

運用報告書 (全体版)

第27期<決算日2021年2月1日>

財形株投(一般財形30)(財形貯蓄専用ファンド)

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/資産複合	
信託期間	原則、無期限です。	
運用方針	信託財産の成長と安定した収益の確保を目的として、安定運用を行います。	
主要投資対象	財形株投(一般財形30)	財形公社債マザーファンド受益証券およびインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券ならびに内外の公社債およびわが国の株式。
	財形公社債マザーファンド	内外の公社債。
	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、日経平均株価(225種・東証)に採用された銘柄。
運用方法	財形公社債マザーファンド受益証券および内外の公社債ならびにインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券およびわが国の株式への投資により、安定した収益の確保と売買益の獲得をはかります。インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド受益証券およびわが国の株式への投資にあたっては、株式の実質投資割合の限度を信託財産の純資産総額の30%とし、常時相当程度の組入比率を維持することを基本とします。	
組入制限	財形株投(一般財形30)	株式(新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。)への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
	財形公社債マザーファンド	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。
	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	株式への投資割合には制限を設けません。
分配方針	原則として、利息等収益を中心に安定的に行います。分配金は、自動的に全額再投資されます。	

受益者の皆さまへ

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、「財形株投(一般財形30)」は、2021年2月1日に第27期の決算を行いました。ここに、運用経過等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：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さま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。

アセットマネジメントOne 株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

<http://www.am-one.co.jp/>

財形株投(一般財形30)

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価(225)		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	純資産総額
	(分配額)	税込み分配金	期中騰落率	(参考指数)	期中騰落率				
	円	円	%	円	%	%	%	%	百万円
23期(2017年2月1日)	9,292	5	1.3	19,148.08	7.2	25.8	1.0	42.3	72
24期(2018年2月1日)	9,711	5	4.6	23,486.11	22.7	25.7	1.4	50.2	75
25期(2019年2月4日)	9,351	5	△3.7	20,883.77	△11.1	26.1	1.5	39.1	92
26期(2020年2月3日)	9,495	5	1.6	22,971.94	10.0	25.2	1.6	50.1	113
27期(2021年2月1日)	9,999	5	5.4	28,091.05	22.3	26.7	0.6	62.9	135

(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組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません(以下同じ)。

(注5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		日経平均株価(225)		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率
	騰落率	(参考指数)	騰落率				
(期首)	円	%	円	%	%	%	%
2020年2月3日	9,495	-	22,971.94	-	25.2	1.6	50.1
2月末	9,281	△2.3	21,142.96	△8.0	25.2	1.5	49.7
3月末	9,040	△4.8	18,917.01	△17.7	27.1	0.8	54.6
4月末	9,195	△3.2	20,193.69	△12.1	27.4	0.7	62.3
5月末	9,395	△1.1	21,877.89	△4.8	27.3	1.9	59.1
6月末	9,436	△0.6	22,288.14	△3.0	25.2	0.7	49.0
7月末	9,357	△1.5	21,710.00	△5.5	26.9	0.4	50.0
8月末	9,513	0.2	23,139.76	0.7	27.2	1.6	58.1
9月末	9,526	0.3	23,185.12	0.9	26.0	1.4	57.9
10月末	9,490	△0.1	22,977.13	0.0	26.6	1.3	59.5
11月末	9,864	3.9	26,433.62	15.1	25.0	1.6	55.8
12月末	9,954	4.8	27,444.17	19.5	26.0	1.1	64.1
2021年1月末	9,963	4.9	27,663.39	20.4	26.4	0.6	63.2
(期末)							
2021年2月1日	10,004	5.4	28,091.05	22.3	26.7	0.6	62.9

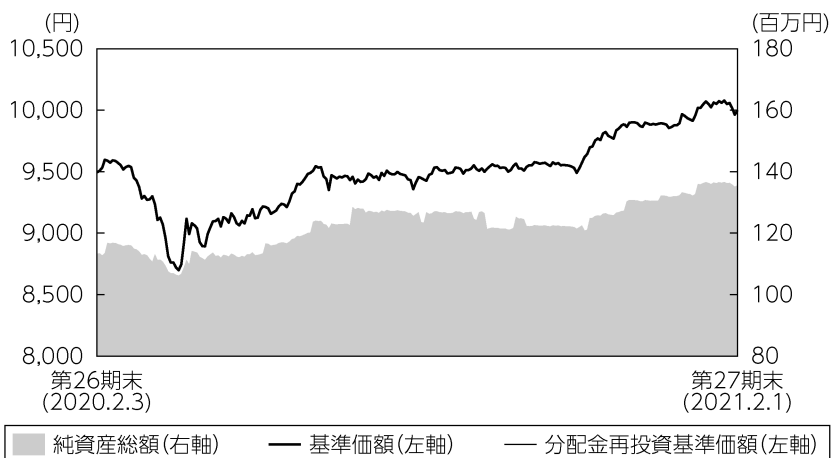
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 株式先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2020年2月4日から2021年2月1日まで）

基準価額等の推移



第27期首： 9,495円
第27期末： 9,999円
(既払分配金5円)
騰落率： 5.4%
(分配金再投資ベース)

