

運用報告書(全体版)

第12期<決算日2020年10月12日>

D I AM国内債券パッシブ・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券（インデックス型）	
信託期間	2009年1月30日から無期限です。	
運用方針	NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	D I AM国内債券パッシブ・ファンド	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
運用方法	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。 マザーファンドにおいては、公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。 外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	決算日（原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の中から、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わない場合があります。	

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、「D I AM国内債券パッシブ・ファンド」は、2020年10月12日に第12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/>

DIAM国内債券パッシブ・ファンド

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			NOMURA-BPI総合		債券組入 比 率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率				
8期(2016年10月12日)	円 11,608	円 0	% 4.3	ポイント 384.37	% 4.9	% 99.5	% —	% —	百万円 13,578
9期(2017年10月12日)	11,389	0	△1.9	379.22	△1.3	99.1	—	—	17,741
10期(2018年10月12日)	11,326	0	△0.6	378.62	△0.2	99.8	—	—	22,011
11期(2019年10月15日)	11,722	0	3.5	393.16	3.8	96.2	—	—	27,457
12期(2020年10月12日)	11,497	0	△1.9	386.79	△1.6	99.1	—	—	25,754

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

(注2) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

(注3) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません（以下同じ）。

(注4) △（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		NOMURA-BPI総合		債券組入 比 率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2019年10月15日	円 11,722	% —	ポイント 393.16	% —	% 96.2	% —	% —
10月 末	11,707	△0.1	392.61	△0.1	99.5	—	—
11月 末	11,664	△0.5	391.33	△0.5	99.7	—	—
12月 末	11,627	△0.8	390.14	△0.8	100.7	—	—
2020年1月 末	11,672	△0.4	391.77	△0.4	98.9	—	—
2月 末	11,759	0.3	394.74	0.4	101.0	—	—
3月 末	11,569	△1.3	388.45	△1.2	101.4	—	—
4月 末	11,606	△1.0	389.79	△0.9	99.4	—	—
5月 末	11,553	△1.4	388.13	△1.3	99.3	—	—
6月 末	11,503	△1.9	386.56	△1.7	99.7	—	—
7月 末	11,539	△1.6	387.91	△1.3	99.5	—	—
8月 末	11,483	△2.0	386.09	△1.8	100.0	—	—
9月 末	11,512	△1.8	387.22	△1.5	99.7	—	—
(期 末) 2020年10月12日	11,497	△1.9	386.79	△1.6	99.1	—	—

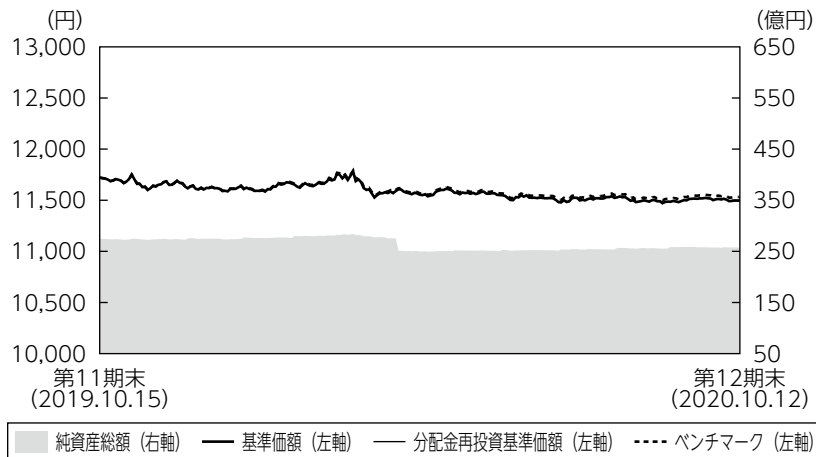
(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2019年10月16日から2020年10月12日まで）

基準価額等の推移



第12期首： 11,722円
第12期末： 11,497円
(既払分配金 0円)
騰落率： △1.9%
(分配金再投資ベース)

- (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す。
- (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およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落（利回りは上昇）を受けて、基準価額は下落しました。期初から2020年1月にかけては、国内債券市場の需給の緩みが意識されたことや、米金利の上昇などを受けて、基準価額は下落基調となりました。2月から3月にかけては新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり基準価額が上昇したものの、期末にかけては、株式を始めとするリスク性資産の価格が反発し、基準価額は下落しました。

投資環境

国内債券市場は下落しました。期初から2020年1月にかけては、国内債券市場の需給の緩みが意識されたことや、米金利の上昇などを受けて10年国債利回りは概ね上昇基調で推移しました。2月から3月にかけては新型コロナウイルスの感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり、10年国債利回りは低下（価格は上昇）したものの、期末にかけては、リスク性資産の価格の反発などを受けて上昇しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

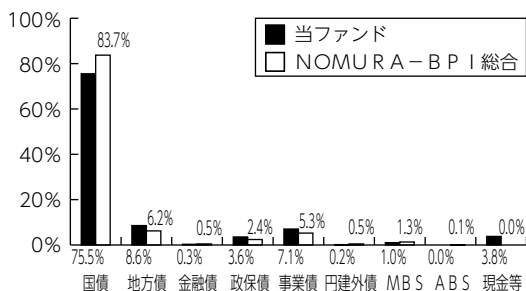
●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

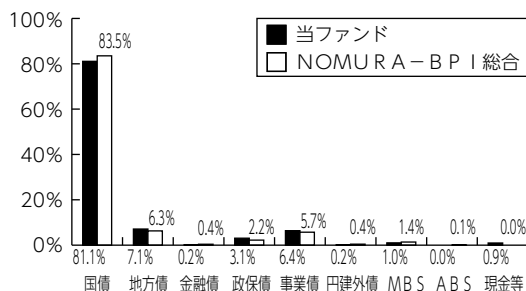
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

