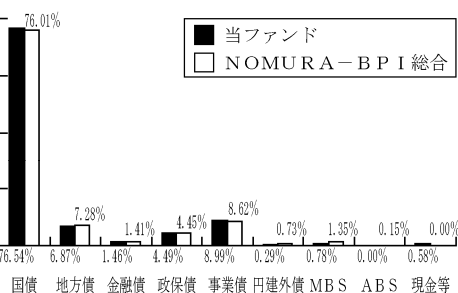
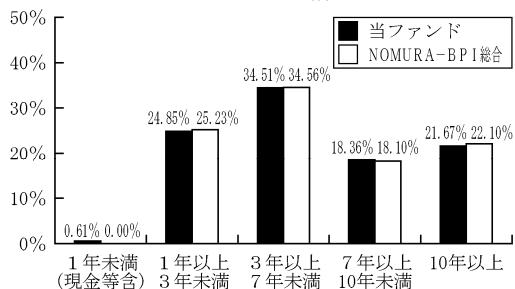
期首 (前期末)

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) 信 託 報 酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	54円 (49) ( 2) ( 3)
(b) 保 管 費 用 等	0
合 計	54

(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（2010年10月13日から2011年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 3,264,937	千円 3,639,000	千口 580,186	千円 650,320

■ 利害関係人との取引状況等（2010年10月13日から2011年10月12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

	前 期 末	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 2,800,550	千口 5,485,301	千円 6,234,593

(注) 親投資信託合計の受益権口数は357,238,752千口です。

<補足情報>

■国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2011年10月12日現在						
	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	296,870,000	310,770,535	76.5	—	46.3	18.7	11.5
地方債証券	26,687,610	27,895,217	6.9	—	2.1	4.3	0.5
特殊債証券 (除く金融債)	29,344,872	30,752,007	7.6	—	3.6	3.4	0.6
金融債券	5,820,000	5,923,385	1.4	—	—	0.9	0.5
普通社債券	27,602,000	28,337,927	7.0	—	1.5	4.5	1.0
合 計	386,324,482	403,679,072	99.4	—	53.5	31.8	14.1

(注) 組入比率は、2011年10月12日現在のマザーファンド純資産総額(406,022,465千円)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298回 利付国庫債券(2年)	0.100	2,000,000	1,999,660	2012/11/15
第299回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,001,960	2012/12/15
第300回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,100	2013/01/15
第301回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,260	2013/02/15
第302回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,240	2013/03/15
第303回 利付国庫債券(2年)	0.200	1,500,000	1,501,785	2013/04/15
第304回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,340	2013/05/15
第305回 利付国庫債券(2年)	0.200	3,000,000	3,003,720	2013/06/15
第306回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,420	2013/07/15
第307回 利付国庫債券(2年)	0.200	1,200,000	1,201,524	2013/08/15
第68回 利付国庫債券(5年)	1.100	2,000,000	2,023,120	2012/12/20
第69回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,800,000	3,834,998	2012/12/20
第70回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,900,000	4,947,285	2013/03/20
第72回 利付国庫債券(5年)	1.500	4,200,000	4,296,432	2013/06/20
第75回 利付国庫債券(5年)	1.100	4,600,000	4,685,238	2013/09/20
第78回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,500,000	3,557,295	2013/12/20
第81回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,500,000	4,569,480	2014/03/20
第83回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,400,000	3,465,586	2014/06/20
第85回 利付国庫債券(5年)	0.700	3,500,000	3,551,940	2014/09/20
第87回 利付国庫債券(5年)	0.500	4,000,000	4,036,560	2014/12/20
第88回 利付国庫債券(5年)	0.500	3,500,000	3,532,060	2015/03/20
第89回 利付国庫債券(5年)	0.400	4,500,000	4,523,715	2015/06/20
第91回 利付国庫債券(5年)	0.400	1,700,000	1,707,922	2015/09/20
第92回 利付国庫債券(5年)	0.300	3,000,000	3,002,310	2015/12/20
第93回 利付国庫債券(5年)	0.500	4,300,000	4,335,432	2015/12/20
第95回 利付国庫債券(5年)	0.600	2,000,000	2,024,400	2016/03/20
第96回 利付国庫債券(5年)	0.500	1,500,000	1,511,760	2016/03/20
第97回 利付国庫債券(5年)	0.400	5,500,000	5,516,445	2016/06/20
第2回 利付国庫債券(40年)	2.200	600,000	624,342	2049/03/20

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3回 利付国庫債券(40年)	2.200	1,000,000	1,036,690	2050/03/20
第4回 利付国庫債券(40年)	2.200	300,000	309,810	2051/03/20
第246回 利付国庫債券(10年)	0.800	1,900,000	1,915,162	2012/12/20
第247回 利付国庫債券(10年)	0.800	700,000	706,755	2013/03/20
第250回 利付国庫債券(10年)	0.500	2,060,000	2,072,895	2013/06/20
第254回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,700,000	2,765,853	2013/09/20
第256回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,500,000	2,568,025	2013/12/20
第258回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,000,000	1,027,620	2014/03/20
第260回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,100,000	2,179,926	2014/06/20
第263回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,700,000	2,810,754	2014/09/20
第266回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,700,000	3,838,861	2014/12/20
第269回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,500,000	1,554,480	2015/03/20
第270回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,900,000	1,972,257	2015/06/20
第272回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,100,000	2,191,329	2015/09/20
第274回 利付国庫債券(10年)	1.500	2,400,000	2,518,752	2015/12/20
第277回 利付国庫債券(10年)	1.600	3,000,000	3,168,120	2016/03/20
第280回 利付国庫債券(10年)	1.900	2,800,000	3,002,328	2016/06/20
第282回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,400,000	3,623,142	2016/09/20
第284回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,100,000	3,310,180	2016/12/20
第285回 利付国庫債券(10年)	1.700	4,400,000	4,707,296	2017/03/20
第286回 利付国庫債券(10年)	1.800	3,700,000	3,985,159	2017/06/20
第288回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,600,000	3,863,088	2017/09/20
第289回 利付国庫債券(10年)	1.500	4,400,000	4,673,372	2017/12/20
第290回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,200,000	3,380,224	2018/03/20
第293回 利付国庫債券(10年)	1.800	5,000,000	5,414,550	2018/06/20
第296回 利付国庫債券(10年)	1.500	4,000,000	4,253,520	2018/09/20
第297回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,200,000	3,381,920	2018/12/20
第299回 利付国庫債券(10年)	1.300	4,100,000	4,300,859	2019/03/20
第301回 利付国庫債券(10年)	1.500	3,800,000	4,037,538	2019/06/20

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303回 利付国庫債券 (10年)	1.400	2,800,000	2,949,380	2019/09/20
第305回 利付国庫債券 (10年)	1.300	4,300,000	4,487,351	2019/12/20
第306回 利付国庫債券 (10年)	1.400	3,700,000	3,882,817	2020/03/20
第308回 利付国庫債券 (10年)	1.300	1,800,000	1,870,722	2020/06/20
第309回 利付国庫債券 (10年)	1.100	2,500,000	2,556,675	2020/06/20
第310回 利付国庫債券 (10年)	1.000	4,500,000	4,552,200	2020/09/20
第312回 利付国庫債券 (10年)	1.200	5,700,000	5,849,853	2020/12/20
第313回 利付国庫債券 (10年)	1.300	7,000,000	7,230,580	2021/03/20
第315回 利付国庫債券 (10年)	1.200	6,500,000	6,640,985	2021/06/20
第1回 利付国庫債券 (30年)	2.800	100,000	117,865	2029/09/20
第2回 利付国庫債券 (30年)	2.400	100,000	111,504	2030/02/20
第3回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	219,586	2030/05/20
第4回 利付国庫債券 (30年)	2.900	200,000	239,426	2030/11/20
第5回 利付国庫債券 (30年)	2.200	200,000	216,284	2031/05/20
第6回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	222,970	2031/11/20
第7回 利付国庫債券 (30年)	2.300	300,000	329,208	2032/05/20
第8回 利付国庫債券 (30年)	1.800	500,000	504,625	2032/11/22
第11回 利付国庫債券 (30年)	1.700	400,000	394,684	2033/06/20
第12回 利付国庫債券 (30年)	2.100	300,000	317,139	2033/09/20
第13回 利付国庫債券 (30年)	2.000	300,000	311,484	2033/12/20
第14回 利付国庫債券 (30年)	2.400	500,000	555,465	2034/03/20
第15回 利付国庫債券 (30年)	2.500	200,000	226,000	2034/06/20
第16回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	452,412	2034/09/20
第17回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	222,166	2034/12/20
第18回 利付国庫債券 (30年)	2.300	820,000	895,661	2035/03/20
第19回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	218,412	2035/06/20
第20回 利付国庫債券 (30年)	2.500	300,000	339,087	2035/09/20
第21回 利付国庫債券 (30年)	2.300	500,000	545,325	2035/12/20
第22回 利付国庫債券 (30年)	2.500	470,000	531,217	2036/03/20
第23回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	452,088	2036/06/20
第24回 利付国庫債券 (30年)	2.500	600,000	678,096	2036/09/20
第25回 利付国庫債券 (30年)	2.300	600,000	653,100	2036/12/20
第26回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,000,000	1,109,480	2037/03/20
第27回 利付国庫債券 (30年)	2.500	900,000	1,017,657	2037/09/20
第28回 利付国庫債券 (30年)	2.500	1,300,000	1,470,833	2038/03/20
第29回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,500,000	1,667,760	2038/09/20
第30回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,500,000	1,633,185	2039/03/20
第31回 利付国庫債券 (30年)	2.200	1,700,000	1,812,880	2039/09/20
第32回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,600,000	1,740,592	2040/03/20
第33回 利付国庫債券 (30年)	2.000	1,800,000	1,837,026	2040/09/20
第34回 利付国庫債券 (30年)	2.200	2,000,000	2,129,300	2041/03/20
第37回 利付国庫債券 (20年)	3.100	600,000	693,372	2017/09/20
第39回 利付国庫債券 (20年)	2.600	400,000	452,544	2018/03/20
第40回 利付国庫債券 (20年)	2.300	720,000	804,866	2018/09/20
第42回 利付国庫債券 (20年)	2.600	800,000	914,656	2019/03/20
第43回 利付国庫債券 (20年)	2.900	860,000	1,005,847	2019/09/20
第45回 利付国庫債券 (20年)	2.400	900,000	1,017,630	2020/03/20
第46回 利付国庫債券 (20年)	2.200	500,000	556,810	2020/06/22
第47回 利付国庫債券 (20年)	2.200	950,000	1,059,506	2020/09/21
第48回 利付国庫債券 (20年)	2.500	500,000	570,480	2020/12/21
第50回 利付国庫債券 (20年)	1.900	780,000	847,782	2021/03/22
第51回 利付国庫債券 (20年)	2.000	600,000	657,282	2021/06/21
第52回 利付国庫債券 (20年)	2.100	550,000	607,662	2021/09/21
第54回 利付国庫債券 (20年)	2.200	700,000	780,458	2021/12/20
第55回 利付国庫債券 (20年)	2.000	810,000	887,298	2022/03/21
第57回 利付国庫債券 (20年)	1.900	830,000	899,869	2022/06/20
第58回 利付国庫債券 (20年)	1.900	900,000	974,979	2022/09/20
第60回 利付国庫債券 (20年)	1.400	990,000	1,019,046	2022/12/20
第61回 利付国庫債券 (20年)	1.000	800,000	787,088	2023/03/20
第62回 利付国庫債券 (20年)	0.800	1,000,000	958,060	2023/06/20

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64回 利付国庫債券 (20年)	1.900	800,000	862,472	2023/09/20
第65回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,400,386	2023/12/20
第67回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,398,371	2024/03/20
第70回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,250,000	1,416,562	2024/06/20
第72回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,250,000	1,372,050	2024/09/20
第73回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,390,000	1,507,065	2024/12/20
第75回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,340,000	1,467,527	2025/03/20
第78回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,550,000	1,656,051	2025/06/20
第81回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,700,000	1,835,983	2025/09/20
第83回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,600,000	1,745,888	2025/12/20
第85回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,750,000	1,907,272	2026/03/20
第88回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,893,154	2026/06/20
第90回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,600,000	1,760,192	2026/09/20
第92回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,700,000	1,844,313	2026/12/20
第93回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,000,000	1,069,310	2027/03/20
第94回 利付国庫債券 (20年)	2.100	800,000	866,624	2027/03/20
第95回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,885,742	2027/06/20
第97回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,500,000	1,640,235	2027/09/20
第99回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,600,000	1,723,840	2027/12/20
第100回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,800,000	1,963,422	2028/03/20
第102回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,900,000	2,126,651	2028/06/20
第105回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,800,000	1,932,732	2028/09/20
第107回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,144,840	2028/12/20
第109回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,000,000	2,081,740	2029/03/20
第111回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,200,000	2,386,780	2029/06/20
第113回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,136,320	2029/09/20
第114回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,133,280	2029/12/20
第116回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,000,000	2,181,952	2030/03/20
第118回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,200,000	1,259,952	2030/06/20
第119回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,500,000	1,526,670	2030/06/20
第121回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,200,000	2,272,754	2030/09/20
第123回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,200,000	2,342,494	2030/12/20
第125回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,400,000	2,596,056	2031/03/20
第128回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,000,000	2,062,000	2031/06/20
第129回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,000,000	1,014,740	2031/06/20
小計	—	296,870,000	310,770,535	—
(地方債証券)				
第602回 東京都公債	1.400	148,000	151,615	2013/10/25
第611回 東京都公債	1.830	200,000	208,572	2014/06/20
第612回 東京都公債	1.710	161,500	167,905	2014/06/20
第614回 東京都公債	1.480	200,000	207,232	2014/09/19
第616回 東京都公債	1.410	100,000	103,600	2014/12/19
第617回 東京都公債	1.400	200,000	207,136	2014/12/19
第619回 東京都公債	1.530	200,000	208,470	2015/03/20
第620回 東京都公債	1.350	200,000	207,246	2015/03/20
第622回 東京都公債	1.280	106,800	110,593	2015/06/19
第623回 東京都公債	1.310	200,000	207,324	2015/06/19
第627回 東京都公債	1.520	100,000	104,622	2015/09/18
第628回 東京都公債	1.590	100,000	105,113	2015/12/18
第629回 東京都公債	1.450	494,000	516,402	2015/12/18
第632回 東京都公債	2.000	115,300	123,492	2016/03/18
第633回 東京都公債	1.970	100,000	106,974	2016/03/18
第634回 東京都公債	1.860	200,000	213,628	2016/06/20
第638回 東京都公債	1.900	200,000	214,532	2016/09/20
第640回 東京都公債	1.790	150,000	160,435	2016/12/20
第641回 東京都公債	1.820	100,000	107,109	2016/12/20
第649回 東京都公債	1.620	203,500	217,193	2018/06/20
第664回 東京都公債	1.400	300,000	315,822	2018/12/20
第667回 東京都公債	1.570	300,000	319,347	2019/03/20
第680回 東京都公債	1.390	200,000	208,826	2020/03/19