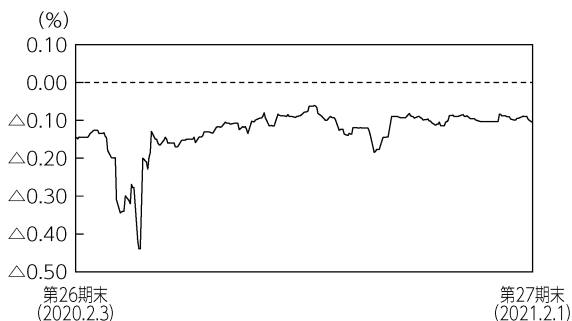
- 純資産総額(右軸) — 基準価額(左軸) — 分配金再投資基準価額(左軸)
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものではありません。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

国内の株式および公社債への投資を行った結果、国内株式の市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

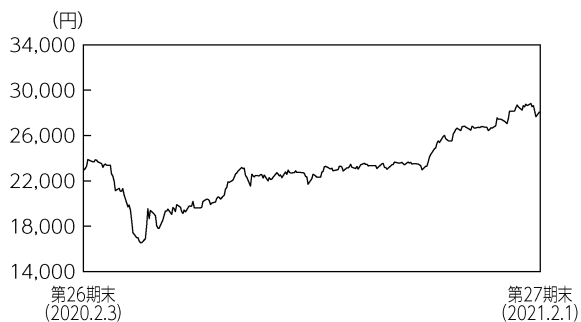
<国庫短期証券（TB）3ヵ月利回りの推移>



※国庫短期証券（TB）3ヵ月利回りの低下は価格の上昇を示し、逆の場合は下落したことを示します。

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力がかかっていることが要因となりました。

<日経平均株価（225）の推移>



国内株式市場は、2020年2月半ばから3月半ばにかけて、新型コロナウイルス感染拡大などを受け、大幅下落となりました。その後は、各国政府による財政出動や新型コロナウイルスのワクチン開発への期待の高まりを受け、戻り歩調を辿りました。11月以降は、米大統領選という大きな政治日程を通過したことや、米経済対策法案成立、米英におけるワクチン接種開始などが好感され、日経平均株価は大きく上昇、30年ぶりの高値更新となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

当ファンドでは、わが国の株式および内外の公社債に実質的に投資し、投資信託財産の成長と安定した収益の確保をはかることを目的として安定運用を行います。当期の運用にあたっては、わが国の株式および内外の公社債への直接投資は行わず、財形公社債マザーファンドおよびインデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドに投資しました。

●財形公社債マザーファンド

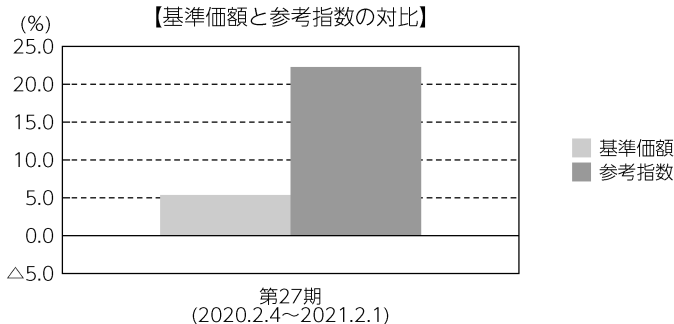
地方債などを組み入れるポートフォリオを維持しました。また、当期は組入債券の償還見合いで地方債などを買付けました。

●インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。
グラフは、基準価額と参考指数の騰落率の対比です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金(税引前)込みです。

分配金

収益分配金につきましては運用実績等を勘案し、以下の表の通り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。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2020年2月4日 ～2021年2月1日
当期分配金（税引前）	5円
対基準価額比率	0.05%
当期の収益	5円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	2,617円

(注1) 「当期の収益」および「当期の収益以外」は、小数点以下切捨てで算出しているためこれらを合計した額と「当期分配金（税引前）」の額が一致しない場合があります。

(注2) 当期分配金の「対基準価額比率」は「当期分配金（税引前）」の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。また、小数点第3位を四捨五入しています。

(注3) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後・繰越欠損補填後の売買益（含、評価益）」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「分配準備積立金」および「収益調整金」から分配に充当した金額です。

今後の運用方針

●当ファンド

財形公社債マザーファンドへの投資により安定した収益の確保に努める一方、インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドへの投資により信託財産の成長を目指します。

●財形公社債マザーファンド

引き続き公社債を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

●インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド

今後の運用につきましても、日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第27期		項目の概要
	(2020年2月4日 ～2021年2月1日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	151円	1.586%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は9,500円です。
(投信会社)	(34)	(0.361)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価
(販売会社)	(109)	(1.149)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
(受託会社)	(7)	(0.077)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売買委託手数料	0	0.000	(b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
(c) その他費用	0	0.001	(c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
(監査費用)	(0)	(0.001)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査にかかる費用
合計	151	1.588	

(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・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
なお、売買委託手数料およびその他費用は、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まず。