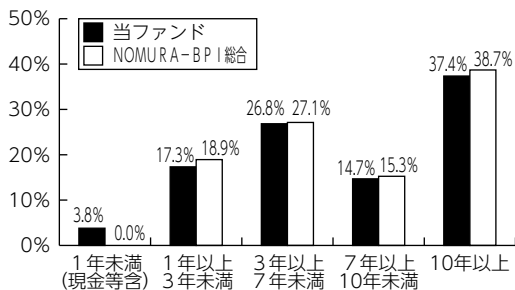


期末

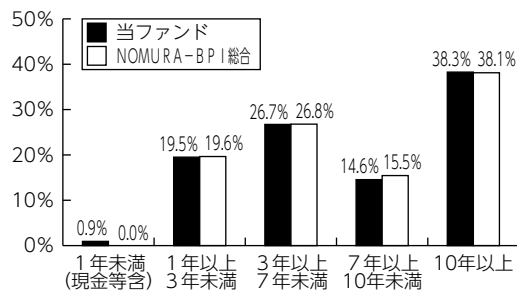


○残存年限別構成比

期首（前期末）



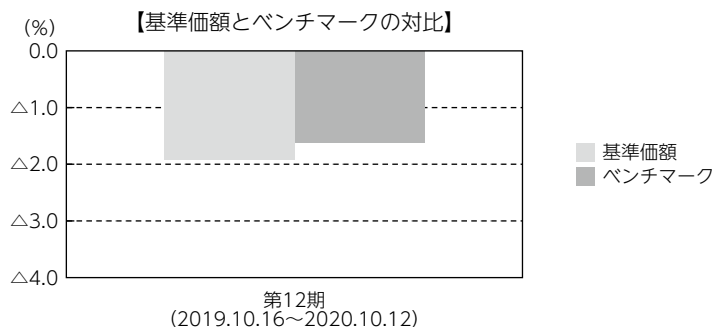
期末



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1.6%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.3%と、信託報酬の影響を除くとベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

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、無分配とさせていただきました。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2019年10月16日 ～2020年10月12日
当期分配金（税引前）	－円
対基準価額比率	－%
当期の収益	－円
当期の収益以外	－円
翌期繰越分配対象額	1,611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

引き続き、国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1 万口当たりの費用明細

項目	第12期		項目の概要
	(2019年10月16日 ～2020年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	38円	0.327%	(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11,583円です。
（投信会社）	(32)	(0.273)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
（販売会社）	(3)	(0.022)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
（受託会社）	(4)	(0.033)	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) その他費用 （監査費用）	0 (0)	0.001 (0.001)	(b) 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	38	0.329	

(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。

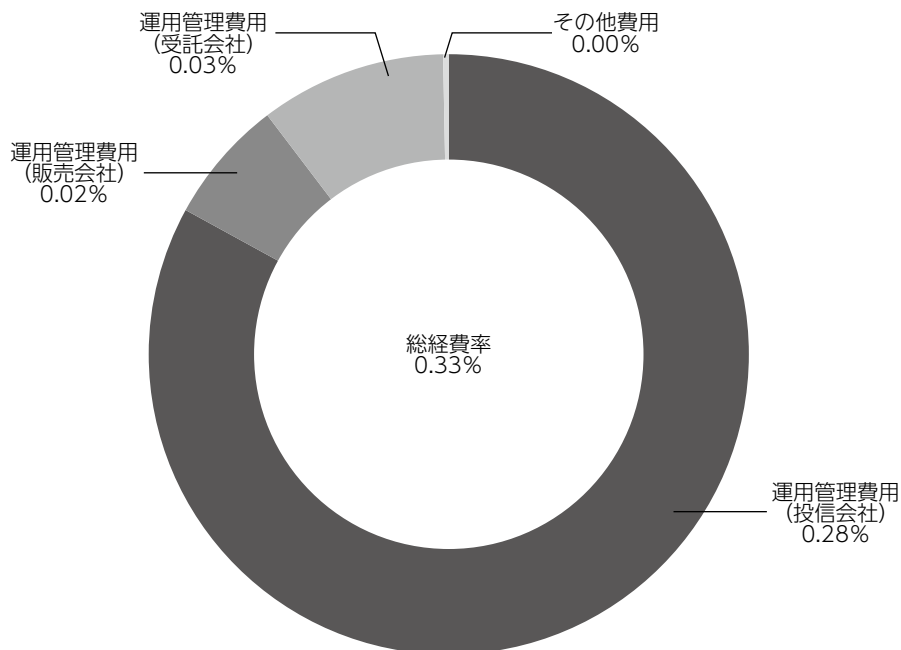
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.33%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（2019年10月16日から2020年10月12日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 2,544,529	千円 3,347,230	千口 3,511,031	千円 4,616,040

■利害関係人との取引状況等（2019年10月16日から2020年10月12日まで）

【D I AM国内債券パッシブ・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等はありません。

【国内債券パッシブ・ファンド・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 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
公 社 債	百万円 116,828	百万円 3,126	% 2.7	百万円 123,615	百万円 15,041	% 12.2

平均保有割合 11.5%

（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。

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

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 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 20,677,232	千口 19,710,730	千円 25,752,069

■投資信託財産の構成

2020年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	25,752,069	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	55,205	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	25,807,274	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

(2020年10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	25,807,274,659円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	43,985,222
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	25,752,069,437
未 収 入 金	11,220,000
(B) 負 債	52,406,417
未 払 解 約 金	10,985,879
未 払 信 託 報 酬	41,231,652
そ の 他 未 払 費 用	188,886
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	25,754,868,242
元 本	22,401,502,821
次 期 繰 越 損 益 金	3,353,365,421
(D) 受 益 権 総 口 数	22,401,502,821口
1 万口当たり基準価額(C／D)	11,497円

(注) 期首における元本額は23,423,698,497円、当期中における追加設定元本額は3,408,989,809円、同解約元本額は4,431,185,485円です。

■損益の状況

当期 自2019年10月16日 至2020年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△11,810円
受 取 利 息	1,013
支 払 利 息	△12,823
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△376,613,440
売 買 益	46,294,296
売 買 損	△422,907,736
(C) 信 託 報 酬 等	△86,924,953
(D) 当 期 損 益 金(A＋B＋C)	△463,550,203
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	800,725,955
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,016,189,669
(配 当 等 相 当 額)	(2,685,235,470)
(売 買 損 益 相 当 額)	(330,954,199)
(G) 合 計(D＋E＋F)	3,353,365,421
次 期 繰 越 損 益 金(G)	3,353,365,421
追 加 信 託 差 損 益 金	3,016,189,669
(配 当 等 相 当 額)	(2,686,197,629)
(売 買 損 益 相 当 額)	(329,992,040)
分 配 準 備 積 立 金	924,572,680
繰 越 損 益 金	△587,396,928

