

運用報告書 (全体版)

第13期<決算日2021年10月12日>

DIAM国内債券パッシブ・ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券（インデックス型）	
信託期間	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	DIAM国内債券パッシブ・ファンド	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	わが国の公社債を主要投資対象とします。
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、「DIAM国内債券パッシブ・ファンド」は、2021年10月12日に第13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)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
9期(2017年10月12日)	円 11,389	円 0	% △1.9	ポイント 379.22	% △1.3	% 99.1	% -	% -	百万円 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
13期(2021年10月12日)	11,455	0	△0.4	386.61	△0.0	99.7	-	-	30,351

(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) 2020年10月12日	円 11,497	% -	ポイント 386.79	% -	% 99.1	% -	% -
10月末	11,490	△0.1	386.63	△0.0	99.5	-	-
11月末	11,501	0.0	387.12	0.1	99.9	-	-
12月末	11,500	0.0	387.20	0.1	99.2	-	-
2021年1月末	11,469	△0.2	386.25	△0.1	99.2	-	-
2月末	11,371	△1.1	383.06	△1.0	99.5	-	-
3月末	11,447	△0.4	385.72	△0.3	99.7	-	-
4月末	11,466	△0.3	386.44	△0.1	99.8	-	-
5月末	11,468	△0.3	386.62	△0.0	99.9	-	-
6月末	11,472	△0.2	386.90	0.0	99.8	-	-
7月末	11,526	0.3	388.81	0.5	99.7	-	-
8月末	11,514	0.1	388.46	0.4	99.4	-	-
9月末	11,473	△0.2	387.12	0.1	105.3	-	-
(期末) 2021年10月12日	11,455	△0.4	386.61	△0.0	99.7	-	-

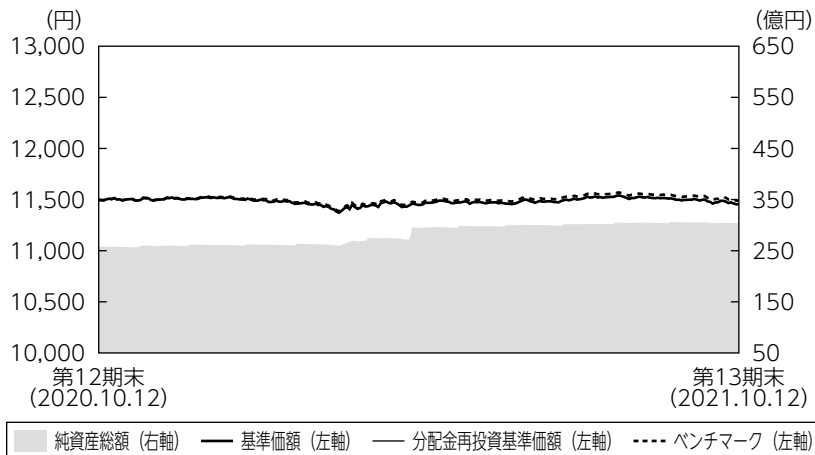
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2020年10月13日から2021年10月12日まで）

基準価額等の推移



第13期首： 11,497円
第13期末： 11,455円
(既払分配金0円)
騰落率： $\Delta 0.4\%$
(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。国内株式市場の上昇や米国で金融当局による年内の資産買い入れ縮小が示唆されたこと、エネルギー価格の上昇を受けインフレ懸念が高まったことなどが下落要因となりました。

投資環境

国内債券市場は下落しました。期初から2021年2月にかけては国内株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。3月から8月にかけては、新型コロナウイルスの感染収束が見通せない中、国内景気の先行き不透明感が意識され、利回りは低下しました。9月から期末にかけては、米国で金融当局による年内の資産買い入れ縮小が示唆されたことや、エネルギー価格の上昇を受けインフレ懸念が高まったことなどを背景に、利回りは上昇しました。

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。

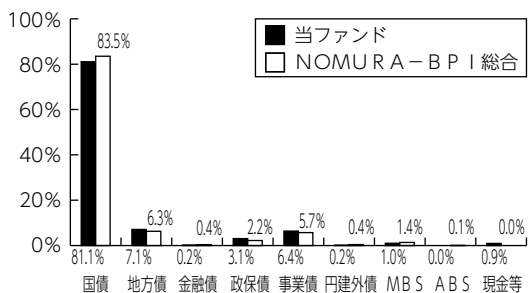
●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

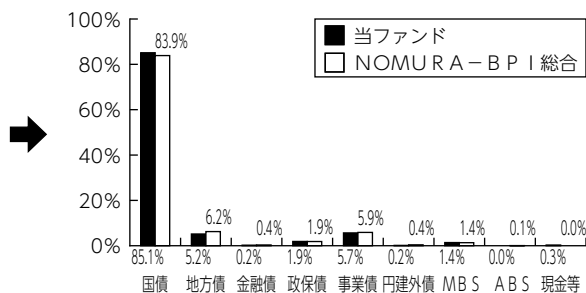
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