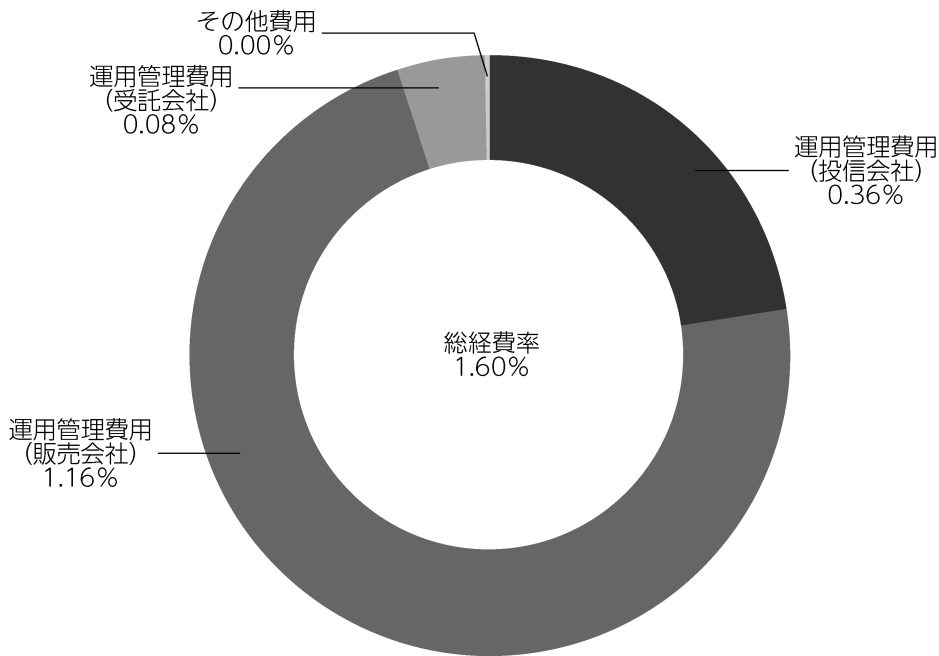
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は1.60%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2020年2月4日から2021年2月1日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
財形公社債マザーファンド	26,649	30,900	12,592	14,600
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	4,662	11,700	4,902	13,700

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,890,106千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,735,934千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.24

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年2月4日から2021年2月1日まで）

【財形株投(一般財形30)における利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

期中の利害関係人との取引等はありません。

(2) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	0.414千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.414千円
(B)/(A)	100.0%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

【財形公社債マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公 社 債	207	70	34.2	-	-	-

平均保有割合 28.3%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

【インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 732	百万円 21	% 2.9	百万円 2,157	百万円 174	% 8.1
株 式 先 物 取 引	4,923	4,923	100.0	5,511	5,511	100.0

平均保有割合 0.3%

(注) 平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 0.13	百万円 0.405722	百万円 2

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 21

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細
親投資信託残高

	期首(前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
財形公社債マザーファンド	66,334	80,392	93,238
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	10,418	10,178	37,053

■投資信託財産の構成

2021年2月1日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
財形公社債マザーファンド	93,238	68.3
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド	37,053	27.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	6,321	4.6
投 資 信 託 財 産 総 額	136,613	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月1日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	136,613,313円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	6,321,157
財形公社債マザーファンド(評価額)	93,238,973
インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド(評価額)	37,053,183
(B) 負 債	1,078,554
未 払 収 益 分 配 金	67,774
未 払 信 託 報 酬	1,009,824
そ の 他 未 払 費 用	956
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	135,534,759
元 本	135,549,848
次 期 繰 越 損 益 金	△15,089
(D) 受 益 権 総 口 数	135,549,848口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,999円

(注) 期首における元本額は119,250,979円、当期中における追加設定元本額は46,778,275円、同解約元本額は30,479,406円です。

■損益の状況

当期 自2020年2月4日 至2021年2月1日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△1,594円
受 取 利 息	210
支 払 利 息	△1,804
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	8,729,099
売 買 益	9,669,232
売 買 損	△940,133
(C) 信 託 報 酬 等	△1,943,747
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	6,783,758
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,641,153
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	△9,372,226
(配 当 等 相 当 額)	(26,116,307)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△35,488,533)
(G) 合 計(D+E+F)	52,685
(H) 収 益 分 配 金	△67,774
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△15,089
追 加 信 託 差 損 益 金	△9,372,226
(配 当 等 相 当 額)	(26,116,307)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△35,488,533)
分 配 準 備 積 立 金	9,358,731
繰 越 損 益 金	△1,594

(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

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	6,105,817
(c) 収 益 調 整 金	26,116,307
(d) 分 配 準 備 積 立 金	3,320,688
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	35,542,812
(f) 1万口当たり当期分配対象額	2,622.12
(g) 分 配 金	67,774
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	5

■分配金のお知らせ

1万口当たり分配金 5円

※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

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（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、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンド 運用報告書

第19期 (決算日 2021年1月14日)

(計算期間 2020年1月15日～2021年1月14日)

インデックス マネジメント ファンド 225 マザーファンドの第19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	原則、無期限です。
運用方針	日経平均株価（225種・東証）に連動する投資成果をめざした運用を行います。
主要投資対象	東京証券取引所第一部に上場されている株式のうち、日経平均株価（225種・東証）に採用された銘柄とします。
主な組入制限	株式の投資割合には制限を設けません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		日経平均株価 (225)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	(ベンチマーク) 円	期中騰落率			
15期 (2017年1月14日)	23,096	14.0	19,287.28	11.9	93.6	6.1	19,333
16期 (2018年1月14日)	28,842	24.9	23,653.82	22.6	93.9	6.0	17,655
17期 (2019年1月14日)	25,333	△12.2	20,359.70	△13.9	93.7	6.2	13,491
18期 (2020年1月14日)	30,531	20.5	24,025.17	18.0	93.2	6.7	13,595
19期 (2021年1月14日)	37,190	21.8	28,698.26	19.5	96.6	3.3	14,019