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688回 東京都公募債	1.130	500,000	510,085	2020/06/19
第688回 東京都公募債	0.940	200,000	200,330	2020/09/18
15年度2回 北海道公募債	1.100	203,000	206,008	2013/07/29
16年度11回 北海道公募債	1.300	250,000	257,785	2015/02/25
18年度4回 北海道公募債	2.000	190,500	203,987	2016/06/30
18年度6回 北海道公募債	2.100	100,000	107,732	2016/08/31
19年度4回 北海道公募債	1.980	300,000	323,760	2017/06/29
21年度2回 北海道公募債	1.600	200,000	211,620	2019/08/28
第125回 神奈川県公募債	1.400	100,000	102,881	2014/03/31
第126回 神奈川県公募債	1.500	178,870	184,622	2014/04/30
第127回 神奈川県公募債	1.800	100,000	104,319	2014/07/30
第128回 神奈川県公募債	1.500	100,000	103,666	2014/09/30
第130回 神奈川県公募債	1.400	156,200	161,885	2015/01/28
第135回 神奈川県公募債	1.600	200,000	209,968	2015/10/28
第136回 神奈川県公募債	1.500	100,000	104,707	2015/12/28
第166回 神奈川県公募債	1.360	300,000	313,593	2019/09/20
第252回 大阪府公募債	0.800	100,000	100,726	2013/01/30
第261回 大阪府公募債	1.500	129,000	132,459	2013/12/25
第278回 大阪府公募債	1.300	200,000	206,620	2015/05/29
第285回 大阪府公募債	1.500	100,000	104,438	2015/12/25
第288回 大阪府公募債	1.500	200,000	208,988	2016/01/29
第289回 大阪府公募債	1.800	200,000	212,010	2016/04/27
第293回 大阪府公募債	2.100	200,000	215,558	2016/08/30
第301回 大阪府公募債	1.830	100,000	107,021	2017/04/26
第310回 大阪府公募債	1.620	240,000	254,707	2018/01/30
第336回 大阪府公募債	1.460	200,000	208,642	2020/03/30
第1回 大阪府公募債 7年	1.800	500,000	514,380	2013/08/28
15年度3回 京都府公募債	1.500	219,300	225,493	2013/12/24
16年度2回 京都府公募債	1.500	100,000	103,646	2014/09/24
18年度1回 京都府公募債	1.700	100,000	106,452	2016/12/22
14年度5回 兵庫県公募債	0.800	100,000	100,783	2013/02/27
15年度1回 兵庫県公募債	0.700	100,000	100,695	2013/04/25
16年度4回 兵庫県公募債	1.600	251,970	260,589	2014/05/27
16年度8回 兵庫県公募債	1.900	111,500	116,573	2014/08/25
17年度2回 兵庫県公募債	1.400	200,000	207,270	2015/04/27
17年度9回 兵庫県公募債	1.600	306,000	320,804	2015/11/30
17年度13回 兵庫県公募債	1.700	105,000	110,790	2016/03/23
18年度1回 兵庫県公募債	1.800	120,000	127,262	2016/04/27
15年度1回 静岡県公募債	0.500	268,500	269,893	2013/06/27
15年度3回 静岡県公募債	1.400	116,130	118,954	2013/10/28
18年度5回 静岡県公募債	1.850	129,800	138,971	2016/10/26
21年度5回 静岡県公募債	1.350	197,000	205,626	2019/10/18
15年度1回 愛知県公募債	1.400	303,600	310,983	2013/10/28
16年度2回 愛知県公募債	1.600	200,000	208,084	2014/10/27
18年度2回 愛知県公募債	2.000	160,300	172,224	2016/06/27
20年度4回 愛知県公募債	1.600	100,000	106,567	2018/09/25
22年度6回 愛知県公募債	1.178	200,000	204,532	2020/07/30
16年度2回 広島県公募債	1.500	200,000	208,158	2015/03/25
22年度1回 広島県公募債	1.370	200,000	207,852	2020/05/27
15年度3回 埼玉県公募債	1.600	100,000	102,727	2013/09/26
17年度2回 埼玉県公募債	1.300	200,000	207,090	2015/05/27
18年度1回 埼玉県公募債	1.800	200,000	212,624	2016/04/27
21年度4回 埼玉県公募債	1.460	440,000	463,685	2019/07/29
16年度3回 福岡県公募債	1.300	131,040	135,456	2015/02/24
17年度1回 福岡県公募債	1.400	100,000	104,075	2015/08/26
17年度5回 福岡県公募債	1.500	100,000	104,775	2016/01/27
18年度1回 福岡県公募債	2.100	104,000	112,438	2016/08/30
21年度3回 福岡県公募債	1.550	200,000	212,052	2019/08/27
15年度4回 千葉県公募債	1.400	100,000	102,682	2014/01/24
16年度3回 千葉県公募債	1.900	100,000	104,713	2014/08/25

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8回 千葉県公募債	1.300	200,000	206,746	2015/02/25
17年度2回 千葉県公募債	1.300	200,000	207,166	2015/06/25
19年度5回 千葉県公募債	1.850	300,000	323,454	2017/10/25
21年度6回 千葉県公募債	1.410	200,000	209,750	2019/09/25
18年度2回 新潟県公募債	1.870	169,000	181,117	2016/11/29
第2回 共同発行市場公募地方債	0.600	100,000	100,659	2013/05/24
第3回 共同発行市場公募地方債	0.500	100,000	100,526	2013/06/25
第8回 共同発行市場公募地方債	1.600	400,000	411,736	2013/11/25
第9回 共同発行市場公募地方債	1.500	210,000	215,915	2013/12/25
第11回 共同発行市場公募地方債	1.300	300,000	307,647	2014/02/25
第12回 共同発行市場公募地方債	1.400	130,000	133,736	2014/03/25
第13回 共同発行市場公募地方債	1.500	221,000	228,098	2014/04/25
第18回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	103,942	2014/09/25
第19回 共同発行市場公募地方債	1.600	130,000	135,240	2014/10/24
第20回 共同発行市場公募地方債	1.500	100,000	103,805	2014/11/25
第21回 共同発行市場公募地方債	1.400	300,000	310,662	2014/12/25
第23回 共同発行市場公募地方債	1.300	100,000	103,373	2015/02/25
第25回 共同発行市場公募地方債	1.400	304,000	315,628	2015/04/24
第28回 共同発行市場公募地方債	1.300	200,000	207,268	2015/07/24
第29回 共同発行市場公募地方債	1.400	200,000	208,144	2015/08/25
第31回 共同発行市場公募地方債	1.500	200,000	209,140	2015/10/23
第32回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	210,112	2015/11/25
第33回 共同発行市場公募地方債	1.600	300,000	315,336	2015/12/25
第35回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	210,540	2016/02/25
第36回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	105,338	2016/03/25
第37回 共同発行市場公募地方債	1.800	150,000	159,457	2016/04/25
第38回 共同発行市場公募地方債	2.000	170,000	182,450	2016/05/25
第39回 共同発行市場公募地方債	1.900	146,000	156,168	2016/06/24
第40回 共同発行市場公募地方債	2.100	150,000	162,004	2016/07/25
第47回 共同発行市場公募地方債	1.800	161,600	173,083	2017/02/24
第55回 共同発行市場公募地方債	1.850	200,000	215,636	2017/10/25
第57回 共同発行市場公募地方債	1.650	200,000	213,386	2017/12/25
第61回 共同発行市場公募地方債	1.550	300,000	318,519	2018/04/25
第65回 共同発行市場公募地方債	1.620	100,000	106,690	2018/08/24
第75回 共同発行市場公募地方債	1.640	500,000	533,955	2019/06/25
第80回 共同発行市場公募地方債	1.540	700,000	740,341	2019/11/25
第94回 共同発行市場公募地方債	1.240	100,000	102,256	2021/01/25
17年度3回 大阪市公募債	1.300	100,000	103,353	2015/07/28
17年度7回 大阪市公募債	1.400	200,000	207,642	2015/09/29
17年度8回 大阪市公募債	1.600	200,000	209,336	2015/10/27
17年度11回 大阪市公募債	1.600	100,000	104,925	2016/02/23
18年度2回 大阪市公募債	2.000	100,000	107,048	2016/06/22
18年度3回 大阪市公募債	2.100	150,000	161,449	2016/07/27
19年度5回 大阪市公募債	1.990	135,000	145,828	2017/07/19
第12回さ号 名古屋市公募債	0.600	100,000	100,664	2013/05/28
第12回ひ号 名古屋市公募債	1.300	200,000	207,254	2015/07/21
第12回せ号 名古屋市公募債	1.400	359,500	374,322	2015/09/28
17年度1回 京都市公募債	1.400	100,000	103,973	2015/08/25
18年度3回 京都市公募債	1.900	101,700	109,328	2017/02/27
16年度5回 神戸市公募債	1.400	200,000	206,970	2014/12/24
17年度13回 神戸市公募債	1.600	103,000	108,304	2016/02/23
15年度5回 横浜市公募債	1.300	200,000	205,098	2014/02/25
16年度1回 横浜市公募債	1.600	200,000	206,686	2014/03/20
17年度1回 横浜市公募債	1.300	300,000	310,254	2015/03/20
14年度5回 札幌市公募債	0.800	106,000	106,832	2013/01/30
14年度7回 札幌市公募債	0.700	100,000	100,763	2013/04/24
16年度7回 札幌市公募債	1.500	100,000	104,079	2015/03/25
第2回 川崎市公募債 15年	1.630	100,000	106,013	2020/06/22
第19回 川崎市公募債 5年	1.410	100,000	102,035	2013/06/20
18年度4回 福岡市公募債	1.800	100,000	106,744	2016/10/27

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1回 広島市公債	1.400	100,000	103,485	2014/12/24
16年度2回 千葉市公債	1.400	100,000	103,586	2015/01/27
小 計	—	26,687,610	27,895,217	—
(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	106,586	2014/08/27
第13回 政保日本政策投資銀行債券	2.000	121,000	130,337	2016/08/25
第16回 日本政策投資銀行債券	1.520	100,000	103,461	2014/09/19
第7回 日本政策投資銀行債券	0.780	200,000	201,484	2013/03/19
第9回 日本政策投資銀行債券	1.580	100,000	102,527	2013/09/20
第13回 日本政策投資銀行債券	1.590	100,000	103,131	2014/03/20
第27回 日本政策投資銀行債券	1.980	200,000	214,424	2016/09/20
第46回 日本政策投資銀行債券	1.690	200,000	213,110	2018/03/20
第12回 日本道路・機構承継債	1.330	100,000	101,274	2012/12/20
第34回 日本道路・機構承継債	1.630	200,000	207,582	2014/09/22
第319回 政保道路債	0.900	132,000	133,785	2013/08/22
第322回 政保道路債	1.500	106,000	108,955	2013/11/28
第323回 政保道路債	1.500	200,000	205,710	2013/12/20
第324回 政保道路債	1.400	200,000	205,482	2014/01/24
第328回 政保道路債	1.500	200,000	206,760	2014/05/28
第329回 政保道路債	1.600	100,000	103,726	2014/06/27
第333回 政保道路債	1.600	300,000	312,327	2014/10/28
第335回 政保道路債	1.400	237,000	245,610	2014/12/24
第338回 政保道路債	1.500	264,000	275,114	2015/03/27
第339回 政保道路債	1.400	301,000	312,823	2015/04/28
第15回 高速道路機構債	2.050	400,000	430,304	2016/09/20
第25回 高速道路機構債	1.820	300,000	321,378	2017/09/20
第35回 高速道路機構債	1.650	400,000	425,232	2018/03/20
第48回 高速道路機構債	1.710	700,000	747,852	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	314,676	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	220,258	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	113,886	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	108,333	2021/03/26
第10回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.000	301,000	324,020	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	131,478	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	106,869	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	401,388	2016/11/30
第22回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.700	300,000	319,743	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	206,184	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	320,316	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	317,302	2017/04/25
第38回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.900	344,000	371,661	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	358,016	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	211,850	2017/12/27
第50回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.400	200,000	210,766	2018/04/20
第60回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	162,000	171,796	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	428,091	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	632,142	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	210,564	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	105,929	2019/06/28
第90回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.300	300,000	312,639	2019/09/30
第16回 日本道路・機構承継債	0.980	430,000	434,424	2013/03/20
第26回 日本道路・機構承継債	1.680	200,000	206,068	2013/12/20
第41回 日本道路・機構承継債	1.520	300,000	311,703	2015/03/20
第5回 公営企業債券	0.770	100,000	100,790	2013/03/22
第829回 政保公営企業債券	1.100	400,000	406,604	2013/07/24
第832回 政保公営企業債券	1.400	298,000	305,393	2013/10/24
第834回 政保公営企業債券	1.500	207,000	212,963	2013/12/24
第837回 政保公営企業債券	1.400	432,000	444,674	2014/03/24
第838回 政保公営企業債券	1.500	600,000	619,584	2014/04/25
第839回 政保公営企業債券	1.500	260,000	268,733	2014/05/26

