

運用報告書 (全体版)

第14期<決算日2022年5月9日>

MHAM日本債券インデックスファンド (ファンドラップ)

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	2008年6月3日から無期限です。	
運用方針	主としてわが国の公社債を主要投資対象として、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の動き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	MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	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	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドを通じてわが国の公社債に投資を行います。公社債への投資割合は、原則として高位を維持します。	
組入制限	MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	株式への投資は、転換社債の転換および新株予約権の行使、株主割当または社債権者割当により取得したものに限り行えるものとし、その実質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行いません。
	国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	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行います。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。
分配方針	毎年原則として5月8日に決算を行い、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲とし、分配金額は委託会社が基準価額の水準や市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないことがあります。収益分配に充てなかった利益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。	

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、「MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)」は、2022年5月9日に第14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/>

MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）

■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	債券先物比率	純資産額
	(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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
10期(2018年5月8日)	12,078	0	0.4	381.90	0.6	99.3	-	79,402
11期(2019年5月8日)	12,259	0	1.5	388.40	1.7	99.5	-	76,535
12期(2020年5月8日)	12,241	0	△0.1	388.67	0.1	99.3	-	62,130
13期(2021年5月10日)	12,156	0	△0.7	386.71	△0.5	99.7	-	57,195
14期(2022年5月9日)	11,890	0	△2.2	378.69	△2.1	99.6	-	52,088

(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」、「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	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2021年5月10日	円 12,156	% -	386.71	% -	% 99.7	% -
5月末	12,152	△0.0	386.62	△0.0	99.7	-
6月末	12,157	0.0	386.90	0.0	99.7	-
7月末	12,218	0.5	388.81	0.5	99.7	-
8月末	12,206	0.4	388.46	0.5	99.4	-
9月末	12,163	0.1	387.12	0.1	105.3	-
10月末	12,148	△0.1	386.72	0.0	100.2	-
11月末	12,177	0.2	387.65	0.2	99.6	-
12月末	12,149	△0.1	386.84	0.0	100.4	-
2022年1月末	12,061	△0.8	384.06	△0.7	99.3	-
2月末	12,000	△1.3	382.13	△1.2	99.8	-
3月末	11,966	△1.6	381.04	△1.5	99.6	-
4月末	11,935	△1.8	380.12	△1.7	99.2	-
(期末) 2022年5月9日	11,890	△2.2	378.69	△2.1	99.6	-

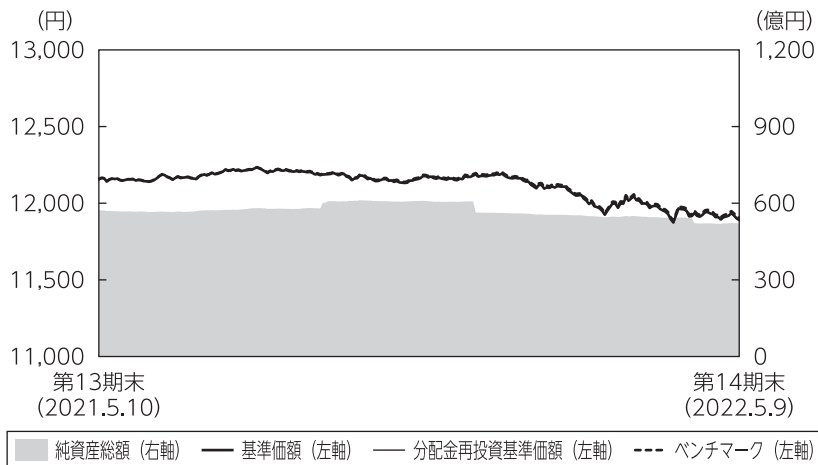
(注1) 騰落率は期首比です。

(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」、「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 (2021年5月11日から2022年5月9日まで)

基準価額等の推移



第14期首： 12,156円

第14期末： 11,890円

(既払分配金0円)

騰落率： △2.2%

(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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドへの投資を通じて、国内債券への投資を行った結果、市況が下落（利回りは上昇）したことから、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。期初から2021年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ず、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12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いでした。2022年に入ると欧米中央銀行による金融政策正常化観測の強まりなどから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

マザーファンド受益証券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。約款変更により、2021年7月2日に主な投資対象として国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド受益証券の組入れを開始しました。また、MHAM日本債券インデックスマザーファンド受益証券は2021年7月14日に繰上償還しました。