(注1) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注2) 「日経平均株価」は、株式会社日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、株式会社日本経済新聞社は、「日経平均株価」自体および「日経平均株価」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。

当ファンドは、投資信託委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、株式会社日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切責任を負いません（以下同じ）。

(注3) △（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

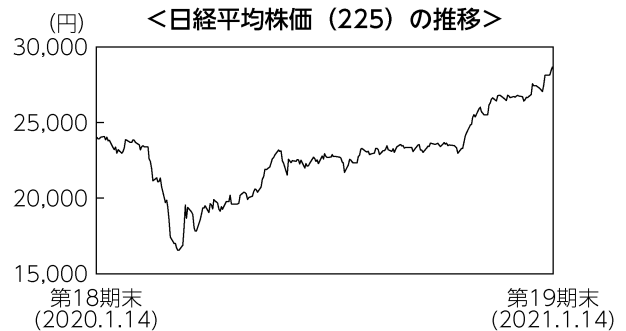
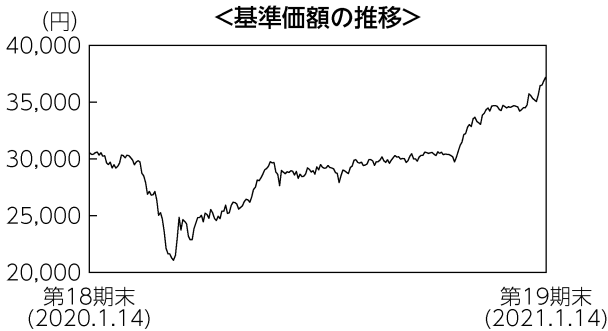
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		日経平均株価 (225)		株式組入 比 率	株式先物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首)	円	%	円	%	%	%
2020年 1 月 14日	30,531	-	24,025.17	-	93.2	6.7
1 月 末	29,488	△3.4	23,205.18	△3.4	93.9	6.0
2 月 末	26,889	△11.9	21,142.96	△12.0	94.2	5.5
3 月 末	24,291	△20.4	18,917.01	△21.3	97.1	2.8
4 月 末	25,928	△15.1	20,193.69	△15.9	97.3	2.4
5 月 末	28,084	△8.0	21,877.89	△8.9	93.5	6.4
6 月 末	28,655	△6.1	22,288.14	△7.2	97.0	2.8
7 月 末	27,914	△8.6	21,710.00	△9.6	98.3	1.5
8 月 末	29,760	△2.5	23,139.76	△3.7	94.2	5.6
9 月 末	30,000	△1.7	23,185.12	△3.5	94.8	5.1
10 月 末	29,730	△2.6	22,977.13	△4.4	95.1	4.7
11 月 末	34,209	12.0	26,433.62	10.0	93.4	6.1
12 月 末	35,561	16.5	27,444.17	14.2	95.8	4.1
(期 末)						
2021年 1 月 14日	37,190	21.8	28,698.26	19.5	96.6	3.3

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 株式先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2020年1月15日から2021年1月14日まで）



基準価額の推移

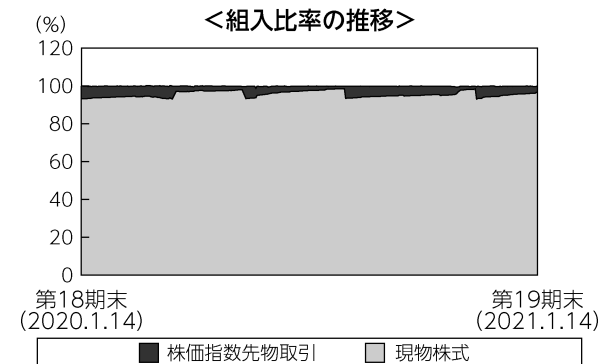
当ファンドの基準価額は、前期末比で21.8%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

主として国内株式への投資を行った結果、市況が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

投資環境

国内株式市場は、2020年2月半ばから3月半ばにかけて、新型コロナウイルス感染拡大などを受け、大幅下落となりました。その後は、各国政府による財政出動や新型コロナウイルスのワクチン開発への期待の高まりを受け、戻り歩調を辿りました。期末にかけては、米国大統領選挙という大きな政治日程を通過したことやワクチン開発の実用化期待の高まりなどから、一段高となりました。



※比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

※計理処理の関係上、一時的に100%を超える場合があります。

ポートフォリオについて

日経平均株価に連動する投資成果を目標に運用を行いました。日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資を行いました。また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価との連動性維持に努めました。なお、日経平均株価採用銘柄の入替等にも適宜対応しました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で19.5%上昇しました。当ファンドはベンチマークを2.3%程度上回りました。この差異は、主に、保有株式の配当金のプラス要因によるものです。

今後の運用方針

今後の運用につきましても、日経平均株価に採用されている銘柄に等株数投資を行い、また、現物株式と株価指数先物を合わせた実質的な株式の組入比率を高位に維持することにより、日経平均株価に連動する投資成果を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
(a) 売買委託手数料	0円	0.001%	(a) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、組入有価証券等の売買の際に発生する手数料
(株式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
合計	0	0.001	
期中の平均基準価額は29,370円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注2) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況 (2020年1月15日から2021年1月14日まで)