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843回 政保公営企業債券	1.500	100,000	103,739	2014/09/29
第847回 政保公営企業債券	1.400	200,000	207,442	2015/01/27
第848回 政保公営企業債券	1.300	200,000	206,912	2015/02/24
第849回 政保公営企業債券	1.500	261,000	271,925	2015/03/20
第852回 政保公営企業債券	1.300	300,000	311,064	2015/06/29
第853回 政保公営企業債券	1.200	204,000	210,848	2015/07/24
第854回 政保公営企業債券	1.400	304,000	316,625	2015/08/18
第856回 政保公営企業債券	1.500	200,000	209,330	2015/10/20
第859回 政保公営企業債券	1.500	207,000	217,101	2016/01/25
第862回 政保公営企業債券	1.800	239,000	254,307	2016/04/20
第863回 政保公営企業債券	2.000	200,000	214,860	2016/05/27
第867回 政保公営企業債券	1.800	200,000	213,674	2016/09/21
第868回 政保公営企業債券	1.800	101,000	108,000	2016/10/21
第869回 政保公営企業債券	1.800	102,000	109,168	2016/11/21
第875回 政保公営企業債券	1.700	482,000	515,094	2017/05/22
第8回 政保地方公営企業金融機構債券	1.500	651,000	689,890	2019/05/24
第3回 政保地方公共団体金融機構債券	1.500	101,000	106,888	2019/08/16
第5回 地方公共団体金融機構債券	1.395	500,000	522,885	2019/10/28
第8回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	300,000	311,880	2020/01/20
第10回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	500,000	519,100	2020/03/13
第15回 政保地方公共団体金融機構債券	1.000	200,000	201,802	2020/08/14
第12回 公営企業金融公庫債券	1.530	300,000	310,926	2014/09/24
第14回 公営企業金融公庫債券	1.450	100,000	103,816	2015/03/24
第15回 公営企業金融公庫債券	1.330	300,000	310,695	2015/06/19
第17回 公営企業金融公庫債券	1.570	100,000	104,652	2015/09/24
第20回 公営企業金融公庫債券	2.050	200,000	214,932	2016/06/20
第24回 公営企業金融公庫債券	1.940	300,000	322,419	2016/12/20
第191回 政保首都高速道路債券	1.800	113,000	117,957	2014/07/29
第142回 政保阪神高速道路債	1.400	100,000	103,611	2014/12/17
第148回 政保阪神高速道路債	1.300	107,000	111,085	2015/09/30
第5回 阪神高速道路・機構承継債	1.790	100,000	103,615	2014/03/20
第176回 政保中小企業債券	1.600	100,000	102,733	2013/09/17
第180回 政保中小企業債券	1.800	142,000	148,186	2014/07/22
第186回 政保中小企業債券	1.300	104,000	107,953	2015/09/15
第26回 中小企業債券	1.990	400,000	411,696	2013/06/20
第15回 国際協力銀行債券	1.740	200,000	207,676	2014/06/20
第8回 国際協力銀行債券	0.650	300,000	301,713	2013/03/19
第12回 国際協力銀行債券	1.600	200,000	206,360	2014/03/20
第2回 都市再生債券	2.150	100,000	104,763	2014/06/20
第19回 都市再生機構債券	2.040	200,000	216,838	2018/03/20
第23回 都市再生機構債券	1.280	200,000	204,000	2013/11/25
第2回 本州四国連絡・機構承継債	1.840	100,000	103,382	2013/12/20
第6回 政保中部国際空港債券	1.400	100,000	102,928	2014/03/26
第11回 住宅金融支援機構債券	1.660	200,000	212,524	2017/12/20
第32回 住宅金融支援機構債券	0.780	300,000	303,924	2014/09/19
第37回 住宅金融支援機構債券	1.400	300,000	312,735	2019/09/20
第6回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.260	133,230	140,886	2037/05/10
第8回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.150	92,000	97,013	2037/05/10
第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.190	137,940	146,056	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	157,815	167,021	2037/11/10
第13回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.960	68,483	72,016	2032/05/10
第4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.700	351,160	365,002	2032/05/10
第4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.820	86,733	90,122	2036/12/10
第43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.280	63,551	67,528	2041/06/10
第44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.300	247,756	263,609	2041/07/10
第51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.210	198,877	209,009	2042/02/10
第1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.130	335,790	352,572	2042/05/10
第29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.950	425,175	442,853	2044/10/10
第36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.810	738,152	762,038	2045/05/10
第14回 政保国民生活債券	1.500	132,000	136,881	2014/09/17

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(特殊債券(除金融債))</b>				
	%	千円	千円	
第1回 政保東日本高速道路債	1.600	101,000	106,192	2015/11/25
第2回 政保東日本高速道路債	1.500	101,000	105,819	2015/12/21
第4回 政保中日本高速道路債	1.600	170,000	179,225	2016/03/24
第8回 政保中日本高速道路債	2.000	170,000	183,067	2016/08/12
第21回 政保中日本高速道路債	1.700	300,000	321,885	2018/05/21
第5回 中日本高速道路債	1.860	200,000	215,282	2018/09/20
第1回 政保西日本高速道路債	1.600	201,000	211,333	2015/11/25
第5回 政保西日本高速道路債	1.800	259,000	277,487	2017/01/25
第6回 政保西日本高速道路債	1.800	117,000	125,457	2017/02/27
第2回 鉄道建設運輸施設	1.920	300,000	312,954	2014/06/20
小計	—	29,344,872	30,752,007	—
<b>(金融債券)</b>				
692号 利附商工債	1.200	200,000	202,452	2013/01/25
704号 利附商工債	1.350	200,000	204,922	2014/01/27
706号 利付商工債	1.350	300,000	307,824	2014/03/27
714号 利付商工債	0.900	300,000	305,334	2014/11/27
723号 利付商工債	0.500	300,000	301,215	2015/08/27
694号 利附農林債	1.150	400,000	405,100	2013/03/27
695号 利附農林債	1.150	200,000	202,678	2013/04/26
698号 利附農林債	1.500	300,000	306,531	2013/07/26
701号 利附農林債	1.450	200,000	204,694	2013/10/25
709号 利附農林債	1.150	400,000	408,848	2014/06/27
713号 利附農林債	0.800	300,000	304,059	2014/10/27
717号 利附農林債	0.750	300,000	303,699	2015/02/27
721号 利附農林債	0.600	120,000	120,852	2015/06/26
第217回 利附信金中金債	1.350	200,000	202,662	2012/12/27
第222回 利附信金中金債	1.400	200,000	203,698	2013/05/27
第223回 利附信金中金債	1.500	300,000	306,348	2013/06/27
第226回 利附信金中金債	1.350	300,000	306,342	2013/09/27
第229回 利附信金中金債	1.400	400,000	409,876	2013/12/27
第233回 利附信金中金債	1.350	300,000	307,998	2014/04/25
第236回 利附信金中金債	0.900	300,000	304,881	2014/07/25
第241回 利附信金中金債	0.700	300,000	303,372	2014/12/26
小計	—	5,820,000	5,923,385	—
<b>(普通社債券)</b>				
第345回 東京地下鉄社債	0.610	100,000	100,580	2013/06/20
第9回 GEキャピタル円貨債	1.770	100,000	101,310	2014/06/02
第12回 GEキャピタル円貨債	1.545	100,000	100,151	2015/06/03
第14回 GEキャピタル円貨債	1.840	100,000	101,494	2015/11/20
第2回 JPMorgan・チェス社債	1.930	100,000	97,536	2015/11/10
第4回 Goldman・サックス円貨債	1.980	100,000	97,872	2014/05/28
第16回 シティグループ円貨社債	1.580	100,000	97,454	2015/09/10
第22回 シティグループ円貨社債	2.130	200,000	200,310	2014/06/20
第3回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	1.790	100,000	93,071	2014/12/03
第8回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	2.305	100,000	87,103	2017/06/26
第7回 ウェストパック銀行円貨社債	1.070	100,000	100,365	2015/09/03
第1回 オーストラリア連邦保証オーストラリア・ニューズランド銀行円貨社債	1.650	100,000	102,769	2014/02/10
第1回 キリンホールディングス社債	1.090	100,000	101,185	2013/03/19
第7回 キリンホールディングス社債	1.639	100,000	105,602	2019/11/05
第5回 日本たばこ産業社債	1.128	100,000	102,115	2014/06/03
第25回 住友化学工業社債	1.620	100,000	102,609	2013/11/12
第33回 住友化学社債	1.260	100,000	101,106	2012/12/06
第25回 三菱化学社債	1.800	100,000	101,969	2013/02/05
第34回 三井化学社債	1.840	100,000	105,540	2016/03/10
第2回 花王社債	1.910	100,000	102,730	2013/06/20
第24回 新日本石油社債	1.530	100,000	103,770	2015/06/12
第8回 旭硝子社債	0.670	100,000	100,662	2013/06/03
第29回 新日本製鐵社債	3.300	100,000	114,665	2017/03/17
第48回 新日本製鐵社債	1.180	100,000	101,228	2013/02/13

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(普通社債券)</b>				
	%	千円	千円	
第52回 新日本製鐵社債	1.670	100,000	103,302	2014/03/20
第10回 ジェイエフイーホールディングス社債	0.927	100,000	101,619	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	100,584	2015/05/27
第11回 豊田自動織機社債	1.130	100,000	101,061	2012/12/20
第12回 日立製作所社債	0.720	100,000	100,702	2013/05/27
第25回 富士通社債	1.730	100,000	104,018	2014/09/25
第7回 パナソニック社債	1.404	200,000	205,318	2014/03/20
第10回 パナソニック社債	0.752	200,000	202,426	2016/03/18
第24回 シャープ社債	0.846	200,000	202,880	2014/09/16
第17回 ソニー社債	1.570	100,000	104,059	2015/06/19
第19回 ソニー社債	1.520	100,000	101,776	2013/03/19
第3回 パナソニック電工社債	1.660	100,000	104,544	2015/06/19
第15回 三菱重工業社債	1.030	100,000	100,987	2013/01/31
第19回 三菱重工業社債	2.040	100,000	107,217	2016/09/07
第49回 日産自動車社債	1.931	100,000	104,280	2014/09/19
第7回 トヨタ自動車社債	1.340	300,000	306,885	2013/12/20
第9回 トヨタ自動車社債	1.073	200,000	204,038	2014/06/20
第49回 伊藤忠商事社債	2.280	100,000	109,602	2018/06/20
第45回 三井物産社債	0.790	100,000	100,740	2013/05/07
第29回 住友商事社債	1.430	100,000	101,501	2013/03/01
第16回 三菱商事社債	3.000	100,000	106,043	2014/01/27
第14回 クレディセゾン社債	1.200	100,000	100,918	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	206,370	2014/02/12
第7回 みずほコーポレート銀行社債	2.080	100,000	107,851	2017/07/27
第11回 みずほコーポレート銀行社債	1.110	200,000	202,104	2013/01/25
第13回 みずほコーポレート銀行社債	1.390	200,000	203,816	2013/07/19
第14回 みずほコーポレート銀行社債	1.520	100,000	102,567	2013/12/10
第15回 みずほコーポレート銀行社債	1.325	200,000	204,676	2014/02/27
第18回 みずほコーポレート銀行社債	0.830	200,000	202,716	2014/10/16
第20回 みずほコーポレート銀行社債	0.710	200,000	202,022	2015/04/20
第100回 三菱東京UFJ銀行社債	1.370	200,000	203,886	2013/07/16
第106回 三菱東京UFJ銀行社債	0.905	300,000	304,884	2014/07/17
第112回 三菱東京UFJ銀行社債	0.660	200,000	201,982	2015/01/26
第114回 三菱東京UFJ銀行社債	0.670	200,000	202,080	2015/04/17
第3回2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	1.300	200,000	202,754	2013/06/26
第6回 東京三菱銀行劣後社債	1.730	100,000	103,557	2014/12/22
第8回 東京三菱銀行劣後社債	1.640	200,000	207,168	2015/07/22
第12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.160	200,000	213,876	2017/07/28
第28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.560	200,000	202,128	2021/01/20
第11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.280	200,000	214,136	2016/10/31
第6回 りそな銀行劣後社債	2.084	100,000	103,550	2020/03/04
第4回 住友信託銀行劣後社債	1.670	100,000	103,020	2015/04/28
第7回 住友信託銀行劣後社債	1.950	100,000	104,927	2017/05/10
第5回 住友信託銀行劣後社債	2.250	100,000	105,946	2016/04/27
第45回 三井住友銀行社債	1.230	200,000	204,250	2014/01/20
第47回 三井住友銀行社債	0.910	200,000	203,266	2014/07/18
第51回 三井住友銀行社債	0.350	200,000	199,424	2015/10/20
第6回 三井住友銀行劣後社債	1.710	100,000	102,154	2013/08/01
第7回 三井住友銀行劣後社債	2.010	100,000	103,332	2014/02/05
第8回 三井住友銀行劣後社債	1.950	100,000	103,986	2014/10/22
第9回 三井住友銀行劣後社債	1.750	100,000	103,979	2015/08/17
第11回 三井住友銀行劣後社債	2.170	200,000	213,880	2017/12/20
第20回 三井住友銀行劣後社債	2.210	200,000	214,766	2019/07/24
第1回 みずほ銀行劣後特約付社債	1.700	100,000	102,958	2015/02/03
第6回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.250	100,000	106,194	2016/11/04
第10回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.060	100,000	105,552	2018/01/26
第14回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.140	100,000	105,645	2018/09/27
第38回 N T Tファイナンス社債	0.550	200,000	200,846	2015/06/19
第19回 トヨタファイナンス社債	2.040	100,000	106,813	2016/03/18
第23回 トヨタファイナンス社債	1.970	300,000	321,258	2016/09/20