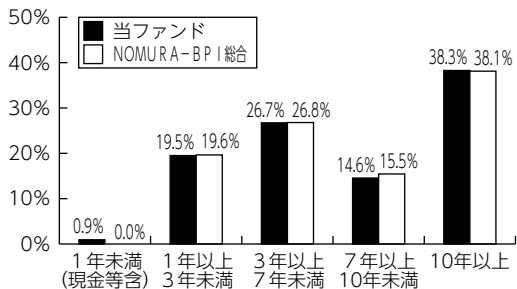


期末

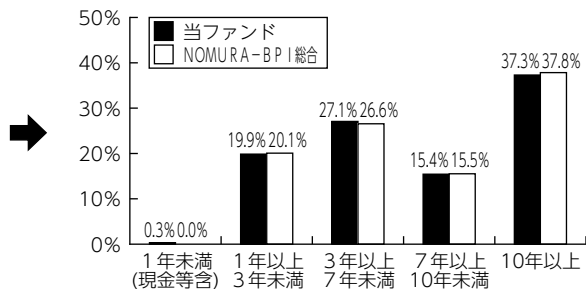


○残存年限別構成比

期首 (前期末)



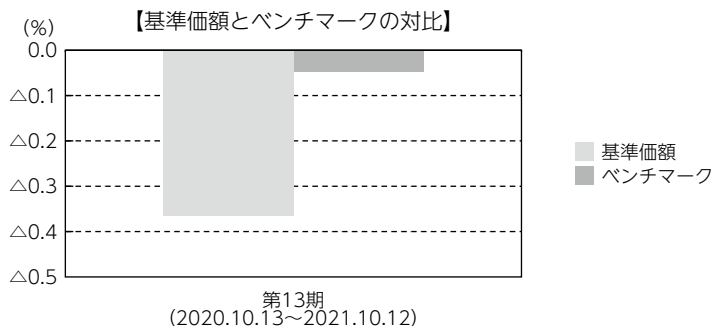
期末



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0.0%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10月13日 ～2021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	1,662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13期		項目の概要
	(2020年10月13日 ～2021年10月12日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	25円	0.220%	(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11,484円です。 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
(投信会社)	(19)	(0.165)	
(販売会社)	(3)	(0.022)	
(受託会社)	(4)	(0.033)	
(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	25	0.221	

(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。

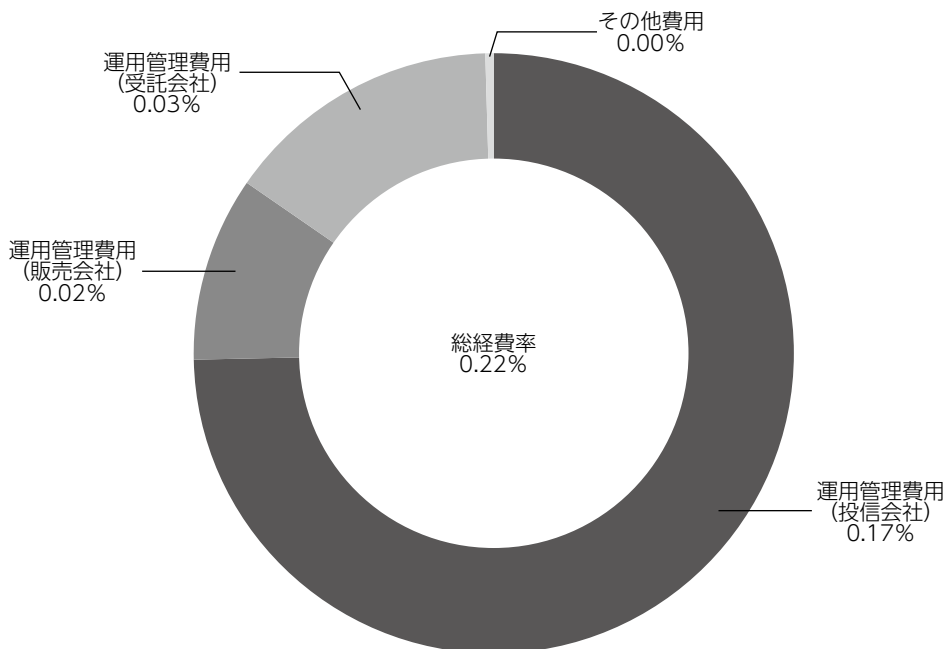
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.22%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10月13日から2021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□ 5,214,264	千円 6,799,392	千□ 1,668,597	千円 2,179,408

■利害関係人との取引状況等（2020年10月13日から2021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】

(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
公 社 債	百万円 561,417	百万円 60,978	% 10.9	百万円 257,326	百万円 30,397	% 11.8

平均保有割合 8.4%

(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
公 社 債	百万円 304

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□ 19,710,730	千□ 23,256,396	千円 30,349,597

■投資信託財産の構成

2021年10月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	30,349,597	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	71,231	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	30,420,829	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10月12日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	30,420,829,511円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	34,722,733
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	30,349,597,778
未 収 入 金	36,509,000
(B) 負 債	69,585,015
未 払 解 約 金	36,148,278
未 払 信 託 報 酬	33,226,729
そ の 他 未 払 費 用	210,008
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	30,351,244,496
元 本	26,495,724,799
次 期 繰 越 損 益 金	3,855,519,697
(D) 受 益 権 総 口 数	26,495,724,799口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11,455円

