

## 運用報告書

第3期<決算日2011年8月12日>

# DIAMロシア株式ファンド

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／株式
信託期間	信託期間は2008年8月29日から2018年8月13日までとします。
運用方針	信託財産の成長を図ることを目標として運用を行います。
主要運用対象	ルクセンブルグ籍円建投資信託である「スウェッドバンク・ロポー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラスJ P Y」投資信託証券、および「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」受益証券への投資を通じて、高い経済成長が期待されるロシアの株式等を実質的な主要投資対象とします。
組入制限	投資信託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。 株式への直接投資は行いません。
分配方針	決算日（原則として8月12日）に、経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象とし、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。この場合、原則として実質的な投資対象である株式等の配当等収益に応じて分配することとし、売買益（評価益を含みます。）は信託財産内に留保することとします。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAMロシア株式ファンド」は、2011年8月12日に第3期の決算を行いました。

ここに、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-506-860

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

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

## DIAMアセットマネジメント

東京都千代田区丸の内3-3-1

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

# D I A Mロシア株式ファンド

## ■設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCIロシア10-40指数 (円換算ベース、配当 込み、為替ヘッジなし)		投資証券 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	(参考指数)	期中 騰落率				
(設定日) 2008年8月29日	円 10,000	円 —	% —	ポイント (8月28日) 149,136.63	% —	% —	% —	% —	百万円 —
1期(2009年8月12日)	6,539	0	△34.6	90,531.33	△39.3	95.6	1.0	—	1,053
2期(2010年8月12日)	8,372	0	28.0	113,279.45	25.1	95.6	1.4	—	810
3期(2011年8月12日)	7,965	0	△4.9	109,894.81	△3.0	95.3	1.1	—	1,003

(注1) 設定日の基準価額は、設定当初の投資元本です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを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) MSCIロシア10-40指数は、MSCI Inc. が公表しているインデックスで、当指数に関する著作権、知的所有権その他一切の権利はMSCI Inc. に属しており、また、MSCI Inc. は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。また、当指数については、わが国の対顧客電信売買相場の仲値によりDIAMが独自に邦貨換算しています。

## ■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		MSCIロシア10-40指数 (円換算ベース、配当 込み、為替ヘッジなし)		投資証券 組入比率	債券組入 比率	債券先物 比率
	騰落率	(参考指数)	騰落率				
(期首) 2010年8月12日	円 8,372	% —	ポイント 113,279.45	% —	% 95.6	% 1.4	% —
8月末	8,151	△2.6	110,255.46	△2.7	95.5	1.4	—
9月末	8,576	2.4	116,757.98	3.1	95.6	1.4	—
10月末	8,717	4.1	118,472.63	4.6	94.0	1.4	—
11月末	9,101	8.7	124,812.56	10.2	94.0	1.2	—
12月末	9,867	17.9	134,309.12	18.6	90.7	1.2	—
2011年1月末	10,382	24.0	141,268.46	24.7	96.7	1.2	—
2月末	10,410	24.3	143,735.48	26.9	96.4	1.2	—
3月末	11,047	32.0	154,133.97	36.1	94.2	1.1	—
4月末	10,794	28.9	149,989.54	32.4	93.5	1.0	—
5月末	10,011	19.6	140,455.08	24.0	95.3	1.0	—
6月末	10,160	21.4	142,386.19	25.7	97.8	1.0	—
7月末	10,212	22.0	142,819.85	26.1	96.2	0.9	—
(期末) 2011年8月12日	円 7,965	% △4.9	ポイント 109,894.81	% △3.0	% 95.3	% 1.1	% —

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを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。

## ■当期の運用経過（2010年8月13日から2011年8月12日まで）



期首	期中高値	期中安値	期末
2010. 8. 12	2011. 4. 7	2010. 8. 26	2011. 8. 12
8,372円	11,718円	7,874円	7,965円



## 《投資環境》

当期は、FRB（米連邦準備理事会）がQE2（量的金融緩和第2弾）実施に動いたことを背景に、ロシアを始め世界の株式市場は2011年4月までほぼ一直線で上昇する展開となりました。2011年4月中旬以降は、QE2の終了、欧州債務問題の拡大、格付機関S&Pによる米国の格下げ、世界的な景況感の悪化などを背景に、株式市場は下落する展開となりました。

### ロシア株式市場

当期のロシア株式市場は、期初から2011年4月中旬までは上昇したものの、その後は下落する展開となりました。2010年8月末にバーナンキFRB議長が、米国の雇用環境の改善の遅れなどに対応するためQE2の実施を示唆し、11月にQE2の実施が決定されました。こうした中、緩和的な米国の金融政策が好感され、ロシアを含め世界の株式市場は上昇する展開となりました。2011年に入ると、民主化運動の高まりを受け中東情勢が不安定化する中、原油価格が上昇する展開となりました。世界景気の改善と、ロシアで最も重要な産業の一つである原油価格が上昇したことを背景に、ロシア株式市場は2011年4月中旬にかけて上昇して推移しました。しかしその後、欧州債務問題がイタリアやスペインに拡大の様相を示したこと、米国財政を巡る大統領と議会間の対立激化、格付機関S&Pによる米国の格下げ、米国や中国などにおける景況感の悪化が確認されたことを背景に、8月初旬にかけて世界的にリスク回避の動きが拡大しました。ロシアを含む世界の株式市場は、短期間の内に大幅に下落する展開となりました。

当期の主要株価指数の騰落率は、前期末比でRTS指数が+10.15%、MICEX指数が+6.91%、ロンドン市場に上場する優良銘柄で構成されるDR（預託証券）指数が▲0.55%となりました。

## 国内債券市場

当期の長期金利（10年国債利回り）は、0.8%前半～1.3%台半ばの範囲で推移し、当期末は1.040%となり、前期末の0.995%とほぼ同水準となりました。

期初は債券価格は一旦下落（利回りは上昇）する局面も見られたものの、その後は上昇（利回りは低下）する展開となり、日銀による追加金融緩和を受けて2010年10月6日には長期金利は大幅に低下（価格は上昇）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、株式市場が上昇してきたことなどを受けて、長期金利は上昇（価格は下落）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、その後2011年4月にかけて1.1%から1.3%台半ば程度の水準での揉み合いとなりました。5月以降は、ギリシャをはじめとする欧州の債務問題や景気減速懸念が広がったことなどから、債券価格は上昇（利回りは低下）しました。期末にかけては、株式市場が急落したこともあり、長期金利は一段と低下し、再び一時1.0%を割り込む水準となりました。

## 《運用経過》

当ファンドではスウェーデン・ロボアドバイザー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス J P Y 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ています。

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は7,965円となり、前期末に比べ4.86%下落しました。

### 基準価額の騰落要因

高位に組入れたスウェーデン・ロボアドバイザー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス J P Y が下落し、当ファンドの基準価額も下落しました。

### 参考指数の推移

参考指数であるMSCIロシア10-40指数（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）は2.99%の下落となりました。

### 参考指数との差異およびその要因

当ファンドは参考指標を1.87%下回りました。

高位に組入れていたスウェーデン・ロボアドバイザー インターナショナル ロシアエクイティ サブ ファンド クラス J P Y がベンチマーク比で下落したことや信託報酬などが、マイナスに寄与しました。

## スウェードバンク・ロポー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス J P Y

### 基準価額の推移

当期末の基準価額は前期末に比べ3.54%下落しました。

### 基準価額の騰落要因

期間：期初～2011年4月中旬

〔上昇要因〕世界的な景況感の改善や、中東情勢の不安定化を受けた原油価格の上昇を背景に、ロシア株式市場全体が上昇したこと。

期間：2011年4月中旬～期末

〔下落要因〕世界的な景況感の悪化、欧州債務問題、米国の格下げなどを受けて、原油価格や株式市場などが下落したこと。また、為替市場において円高が進行し円ベースの収益率にマイナスに寄与したこと。

### ベンチマークの推移

ベンチマークであるMSCIロシア10-40指数（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）は2.99%下落しました。

### ベンチマークとの差異およびその要因

当ファンドはベンチマークを0.55%下回りました。

情報技術セクターの保有銘柄が上昇したことがプラスに寄与した一方、通信、公益関連銘柄の保有銘柄が下落したことがマイナスに寄与しました。

## 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

当期末の基準価額は11,288円となり、前期末に比べ0.17%上昇しました。

### 基準価額の騰落要因

利息収入を得たこと。ギリシャ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、利回りが低下したこと。

### ベンチマークの推移

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、0.27%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▲0.10%と、ベンチマークにはほぼ連動した運用成果となりました。

## 収益分配金

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

## 《今後の投資環境および運用方針》

引き続き、スウェドバンク・ロボー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス J P Y を高位に組入れ、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率は低位を維持します。

### スウェドバンク・ロボー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス J P Y

今後のロシア株式市場は、引き続き値動きの大きい展開が予想されます。世界景気の先行きに不透明感が高まる中、財政面で余裕のない欧米の金融政策当局は難しい決断を迫られている状況です。欧州債務問題は一朝一夕での解決は難しく、今後も波乱含みの展開が予想されます。また、2012年はロシアをはじめ、米国やフランスなどで大統領選挙を迎えることから、政策を巡る議論が活発化することが予想されます。このように、各国の政策を巡り投資環境は複雑化すると予想されることから、株式市場もその動向に一喜一憂する展開になることが予想されます。一方、ロシア経済を取り巻く環境については、今後も民営化の推進やロシアのWTO（世界貿易機関）加盟に向けた動きの進展などが期待されます。これまでは新興諸国で物価上昇圧力が高まりましたが、ロシアでは既に政策金利の引き上げなどで対処しており、今後沈静化して行くことが期待されます。ロシア株式市場はP E R（株価収益率）面で割安な水準にあると見られ、今後も魅力度の高い投資機会を提供すると考えます。