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40回 トヨタファイナンス社債	1.478	100,000	103,084	2014/06/20
第118回 オリックス社債	2.180	100,000	103,906	2014/07/30
第144回 オリックス社債	1.510	100,000	100,854	2017/12/22
第8回 野村ホールディングス社債	2.120	100,000	105,851	2017/08/14
第9回 野村ホールディングス社債	1.390	100,000	101,036	2012/11/27
第15回 野村ホールディングス社債	2.010	100,000	103,692	2014/06/13
第17回 野村ホールディングス社債	1.280	200,000	203,710	2014/11/27
第20回 野村ホールディングス社債	0.980	100,000	100,891	2015/03/17
第22回 野村ホールディングス社債	0.937	200,000	201,322	2015/06/24
第24回 三井不動産社債	1.650	100,000	104,851	2015/12/18
第31回 三井不動産社債	1.645	100,000	103,752	2014/09/19
第60回 三菱地所社債	1.200	100,000	101,118	2012/12/10
第66回 三菱地所社債	0.785	100,000	100,846	2013/05/09
第79回 三菱地所社債	1.790	200,000	213,334	2017/03/17
第73回 住友不動産社債	0.960	100,000	101,028	2015/04/30
第41回 小田急電鉄社債	2.240	100,000	108,131	2016/08/08
第2回 東日本旅客鉄道社債	4.900	200,000	230,254	2015/02/25
第7回 東日本旅客鉄道社債	3.300	100,000	115,572	2017/08/25
第19回 東日本旅客鉄道社債	2.360	100,000	111,316	2022/02/25
第25回 東日本旅客鉄道社債	0.790	300,000	302,205	2013/03/19
第31回 東日本旅客鉄道社債	1.580	200,000	206,132	2014/03/19
第41回 東日本旅客鉄道社債	1.560	100,000	104,392	2015/09/18
第3回 西日本旅客鉄道社債	3.450	100,000	114,949	2016/12/20
第10回 西日本旅客鉄道社債	2.040	100,000	107,424	2023/09/20
第1回 東海旅客鉄道社債	4.650	100,000	110,239	2014/02/21
第2回 東海旅客鉄道社債	3.950	200,000	231,106	2016/04/25
第6回 東海旅客鉄道社債	2.390	100,000	111,619	2022/02/15
第10回 東海旅客鉄道社債	1.420	190,000	199,118	2017/09/20
第23回 東海旅客鉄道社債	2.140	100,000	109,442	2018/04/25
第3回 東京地下鉄社債	1.900	100,000	106,826	2016/09/20
第48回 日本電信電話社債	1.610	400,000	414,952	2014/09/19
第50回 日本電信電話社債	1.580	100,000	104,510	2015/09/18
第51回 日本電信電話社債	2.060	200,000	214,630	2016/06/20
第58回 日本電信電話社債	1.000	100,000	101,824	2014/06/20
第5回 KDDI社債	3.200	100,000	114,122	2017/04/28
第16回 NTTドコモ社債	1.260	200,000	204,334	2013/12/20
第18回 NTTドコモ社債	1.000	200,000	202,204	2013/03/27
第455回 東京電力社債	2.075	200,000	135,700	2018/10/23
第511回 東京電力社債	1.615	100,000	85,626	2014/05/28
第516回 東京電力社債	1.420	100,000	78,623	2015/04/27
第519回 東京電力社債	1.590	372,000	282,489	2015/12/28
第542回 東京電力社債	1.602	500,000	337,235	2018/04/25
第407回 中部電力社債	3.400	100,000	110,120	2015/07/24
第409回 中部電力社債	3.900	300,000	343,275	2016/06/24
第463回 中部電力社債	0.820	200,000	201,050	2013/04/25
第467回 中部電力社債	1.540	100,000	102,855	2014/12/25
第468回 中部電力社債	1.430	100,000	102,590	2015/02/25
第471回 中部電力社債	1.310	300,000	306,930	2015/06/25
第476回 中部電力社債	2.120	100,000	107,337	2018/06/25
第478回 中部電力社債	1.890	100,000	105,339	2016/09/23
第480回 中部電力社債	1.790	200,000	210,044	2017/01/25
第484回 中部電力社債	1.410	200,000	204,670	2014/09/25
第487回 中部電力社債	1.209	140,000	141,904	2013/11/25
第496回 中部電力社債	1.227	500,000	498,100	2020/07/24
第410回 関西電力社債	2.000	300,000	319,557	2018/11/22
第427回 関西電力社債	1.500	100,000	101,661	2013/06/25
第433回 関西電力社債	1.300	200,000	204,192	2014/11/25
第441回 関西電力社債	1.460	200,000	205,628	2015/04/24
第446回 関西電力社債	1.780	200,000	209,100	2016/03/18
第298回 中国電力社債	4.100	200,000	224,538	2015/05/25

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310回 中国電力社債	3.225	200,000	226,626	2017/07/25
第341回 中国電力社債	1.550	100,000	102,579	2014/06/25
第350回 中国電力社債	1.570	200,000	205,746	2014/10/24
第245回 北陸電力社債	3.800	200,000	222,848	2015/06/25
第260回 北陸電力社債	2.330	100,000	108,866	2020/05/25
第281回 北陸電力社債	1.970	200,000	212,746	2018/04/25
第289回 北陸電力社債	1.410	300,000	307,347	2014/12/25
第368回 東北電力社債	4.800	300,000	331,368	2014/04/25
第375回 東北電力社債	3.700	100,000	110,842	2015/06/25
第380回 東北電力社債	3.550	300,000	340,476	2016/11/25
第420回 東北電力社債	1.360	100,000	101,730	2014/02/25
第427回 東北電力社債	1.430	200,000	205,260	2015/09/25
第432回 東北電力社債	2.090	500,000	528,825	2016/05/25
第237回 四国電力社債	2.050	100,000	106,992	2018/11/22
第257回 四国電力社債	1.390	200,000	204,984	2015/02/25
第374回 九州電力社債	1.500	300,000	305,565	2013/09/25
第382回 九州電力社債	1.440	100,000	102,657	2015/02/25
第383回 九州電力社債	1.460	100,000	102,814	2015/04/24
第387回 九州電力社債	1.690	200,000	208,362	2016/03/25
第257回 北海道電力社債	3.850	200,000	227,586	2016/04/25
第282回 北海道電力社債	1.440	200,000	203,850	2013/12/25
第284回 北海道電力社債	1.480	500,000	516,105	2016/02/25
第286回 北海道電力社債	1.530	100,000	102,754	2014/10/24
第2回 電源開発社債	1.610	100,000	101,850	2013/06/20
第4回 電源開発社債	1.320	200,000	203,136	2013/12/20
第6回 電源開発社債	1.550	100,000	102,641	2014/09/19
第14回 電源開発社債	1.560	100,000	103,221	2015/09/18
第17回 電源開発社債	2.070	100,000	105,871	2016/06/20
第14回 東京ガス社債	5.100	100,000	113,203	2014/07/25
第24回 東京瓦斯社債	1.410	200,000	204,784	2013/12/02
第9回 大阪ガス社債	2.900	100,000	113,965	2018/01/30
第24回 大阪瓦斯社債	1.590	100,000	103,767	2014/10/24
第27回 大阪瓦斯社債	1.199	100,000	101,931	2013/11/27
第20回 NTTデータ社債	1.100	100,000	101,386	2013/06/20
小計	—	27,602,000	28,337,927	—
合計	—	386,324,482	403,679,072	—

## ■投資信託財産の構成

2011年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千円 6,234,593	% 99.5
コール・ローン等、その他	29,443	0.5
投資信託財産総額	6,264,036	100.0

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2011年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	6,264,036,898円
コール・ローン等	16,293,522
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	6,234,593,376
未 収 入 金	13,150,000
(B) 負 債	29,293,918
未 払 解 約 金	13,069,948
未 払 信 託 報 酬	16,147,362
そ の 他 未 払 費 用	76,608
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	6,234,742,980
元 本	5,974,618,965
次 期 繰 越 損 益 金	260,124,015
(D) 受 益 権 総 口 数	5,974,618,965口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	10,435円

<注記事項>

期首元本額	3,034,441,438円
期中追加設定元本額	3,689,799,196円
期中一部解約元本額	749,621,669円

## ■損益の状況

当期 自2010年10月13日 至2011年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,168円
受 取 利 息	2,168
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	81,869,158
売 買 益	85,855,371
売 買 損	△ 3,986,213
(C) 信 託 報 酬 等	△ 25,394,818
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	56,476,508
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	67,551,091
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	136,096,416
(配 当 等 相 当 額)	( 122,466,234)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 13,630,182)
(G) 計 (D + E + F)	260,124,015
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	260,124,015
追 加 信 託 差 損 益 金	136,096,416
(配 当 等 相 当 額)	( 122,466,234)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 13,630,182)
分 配 準 備 積 立 金	124,027,599

(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

計算期間末における費用控除後の配当等収益(46,634,652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(9,841,856円)、信託約款に規定される収益調整金(136,096,416円)及び分配準備積立金(67,551,091円)より分配対象収益は260,124,015円(1万口当たり435.38円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、運用実績等を勘案して無分配とさせていただきました。

# 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8期（決算日 2011年2月14日）

（計算期間 2010年2月16日～2011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国内債券パッシブ・ファンド」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8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"> <li>・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。</li> <li>・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。</li> <li>・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。</li> </ul>

### ■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				
4期(2007年2月14日)	10,172	0.8	300.18	0.8	98.9	—	—	150,781
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

(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) 2010年 2月 15日	円 10,931	% —	ポイント 322.75	% —	% 99.0	% —	% —
2月 末	10,949	0.2	323.28	0.2	99.4	—	—
3月 末	10,927	△0.0	322.69	△0.0	99.6	—	—
4月 末	11,018	0.8	325.44	0.8	99.5	—	—
5月 末	11,049	1.1	326.27	1.1	99.4	—	—
6月 末	11,174	2.2	329.97	2.2	99.4	—	—
7月 末	11,209	2.5	331.02	2.6	99.4	—	—
8月 末	11,282	3.2	333.17	3.2	99.5	—	—
9月 末	11,292	3.3	333.51	3.3	99.7	—	—
10月 末	11,255	3.0	332.38	3.0	99.5	—	—
11月 末	11,131	1.8	328.76	1.9	99.5	—	—
12月 末	11,201	2.5	330.80	2.5	99.5	—	—
2011年 1月 末	11,140	1.9	329.03	1.9	99.5	—	—
(期末) 2011年 2月 14日	11,081	1.4	327.28	1.4	99.4	—	—

(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 (2010年2月16日から2011年2月14日まで)



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2010. 2. 15	2010. 10. 6	2010. 2. 22	2011. 2. 14
10,931円	11,337円	10,923円	11,081円

## 《投資環境》

当期の長期金利（10年国債利回り）は、0.8%台前半から1.4%程度の範囲で推移し、前期末の1.32%から1.30%に小幅に低下（債券価格は上昇）しました。債券の残存期間別では、期間が10年程度未満の債券は利回りが上昇（価格は下落）し、10年程度以上では利回りが低下（価格は上昇）する結果となりました。

期初から2010年4月下旬までは、長期金利は概ね1.3%台での揉み合いとなりました。4月下旬以降は、ギリシャをはじめとする南欧諸国の財政問題の深刻化によりリスク回避の動きが強まり、長期金利は低下基調となりました。6月以降も、世界的に景気回復の鈍化懸念が高まったことや、日米で追加の金融緩和観測が強まってきたことなどから、長期金利の低下基調が続きました。9月上旬にかけて債券は一旦下落（金利は上昇）する局面もありましたが、

### 〈NOMURA-BPI総合の推移〉



10月上旬には日銀による追加金融緩和を受けて長期金利は一段と低下し、一時約7年ぶりの低水準となる0.82%を記録しました。その後は、米国で長期金利が上昇したことや、これまでの急速な金利低下に対する警戒感などから、長期金利は上昇に転じました。12月中旬に長期金利は一時1.3%近くまで上昇した後、12月末にかけては一旦1.1%近辺まで低下しましたが、2011年に入って以降は、米国での良好な経済指標の発表を受けた景況感の改善などから、株高・債券安の展開となり、長期金利は1.3%台まで上昇して期末を迎えました。

### 《運用経過》

#### 基準価額の推移

当期末の基準価額は11,081円となり、前期末に比べ1.37%上昇しました。

#### 基準価額の騰落要因

期間：期初～2010年10月上旬

[上昇要因] ギリシャをはじめとする南欧諸国の財政問題の深刻化によるリスク回避の動きや、日銀による追加金融緩和等により、金利が低下したこと。

期間：2010年10月上旬～期末

[下落要因] 海外で長期金利が上昇したことや、景況感の改善から株式市場が上昇したことなどを受けて、金利が上昇したこと。

#### ベンチマークの推移

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、1.40%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▲0.03%と、ベンチマークに概ね連動した運用成果となりました。

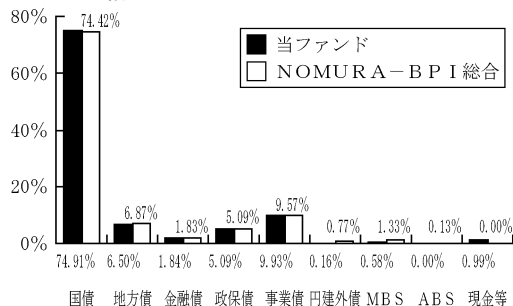
### 《今後の運用方針》

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。

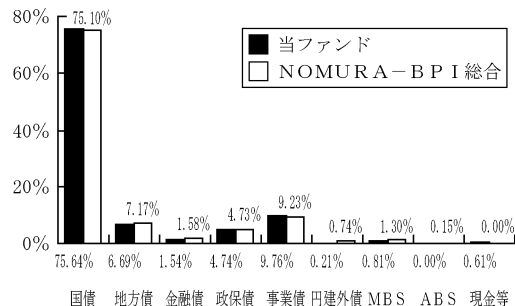
【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】 (注) 組入比率は純資産総額比です。

期首 (前期末)