(注) 期首における元本額は22,401,502,821円、当期中における追加設定元本額は6,524,185,650円、同解約元本額は2,429,963,672円です。

■損益の状況

当期 自2020年10月13日 至2021年10月12日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,503円
受 取 利 息	327
支 払 利 息	△4,830
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△18,552,343
売 買 益	5,844,592
売 買 損	△24,396,935
(C) 信 託 報 酬 等	△69,743,813
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△88,300,659
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	304,973,927
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	3,638,846,429
(配 当 等 相 当 額)	(3,434,412,074)
(売 買 損 益 相 当 額)	(204,434,355)
(G) 合 計(D+E+F)	3,855,519,697
次 期 繰 越 損 益 金(G)	3,855,519,697
追 加 信 託 差 損 益 金	3,638,846,429
(配 当 等 相 当 額)	(3,436,088,148)
(売 買 損 益 相 当 額)	(202,758,281)
分 配 準 備 積 立 金	967,725,685
繰 越 損 益 金	△751,052,417

(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	131,453,900円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	3,436,088,148
(d) 分配準備積立金	836,271,785
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	4,403,813,833
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	1,662.08
(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。

《お知らせ》

■信託報酬率を年率0.20%（税込み0.22%）に引き下げる所要の約款変更を行いました。

(2021年1月13日)

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18期 (決算日 2021年2月15日)

(計算期間 2020年2月15日～2021年2月15日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第18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 (ベンチマーク)		債券組入 比率	新株予約 権付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率				
14期 (2017年2月14日)	12,730	0.9	376.81	0.9	98.6	—	—	百万円 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
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	—	—	273,346

(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)。

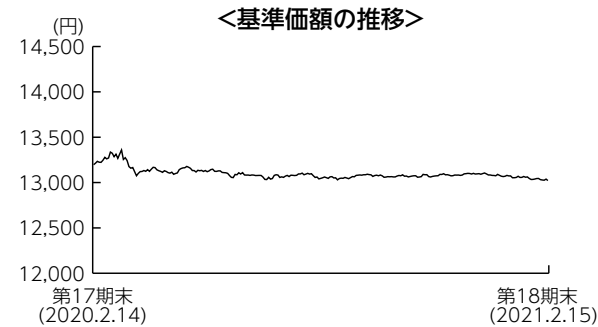
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合		債券組入率	新株予約権付社債(転換社債)比	債券先物率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率				
(期 首) 2020年 2月14日	円 13,197	% -	ポイント 390.72	% -	% 99.4	% -	% -
2 月 末	13,336	1.1	394.74	1.0	101.0	-	-
3 月 末	13,124	△0.6	388.45	△0.6	101.4	-	-
4 月 末	13,169	△0.2	389.79	△0.2	99.4	-	-
5 月 末	13,112	△0.6	388.13	△0.7	99.4	-	-
6 月 末	13,060	△1.0	386.56	△1.1	99.7	-	-
7 月 末	13,104	△0.7	387.91	△0.7	99.5	-	-
8 月 末	13,044	△1.2	386.09	△1.2	100.0	-	-
9 月 末	13,081	△0.9	387.22	△0.9	99.7	-	-
10 月 末	13,059	△1.0	386.63	△1.0	99.5	-	-
11 月 末	13,076	△0.9	387.12	△0.9	99.9	-	-
12 月 末	13,078	△0.9	387.20	△0.9	99.3	-	-
2021年 1 月 末	13,045	△1.2	386.25	△1.1	99.2	-	-
(期 末) 2021年 2月15日	13,022	△1.3	385.59	△1.3	99.2	-	-

(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15日から2021年2月15日まで）

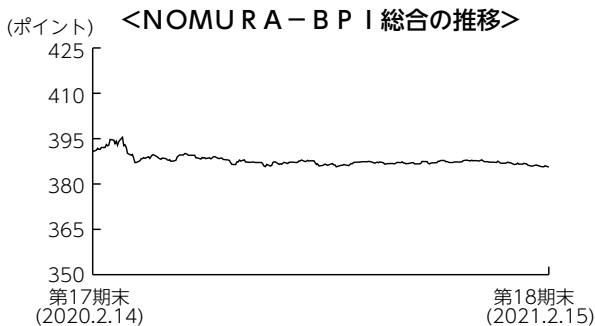


基準価額の推移

当期末の基準価額は13,022円となり、前期末比で1.3%下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり基準価額は上昇して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和政策などを受けて基準価額は下落に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に基準価額は下落しました。



投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇（価格は下落）しました。期初、新型コロナウイルス感染拡大に伴う世界の景気悪化懸念が強まり利回りは低下（価格は上昇）して始まりました。しかし2020年3月には、各国中央銀行による金融緩和

政策などを受けて利回りは上昇に転じました。4月から12月にかけては新型コロナウイルスの動向を注視する展開となり方向感を欠きました。12月下旬から期末にかけては、国内株式市場が堅調に推移したことなどを背景に利回りは上昇しました。