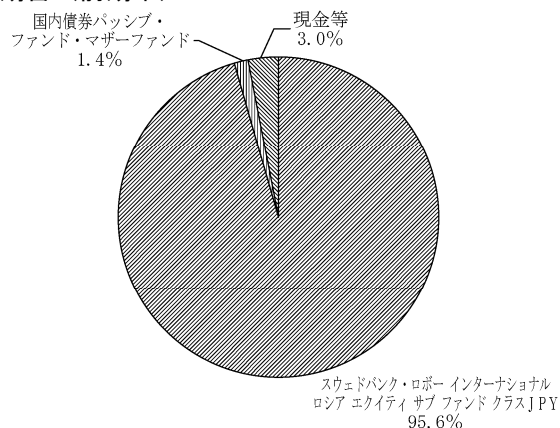
ポートフォリオ戦略としては、エネルギー関連への投資割合をやや低めとする一方、資本財や素材関連を嗜好する方針です。

### 国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

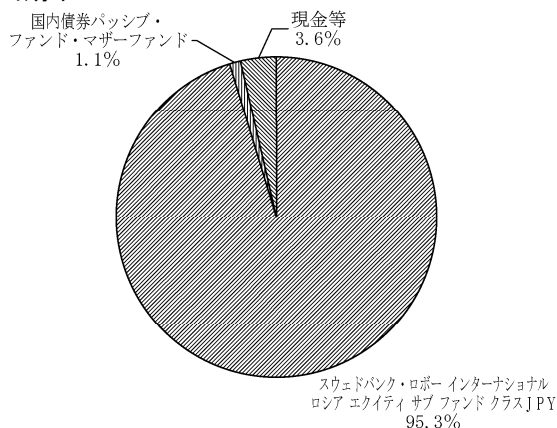
当マザーファンドでは引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力近づけることにより、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果を目指した運用を行います。

## ポートフォリオ構成 ※比率は純資産総額比です。

### 期首（前期末）



### 当期末



## ■ 1万円（元本10,000円）当たりの費用の明細

項 目	当 期
(a) 信 託 報 酬 ( 投 信 会 社 ) ( 販 売 会 社 ) ( 受 託 銀 行 )	126円 ( 50 ) ( 72 ) ( 4 )
(b) 保 管 費 用 等	0
合 計	126

(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（2010年8月13日から2011年8月12日まで）

### 投資証券

		買 付		売 付	
		口 数	金 額	口 数	金 額
外国 邦貨建	スウェーデン・ロボー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス JPY	千口 70	千円 653,000	千口 41	千円 377,208

(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（2010年8月13日から2011年8月12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（2010年8月13日から2011年8月12日まで）

期中の利害関係人との取引はありません。

(注) 利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人です。

## ■ 組入資産の明細

### (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	前 期 末	当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
スウェーデン・ロボー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス JPY	口 102,341	口 130,957	百万円 956	% 95.3
合 計	102,341	130,957	956	95.3

(注) 比率は純資産に対する比率です。

### (2) 親投資信託残高

	前 期 末	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 10,126	千口 10,126	千円 11,430

(注) 親投資信託合計の受益権口数は375,161,685千口です。

<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8月12日現在							
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格 以下組入比率	残存期間別組入比率			%
					5年以上	2年以上	2年未満	
国債証券	千円 310,170,000	千円 322,271,929	% 76.1	% —	% 45.2	% 19.5	% 11.4	%
地方債証券	27,477,400	28,696,141	6.8	—	2.2	4.1	0.5	
特殊債証券 (除く金融債)	30,438,012	31,832,602	7.5	—	3.8	3.0	0.7	
金融債券	6,220,000	6,335,847	1.5	—	—	1.0	0.5	
普通社債券	29,802,000	30,572,383	7.2	—	1.7	4.4	1.1	
合計	404,107,412	419,708,902	99.1	—	52.9	32.0	14.2	

(注) 組入比率は、2011年8月12日現在のマザーファンド純資産総額（423,466,794千円）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

2011年8月12日現在					
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296回 利付国庫債券(2年)	0.100	2,500,000	2,499,450	2012/09/15	
第297回 利付国庫債券(2年)	0.100	3,000,000	2,999,280	2012/10/15	
第298回 利付国庫債券(2年)	0.100	2,000,000	1,999,360	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	2,002,100	2013/01/15	
第301回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,080	2013/02/15	
第302回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,040	2013/03/15	
第303回 利付国庫債券(2年)	0.200	1,500,000	1,501,605	2013/04/15	
第304回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,080	2013/05/15	
第305回 利付国庫債券(2年)	0.200	2,000,000	2,002,180	2013/06/15	
第66回 利付国庫債券(5年)	1.100	5,700,000	5,760,933	2012/09/20	
第68回 利付国庫債券(5年)	1.100	2,000,000	2,026,120	2012/12/20	
第69回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,800,000	3,839,444	2012/12/20	
第70回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,900,000	4,951,646	2013/03/20	
第72回 利付国庫債券(5年)	1.500	4,200,000	4,304,874	2013/06/20	
第75回 利付国庫債券(5年)	1.100	4,600,000	4,691,172	2013/09/20	
第78回 利付国庫債券(5年)	0.900	3,500,000	3,560,410	2013/12/20	
第81回 利付国庫債券(5年)	0.800	4,500,000	4,571,865	2014/03/20	
第83回 利付国庫債券(5年)	0.900	4,400,000	4,487,604	2014/06/20	
第85回 利付国庫債券(5年)	0.700	3,500,000	3,551,590	2014/09/20	
第87回 利付国庫債券(5年)	0.500	4,000,000	4,034,480	2014/12/20	
第88回 利付国庫債券(5年)	0.500	4,500,000	4,538,385	2015/03/20	
第89回 利付国庫債券(5年)	0.400	5,500,000	5,525,080	2015/06/20	
第91回 利付国庫債券(5年)	0.400	1,700,000	1,706,868	2015/09/20	
第92回 利付国庫債券(5年)	0.300	4,000,000	4,000,000	2015/09/20	
第93回 利付国庫債券(5年)	0.500	5,800,000	5,845,936	2015/12/20	
第95回 利付国庫債券(5年)	0.600	2,000,000	2,024,400	2016/03/20	
第96回 利付国庫債券(5年)	0.500	3,000,000	3,022,350	2016/03/20	
第97回 利付国庫債券(5年)	0.400	1,500,000	1,503,570	2016/06/20	

2011年8月12日現在					
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2回 利付国庫債券(40年)	2.200	600,000	595,710	2049/03/20	
第3回 利付国庫債券(40年)	2.200	1,000,000	989,670	2050/03/20	
第243回 利付国庫債券(10年)	1.100	1,400,000	1,414,966	2012/09/20	
第246回 利付国庫債券(10年)	0.800	1,900,000	1,917,176	2012/12/20	
第247回 利付国庫債券(10年)	0.800	700,000	707,378	2013/03/20	
第250回 利付国庫債券(10年)	0.500	2,060,000	2,073,616	2013/06/20	
第254回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,700,000	2,770,686	2013/09/20	
第256回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,500,000	2,572,325	2013/12/20	
第258回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,000,000	1,028,860	2014/03/20	
第260回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,100,000	2,183,055	2014/06/20	
第263回 利付国庫債券(10年)	1.600	2,700,000	2,814,885	2014/09/20	
第266回 利付国庫債券(10年)	1.400	3,700,000	3,842,931	2014/12/20	
第269回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,500,000	1,555,740	2015/03/20	
第270回 利付国庫債券(10年)	1.300	1,900,000	1,974,005	2015/06/20	
第272回 利付国庫債券(10年)	1.400	2,100,000	2,193,828	2015/09/20	
第274回 利付国庫債券(10年)	1.500	2,400,000	2,522,352	2015/12/20	
第277回 利付国庫債券(10年)	1.600	3,000,000	3,172,230	2016/03/20	
第280回 利付国庫債券(10年)	1.900	2,800,000	3,008,012	2016/06/20	
第282回 利付国庫債券(10年)	1.700	2,900,000	3,093,575	2016/09/20	
第284回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,100,000	3,312,505	2016/12/20	
第285回 利付国庫債券(10年)	1.700	5,100,000	5,457,969	2017/03/20	
第286回 利付国庫債券(10年)	1.800	3,700,000	3,985,418	2017/06/20	
第288回 利付国庫債券(10年)	1.700	3,600,000	3,861,144	2017/09/20	
第289回 利付国庫債券(10年)	1.500	4,400,000	4,669,016	2017/12/20	
第290回 利付国庫債券(10年)	1.400	4,200,000	4,431,210	2018/03/20	
第293回 利付国庫債券(10年)	1.800	5,000,000	5,408,450	2018/06/20	
第296回 利付国庫債券(10年)	1.500	4,000,000	4,244,920	2018/09/20	
第297回 利付国庫債券(10年)	1.400	4,200,000	4,426,926	2018/12/20	
第299回 利付国庫債券(10年)	1.300	4,100,000	4,284,992	2019/03/20	