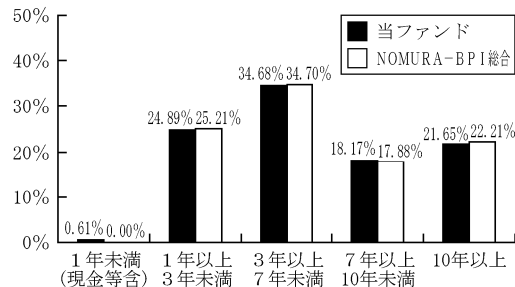
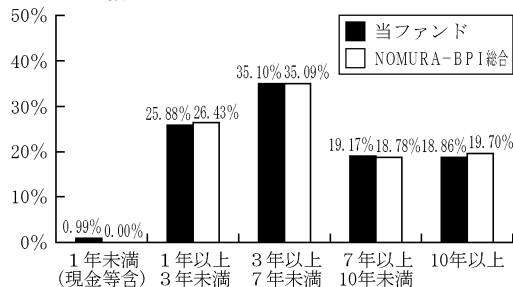
セクター別構成比



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（2010年2月16日から2011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	120,087,543	118,321,975
	地 方 債 証 券	4,121,460	3,264,281
	特 殊 債 券	5,466,253	6,477,162 ( 376,871)
	社 債 券	5,052,892	5,723,684

(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（2010年2月16日から2011年2月14日まで）

### 国内公社債

買 付		売 付		
銘	柄	銘	柄	
	金 額		金 額	
	千円		千円	
第305回	利付国庫債券（10年）	6,979,605	第 60 回 利付国庫債券（5年）	6,371,939
第310回	利付国庫債券（10年）	6,925,190	第 61 回 利付国庫債券（5年）	6,367,977
第306回	利付国庫債券（10年）	6,314,214	第 57 回 利付国庫債券（5年）	5,065,800
第 92 回	利付国庫債券（5年）	5,968,320	第 54 回 利付国庫債券（5年）	3,939,819
第 89 回	利付国庫債券（5年）	5,533,885	第286回 利付国庫債券（2年）	3,708,494
第 88 回	利付国庫債券（5年）	5,524,435	第303回 利付国庫債券（10年）	3,668,740
第 87 回	利付国庫債券（5年）	4,998,860	第280回 利付国庫債券（2年）	3,308,844
第 70 回	利付国庫債券（5年）	3,758,076	第289回 利付国庫債券（2年）	3,201,632
第309回	利付国庫債券（10年）	3,534,240	第 70 回 利付国庫債券（5年）	3,147,382
第289回	利付国庫債券（2年）	3,203,120	第282回 利付国庫債券（2年）	3,105,557

(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（2010年2月16日から2011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	316,310,000	323,593,220	75.6	—	43.2	20.5	11.9	
地方債証券	27,688,310	28,627,259	6.7	—	2.7	3.7	0.3	
特殊債証券 (除く金融債)	31,778,156	32,864,036	7.7	—	4.0	3.3	0.4	
金融債証券	6,470,000	6,577,115	1.5	—	—	1.1	0.4	
普通社債証券	32,221,000	33,541,471	7.9	—	2.2	4.3	1.4	
合計	414,467,466	425,203,104	99.4	—	52.1	32.9	14.4	

（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291回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,500,000	2,500,425	2012/04/15
第292回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,000,120	2012/05/15
第294回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,200,000	2,200,000	2012/07/15
第295回 利付国庫債券(2年)	0.200	3,000,000	2,999,760	2012/08/15
第296回 利付国庫債券(2年)	0.100	2,500,000	2,495,675	2012/09/15
第297回 利付国庫債券(2年)	0.100	3,000,000	2,994,300	2012/10/15
第298回 利付国庫債券(2年)	0.100	2,000,000	1,995,820	2012/11/15
第299回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	1,999,080	2012/12/15
第63回 利付国庫債券(5年)	1.200	7,500,000	7,583,175	2012/03/20
第64回 利付国庫債券(5年)	1.500	7,200,000	7,325,280	2012/06/20
第66回 利付国庫債券(5年)	1.100	5,700,000	5,780,313	2012/09/20
第68回 利付国庫債券(5年)	1.100	2,000,000	2,032,020	2012/12/20
第69回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,800,000	3,846,930	2012/12/20
第70回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,900,000	4,955,860	2013/03/20
第72回 利付国庫債券(5年)	1.500	4,900,000	5,038,180	2013/06/20
第75回 利付国庫債券(5年)	1.100	5,300,000	5,407,537	2013/09/20
第78回 利付国庫債券(5年)	0.900	4,000,000	4,062,960	2013/12/20
第81回 利付国庫債券(5年)	0.800	6,200,000	6,279,360	2014/03/20
第83回 利付国庫債券(5年)	0.900	4,400,000	4,470,224	2014/06/20
第85回 利付国庫債券(5年)	0.700	5,200,000	5,245,864	2014/09/20
第87回 利付国庫債券(5年)	0.500	5,000,000	5,002,800	2014/12/20
第88回 利付国庫債券(5年)	0.500	5,500,000	5,497,745	2015/03/20

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89回 利付国庫債券(5年)	0.400	5,500,000	5,467,330	2015/06/20
第91回 利付国庫債券(5年)	0.400	1,700,000	1,687,437	2015/09/20
第92回 利付国庫債券(5年)	0.300	5,000,000	4,940,700	2015/09/20
第93回 利付国庫債券(5年)	0.500	1,500,000	1,494,000	2015/12/20
第2回 利付国庫債券(40年)	2.200	600,000	589,614	2049/03/20
第3回 利付国庫債券(40年)	2.200	700,000	687,001	2050/03/20
第237回 利付国庫債券(10年)	1.500	1,540,000	1,562,083	2012/03/20
第240回 利付国庫債券(10年)	1.300	300,000	304,419	2012/06/20
第243回 利付国庫債券(10年)	1.100	1,400,000	1,419,726	2012/09/20
第246回 利付国庫債券(10年)	0.800	1,900,000	1,919,817	2012/12/20
第247回 利付国庫債券(10年)	0.800	700,000	707,910	2013/03/20
第250回 利付国庫債券(10年)	0.500	2,060,000	2,070,279	2013/06/20
第254回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,700,000	2,775,573	2013/09/20
第256回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,500,000	2,574,125	2013/12/20
第258回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,000,000	1,028,050	2014/03/20
第260回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,800,000	2,909,676	2014/06/20
第263回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,700,000	2,810,160	2014/09/20
第266回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,700,000	3,828,279	2014/12/20
第269回 利付国庫債券(10年)	1.300	2,000,000	2,064,040	2015/03/20
第270回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,900,000	1,962,016	2015/06/20
第272回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,800,000	2,906,512	2015/09/20
第274回 利付国庫債券(10年)	1.500	2,400,000	2,505,072	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277回 利付国庫債券 (10年)	1.600	2,500,000	2,624,650	2016/03/20
第280回 利付国庫債券 (10年)	1.900	2,800,000	2,985,136	2016/06/20
第282回 利付国庫債券 (10年)	1.700	3,100,000	3,274,654	2016/09/20
第284回 利付国庫債券 (10年)	1.700	3,100,000	3,275,708	2016/12/20
第285回 利付国庫債券 (10年)	1.700	5,600,000	5,916,456	2017/03/20
第286回 利付国庫債券 (10年)	1.800	4,500,000	4,781,475	2017/06/20
第288回 利付国庫債券 (10年)	1.700	4,300,000	4,539,381	2017/09/20
第289回 利付国庫債券 (10年)	1.500	4,400,000	4,581,852	2017/12/20
第290回 利付国庫債券 (10年)	1.400	4,200,000	4,336,962	2018/03/20
第293回 利付国庫債券 (10年)	1.800	5,000,000	5,295,100	2018/06/20
第296回 利付国庫債券 (10年)	1.500	4,000,000	4,142,520	2018/09/20
第297回 利付国庫債券 (10年)	1.400	4,200,000	4,311,132	2018/12/20
第299回 利付国庫債券 (10年)	1.300	4,800,000	4,880,304	2019/03/20
第301回 利付国庫債券 (10年)	1.500	4,100,000	4,223,615	2019/06/20
第303回 利付国庫債券 (10年)	1.400	3,600,000	3,673,188	2019/09/20
第305回 利付国庫債券 (10年)	1.300	5,500,000	5,552,800	2019/12/20
第306回 利付国庫債券 (10年)	1.400	6,200,000	6,296,410	2020/03/20
第308回 利付国庫債券 (10年)	1.300	2,300,000	2,311,546	2020/06/20
第309回 利付国庫債券 (10年)	1.100	3,500,000	3,456,075	2020/06/20
第310回 利付国庫債券 (10年)	1.000	6,500,000	6,341,790	2020/09/20
第312回 利付国庫債券 (10年)	1.200	2,500,000	2,477,100	2020/12/20
第1回 利付国庫債券 (30年)	2.800	100,000	112,132	2029/09/20
第2回 利付国庫債券 (30年)	2.400	100,000	105,654	2030/02/20
第3回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	208,194	2030/05/20
第4回 利付国庫債券 (30年)	2.900	200,000	227,258	2030/11/20
第5回 利付国庫債券 (30年)	2.200	200,000	204,292	2031/05/20
第6回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	210,652	2031/11/20
第7回 利付国庫債券 (30年)	2.300	300,000	311,100	2032/05/20
第8回 利付国庫債券 (30年)	1.800	500,000	474,405	2032/11/22
第11回 利付国庫債券 (30年)	1.700	400,000	372,276	2033/06/20
第12回 利付国庫債券 (30年)	2.100	300,000	300,000	2033/09/20
第13回 利付国庫債券 (30年)	2.000	300,000	294,459	2033/12/20
第14回 利付国庫債券 (30年)	2.400	500,000	526,595	2034/03/20
第15回 利付国庫債券 (30年)	2.500	200,000	214,206	2034/06/20
第16回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	428,620	2034/09/20
第17回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	210,534	2034/12/20
第18回 利付国庫債券 (30年)	2.300	820,000	847,584	2035/03/20
第19回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	206,942	2035/06/20
第20回 利付国庫債券 (30年)	2.500	300,000	321,807	2035/09/20
第21回 利付国庫債券 (30年)	2.300	500,000	517,165	2035/12/20
第22回 利付国庫債券 (30年)	2.500	470,000	504,197	2036/03/20
第23回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	428,940	2036/06/20
第24回 利付国庫債券 (30年)	2.500	600,000	643,158	2036/09/20
第25回 利付国庫債券 (30年)	2.300	600,000	619,578	2036/12/20
第26回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,200,000	1,262,796	2037/03/20
第27回 利付国庫債券 (30年)	2.500	1,200,000	1,287,384	2037/09/20
第28回 利付国庫債券 (30年)	2.500	1,300,000	1,392,170	2038/03/20
第29回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,500,000	1,577,220	2038/09/20
第30回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,500,000	1,544,805	2039/03/20
第31回 利付国庫債券 (30年)	2.200	2,000,000	2,019,480	2039/09/20
第32回 利付国庫債券 (30年)	2.300	2,200,000	2,267,166	2040/03/20
第33回 利付国庫債券 (30年)	2.000	1,600,000	1,544,032	2040/09/20
第37回 利付国庫債券 (20年)	3.100	600,000	687,018	2017/09/20
第39回 利付国庫債券 (20年)	2.600	400,000	445,880	2018/03/20
第40回 利付国庫債券 (20年)	2.300	720,000	788,241	2018/09/20
第42回 利付国庫債券 (20年)	2.600	800,000	893,400	2019/03/20

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43回 利付国庫債券 (20年)	2.900	860,000	981,862	2019/09/20
第45回 利付国庫債券 (20年)	2.400	900,000	991,314	2020/03/20
第46回 利付国庫債券 (20年)	2.200	500,000	542,230	2020/06/22
第47回 利付国庫債券 (20年)	2.200	950,000	1,029,942	2020/09/21
第48回 利付国庫債券 (20年)	2.500	500,000	555,495	2020/12/21
第50回 利付国庫債券 (20年)	1.900	780,000	822,445	2021/03/22
第51回 利付国庫債券 (20年)	2.000	600,000	637,986	2021/06/21
第52回 利付国庫債券 (20年)	2.100	750,000	804,360	2021/09/21
第54回 利付国庫債券 (20年)	2.200	700,000	756,609	2021/12/20
第55回 利付国庫債券 (20年)	2.000	810,000	858,292	2022/03/21
第57回 利付国庫債券 (20年)	1.900	830,000	869,748	2022/06/20
第58回 利付国庫債券 (20年)	1.900	900,000	941,112	2022/09/20
第60回 利付国庫債券 (20年)	1.400	990,000	981,525	2022/12/20
第61回 利付国庫債券 (20年)	1.000	1,000,000	944,010	2023/03/20
第62回 利付国庫債券 (20年)	0.800	1,000,000	917,570	2023/06/20
第64回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,000,000	1,037,410	2023/09/20
第65回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,345,825	2023/12/20
第67回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,342,913	2024/03/20
第70回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,450,000	1,580,094	2024/06/20
第72回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,450,000	1,524,965	2024/09/20
第73回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,390,000	1,441,555	2024/12/20
第75回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,540,000	1,612,749	2025/03/20
第78回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,550,000	1,580,256	2025/06/20
第81回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,700,000	1,749,385	2025/09/20
第83回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,800,000	1,870,902	2025/12/20
第85回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,750,000	1,813,350	2026/03/20
第88回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,900,000	2,015,387	2026/06/20
第90回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,900,000	1,986,469	2026/09/20
第92回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,700,000	1,750,983	2026/12/20
第93回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,000,000	1,014,190	2027/03/20
第94回 利付国庫債券 (20年)	2.100	800,000	822,240	2027/03/20
第95回 利付国庫債券 (20年)	2.300	2,000,000	2,107,600	2027/06/20
第97回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,800,000	1,866,924	2027/09/20
第99回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,800,000	1,838,880	2027/12/20
第100回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,000,000	2,069,380	2028/03/20
第102回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,900,000	2,015,995	2028/06/20
第105回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,100,000	2,134,251	2028/09/20
第107回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,030,280	2028/12/20
第109回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,200,000	2,163,590	2029/03/20
第111回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,500,000	2,568,800	2029/06/20
第113回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,400,000	2,425,944	2029/09/20
第114回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,500,000	2,523,825	2029/12/20
第116回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,600,000	2,662,608	2030/03/20
第118回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,400,000	1,388,380	2030/06/20
第119回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,500,000	1,440,090	2030/06/20
第121回 利付国庫債券 (20年)	1.900	3,100,000	3,022,314	2030/09/20
第123回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,000,000	1,066,340	2030/12/20
小計	—	316,310,000	323,593,220	—
(地方債証券)				
第602回 東京都公債	1.400	148,000	151,994	2013/10/25
第611回 東京都公債	1.830	200,000	208,922	2014/06/20
第612回 東京都公債	1.710	161,500	168,066	2014/06/20
第614回 東京都公債	1.480	200,000	206,846	2014/09/19
第616回 東京都公債	1.410	100,000	103,295	2014/12/19
第617回 東京都公債	1.400	200,000	206,476	2014/12/19
第619回 東京都公債	1.530	200,000	207,720	2015/03/20