(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	123,846,725円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,686,197,629
(d) 分配準備積立金	800,725,955
(e) 当期分配対象額(a＋b＋c＋d)	3,610,770,309
(f) 1 万口当たり当期分配対象額	1,611.84
(g) 分配金	0
(h) 1 万口当たり分配金	0

■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、無分配とさせていただきます。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第17期（決算日 2020年2月14日）

（計算期間 2019年2月15日～2020年2月14日）

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第17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	2002年12月3日から無期限です。
運 用 方 針	NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主 要 投 資 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	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		債券組入 比 率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比 率	債券先物 比 率	純 資 産 額
	円	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
13期 (2016年2月15日)	12,614	3.7	ポイント 373.37	3.7	98.6	—	—	百万円 400,593
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	—	—	379,734
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	355,598
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	292,112
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	222,859

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）NOMURA-BPI 総合の知的財産権その他一切の権利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、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、ファンドの運用成果等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

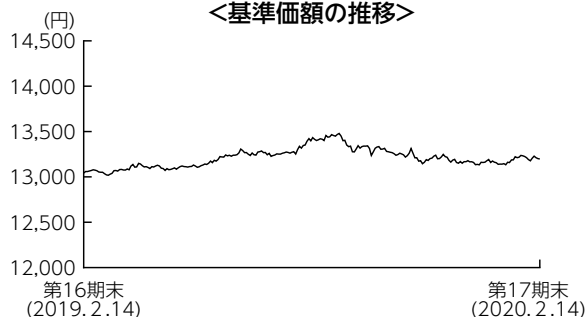
年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率 比	新株予約権付社債 (転換社債)率 比	債券先物率 比
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期 首) 2019 年 2 月 14 日	円 13,042	% —	ポイント 386.15	% —	% 99.3	% —	% —
2 月 末	13,051	0.1	386.43	0.1	99.2	—	—
3 月 末	13,142	0.8	389.14	0.8	99.4	—	—
4 月 末	13,101	0.5	387.94	0.5	98.8	—	—
5 月 末	13,183	1.1	390.32	1.1	99.4	—	—
6 月 末	13,263	1.7	392.69	1.7	99.2	—	—
7 月 末	13,278	1.8	393.15	1.8	99.4	—	—
8 月 末	13,456	3.2	398.50	3.2	98.8	—	—
9 月 末	13,313	2.1	394.27	2.1	101.5	—	—
10 月 末	13,262	1.7	392.61	1.7	99.5	—	—
11 月 末	13,217	1.3	391.33	1.3	99.7	—	—
12 月 末	13,178	1.0	390.14	1.0	100.7	—	—
2020 年 1 月 末	13,233	1.5	391.77	1.5	98.9	—	—
(期 末) 2020 年 2 月 14 日	13,197	1.2	390.72	1.2	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（2019年2月15日から2020年2月14日まで）

＜基準価額の推移＞



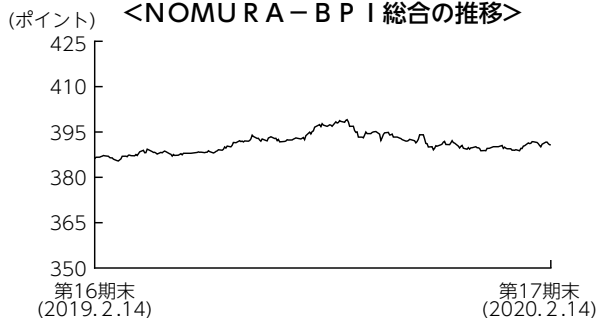
基準価額の推移

当ファンドの基準価額は13,197円となり、前期末比で1.2%上昇しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の上昇を受けて、基準価額は上昇しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧中央銀行の金融緩和観測などを背景に、基準価額は概ね上昇基調で推移しました。9月から期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きや、国内債券需給の緩みが意識されたことから、上昇幅は縮小しました。

＜NOMURA-BPI総合の推移＞



投資環境

国内債券市場では、利回りが低下（価格は上昇）しました。期初から2019年8月にかけては、米中貿易摩擦の長期化懸念や、世界景気の先行き不透明感の高まり、米欧中央銀行の金融緩和観測などを背景に、10年国債利回りは概ね低下基調で推移しました。9月から期末にかけては、米中貿易摩擦の緩和期待に伴うリスク選好の動きや、国内債券需給の緩みが意識されたことなどから、低下幅は縮小しました。

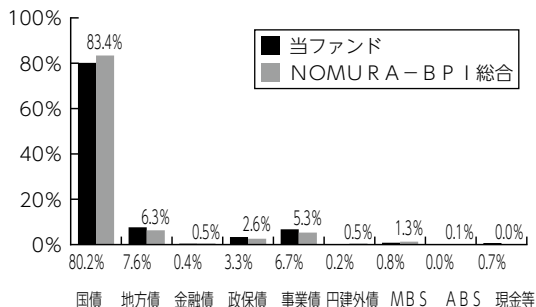
ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

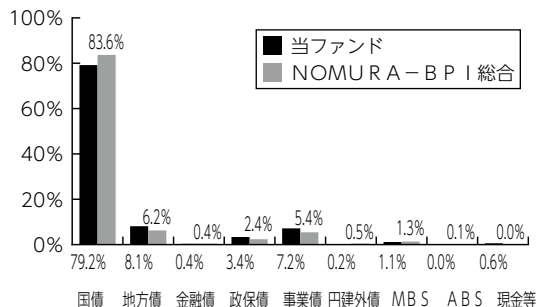
【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

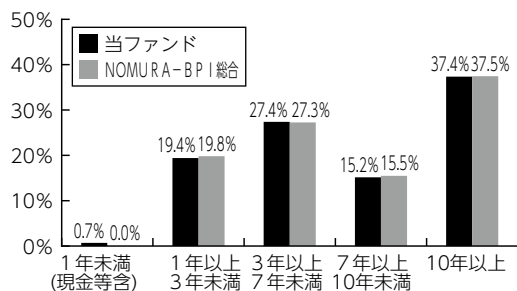


期末

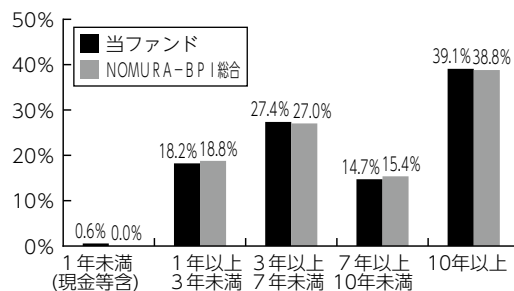


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で1.2%上昇しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で+0.0%と、ベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。