2011年8月12日現在				
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301回 利付国庫債券 (10年)	1.500	3,800,000	4,021,464	2019/06/20
第303回 利付国庫債券 (10年)	1.400	2,800,000	2,937,732	2019/09/20
第305回 利付国庫債券 (10年)	1.300	5,000,000	5,193,450	2019/12/20
第306回 利付国庫債券 (10年)	1.400	5,200,000	5,431,088	2020/03/20
第308回 利付国庫債券 (10年)	1.300	1,300,000	1,343,134	2020/06/20
第309回 利付国庫債券 (10年)	1.100	2,500,000	2,540,925	2020/06/20
第310回 利付国庫債券 (10年)	1.000	5,500,000	5,525,300	2020/09/20
第312回 利付国庫債券 (10年)	1.200	6,200,000	6,316,684	2020/12/20
第313回 利付国庫債券 (10年)	1.300	7,000,000	7,180,600	2021/03/20
第315回 利付国庫債券 (10年)	1.200	2,000,000	2,028,560	2021/06/20
第1回 利付国庫債券 (30年)	2.800	100,000	115,460	2029/09/20
第2回 利付国庫債券 (30年)	2.400	100,000	109,012	2030/02/20
第3回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	214,774	2030/05/20
第4回 利付国庫債券 (30年)	2.900	200,000	234,142	2030/11/20
第5回 利付国庫債券 (30年)	2.200	200,000	211,196	2031/05/20
第6回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	217,814	2031/11/20
第7回 利付国庫債券 (30年)	2.300	300,000	321,207	2032/05/20
第8回 利付国庫債券 (30年)	1.800	500,000	491,310	2032/11/22
第11回 利付国庫債券 (30年)	1.700	400,000	384,092	2033/06/20
第12回 利付国庫債券 (30年)	2.100	300,000	309,096	2033/09/20
第13回 利付国庫債券 (30年)	2.000	300,000	303,513	2033/12/20
第14回 利付国庫債券 (30年)	2.400	500,000	542,080	2034/03/20
第15回 利付国庫債券 (30年)	2.500	200,000	220,342	2034/06/20
第16回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	440,640	2034/09/20
第17回 利付国庫債券 (30年)	2.400	200,000	216,696	2034/12/20
第18回 利付国庫債券 (30年)	2.300	820,000	872,709	2035/03/20
第19回 利付国庫債券 (30年)	2.300	200,000	212,776	2035/06/20
第20回 利付国庫債券 (30年)	2.500	300,000	330,567	2035/09/20
第21回 利付国庫債券 (30年)	2.300	500,000	531,515	2035/12/20
第22回 利付国庫債券 (30年)	2.500	470,000	517,690	2036/03/20
第23回 利付国庫債券 (30年)	2.500	400,000	440,872	2036/06/20
第24回 利付国庫債券 (30年)	2.500	600,000	661,170	2036/09/20
第25回 利付国庫債券 (30年)	2.300	600,000	637,236	2036/12/20
第26回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,000,000	1,082,360	2037/03/20
第27回 利付国庫債券 (30年)	2.500	900,000	992,466	2037/09/20
第28回 利付国庫債券 (30年)	2.500	1,300,000	1,433,978	2038/03/20
第29回 利付国庫債券 (30年)	2.400	1,500,000	1,623,975	2038/09/20
第30回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,500,000	1,591,320	2039/03/20
第31回 利付国庫債券 (30年)	2.200	1,700,000	1,767,507	2039/09/20
第32回 利付国庫債券 (30年)	2.300	1,900,000	2,016,508	2040/03/20
第33回 利付国庫債券 (30年)	2.000	1,800,000	1,790,118	2040/09/20
第34回 利付国庫債券 (30年)	2.200	2,200,000	2,286,020	2041/03/20
第37回 利付国庫債券 (20年)	3.100	600,000	694,500	2017/09/20
第39回 利付国庫債券 (20年)	2.600	400,000	452,860	2018/03/20
第40回 利付国庫債券 (20年)	2.300	720,000	804,096	2018/09/20
第42回 利付国庫債券 (20年)	2.600	800,000	912,816	2019/03/20
第43回 利付国庫債券 (20年)	2.900	860,000	1,003,757	2019/09/20
第45回 利付国庫債券 (20年)	2.400	900,000	1,013,688	2020/03/20
第46回 利付国庫債券 (20年)	2.200	500,000	554,625	2020/06/22
第47回 利付国庫債券 (20年)	2.200	950,000	1,054,272	2020/09/21
第48回 利付国庫債券 (20年)	2.500	500,000	567,490	2020/12/21
第50回 利付国庫債券 (20年)	1.900	780,000	842,556	2021/03/22
第51回 利付国庫債券 (20年)	2.000	600,000	652,596	2021/06/21
第52回 利付国庫債券 (20年)	2.100	550,000	602,987	2021/09/21
第54回 利付国庫債券 (20年)	2.200	700,000	773,654	2021/12/20
第55回 利付国庫債券 (20年)	2.000	810,000	878,315	2022/03/21

2011年8月12日現在				
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57回 利付国庫債券 (20年)	1.900	830,000	890,432	2022/06/20
第58回 利付国庫債券 (20年)	1.900	900,000	963,558	2022/09/20
第60回 利付国庫債券 (20年)	1.400	990,000	1,006,245	2022/12/20
第61回 利付国庫債券 (20年)	1.000	1,000,000	971,250	2023/03/20
第62回 利付国庫債券 (20年)	0.800	1,000,000	944,810	2023/06/20
第64回 利付国庫債券 (20年)	1.900	800,000	851,936	2023/09/20
第65回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,382,225	2023/12/20
第67回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,300,000	1,379,157	2024/03/20
第70回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,250,000	1,398,225	2024/06/20
第72回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,250,000	1,351,300	2024/09/20
第73回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,390,000	1,483,755	2024/12/20
第75回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,340,000	1,444,613	2025/03/20
第78回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,550,000	1,628,523	2025/06/20
第81回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,700,000	1,804,125	2025/09/20
第83回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,800,000	1,930,878	2025/12/20
第85回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,750,000	1,874,547	2026/03/20
第88回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,862,826	2026/06/20
第90回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,900,000	2,053,558	2026/09/20
第92回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,700,000	1,810,279	2026/12/20
第93回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,000,000	1,049,250	2027/03/20
第94回 利付国庫債券 (20年)	2.100	800,000	850,432	2027/06/20
第95回 利付国庫債券 (20年)	2.300	1,700,000	1,851,555	2027/09/20
第97回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,800,000	1,932,300	2027/12/20
第99回 利付国庫債券 (20年)	2.100	1,600,000	1,691,584	2028/03/20
第100回 利付国庫債券 (20年)	2.200	1,800,000	1,925,172	2028/06/20
第102回 利付国庫債券 (20年)	2.400	1,900,000	2,085,041	2028/09/20
第105回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,100,000	2,209,788	2028/12/20
第107回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,100,100	2029/03/20
第109回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,000,000	2,036,220	2029/06/20
第111回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,200,000	2,336,180	2029/09/20
第113回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,400,000	2,510,256	2029/12/20
第114回 利付国庫債券 (20年)	2.100	2,000,000	2,087,400	2030/03/20
第116回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,600,000	2,752,516	2030/06/20
第118回 利付国庫債券 (20年)	2.000	1,400,000	1,437,366	2030/09/20
第119回 利付国庫債券 (20年)	1.800	1,500,000	1,491,600	2030/12/20
第121回 利付国庫債券 (20年)	1.900	2,600,000	2,625,740	2031/03/20
第123回 利付国庫債券 (20年)	2.100	3,000,000	3,122,400	2031/06/20
第125回 利付国庫債券 (20年)	2.200	2,100,000	2,218,419	2031/09/20
第128回 利付国庫債券 (20年)	1.900	1,000,000	1,007,250	2031/12/20
小計	—	310,170,000	322,271,929	—
(地方債証券)	%	千円	千円	
第602回 東京都公債	1.400	148,000	151,868	2013/10/25
第611回 東京都公債	1.830	200,000	208,986	2014/06/20
第612回 東京都公債	1.710	161,500	168,207	2014/06/20
第614回 東京都公債	1.480	200,000	207,448	2014/09/19
第616回 東京都公債	1.410	100,000	103,719	2014/12/19
第617回 東京都公債	1.400	200,000	207,372	2014/12/19
第619回 東京都公債	1.530	200,000	208,730	2015/03/20
第620回 東京都公債	1.350	200,000	207,448	2015/03/20
第622回 東京都公債	1.280	106,800	110,680	2015/06/19
第623回 東京都公債	1.310	200,000	207,494	2015/06/19
第627回 東京都公債	1.520	100,000	104,752	2015/09/18
第628回 東京都公債	1.590	100,000	105,269	2015/12/18
第629回 東京都公債	1.450	494,000	517,064	2015/12/18
第632回 東京都公債	2.000	115,300	123,739	2016/03/18
第633回 東京都公債	1.970	100,000	107,184	2016/03/18

