

運用報告書

DIAM高金利通貨ファンド

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 海外／債券
信託期間	信託期間は2007年12月27日から無期限です。
運用方針	インカムゲインの獲得と中長期的な信託財産の成長を目指して運用を行います。
主要運用対象	円建ての外国籍投資信託である「DIAMマルチチャレンジャーファンド（JPY）クラスF」受益証券および円建ての国内籍投資信託である「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。
組入制限	投資対象ファンド受益証券への投資割合には制限を設けません。 外貨建資産への直接投資は行いません。
分配方針	決算日（原則として毎月11日。）に、経費控除後の利子配当等収益（繰越分およびマザーファンドの信託財産に属する配当等収益のうち、信託財産に属するとみなした額（「みなし配当等収益」という。）を含みます。）および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、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。毎年4月、10月の決算時には、原則として利子配当等収益に売買益（評価益を含みます。）等を加えた額から分配を行います。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。

愛称：通貨セレクション

第41期決算日 2011年5月11日
 第42期決算日 2011年6月13日
 第43期決算日 2011年7月11日
 第44期決算日 2011年8月11日
 第45期決算日 2011年9月12日
 第46期決算日 2011年10月11日

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高金利通貨ファンド（愛称：通貨セレクション）」は、2011年10月11日に第46期の決算を行いました。

ここに、第41期～第46期中の運用状況と収益分配金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高金利通貨ファンド（愛称：通貨セレクション）

■最近5作成期の運用実績

作成期	決算期	基準価額			投資信託 受益証券 組入比率	債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
		(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率				
第4作成期	17期(2009年5月11日)	円 6,668	円 70	% 3.5	% 98.0	% 0.1	% —	百万円 10,680
	18期(2009年6月11日)	6,781	70	2.7	99.2	0.1	—	11,211
	19期(2009年7月13日)	6,331	50	△ 5.9	98.9	0.1	—	10,386
	20期(2009年8月11日)	6,921	50	10.1	99.0	0.1	—	10,971
	21期(2009年9月11日)	6,545	50	△ 4.7	99.6	0.1	—	10,116
	22期(2009年10月13日)	6,435	50	△ 0.9	99.3	0.1	—	9,607
第5作成期	23期(2009年11月11日)	6,555	50	2.6	99.5	0.1	—	9,469
	24期(2009年12月11日)	6,344	50	△ 2.5	99.6	0.1	—	8,752
	25期(2010年1月12日)	6,644	50	5.5	99.4	0.1	—	8,756
	26期(2010年2月12日)	6,191	50	△ 6.1	99.4	0.1	—	7,908
	27期(2010年3月11日)	6,253	50	1.8	99.5	0.1	—	7,730
	28期(2010年4月12日)	6,506	50	4.8	99.3	0.1	—	7,776
第6作成期	29期(2010年5月11日)	6,245	50	△ 3.2	98.3	0.1	—	7,284
	30期(2010年6月11日)	5,820	50	△ 6.0	99.4	0.2	—	6,412
	31期(2010年7月12日)	5,817	50	0.8	99.2	0.2	—	6,153
	32期(2010年8月11日)	5,804	50	0.6	99.3	0.2	—	5,768
	33期(2010年9月13日)	5,630	50	△ 2.1	99.4	0.2	—	5,458
	34期(2010年10月12日)	5,713	50	2.4	99.3	0.2	—	5,408
第7作成期	35期(2010年11月11日)	5,717	50	0.9	99.4	0.2	—	5,213
	36期(2010年12月13日)	5,674	50	0.1	99.2	0.2	—	4,974
	37期(2011年1月11日)	5,620	50	△ 0.1	98.5	0.2	—	4,795
	38期(2011年2月14日)	5,471	50	△ 1.8	99.4	0.2	—	4,465
	39期(2011年3月11日)	5,533	50	2.0	100.2	0.2	—	4,322
	40期(2011年4月11日)	5,893	50	7.4	99.1	0.2	—	4,501
第8作成期	41期(2011年5月11日)	5,513	50	△ 5.6	98.1	0.3	—	3,996
	42期(2011年6月13日)	5,438	50	△ 0.5	98.3	0.3	—	3,651
	43期(2011年7月11日)	5,515	50	2.3	98.6	0.3	—	3,556
	44期(2011年8月11日)	4,977	50	△ 8.8	99.1	0.3	—	3,080
	45期(2011年9月12日)	4,940	50	0.3	98.9	0.4	—	2,995
	46期(2011年10月11日)	4,531	50	△ 7.3	99.0	0.4	—	2,692

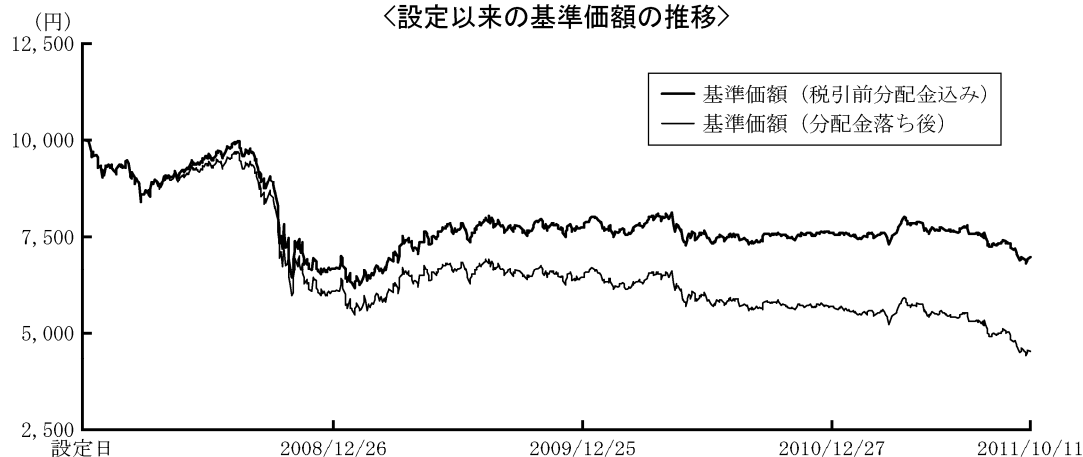
(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを通じて国内債券を組入れますので、「債券組入比率」、「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。

(注4) 当ファンドは、運用方針に合った適切な指数が存在しないため、ベンチマーク及び参考指標を定めておりません。

〈設定以来の基準価額の推移〉



■過去6ヶ月間の基準価額の推移

決算期	年 月 日	基 準 価 額		投資信託受益証券 組入 比 率	債 券 組 入 率	債 券 先 物 率	
		騰 落 率	騰 落 率				
第41期	(期 首) 2011年 4 月 11 日	円	5,893	—	99.1	0.2	—
	4 月 末		5,748	△2.5	97.8	0.3	—
	(期 末) 2011年 5 月 11 日		5,563	△5.6	98.1	0.3	—
第42期	(期 首) 2011年 5 月 11 日		5,513	—	98.1	0.3	—
	5 月 末		5,480	△0.6	98.9	0.3	—
	(期 末) 2011年 6 月 13 日		5,488	△0.5	98.3	0.3	—
第43期	(期 首) 2011年 6 月 13 日		5,438	—	98.3	0.3	—
	6 月 末		5,468	0.6	98.8	0.3	—
	(期 末) 2011年 7 月 11 日		5,565	2.3	98.6	0.3	—
第44期	(期 首) 2011年 7 月 11 日		5,515	—	98.6	0.3	—
	7 月 末		5,303	△3.8	99.1	0.3	—
	(期 末) 2011年 8 月 11 日		5,027	△8.8	99.1	0.3	—
第45期	(期 首) 2011年 8 月 11 日		4,977	—	99.1	0.3	—
	8 月 末		5,047	1.4	99.1	0.4	—
	(期 末) 2011年 9 月 12 日		4,990	0.3	98.9	0.4	—
第46期	(期 首) 2011年 9 月 12 日		4,940	—	98.9	0.4	—
	9 月 末		4,574	△7.4	98.9	0.4	—
	(期 末) 2011年 10 月 11 日		4,581	△7.3	99.0	0.4	—

(注1) 期末基準価額は分配金込み、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通じて国内債券を組入れますので、「債券組入比率」、「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。

■第41期～第46期の運用経過（2011年4月12日から2011年10月11日まで）



〈第41期〉

期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 4. 11	2011. 4. 11	2011. 5. 9	2011. 5. 11
5,893円	5,893円	5,535円	5,563円 (分配金込み)

〈第42期〉

期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 5. 11	2011. 6. 2 2011. 6. 3	2011. 5. 17	2011. 6. 13
5,513円	5,568円	5,404円	5,488円 (分配金込み)

〈第43期〉

期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 6. 13	2011. 7. 11	2011. 6. 27	2011. 7. 11
5,438円	5,565円	5,373円	5,565円 (分配金込み)

〈第44期〉

期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 7. 11	2011. 7. 11	2011. 8. 10	2011. 8. 11
5,515円	5,515円	4,983円	5,027円 (分配金込み)

〈第45期〉

期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 8. 11	2011. 9. 2	2011. 8. 12	2011. 9. 12
4,977円	5,091円	4,911円	4,990円 (分配金込み)

《投資環境》

当作成期は、欧州での財政問題の深刻化や欧米など先進国での景気減速懸念など先行き不透明感が高まり、投資家のリスク許容度が大きく悪化したことから、エマージング通貨は円に対して大きく下落する展開となりました。