(1) 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内 上 場		千株	千円	千株	千円
		269.6 (41.6)	732,978 (-)	638	2,157,127

(注1) 金額は受渡代金です。

(注2) () 内は株式分割、増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(2) 先物取引の種類別取引状況

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		4,923	5,435	-	-

(注) 金額は受渡代金です。

■ 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	2,890,106千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	11,667,618千円
(c) 売 買 高 比 率 (a) / (b)	0.24

(注) (b)は各月末の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2020年1月15日から2021年1月14日まで）

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
株 式	百万円 732	百万円 21	% 2.9	百万円 2,157	百万円 174	% 8.1
株 式 先 物 取 引	4,923	4,923	100.0	5,435	5,435	100.0

(2) 利害関係人の発行する有価証券等

種 類	当 期		
	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株 式	百万円 0.13	百万円 0.405722	百万円 2

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
株 式	百万円 21

(4) 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売 買 委 託 手 数 料 総 額 (A)	149千円
う ち 利 害 関 係 人 へ の 支 払 額 (B)	149千円
(B)/(A)	100.0%

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほフィナンシャルグループです。

■組入資産の明細

(1) 国内株式

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)			
日本水産	19	17	7,582
マルハニチロ	1.9	1.7	3,889
鉱業 (0.0%)			
国際石油開発帝石	7.6	6.8	4,372
建設業 (1.6%)			
コムシスホールディングス	19	17	55,165
大成建設	3.8	3.4	12,223
大林組	19	17	16,065
清水建設	19	17	13,243
長谷工コーポレーション	3.8	3.4	4,154
鹿島建設	9.5	8.5	12,359
大和ハウス工業	19	17	53,584
積水ハウス	19	17	36,550
日揮ホールディングス	19	17	18,921
食料品 (3.4%)			
日清製粉グループ本社	19	17	28,883
明治ホールディングス	3.8	3.4	25,058
日本ハム	9.5	8.5	39,142
サッポロホールディングス	3.8	3.4	6,749
アサヒグループホールディングス	19	17	71,689
キリンホールディングス	19	17	39,967
宝ホールディングス	19	17	21,930
キッコーマン	19	17	127,160
味の素	19	17	41,888
ニチレイ	9.5	8.5	25,304
日本たばこ産業	19	17	34,935
繊維製品 (0.2%)			
東洋紡	1.9	1.7	2,364
ユニチカ	1.9	1.7	683
帝人	3.8	3.4	6,803
東レ	19	17	11,257
パルプ・紙 (0.1%)			
王子ホールディングス	19	17	10,795
日本製紙	1.9	1.7	2,157

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (7.8%)			
クラレ	19	17	19,108
旭化成	19	17	19,516
昭和電工	1.9	1.7	4,166
住友化学	19	17	7,344
日産化学	19	17	101,320
東ソー	9.5	8.5	14,994
トクヤマ	3.8	3.4	8,690
デンカ	3.8	3.4	14,620
信越化学工業	19	17	324,360
三井化学	3.8	3.4	10,193
三菱ケミカルホールディングス	9.5	8.5	5,633
宇部興産	1.9	1.7	3,323
日本化薬	19	—	—
花王	19	17	133,841
D I C	1.9	1.7	4,479
富士フィルムホールディングス	19	17	104,244
資生堂	19	17	113,696
日東電工	19	17	161,500
医薬品 (7.8%)			
協和キリン	19	17	47,413
武田薬品工業	19	17	62,730
アステラス製薬	95	85	140,632
大日本住友製薬	19	17	25,398
塩野義製薬	19	17	99,297
中外製薬	19	51	295,902
エーザイ	19	17	129,166
第一三共	19	51	185,997
大塚ホールディングス	19	17	75,157
石油・石炭製品 (0.2%)			
出光興産	7.6	6.8	16,680
E N E O S ホールディングス	19	17	7,255
ゴム製品 (0.6%)			
横浜ゴム	9.5	8.5	13,889
ブリヂストン	19	17	66,300

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ガラス・土石製品 (1.0%)			
AGC	3.8	3.4	12,682
日本板硝子	1.9	1.7	843
日本電気硝子	5.7	5.1	11,760
住友大阪セメント	1.9	1.7	5,397
太平洋セメント	1.9	1.7	4,671
東海カーボン	19	17	25,279
TOTO	9.5	8.5	50,490
日本碍子	19	17	30,260
鉄鋼 (0.1%)			
日本製鉄	1.9	1.7	2,450
神戸製鋼所	1.9	1.7	965
ジェイ エフ イー ホールディングス	1.9	1.7	1,759
大平洋金属	1.9	1.7	4,017
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	19	1.7	3,413
三井金属鉱業	1.9	1.7	6,885
東邦亜鉛	1.9	1.7	4,205
三菱マテリアル	1.9	1.7	4,073
住友金属鉱山	9.5	8.5	42,831
DOWAホールディングス	3.8	3.4	14,059
古河電気工業	1.9	1.7	5,074
住友電気工業	19	17	25,406
フジクラ	19	17	8,568
金属製品 (0.2%)			
SUMCO	1.9	1.7	4,090
東洋製罐グループホールディングス	19	17	19,890
機械 (5.0%)			
日本製鋼所	3.8	3.4	10,727
オークマ	3.8	3.4	21,148
アマダ	19	17	20,383
小松製作所	19	17	51,340
住友重機械工業	3.8	3.4	9,972
日立建機	19	17	54,145
クボタ	19	17	39,652
荏原製作所	3.8	3.4	12,631
ダイキン工業	19	17	404,515