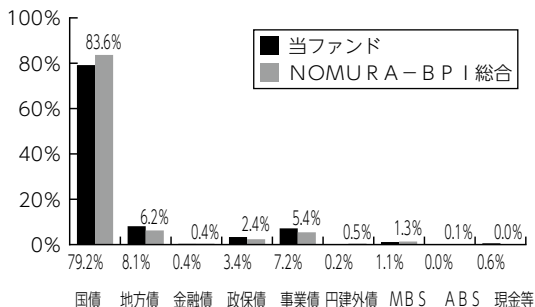
ポートフォリオについて

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。

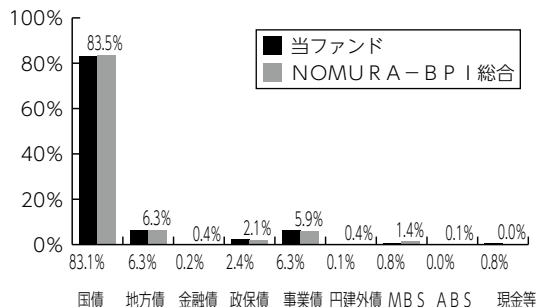
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

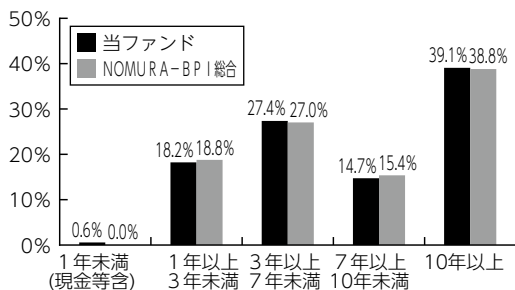


期末

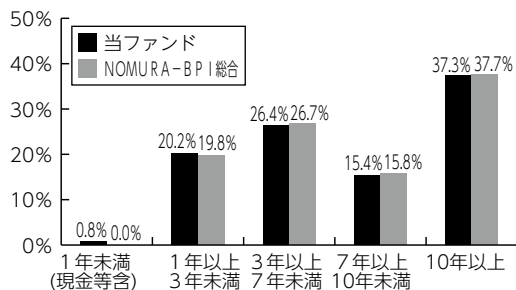


○残存年限別構成比

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1.3%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%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 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	191,780,597	136,499,291 (-)
	地方債証券	2,830,950	3,489,753 (-)
	特殊債証券	2,021,381	1,817,635 (203,888)
	社債証券	1,451,683	1,318,867 (-)

(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 (2020年2月15日から2021年2月15日まで)

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
公 社 債	百万円 198,084	百万円 4,470	% 2.3	百万円 143,125	百万円 11,792	% 8.2

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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	212,920,000	227,135,859	83.1	—	55.9	18.5	8.7
地 方 債 証 券	16,600,000	17,224,060	6.3	5.1	2.3	2.8	1.1
特 殊 債 券	14,894,979	15,838,836	5.8	—	3.8	1.5	0.5
金 融 債 券	500,000	500,321	0.2	—	—	0.2	—
普 通 社 債 券	10,281,000	10,583,824	3.9	0.1	1.2	2.0	0.7
合 計	255,195,979	271,282,901	99.2	5.2	63.1	25.1	11.0

(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 2 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	1.0000	1,300,000	1,315,925	2022/03/20
4 1 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	900,000	902,367	2022/04/01
4 1 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,500,000	1,504,245	2022/05/01
4 1 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	400,000	401,184	2022/06/01
4 1 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,500,000	2,507,700	2022/06/20
3 2 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.9000	3,200,000	3,244,000	2022/06/20
3 2 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,050,000	1,063,030	2022/06/20
4 1 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,000,000	1,003,220	2022/07/01
4 1 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	200,000	200,684	2022/08/01
4 1 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,270,000	1,274,597	2022/09/01
1 3 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,980,000	1,987,246	2022/09/20
3 2 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,400,000	1,420,650	2022/09/20
4 1 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,300,000	1,305,330	2022/11/01
4 1 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	600,000	602,526	2022/12/01
1 3 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,697,165	2022/12/20
3 2 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.7000	500,000	507,610	2022/12/20
3 2 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,200,000	1,220,472	2022/12/20
4 2 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.1000	1,600,000	1,607,056	2023/01/01
1 3 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,840,000	1,848,648	2023/03/20
3 2 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	1,790,000	1,817,154	2023/03/20
1 3 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,250,000	1,256,587	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,770,000	1,808,196	2023/06/20
1 3 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,400,000	1,408,190	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.8000	1,250,000	1,279,887	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	650,000	662,161	2023/09/20