海外市場

当作成期の主要国の国債利回りは大きく低下（価格は上昇）しました。欧州及び米国の債務問題に対する懸念が高まり、投資家のリスク許容度が大きく低下する中、国債に対する需要が強まったことが背景にあります。欧州においては、ユーロ圏首脳会議でギリシャ向け第2次支援策及び金融支援体制の拡充が策定されましたが、実施に向けて各国の足並みが揃わない状況が続き、スペインやイタリアなど周辺国の国債利回りも上昇し、欧州の金融機関にも悪影響が拡大するなど金融市場の不透明感は強まりました。米国においては、緊迫した議論の末ようやく債務上限を引き上げる法案が可決されましたが、米国の大手格付会社が米国債の格付を最上級の「AAA」から「AA+」に引き下げる事態に至りました。また、米国の経済指標の悪化などを受けて景気減速懸念も強まったことから、FRB（米連邦準備理事会）は2013年半ばまで低金利政策を維持すると発表し、オバマ大統領も景気・雇用対策を発表するなど、景気対策に向けた動向に注目が集まりました。ECB（欧州中央銀行）はインフレ懸念に対応するため、2011年4月と7月の二度にわたって政策金利の引き上げを決定しました。他の主要国に先駆けての金融引き締め策への転換になりましたが、財政問題や景気の後退懸念が強まりつつあることから、市場での利上げ期待は大きく後退しました。

為替市場では、投資家のリスク回避の動きから円が主要通貨やエマージング通貨に対して大きく上昇しました。

〈第46期〉

期首	期中高値	期中安値	期末
2011. 9. 12	2011. 9. 12	2011. 10. 5	2011. 10. 11
4,940円	4,940円	4,422円	4,581円 (分配金込み)

分配金実績（1万口当たり）

第41期	(2011. 5. 11)	分配金	50円
第42期	(2011. 6. 13)	分配金	50円
第43期	(2011. 7. 11)	分配金	50円
第44期	(2011. 8. 11)	分配金	50円
第45期	(2011. 9. 12)	分配金	50円
第46期	(2011. 10. 11)	分配金	50円
当作成期合計分配金			300円

国内市場

当作成期の長期金利（10年国債利回り）は、0.9%台後半～1.3%台前半の範囲で推移し、前作成期末の1.320%から0.990%へと大幅に低下（価格は上昇）しました。

当作成期の開始直後に長期金利は1.33%を記録しましたが、これが当作成期の最高水準となり、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、2011年5月中旬にかけて長期金利は大きく低下しました。6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期待が高まったことや、欧州の債務問題の深刻化や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、長期金利は低下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、その後は作成期末まで概ね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》

当ファンドではD I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスFの組入比率を高位に維持し、また国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを少額組入れました。

基準価額の推移

当作成期末の基準価額は4,531円となりました。第41期から第46期までの1万口当たりの収益分配金合計額300円を加算すると4,831円となり、前作成期末に比べて18.02%下落しました。

基準価額の騰落要因

主要投資対象であるD I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスFが下落したことにより、当ファンドの基準価額も下落しました。

D I A Mマルチカレンシーファンド（J P Y）クラスF

基準価額の推移

当作成期末の基準価額は前作成期末に比べ17.87%下落しました。

基準価額の騰落要因

〔下落要因〕投資対象通貨に対して大きく円高が進んだことがマイナス寄与となりました。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

基準価額の推移

当作成期末の基準価額は11,368円となり、前作成期末に比べ2.64%上昇しました。

基準価額の騰落要因

〔上昇要因〕保有する債券から利息収入を得たこと。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（価格は上昇）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、2.69%上昇しました。

ベンチマークとの差異およびその要因

当マザーファンドの騰落率はベンチマーク比で▲0.06%と、ベンチマークにほぼ連動した運用成果となりました。

収益分配金

第41期から第46期の各決算期の収益分配金につきましては、利子・配当等収益より運用実績等を考慮し、1万円当たり50円とさせていただきます（当作成期合計分配金額300円）。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。

《今後の投資環境および運用方針》

当ファンドでは引き続きDIAMマルチカレンシーファンド（JPY）クラスFを高位に組入れることを基本とした運用を行い、インカムゲインの獲得と中長期的な信託財産の成長を目指します。

DIAMマルチカレンシーファンド（JPY）クラスF

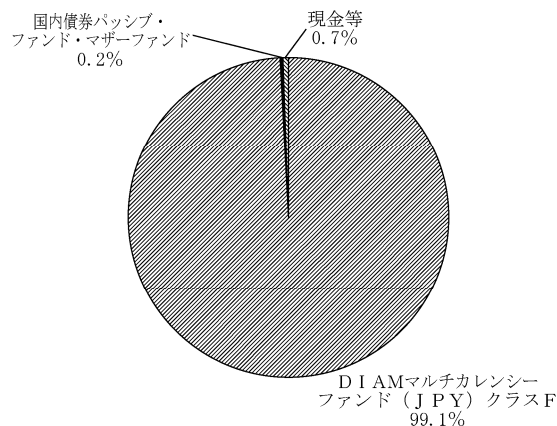
先進国では雇用や住宅市場の低迷が続いており、景気回復は引き続き緩やかな動きになると見られます。また、ユーロ圏の財政問題についても根本的な解決には相応の時間を要すると見られ、引き続き注意が必要です。一方エマージング諸国では、先進国の景気減速に伴う外需の低下懸念はあるものの、家計の所得環境の改善や企業の設備投資の活発化などから国内需要は堅調な推移を見せており、先進国と比べて高い成長が今後も期待されます。また、高い成長などを背景に国債利回りは相対的に高い水準にあり、財政状況なども先進国と比べて総じて良好であることなどから、投資家のリスク許容度の回復局面ではエマージング国債に対する積極的な需要が見込まれます。

当ファンドでは引き続き一定の信用格付以上を有する国の通貨の中から、為替予約取引の流動性、投資規制、市場規模等を勘案し、相対的に金利の高い通貨を選定し、各市場のファンダメンタルズに注視した運用を継続する方針です。現在の投資対象国である英国、ハンガリー、トルコ、南アフリカ、ブラジル、オーストラリア、インドを中心として、経済状況・政治状況等をモニタリングします。

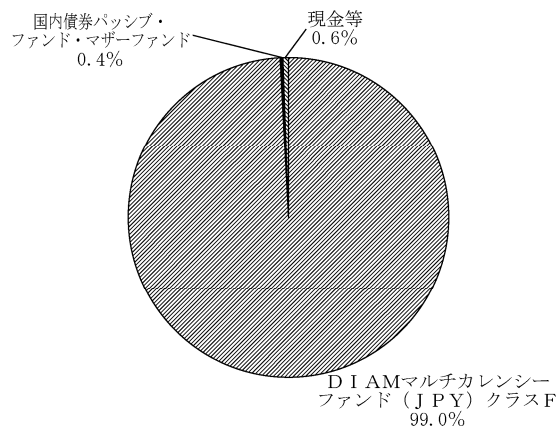
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

当マザーファンドでは引き続き、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、ベンチマークである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。

ポートフォリオ構成 ※比率は純資産総額に対する割合です。
前作成期末



当作成期末



■ 1万口（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	第41期～第46期
(a) 信託報酬 (投 信 会 社) (販 売 会 社) (受 託 銀 行)	22円 (7) (14) (1)
(b) 保 管 費 用 等	0
合 計	22

(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 × $\frac{\text{経過日数}}{365}$

(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。

■売買及び取引の状況（2011年4月12日から2011年10月11日まで）
投資信託受益証券

		第 41 期 ～ 第 46 期			
		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外(邦 国(貨 建)	DIAMマルチカレンシー ファンド(JPY)クラスF	千口 —	千円 —	千口 182	千円 954,086

(注) 金額は受渡代金です。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2011年4月12日から2011年10月11日まで）
期中の親投資信託受益証券の設定、解約はありません。

■利害関係人との取引状況等（2011年4月12日から2011年10月11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

(1) ファンド・オブ・ファンズが組入れた邦貨建ファンドの明細

フ ァ ン ド 名	第 7 作 成 期 末	第 8 作 成 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
DIAMマルチカレンシーファンド(JPY)クラスF	口 783,535	口 601,135	百万円 2,666	% 99.0
合 計	783,535	601,135	2,666	99.0

(注1) 比率は純資産総額に対する比率です。

(注2) 評価額の単位未満は切り捨ててあります。

(2) 親投資信託残高

	第 7 作 成 期 末	第 8 作 成 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 9,608	千口 9,608	千円 10,923

(注) 親投資信託合計の受益権口数は357,271,364千口です。

<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11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	310,855,586	76.5	—	46.2	18.7	11.6	
地方債証券	26,687,610	27,898,110	6.9	—	2.2	4.2	0.5	
特殊債証券 (除く金融債)	29,344,872	30,755,810	7.5	—	3.6	3.4	0.5	
金融債券	5,820,000	5,923,528	1.5	—	—	1.0	0.5	
普通社債券	27,602,000	28,363,789	7.0	—	1.5	4.5	1.0	
合計	386,324,482	403,796,825	99.4	—	53.5	31.8	14.1	