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620回 東京都公債券	1.350	200,000	206,280	2015/03/20
第622回 東京都公債券	1.280	106,800	109,943	2015/06/19
第623回 東京都公債券	1.310	200,000	206,140	2015/06/19
第627回 東京都公債券	1.520	100,000	104,064	2015/09/18
第628回 東京都公債券	1.590	100,000	104,509	2015/12/18
第629回 東京都公債券	1.450	494,000	512,905	2015/12/18
第632回 東京都公債券	2.000	115,300	122,997	2016/03/18
第633回 東京都公債券	1.970	100,000	106,528	2016/03/18
第634回 東京都公債券	1.860	200,000	212,170	2016/06/20
第638回 東京都公債券	1.900	200,000	212,754	2016/09/20
第640回 東京都公債券	1.790	150,000	158,736	2016/12/20
第641回 東京都公債券	1.820	100,000	105,992	2016/12/20
第659回 東京都公債券	1.620	203,500	211,994	2018/06/20
第664回 東京都公債券	1.400	300,000	306,501	2018/12/20
第667回 東京都公債券	1.570	300,000	309,789	2019/03/20
第680回 東京都公債券	1.390	200,000	201,956	2020/03/19
第685回 東京都公債券	1.130	500,000	492,505	2020/06/19
15年度2回 北海道公債券	1.100	203,000	206,040	2013/07/29
16年度11回 北海道公債券	1.300	250,000	256,080	2015/05/25
18年度4回 北海道公債券	2.000	190,500	202,221	2016/06/30
18年度6回 北海道公債券	2.100	100,000	106,757	2016/08/31
19年度4回 北海道公債券	1.980	300,000	318,654	2017/06/29
21年度6回 北海道公債券	1.600	200,000	204,346	2019/08/28
第118回 神奈川県公債券	1.100	145,090	147,145	2012/11/22
第125回 神奈川県公債券	1.400	100,000	102,910	2014/03/31
第126回 神奈川県公債券	1.500	178,870	184,686	2014/04/30
第127回 神奈川県公債券	1.800	100,000	104,414	2014/07/30
第128回 神奈川県公債券	1.500	100,000	103,467	2014/09/30
第130回 神奈川県公債券	1.400	156,200	161,273	2015/01/28
第135回 神奈川県公債券	1.600	200,000	208,858	2015/10/28
第136回 神奈川県公債券	1.500	100,000	104,035	2015/12/28
第166回 神奈川県公債券	1.360	300,000	303,327	2019/09/20
第251回 大阪府公債券	1.100	110,100	111,498	2012/11/20
第252回 大阪府公債券	0.800	100,000	100,790	2013/01/30
第261回 大阪府公債券	1.500	129,000	132,599	2013/12/25
第278回 大阪府公債券	1.300	200,000	205,162	2015/05/29
第285回 大阪府公債券	1.500	100,000	103,589	2015/12/25
第286回 大阪府公債券	1.500	200,000	207,218	2016/01/29
第289回 大阪府公債券	1.800	200,000	210,348	2016/04/27
第293回 大阪府公債券	2.100	200,000	213,734	2016/08/30
第301回 大阪府公債券	1.830	100,000	105,456	2017/04/26
第310回 大阪府公債券	1.620	240,000	249,024	2018/01/30
第336回 大阪府公債券	1.460	200,000	201,376	2020/03/30
第1回 大阪府公債券 7年	1.800	500,000	516,685	2013/08/28
15年度3回 京都府公債券	1.500	219,300	225,986	2013/12/24
16年度2回 京都府公債券	1.500	100,000	103,470	2014/09/24
18年度12回 京都府公債券	1.700	100,000	105,237	2016/12/22
14年度5回 兵庫県公債券	0.800	100,000	100,843	2013/02/27
15年度1回 兵庫県公債券	0.700	100,000	100,627	2013/04/25
16年度4回 兵庫県公債券	1.600	251,970	260,491	2014/05/27
16年度8回 兵庫県公債券	1.900	111,500	116,605	2014/08/25
17年度2回 兵庫県公債券	1.400	200,000	206,086	2015/04/27
17年度9回 兵庫県公債券	1.600	306,000	318,692	2015/11/30
17年度13回 兵庫県公債券	1.700	105,000	110,010	2016/03/23
18年度1回 兵庫県公債券	1.800	120,000	126,334	2016/04/27
14年度3回 静岡県公債券	1.300	147,610	150,117	2012/10/24

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	
15年度1回 静岡県公債券	0.500	268,500	269,375	2013/06/27
15年度3回 静岡県公債券	1.400	116,130	119,242	2013/10/28
18年度5回 静岡県公債券	1.850	129,800	137,673	2016/10/26
21年度5回 静岡県公債券	1.350	197,000	198,904	2019/10/18
15年度1回 愛知県公債券	1.400	303,600	311,736	2013/10/28
16年度2回 愛知県公債券	1.600	200,000	207,762	2014/10/27
18年度2回 愛知県公債券	2.000	160,300	171,117	2016/06/27
20年度4回 愛知県公債券	1.600	100,000	103,760	2018/09/25
22年度6回 愛知県公債券	1.178	200,000	197,398	2020/07/30
16年度2回 広島県公債券	1.500	200,000	207,338	2015/03/25
14年度2回 埼玉県公債券	1.300	100,000	101,471	2012/07/25
15年度3回 埼玉県公債券	1.600	100,000	103,135	2013/09/26
17年度2回 埼玉県公債券	1.300	200,000	205,926	2015/05/27
18年度1回 埼玉県公債券	1.800	200,000	211,298	2016/04/27
21年度4回 埼玉県公債券	1.460	440,000	448,918	2019/07/29
16年度3回 福岡県公債券	1.300	131,040	134,804	2015/02/24
17年度1回 福岡県公債券	1.400	100,000	103,458	2015/08/26
17年度5回 福岡県公債券	1.500	100,000	104,077	2016/01/27
18年度1回 福岡県公債券	2.100	104,000	111,674	2016/08/30
21年度3回 福岡県公債券	1.550	200,000	205,388	2019/08/27
15年度4回 千葉県公債券	1.400	100,000	102,818	2014/01/24
16年度3回 千葉県公債券	1.900	100,000	104,814	2014/08/25
16年度8回 千葉県公債券	1.300	200,000	205,750	2015/02/25
17年度2回 千葉県公債券	1.300	200,000	205,946	2015/06/25
19年度5回 千葉県公債券	1.850	300,000	318,084	2017/10/25
21年度6回 千葉県公債券	1.410	200,000	203,004	2019/09/25
18年度2回 新潟県公債券	1.870	169,000	179,202	2016/11/29
第2回 共同発行市場公募地方債	0.600	100,000	100,561	2013/05/24
第3回 共同発行市場公募地方債	0.500	100,000	100,326	2013/06/25
第8回 共同発行市場公募地方債	1.600	400,000	413,120	2013/11/25
第9回 共同発行市場公募地方債	1.500	210,000	216,409	2013/12/25
第11回 共同発行市場公募地方債	1.300	300,000	307,668	2014/02/25
第12回 共同発行市場公募地方債	1.400	130,000	133,762	2014/03/25
第13回 共同発行市場公募地方債	1.500	221,000	228,193	2014/04/25
第18回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	103,827	2014/09/25
第19回 共同発行市場公募地方債	1.600	130,000	135,033	2014/10/24
第20回 共同発行市場公募地方債	1.500	100,000	103,554	2014/11/25
第21回 共同発行市場公募地方債	1.400	300,000	309,636	2014/12/25
第23回 共同発行市場公募地方債	1.300	100,000	102,875	2015/02/25
第25回 共同発行市場公募地方債	1.400	304,000	314,129	2015/04/24
第28回 共同発行市場公募地方債	1.300	200,000	206,006	2015/07/24
第29回 共同発行市場公募地方債	1.400	200,000	206,912	2015/08/25
第31回 共同発行市場公募地方債	1.500	200,000	207,922	2015/10/23
第32回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	208,950	2015/11/25
第33回 共同発行市場公募地方債	1.600	300,000	313,500	2015/12/25
第35回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	209,204	2016/02/25
第36回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	104,619	2016/03/25
第37回 共同発行市場公募地方債	1.800	150,000	158,464	2016/04/25
第38回 共同発行市場公募地方債	2.000	170,000	181,424	2016/05/25
第39回 共同発行市場公募地方債	1.900	146,000	155,084	2016/06/24
第40回 共同発行市場公募地方債	2.100	150,000	161,005	2016/07/25
第47回 共同発行市場公募地方債	1.800	161,600	171,039	2017/02/24
第55回 共同発行市場公募地方債	1.850	200,000	212,056	2017/10/25
第57回 共同発行市場公募地方債	1.650	200,000	209,274	2017/12/25
第61回 共同発行市場公募地方債	1.550	300,000	311,283	2018/04/25
第65回 共同発行市場公募地方債	1.620	100,000	103,970	2018/08/24

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75回 共同発行市場公募地方債	1.640	500,000	517,695	2019/06/25
第80回 共同発行市場公募地方債	1.540	700,000	717,157	2019/11/25
14年度3回 大阪市公募債	1.300	146,500	148,426	2012/07/18
14年度6回 大阪市公募債	1.300	116,800	118,574	2012/10/17
17年度3回 大阪市公募債	1.300	100,000	102,500	2015/07/28
17年度7回 大阪市公募債	1.400	200,000	205,944	2015/09/29
17年度8回 大阪市公募債	1.600	200,000	207,808	2015/10/27
17年度11回 大阪市公募債	1.600	100,000	104,041	2016/02/23
18年度2回 大阪市公募債	2.000	100,000	106,157	2016/06/22
18年度3回 大阪市公募債	2.100	150,000	160,093	2016/07/27
19年度5回 大阪市公募債	1.990	135,000	143,457	2017/07/19
第12回さ号 名古屋市公募債	0.600	100,000	100,564	2013/05/28
第12回心号 名古屋市公募債	1.300	200,000	205,996	2015/07/21
第12回せ号 名古屋市公募債	1.400	359,500	372,007	2015/09/28
17年度1回 京都市公募債	1.400	100,000	103,320	2015/08/25
18年度3回 京都市公募債	1.900	101,700	108,047	2017/02/27
16年度5回 神戸市公募債	1.400	200,000	205,954	2014/12/24
17年度13回 神戸市公募債	1.600	103,000	107,421	2016/02/23
14年度3回 横浜市公募債	1.000	153,500	155,472	2012/12/20
14年度5回 横浜市公募債	0.800	281,100	283,818	2013/02/28
15年度5回 横浜市公募債	1.300	200,000	205,112	2014/02/25
16年度1回 横浜市公募債	1.600	200,000	207,016	2014/03/20
17年度1回 横浜市公募債	1.300	300,000	308,634	2015/03/20
14年度5回 札幌市公募債	0.800	106,000	106,982	2013/01/30
14年度7回 札幌市公募債	0.700	100,000	100,758	2013/04/24
16年度7回 札幌市公募債	1.500	100,000	103,669	2015/03/25
第2回 川崎市公募債 15年	1.630	100,000	102,709	2020/06/22
第19回 川崎市公募債 5年	1.410	100,000	102,429	2013/06/20
14年度2回 北九州市公募債	1.000	100,000	101,229	2012/12/20
14年度1回 福岡市公募債	1.300	200,000	203,294	2012/10/14
18年度4回 福岡市公募債	1.800	100,000	105,622	2016/10/27
16年度1回 広島市公募債	1.400	100,000	103,055	2014/12/24
16年度2回 千葉市公募債	1.400	100,000	103,127	2015/01/27
小計	—	27,688,310	28,627,259	—
(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	106,637	2014/08/27
第13回 政保日本政策投資銀行債券	2.000	121,000	129,402	2016/08/25
第16回 日本政策投資銀行債券	1.520	100,000	103,309	2014/09/19
第7回 日本政策投資銀行債券	0.780	200,000	201,632	2013/03/19
第9回 日本政策投資銀行債券	1.580	100,000	102,918	2013/09/20
第13回 日本政策投資銀行債券	1.590	100,000	103,288	2014/03/20
第27回 日本政策投資銀行債券	1.980	200,000	212,756	2016/09/20
第46回 日本政策投資銀行債券	1.690	200,000	208,588	2018/03/20
第12回 日本道路・機構承継債	1.330	100,000	101,779	2012/12/20
第34回 日本道路・機構承継債	1.630	200,000	207,336	2014/09/22
第314回 政保道路債	1.000	200,000	202,682	2012/12/20
第315回 政保道路債	0.700	300,000	302,538	2013/04/25
第319回 政保道路債	0.900	132,000	133,820	2013/08/22
第322回 政保道路債	1.500	106,000	109,270	2013/11/28
第323回 政保道路債	1.500	200,000	206,248	2013/12/20
第324回 政保道路債	1.400	200,000	205,816	2014/01/24
第328回 政保道路債	1.500	200,000	206,792	2014/05/28
第329回 政保道路債	1.600	100,000	103,776	2014/06/27
第333回 政保道路債	1.600	300,000	311,991	2014/10/28
第335回 政保道路債	1.400	237,000	244,884	2014/12/24
第338回 政保道路債	1.500	264,000	274,140	2015/03/27