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	
1 3 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,550,000	2,567,085	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,360,000	2,408,781	2023/12/20
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,720,000	1,732,263	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,250,000	2,300,557	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,690,000	1,702,742	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	2,380,000	2,437,453	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,660,000	1,673,163	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	2,940,000	3,005,209	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	350,000	377,958	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,920,000	1,935,916	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	760,000	777,882	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,340,000	1,361,185	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	340,000	367,672	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,500,000	1,513,245	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,030,000	2,072,508	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	152,703	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,750,000	2,775,162	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	3,040,000	3,107,579	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	190,000	206,606	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,000,000	2,019,380	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	2,350,000	2,405,295	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	240,000	263,308	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,100,000	1,110,967	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	2,210,000	2,253,537	2025/12/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	2,580,000	2,605,696	2026/03/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
85回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	489,249	2026/03/20
343回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,280,000	2,303,233	2026/06/20
88回 利付国庫債券(20年)	2.3000	350,000	394,775	2026/06/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,280,000	2,303,689	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	300,000	338,418	2026/09/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,010,000	3,041,785	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	870,000	981,012	2026/12/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,470,000	2,496,429	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	250,000	281,637	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	450,000	509,697	2027/03/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,010,000	2,031,748	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	350,000	402,692	2027/06/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,980,000	2,001,621	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	574,780	2027/09/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,060,000	2,082,639	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	450,000	516,591	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,700,000	2,727,837	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	695,772	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,960,000	1,979,462	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	360,000	424,504	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,220,000	2,241,090	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	400,000	464,652	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	350,000	409,230	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,840,000	1,856,596	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	400,000	466,412	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	400,000	460,132	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,870,000	1,885,876	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	220,000	253,908	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	330,000	386,202	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,920,000	1,935,187	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	290,000	343,064	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	646,052	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,180,000	2,195,892	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	100,000	123,791	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	770,000	907,753	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,160,000	2,173,327	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	550,000	650,386	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	200,000	238,268	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	121,243	2030/02/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,100,000	2,111,403	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	320,000	382,585	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	650,000	771,238	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,160,000	2,169,028	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	310,000	366,193	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	300,000	348,804	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	400,000	457,636	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,090,000	2,096,959	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	634,451	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	350,000	407,883	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	254,984	2030/11/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	800,000	801,952	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	898,800	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	390,000	463,565	2030/12/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	800,012	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	340,000	405,324	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	420,000	496,490	2031/03/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	620,000	734,582	2031/06/20
129回 利付国庫債券(20年)	1.8000	590,000	692,996	2031/06/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	680,000	800,734	2031/09/20
131回 利付国庫債券(20年)	1.7000	300,000	350,124	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	248,698	2031/11/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	420,000	491,278	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	672,839	2031/12/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	630,000	745,397	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	350,000	410,284	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	440,000	510,972	2032/03/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	350,000	411,176	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	380,000	437,931	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	450,000	523,629	2032/06/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,090,000	1,283,224	2032/09/20
8回 利付国庫債券(30年)	1.8000	200,000	238,010	2032/11/22
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	750,000	884,730	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	400,000	476,508	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	700,000	889,245	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	430,000	498,030	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	200,000	236,840	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,410,000	1,669,722	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	200,000	247,280	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,050,000	1,245,741	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	100,000	122,688	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,180,000	1,387,691	2033/12/20
148回 利付国庫債券(30年)	2.4000	290,000	371,606	2034/03/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,090,000	1,269,904	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	259,598	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,130,000	1,318,291	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	150,000	195,262	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,230,000	1,420,600	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	258,562	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,410,000	1,592,383	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	320,000	410,387	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,270,000	1,435,150	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	257,114	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	1,170,000	1,339,135	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	263,350	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	1,030,000	1,165,290	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	258,300	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	1,230,000	1,356,185	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	220,000	291,332	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	940,000	953,564	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	200,000	265,498	2036/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	1,150,000	1,130,645	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	190,000	252,825	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	980,000	1,006,195	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	200,000	260,686	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,050,000	1,093,501	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	400,000	528,508	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,080,000	1,140,166	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,150,000	1,194,424	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	420,000	564,253	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	920,000	954,564	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,070,000	1,109,012	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	480,000	647,956	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,160,000	1,182,330	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	890,000	905,895	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	560,000	749,616	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,150,000	1,207,684	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	950,000	963,404	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	570,000	755,215	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	850,000	845,716	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	850,000	829,098	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	460,000	603,280	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	820,000	798,212	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,060,000	1,029,694	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	610,000	814,807	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	760,000	751,336	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,020,000	1,006,444	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	930,000	1,194,910	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,100,000	1,084,237	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	400,000	401,812	2040/12/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	920,000	1,221,097	2041/03/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,100,000	1,422,652	2041/09/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	950,000	1,232,416	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	990,000	1,267,506	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	690,000	871,884	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	610,000	783,972	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	500,000	633,225	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	500,000	623,635	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	810,000	1,011,179	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	520,000	649,740	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	590,000	737,848	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	580,000	700,564	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	750,000	906,360	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	710,000	874,720	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	710,000	842,549	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	800,000	949,648	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	610,000	639,389	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	620,000	576,550	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	680,000	663,442	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	750,000	748,320	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	700,000	731,577	2047/03/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	700,000	731,010	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	620,000	646,951	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	690,000	719,407	2047/12/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	870,000	906,313	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	680,000	691,097	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	760,000	809,179	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	660,000	668,566	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	280,000	390,972	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	500,000	480,470	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	570,000	532,072	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	640,000	596,384	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	610,000	567,446	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	290,000	406,925	2050/03/20
66回 利付国庫債券(30年)	0.4000	520,000	483,464	2050/03/20
67回 利付国庫債券(30年)	0.6000	690,000	676,496	2050/06/20
68回 利付国庫債券(30年)	0.6000	710,000	696,005	2050/09/20
69回 利付国庫債券(30年)	0.7000	400,000	402,480	2050/12/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	550,000	776,259	2051/03/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	500,000	683,400	2052/03/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	570,000	768,348	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	530,000	688,099	2054/03/20
8回 利付国庫債券(40年)	1.4000	620,000	753,963	2055/03/20
9回 利付国庫債券(40年)	0.4000	1,020,000	928,567	2056/03/20
10回 利付国庫債券(40年)	0.9000	900,000	960,156	2057/03/20
11回 利付国庫債券(40年)	0.8000	750,000	776,655	2058/03/20
12回 利付国庫債券(40年)	0.5000	750,000	701,722	2059/03/20
13回 利付国庫債券(40年)	0.5000	560,000	523,213	2060/03/20
小 計	-	212,920,000	227,135,859	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
23年度20回 愛知県公募公債	1.0820	500,000	505,950	2022/03/29
109回 共同発行市場公募地方債	1.0500	500,000	506,155	2022/04/25
708回 東京都公募公債	0.8900	500,000	505,870	2022/06/20
111回 共同発行市場公募地方債	0.8900	700,000	708,288	2022/06/24
364回 大阪府公募公債	0.7900	300,000	303,675	2022/09/27
194回 神奈川県公募公債	0.7910	300,000	304,290	2022/12/20
24年度7回 千葉県公募公債	0.7400	300,000	304,020	2022/12/22
119回 共同発行市場公募地方債	0.8000	500,000	507,945	2023/02/24
121回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	506,070	2023/04/25
25年度4回 愛知県公募公債	0.8560	300,000	305,760	2023/05/30
720回 東京都公募公債	0.8700	300,000	306,006	2023/06/20
25年度4回 札幌市公募公債	0.8000	200,000	203,676	2023/06/20
25年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	408,404	2023/07/14
374回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	306,657	2023/07/28
25年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	204,162	2023/08/25
128回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	305,367	2023/11/24
726回 東京都公募公債	0.7300	400,000	408,140	2023/12/20
25年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	204,114	2024/02/26
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	305,370	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債(12年)	1.1000	300,000	310,767	2024/06/26
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	408,188	2024/07/29