(注) 組入比率は、2011年10月11日現在のマザーファンド純資産総額(406,161,847千円)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	2,001,980	2012/12/15
第300回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,120	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	2,002,260	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	2,002,360	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	2,002,440	2013/07/15
第307回 利付国庫債券(2年)	0.200	1,200,000	1,201,536	2013/08/15
第689回 利付国庫債券(5年)	1.100	2,000,000	2,023,280	2012/12/20
第69回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,800,000	3,835,226	2012/12/20
第70回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,900,000	4,947,530	2013/03/20
第72回 利付国庫債券(5年)	1.500	4,200,000	4,296,936	2013/06/20
第75回 利付国庫債券(5年)	1.100	4,600,000	4,685,606	2013/09/20
第78回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,500,000	3,557,505	2013/12/20
第81回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,500,000	4,569,705	2014/03/20
第83回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,400,000	3,465,790	2014/06/20
第85回 利付国庫債券(5年)	0.700	3,500,000	3,552,080	2014/09/20
第87回 利付国庫債券(5年)	0.500	4,000,000	4,036,680	2014/12/20
第88回 利付国庫債券(5年)	0.500	3,500,000	3,532,130	2015/03/20
第89回 利付国庫債券(5年)	0.400	4,500,000	4,523,760	2015/06/20
第91回 利付国庫債券(5年)	0.400	1,700,000	1,708,262	2015/09/20
第92回 利付国庫債券(5年)	0.300	3,000,000	3,002,910	2015/09/20
第93回 利付国庫債券(5年)	0.500	4,300,000	4,336,421	2015/12/20
第95回 利付国庫債券(5年)	0.600	2,000,000	2,024,900	2016/03/20
第96回 利付国庫債券(5年)	0.500	1,500,000	1,512,120	2016/03/20
第97回 利付国庫債券(5年)	0.400	5,500,000	5,517,710	2016/06/20
第2回 利付国庫債券(40年)	2.200	600,000	626,352	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	1,040,060	2050/03/20
第4回 利付国庫債券(40年)	2.200	300,000	310,827	2051/03/20
第246回 利付国庫債券(10年)	0.800	1,900,000	1,915,257	2012/12/20
第247回 利付国庫債券(10年)	0.800	700,000	706,790	2013/03/20
第250回 利付国庫債券(10年)	0.500	2,060,000	2,072,957	2013/06/20
第254回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,700,000	2,766,150	2013/09/20
第256回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,500,000	2,568,275	2013/12/20
第258回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,000,000	1,027,720	2014/03/20
第260回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,100,000	2,180,178	2014/06/20
第263回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,700,000	2,811,078	2014/09/20
第266回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,700,000	3,839,231	2014/12/20
第269回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,500,000	1,554,615	2015/03/20
第270回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,900,000	1,972,428	2015/06/20
第272回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,100,000	2,191,938	2015/09/20
第274回 利付国庫債券(10年)	1.500	2,400,000	2,519,496	2015/12/20
第277回 利付国庫債券(10年)	1.600	3,000,000	3,169,110	2016/03/20
第280回 利付国庫債券(10年)	1.900	2,800,000	3,003,364	2016/06/20
第282回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,400,000	3,624,366	2016/09/20
第284回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,100,000	3,310,521	2016/12/20
第285回 利付国庫債券(10年)	1.700	4,400,000	4,707,736	2017/03/20
第286回 利付国庫債券(10年)	1.800	3,700,000	3,985,566	2017/06/20
第288回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,600,000	3,863,412	2017/09/20
第289回 利付国庫債券(10年)	1.500	4,400,000	4,673,724	2017/12/20
第290回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,200,000	3,380,448	2018/03/20
第293回 利付国庫債券(10年)	1.800	5,000,000	5,415,000	2018/06/20
第296回 利付国庫債券(10年)	1.500	4,000,000	4,253,800	2018/09/20
第297回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,200,000	3,383,264	2018/12/20
第299回 利付国庫債券(10年)	1.300	4,100,000	4,301,064	2019/03/20
第301回 利付国庫債券(10年)	1.500	3,800,000	4,037,804	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	2,949,520	2019/09/20
第305回 利付国庫債券 (10年)	1.300	4,300,000	4,487,523	2019/12/20
第308回 利付国庫債券 (10年)	1.400	3,700,000	3,882,965	2020/03/20
第308回 利付国庫債券 (10年)	1.300	1,800,000	1,870,776	2020/06/20
第309回 利付国庫債券 (10年)	1.100	2,500,000	2,556,725	2020/06/20
第310回 利付国庫債券 (10年)	1.000	4,500,000	4,552,245	2020/09/20
第312回 利付国庫債券 (10年)	1.200	5,700,000	5,849,967	2020/12/20
第313回 利付国庫債券 (10年)	1.300	7,000,000	7,230,790	2021/03/20
第315回 利付国庫債券 (10年)	1.200	6,500,000	6,641,115	2021/06/20
第1回 利付国庫債券 (30年)	2.800	100,000	117,955	2029/09/20
第2回 利付国庫債券 (30年)	2.400	100,000	111,587	2030/02/20
第3回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	219,750	2030/05/20
第4回 利付国庫債券 (30年)	2.900	200,000	239,614	2030/11/20
第5回 利付国庫債券 (30年)	2.200	200,000	216,448	2031/05/20
第6回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	223,146	2031/11/20
第7回 利付国庫債券 (30年)	2.300	300,000	329,469	2032/05/20
第8回 利付国庫債券 (30年)	1.800	500,000	505,020	2032/11/22
第11回 利付国庫債券 (30年)	1.700	400,000	394,992	2033/06/20
第12回 利付国庫債券 (30年)	2.100	300,000	317,397	2033/09/20
第13回 利付国庫債券 (30年)	2.000	300,000	311,487	2033/12/20
第14回 利付国庫債券 (30年)	2.400	500,000	555,930	2034/03/20
第15回 利付国庫債券 (30年)	2.500	200,000	226,190	2034/06/20
第16回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	452,800	2034/09/20
第17回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	222,356	2034/12/20
第18回 利付国庫債券 (30年)	2.300	820,000	896,424	2035/03/20
第19回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	218,600	2035/06/20
第20回 利付国庫債券 (30年)	2.500	300,000	339,384	2035/09/20
第21回 利付国庫債券 (30年)	2.300	500,000	545,800	2035/12/20
第22回 利付国庫債券 (30年)	2.500	470,000	531,687	2036/03/20
第23回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	452,488	2036/06/20
第24回 利付国庫債券 (30年)	2.500	600,000	678,702	2036/09/20
第25回 利付国庫債券 (30年)	2.300	600,000	653,682	2036/12/20
第26回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,000,000	1,110,480	2037/03/20
第27回 利付国庫債券 (30年)	2.500	900,000	1,018,584	2037/09/20
第28回 利付国庫債券 (30年)	2.500	1,300,000	1,472,198	2038/03/20
第29回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,500,000	1,669,305	2038/09/20
第30回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,500,000	1,634,715	2039/03/20
第31回 利付国庫債券 (30年)	2.200	1,700,000	1,814,580	2039/09/20
第32回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,600,000	1,742,256	2040/03/20
第33回 利付国庫債券 (30年)	2.000	1,800,000	1,838,754	2040/09/20
第34回 利付国庫債券 (30年)	2.200	2,000,000	2,131,340	2041/03/20
第37回 利付国庫債券 (20年)	3.100	600,000	693,498	2017/09/20
第39回 利付国庫債券 (20年)	2.600	400,000	452,612	2018/03/20
第40回 利付国庫債券 (20年)	2.300	720,000	804,967	2018/09/20
第42回 利付国庫債券 (20年)	2.600	800,000	914,784	2019/03/20
第43回 利付国庫債券 (20年)	2.900	860,000	1,005,993	2019/09/20
第45回 利付国庫債券 (20年)	2.400	900,000	1,017,738	2020/03/20
第46回 利付国庫債券 (20年)	2.200	500,000	556,860	2020/06/22
第47回 利付国庫債券 (20年)	2.200	950,000	1,059,601	2020/09/21
第48回 利付国庫債券 (20年)	2.500	500,000	570,540	2020/12/21
第50回 利付国庫債券 (20年)	1.900	780,000	847,836	2021/03/22
第51回 利付国庫債券 (20年)	2.000	600,000	657,330	2021/06/21
第52回 利付国庫債券 (20年)	2.100	550,000	607,700	2021/09/21
第54回 利付国庫債券 (20年)	2.200	700,000	780,521	2021/12/20
第55回 利付国庫債券 (20年)	2.000	810,000	887,355	2022/03/21
第57回 利付国庫債券 (20年)	1.900	830,000	899,919	2022/06/20
第58回 利付国庫債券 (20年)	1.900	900,000	975,024	2022/09/20
第60回 利付国庫債券 (20年)	1.400	990,000	1,019,066	2022/12/20
第61回 利付国庫債券 (20年)	1.000	800,000	787,080	2023/03/20

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62回 利付国庫債券 (20年)	0.800	1,000,000	958,030	2023/06/20
第64回 利付国庫債券 (20年)	1.900	800,000	862,960	2023/09/20
第65回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,401,192	2023/12/20
第67回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,399,177	2024/03/20
第70回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,250,000	1,417,437	2024/06/20
第72回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,250,000	1,372,875	2024/09/20
第73回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,390,000	1,507,983	2024/12/20
第75回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,340,000	1,468,439	2025/03/20
第78回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,550,000	1,657,058	2025/06/20
第81回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,700,000	1,837,122	2025/09/20
第83回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,600,000	1,747,008	2025/12/20
第85回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,750,000	1,907,360	2026/03/20
第88回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,894,395	2026/06/20
第90回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,600,000	1,760,272	2026/09/20
第92回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,700,000	1,844,381	2026/12/20
第93回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,000,000	1,069,340	2027/03/20
第94回 利付国庫債券 (20年)	2.100	800,000	866,656	2027/06/20
第95回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,887,034	2027/09/20
第97回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,500,000	1,641,360	2027/12/20
第99回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,600,000	1,725,008	2028/03/20
第100回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,800,000	1,964,790	2028/06/20
第102回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,900,000	2,128,152	2028/09/20
第105回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,800,000	1,934,082	2028/12/20
第107回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,146,340	2029/03/20
第109回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,000,000	2,083,180	2029/06/20
第111回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,000,000	2,388,496	2029/09/20
第113回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,137,860	2029/12/20
第114回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,134,840	2030/03/20
第116回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,000,000	2,814,006	2030/06/20
第118回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,200,000	1,260,876	2030/09/20
第119回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,500,000	1,527,765	2030/12/20
第121回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,200,000	2,274,426	2031/03/20
第123回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,200,000	2,344,254	2031/06/20
第125回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,400,000	2,598,024	2031/09/20
第128回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,000,000	2,063,540	2031/12/20
第129回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,000,000	1,015,490	2031/06/20
小計	—	296,870,000	310,855,586	—
(地方債証券)				
第602回 東京都公債	1.400	148,000	151,620	2013/10/25
第611回 東京都公債	1.830	200,000	208,586	2014/06/20
第612回 東京都公債	1.710	161,500	167,914	2014/06/20
第614回 東京都公債	1.480	200,000	207,236	2014/09/19
第616回 東京都公債	1.410	100,000	103,605	2014/12/19
第617回 東京都公債	1.400	200,000	207,146	2014/12/19
第619回 東京都公債	1.530	200,000	208,442	2015/03/20
第620回 東京都公債	1.350	200,000	207,216	2015/03/20
第622回 東京都公債	1.280	106,800	110,596	2015/06/19
第623回 東京都公債	1.310	200,000	207,330	2015/06/19
第627回 東京都公債	1.520	100,000	104,645	2015/09/18
第628回 東京都公債	1.590	100,000	105,136	2015/12/18
第629回 東京都公債	1.450	494,000	516,516	2015/12/18
第632回 東京都公債	2.000	115,300	123,523	2016/03/18
第633回 東京都公債	1.970	100,000	107,001	2016/03/18
第634回 東京都公債	1.860	200,000	213,690	2016/06/20
第638回 東京都公債	1.900	200,000	214,592	2016/09/20
第640回 東京都公債	1.790	150,000	160,482	2016/12/20
第641回 東京都公債	1.820	100,000	107,141	2016/12/20
第649回 東京都公債	1.620	203,500	217,201	2018/06/20
第654回 東京都公債	1.400	300,000	315,903	2018/12/20