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本精工	19	17	16,388
NTN	19	17	4,590
ジェイテクト	19	17	14,773
日立造船	3.8	3.4	2,261
三菱重工業	1.9	1.7	5,662
IHI	1.9	1.7	3,360
電気機器 (22.3%)			
日清紡ホールディングス	19	17	13,311
コニカミノルタ	19	17	7,021
ミネベアミツミ	19	17	37,400
日立製作所	3.8	3.4	14,756
三菱電機	19	17	28,594
富士電機	3.8	3.4	14,161
安川電機	19	17	101,320
オムロン	19	17	168,470
ジーエス・ユアサ コーポレーション	3.8	3.4	10,608
日本電気	1.9	1.7	9,860
富士通	1.9	1.7	27,234
沖電気工業	1.9	1.7	1,749
セイコーエプソン	38	34	54,774
パナソニック	19	17	21,913
シャープ	—	17	31,195
ソニー	19	17	182,750
TDK	19	17	294,950
アルプスアルパイン	19	17	25,024
横河電機	19	17	39,236
アドバンテスト	38	34	295,800
カシオ計算機	19	17	31,416
ファナック	19	17	470,475
京セラ	38	34	228,650
太陽誘電	19	17	94,860
SCREENホールディングス	3.8	3.4	28,288
キャノン	28.5	25.5	52,899
リコー	19	17	12,444
東京エレクトロン	19	17	718,250
輸送用機器 (4.0%)			
デンソー	19	17	100,844

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井E&Sホールディングス	1.9	1.7	685
川崎重工業	1.9	1.7	4,358
日産自動車	19	17	9,159
いすゞ自動車	9.5	8.5	8,670
トヨタ自動車	19	17	133,671
日野自動車	19	17	15,572
三菱自動車工業	1.9	1.7	391
マツダ	3.8	3.4	2,584
本田技研工業	38	34	99,246
スズキ	19	17	88,740
S U B A R U	19	17	35,904
ヤマハ発動機	19	17	36,193
精密機器 (3.3%)			
テルモ	76	68	288,048
ニコン	19	17	13,651
オリンパス	76	68	138,142
シチズン時計	19	17	5,389
その他製品 (2.2%)			
バンダイナムコホールディングス	19	17	158,695
凸版印刷	9.5	8.5	13,090
大日本印刷	9.5	8.5	16,235
ヤマハ	19	17	107,780
電気・ガス業 (0.1%)			
東京電力ホールディングス	1.9	1.7	554
中部電力	1.9	1.7	2,250
関西電力	1.9	1.7	1,743
東京瓦斯	3.8	3.4	8,166
大阪瓦斯	3.8	3.4	7,027
陸運業 (1.6%)			
東武鉄道	3.8	3.4	10,421
東急	9.5	8.5	10,829
小田急電鉄	9.5	8.5	27,625
京王電鉄	3.8	3.4	28,118
京成電鉄	9.5	8.5	29,240
東日本旅客鉄道	1.9	1.7	11,396
西日本旅客鉄道	1.9	1.7	9,261
東海旅客鉄道	1.9	1.7	24,905

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本通運	1.9	1.7	12,750
ヤマトホールディングス	19	17	47,362
海運業 (0.1%)			
日本郵船	1.9	1.7	4,488
商船三井	1.9	1.7	5,423
川崎汽船	1.9	1.7	3,587
空運業 (0.0%)			
ANAホールディングス	1.9	1.7	3,878
倉庫・運輸関連業 (0.2%)			
三菱倉庫	9.5	8.5	27,242
情報・通信業 (12.6%)			
ネクソン	-	34	115,600
Zホールディングス	7.6	6.8	4,806
トレンドマイクロ	19	17	98,090
スカパーJ S A Tホールディングス	1.9	1.7	805
日本電信電話	7.6	6.8	18,802
K D D I	114	102	330,276
ソフトバンク	-	17	23,009
N T T ドコモ	1.9	-	-
東宝	1.9	1.7	7,148
エヌ・ティ・ティ・データ	95	85	126,650
コナミホールディングス	19	17	109,990
ソフトバンクグループ	114	102	874,038
卸売業 (1.8%)			
双日	1.9	1.7	425
伊藤忠商事	19	17	53,329
丸紅	19	17	12,812
豊田通商	19	17	74,970
三井物産	19	17	34,000
住友商事	19	17	24,437
三菱商事	19	17	45,747
小売業 (13.1%)			
J. フロント リテイリング	9.5	8.5	7,199
三越伊勢丹ホールディングス	19	17	10,727
セブン&アイ・ホールディングス	19	17	67,184
ファミリーマート	76	-	-
高島屋	9.5	8.5	7,709