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	
488回 名古屋市公債券 10年	0.5980	450,000	459,342	2024/09/20
26年度11回 京都府公債券	0.4760	350,000	356,125	2024/12/19
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	506,395	2025/01/24
26年度17回 兵庫県公債券	0.4600	200,000	203,420	2025/02/26
5回 東京都公債券 20年	2.1100	100,000	108,538	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	407,380	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	400,000	409,088	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	511,810	2025/07/25
1回 静岡県公債券 20年	2.1800	100,000	109,907	2025/09/19
9回 東京都公債券 20年	2.4400	200,000	225,162	2026/06/19
10回 東京都公債券 20年	2.3300	300,000	337,659	2026/09/18
4回 京都府公債券 20年	2.5100	100,000	113,555	2026/09/18
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	503,105	2027/01/25
29年度4回 大阪市公債券	0.1500	200,000	200,720	2027/09/21
29年度6回 広島市公債券	0.2300	300,000	302,616	2028/02/25
5回 兵庫県公債券 15年	1.3100	300,000	325,755	2028/05/26
30年度7回 神戸市公債券 30年	0.2540	300,000	302,910	2028/09/20
第91回 川崎市公債券	0.1850	200,000	200,902	2028/09/20
7回 静岡県公債券 20年	2.3200	300,000	349,713	2028/09/21
30年度14回 北海道公債券	0.1950	300,000	301,023	2028/12/28
30年度19回 愛知県公債券	0.1150	200,000	199,584	2029/03/28
802回 東京都公債券	0.1300	400,000	398,920	2030/03/19
8回 静岡県公債券 15年	0.8280	200,000	212,062	2030/06/07
36回2号 宮城県公債券 10年	0.1350	250,000	249,280	2030/10/28
19回 神奈川県公債券 20年	1.8180	100,000	117,027	2032/01/30
24年度2回 福岡県公債券(20年)	1.6350	300,000	346,629	2032/08/16
10回 大阪府公債券 20年	1.7200	200,000	233,022	2032/09/24
14回 千葉県公債券 20年	1.1370	100,000	110,202	2033/04/15
14回 埼玉県公債券 20年	1.5460	300,000	347,556	2034/05/08
17回 北九州市公債券 20年	1.5290	100,000	115,540	2034/06/20
2回 横浜市公債券 30年	2.4900	100,000	129,352	2035/03/20
18回 千葉県公債券 20年	1.1380	100,000	110,769	2035/04/13
14回 大阪府公債券 20年	0.5400	100,000	101,754	2036/09/29
30年度7回 福岡市公債券	0.7010	200,000	207,200	2038/10/19
27年度8回 愛知県公債券 30年	1.5790	150,000	180,630	2045/06/20
27年度2回 広島県公債券 30年	0.7110	100,000	100,534	2046/03/22
小 計	-	16,600,000	17,224,060	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
36回 政地方公共団体金融機構債券	0.9010	300,000	303,435	2022/05/20
96回 高速道路機構債	0.7960	700,000	708,715	2022/09/20
44回 政地方公共団体金融機構債券	0.8340	400,000	406,508	2023/01/20
5回 鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	508,535	2023/03/20
189回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	505,830	2023/04/28
193回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	510,330	2023/06/30
50回 政地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	510,845	2023/07/14
195回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	330,000	337,296	2023/07/31
116回 高速道路機構債	0.7220	100,000	101,807	2023/09/20
56回 政地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	553,696	2024/01/19
64回 政地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	305,619	2024/09/13
241回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	508,850	2025/03/31