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一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 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（2019年 2 月15日から2020年 2 月14日まで）

公社債

		買 付 額	売 付 額
国 内	国 債 証 券	千円 101,489,234	千円 161,330,716 (-)
	地 方 債 証 券	1,154,420	5,193,999 (-)
	特 殊 債 券	588,183	2,537,310 (190,215)
	社 債 券	821,439	5,064,157 (-)

- (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。

■ 利害関係人との取引状況等（2019年 2 月15日から2020年 2 月14日まで）

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
区 分	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 104,053	百万円 8,065	% 7.8	百万円 174,126	百万円 18,207	% 10.5

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 B B 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 159,940,000	千円 176,414,100	% 79.2	% －	% 56.3	% 15.5	% 7.3
地 方 債 証 券	17,450,000	18,054,906	8.1	6.7	2.4	4.1	1.6
特 殊 債 券	14,698,867	15,758,836	7.1	－	4.4	2.2	0.5
金 融 債 券	800,000	800,829	0.4	－	－	0.0	0.3
普 通 社 債 券	10,181,000	10,545,134	4.7	0.1	1.1	3.1	0.5
合 計	203,069,867	221,573,805	99.4	6.8	64.3	25.0	10.2

(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、B B 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
(国債証券)	%	千円	千円	
3 1 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.3000	1,180,000	1,198,526	2021/03/20
3 1 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	800,000	810,816	2021/03/20
3 9 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,000,000	1,002,790	2021/04/01
1 2 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,200,000	2,207,348	2021/06/20
3 1 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.2000	1,500,000	1,527,015	2021/06/20
3 1 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	1,000,000	1,016,670	2021/06/20
1 2 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,120,000	2,128,437	2021/09/20
3 1 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	600,000	611,892	2021/09/20
3 1 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,400,000	1,425,522	2021/09/20
1 3 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,780,000	1,788,188	2021/12/20
3 1 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.1000	800,000	818,352	2021/12/20
3 2 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	900,000	918,990	2021/12/20
4 0 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	800,000	803,752	2022/01/01
1 3 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,420,000	1,427,412	2022/03/20
3 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	800,000	819,152	2022/03/20
3 2 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	500,000	510,925	2022/03/20
1 3 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,200,000	1,207,032	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	750,000	768,375	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,050,000	1,073,257	2022/06/20
1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,180,000	1,187,811	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,300,000	1,331,915	2022/09/20
1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,180,000	1,188,566	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.7000	500,000	512,110	2022/12/20
3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,200,000	1,232,484	2022/12/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
1 3 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,040,000	1,048,216	2023/03/20
3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,090,000	1,115,331	2023/03/20
1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,250,000	1,260,900	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,770,000	1,826,392	2023/06/20
1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,400,000	1,412,880	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	450,000	465,507	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	650,000	667,706	2023/09/20
1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,450,000	1,464,268	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,410,000	1,451,101	2023/12/20
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,300,000	1,313,351	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,650,000	1,701,199	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,300,000	1,313,611	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,770,000	1,827,949	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,410,000	1,425,298	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	1,900,000	1,957,057	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	350,000	386,298	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	500,000	505,595	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	700,000	722,526	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,090,000	1,114,176	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	340,000	375,533	2024/12/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	1,730,000	1,778,751	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	156,100	2025/03/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	1,790,000	1,842,464	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	190,000	210,841	2025/06/20

銘	柄	当期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
340回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	1,900,000	1,958,330	2025/09/20	
81回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	240,000	268,929	2025/09/20	
341回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	1,910,000	1,960,042	2025/12/20	
342回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,980,000	2,009,145	2026/03/20	
85回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	440,000	500,486	2026/03/20	
343回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,780,000	1,807,305	2026/06/20	
88回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	350,000	404,600	2026/06/20	
344回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,930,000	1,960,802	2026/09/20	
90回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	700,000	808,927	2026/09/20	
345回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,710,000	1,738,334	2026/12/20	
92回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	870,000	1,004,545	2026/12/20	
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,920,000	1,952,275	2027/03/20	
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	250,000	288,180	2027/03/20	
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	450,000	521,941	2027/03/20	
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,560,000	1,586,566	2027/06/20	
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	350,000	412,846	2027/06/20	
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,630,000	1,658,084	2027/09/20	
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	588,840	2027/09/20	
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,760,000	1,790,624	2027/12/20	
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	450,000	528,628	2027/12/20	
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,250,000	2,288,542	2028/03/20	
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	600,000	712,476	2028/03/20	
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,860,000	1,890,466	2028/06/20	
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	360,000	435,297	2028/06/20	
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,720,000	1,747,520	2028/09/20	
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	475,412	2028/09/20	
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	350,000	419,013	2028/09/20	
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,500,000	1,523,355	2028/12/20	
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	400,000	477,192	2028/12/20	
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	400,000	470,076	2028/12/20	
354回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,470,000	1,492,152	2029/03/20	
109回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	220,000	259,388	2029/03/20	
110回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	330,000	395,112	2029/03/20	
355回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,450,000	1,471,083	2029/06/20	
111回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	290,000	351,207	2029/06/20	
112回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	660,924	2029/06/20	
356回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	1,330,000	1,348,566	2029/09/20	
11回 利付国庫債券 (30年)	2.8000	100,000	127,276	2029/09/20	
113回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	770,000	929,058	2029/09/20	
357回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	400,000	405,328	2029/12/20	
114回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	550,000	665,923	2029/12/20	
115回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	200,000	244,128	2029/12/20	
2回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	100,000	124,330	2030/02/20	
116回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	450,000	551,227	2030/03/20	
117回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	650,000	789,646	2030/03/20	
3回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	247,666	2030/05/20	
118回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	310,000	374,669	2030/06/20	
119回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	300,000	356,370	2030/06/20	