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667回 東京都公募債	1.570	300,000	319,359	2019/03/20
第680回 東京都公募債	1.390	200,000	208,826	2020/03/19
第685回 東京都公募債	1.130	500,000	510,070	2020/06/19
第688回 東京都公募債	0.940	200,000	200,422	2020/09/18
15年度2回 北海道公募債	1.100	203,000	206,010	2013/07/29
16年度11回 北海道公募債	1.300	250,000	257,762	2015/02/25
18年度4回 北海道公募債	2.000	190,500	204,046	2016/06/30
18年度6回 北海道公募債	2.100	100,000	107,762	2016/08/31
19年度4回 北海道公募債	1.980	300,000	323,862	2017/06/29
21年度6回 北海道公募債	1.600	200,000	211,622	2019/08/28
第125回 神奈川県公募債	1.400	100,000	102,884	2014/03/31
第126回 神奈川県公募債	1.500	178,870	184,629	2014/04/30
第127回 神奈川県公募債	1.800	100,000	104,324	2014/07/30
第128回 神奈川県公募債	1.500	100,000	103,668	2014/09/30
第130回 神奈川県公募債	1.400	156,200	161,880	2015/01/28
第135回 神奈川県公募債	1.600	200,000	210,016	2015/10/28
第136回 神奈川県公募債	1.500	100,000	104,730	2015/12/28
第166回 神奈川県公募債	1.360	300,000	313,596	2019/09/20
第252回 大阪府公募債	0.800	100,000	100,727	2013/01/30
第261回 大阪府公募債	1.500	129,000	132,462	2013/12/25
第278回 大阪府公募債	1.300	200,000	206,624	2015/05/29
第285回 大阪府公募債	1.500	100,000	104,462	2015/12/25
第286回 大阪府公募債	1.500	200,000	209,036	2016/01/29
第289回 大阪府公募債	1.800	200,000	212,066	2016/04/27
第293回 大阪府公募債	2.100	200,000	215,620	2016/08/30
第301回 大阪府公募債	1.830	100,000	107,054	2017/04/26
第310回 大阪府公募債	1.620	240,000	254,757	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	514,400	2013/08/28
15年度3回 京都府公募債	1.500	219,300	225,501	2013/12/24
16年度2回 京都府公募債	1.500	100,000	103,648	2014/09/24
18年度1回 京都府公募債	1.700	100,000	106,483	2016/11/22
14年度5回 兵庫県公募債	0.800	100,000	100,784	2013/02/27
15年度1回 兵庫県公募債	0.700	100,000	100,696	2013/04/25
16年度4回 兵庫県公募債	1.600	251,970	260,602	2014/05/27
16年度8回 兵庫県公募債	1.900	111,500	116,576	2014/08/25
17年度2回 兵庫県公募債	1.400	200,000	207,274	2015/04/27
17年度9回 兵庫県公募債	1.600	306,000	320,874	2015/11/30
17年度13回 兵庫県公募債	1.700	105,000	110,818	2016/03/23
18年度1回 兵庫県公募債	1.800	120,000	127,296	2016/04/27
15年度1回 静岡県公募債	0.500	268,500	269,890	2013/06/27
15年度3回 静岡県公募債	1.400	116,130	118,957	2013/10/28
18年度5回 静岡県公募債	1.850	129,800	138,997	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	310,992	2013/10/28
16年度2回 愛知県公募債	1.600	200,000	208,092	2014/10/27
18年度2回 愛知県公募債	2.000	160,300	172,276	2016/06/27
20年度4回 愛知県公募債	1.600	100,000	106,572	2018/09/25
22年度6回 愛知県公募債	1.178	200,000	204,572	2020/07/30
16年度2回 広島県公募債	1.500	200,000	208,128	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	102,731	2013/09/26
17年度2回 埼玉県公募債	1.300	200,000	207,060	2015/05/27
18年度1回 埼玉県公募債	1.800	200,000	212,682	2016/04/27
21年度4回 埼玉県公募債	1.460	440,000	463,694	2019/07/29
16年度3回 福岡県公募債	1.300	131,040	135,444	2015/02/24
17年度1回 福岡県公募債	1.400	100,000	104,093	2015/08/26
17年度5回 福岡県公募債	1.500	100,000	104,800	2016/01/27
18年度1回 福岡県公募債	2.100	104,000	112,470	2016/08/30

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	
21年度3回 福岡県公募債	1.550	200,000	212,056	2019/08/27
15年度4回 千葉県公募債	1.400	100,000	102,685	2014/01/24
16年度3回 千葉県公募債	1.900	100,000	104,717	2014/08/25
16年度8回 千葉県公募債	1.300	200,000	206,726	2015/02/25
17年度2回 千葉県公募債	1.300	200,000	207,174	2015/06/25
19年度5回 千葉県公募債	1.850	300,000	323,541	2017/10/25
21年度6回 千葉県公募債	1.410	200,000	209,752	2019/09/25
18年度2回 新潟県公募債	1.870	169,000	181,179	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	100,525	2013/06/25
第8回 共同発行市場公募地方債	1.600	400,000	411,752	2013/11/25
第9回 共同発行市場公募地方債	1.500	210,000	215,922	2013/12/25
第11回 共同発行市場公募地方債	1.300	300,000	307,656	2014/02/25
第12回 共同発行市場公募地方債	1.400	130,000	133,740	2014/03/25
第13回 共同発行市場公募地方債	1.500	221,000	228,107	2014/04/25
第18回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	103,944	2014/09/25
第19回 共同発行市場公募地方債	1.600	130,000	135,245	2014/10/24
第20回 共同発行市場公募地方債	1.500	100,000	103,809	2014/11/25
第21回 共同発行市場公募地方債	1.400	300,000	310,674	2014/12/25
第23回 共同発行市場公募地方債	1.300	100,000	103,363	2015/02/25
第25回 共同発行市場公募地方債	1.400	304,000	315,637	2015/04/24
第28回 共同発行市場公募地方債	1.300	200,000	207,288	2015/07/24
第29回 共同発行市場公募地方債	1.400	200,000	208,180	2015/08/25
第31回 共同発行市場公募地方債	1.500	200,000	209,186	2015/10/23
第32回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	210,160	2015/11/25
第33回 共同発行市場公募地方債	1.600	300,000	315,405	2015/12/25
第35回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	210,590	2016/02/25
第36回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	105,364	2016/03/25
第37回 共同発行市場公募地方債	1.800	150,000	159,499	2016/04/25
第38回 共同発行市場公募地方債	2.000	170,000	182,501	2016/05/25
第39回 共同発行市場公募地方債	1.900	146,000	156,214	2016/06/24
第40回 共同発行市場公募地方債	2.100	150,000	162,052	2016/07/25
第47回 共同発行市場公募地方債	1.800	161,600	173,102	2017/02/24
第58回 共同発行市場公募地方債	1.850	200,000	215,694	2017/10/25
第57回 共同発行市場公募地方債	1.650	200,000	213,456	2017/12/25
第61回 共同発行市場公募地方債	1.550	300,000	318,531	2018/04/25
第68回 共同発行市場公募地方債	1.620	100,000	106,694	2018/08/24
第75回 共同発行市場公募地方債	1.640	500,000	533,970	2019/06/25
第80回 共同発行市場公募地方債	1.540	700,000	740,355	2019/11/25
第94回 共同発行市場公募地方債	1.240	100,000	102,305	2021/01/25
17年度3回 大阪市公募債	1.300	100,000	103,364	2015/07/28
17年度7回 大阪市公募債	1.400	200,000	207,688	2015/09/29
17年度8回 大阪市公募債	1.600	200,000	209,382	2015/10/27
17年度11回 大阪市公募債	1.600	100,000	104,950	2016/02/23
18年度2回 大阪市公募債	2.000	100,000	107,079	2016/06/22
18年度3回 大阪市公募債	2.100	150,000	161,496	2016/07/27
19年度5回 大阪市公募債	1.990	135,000	145,870	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	207,272	2015/07/21
第12回せ号 名古屋市公募債	1.400	359,500	374,404	2015/09/28
17年度1回 京都市公募債	1.400	100,000	103,990	2015/08/25
18年度3回 京都市公募債	1.900	101,700	109,339	2017/02/27
16年度5回 神戸市公募債	1.400	200,000	206,978	2014/12/24
17年度13回 神戸市公募債	1.600	103,000	108,331	2016/02/23
15年度5回 横浜市公募債	1.300	200,000	205,104	2014/02/25
16年度1回 横浜市公募債	1.600	200,000	206,692	2014/03/20
17年度1回 横浜市公募債	1.300	300,000	310,209	2015/03/20
14年度5回 札幌市公募債	0.800	106,000	106,833	2013/01/30
14年度7回 札幌市公募債	0.700	100,000	100,764	2013/04/24

銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)				
16年度7回 札幌市公債券	1.500	100,000	104,064	2015/03/25
第2回 川崎市公債券 15年	1.630	100,000	106,015	2020/06/22
第19回 川崎市公債券 5年	1.410	100,000	102,037	2013/06/20
18年度4回 福岡市公債券	1.800	100,000	106,763	2016/10/27
16年度1回 広島市公債券	1.400	100,000	103,489	2014/12/24
16年度2回 千葉市公債券	1.400	100,000	103,583	2015/01/27
小計	—	26,687,610	27,898,110	—
(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	106,590	2014/08/27
第13回 政保日本政策投資銀行債券	2.000	121,000	130,375	2016/08/25
第16回 日本政策投資銀行債券	1.520	100,000	103,463	2014/09/19
第7回 日本政策投資銀行債券	0.780	200,000	201,486	2013/03/19
第9回 日本政策投資銀行債券	1.580	100,000	102,531	2013/09/20
第13回 日本政策投資銀行債券	1.590	100,000	103,135	2014/03/20
第27回 日本政策投資銀行債券	1.980	200,000	214,484	2016/09/20
第46回 日本政策投資銀行債券	1.690	200,000	213,118	2018/03/20
第12回 日本道路・機構承継債	1.330	100,000	101,277	2012/12/20
第34回 日本道路・機構承継債	1.630	200,000	207,586	2014/09/22
第319回 政保道路債	0.900	132,000	133,788	2013/08/22
第322回 政保道路債	1.500	106,000	108,958	2013/11/28
第323回 政保道路債	1.500	200,000	205,718	2013/12/20
第324回 政保道路債	1.400	200,000	205,488	2014/04/24
第328回 政保道路債	1.500	200,000	206,768	2014/05/28
第329回 政保道路債	1.600	100,000	103,731	2014/06/27
第333回 政保道路債	1.600	300,000	312,336	2014/10/28
第335回 政保道路債	1.400	237,000	245,619	2014/12/24
第338回 政保道路債	1.500	264,000	275,074	2015/03/27
第339回 政保道路債	1.400	301,000	312,832	2015/04/28
第15回 高速道路機構債	2.050	400,000	430,424	2016/09/20
第25回 高速道路機構債	1.820	300,000	321,444	2017/09/20
第35回 高速道路機構債	1.650	400,000	425,248	2018/03/20
第48回 高速道路機構債	1.710	700,000	747,873	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	314,751	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	220,311	2016/02/26
第9回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.600	108,000	113,914	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	108,387	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	324,113	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	131,516	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	106,897	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	401,527	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	319,830	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	206,192	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	320,328	2017/03/28
第32回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.700	297,000	317,314	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	371,781	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	358,105	2017/08/31
第41回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	200,000	211,916	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	210,772	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	171,805	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	428,151	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	632,298	2018/12/25
第76回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.400	200,000	210,568	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	105,931	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	312,639	2019/09/30
第16回 日本道路・機構承継債	0.980	430,000	434,433	2013/03/20
第26回 日本道路・機構承継債	1.680	200,000	206,076	2013/12/20
第41回 日本道路・機構承継債	1.520	300,000	311,658	2015/03/20
第5回 公営企業債券	0.770	100,000	100,791	2013/03/22
第829回 政保公営企業債券	1.100	400,000	406,608	2013/07/24

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))				
第832回 政保公営企業債券	1.400	298,000	305,402	2013/10/24
第834回 政保公営企業債券	1.500	207,000	212,969	2013/12/24
第837回 政保公営企業債券	1.400	432,000	444,687	2014/03/24
第838回 政保公営企業債券	1.500	600,000	619,608	2014/04/25
第839回 政保公営企業債券	1.500	260,000	268,746	2014/05/26
第843回 政保公営企業債券	1.500	100,000	103,741	2014/09/29
第847回 政保公営企業債券	1.400	200,000	207,436	2015/01/27
第848回 政保公営企業債券	1.300	200,000	206,894	2015/02/24
第849回 政保公営企業債券	1.500	261,000	271,888	2015/03/20
第852回 政保公営企業債券	1.300	300,000	311,079	2015/06/29
第853回 政保公営企業債券	1.200	204,000	210,868	2015/07/24
第854回 政保公営企業債券	1.400	304,000	316,673	2015/08/18
第856回 政保公営企業債券	1.500	200,000	209,376	2015/10/20
第859回 政保公営企業債券	1.500	207,000	217,151	2016/01/25
第862回 政保公営企業債券	1.800	239,000	254,374	2016/04/20
第863回 政保公営企業債券	2.000	200,000	214,920	2016/05/27
第867回 政保公営企業債券	1.800	200,000	213,734	2016/06/29
第868回 政保公営企業債券	1.800	101,000	108,021	2016/10/21
第869回 政保公営企業債券	1.800	102,000	109,181	2016/11/21
第875回 政保公営企業債券	1.700	482,000	515,258	2017/05/22
第8回 政保地方公営企業金融機構債券	1.500	651,000	689,903	2019/05/24
第3回 政保地方公共団体金融機構債券	1.500	101,000	106,890	2019/08/16
第5回 地方公共団体金融機構債券	1.395	500,000	522,090	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	519,095	2020/03/13
第15回 政保地方公共団体金融機構債券	1.000	200,000	201,856	2020/08/14
第12回 公営企業金融公庫債券	1.530	300,000	310,932	2014/09/24
第14回 公営企業金融公庫債券	1.450	100,000	103,802	2015/03/24
第15回 公営企業金融公庫債券	1.330	300,000	310,704	2015/06/19
第17回 公営企業金融公庫債券	1.570	100,000	104,675	2015/09/24
第20回 公営企業金融公庫債券	2.050	200,000	214,996	2016/06/20
第24回 公営企業金融公庫債券	1.940	300,000	322,515	2016/12/20
第191回 政保首都高速道路債券	1.800	113,000	117,962	2014/07/29
第142回 政保阪神高速道路債	1.400	100,000	103,616	2014/12/17
第148回 政保阪神高速道路債	1.300	107,000	111,109	2015/09/30
第5回 阪神高速道路・機構承継債	1.790	100,000	103,619	2014/03/20
第176回 政保中小企業債券	1.600	100,000	102,737	2013/09/17
第180回 政保中小企業債券	1.800	142,000	148,194	2014/07/22
第186回 政保中小企業債券	1.300	104,000	107,974	2015/09/15
第26回 中小企業債券	1.990	400,000	411,708	2013/06/20
第15回 国際協力銀行債券	1.740	200,000	207,688	2014/06/20
第8回 国際協力銀行債券	0.650	300,000	301,716	2013/03/19
第12回 国際協力銀行債券	1.600	200,000	206,368	2014/03/20
第2回 都市再生債券	2.150	100,000	104,770	2014/06/20
第19回 都市再生機構債券	2.040	200,000	216,848	2018/03/20
第23回 都市再生機構債券	1.280	200,000	204,006	2013/11/25
第2回 本州四国連絡・機構承継債	1.840	100,000	103,387	2013/12/20
第6回 政保中部国際空港債券	1.400	100,000	102,931	2014/03/26
第11回 住宅金融支援機構債券	1.660	200,000	212,594	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	312,738	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	140,937	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	97,047	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	146,107	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	167,069	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	72,045	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	351,160	365,146	2032/05/10
第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.820	86,733	90,158	2036/12/10
第43回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.280	63,551	67,542	2041/06/10

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44回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.300	247,756	263,661	2041/07/10
第51回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.210	198,087	209,051	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	352,663	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	442,981	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	762,296	2045/05/10
第14回 政保国民生活債券	1.500	132,000	136,884	2014/09/17
第1回 政保東日本高速道路債券	1.600	101,000	106,216	2015/11/25
第2回 政保東日本高速道路債券	1.500	101,000	105,843	2015/12/21
第4回 政保東日本高速道路債券	1.600	170,000	179,270	2016/03/24
第8回 政保中日本高速道路債券	2.000	170,000	183,120	2016/08/12
第21回 政保中日本高速道路債券	1.700	300,000	321,900	2018/05/21
第5回 中日本高速道路債券	1.860	200,000	215,290	2018/09/20
第1回 政保西日本高速道路債券	1.600	201,000	211,381	2015/11/25
第5回 政保西日本高速道路債券	1.800	259,000	277,541	2017/01/25
第6回 政保西日本高速道路債券	1.800	117,000	125,470	2017/02/27
第2回 鉄道建設運輸施設債	1.920	300,000	312,972	2014/06/20
小計	—	29,344,872	30,755,810	—
(金融債券)				
692号 利附商工債	1.200	200,000	202,456	2013/01/25
704号 利附商工債	1.350	200,000	204,928	2014/01/27
706号 利付商工債	1.350	300,000	307,833	2014/03/27
714号 利付商工債	0.900	300,000	305,343	2014/11/27
723号 利付商工債	0.500	300,000	301,257	2015/08/27
694号 利附農林債	1.150	400,000	405,108	2013/03/27
695号 利附農林債	1.150	200,000	202,682	2013/04/26
698号 利附農林債	1.500	300,000	306,540	2013/07/26
701号 利附農林債	1.450	200,000	204,700	2013/10/25
709号 利附農林債	1.150	400,000	408,864	2014/06/27
713号 利附農林債	0.800	300,000	304,062	2014/10/27
717号 利附農林債	0.750	300,000	303,666	2015/02/27
721号 利附農林債	0.600	120,000	120,854	2015/06/26
第217回 利附信金中金債	1.350	200,000	202,668	2012/12/27
第222回 利附信金中金債	1.400	200,000	203,702	2013/05/27
第223回 利附信金中金債	1.500	300,000	306,354	2013/06/27
第226回 利附信金中金債	1.350	300,000	306,351	2013/09/27
第229回 利附信金中金債	1.400	400,000	409,888	2013/12/27
第233回 利附信金中金債	1.350	300,000	308,007	2014/04/25
第236回 利附信金中金債	0.900	300,000	304,887	2014/07/25
第241回 利附信金中金債	0.700	300,000	303,378	2014/12/26
小計	—	5,820,000	5,923,528	—
(普通社債券)				
第345回 東京地下鉄社債	0.610	100,000	100,579	2013/06/20
第9回 G Eキャピタル円貨債	1.770	100,000	101,311	2014/06/02
第12回 G Eキャピタル円貨債	1.545	100,000	100,148	2015/06/03
第14回 G Eキャピタル円貨債	1.840	100,000	101,490	2015/11/20
第2回 J Pモルガン・チェス劣債	1.930	100,000	97,529	2015/11/10
第4回 ゴールドマン・サックス円貨債	1.980	100,000	97,866	2014/05/28
第16回 シティグループ円貨社債	1.580	100,000	97,446	2015/09/16
第22回 シティグループ円貨社債	2.130	200,000	200,306	2014/06/20
第3回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	1.790	100,000	93,058	2014/12/03
第8回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	2.305	100,000	87,076	2017/06/26
第7回 ウェストパック銀行円貨社債	1.070	100,000	100,360	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	102,774	2014/02/10
第1回 キリンホールディングス社債	1.090	100,000	101,184	2013/03/19
第7回 キリンホールディングス社債	1.639	100,000	105,589	2019/11/05
第5回 日本たばこ産業社債	1.128	100,000	102,119	2014/06/03
第25回 住友化学工業社債	1.620	100,000	102,608	2013/11/12
第33回 住友化学社債	1.260	100,000	101,107	2012/12/06