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	
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,988	2025/10/21
83回 地方公共団体金融機構債券	0.0900	400,000	400,100	2026/04/28
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	200,000	201,450	2027/04/13
309回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	804,584	2027/04/30
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,936	2027/06/18
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,809	2027/11/19
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	302,601	2028/02/18
9回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	216,500	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	229,678	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	200,000	234,800	2029/06/28
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	353,061	2029/08/28
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	233,760	2029/09/20
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	213,174	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	232,584	2030/10/29
121回 政日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	580,090	2030/10/31
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	415,009	2031/06/13
9回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	233,608	2031/12/26
13回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.9600	9,602	9,625	2032/05/10
14回 貸付債権担保5種住宅金融支援機構債券	1.7000	48,380	48,479	2032/05/10
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	116,203	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	231,992	2032/09/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	400,000	524,544	2033/12/20
239回 政日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	334,509	2035/02/28
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	224,840	2035/06/28
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	195,472	2036/06/20
6回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	33,729	34,375	2037/05/10
8回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	23,700	24,300	2037/05/10
9回 貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	35,535	36,439	2037/05/10
319回 政日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	206,776	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	269,850	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	37,851	39,092	2037/11/10
43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	12,520	12,966	2041/06/10
44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,532	49,903	2041/07/10
51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	36,441	37,518	2042/02/10
1回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	59,815	61,473	2042/05/10
29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	126,650	135,786	2044/10/10
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	201,216	212,960	2045/05/10
260回 政日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	232,750	2045/10/31
169回 高速道路機構債	1.2000	100,000	109,874	2045/12/20
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	219,892	2047/03/20
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	97,973	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	100,000	98,305	2050/06/20
114回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	243,543	244,073	2051/11/10
126回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	256,239	258,150	2052/11/10
128回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	256,635	258,377	2053/01/10
131回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,603	262,976	2053/04/10
132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	261,339	262,708	2053/05/10
137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	269,649	272,447	2053/10/10
小 計	-	14,894,979	15,838,836	-

銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(金融債券)	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,245	2024/05/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	400,076	2025/08/27
小 計	-	500,000	500,321	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
13回 パナソニック社債	0.5680	100,000	100,504	2022/03/18
9回 西日本旅客鉄道社債	2.2800	200,000	204,970	2022/03/25
45回 住友商事社債	1.1170	100,000	101,167	2022/04/20
23回 ゼイ エフ イー ホールディングス社債	0.0900	100,000	99,933	2022/05/23
1回 BPCE SA円債社債(ノンチャルボンド)	0.2140	200,000	200,026	2022/06/30
21回 東日本旅客鉄道社債	2.0200	100,000	103,163	2022/09/20
94回 丸紅社債	1.1700	100,000	101,679	2022/10/12
57回 東京三菱銀行社債	2.2200	200,000	207,266	2022/10/27
19回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.4760	100,000	100,632	2022/12/02
11回 東海旅客鉄道社債	1.1500	300,000	306,135	2022/12/20
18回 大阪ガス社債	1.4700	100,000	102,634	2022/12/20
518回 中部電力社債	0.1900	200,000	200,522	2023/01/25
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	203,664	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	101,449	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	203,150	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	102,272	2023/03/24
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	306,687	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	100,000	101,833	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	204,340	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	102,389	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	410,484	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	315,429	2023/09/20
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	102,394	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,811	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	206,326	2023/11/24
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	211,196	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	307,551	2023/12/20

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	
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	412,360	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	411,680	2024/02/23
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	203,324	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	106,595	2024/03/19
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	107,569	2024/09/20
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	203,108	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	204,512	2024/11/28
321回 北海道電力社債	0.8860	161,000	165,607	2024/12/25
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	325,155	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	216,228	2025/06/20
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	218,268	2025/09/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	134,320	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	104,642	2026/06/25
33回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	302,778	2026/12/14
34回 西日本高速道路債	0.3350	200,000	202,562	2027/02/16
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	303,708	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	304,260	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,200	2027/05/07
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	200,000	202,036	2028/01/18
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	202,072	2028/06/06
14回 プリズトン社債	0.3750	200,000	200,284	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	107,232	2029/04/27
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	200,000	201,788	2030/09/20
73回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	235,190	2030/12/20
350回 北海道電力社債	0.7540	200,000	202,868	2038/03/25
43回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	99,910	2038/07/12
71回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	98,726	2059/12/24
47回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	97,235	2060/09/17
小 計	-	10,281,000	10,583,824	-
合 計	-	255,195,979	271,282,901	-