銘	柄	当期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
120回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	400,000	466,880	2030/06/20	
121回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	540,000	648,982	2030/09/20	
122回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	350,000	416,930	2030/09/20	
4回 利付国庫債券 (30年)	2.9000	200,000	262,384	2030/11/20	
123回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	430,000	527,868	2030/12/20	
124回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	250,000	304,190	2030/12/20	
125回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	360,000	447,296	2031/03/20	
126回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	340,000	414,915	2031/03/20	
127回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	302,317	2031/03/20	
128回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	550,000	666,957	2031/06/20	
129回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	290,000	348,388	2031/06/20	
130回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	580,000	698,557	2031/09/20	
131回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	300,000	357,858	2031/09/20	
6回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	255,378	2031/11/20	
132回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	440,000	526,367	2031/12/20	
133回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	570,000	688,605	2031/12/20	
134回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	520,000	629,688	2032/03/20	
135回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	350,000	419,622	2032/03/20	
136回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	200,000	237,380	2032/03/20	
137回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	350,000	420,549	2032/06/20	
138回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	280,000	329,576	2032/06/20	
139回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	430,000	511,407	2032/06/20	
140回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	920,000	1,108,517	2032/09/20	
8回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	200,000	243,918	2032/11/22	
141回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	650,000	784,810	2032/12/20	
142回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	400,000	488,048	2032/12/20	
143回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	560,000	670,656	2033/03/20	
144回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	310,000	367,238	2033/03/20	
11回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	200,000	242,594	2033/06/20	
145回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	840,000	1,018,894	2033/06/20	
12回 利付国庫債券 (30年)	2.1000	200,000	253,966	2033/09/20	
146回 利付国庫債券 (20年)	1.7000	850,000	1,033,719	2033/09/20	
13回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	100,000	126,019	2033/12/20	
147回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	980,000	1,181,448	2033/12/20	
14回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	290,000	382,640	2034/03/20	
148回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	690,000	823,597	2034/03/20	
15回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	267,654	2034/06/20	
149回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	900,000	1,076,571	2034/06/20	
16回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	150,000	201,330	2034/09/20	
150回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	950,000	1,124,344	2034/09/20	
17回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	200,000	266,478	2034/12/20	
151回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	820,000	948,412	2034/12/20	
18回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	320,000	423,046	2035/03/20	
152回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	890,000	1,030,121	2035/03/20	
19回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	265,062	2035/06/20	
153回 利付国庫債券 (20年)	1.3000	890,000	1,045,002	2035/06/20	
20回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	272,216	2035/09/20	
154回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	850,000	986,697	2035/09/20	

銘	柄	当期 末		
		利 率	額面金額	評 価 額 償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円
21回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	266,730 2035/12/20
155回	利付国庫債券 (20年)	1.0000	860,000	972,333 2035/12/20
22回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	320,000	438,108 2036/03/20
156回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	780,000	808,087 2036/03/20
23回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	200,000	274,728 2036/06/20
157回	利付国庫債券 (20年)	0.2000	850,000	852,694 2036/06/20
24回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	190,000	261,846 2036/09/20
158回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	860,000	904,324 2036/09/20
25回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	200,000	269,956 2036/12/20
159回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	850,000	907,596 2036/12/20
26回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	400,000	548,096 2037/03/20
160回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	700,000	759,073 2037/03/20
161回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	800,000	854,328 2037/06/20
27回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	420,000	586,126 2037/09/20
162回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	800,000	854,368 2037/09/20
163回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	770,000	822,336 2037/12/20
28回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	480,000	673,862 2038/03/20
164回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	910,000	955,145 2038/03/20
165回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	740,000	776,519 2038/06/20
29回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	560,000	780,802 2038/09/20
166回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	750,000	814,290 2038/09/20
167回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	800,000	839,000 2038/12/20
30回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	570,000	788,595 2039/03/20
168回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	700,000	720,433 2039/03/20
169回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	750,000	757,612 2039/06/20
31回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	600,000	823,098 2039/09/20
170回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	630,000	635,877 2039/09/20
171回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	250,000	252,122 2039/12/20
32回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	760,000	1,063,042 2040/03/20
33回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	740,000	996,498 2040/09/20
34回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	670,000	933,544 2041/03/20
35回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	820,000	1,113,937 2041/09/20
36回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	800,000	1,091,864 2042/03/20
37回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	790,000	1,065,291 2042/09/20
38回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	570,000	759,507 2043/03/20
39回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	480,000	651,763 2043/06/20
40回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	450,000	602,014 2043/09/20
41回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	460,000	605,967 2043/12/20
42回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	510,000	673,398 2044/03/20
43回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	500,000	661,015 2044/06/20
44回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	490,000	649,318 2044/09/20
45回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	500,000	639,430 2044/12/20
46回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	630,000	807,307 2045/03/20
47回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	540,000	706,131 2045/06/20
48回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	590,000	744,231 2045/09/20
49回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	560,000	706,865 2045/12/20
50回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	540,000	601,678 2046/03/20
51回	利付国庫債券 (30年)	0.3000	570,000	563,804 2046/06/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
5 2 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.5000	580,000	602,625	2046/09/20
5 3 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.6000	600,000	638,364	2046/12/20
5 4 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.8000	600,000	669,276	2047/03/20
5 5 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.8000	590,000	657,879	2047/06/20
5 6 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.8000	550,000	613,041	2047/09/20
5 7 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.8000	650,000	725,114	2047/12/20
5 8 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.8000	710,000	791,699	2048/03/20
5 9 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.7000	580,000	631,515	2048/06/20
6 0 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.9000	500,000	571,465	2048/09/20
6 1 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.7000	500,000	543,700	2048/12/20
2 回	利付国庫債券 (4 0 年)	2.2000	280,000	420,064	2049/03/20
6 2 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.5000	500,000	516,390	2049/03/20
6 3 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.4000	570,000	573,003	2049/06/20
6 4 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.4000	500,000	501,990	2049/09/20
6 5 回	利付国庫債券 (3 0 年)	0.4000	200,000	200,802	2049/12/20
3 回	利付国庫債券 (4 0 年)	2.2000	290,000	439,016	2050/03/20
4 回	利付国庫債券 (4 0 年)	2.2000	430,000	657,624	2051/03/20
5 回	利付国庫債券 (4 0 年)	2.0000	480,000	711,532	2052/03/20
6 回	利付国庫債券 (4 0 年)	1.9000	450,000	658,768	2053/03/20
7 回	利付国庫債券 (4 0 年)	1.7000	480,000	678,360	2054/03/20
8 回	利付国庫債券 (4 0 年)	1.4000	520,000	689,535	2055/03/20
9 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.4000	780,000	778,767	2056/03/20
1 0 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.9000	770,000	900,145	2057/03/20
1 1 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.8000	580,000	658,851	2058/03/20
1 2 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.5000	380,000	391,517	2059/03/20
小	計	—	159,940,000	176,414,100	—
(地方債証券)		%	千円	千円	
2 3 年度 1 回	千葉市公募公債	1.3700	200,000	203,200	2021/04/21
2 3 年度 2 回	埼玉県公募公債	1.1900	200,000	202,994	2021/05/25
6 9 7 回	東京都公募公債	1.1100	500,000	507,330	2021/06/18
9 9 回	共同発行市場公募地方債	1.1700	700,000	710,983	2021/06/25
7 0 1 回	東京都公募公債	0.9900	700,000	710,843	2021/09/17
2 3 年度 4 回	横浜市公募公債	1.0450	450,000	458,073	2021/11/12
2 3 年度 9 回	静岡県公募公債	1.0450	200,000	203,660	2021/11/25
3 5 6 回	大阪府公募公債	1.0600	200,000	203,896	2021/12/27
1 0 6 回	共同発行市場公募地方債	0.9700	300,000	305,568	2022/01/25
2 3 年度 2 0 回	愛知県公募公債	1.0820	500,000	511,295	2022/03/29
1 0 9 回	共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	511,340	2022/04/25
7 0 8 回	東京都公募公債	0.8900	500,000	510,255	2022/06/20
1 1 1 回	共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	714,427	2022/06/24
3 6 4 回	大阪府公募公債	0.7900	300,000	306,081	2022/09/27
1 9 4 回	神奈川県公募公債	0.7910	300,000	306,624	2022/12/20
2 4 年度 7 回	千葉県公募公債	0.7400	300,000	306,201	2022/12/22
1 1 9 回	共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	511,875	2023/02/24
1 2 1 回	共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	508,885	2023/04/25
2 5 年度 4 回	愛知県公募公債	0.8560	300,000	308,331	2023/05/30
7 2 0 回	東京都公募公債	0.8700	300,000	308,628	2023/06/20
2 5 年度 4 回	札幌市公募公債	0.8000	200,000	205,284	2023/06/20