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25回 三菱化学社債	1.800	100,000	101,970	2013/02/05
第34回 三菱化学社債	1.840	100,000	105,532	2016/03/10
第2回 花王社債	1.910	100,000	102,731	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	100,661	2013/06/03
第29回 新日本製鐵社債	3.300	100,000	114,670	2017/03/17
第48回 新日本製鐵社債	1.180	100,000	101,228	2013/02/13
第52回 新日本製鐵社債	1.670	100,000	103,299	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	101,611	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	100,582	2015/05/27
第11回 豊田自動織機社債	1.130	100,000	101,063	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	104,021	2014/09/25
第7回 パナソニック社債	1.404	200,000	205,310	2014/03/20
第10回 パナソニック社債	0.752	200,000	202,402	2016/03/18
第24回 シャープ社債	0.846	200,000	202,862	2014/09/16
第17回 ソニー社債	1.570	100,000	104,062	2015/06/19
第19回 ソニー社債	1.520	100,000	101,780	2013/03/19
第3回 パナソニック電工社債	1.660	100,000	104,545	2015/06/19
第15回 三菱重工業社債	1.030	100,000	100,989	2013/01/31
第19回 三菱重工業社債	2.040	100,000	107,247	2016/09/07
第49回 日産自動車社債	1.931	100,000	104,273	2014/09/19
第7回 トヨタ自動車社債	1.340	300,000	306,891	2013/12/20
第9回 トヨタ自動車社債	1.073	200,000	204,046	2014/06/20
第49回 伊藤忠商事社債	2.280	100,000	109,607	2018/06/20
第45回 三井物産社債	0.790	100,000	100,741	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	106,044	2014/01/27
第14回 クレディセゾン社債	1.200	100,000	100,916	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	206,366	2014/02/12
第7回 みずほコーポレート銀行社債	2.080	100,000	107,874	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	203,814	2013/07/19
第14回 みずほコーポレート銀行社債	1.520	100,000	102,565	2013/12/10
第15回 みずほコーポレート銀行社債	1.325	200,000	204,668	2014/02/27
第18回 みずほコーポレート銀行社債	0.830	200,000	202,694	2014/10/16
第20回 みずほコーポレート銀行社債	0.710	200,000	201,988	2015/04/20
第100回 三菱東京UFJ銀行社債	1.370	200,000	203,980	2013/07/16
第106回 三菱東京UFJ銀行社債	0.905	300,000	304,893	2014/07/17
第112回 三菱東京UFJ銀行社債	0.660	200,000	201,972	2015/01/26
第114回 三菱東京UFJ銀行社債	0.670	200,000	202,046	2015/04/17
第3回2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	1.300	200,000	202,756	2013/06/26
第6回 東京三菱銀行劣後社債	1.730	100,000	103,561	2014/12/22
第8回 東京三菱銀行劣後社債	1.640	200,000	207,186	2015/07/22
第12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.160	200,000	213,932	2017/07/28
第28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.560	200,000	202,218	2021/01/20
第11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.280	200,000	214,824	2016/10/31
第6回 りそな銀行劣後社債	2.084	100,000	103,530	2020/03/04
第4回 住友信託銀行劣後社債	1.670	100,000	103,003	2015/04/28
第7回 住友信託銀行劣後社債	1.950	100,000	104,922	2017/05/10
第5回 住友信託銀行劣後社債	2.250	100,000	105,935	2016/04/27
第45回 三井住友銀行社債	1.230	200,000	204,244	2014/01/20
第47回 三井住友銀行社債	0.910	200,000	203,250	2014/07/18
第51回 三井住友銀行社債	0.350	200,000	199,410	2015/10/20
第6回 三井住友銀行劣後社債	1.710	100,000	102,153	2013/08/01
第7回 三井住友銀行劣後社債	2.010	100,000	103,329	2014/02/05
第8回 三井住友銀行劣後社債	1.950	100,000	103,978	2014/10/22
第9回 三井住友銀行劣後社債	1.750	100,000	103,977	2015/08/17
第11回 三井住友銀行劣後社債	2.170	200,000	213,906	2017/12/20

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20回 三井住友銀行劣後社債	2.210	200,000	214,744	2019/07/24
第1回 みずほ銀行劣後特約付社債	1.700	100,000	102,945	2015/02/03
第6回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.250	100,000	106,174	2016/11/04
第10回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.060	100,000	105,561	2018/01/26
第19回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.140	100,000	105,631	2019/09/27
第38回 N T Tファイナンス社債	0.550	200,000	200,840	2015/06/19
第19回 トヨタファイナンス社債	2.040	100,000	106,841	2016/03/18
第23回 トヨタファイナンス社債	1.970	300,000	321,348	2019/09/20
第40回 トヨタファイナンス社債	1.478	100,000	103,089	2014/06/20
第118回 オリックス社債	2.180	100,000	103,914	2014/07/30
第144回 オリックス社債	1.510	100,000	100,832	2017/12/22
第8回 野村ホールディングス社債	2.120	100,000	105,899	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	103,687	2014/06/13
第17回 野村ホールディングス社債	1.280	200,000	203,688	2014/11/27
第20回 野村ホールディングス社債	0.980	100,000	100,875	2015/03/17
第22回 野村ホールディングス社債	0.937	200,000	201,316	2015/06/24
第24回 三井不動産社債	1.650	100,000	104,845	2015/12/18
第31回 三井不動産社債	1.645	100,000	103,744	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	100,845	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	101,027	2015/04/30
第41回 小田急電鉄社債	2.240	100,000	108,116	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	115,606	2017/08/25
第19回 東日本旅客鉄道社債	2.360	100,000	111,370	2022/02/25
第25回 東日本旅客鉄道社債	0.790	300,000	302,208	2013/03/19
第31回 東日本旅客鉄道社債	1.580	200,000	206,138	2014/03/30
第41回 東日本旅客鉄道社債	1.560	100,000	104,415	2015/09/18
第3回 西日本旅客鉄道社債	3.450	100,000	114,987	2016/12/20
第10回 西日本旅客鉄道社債	2.040	100,000	107,538	2023/09/20
第1回 東海旅客鉄道社債	4.650	100,000	110,251	2014/02/21
第2回 東海旅客鉄道社債	3.950	200,000	231,176	2016/04/25
第6回 東海旅客鉄道社債	2.390	100,000	111,673	2022/02/15
第10回 東海旅客鉄道社債	1.420	190,000	199,156	2017/09/20
第23回 東海旅客鉄道社債	2.140	100,000	109,448	2018/04/25
第3回 東京地下鉄社債	1.900	100,000	106,856	2016/09/20
第48回 日本電信電話社債	1.610	400,000	414,900	2014/09/19
第50回 日本電信電話社債	1.580	100,000	104,533	2015/09/18
第51回 日本電信電話社債	2.060	200,000	214,692	2016/06/20
第58回 日本電信電話社債	1.000	100,000	101,828	2014/06/20
第5回 KDD I社債	3.200	100,000	114,124	2017/04/28
第16回 N T Tドコモ社債	1.260	200,000	204,330	2013/12/20
第18回 N T Tドコモ社債	1.000	200,000	202,202	2013/03/27
第455回 東京電力社債	2.075	200,000	139,134	2018/10/23
第511回 東京電力社債	1.615	100,000	87,340	2014/05/28
第516回 東京電力社債	1.420	100,000	80,718	2015/04/27
第519回 東京電力社債	1.590	372,000	291,495	2015/12/28
第542回 東京電力社債	1.602	500,000	345,300	2018/04/25
第407回 中部電力社債	3.400	100,000	110,135	2015/07/24
第409回 中部電力社債	3.900	300,000	343,386	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	102,859	2014/12/25
第468回 中部電力社債	1.430	100,000	102,580	2015/02/25
第471回 中部電力社債	1.310	300,000	306,939	2015/06/25
第476回 中部電力社債	2.120	100,000	107,340	2018/06/25
第478回 中部電力社債	1.890	100,000	105,366	2016/09/23
第480回 中部電力社債	1.790	200,000	210,082	2017/01/25