■投資信託財産の構成

2021年2月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 271,282,901	% 99.2
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,188,062	0.8
投 資 信 託 財 産 総 額	273,470,964	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15日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	273,470,964,587円
コ ー ル ・ 公 司 未 前 負 未 払 純 資 産 元 次 受 取 払 解 約 総 額 (A - B) 期 繰 越 損 益 受 益 権 総 口 数	1,577,987,460 271,282,901,629 528,367,341 81,708,157 124,841,000 124,841,000 273,346,123,587 209,919,027,595 63,427,095,992 209,919,027,595口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額 (C / D)	13,022円

(注1) 期首元本額	168,870,516,479円	リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	25,891,763円
追加設定元本額	167,666,444,476円	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	37,090,342円
一部解約元本額	126,617,933,360円	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	588,184,487円
(注2) 期末における元本の内訳		リスクコントロール世界資産分散ファンド	1,654,944,013円
D I A M国内債券パッシブ・ファンド	20,138,397,472円	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,553,714,682円
M I T O ラップ型ファンド(安定型)	75,739,659円	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	8,354,710円
M I T O ラップ型ファンド(中立型)	64,284,684円	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	4,154,214円
M I T O ラップ型ファンド(積極型)	13,922,204円	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	4,151,302円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	698,579,753円	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	10,186,401円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	175,024,830円	D I A Mエマージング債券ファンド	9,450,010円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	22,170,668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)	1,324,203円
たわらノーロード 国内債券	13,371,410,550円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06(適格機関投資家限定)	18,427,003円
たわらノーロード バランス(8資産均等型)	1,375,425,101円	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	1,519,942,923円
たわらノーロード バランス(堅実型)	479,364,723円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-09(適格機関投資家限定)	9,097,902円
たわらノーロード バランス(標準型)	771,140,997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)	7,795,147,063円
たわらノーロード バランス(積極型)	94,268,225円	Oneコアポートフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	1,101,630,563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)	35,956,909円	D I A Mワールドバランス25VA(適格機関投資家限定)	308,141,870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)	841,677,984円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI(適格機関投資家限定)	5,804,574,674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)	857,299,721円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドII(適格機関投資家限定)	5,780,092,239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)	267,544,001円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドIV(適格機関投資家限定)	5,759,938,173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)	94,593,242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)	5,767,537,679円
たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	11,595,925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)	2,207,986円
たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	7,216,822円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA	194,833,349円
たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	15,550,209円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA	115,400,455円
たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	3,935,187円	D I A M国際分散バランスファンド30VA	41,774,211円
たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	2,527,471円	D I A M国際分散バランスファンド50VA	118,714,473円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,617,188,939円	D I A M国内重視バランスファンド30VA	47,275,935円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	7,945,845,516円	D I A M国内重視バランスファンド50VA	10,741,315円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	10,564,168,081円	D I A M世界バランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	63,831,542円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	4,214,698,647円	D I A M世界バランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	147,396,923円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	1,934,636,468円	D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	4,113,378,518円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,100,996,248円	D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,455,390,819円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	317,515,894円	D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,620,892,716円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	69,643,768円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA	512,197,093円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	2,183,121,770円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2(適格機関投資家限定)	209,605,289円
マネックス資産設計ファンド エボリューション	9,343,546円	D I A M アグサ グローバル バランスファンド30VA	2,518,908,521円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	3,834,269,246円	D I A M世界アセットバランスファンドVA(適格機関投資家向け)	229,606,580円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,215,297,756円	D I A M世界バランスファンド55VA(適格機関投資家限定)	10,843,033円
D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	244,940,249円	D I A M世界アセットバランスファンド2VA(適格機関投資家限定)	2,800,949,726円
投資のソムリエ	19,968,780,596円	D I A M世界アセットバランスファンド40VA(適格機関投資家限定)	54,001,054円
クルーズコントロール	1,710,359,908円	D I A M世界アセットバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	448,922,701円
投資のソムリエ<DC年金>	1,200,230,759円	D I A M世界アセットバランスファンド3VA(適格機関投資家限定)	713,955,739円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	3,601,786,821円	D I A M世界アセットバランスファンド4VA(適格機関投資家限定)	1,210,800,648円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	458,001,465円	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	338,532,229円
D I A Mコア資産設計ファンド(堅実型)	6,432,489円	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	106,770,675円
D I A Mコア資産設計ファンド(積極型)	14,490,817円	Oneコアポートフォリオ・アリス戦略ファンドI(適格機関投資家限定)	928,960,030円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	2,572,825,479円	コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	382,409,178円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	28,534,806,570円	期末元本合計	209,919,027,595円
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	15,124,286円		
投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	7,164,986円		

■損益の状況

当期 自2020年2月15日 至2021年2月15日

項	目	当	期
(A) 配	当 等 収 益		1,854,548,870円
受	取 利 息		1,855,446,015
支	払 利 息		△897,145
(B) 有	価 証 券 売 買 損 益		△5,046,081,656
売	買 益		53,162,300
売	買 損		△5,099,243,956
(C) 当	期 損 益 金(A+B)		△3,191,532,786
(D) 前	期 繰 越 損 益 金		53,988,844,136
(E) 解	約 差 損 益 金		△39,191,042,382
(F) 追	加 信 託 差 損 益 金		51,820,827,024
(G) 合	計(C+D+E+F)		63,427,095,992
次	期 繰 越 損 益 金(G)		63,427,095,992

(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。