2011年8月12日現在				
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634回 東京都公募公債	1.860	200,000	214,004	2016/06/20
第638回 東京都公募公債	1.900	200,000	214,852	2016/09/20
第640回 東京都公募公債	1.790	150,000	160,596	2016/12/20
第641回 東京都公募公債	1.820	100,000	107,221	2016/12/20
第659回 東京都公募公債	1.620	203,500	216,951	2018/06/20
第664回 東京都公募公債	1.400	300,000	315,021	2018/12/20
第667回 東京都公募公債	1.570	300,000	318,381	2019/03/20
第680回 東京都公募公債	1.390	200,000	207,912	2020/03/19
第685回 東京都公募公債	1.130	500,000	507,340	2020/06/19
第688回 東京都公募公債	0.940	200,000	198,952	2020/09/18
15年度2回 北海道公募公債	1.100	203,000	206,209	2013/07/29
16年度11回 北海道公募公債	1.300	250,000	257,942	2015/02/25
18年度4回 北海道公募公債	2.000	190,500	204,309	2016/06/30
18年度6回 北海道公募公債	2.100	100,000	107,884	2016/08/31
19年度4回 北海道公募公債	1.980	300,000	323,865	2016/06/29
21年度6回 北海道公募公債	1.600	200,000	210,738	2019/08/28
第118回 神奈川県公募公債	1.100	145,090	146,783	2012/11/22
第125回 神奈川県公募公債	1.400	100,000	103,021	2014/03/31
第126回 神奈川県公募公債	1.500	178,870	184,899	2014/04/30
第127回 神奈川県公募公債	1.800	100,000	104,515	2014/07/30
第128回 神奈川県公募公債	1.500	100,000	103,774	2014/09/30
第130回 神奈川県公募公債	1.400	156,200	162,060	2015/01/28
第135回 神奈川県公募公債	1.600	200,000	210,286	2015/10/28
第136回 神奈川県公募公債	1.500	100,000	104,846	2015/12/28
第166回 神奈川県公募公債	1.360	300,000	312,312	2019/09/20
第251回 大阪府公募公債	1.100	110,100	111,294	2012/11/20
第252回 大阪府公募公債	0.800	100,000	100,804	2013/01/30
第261回 大阪府公募公債	1.500	129,000	132,655	2013/12/25
第278回 大阪府公募公債	1.300	200,000	206,728	2015/05/29
第285回 大阪府公募公債	1.500	100,000	104,544	2015/12/25
第286回 大阪府公募公債	1.500	200,000	209,192	2016/01/29
第289回 大阪府公募公債	1.800	200,000	212,296	2016/04/27
第293回 大阪府公募公債	2.100	200,000	215,918	2016/08/30
第301回 大阪府公募公債	1.830	100,000	107,047	2015/01/26
第310回 大阪府公募公債	1.620	240,000	254,486	2018/01/30
第336回 大阪府公募公債	1.460	200,000	207,644	2020/03/30
第1回 大阪府公募公債 7年	1.800	500,000	515,455	2013/08/28
15年度3回 京都府公募公債	1.500	219,300	225,879	2013/12/24
16年度2回 京都府公募公債	1.500	100,000	103,771	2014/09/24
18年度1回 京都府公募公債	1.700	100,000	106,544	2016/12/22
14年度5回 兵庫県公募公債	0.800	100,000	100,877	2013/02/27
15年度1回 兵庫県公募公債	0.700	100,000	100,767	2013/04/25
16年度4回 兵庫県公募公債	1.600	251,970	261,028	2014/05/27
16年度8回 兵庫県公募公債	1.900	111,500	116,778	2014/08/25
17年度2回 兵庫県公募公債	1.400	200,000	207,494	2015/04/27
17年度9回 兵庫県公募公債	1.600	306,000	321,324	2015/11/30
17年度13回 兵庫県公募公債	1.700	105,000	110,978	2016/03/23
18年度1回 兵庫県公募公債	1.800	120,000	127,495	2016/04/27
15年度1回 静岡県公募公債	0.500	268,500	269,976	2013/06/27
15年度3回 静岡県公募公債	1.400	116,130	119,151	2013/10/28
18年度5回 静岡県公募公債	1.850	129,800	139,149	2016/10/26
21年度5回 静岡県公募公債	1.350	197,000	204,769	2019/10/18
15年度1回 愛知県公募公債	1.400	303,600	311,499	2013/10/28
16年度2回 愛知県公募公債	1.600	200,000	208,360	2014/10/27
18年度2回 愛知県公募公債	2.000	160,300	172,558	2016/06/27
20年度4回 愛知県公募公債	1.600	100,000	106,393	2018/09/25

2011年8月12日現在				
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	
22年度6回 愛知県公募公債	1.178	200,000	203,240	2020/07/30
16年度2回 広島県公募公債	1.500	200,000	208,400	2015/03/25
22年度1回 広島県公募公債	1.370	200,000	206,814	2020/05/27
15年度3回 埼玉県公募公債	1.600	100,000	102,930	2013/09/26
17年度2回 埼玉県公募公債	1.300	200,000	207,260	2015/05/27
18年度1回 埼玉県公募公債	1.800	200,000	212,984	2016/04/27
21年度4回 埼玉県公募公債	1.460	440,000	461,907	2019/07/29
16年度3回 福岡県公募公債	1.300	131,040	135,577	2015/02/24
17年度1回 福岡県公募公債	1.400	100,000	104,181	2015/08/26
16年度5回 福岡県公募公債	1.500	100,000	104,912	2016/01/27
18年度1回 福岡県公募公債	2.100	104,000	112,638	2016/08/30
21年度3回 福岡県公募公債	1.550	200,000	211,252	2019/08/27
15年度4回 千葉県公募公債	1.400	100,000	102,834	2014/01/24
16年度3回 千葉県公募公債	1.900	100,000	104,892	2014/08/25
16年度8回 千葉県公募公債	1.300	200,000	206,932	2015/02/25
17年度2回 千葉県公募公債	1.300	200,000	207,330	2015/06/25
19年度5回 千葉県公募公債	1.850	300,000	323,490	2017/10/25
21年度6回 千葉県公募公債	1.410	200,000	208,982	2019/09/25
18年度2回 新潟県公募公債	1.870	169,000	181,372	2016/11/29
第2回 共同発行市場公募地方債	0.600	100,000	100,712	2013/05/24
第3回 共同発行市場公募地方債	0.500	100,000	100,558	2013/06/25
第8回 共同発行市場公募地方債	1.600	400,000	412,552	2013/11/25
第9回 共同発行市場公募地方債	1.500	210,000	216,281	2013/12/25
第11回 共同発行市場公募地方債	1.300	300,000	308,034	2014/02/25
第12回 共同発行市場公募地方債	1.400	130,000	133,920	2014/03/25
第13回 共同発行市場公募地方債	1.500	221,000	228,443	2014/04/25
第18回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	104,067	2014/09/25
第19回 共同発行市場公募地方債	1.600	130,000	135,421	2014/10/24
第20回 共同発行市場公募地方債	1.500	100,000	103,923	2014/11/25
第21回 共同発行市場公募地方債	1.400	300,000	311,007	2014/12/25
第23回 共同発行市場公募地方債	1.300	100,000	103,466	2015/02/25
第25回 共同発行市場公募地方債	1.400	304,000	315,944	2015/04/24
第28回 共同発行市場公募地方債	1.300	200,000	207,438	2015/07/24
第29回 共同発行市場公募地方債	1.400	200,000	208,356	2015/08/25
第31回 共同発行市場公募地方債	1.500	200,000	209,428	2015/10/23
第32回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	210,428	2015/11/25
第33回 共同発行市場公募地方債	1.600	300,000	315,801	2015/12/25
第35回 共同発行市場公募地方債	1.600	200,000	210,842	2016/02/25
第36回 共同発行市場公募地方債	1.600	100,000	105,463	2016/03/25
第37回 共同発行市場公募地方債	1.800	150,000	159,726	2016/04/25
第38回 共同発行市場公募地方債	2.000	170,000	182,807	2016/05/25
第39回 共同発行市場公募地方債	1.900	146,000	156,449	2016/06/24
第40回 共同発行市場公募地方債	2.100	150,000	162,298	2016/07/25
第47回 共同発行市場公募地方債	1.800	161,600	173,199	2017/02/24
第55回 共同発行市場公募地方債	1.850	200,000	215,660	2017/10/25
第57回 共同発行市場公募地方債	1.650	200,000	213,280	2017/12/25
第61回 共同発行市場公募地方債	1.550	300,000	318,258	2018/04/25
第65回 共同発行市場公募地方債	1.620	100,000	106,523	2018/08/24
第75回 共同発行市場公募地方債	1.640	500,000	532,075	2019/06/25
第80回 共同発行市場公募地方債	1.540	700,000	737,394	2019/11/25
第94回 共同発行市場公募地方債	1.240	100,000	101,589	2021/01/25
17年度3回 大阪市公募公債	1.300	100,000	103,406	2015/07/28
17年度7回 大阪市公募公債	1.400	200,000	207,790	2015/09/29
17年度8回 大阪市公募公債	1.600	200,000	209,586	2015/10/27
17年度11回 大阪市公募公債	1.600	100,000	105,040	2016/02/23
18年度2回 大阪市公募公債	2.000	100,000	107,217	2016/06/22

2011年8月12日現在					
銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
<b>(地方債証券)</b>					
	%	千円	千円		
18年度3回 大阪市公債	2.100	150,000	161,722	2016/07/27	
19年度5回 大阪市公債	1.990	135,000	145,831	2017/07/19	
第12回さ号 名古屋市公債	0.600	100,000	100,716	2013/05/28	
第12回ひ号 名古屋市公債	1.300	200,000	207,424	2015/07/21	
第12回せ号 名古屋市公債	1.400	359,500	374,710	2015/09/28	
17年度1回 京都市公債	1.400	100,000	104,095	2015/08/25	
18年度3回 京都市公債	1.900	101,700	109,441	2017/02/27	
16年度5回 神戸市公債	1.400	200,000	207,160	2014/12/24	
17年度13回 神戸市公債	1.600	103,000	108,432	2016/02/23	
14年度3回 横浜市公債	1.000	153,500	155,191	2012/12/20	
14年度5回 横浜市公債	0.800	281,100	283,745	2013/02/28	
15年度5回 横浜市公債	1.300	200,000	205,356	2014/02/25	
16年度1回 横浜市公債	1.600	200,000	207,034	2014/03/20	
17年度1回 横浜市公債	1.300	300,000	310,527	2015/03/20	
14年度5回 札幌市公債	0.800	106,000	106,930	2013/01/30	
14年度7回 札幌市公債	0.700	100,000	100,834	2013/04/24	
16年度7回 札幌市公債	1.500	100,000	104,200	2015/03/25	
第2回 川崎市公債 15年	1.630	100,000	105,513	2020/06/22	
第19回 川崎市公債 5年	1.410	100,000	102,217	2013/06/20	
14年度2回 北九州市公債	1.000	100,000	101,075	2012/12/20	
18年度4回 福岡市公債	1.800	100,000	106,843	2016/10/27	
16年度1回 広島市公債	1.400	100,000	103,615	2014/12/24	
16年度2回 千葉市公債	1.400	100,000	103,714	2015/01/27	
小計	—	27,477,400	28,696,141	—	
<b>(特殊債券(除金融債))</b>					
	%	千円	千円		
第8回 政保日本政策投資銀行債券	1.800	102,000	106,738	2014/08/27	
第13回 政保日本政策投資銀行債券	2.000	121,000	130,523	2016/08/25	
第16回 日本政策投資銀行債券	1.520	100,000	103,545	2014/09/19	
第7回 日本政策投資銀行債券	0.780	200,000	201,624	2013/03/19	
第9回 日本政策投資銀行債券	1.580	100,000	102,704	2013/09/20	
第13回 日本政策投資銀行債券	1.590	100,000	103,278	2014/03/20	
第27回 日本政策投資銀行債券	1.980	200,000	214,740	2016/09/20	
第46回 日本政策投資銀行債券	1.690	200,000	212,898	2018/03/20	
第12回 日本道路・機構承継債	1.330	100,000	101,439	2012/10/22	
第34回 日本道路・機構承継債	1.630	200,000	207,786	2014/09/22	
第315回 政保道路債	0.700	300,000	302,661	2013/04/25	
第319回 政保道路債	0.900	132,000	133,894	2013/08/22	
第322回 政保道路債	1.500	106,000	109,133	2013/11/28	
第323回 政保道路債	1.500	200,000	206,046	2013/12/20	
第324回 政保道路債	1.400	200,000	205,768	2014/01/24	
第328回 政保道路債	1.500	200,000	207,046	2014/05/28	
第329回 政保道路債	1.600	100,000	103,882	2014/06/27	
第333回 政保道路債	1.600	300,000	312,702	2014/10/28	
第335回 政保道路債	1.400	237,000	245,854	2014/12/24	
第338回 政保道路債	1.500	264,000	275,399	2015/03/27	
第339回 政保道路債	1.400	301,000	313,088	2015/04/28	
第15回 高速道路機構債	2.050	400,000	430,876	2016/09/20	
第25回 高速道路機構債	1.820	300,000	321,276	2017/09/20	
第35回 高速道路機構債	1.650	400,000	424,784	2018/03/20	
第48回 高速道路機構債	1.710	700,000	745,381	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	315,030	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	220,532	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	114,000	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	107,665	2021/03/26	
第10回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.000	301,000	324,571	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	131,666	2016/08/31	