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
丸井グループ	19	17	31,110
イオン	19	17	57,511
ファーストリテイリング	19	17	1,592,220
銀行業 (0.5%)			
コンコルディア・フィナンシャルグループ	19	17	6,732
新生銀行	1.9	1.7	2,383
あおぞら銀行	1.9	1.7	3,372
三菱UFJフィナンシャル・グループ	19	17	8,518
りそなホールディングス	1.9	1.7	668
三井住友トラスト・ホールディングス	1.9	1.7	5,742
三井住友フィナンシャルグループ	1.9	1.7	6,024
千葉銀行	19	17	10,421
ふくおかフィナンシャルグループ	3.8	3.4	6,874
静岡銀行	19	17	13,430
みずほフィナンシャルグループ	19	1.7	2,443
証券、商品先物取引業 (0.2%)			
大和証券グループ本社	19	17	8,802
野村ホールディングス	19	17	10,031
松井証券	19	17	14,076
保険業 (0.7%)			
SOMPOホールディングス	4.7	4.2	18,102
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	5.7	5.1	16,911
ソニーフィナンシャルホールディングス	3.8	-	-
第一生命ホールディングス	1.9	1.7	2,992
東京海上ホールディングス	9.5	8.5	47,965

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
T&Dホールディングス	3.8	3.4	4,702
その他金融業 (0.5%)			
クレディセゾン	19	17	21,250
日本取引所グループ	-	17	45,254
不動産業 (1.0%)			
東急不動産ホールディングス	19	17	9,401
三井不動産	19	17	35,394
三菱地所	19	17	28,398
東京建物	9.5	8.5	12,580
住友不動産	19	17	53,380
サービス業 (6.9%)			
エムスリー	45.6	40.8	419,628
ディー・エヌ・エー	5.7	5.1	9,654
電通グループ	19	17	52,530
サイバーエージェント	3.8	3.4	24,684
楽天	19	17	16,558
リクルートホールディングス	57	51	232,968
日本郵政	19	17	14,793
セコム	19	17	169,116
合 計	株 数 ・ 金 額	株 数	株 数
	銘柄数 < 比率 >	225 銘柄	225 銘柄
		3,411.4	3,084.6
		13,547,460	<96.6%>

(注1) 銘柄欄の () 内は、期末の国内株式評価額に対する各業種の比率です。

(注2) 合計欄の < > 内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨ててあります。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	別	当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国内	日 経 平 均	百万円	百万円
		460	-

■投資信託財産の構成

2021年1月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株 式	千円 13,547,460	% 96.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	545,343	3.9
投 資 信 託 財 産 総 額	14,092,803	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年1月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	14,092,803,882円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	498,675,682
株 式(評価額)	13,547,460,030
未 収 入 金	34,778,720
未 収 配 当 金	16,113,450
差 入 委 託 証 拠 金	△4,224,000
(B) 負 債	73,649,000
未 払 解 約 金	73,649,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	14,019,154,882
元 本	3,769,640,045
次 期 繰 越 損 益 金	10,249,514,837
(D) 受 益 権 総 口 数	3,769,640,045口
1万口当たり基準価額(C/D)	37,190円

(注1) 期首元本額 4,453,179,531円
追加設定元本額 180,747,596円
一部解約元本額 864,287,082円

(注2) 期末における元本の内訳
インデックスポートフォリオ 231,115,866円
ボンドミックスポートフォリオ 9,291,495円
財形株投 (一般財形30) 10,178,607円
財形株投 (一般財形50) 35,093,080円
財形株投 (年金・住宅財形30) 9,930,625円
インデックス マネジメント ファンド 225 2,127,231,003円
インデックス マネジメント ファンド 225 (DC年金) 182,674,135円
インデックス マネジメント ファンド 225 (変額年金) 643,611,655円
太陽ミリオン・インデックスポートフォリオ 498,602,837円
太陽ミリオン・ボンドミックスポートフォリオ 21,910,742円
期末元本合計 3,769,640,045円

■損益の状況

当期 自2020年1月15日 至2021年1月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	211,566,117円
受 取 配 当 金	211,759,826
そ の 他 収 益 金	6,748
支 払 利 息	△200,457
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	2,299,981,918
売 買 益	3,084,104,956
売 買 損	△784,123,038
(C) 先 物 取 引 等 損 益	61,070,180
取 引 益	226,353,830
取 引 損	△165,283,650
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	2,572,618,215
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	9,142,785,136
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,739,206,918
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	273,318,404
(H) 合 計(D+E+F+G)	10,249,514,837
次 期 繰 越 損 益 金(H)	10,249,514,837

(注1) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)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) (G)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。

財形公社債マザーファンド

運用報告書

第27期（決算日 2021年2月1日）

（計算期間 2020年2月2日～2021年2月1日）

財形公社債マザーファンドの第27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	原則、無期限です。
運用方針	内外の公社債への投資により、安定した収益の確保を目的として安定運用を行います。
主要投資対象	内外の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率			
23期（2017年2月1日）	11,592	0.0	65.2	—	192
24期（2018年2月1日）	11,590	△0.0	75.2	—	219
25期（2019年2月1日）	11,596	0.1	58.2	—	230
26期（2020年2月1日）	11,595	△0.0	73.8	—	272
27期（2021年2月1日）	11,598	0.0	91.5	—	334