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484回 中部電力社債	1.410	200,000	204,672	2014/09/25
第487回 中部電力社債	1.209	140,000	141,905	2013/11/25
第496回 中部電力社債	1.227	500,000	498,165	2020/07/24
第410回 関西電力社債	2.000	300,000	319,614	2018/11/22
第423回 関西電力社債	1.500	100,000	101,662	2013/06/25
第437回 関西電力社債	1.300	200,000	204,198	2014/11/25
第441回 関西電力社債	1.460	200,000	205,596	2015/04/24
第446回 関西電力社債	1.780	200,000	209,152	2016/03/18
第298回 中国電力社債	4.100	200,000	224,558	2015/05/25
第310回 中国電力社債	3.225	200,000	226,696	2017/07/25
第341回 中国電力社債	1.550	100,000	102,583	2014/06/25
第350回 中国電力社債	1.570	200,000	205,750	2014/10/24
第245回 北陸電力社債	3.800	200,000	222,868	2015/06/25
第260回 北陸電力社債	2.330	100,000	108,868	2020/05/25
第281回 北陸電力社債	1.970	200,000	212,752	2018/04/25
第289回 北陸電力社債	1.410	300,000	307,449	2014/12/25
第368回 東北電力社債	4.800	300,000	331,404	2014/04/25
第375回 東北電力社債	3.700	100,000	110,852	2015/06/25
第380回 東北電力社債	3.550	300,000	340,521	2016/11/25
第420回 東北電力社債	1.360	100,000	101,732	2014/02/25
第427回 東北電力社債	1.430	200,000	205,304	2015/09/25
第432回 東北電力社債	2.090	500,000	528,965	2016/05/25
第237回 四国電力社債	2.050	100,000	107,012	2018/11/22
第257回 四国電力社債	1.390	200,000	204,964	2015/02/25
第374回 九州電力社債	1.500	300,000	305,574	2013/09/25
第382回 九州電力社債	1.440	100,000	102,647	2015/02/25
第383回 九州電力社債	1.460	100,000	102,798	2015/04/24
第387回 九州電力社債	1.690	200,000	208,412	2016/03/25
第257回 北海道電力社債	3.850	200,000	227,654	2016/04/25
第282回 北海道電力社債	1.440	200,000	203,856	2013/12/25
第284回 北海道電力社債	1.480	500,000	516,225	2016/02/25
第286回 北海道電力社債	1.530	100,000	102,756	2014/10/24
第2回 電源開発社債	1.610	100,000	101,849	2013/06/20
第4回 電源開発社債	1.320	200,000	203,130	2013/12/20
第6回 電源開発社債	1.550	100,000	102,632	2014/09/19
第14回 電源開発社債	1.560	100,000	103,217	2015/09/18
第17回 電源開発社債	2.070	100,000	105,857	2016/06/20
第14回 東京ガス社債	5.100	100,000	113,216	2014/07/25
第24回 東京瓦斯社債	1.410	200,000	204,790	2013/12/02
第9回 大阪ガス社債	2.900	100,000	113,993	2018/01/30
第24回 大阪瓦斯社債	1.590	100,000	103,770	2014/10/24
第27回 大阪瓦斯社債	1.199	100,000	101,933	2013/11/27
第20回 N T Tデータ社債	1.100	100,000	101,386	2013/06/20
小計	—	27,602,000	28,363,789	—
合計	—	386,324,482	403,796,825	—

■投資信託財産の構成

2011年10月11日現在

項 目	第 8 作 成 期 末	
	評 価 額	比 率
投 資 信 託 受 益 証 券	千円 2,666,033	% 97.6
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	10,923	0.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	53,521	2.0
投 資 信 託 財 産 総 額	2,730,477	100.0

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2011年5月11日)、 (2011年6月13日)、 (2011年7月11日)、 (2011年8月11日)、 (2011年9月12日)、 (2011年10月11日)現在

項 目	第 41 期 末	第 42 期 末	第 43 期 末	第 44 期 末	第 45 期 末	第 46 期 末
(A) 資 産	4,038,307,426円	3,701,769,988円	3,594,929,214円	3,120,682,976円	3,030,184,786円	2,730,477,177円
コール・ローン等	76,515,661	89,632,340	77,154,676	55,469,358	46,162,341	44,650,035
投資信託受益証券(評価額)	3,921,613,160	3,589,224,730	3,506,985,645	3,054,359,385	2,963,464,245	2,666,033,725
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	10,781,205	10,773,518	10,788,893	10,854,233	10,904,200	10,923,417
未 収 入 金	—	12,139,400	—	—	9,654,000	8,870,000
未 収 配 当 金	29,397,400	—	—	—	—	—
(B) 負 債	42,274,684	50,672,234	38,291,020	40,015,251	34,903,865	38,322,883
未 払 収 益 分 配 金	36,240,714	33,572,595	32,246,362	30,946,911	30,314,791	29,708,907
未 払 解 約 金	3,124,457	14,237,000	3,745,127	6,677,149	2,331,461	6,749,645
未 払 信 託 報 酬	2,892,359	2,845,758	2,285,974	2,377,092	2,244,308	1,853,339
そ の 他 未 払 費 用	17,154	16,881	13,557	14,099	13,305	10,992
(C) 純資産総額(A-B)	3,996,032,742	3,651,097,754	3,556,638,194	3,080,667,725	2,995,280,921	2,692,154,294
元 本	7,248,142,922	6,714,519,107	6,449,272,413	6,189,382,252	6,062,958,370	5,941,781,421
次 期 繰 越 損 益 金	△3,252,110,180	△3,063,421,353	△2,892,634,219	△3,108,714,527	△3,067,677,449	△3,249,627,127
(D) 受 益 権 総 口 数	7,248,142,922口	6,714,519,107口	6,449,272,413口	6,189,382,252口	6,062,958,370口	5,941,781,421口
1万口当たり基準価額(C/D)	5,513円	5,438円	5,515円	4,977円	4,940円	4,531円

<注記事項>	2011年5月11日	2011年6月13日	2011年7月11日	2011年8月11日	2011年9月12日	2011年10月11日
期首元本額	7,639,296,323円	7,248,142,922円	6,714,519,107円	6,449,272,413円	6,189,382,252円	6,062,958,370円
期中追加設定元本額	20,816,486円	35,838,240円	61,130,831円	41,378,284円	25,564,264円	20,366,550円
期中一部解約元本額	411,969,887円	569,462,055円	326,377,525円	301,268,445円	151,988,146円	141,543,499円

■損益の状況

〔自 2011年4月12日 至 2011年5月11日〕〔自 2011年5月12日 至 2011年6月13日〕〔自 2011年6月14日 至 2011年7月11日〕〔自 2011年7月12日 至 2011年8月11日〕〔自 2011年8月12日 至 2011年9月12日〕〔自 2011年9月13日 至 2011年10月11日〕

項 目	第 41 期	第 42 期	第 43 期	第 44 期	第 45 期	第 46 期
(A) 配 当 等 收 益	29,381,957円	27,470,840円	26,205,793円	25,239,772円	24,693,466円	24,117,182円
受 取 配 当 金	29,376,754	27,467,394	26,202,588	25,237,149	24,691,583	24,115,482
受 取 利 息	5,203	3,446	3,205	2,623	1,883	1,700
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 264,998,025	△ 41,724,787	58,124,195	△ 323,805,785	△ 14,594,427	△ 235,587,336
売 買 益	5,428,014	755,223	59,067,093	6,656,609	567,997	3,512,566
売 買 損	△ 270,426,039	△ 42,480,010	△ 942,898	△ 330,462,394	△ 15,162,424	△ 239,099,902
(C) 信 託 報 酬 等	△ 2,909,513	△ 2,862,639	△ 2,299,531	△ 2,391,191	△ 2,257,613	△ 1,864,331
(D) 当 期 繰 上 損 益 (A+B+C)	△ 238,525,581	△ 17,116,586	82,030,457	△ 300,957,204	7,841,426	△ 213,334,485
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 1,454,465,081	△ 1,593,554,146	△ 1,564,619,101	△ 1,444,353,477	△ 1,732,759,945	△ 1,714,363,489
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,522,878,804	△ 1,419,178,026	△ 1,377,799,213	△ 1,332,456,935	△ 1,312,444,139	△ 1,292,220,246
(配 当 等 相 当 額)	(173,250,714)	(161,254,638)	(156,098,749)	(150,572,980)	(147,931,662)	(145,286,794)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,696,129,518)	(△ 1,580,432,664)	(△ 1,533,897,962)	(△ 1,483,029,915)	(△ 1,460,375,801)	(△ 1,437,507,040)
(G) 計 (D+E+F)	△ 3,215,869,466	△ 3,029,848,758	△ 2,860,387,857	△ 3,077,767,616	△ 3,037,362,658	△ 3,219,918,220
(H) 収 益 分 配 金	△ 36,240,714	△ 33,572,595	△ 32,246,362	△ 30,946,911	△ 30,314,791	△ 29,708,907
次 期 繰 上 損 益 金 (G+H)	△ 3,252,110,180	△ 3,063,421,353	△ 2,892,634,219	△ 3,108,714,527	△ 3,067,677,449	△ 3,249,627,127
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 1,522,878,804	△ 1,419,178,026	△ 1,377,799,213	△ 1,332,456,935	△ 1,312,444,139	△ 1,292,220,246
(配 当 等 相 当 額)	(173,250,714)	(161,254,638)	(156,098,749)	(150,572,980)	(147,931,662)	(145,286,794)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 1,696,129,518)	(△ 1,580,432,664)	(△ 1,533,897,962)	(△ 1,483,029,915)	(△ 1,460,375,801)	(△ 1,437,507,040)
分 配 準 備 積 立 金	150,688,719	129,914,482	116,879,177	103,355,211	92,958,336	83,349,488
繰 越 損 益 金	△ 1,879,920,095	△ 1,774,157,809	△ 1,631,714,183	△ 1,879,612,803	△ 1,848,191,646	△ 2,040,756,369

(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

第41期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (26,484,436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 (0円)、信託約款に規定される収益調整金 (173,250,714円) 及び分配準備積立金 (160,444,997円) より分配対象収益は 360,180,147円 (1万口当たり496.93円) であり、うち36,240,714円 (1万口当たり50円) を分配金額としております。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。(以下、各期間において同じ。)

第42期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (24,621,546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 (0円)、信託約款に規定される収益調整金 (161,254,638円) 及び分配準備積立金 (138,865,531円) より分配対象収益は 324,741,715円 (1万口当たり483.64円) であり、うち33,572,595円 (1万口当たり50円) を分配金額としております。

第43期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (25,502,304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 (0円)、信託約款に規定される収益調整金 (156,098,749円) 及び分配準備積立金 (123,623,235円) より分配対象収益は 305,224,288円 (1万口当たり473.27円) であり、うち32,246,362円 (1万口当たり50円) を分配金額としております。

第44期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (22,861,044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 (0円)、信託約款に規定される収益調整金 (150,572,980円) 及び分配準備積立金 (111,441,078円) より分配対象収益は 284,875,102円 (1万口当たり460.26円) であり、うち30,946,911円 (1万口当たり50円) を分配金額としております。

第45期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (22,448,916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 (0円)、信託約款に規定される収益調整金 (147,931,662円) 及び分配準備積立金 (100,824,211円) より分配対象収益は 271,204,789円 (1万口当たり447.31円) であり、うち30,314,791円 (1万口当たり50円) を分配金額としております。