2011年8月12日現在					
銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
<b>(特殊債券(除金融債))</b>					
	%	千円	千円		
第19回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.800	100,000	106,986	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	401,733	2016/11/30	
第23回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.700	300,000	319,944	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	206,490	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	320,394	2017/03/28	
第33回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.700	297,000	317,365	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	371,798	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	358,112	2017/08/31	
第47回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.500	200,000	211,642	2017/12/27	
第50回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.400	200,000	210,490	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	171,439	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	427,121	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	630,528	2018/12/25	
第78回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.400	200,000	209,710	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	105,499	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	311,334	2019/09/30	
第16回 日本道路・機構承継債	0.980	430,000	434,871	2013/03/20	
第26回 日本道路・機構承継債	1.680	200,000	206,430	2013/12/20	
第41回 日本道路・機構承継債	1.520	300,000	311,988	2015/03/20	
第5回 公営企業債券	0.770	100,000	100,865	2013/03/22	
第824回 政保公営企業債券	0.800	300,000	302,934	2013/02/27	
第828回 政保公営企業債券	0.500	210,000	211,232	2013/06/26	
第829回 政保公営企業債券	1.100	400,000	407,104	2013/07/24	
第832回 政保公営企業債券	1.400	298,000	305,849	2013/10/24	
第834回 政保公営企業債券	1.500	207,000	213,309	2013/12/24	
第837回 政保公営企業債券	1.400	432,000	445,245	2014/03/24	
第838回 政保公営企業債券	1.500	600,000	620,454	2014/04/25	
第839回 政保公営企業債券	1.500	260,000	269,102	2014/05/26	
第843回 政保公営企業債券	1.500	100,000	103,835	2014/09/29	
第847回 政保公営企業債券	1.400	200,000	207,640	2015/01/27	
第848回 政保公営企業債券	1.300	200,000	207,072	2015/02/24	
第849回 政保公営企業債券	1.500	261,000	272,209	2015/03/20	
第852回 政保公営企業債券	1.300	300,000	311,265	2015/06/29	
第853回 政保公営企業債券	1.200	204,000	210,956	2015/07/24	
第854回 政保公営企業債券	1.400	304,000	316,892	2015/08/18	
第856回 政保公営企業債券	1.500	200,000	209,582	2015/10/20	
第859回 政保公営企業債券	1.500	207,000	217,345	2016/01/25	
第862回 政保公営企業債券	1.800	239,000	254,687	2016/04/20	
第863回 政保公営企業債券	2.000	200,000	215,236	2016/05/27	
第867回 政保公営企業債券	1.800	200,000	213,914	2016/09/21	
第868回 政保公営企業債券	1.800	101,000	108,109	2016/10/21	
第869回 政保公営企業債券	1.800	102,000	109,266	2016/11/21	
第875回 政保公営企業債券	1.700	482,000	515,171	2017/05/22	
第8回 政保地方公営企業金融機構債券	1.500	651,000	687,143	2019/05/24	
第3回 政保地方公共団体金融機構債券	1.500	101,000	106,482	2019/08/16	
第5回 地方公共団体金融機構債券	1.395	500,000	519,715	2019/10/28	
第8回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	300,000	310,389	2020/01/20	
第10回 政保地方公共団体金融機構債券	1.300	500,000	516,565	2020/03/13	
第15回 政保地方公共団体金融機構債券	1.000	200,000	200,462	2020/08/14	
第6回 公営企業金融公庫債券	0.640	200,000	201,316	2013/03/22	
第12回 公営企業金融公庫債券	1.530	300,000	311,205	2014/09/24	
第14回 公営企業金融公庫債券	1.450	100,000	103,907	2015/03/24	
第15回 公営企業金融公庫債券	1.330	300,000	310,878	2015/06/19	
第17回 公営企業金融公庫債券	1.570	100,000	104,761	2015/09/24	
第20回 公営企業金融公庫債券	2.050	200,000	215,300	2016/06/20	
第24回 公営企業金融公庫債券	1.940	300,000	322,704	2016/12/20	

2011年8月12日現在				
銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(特殊債券(除金融債))</b>				
第191回 政保首都高速道路債	1.800	113,000	118,149	2014/07/29
第142回 政保阪神高速道路債	1.400	100,000	103,715	2014/12/17
第148回 政保阪神高速道路債	1.300	107,000	111,164	2015/09/30
第5回 阪神高速道路・機構承継債	1.790	100,000	103,794	2014/03/20
第176回 政保中小企業債券	1.600	100,000	102,939	2013/09/17
第180回 政保中小企業債券	1.800	142,000	148,428	2014/07/22
第186回 政保中小企業債券	1.300	104,000	108,030	2015/09/15
第26回 中小企業債券	1.990	400,000	412,736	2013/06/20
第15回 国際協力銀行債券	1.740	200,000	208,004	2014/06/20
第8回 国際協力銀行債券	0.650	300,000	301,863	2013/03/19
第12回 国際協力銀行債券	1.600	200,000	206,660	2014/03/20
第2回 都市再生債券	2.150	100,000	104,984	2014/06/20
第19回 都市再生機構債券	2.040	200,000	216,708	2018/03/20
第23回 都市再生機構債券	1.280	200,000	204,214	2013/11/25
第2回 本州四国連絡・機構承継債	1.840	100,000	103,589	2013/12/20
第6回 政保中部国際空港債	1.400	100,000	103,059	2014/03/26
第11回 住宅金融支援機構債券	1.660	200,000	212,330	2017/12/20
第32回 住宅金融支援機構債券	0.780	300,000	303,819	2014/09/19
第37回 住宅金融支援機構債券	1.400	300,000	311,331	2019/09/20
第6回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.260	139,629	146,935	2037/05/10
第8回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.150	96,694	101,128	2037/05/10
第9回 貸付債権担保S種住宅金融公庫債券	2.190	145,113	152,071	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	165,099	173,512	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	70,734	74,122	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	362,825	375,015	2032/05/10
第4回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.820	93,630	97,002	2036/12/10
第43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.280	64,892	68,485	2041/06/10
第44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.300	253,196	267,894	2041/07/10
第51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.210	203,298	212,733	2042/02/10
第1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.130	344,415	359,831	2042/05/10
第29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.950	432,815	446,833	2044/10/10
第30回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.810	746,672	764,211	2045/05/10
第14回 政保国民生活債券	1.500	132,000	137,009	2014/09/17
第1回 政保東日本高速道路債	1.600	101,000	106,310	2015/11/25
第2回 政保東日本高速道路債	1.500	101,000	105,940	2015/12/21
第4回 政保中日本高速道路債	1.600	170,000	179,404	2016/03/24
第8回 政保中日本高速道路債	2.000	170,000	183,331	2016/08/12
第21回 政保中日本高速道路債	1.700	300,000	321,582	2018/05/21
第5回 中日本高速道路債	1.860	200,000	214,906	2018/09/20
第1回 政保西日本高速道路債	1.600	201,000	211,568	2015/11/25
第5回 政保西日本高速道路債	1.800	259,000	277,689	2017/01/25
第6回 政保西日本高速道路債	1.800	117,000	125,511	2017/02/27
第2回 鉄道建設運輸施設債	1.920	300,000	313,533	2014/06/20
小計	—	30,438,012	31,832,602	—
<b>(金融債券)</b>				
691号 利附商工債	1.400	200,000	203,194	2012/12/27
692号 利附商工債	1.200	200,000	202,782	2013/01/25
704号 利附商工債	1.350	200,000	205,216	2014/01/27
706号 利付商工債	1.350	300,000	308,235	2014/03/27
714号 利付商工債	0.900	300,000	305,421	2014/11/27
723号 利付商工債	0.500	300,000	301,131	2015/08/27
694号 利附農林債	1.150	400,000	405,680	2013/03/27
695号 利附農林債	1.150	200,000	202,960	2013/04/26
698号 利附農林債	1.500	300,000	307,113	2013/07/26
701号 利附農林債	1.450	200,000	205,044	2013/10/25
709号 利附農林債	1.150	400,000	409,220	2014/06/27