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	
2 5 年度 2 回 横浜市公債券	0.8880	400,000	411,976	2023/07/14
3 7 4 回 大阪府公債券	0.9380	300,000	309,600	2023/07/28
2 5 年度 5 回 千葉県公債券	0.8400	200,000	205,852	2023/08/25
1 2 8 回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	307,359	2023/11/24
7 2 6 回 東京都公債券	0.7300	400,000	411,076	2023/12/20
2 5 年度 1 1 回 福岡県公債券	0.6940	200,000	205,508	2024/02/26
2 0 8 回 神奈川県公債券	0.5510	300,000	307,050	2024/06/20
1 回 兵庫県公債券 (1 2 年)	1.1000	300,000	314,259	2024/06/26
2 6 年度 5 回 埼玉県公債券	0.6110	400,000	410,696	2024/07/29
4 8 8 回 名古屋市長公債券 1 0 年	0.5980	450,000	462,159	2024/09/20
2 6 年度 1 1 回 京都府公債券	0.4760	350,000	357,896	2024/12/19
1 4 2 回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	508,275	2025/01/24
2 6 年度 1 7 回 兵庫県公債券	0.4600	200,000	204,372	2025/02/26
5 回 東京都公債券 2 0 年	2.1100	100,000	110,630	2025/03/19
1 4 4 回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	409,184	2025/03/25
1 4 6 回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	411,220	2025/05/23
1 4 8 回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	514,485	2025/07/25
1 回 静岡県公債券 2 0 年	2.1800	100,000	112,072	2025/09/19
9 回 東京都公債券 2 0 年	2.4400	200,000	230,576	2026/06/19
1 0 回 東京都公債券 2 0 年	2.3300	300,000	345,534	2026/09/18
4 回 京都市公債券 2 0 年	2.5100	100,000	116,363	2026/09/18
1 6 6 回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	505,370	2027/01/25
2 9 年度 4 回 大阪市公債券	0.1500	200,000	201,820	2027/09/21
3 0 年度 7 回 神戸市公債券 3 0 年	0.2540	300,000	305,499	2028/09/20
第 9 1 回 川崎市公債券	0.1850	200,000	202,484	2028/09/20
3 0 年度 1 4 回 北海道公債券	0.1950	300,000	303,438	2028/12/28
3 0 年度 1 9 回 愛知県公債券	0.1150	200,000	200,996	2029/03/28
8 回 静岡県公債券 1 5 年	0.8280	200,000	214,750	2030/06/07
24 年度 2 回 福岡県公債券 (2 0 年)	1.6350	300,000	353,565	2032/08/16
1 4 回 千葉県公債券 2 0 年	1.1370	100,000	112,016	2033/04/15
1 4 回 埼玉県公債券 2 0 年	1.5460	300,000	355,014	2034/05/08
1 7 回 北九州市公債券 2 0 年	1.5290	100,000	118,039	2034/06/20
小 計	—	17,450,000	18,054,906	—
(特殊債券)	%	千円	千円	
9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.9000	100,000	102,181	2021/03/26
2 4 回 地方公共団体金融機構債券	1.2080	300,000	304,548	2021/05/28
1 8 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.2000	300,000	310,470	2021/08/30
1 4 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.0000	400,000	407,636	2021/11/30
3 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	306,246	2022/05/20
9 6 回 高速道路機構債	0.7960	700,000	714,196	2022/09/20
4 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	410,020	2023/01/20
5 5 回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	512,865	2023/03/20
1 8 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	509,015	2023/04/28
1 9 3 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	515,305	2023/06/30
5 0 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	515,975	2023/07/14
1 9 5 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	340,688	2023/07/31
1 1 6 回 高速道路機構債	0.7220	100,000	102,579	2023/09/20
5 6 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	558,444	2024/01/19