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

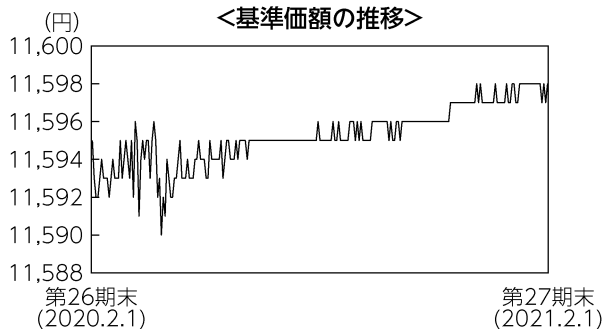
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額		債券組入 比 率	債券先物 比 率
	円	騰 落 率		
(期 首) 2020 年 2 月 1 日	11,595	—	73.8	—
2 月 末	11,595	0.0	71.0	—
3 月 末	11,591	△0.0	79.5	—
4 月 末	11,594	△0.0	90.8	—
5 月 末	11,594	△0.0	87.4	—
6 月 末	11,595	0.0	71.1	—
7 月 末	11,596	0.0	71.0	—
8 月 末	11,595	0.0	84.0	—
9 月 末	11,595	0.0	83.8	—
10 月 末	11,596	0.0	85.9	—
11 月 末	11,597	0.0	84.4	—
12 月 末	11,597	0.0	94.6	—
2021 年 1 月 末	11,597	0.0	91.5	—
(期 末) 2021 年 2 月 1 日	11,598	0.0	91.5	—

(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 (2020年2月2日から2021年2月1日まで)



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は前期末比で0.03%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

当ファンドは残存期間が1年程度の公社債を中心に実質的に投資を行いました。日銀のマイナス金利政策などは基準価額に対するマイナス要因となりましたが、保有債券のインカム収入などがプラス要因となったことから前期末比で基準価額は上昇しました。



※国庫短期証券 (TB) 3ヵ月利回りの低下は価格の上昇を示し、逆の場合は下落したことを示します。

投資環境

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀の金融緩和政策の影響からマイナス圏で推移しました。日銀が大規模な金融緩和政策を続けており、国債利回りに低下圧力が加かっていることが要因となりました。

ポートフォリオについて

当期は組入債券の償還見合いで地方債などを買付けました。

今後の運用方針

引き続き公社債を中心に投資を行い、安定した収益の確保を目指します。

■ 1万口当たりの費用明細

計算期間中に発生した費用はありません。

■ 売買及び取引の状況 (2020年2月2日から2021年2月1日まで)

公社債

		買付額	売付額
国	地方債証券	千円 166,614	千円 -
	特殊債証券	40,392	(100,000) -
			(-)

(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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2020年2月2日から2021年2月1日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決算期 区分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公社債	百万円 207	百万円 70	% 34.2	百万円 -	百万円 -	% -

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あり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券です。

■ 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			
地方債証券	千円 264,000	千円 266,009	% 79.5	% 69.2	% -	% 3.1	% 76.3			
特殊債券(除く金融債券)	40,000	40,209	12.0	-	-	-	12.0			
合計	304,000	306,219	91.5	69.2	-	3.1	88.3			

(注1) 組入比率は、期末の純資産総額に対する評価額の比率であり、小数点第2位を四捨五入しています。

(注2) 無格付銘柄については、BB格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示
国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘柄	当 期 末			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(地方債証券)	%	千円	千円	
474回 名古屋市公募公債 10年	1.3100	70,000	70,115	2021/03/19
96回 共同発行市場公募地方債	1.2900	30,000	30,054	2021/03/25
23年度6回 大阪市公募公債	1.0710	20,000	20,125	2021/09/16
28年度13回 京都府公募公債	0.0200	30,000	30,003	2022/03/17
23年度9回 福岡市公募公債 10年	1.0100	70,000	70,805	2022/03/28
24年度2回 愛知県公募公債	0.9820	18,700	18,924	2022/04/27
24年度3回 愛知県公募公債 10年	0.8910	15,300	15,478	2022/05/30
2回 横浜市公募公債 20年	1.9300	10,000	10,504	2023/09/20
小 計	—	264,000	266,009	—
(特殊債券（除く金融債券）)	%	千円	千円	
139回 高速道路機構債	1.1000	40,000	40,209	2021/07/30
小 計	—	40,000	40,209	—
合 計	—	304,000	306,219	—

■投資信託財産の構成

2021年2月1日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 306,219	% 91.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	28,547	8.5
投 資 信 託 財 産 総 額	334,766	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2021年2月1日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	334,766,213円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	27,556,207
公 社 債(評価額)	306,219,134
未 収 利 息	767,980
前 払 費 用	222,892
(B) 負 債	-
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	334,766,213
元 本	288,653,328
次 期 繰 越 損 益 金	46,112,885
(D) 受 益 権 総 口 数	288,653,328口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11,598円

(注1) 期首元本額	234,967,177円
追加設定元本額	88,013,688円
一部解約元本額	34,327,537円
(注2) 期末における元本の内訳	
財形株投 (一般財形30)	80,392,286円
財形株投 (一般財形50)	131,787,984円
財形株投 (年金・住宅財形30)	76,473,058円
期末元本合計	288,653,328円

■損益の状況

当期 自2020年2月2日 至2021年2月1日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	2,053,165円
受 取 利 息	2,076,164
支 払 利 息	△22,999
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,984,458
売 買 益	50,608
売 買 損	△2,035,066
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	68,707
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	37,480,329
(E) 解 約 差 損 益 金	△5,472,463
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	14,036,312
(G) 合 計(C+D+E+F)	46,112,885
次 期 繰 越 損 益 金(G)	46,112,885

(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。