2011年8月12日現在				
銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
<b>(金融債券)</b>				
713号 利附農林債	0.800	300,000	304,089	2014/10/27
717号 利附農林債	0.750	300,000	303,723	2015/02/27
721号 利附農林債	0.600	120,000	120,822	2015/06/26
第215回 利附信金中金債	1.500	200,000	203,016	2012/10/26
第217回 利附信金中金債	1.350	200,000	203,028	2012/12/27
第222回 利附信金中金債	1.400	200,000	204,064	2013/05/27
第223回 利附信金中金債	1.500	300,000	306,936	2013/06/27
第226回 利附信金中金債	1.350	300,000	306,825	2013/09/27
第229回 利附信金中金債	1.400	400,000	410,512	2013/12/27
第233回 利附信金中金債	1.350	300,000	308,400	2014/04/25
第236回 利附信金中金債	0.900	300,000	305,040	2014/07/25
第241回 利附信金中金債	0.700	300,000	303,396	2014/12/26
小計	—	6,220,000	6,335,847	—
<b>(普通社債券)</b>				
第345回 東京地下鉄社債	0.610	100,000	100,608	2013/06/20
第9回 G Eキャピタル円貨債	1.770	100,000	102,534	2014/06/02
第12回 G Eキャピタル円貨債	1.545	100,000	101,671	2015/06/03
第14回 G Eキャピタル円貨債	1.840	100,000	103,225	2015/11/20
第2回 J Pモルガン・チェース劣後債	1.930	100,000	102,088	2015/11/10
第4回 ゴールドマン・サックス円貨債	1.980	100,000	102,678	2014/05/28
第16回 シティグループ円貨社債	1.580	100,000	100,661	2015/09/16
第22回 シティグループ円貨社債	2.130	200,000	205,152	2014/06/20
第3回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	1.790	100,000	101,175	2014/12/03
第8回 バンク・オブ・アメリカ円貨債	2.305	100,000	100,801	2017/06/26
第7回 ウェストバック銀行円貨社債	1.070	100,000	101,034	2015/09/03
第1回 オーストラリア連邦証券オーストラリア・ニューズグループ銀行円貨社債	1.650	100,000	103,109	2014/02/10
第1回 キリンホールディングス社債	1.090	100,000	101,274	2013/03/19
第7回 キリンホールディングス社債	1.639	100,000	105,098	2019/11/05
第5回 日本たばこ産業社債	1.128	100,000	102,149	2014/06/03
第25回 住友化学工業社債	1.620	100,000	102,711	2013/11/12
第33回 住友化学社債	1.260	100,000	101,214	2012/12/06
第25回 三菱化学社債	1.800	100,000	102,127	2013/02/05
第34回 三井化学社債	1.840	100,000	105,416	2016/03/10
第2回 花王社債	1.910	100,000	102,979	2013/06/20
第24回 新日本石油社債	1.530	100,000	103,730	2015/06/12
第8回 旭硝子社債	0.670	100,000	100,648	2013/06/03
第29回 新日本製鐵社債	3.300	100,000	114,776	2017/03/17
第48回 新日本製鐵社債	1.180	100,000	101,320	2013/02/13
第52回 新日本製鐵社債	1.670	100,000	103,416	2014/03/20
第5回 ジェイ・エフ・イー・ホールディングス社債	0.927	100,000	101,547	2014/07/24
第5回 ジェイ・エフ・イー・ホールディングス社債	0.572	100,000	100,410	2015/05/27
第11回 豊田自動織機社債	1.130	100,000	101,155	2012/12/20
第12回 日立製作所社債	0.720	100,000	100,552	2013/05/27
第25回 富士通社債	1.730	100,000	104,035	2014/09/25
第7回 パナソニック社債	1.404	200,000	205,460	2014/03/20
第10回 パナソニック社債	0.752	200,000	202,016	2016/03/18
第24回 シャープ社債	0.846	200,000	202,658	2014/09/16
第17回 ソニー社債	1.570	100,000	103,926	2015/06/19
第19回 ソニー社債	1.520	100,000	101,918	2013/03/19
第3回 パナソニック電工社債	1.660	100,000	104,594	2015/06/19
第15回 三菱重工業社債	1.030	100,000	100,950	2013/01/31
第19回 三菱重工業社債	2.040	100,000	106,903	2016/09/07
第49回 日産自動車社債	1.931	100,000	104,418	2014/09/19
第7回 トヨタ自動車社債	1.340	300,000	307,260	2013/12/20
第9回 トヨタ自動車社債	1.073	200,000	204,144	2014/06/20

2011年8月12日現在				
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49回 伊藤忠商事社債	2.280	100,000	109,424	2018/06/20
第45回 三井物産社債	0.790	100,000	100,779	2013/05/07
第29回 住友商事社債	1.430	100,000	101,666	2013/03/01
第16回 三菱商事社債	3.000	100,000	106,424	2014/01/27
第14回 クレディセゾン社債	1.200	100,000	100,779	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	207,014	2014/02/12
第7回 みずほコーポレート銀行社債	2.080	100,000	107,952	2017/07/27
第9回 みずほコーポレート銀行社債	1.435	200,000	202,812	2012/10/26
第11回 みずほコーポレート銀行社債	1.110	200,000	202,406	2013/01/25
第13回 みずほコーポレート銀行社債	1.390	200,000	204,212	2013/07/19
第14回 みずほコーポレート銀行社債	1.520	100,000	102,761	2013/12/10
第15回 みずほコーポレート銀行社債	1.325	200,000	204,994	2014/02/27
第18回 みずほコーポレート銀行社債	0.830	200,000	202,786	2014/10/16
第20回 みずほコーポレート銀行社債	0.710	200,000	202,094	2015/04/20
第92回 三菱東京UFJ銀行社債	1.490	200,000	202,930	2012/10/17
第100回 三菱東京UFJ銀行社債	1.370	200,000	204,236	2013/07/16
第106回 三菱東京UFJ銀行社債	0.905	300,000	305,046	2014/07/17
第112回 三菱東京UFJ銀行社債	0.660	200,000	201,980	2015/01/26
第114回 三菱東京UFJ銀行社債	0.670	200,000	202,066	2015/04/17
第3回2号 三菱東京UFJ銀行社債(劣後)	1.300	200,000	203,040	2013/06/26
第6回 東京三菱銀行劣後社債	1.730	100,000	103,723	2014/12/22
第8回 東京三菱銀行劣後社債	1.640	200,000	207,610	2015/07/22
第12回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.160	200,000	214,548	2017/07/28
第28回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	1.560	200,000	201,904	2021/01/20
第11回 三菱東京UFJ銀行劣後社債	2.280	200,000	214,938	2016/10/31
第6回 りそな銀行劣後社債	2.084	100,000	104,026	2020/03/04
第4回 住友信託銀行劣後社債	1.670	100,000	103,296	2015/04/28
第7回 住友信託銀行劣後社債	1.950	100,000	105,419	2017/05/10
第5回 住友信託銀行劣後社債	2.250	100,000	106,372	2016/04/27
第41回 三井住友銀行社債	1.330	100,000	101,278	2012/10/19
第45回 三井住友銀行社債	1.230	200,000	204,530	2014/01/20
第47回 三井住友銀行社債	0.910	200,000	203,392	2014/07/18
第51回 三井住友銀行社債	0.350	200,000	199,324	2015/10/20
第6回 三井住友銀行劣後社債	1.710	100,000	102,360	2013/08/01
第7回 三井住友銀行劣後社債	2.010	100,000	103,565	2014/02/05
第8回 三井住友銀行劣後社債	1.950	100,000	104,211	2014/10/22
第9回 三井住友銀行劣後社債	1.750	100,000	104,213	2015/08/17
第11回 三井住友銀行劣後社債	2.170	200,000	214,676	2017/12/20
第20回 三井住友銀行劣後社債	2.210	200,000	214,896	2019/07/24
第1回 みずほ銀行劣後特約付社債	1.700	100,000	103,234	2015/02/03
第6回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.250	100,000	106,619	2016/11/04
第10回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.060	100,000	105,747	2018/01/26
第14回 みずほ銀行劣後特約付社債	2.140	100,000	105,668	2019/09/27
第38回 N T Tファイナンス社債	0.550	200,000	200,628	2015/06/19
第19回 トヨタファイナンス社債	2.040	100,000	106,849	2016/03/18
第23回 トヨタファイナンス社債	1.970	300,000	321,003	2016/09/20
第40回 トヨタファイナンス社債	1.478	100,000	103,115	2014/06/20
第118回 オリックス社債	2.180	100,000	104,159	2014/07/30
第144回 オリックス社債	1.510	100,000	100,312	2017/12/22
第8回 野村ホールディングス社債	2.120	100,000	107,011	2017/08/14
第9回 野村ホールディングス社債	1.390	100,000	101,320	2012/11/27
第15回 野村ホールディングス社債	2.010	100,000	104,292	2014/06/13
第17回 野村ホールディングス社債	1.280	200,000	204,814	2014/11/27
第20回 野村ホールディングス社債	0.980	100,000	101,385	2015/03/17
第22回 野村ホールディングス社債	0.937	200,000	202,340	2015/06/24
第24回 三井不動産社債	1.650	100,000	104,820	2015/12/18