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
6 4 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	307,824	2024/09/13
2 4 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	512,180	2025/03/31
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 1 0 年	0.0900	400,000	401,348	2026/04/28
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	202,492	2027/04/13
3 0 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	809,208	2027/04/30
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	303,123	2027/11/19
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	304,176	2028/02/18
1 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	2.0700	200,000	234,556	2028/12/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	238,634	2029/09/20
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	215,540	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	236,862	2030/10/29
1 2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	592,285	2030/10/31
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	423,048	2031/06/13
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	238,268	2031/12/26
1 3 回貸付債権担保 5 種住宅金融支援機構債券	1.9600	13,092	13,312	2032/05/10
1 4 回貸付債権担保 5 種住宅金融支援機構債券	1.7000	65,775	66,712	2032/05/10
1 5 回 国際協力機構債	1.7240	100,000	118,487	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.7020	200,000	236,520	2032/09/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	538,836	2033/12/20
2 3 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	342,360	2035/02/28
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 2 0 年	1.2980	200,000	230,018	2035/06/28
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	199,156	2036/06/20
6 回貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.2600	38,001	39,292	2037/05/10
8 回貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.1500	26,704	27,709	2037/05/10
9 回貸付債権担保 5 種住宅金融公庫債券	2.1900	39,924	41,489	2037/05/10
3 1 9 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	212,890	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	279,906	2037/09/18
2 回貸付債権担保 5 種住宅金融支援機構債券	2.2700	42,426	44,458	2037/11/10
4 3 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	14,127	14,853	2041/06/10
4 4 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	54,016	56,417	2041/07/10
5 1 回貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	40,311	42,042	2042/02/10
1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	66,765	69,041	2042/05/10
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	142,365	153,423	2044/10/10
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	242,352	257,370	2045/05/10
2 6 0 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	246,734	2045/10/31
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	234,732	2047/03/20
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	258,345	260,466	2051/11/10
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	272,001	276,067	2052/11/10
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	272,523	276,398	2053/01/10
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	277,092	280,680	2053/04/10
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	276,636	280,229	2053/05/10
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	284,412	289,520	2053/10/10
小 計	—	14,698,867	15,758,836	—
(金融債券)	%	千円	千円	
2 2 0 号 利附商工債 (3 年)	0.1100	300,000	300,324	2021/05/27
3 2 5 回 利附信金中金債	0.0400	400,000	400,144	2021/12/27
い第 8 2 8 号 利付商工債	0.1400	100,000	100,361	2024/05/27
小 計	—	800,000	800,829	—

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
3 3 7 回 東京交通債	2.2300	200,000	204,772	2021/03/19
4 7 3 回 東北電力社債	0.5970	300,000	301,854	2021/04/23
9 回 三菱ＵＦＪ信託銀行劣後債	1.6800	100,000	101,886	2021/04/28
3 2 回 三菱東京ＵＦＪ銀行劣後社債	1.6200	300,000	305,928	2021/06/09
3 2 0 回 北海道電力社債	0.5850	200,000	201,758	2021/12/24
6 回 東海旅客鉄道社債	2.3900	100,000	104,660	2022/02/15
1 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.3600	100,000	104,663	2022/02/25
1 3 回 パナソニック社債	0.5680	100,000	100,937	2022/03/18
9 回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	209,320	2022/03/25
4 5 回 住友商事社債	1.1170	100,000	102,192	2022/04/20
23 回 ジェイ エフ イー ホールディングス社債	0.0900	100,000	99,925	2022/05/23
1 回 BPCE SA 円債社債 (ソーシャルボンド)	0.2140	200,000	200,016	2022/06/30
2 1 回 東日本旅客鉄道社債	2.0200	100,000	105,042	2022/09/20
9 4 回 丸紅社債	1.1700	100,000	102,719	2022/10/12
5 7 回 東京三菱銀行社債	2.2200	200,000	211,582	2022/10/27
1 9 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.4760	100,000	101,026	2022/12/02
1 1 回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	309,117	2022/12/20
1 8 回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	103,948	2022/12/20
5 1 8 回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,498	2023/01/25
1 4 回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	205,354	2023/03/20
1 0 回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	102,158	2023/03/20
4 7 回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	204,470	2023/03/20
3 0 1 回 北陸電力社債	1.1580	100,000	103,211	2023/03/24
2 3 回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	309,114	2023/06/09
2 7 回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	102,598	2023/06/20
2 5 3 回 四国電力社債	1.0000	200,000	205,808	2023/06/23
6 回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	103,273	2023/07/19
3 7 7 回 中国電力社債	1.1210	400,000	414,056	2023/08/25
1 0 回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	320,919	2023/09/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
4 8 回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	102,955	2023/10/20
4 7 回 住友商事社債	0.8580	100,000	102,566	2023/10/23
4 2 4 回 九州電力社債	1.2330	200,000	208,052	2023/11/24
1 3 回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	214,718	2023/12/20
3 8 回 電源開発社債	0.9780	300,000	309,522	2023/12/20
4 7 1 回 東北電力社債	1.1680	400,000	415,628	2023/12/25
4 2 6 回 九州電力社債	1.0640	400,000	414,280	2024/02/23
1 6 回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	204,432	2024/03/19
1 4 回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	108,529	2024/03/19
7 2 回 三菱地所社債	2.2800	100,000	109,866	2024/09/20
1 0 回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	204,332	2024/10/28
6 回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	205,188	2024/11/28
3 2 1 回 北海道電力社債	0.8860	161,000	165,995	2024/12/25
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	330,489	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	219,160	2025/06/20
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	221,934	2025/09/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	136,720	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	105,066	2026/06/25
3 4 回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	203,128	2027/02/16
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	303,363	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	201,258	2027/05/07
5 6 回 三菱ＵＦＪリソース社債	0.4550	200,000	201,994	2028/01/18
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	201,686	2028/06/06
1 4 回 プリダズトン社債	0.3750	200,000	201,412	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	108,193	2029/04/27
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	101,863	2038/07/12
小 計	—	10,181,000	10,545,134	—
合 計	—	203,069,867	221,573,805	—

■投資信託財産の構成

2020年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 221,573,805	% 99.3
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	1,482,460	0.7
投 資 信 託 財 産 総 額	223,056,266	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