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333回 政保道路債	1.400	301,000	311,438	2015/04/28
第342回 政保道路債	0.800	100,000	100,733	2012/05/31
第15回 高速道路機構債	2.500	400,000	427,012	2016/09/20
第25回 高速道路機構債	1.820	300,000	316,203	2017/09/20
第35回 高速道路機構債	1.650	400,000	416,120	2018/03/20
第48回 高速道路機構債	1.710	700,000	726,068	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	312,696	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	218,944	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	113,153	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	104,983	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	321,958	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	130,565	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	105,949	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	397,406	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	316,284	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	206,510	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	316,293	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	313,138	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	366,848	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	352,756	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	207,680	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	205,842	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	167,250	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	416,715	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	613,914	2018/12/25
第82回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	100,000	102,670	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	302,529	2019/09/30
第16回 日本道路・機構承継債	0.980	430,000	435,297	2013/03/20
第26回 日本道路・機構承継債	1.680	200,000	206,768	2013/12/20
第41回 日本道路・機構承継債	1.520	300,000	310,467	2015/03/20
第5回 公営企業債券	0.770	100,000	100,882	2013/03/22
第818回 政保公営企業債券	1.300	107,000	108,709	2012/08/23
第821回 政保公営企業債券	1.100	405,000	410,989	2012/11/22
第823回 政保公営企業債券	0.800	200,000	202,028	2013/01/29
第824回 政保公営企業債券	0.800	300,000	303,111	2013/02/27
第828回 政保公営企業債券	0.500	210,000	210,833	2013/06/26
第829回 政保公営企業債券	1.100	400,000	407,336	2013/07/24
第832回 政保公営企業債券	1.400	298,000	306,197	2013/10/24
第834回 政保公営企業債券	1.500	207,000	213,522	2013/12/24
第837回 政保公営企業債券	1.400	432,000	444,968	2014/03/24
第838回 政保公営企業債券	1.500	600,000	620,112	2014/04/25
第839回 政保公営企業債券	1.500	260,000	268,814	2014/05/26
第843回 政保公営企業債券	1.500	100,000	103,575	2014/09/29
第847回 政保公営企業債券	1.400	200,000	206,732	2015/01/27
第848回 政保公営企業債券	1.300	200,000	205,990	2015/02/24
第849回 政保公営企業債券	1.500	261,000	270,978	2015/03/20
第852回 政保公営企業債券	1.300	300,000	309,336	2015/06/29
第853回 政保公営企業債券	1.200	204,000	209,471	2015/07/24
第854回 政保公営企業債券	1.400	304,000	314,877	2015/08/18
第856回 政保公営企業債券	1.500	200,000	208,192	2015/10/20
第859回 政保公営企業債券	1.500	207,000	215,739	2016/01/25
第862回 政保公営企業債券	1.800	239,000	252,895	2016/04/20
第863回 政保公営企業債券	2.000	200,000	213,726	2016/05/27
第867回 政保公営企業債券	1.800	200,000	211,854	2016/09/21
第868回 政保公営企業債券	1.800	101,000	107,012	2016/10/21
第869回 政保公営企業債券	1.800	102,000	108,099	2016/11/21

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875回 政保公営企業債券	1.700	482,000	508,032	2017/05/22
第8回 政保地方公営企業金融機構債券	1.500	651,000	668,720	2019/05/24
第3回 政保地方公共団体金融機構債券	1.500	101,000	103,565	2019/08/16
第5回 地方公共団体金融機構債券	1.395	500,000	505,635	2019/10/28
第8回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	300,000	301,650	2020/01/20
第10回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	500,000	502,050	2020/03/13
第15回 政保地方公共団体金融機構債券	1.000	200,000	194,810	2020/08/14
第6回 公営企業金融公庫債券	0.640	200,000	201,222	2013/03/22
第12回 公営企業金融公庫債券	1.530	300,000	310,509	2014/09/24
第14回 公営企業金融公庫債券	1.450	100,000	103,425	2015/03/24
第15回 公営企業金融公庫債券	1.330	300,000	309,072	2015/06/19
第17回 公営企業金融公庫債券	1.570	100,000	104,162	2015/09/24
第20回 公営企業金融公庫債券	2.050	200,000	213,800	2016/06/20
第24回 公営企業金融公庫債券	1.940	300,000	319,458	2016/12/20
第191回 政保首都高速道路債券	1.800	113,000	118,085	2014/07/29
第142回 政保阪神高速道路債	1.400	100,000	103,311	2014/12/17
第148回 政保阪神高速道路債	1.300	107,000	110,369	2015/09/30
第5回 阪神高速道路、機構承継債	1.790	100,000	103,897	2014/03/20
第176回 政保中小企業債券	1.600	100,000	103,185	2013/09/17
第180回 政保中小企業債券	1.800	142,000	148,354	2014/07/22
第186回 政保中小企業債券	1.300	104,000	107,270	2015/09/15
第26回 中小企業債券	1.990	400,000	414,772	2013/06/20
第15回 国際協力銀行債券	1.740	200,000	207,918	2016/06/20
第8回 国際協力銀行債券	0.650	300,000	301,701	2013/03/19
第12回 国際協力銀行債券	1.600	200,000	206,700	2014/03/20
第2回 都市再生債券	2.150	100,000	105,134	2014/06/20
第19回 都市再生機構債券	2.040	200,000	212,650	2018/03/20
第23回 都市再生機構債券	1.280	200,000	204,240	2013/11/25
第2回 本州四国連絡、機構承継債券	1.840	100,000	103,833	2013/12/20
第6回 政保中部国際空港債券	1.400	100,000	102,976	2014/03/26
第140回 政保預金保険機構債券	0.800	300,000	302,331	2012/07/12
第143回 政保預金保険機構債券	0.900	280,000	282,716	2012/08/15
第11回 住宅金融支援機構債券	1.660	200,000	208,444	2017/12/20
第37回 住宅金融支援機構債券	1.400	300,000	302,496	2019/09/20
第6回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.260	161,007	167,614	2037/05/10
第8回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.150	111,128	114,899	2037/05/10
第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.190	167,598	173,648	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	185,433	192,850	2037/11/10
第13回 貸付債権担保S種住宅金融支援機構債券	1.960	77,075	80,034	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	395,335	404,285	2032/05/10
第4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.820	108,708	111,124	2036/12/10
第43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.280	69,767	72,735	2041/06/10
第44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.300	278,228	289,660	2041/07/10
第51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.210	217,959	225,397	2042/02/10
第1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.130	373,430	386,481	2042/05/10
第29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.950	452,760	460,592	2044/10/10
第30回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.810	768,728	773,870	2045/05/10
第14回 政保国民生活債券	1.500	132,000	136,676	2014/09/17
第1回 政保東日本高速道路債券	1.600	101,000	105,641	2015/11/25
第2回 政保東日本高速道路債券	1.500	101,000	105,183	2015/12/21
第4回 政保中日本高速道路債券	1.600	170,000	178,068	2016/03/24
第8回 政保中日本高速道路債券	2.000	170,000	181,826	2016/08/12
第21回 政保中日本高速道路債券	1.700	300,000	314,757	2018/05/21
第5回 中日本高速道路債券	1.860	200,000	210,054	2018/09/20
第1回 政保西日本高速道路債券	1.600	201,000	210,237	2015/11/25
第5回 政保西日本高速道路債券	1.800	259,000	274,475	2017/01/25

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6回 政保西日本高速道路債券	1.800	117,000	123,986	2017/02/27
第2回 鉄道建設運輸施設債	1.920	300,000	313,653	2014/06/20
小計	—	31,778,156	32,864,036	—
(金融債券)				
683号 利附商工債	1.350	100,000	101,282	2012/04/27
685号 利附商工債	1.550	200,000	203,424	2012/06/27
691号 利附商工債	1.400	200,000	203,988	2012/12/27
692号 利附商工債	1.200	200,000	203,308	2013/01/25
704号 利附商工債	1.350	200,000	205,180	2014/01/27
706号 利付商工債	1.350	300,000	307,956	2014/03/27
723号 利付商工債	0.500	300,000	297,954	2015/08/27
684号 利附農林債	1.350	250,000	253,362	2012/05/25
688号 利附農林債	1.350	200,000	203,296	2012/09/27
694号 利附農林債	1.150	400,000	406,272	2013/03/27
695号 利附農林債	1.150	200,000	203,236	2013/04/26
698号 利附農林債	1.500	300,000	307,713	2013/07/26
701号 利附農林債	1.450	200,000	205,228	2013/10/25
709号 利附農林債	1.150	400,000	407,724	2014/06/27
713号 利附農林債	0.800	300,000	302,115	2014/10/27
717号 利附農林債	0.750	300,000	301,239	2015/02/27
721号 利附農林債	0.600	120,000	119,618	2015/06/26
第210回 利附信金中金債	1.350	100,000	101,358	2012/05/25
第215回 利附信金中金債	1.500	200,000	203,980	2012/10/26
第217回 利附信金中金債	1.350	200,000	203,764	2012/12/27
第222回 利附信金中金債	1.400	200,000	204,584	2013/05/27
第226回 利附信金中金債	1.350	300,000	307,155	2013/09/27
第229回 利附信金中金債	1.400	400,000	410,632	2013/12/27
第233回 利附信金中金債	1.350	300,000	307,962	2014/04/25
第236回 利附信金中金債	0.900	300,000	303,597	2014/07/25
第241回 利附信金中金債	0.700	300,000	301,188	2014/12/26
小計	—	6,470,000	6,577,115	—
(普通社債券)				
第345回 東京地下鉄社債	0.610	100,000	100,463	2013/06/20
第12回 GEキャピタル円貨債	1.545	100,000	100,517	2015/06/03
第14回 GEキャピタル円貨債	1.840	100,000	101,714	2015/11/20
第4回 ゴールドマン・サックス円貨債	1.980	100,000	103,144	2014/05/28
第15回 シティグループ円貨社債	1.110	100,000	100,310	2012/09/14
第22回 シティグループ円貨社債	2.130	200,000	205,654	2014/06/20
第3回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	1.790	100,000	101,590	2014/12/03
第7回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	1.785	100,000	101,336	2012/06/27
第2回 オーストラリア連邦保証オーストラリア・ニュージーランド銀行円貨社債	1.270	100,000	101,323	2012/08/24
第1回 キリンホールディングス社債	1.090	100,000	101,422	2013/03/19
第5回 日本たばこ産業社債	1.128	100,000	101,955	2014/06/03
第25回 住友化学工業社債	1.620	100,000	102,929	2013/11/12
第33回 住友化学社債	1.260	100,000	101,517	2012/12/06
第25回 三菱化学社債	1.800	100,000	102,644	2013/02/05
第34回 三井化学社債	1.840	100,000	104,465	2016/03/10
第2回 花王社債	1.910	100,000	103,405	2013/06/20
第19回 新日本石油社債	1.730	100,000	101,692	2012/05/22
第8回 旭硝子社債	0.670	100,000	100,499	2013/06/03
第48回 新日本製鐵社債	1.180	100,000	101,557	2013/02/13
第52回 新日本製鐵社債	1.670	100,000	103,453	2014/03/20
第11回 豊田自動織機社債	1.130	100,000	101,375	2012/12/20
第12回 日立製作所社債	0.720	100,000	100,494	2013/05/27
第7回 パナソニック社債	1.404	200,000	205,226	2014/03/20

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24回 シャープ社債	0.846	100,000	100,866	2014/09/16
第16回 ソニー社債	1.160	100,000	101,222	2012/09/20
第17回 ソニー社債	1.570	100,000	103,513	2015/06/19
第19回 ソニー社債	1.520	100,000	102,234	2013/03/19
第4回 デンソー社債	1.110	100,000	101,175	2012/09/20
第15回 三菱重工業社債	1.030	100,000	101,180	2013/01/31
第19回 三菱重工業社債	2.040	100,000	106,178	2016/09/07
第6回 トヨタ自動車社債	1.330	200,000	203,048	2012/09/20
第7回 トヨタ自動車社債	1.340	300,000	306,942	2013/12/20
第45回 三井物産社債	0.790	100,000	100,625	2013/05/07
第29回 住友商事社債	1.430	100,000	101,943	2013/03/01
第16回 三菱商事社債	3.000	100,000	107,159	2014/01/27
第14回 クレディセゾン社債	1.200	100,000	100,977	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	208,272	2014/02/12
第6回 みずほコーポレート銀行社債	1.605	200,000	203,698	2012/07/27
第7回 みずほコーポレート銀行社債	2.080	100,000	106,750	2017/07/27
第9回 みずほコーポレート銀行社債	1.435	200,000	203,640	2012/10/26
第11回 みずほコーポレート銀行社債	1.110	200,000	202,820	2013/01/25
第13回 みずほコーポレート銀行社債	1.390	200,000	204,620	2013/07/19
第14回 みずほコーポレート銀行社債	1.520	100,000	102,904	2013/12/10
第15回 みずほコーポレート銀行社債	1.325	200,000	204,872	2014/02/27
第18回 みずほコーポレート銀行社債	0.830	200,000	201,656	2014/10/17
第92回 三菱東京UFJ銀行社債	1.490	200,000	203,906	2012/10/16
第100回 三菱東京UFJ銀行社債	1.370	200,000	204,636	2013/07/16
第106回 三菱東京UFJ銀行社債	0.905	300,000	303,726	2014/07/17
第112回 三菱東京UFJ銀行社債	0.660	200,000	200,462	2015/01/26
第114回 三菱東京UFJ銀行社債	0.670	200,000	200,324	2015/04/17
第3回2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	1.300	200,000	203,684	2013/06/26
第3回 東京三菱銀行劣後社債	2.390	200,000	205,322	2012/06/25
第6回 東京三菱銀行劣後社債	1.730	100,000	103,824	2014/12/22
第8回 東京三菱銀行劣後社債	1.640	100,000	103,707	2015/07/22
第11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.280	100,000	107,231	2016/10/31
第5回 三井住友銀行劣後社債	2.620	100,000	102,934	2012/06/20
第4回 住友信託銀行劣後社債	1.670	100,000	103,541	2015/04/28
第5回 住友信託銀行劣後社債	2.250	100,000	106,530	2016/04/27
第41回 三井住友銀行社債	1.330	100,000	101,692	2012/10/19
第45回 三井住友銀行社債	1.230	200,000	204,422	2014/01/20
第47回 三井住友銀行社債	0.910	200,000	202,524	2014/07/18
第51回 三井住友銀行社債	0.350	200,000	197,114	2015/10/20
第6回 三井住友銀行劣後社債	1.710	100,000	102,872	2013/08/01
第7回 三井住友銀行劣後社債	2.010	100,000	104,151	2014/02/05
第8回 三井住友銀行劣後社債	1.950	100,000	104,549	2014/10/22
第9回 三井住友銀行劣後社債	1.750	100,000	104,183	2015/08/17
第20回 三井住友銀行劣後社債	2.210	200,000	211,050	2019/07/24
第1回 みずほ銀行劣後特約付社債	1.700	100,000	103,347	2015/02/03
第6回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.250	100,000	106,518	2016/11/04
第10回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.060	100,000	104,693	2018/01/26
第38回 NTFファイナンス社債	0.550	200,000	199,086	2015/06/19
第14回 トヨタファイナンス社債	1.045	100,000	101,087	2012/09/20
第19回 トヨタファイナンス社債	2.040	100,000	106,193	2016/03/18
第23回 トヨタファイナンス社債	1.970	100,000	105,984	2016/09/20
第26回 トヨタファイナンス社債	1.360	100,000	101,359	2012/06/20
第115回 オリックス社債	1.630	100,000	101,133	2012/05/30
第117回 オリックス社債	2.180	100,000	103,562	2014/08/30
第6回 大和証券グループ本社社債	1.500	100,000	101,411	2012/09/25
第7回 野村ホールディングス社債	1.630	100,000	101,812	2012/08/14