2011年8月12日現在				
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31回 三井不動産社債	1.645	100,000	103,734	2014/09/19
第60回 三菱地所社債	1.200	100,000	101,225	2012/12/10
第66回 三菱地所社債	0.785	100,000	100,866	2013/05/09
第79回 三菱地所社債	1.790	200,000	213,238	2017/03/17
第73回 住友不動産社債	0.960	100,000	101,155	2015/04/30
第41回 小田急電鉄社債	2.240	100,000	108,192	2016/08/08
第2回 東日本旅客鉄道社債	4.900	200,000	231,536	2015/02/25
第7回 東日本旅客鉄道社債	3.300	100,000	115,760	2017/08/25
第19回 東日本旅客鉄道社債	2.360	100,000	110,336	2022/02/25
第25回 東日本旅客鉄道社債	0.790	300,000	302,412	2013/03/19
第31回 東日本旅客鉄道社債	1.580	200,000	206,418	2014/03/19
第41回 東日本旅客鉄道社債	1.560	100,000	104,491	2015/09/18
第3回 西日本旅客鉄道社債	3.450	100,000	115,270	2016/12/20
第10回 西日本旅客鉄道社債	2.040	100,000	106,181	2023/09/20
第1回 東海旅客鉄道社債	4.650	100,000	110,907	2014/02/21
第2回 東海旅客鉄道社債	3.950	200,000	232,068	2016/04/25
第6回 東海旅客鉄道社債	2.390	100,000	110,643	2022/02/15
第10回 東海旅客鉄道社債	1.420	190,000	198,943	2017/09/20
第23回 東海旅客鉄道社債	2.140	100,000	109,392	2018/04/25
第3回 東京地下鉄社債	1.900	100,000	106,945	2016/09/20
第48回 日本電信電話社債	1.610	400,000	415,348	2014/09/19
第50回 日本電信電話社債	1.580	100,000	104,614	2015/09/18
第51回 日本電信電話社債	2.060	200,000	214,988	2016/06/20
第58回 日本電信電話社債	1.000	100,000	101,866	2014/06/20
第5回 KDD I社債	3.200	100,000	114,074	2017/04/28
第16回 N T Tドコモ社債	1.260	200,000	204,562	2013/12/20
第18回 N T Tドコモ社債	1.000	200,000	202,424	2013/03/27
第455回 東京電力社債	2.075	200,000	158,382	2018/10/23
第457回 東京電力社債	2.050	100,000	78,857	2018/11/16
第510回 東京電力社債	1.415	200,000	175,736	2013/12/24
第511回 東京電力社債	1.615	100,000	86,790	2014/05/28
第515回 東京電力社債	1.435	200,000	174,142	2015/02/10
第516回 東京電力社債	1.420	100,000	86,883	2015/04/27
第518回 東京電力社債	1.360	300,000	256,986	2015/08/12
第519回 東京電力社債	1.590	372,000	317,130	2015/12/28
第536回 東京電力社債	1.672	200,000	157,548	2018/01/29
第542回 東京電力社債	1.602	500,000	390,485	2018/04/25
第407回 中部電力社債	3.400	100,000	110,394	2015/07/24
第409回 中部電力社債	3.900	300,000	344,196	2016/06/24
第460回 中部電力社債	1.140	200,000	201,678	2012/11/22
第463回 中部電力社債	0.820	200,000	201,122	2013/04/25
第467回 中部電力社債	1.540	100,000	102,850	2014/12/25
第468回 中部電力社債	1.430	100,000	102,556	2015/02/25
第471回 中部電力社債	1.310	300,000	306,717	2015/06/25
第476回 中部電力社債	2.120	100,000	107,164	2018/06/25
第478回 中部電力社債	1.890	100,000	105,304	2016/09/23
第480回 中部電力社債	1.790	200,000	209,854	2017/01/25
第484回 中部電力社債	1.410	200,000	204,586	2014/09/25
第487回 中部電力社債	1.209	140,000	141,919	2013/11/25
第496回 中部電力社債	1.227	500,000	493,855	2020/07/24
第410回 関西電力社債	2.000	300,000	318,198	2018/11/22
第427回 関西電力社債	1.500	100,000	101,794	2013/06/25
第433回 関西電力社債	1.300	200,000	204,118	2014/11/25
第441回 関西電力社債	1.460	200,000	205,554	2015/04/24
第446回 関西電力社債	1.780	200,000	209,108	2016/03/18
第298回 中国電力社債	4.100	200,000	225,314	2015/05/25

2011年8月12日現在				
銘柄名	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
第310回 中国電力社債	3.225	200,000	226,706	2017/07/25
第341回 中国電力社債	1.550	100,000	102,606	2014/06/25
第350回 中国電力社債	1.570	200,000	205,736	2014/10/24
第245回 北陸電力社債	3.800	200,000	223,522	2015/06/25
第260回 北陸電力社債	2.330	100,000	108,206	2020/05/25
第281回 北陸電力社債	1.970	200,000	212,518	2018/04/25
第289回 北陸電力社債	1.410	300,000	307,365	2014/12/25
第368回 東北電力社債	4.800	300,000	332,745	2014/04/25
第375回 東北電力社債	3.700	100,000	111,007	2015/06/25
第380回 東北電力社債	3.550	300,000	340,473	2016/11/25
第411回 東北電力社債	1.230	200,000	201,588	2012/10/25
第420回 東北電力社債	1.360	100,000	101,662	2014/02/25
第427回 東北電力社債	1.430	200,000	204,902	2015/09/25
第432回 東北電力社債	2.090	500,000	528,245	2016/05/25
第237回 四国電力社債	2.050	100,000	106,762	2018/11/22
第257回 四国電力社債	1.390	200,000	204,908	2015/02/25
第369回 九州電力社債	1.150	300,000	302,553	2012/11/22
第374回 九州電力社債	1.500	300,000	305,790	2013/09/25
第382回 九州電力社債	1.440	100,000	102,627	2015/02/25

2011年8月12日現在				
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383回 九州電力社債	1.460	100,000	102,777	2015/04/24
第387回 九州電力社債	1.690	200,000	208,294	2016/03/25
第257回 北海道電力社債	3.850	200,000	228,208	2016/04/25
第282回 北海道電力社債	1.440	200,000	203,944	2013/12/25
第284回 北海道電力社債	1.480	500,000	515,910	2016/02/25
第286回 北海道電力社債	1.530	100,000	102,742	2014/10/24
第2回 電源開発社債	1.610	100,000	101,974	2013/06/20
第4回 電源開発社債	1.320	200,000	203,178	2013/12/20
第6回 電源開発社債	1.550	100,000	102,626	2014/09/19
第14回 電源開発社債	1.560	100,000	103,174	2015/09/18
第17回 電源開発社債	2.070	100,000	105,872	2016/06/20
第14回 東京ガス社債	5.100	100,000	113,890	2014/07/25
第24回 東京瓦斯社債	1.410	200,000	205,080	2013/12/02
第9回 大阪ガス社債	2.900	100,000	114,054	2018/01/30
第24回 大阪瓦斯社債	1.590	100,000	103,874	2014/10/24
第27回 大阪瓦斯社債	1.199	100,000	102,044	2013/11/27
第20回 NTTデータ社債	1.100	100,000	101,475	2013/06/20
小計	—	29,802,000	30,572,383	—
合計	—	404,107,412	419,708,902	—

## ■投資信託財産の構成

2011年8月12日現在

項 目	評 価 額	比 率
	千円	%
投 資 証 券	956,640	94.0
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	11,430	1.1
コール・ローン等、その他	50,109	4.9
投 資 信 託 財 産 総 額	1,018,179	100.0

## ■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2011年8月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	1,018,179,181円
コール・ローン等	50,107,947
投資証券(評価額)	956,640,958
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	11,430,276
(B) 負 債	14,469,192
未払解約金	7,488,143
未払信託報酬	6,954,289
その他未払費用	26,760
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,003,709,989
元 本	1,260,110,224
次期繰越損益金	△ 256,400,235
(D) 受 益 権 総 口 数	1,260,110,224口
1万口当たり基準価額(C/D)	7,965円

<注記事項>

期首元本額	968,666,140円
期中追加設定元本額	1,104,345,720円
期中一部解約元本額	812,901,636円

## ■損益の状況

当期 自2010年8月13日 至2011年8月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	29,145円
受 取 利 息	29,145
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△188,059,090
売 買 益	45,987,743
売 買 損	△234,046,833
(C) 信 託 報 酬 等	△ 12,895,477
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△200,925,422
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 20,937,444
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△ 34,537,369
(配 当 等 相 当 額)	( 149,292)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 34,686,661)
(G) 計 (D + E + F)	△256,400,235
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	△256,400,235
追 加 信 託 差 損 益 金	△ 34,537,369
(配 当 等 相 当 額)	( 149,292)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 34,686,661)
分 配 準 備 積 立 金	60,340
繰 越 損 益 金	△221,923,206

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

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

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

(注4) 分配金の計算過程

計算期間末における費用控除後の配当等収益(0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(149,292円)及び分配準備積立金(60,340円)より分配対象収益は209,632円(1万口当たり1.66円)ですが、分配を行っておりません。なお、分配金の計算過程においては、親投資信託の配当等収益及び収益調整金相当額を充当する方法によっております。

## ■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては、運用実績等を勘案して無分配とさせていただきます。

## スウェドバンク・ロボー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス J P Y

当ファンドは「D I A Mロシア株式ファンド」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
投資方針および 主要投資対象	<p>①主として、ロシアの株式等<sup>(※1)</sup>を主要投資対象<sup>(※2)</sup>とし、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。</p> <p><sup>(※1)</sup>現物株式のほか、D R（海外預託証書）にも投資する場合があります。</p> <p><sup>(※2)</sup>ロシア企業を主要投資対象としますが、ロシアを除くC I S（独立国家共同体）の企業にも投資することがあります。この場合、時価金額の合計は純資産総額の20%以下とします。</p> <p>②ロシア株式の代表的指数である「M S C I ロシア10-40指数（円換算ベース、配当込み、為替ヘッジなし）」をベンチマークとします。</p> <p>③銘柄選定にあたっては、トップダウンとボトムアップによるリサーチを行い、投資対象銘柄のファンダメンタルズ分析やバリュエーション分析などを行って、投資銘柄を選定します。</p> <p>④外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。</p>
運 用 会 社	スウェドバンク・ロボー・エービー（Swedbank Robur AB）

スウェドバンク・ロポー インターナショナル ロシア エクイティ サブ ファンド クラス J P Yはルクセンブルグ籍円建投資信託で、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」は、2010年12月31日現在の財務諸表の原文の一部を抜粋・翻訳したものです。

## 損益計算書および純資産変動計算書

(ユーロ建て表示)