(2020年2月14日)現在

項 目		当 期 末
(A) 資 産	223,056,266,615円	
コ ー ル ・ 公 司 債 等	925,968,916	
未 前 社 債(評価額)	221,573,805,885	
利 費	530,848,633	
(B) 負 債	25,643,181	
未 払 解 約 金	196,906,000	
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	196,906,000	
元 次 期 繰 越 損 益 本 金	222,859,360,615	
(D) 受 益 権 総 口 数	168,870,516,479	
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	53,988,844,136	
	168,870,516,479円	13,197円
(注1) 期首元本額	223,973,156,427円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045) 4,843,326円
追加設定元本額	120,614,812,838円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055) 3,778,447円
一部解約元本額	175,717,452,786円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (D C) 4,877,007円
(注2) 期末における元本の内訳		投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035) 9,781,550円
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	21,184,712,153円	4資産分散投資・スタンダード<D C年金> 191,589,421円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	69,986,260円	リスクコントロール世界資産分散ファンド 4,735,395,954円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	68,506,951円	9資産分散投資・スタンダード<D C年金> 3,293,364,512円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	18,787,911円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040) 723,181円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	987,848,234円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050) 610,771円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	253,839,832円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060) 708,717円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	25,260,802円	4資産分散投資・ミドルクラス<D C年金> 498,022円
たわらノーロード 国内債券	10,015,397,101円	D I A Mエマージング債券ファンド 9,450,010円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	644,889,238円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2019-12 (適格機関投資家限定) 1,002,734,258円
たわらノーロード バランス (堅実型)	198,546,011円	D I A M国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け) 10,109,222,296円
たわらノーロード バランス (標準型)	329,055,628円	D I A Mワールドバランス25 V A (適格機関投資家限定) 342,183,786円
たわらノーロード バランス (積極型)	41,366,056円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンド (適格機関投資家限定) 5,071,969,240円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (保守型)	14,261,260円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I (適格機関投資家限定) 5,050,603,156円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定型)	422,619,412円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I I (適格機関投資家限定) 5,102,756,119円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (安定成長型)	415,409,126円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI V (適格機関投資家限定) 5,076,506,178円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (成長型)	104,078,457円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドV (適格機関投資家限定) 5,113,422,319円
たわらノーロード スマートグローバルバランス (積極型)	8,657,075円	インカム重視マルチアセット運用ファンド (適格機関投資家限定) 618,326,873円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	5,579,866円	D I A Mグローバル・バランスファンド25 V A 219,862,252円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	8,704,630円	D I A Mグローバル・バランスファンド50 V A 165,143,096円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	9,632,593円	D I A M国際分散バランスファンド30 V A 61,558,322円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	1,871,083円	D I A M国際分散バランスファンド50 V A 148,494,901円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	243,993円	D I A M国内重視バランスファンド30 V A 70,976,271円
D I A M国内債券インデックスファンド<D C年金>	14,054,492,139円	D I A M国内重視バランスファンド50 V A 29,810,777円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 1安定型	6,915,364,061円	D I A M世界バランスファンド40 V A (適格機関投資家限定) 80,376,845円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 2安定・成長型	9,496,684,077円	D I A M世界バランスファンド50 V A (適格機関投資家限定) 167,069,557円
D I A Mバランス・ファンド<D C年金> 3成長型	3,799,837,596円	D I A Mバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定) 4,589,661,319円
D I A M D Cバランス30インデックスファンド	1,841,604,708円	D I A Mバランスファンド37.5 V A (適格機関投資家限定) 2,581,596,662円
D I A M D Cバランス50インデックスファンド	2,047,028,967円	D I A Mバランスファンド50 V A (適格機関投資家限定) 4,902,110,574円
D I A M D Cバランス70インデックスファンド	317,181,619円	D I A Mグローバル・アセット・バランス V A 528,103,309円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	82,330,193円	D I A M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) 243,077,089円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,373,109,117円	D I A M アクサ グローバル バランスファンド30 V A 2,833,060,371円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,459,038円	D I A M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) 252,830,217円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国10)	3,565,751,861円	D I A M世界バランスファンド55 V A (適格機関投資家限定) 14,003,137円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国20)	1,006,035,152円	D I A M世界バランスファンド35 V A (適格機関投資家限定) 59,261,134円
D I A M D C 8資産バランスファンド (新興国30)	214,761,880円	D I A M世界アセットバランスファンド 2 V A (適格機関投資家限定) 2,634,815,087円
投資のソムリエ	6,982,653,969円	D I A M世界アセットバランスファンド40 V A (適格機関投資家限定) 74,826,164円
グルーズコントロール	1,214,453,782円	D I A M世界アセットバランスファンド25 V A (適格機関投資家限定) 541,115,349円
投資のソムリエ<D C年金>	663,342,952円	D I A M世界アセットバランスファンド 3 V A (適格機関投資家限定) 933,900,682円
D I A M 8資産バランスファンドN<D C年金>	3,041,421,611円	D I A M世界アセットバランスファンド 4 V A (適格機関投資家限定) 2,409,352,967円
4資産分散投資・ハイクラス<D C年金>	354,073,730円	D I A M世界バランス25 V A (適格機関投資家限定) 352,962,064円
グルーズコントロール<D C年金>	1,228,781円	D I A M国内バランス30 V A (適格機関投資家限定) 110,662,909円
D I A Mコア資産設計ファンド (堅実型)	1,760,959円	D I A Mバランス20 V A (適格機関投資家限定) 256,171,767円
D I A Mコア資産設計ファンド (積極型)	7,262,628円	D I A Mバランス40 V A (適格機関投資家限定) 739,037円
投資のソムリエ<D C年金>リスク抑制型	522,448,330円	D I A Mバランス60 V A (適格機関投資家限定) 410,778円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	5,526,677,877円	期末元本合計 168,870,516,479円

■損益の状況

当期 自2019年2月15日 至2020年2月14日

項 目					当 期
(A)	配	当	等	収 益	2,279,859,711円
	受		取	利 息	2,281,738,927
	支		払	利 息	△1,879,216
(B)	有 価 証 券	売 買	損 益		1,759,087,828
	売		買	益	3,410,195,048
	売		買	損	△1,651,107,220
(C)	当 期	損 益	金(A + B)		4,038,947,539
(D)	前 期	繰 越	損 益 金		68,139,769,721
(E)	解 約	差 損 益 金			△56,993,272,286
(F)	追 加	信 託 差 損 益 金			38,803,399,162
(G)	合 計	(C + D + E + F)			53,988,844,136
	次 期	繰 越 損 益 金(G)			53,988,844,136

(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。