第46期 計算期間末における費用控除後の配当等収益 (22,264,550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 (0円)、信託約款に規定される収益調整金 (145,286,794円) 及び分配準備積立金 (90,793,845円) より分配対象収益は 258,345,189円 (1万口当たり434.79円) であり、うち29,708,907円 (1万口当たり50円) を分配金額としております。

■分配金のお知らせ

決 算 期	第 41 期	第 42 期	第 43 期	第 44 期	第 45 期	第 46 期
1 万口当たり分配金	50円	50円	50円	50円	50円	50円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「特別分配金」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が特別分配金、残りの額が普通分配金となります。
- ・特別分配金が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該特別分配金を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

D I A Mマルチカレンシーファンド（JPY）クラスF

当ファンドは「D I A M高金利通貨ファンド」が投資対象とする円建外国投資信託です。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

形態	ルクセンブルグ籍 円建外国投資信託受益証券
主要投資対象	<ul style="list-style-type: none"> ・日本国債および新興国を含む世界の国の通貨建て債券（国債、政府機関債、政府保証債、国際機関債、社債、資産担保証券等）およびコマーシャルペーパー等の短期証券 ・新興国を含む世界の国の通貨に関する為替予約取引（NDFを含みます）、為替先渡取引等の金融派生商品
投資態度	<ul style="list-style-type: none"> ・新興国を含む世界の中で、相対的に金利の高い複数の通貨を選定し、当該通貨を買い持ちする為替予約取引を活用することで実質的に当該通貨建て金利の獲得をめざします。 ・通貨の選定に当たっては、一定の信用格付^(注)以上を有する国の通貨の中から、為替予約取引の流動性、投資規制、市場規模等を勘案し、相対的に金利の高い8通貨を選定することを基本とし、そのうち1通貨は米ドル、英ポンド、ユーロの主要3通貨の中から選定することとします。 <div style="border: 1px solid black; padding: 5px; margin: 5px 0;"> <p>(注) 当初組入れ時において、S & PもしくはMoody'sの自国通貨建長期債務格付がBB-もしくはBa3格以上を取得している国の通貨とします。(ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか高い方の格付を基準とします。)</p> </div> <ul style="list-style-type: none"> ・為替予約取引の取引相手先は、S & PもしくはMoody'sの発行体格付がA-もしくはA3格以上を取得している金融機関とします。(ただし、両社が格付を付与している場合には、どちらか高い方の格付を基準とします。) ・為替予約取引の期間は原則として6ヵ月以内とします。 ・外貨建資産については、原則として対円での為替ヘッジを行いません。
運用会社	DIAM International Ltd

D I AMマルチカレンシーファンド（JPY）クラスFはルクセンブルグ籍円建外国投資信託受益証券で、2010年12月31日に会計期間が終了し、現地の公認会計士による財務諸表監査を受けて完了しています。以下の「損益計算書および純資産変動計算書」及び「組入投資有価証券明細」等は、2010年12月31日現在の財務諸表の原文の一部を翻訳したものです。

損益計算書および純資産変動計算書
2010年12月31日に終了した会計期間
（日本円で表示）

	(円)
期首時点の純資産	8,729,133,635
収益	
預金利息	1,896
債券利息	98,325,070
収益合計	98,326,966
費用	
投資運用報酬および運用会社報酬	16,785,013
管理手数料	5,779,802
専門家報酬	5,383,712
設定費用償却	367,136
保管費用	2,029,839
年次税（“Taxe d’abonnement”）	598,747
その他費用	890,320
費用合計	31,834,569
投資損益	66,492,397
<hr/>	
投資損益繰越額	66,492,397
投資有価証券売却実現損益	(99,976,792)
通貨および為替予約取引に係る実現損益	(237,889,341)
当期実現損益	(337,866,133)
投資有価証券未実現損益の変動	42,083,986
為替予約取引に係る未実現損益の変動	(246,124,670)
運用における純資産の増減	(475,414,420)
ファンドの受益証券の追加設定による純資産増加額	220,500,000
ファンドの受益証券の一部解約による純資産減少額	(2,855,439,400)
追加設定および一部解約による純資産増加額	(2,634,939,400)
支払分配金	(839,462,616)
期末時点の純資産	4,779,317,199

組入投資有価証券明細
2010年12月31日現在
(日本円で表示)

額面	銘柄	通貨	取得原価		評価額	純資産価値 に対する比率	
			日本円	日本円			%
公認の証券取引所に上場されている、もしくはその他の規制市場で取引されている譲渡可能な有価証券							
債券							
オーストリア							
350,000,000	PFANDBRIEF 15/02/11	OST LANDES HYPO	1.600%	日本円	351,445,000	350,280,000	7.33
	オーストリア小計				351,445,000	350,280,000	7.33
ドイツ							
2,370,000,000	KREDITANSTALT 22/03/10	FUR WIEDERAUFBAU	0.750%	日本円	2,378,248,000	2,372,844,000	49.65
	ドイツ小計				2,378,248,000	2,372,844,000	49.65
オランダ							
350,000,000	RABOBANK NEDERLAND	0.800% 03/02/11		日本円	350,797,500	350,140,000	7.33
	オランダ小計				350,797,500	350,140,000	7.33
	債券合計				3,080,490,500	3,073,264,000	64.31
ゼロクーポン債							
オーストラリア							
5,000,000	AUSTRALIAN 21/01/11	(COMMONWEALTH OF)	0.000%	オーストラ リア・ドル	405,485,918	414,540,274	8.67
	オーストラリア小計				405,485,918	414,540,274	8.67
	ゼロクーポン債				405,485,918	414,540,274	8.67
	投資有価証券合計				3,485,976,418	3,487,804,274	72.98

為替予約取引の残高
2010年12月31日現在

通貨	購入金額	通貨	売却金額	満期日	未実現利益／(損失) (日本円)
エジプト・ポンド	20,000,000	日本円	285,360,000	2011/1/18	(7,087,647)
トルコ・リラ	15,000,000	日本円	835,500,000	2011/1/18	(46,972,437)
インド・ルピー	518,000,000	日本円	951,566,000	2011/1/18	(15,087,211)
オーストラリア・ドル	5,000,000	日本円	409,250,000	2011/1/18	5,497,326
南アフリカ・ランド	70,500,000	日本円	839,732,550	2011/1/18	22,196,474
英ポンド	1,500,000	日本円	195,787,500	2011/1/18	(5,351,143)
日本円	36,216,000	南アフリカ・ランド	3,000,000	2011/1/18	(459,187)
ブラジル・レアル	17,000,000	日本円	826,091,200	2011/1/28	(2,200,814)
日本円	55,350,000	インド・ルピー	30,000,000	2011/1/18	1,110,957
					<u>(48,353,682)</u>

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高金利通貨ファンド」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"> ・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				
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)



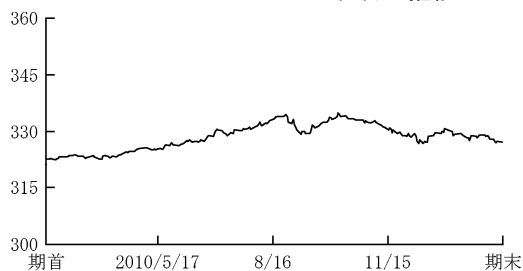
期 首	期中高値	期中安値	期 末
2010. 2. 15	2010. 10. 6	2010. 2. 22	2011. 2. 14
10,931円	11,337円	10,923円	11,081円

《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。

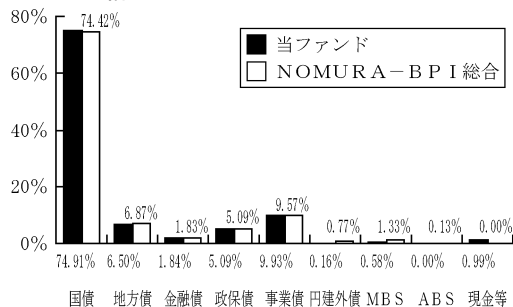
《今後の運用方針》

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。

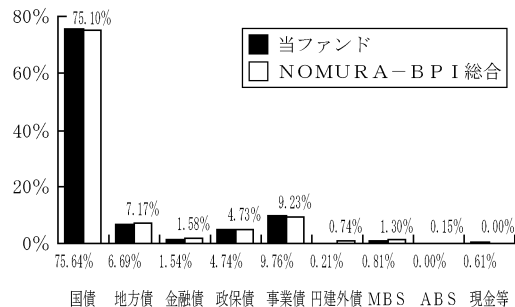
【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】 (注) 組入比率は純資産総額比です。

期首 (前期末)

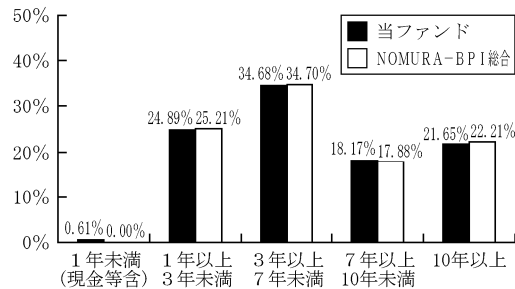
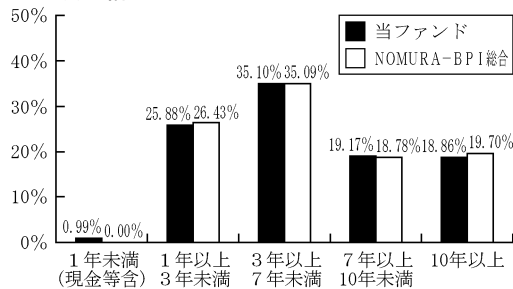
セクター別構成比



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	1,580,994	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338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	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	2014/08/20
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44回 東京電力社債	3.075	200,000	227,392	2017/09/22
第45回 東京電力社債	2.075	200,000	213,888	2018/10/23
第45回 東京電力社債	2.050	100,000	106,746	2018/11/16
第47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520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国内債券バッシブ・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国内債券バッシブファンド(適格機関投資家向け)	17,805,464,716円
D I AM国内債券バ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。