2010年1月1日～2010年12月31日

	ユーロ
期首時点の純資産	7,198,793.20
<b>収益</b>	
配当金	96,703.14
<b>収益合計</b>	<b>96,703.14</b>
<b>費用</b>	
投資顧問報酬	37,241.98
保管費用	6,233.74
ファンド管理手数料	1,225.88
監査報酬および弁護士報酬	14,028.06
当局に支払われた各種手数料	752.08
銀行預金利息	129.19
その他管理費用	17,435.62
<b>費用合計</b>	<b>77,046.55</b>
<b>投資損益</b>	<b>19,656.59</b>
有価証券売却実現損益	1,000,722.64
外国為替実現損益	292,446.21
<b>当期実現損益</b>	<b>1,312,825.44</b>
<b>未実現損益の変動：</b>	
投資有価証券	1,360,835.33
<b>当期未実現損益の変動</b>	<b>1,360,835.33</b>
<b>当期の運用における純資産の変動</b>	<b>2,673,660.77</b>
投資口の発行による純資産増加額	2,129,518.18
投資口の買戻による純資産減少額	-3,576,832.04
<b>期末時点の純資産</b>	<b>8,425,140.11</b>

組入投資有価証券明細  
2010年12月31日現在  
(ユーロ建て表示)

銘柄名	株数	評価額 (ユーロ建て)	純資産価値に 対する比率
<b>公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券</b>			
<b>株式</b>			
英ポンド建て株式			
PETER HAMBRO MINING	1,150	15,306.39	0.18
		15,306.39	0.18
米ドル建て株式			
GAZPROM OAO	41,235	777,176.84	9.22
JSFC SISTEMA GDR REG S	6,100	113,512.73	1.35
LUKOIL HLDG SPONSORED ADR REPR 4 SHS	15,974	673,681.46	8.00
MAGNITOGORSK IRON SP GDR REG S	2,200	23,893.41	0.28
MECHEL ADR	10,083	221,800.42	2.63
MECHEL OJSC	7,200	51,593.64	0.61
MMC NORILSK NICKEL SP GDR REG S	41,051	725,294.64	8.61
MOBILE TELESYSTEMS SPON ADR	4,450	68,924.02	0.82
NOVATEK SP GDR REPR 10 REG -S-	4,700	419,235.67	4.98
NOVOLIPET GDR REG S	8,900	316,884.40	3.76
POLYMETAL GDR REG -S-	9,075	124,030.20	1.47
POLYUS ZOLOTO SP ADR	3,700	100,115.70	1.19
ROSNEFT OIL OJSC SP GDR REG S	64,300	343,650.09	4.08
RUSHYDRO-SP GDR	77,550	315,479.23	3.74
SEVERESTAL REG-S SGDRR	27,262	342,886.26	4.07
TATNFT SP GDR REG S	13,333	329,418.77	3.91
TMK SPONSORED GLOBAL DEPO RECEIPT REG -S-	4,900	75,564.68	0.90
TRANSCONTAINER	12,500	88,639.25	1.05
URALKALI GDR REG S	13,640	373,860.44	4.44
VIMPEL COMMUNICATION SP ADR	9,300	104,683.14	1.24
VNESHTORGBANK GDR REG S	70,400	346,298.45	4.11
X5 RTL SP GDR	8,583	296,307.96	3.52
		6,232,931.40	73.98
<b>株式合計</b>		<b>6,248,237.79</b>	<b>74.16</b>
<b>公認の証券取引所に上場されている譲渡可能な有価証券合計</b>		<b>6,248,237.79</b>	<b>74.16</b>

銘柄名	株数	評価額 (ユーロ建て)	純資産価値に 対する比率
<b>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</b>			
<b>株式</b>			
米ドル建て株式			
2ND GENERATION COMPANY OF WHOLESALE ELECTRICITY OJSC WGC-2	1,140,000	49,984.03	0.59
FGC UES	31,900,000	286,211.86	3.40
GROUP LSR	1,300	31,925.06	0.38
IDGC HOLDING	1,024,000	134,227.55	1.59
INTER RAO UES	76,000,000	93,035.76	1.10
MOBILE TELESYSTEMS OJSC	22,800	144,823.32	1.72
PROTEK OJSC	29,000	45,413.35	0.54
RUSHYDRO	972,207	39,081.32	0.46
SBERBANK PREF	162,400	297,937.41	3.54
SBERBANK SHS	175,000	446,377.39	5.30
SURGUTNEFTEGAZ	308,000	117,985.82	1.40
SURGUTNEFTEGAZ OJSC	140,000	110,319.63	1.31
TRANSNEFT	150	137,669.80	1.63
WIMM BILL DANN FOODS OJSC	1,883	175,784.95	2.09
		2,110,777.25	25.05
<b>株式合計</b>		<b>2,110,777.25</b>	<b>25.05</b>
<b>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合計</b>		<b>2,110,777.25</b>	<b>25.05</b>
<b>投資有価証券評価額合計</b>		<b>8,359,015.04</b>	<b>99.21</b>
現金		48,045.96	0.57
その他資産		18,079.11	0.22
<b>純資産合計</b>		<b>8,425,140.11</b>	<b>100.00</b>

# 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ロシア株式ファンド」が投資対象とする親投資信託で、信託財産の実質的な運用を行っております。

以下、法令・諸規則に基づき、当親投資信託の第8期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

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

### ■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入率	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	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)



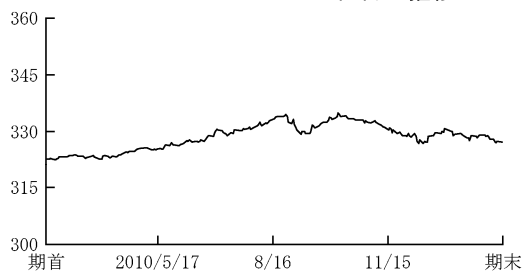
期 首	期中高値	期中安値	期 末
2010. 2. 15	2010. 10. 6	2010. 2. 22	2011. 2. 14
10,931円	11,337円	10,923円	11,081円

## 《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。

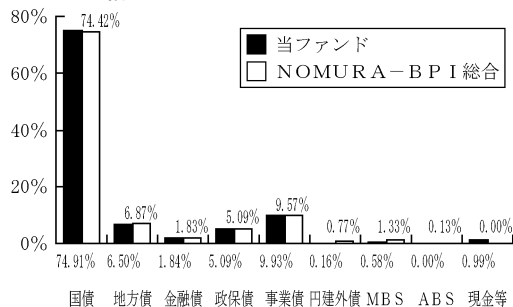
### 《今後の運用方針》

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。

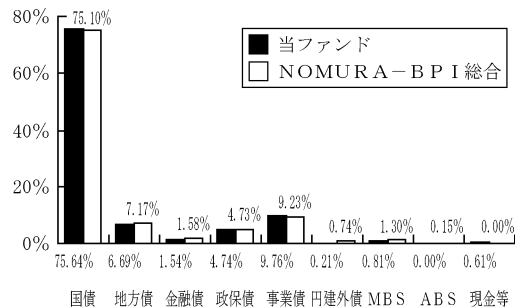
【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの運用状況】 (注) 組入比率は純資産総額比です。

期首 (前期末)

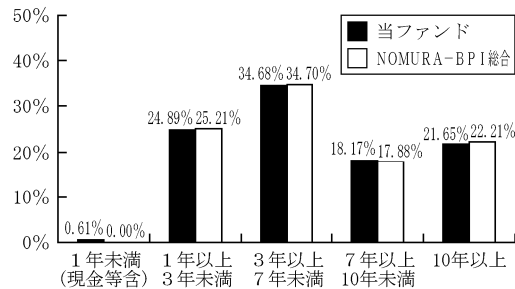
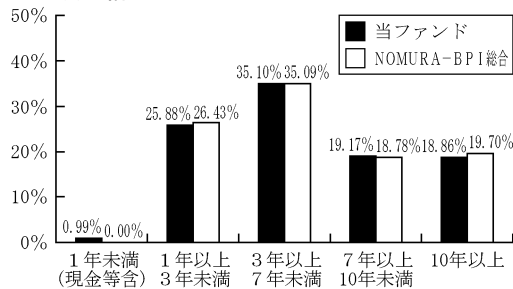
セクター別構成比



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	2,000,000	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	—
<b>(地方債証券)</b>				
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	2012/10/24
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、機構承継債券	1.840	100,000	103,833	2013/12/20
第6回 政保中部国際空港債券	1.400	100,000	102,976	2014/03/26
第140回 政保預金保険機構債券	0.800	300,000	302,331	2012/07/12
第143回 政保預金保険機構債券	0.900	280,000	282,716	2012/08/15
第11回 住宅金融支援機構債券	1.660	200,000	208,444	2016/05/10
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441回 東京電力社債	3.075	200,000	227,392	2017/09/22
第455回 東京電力社債	2.075	200,000	213,888	2018/10/23
第457回 東京電力社債	2.050	100,000	106,746	2018/11/16
第473回 東京電力社債	1.975	300,000	307,500	2012/08/17
第501回 東京電力社債	0.920	200,000	202,272	2013/02/14
第502回 東京電力社債	0.960	200,000	202,456	2013/02/27
第503回 東京電力社債	0.775	100,000	100,878	2013/04/25
第507回 東京電力社債	1.470	300,000	308,355	2013/10/28
第510回 東京電力社債	1.415	200,000	205,444	2013/12/24
第511回 東京電力社債	1.615	100,000	103,566	2014/05/28
第514回 東京電力社債	1.565	300,000	310,938	2014/10/29
第515回 東京電力社債	1.435	200,000	206,546	2015/02/10
第516回 東京電力社債	1.420	100,000	103,293	2015/04/27
第517回 東京電力社債	1.355	100,000	103,078	2015/06/15
第518回 東京電力社債	1.360	300,000	309,426	2015/08/12
第519回 東京電力社債	1.590	372,000	388,440	2015/12/28
第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 債	1,654,974,095
未 収 利 息	71,172,158
前 払 費 用	254,200,000
(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。