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8回 野村ホールディングス社債	2.120	100,000	105,369	2017/08/14
第9回 野村ホールディングス社債	1.390	100,000	101,681	2012/11/27
第13回 野村ホールディングス社債	1.720	100,000	101,760	2012/06/15
第15回 野村ホールディングス社債	2.010	100,000	104,174	2014/06/13
第17回 野村ホールディングス社債	1.280	200,000	203,568	2014/11/27
第22回 野村ホールディングス社債	0.937	200,000	200,492	2015/06/24
第24回 三井不動産社債	1.650	100,000	104,092	2015/12/18
第53回 三菱地所社債	1.580	100,000	101,509	2012/04/26
第60回 三菱地所社債	1.200	100,000	101,509	2012/12/10
第66回 三菱地所社債	0.785	100,000	100,799	2013/05/09
第41回 小田急電鉄社債	2.240	100,000	107,487	2016/08/08
第18回 京王電鉄社債	3.075	100,000	103,273	2012/04/20
第2回 東日本旅客鉄道社債	4.900	200,000	234,022	2015/02/25
第7回 東日本旅客鉄道社債	3.300	100,000	114,969	2017/08/25
第19回 東日本旅客鉄道社債	2.360	100,000	108,395	2022/02/25
第25回 東日本旅客鉄道社債	0.790	300,000	302,667	2013/03/19
第31回 東日本旅客鉄道社債	1.580	100,000	103,349	2014/03/19
第41回 東日本旅客鉄道社債	1.560	100,000	104,057	2015/09/18
第3回 西日本旅客鉄道社債	3.450	100,000	114,992	2016/12/20
第10回 西日本旅客鉄道社債	2.040	100,000	104,006	2023/09/20
第1回 東海旅客鉄道社債	4.650	100,000	112,459	2014/02/21
第2回 東海旅客鉄道社債	3.950	200,000	232,738	2016/04/25
第6回 東海旅客鉄道社債	2.390	100,000	108,713	2022/02/15
第10回 東海旅客鉄道社債	1.420	190,000	195,909	2017/09/20
第19回 東海旅客鉄道社債	1.280	200,000	203,066	2012/09/20
第23回 東海旅客鉄道社債	2.140	100,000	107,613	2018/04/25
第48回 日本電信電話社債	1.610	400,000	414,652	2014/09/19
第50回 日本電信電話社債	1.580	100,000	104,100	2015/09/18
第51回 日本電信電話社債	2.060	200,000	213,572	2016/06/20
第2回 KDD I社債	1.140	100,000	101,197	2012/09/20
第5回 KDD I社債	3.200	100,000	113,287	2017/04/28
第16回 NTTドコモ社債	1.260	200,000	204,376	2013/12/20
第18回 NTTドコモ社債	1.000	200,000	202,518	2013/03/27
第441回 東京電力社債	3.075	200,000	227,392	2017/09/22
第455回 東京電力社債	2.075	200,000	213,888	2018/10/23
第457回 東京電力社債	2.050	100,000	106,746	2018/11/16
第473回 東京電力社債	1.975	300,000	307,500	2012/08/17
第501回 東京電力社債	0.920	200,000	202,272	2013/02/14
第502回 東京電力社債	0.960	200,000	202,456	2013/02/27
第503回 東京電力社債	0.775	100,000	100,878	2013/04/25
第507回 東京電力社債	1.470	300,000	308,355	2013/10/28
第510回 東京電力社債	1.415	200,000	205,444	2013/12/24
第511回 東京電力社債	1.615	100,000	103,566	2014/05/28
第514回 東京電力社債	1.565	300,000	310,938	2014/10/29
第515回 東京電力社債	1.435	200,000	206,546	2015/02/10
第516回 東京電力社債	1.420	100,000	103,293	2015/04/27
第517回 東京電力社債	1.355	100,000	103,078	2015/06/15
第518回 東京電力社債	1.360	300,000	309,426	2015/08/12
第519回 東京電力社債	1.590	372,000	388,440	2015/12/28
第522回 東京電力社債	2.060	300,000	320,997	2016/08/31
第527回 東京電力社債	1.500	500,000	516,005	2014/05/30
第535回 東京電力社債	1.772	500,000	526,360	2017/11/30
第536回 東京電力社債	1.672	200,000	209,074	2018/01/29
第541回 東京電力社債	1.094	500,000	507,855	2013/04/25
第542回 東京電力社債	1.602	500,000	519,505	2018/04/25
第557回 東京電力社債	0.923	500,000	506,075	2015/07/16

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407回 中部電力社債	3.400	100,000	112,007	2015/07/24
第409回 中部電力社債	3.900	300,000	349,467	2016/06/24
第460回 中部電力社債	1.140	200,000	202,850	2012/11/22
第463回 中部電力社債	0.820	200,000	201,952	2013/04/25
第467回 中部電力社債	1.540	100,000	103,644	2014/12/25
第468回 中部電力社債	1.430	100,000	103,266	2015/02/25
第471回 中部電力社債	1.310	300,000	308,652	2015/06/25
第476回 中部電力社債	2.120	100,000	107,421	2018/06/25
第478回 中部電力社債	1.890	100,000	106,103	2016/09/23
第480回 中部電力社債	1.790	200,000	211,176	2017/01/25
第484回 中部電力社債	1.410	200,000	206,088	2014/09/25
第487回 中部電力社債	1.209	140,000	142,949	2013/11/25
第496回 中部電力社債	1.227	500,000	494,505	2020/07/24
第410回 関西電力社債	2.000	300,000	319,092	2018/11/22
第427回 関西電力社債	1.500	100,000	102,605	2013/06/25
第431回 関西電力社債	1.470	100,000	101,497	2012/05/25
第432回 関西電力社債	1.400	300,000	304,713	2012/07/25
第433回 関西電力社債	1.300	200,000	205,398	2014/11/25
第441回 関西電力社債	1.460	200,000	206,900	2015/04/24
第446回 関西電力社債	1.780	200,000	210,718	2016/03/18
第298回 中国電力社債	4.100	200,000	229,120	2015/05/25
第310回 中国電力社債	3.225	200,000	228,864	2017/07/25
第337回 中国電力社債	1.380	219,000	222,567	2012/08/24
第341回 中国電力社債	1.550	100,000	103,400	2014/06/25
第350回 中国電力社債	1.570	200,000	207,302	2014/10/24
第245回 北陸電力社債	3.800	200,000	227,086	2015/06/25
第260回 北陸電力社債	2.330	100,000	108,659	2020/05/25
第281回 北陸電力社債	1.970	200,000	212,874	2018/04/25
第289回 北陸電力社債	1.410	300,000	309,399	2014/12/25
第368回 東北電力社債	4.800	300,000	340,683	2014/04/25

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375回 東北電力社債	3.700	100,000	113,095	2015/06/25
第380回 東北電力社債	3.550	300,000	346,323	2016/11/25
第411回 東北電力社債	1.230	200,000	203,064	2012/10/25
第420回 東北電力社債	1.360	100,000	102,643	2014/02/25
第427回 東北電力社債	1.430	200,000	206,936	2015/09/25
第432回 東北電力社債	2.090	500,000	535,075	2016/05/25
第257回 四国電力社債	1.390	200,000	206,216	2016/02/25
第369回 九州電力社債	1.150	300,000	304,326	2012/11/22
第374回 九州電力社債	1.500	300,000	308,382	2013/09/25
第382回 九州電力社債	1.440	100,000	103,305	2015/02/25
第383回 九州電力社債	1.460	100,000	103,450	2015/04/24
第387回 九州電力社債	1.690	200,000	209,816	2016/03/25
第257回 北海道電力社債	3.850	200,000	231,734	2016/04/25
第282回 北海道電力社債	1.440	200,000	205,590	2013/12/25
第284回 北海道電力社債	1.480	500,000	519,205	2016/02/25
第286回 北海道電力社債	1.530	100,000	103,507	2014/10/24
第7回 沖縄電力社債	1.510	100,000	101,637	2012/06/25
第2回 電源開発社債	1.610	100,000	102,780	2013/06/20
第4回 電源開発社債	1.320	200,000	204,770	2013/12/20
第6回 電源開発社債	1.550	100,000	103,436	2014/09/19
第14回 電源開発社債	1.560	100,000	103,949	2015/09/18
第17回 電源開発社債	2.070	100,000	106,823	2016/06/20
第14回 東京ガス社債	5.100	100,000	115,462	2014/07/25
第24回 東京瓦斯社債	1.410	200,000	205,300	2013/12/02
第9回 大阪ガス社債	2.900	100,000	112,760	2018/01/30
第24回 大阪瓦斯社債	1.590	100,000	103,686	2014/10/24
第20回 NTTデータ社債	1.100	100,000	101,637	2013/06/20
小計	—	32,221,000	33,541,471	—
合計	—	414,467,466	425,203,104	—

## ■投資信託財産の構成

2011年2月14日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 425,203,104	% 99.3
コール・ローン等、その他	2,845,242	0.7
投資信託財産総額	428,048,346	100.0

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2011年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	428,048,346,470円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	1,119,095,886
社 債 (評価額)	425,203,104,331
公 未 収 利 息	1,654,974,095
前 払 費 用	71,172,158
(B) 負 債	254,200,000
未 払 解 約 金	254,200,000
(C) 純 資 産 総 額 (A-B)	427,794,146,470
元 次 期 繰 越 損 益 本 金	386,067,411,884
(D) 受 益 権 総 口 数	41,726,734,586
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C/D)	386,067,411,884円
	11,081円

<注記事項>

※ 期首元本額 392,257,810,576円  
 期中追加設定元本額 66,192,976,617円  
 期中一部解約元本額 72,383,375,309円

※ 期末における元本の内訳

D I AM国内債券パッシブ・ファンド	3,212,852,286円
D I AM国内債券インデックスファンド<DC年金>	7,484,227,559円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	2,560,897,784円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>2 安定・成長型	4,100,155,066円
D I AMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	1,683,247,411円
D I AM DC バランス30インデックスファンド	1,172,809,174円
D I AM DC バランス50インデックスファンド	1,169,258,527円
D I AM DC バランス70インデックスファンド	148,687,126円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	219,650,601円
マネックス資産設計ファンド<育成型>	2,024,367,484円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	256,676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国内債券パッシブファンド(適格機関投資家向け)	17,805,464,716円
D I AM国内債券パッシブ私募ファンド(適格機関投資家限定)	111,008,492円
D I AMワールドバランス25V A (適格機関投資家限定)	889,437,282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)	13,080,023,051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)	743,459,081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)	500,164,300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)	1,226,743,288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)	581,451,739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)	408,045,160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)	30,676,208,539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)	10,219,569,128円
D I AMバランスファンド25V A (適格機関投資家限定)	14,140,415,421円
D I AMバランスファンド37.5V A (適格機関投資家限定)	5,366,693,661円
D I AMバランスファンド50V A (適格機関投資家限定)	8,426,369,467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)	1,906,920,156円
D I AMグローバル・アセット・バランスV A 2 (適格機関投資家限定)	6,696,250,116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)	8,187,414,361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)	14,663,385,776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)	745,905,317円
D I AM培養フルヘッジ型グローバルアセット私募ファンド(適格機関投資家向け)	622,553,631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)	15,013,250,731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)	7,370,232,806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)	1,543,769,952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)	111,953,495,382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)	2,849,592,566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)	10,189,547,490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)	33,889,184,798円
D I AMバランス30V A (適格機関投資家限定)	2,323,727,417円
D I AMバランス50V A (適格機関投資家限定)	245,550円
D I AMバランス70V A (適格機関投資家限定)	153,891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)	36,962,800,524円
D I AM世界バランス25V A (適格機関投資家限定)	760,737,030円
D I AM国内バランス30V A (適格機関投資家限定)	188,677,518円
D I AMバランス20V A (適格機関投資家限定)	2,207,560,636円
D I AMバランス40V A (適格機関投資家限定)	321,225円
D I AMバランス60V A (適格機関投資家限定)	235,111円
期末元本合計	386,067,411,884円

## ■損益の状況

当期 自2010年2月16日 至2011年2月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	6,006,538,702円
受 取 利 息	6,006,538,702
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	121,955,506
売 買 益	2,789,931,285
売 買 損	△ 2,667,975,779
(C) 当 期 損 益 金 (A+B)	6,128,494,208
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	36,524,196,686
(E) 解 約 差 損 益 金	△ 8,281,776,691
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	7,355,820,383
(G) 計 算 (C+D+E+F)	41,726,734,586
次 期 繰 越 損 益 金	41,726,734,586

(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。