●MHAM日本債券インデックスマザーファンド

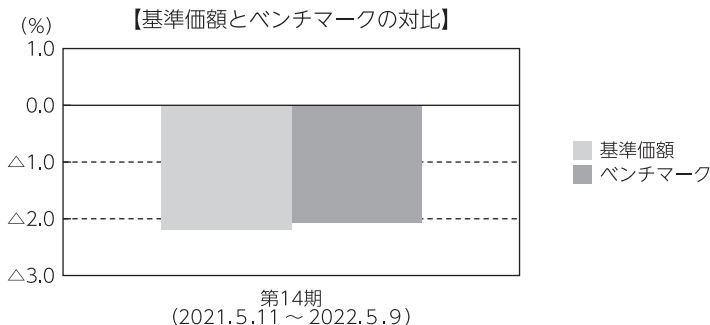
ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行いました。2021年7月14日に繰上償還しました。

●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総合の動きに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行いました。

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2.1%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%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

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。なお、収益分配に充てなかった収益については、運用の基本方針に基づいて運用を行います。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2021年5月11日 ～2022年5月9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	2,150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14期		項目の概要
	(2021年5月11日 ～2022年5月9日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.115%	(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12,115円です。
(投信会社)	(9)	(0.071)	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)	(1)	(0.011)	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	14	0.116	

(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、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みます。

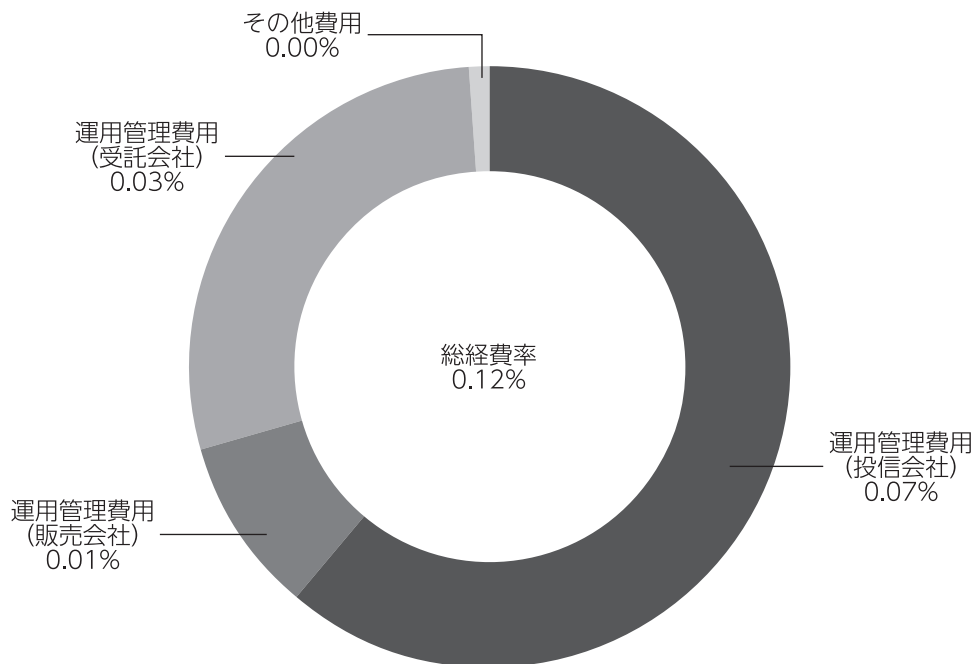
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.12%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（2021年5月11日から2022年5月9日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	千口 556,608	千円 694,770	千口 46,403,796	千円 58,021,933
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	47,899,531	62,675,209	7,155,981	9,306,028

■利害関係人との取引状況等（2021年5月11日から2022年5月9日まで）

【MHAM日本債券インデックスファンド（ファンドラップ）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。

【MHAM日本債券インデックス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					
	区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D
公 社 債						

平均保有割合 42.8%

(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。

【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	当 期					
	区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D
公 社 債						

平均保有割合 10.9%

(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
MHAM日本債券インデックスマザーファンド	千口 45,847,187	千口 -	千円 -
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	-	40,743,549	52,086,553

■投資信託財産の構成

2022年5月9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	千円 52,086,553	% 99.9
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	63,612	0.1
投 資 信 託 財 産 総 額	52,150,165	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

(2022年5月9日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	52,150,165,274円
コール・ローン等	61,493,191
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	52,086,553,083
未 収 入 金	2,119,000
(B) 負 債	62,127,061
未 払 解 約 金	30,227,550
未 払 信 託 報 酬	31,588,511
そ の 他 未 払 費 用	311,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	52,088,038,213
元 本	43,809,441,668
次 期 繰 越 損 益 金	8,278,596,545
(D) 受 益 権 総 口 数	43,809,441,668口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11,890円

(注) 期首における元本額は47,050,497,080円、当期中における追加設定元本額は7,712,402,357円、同解約元本額は10,953,457,769円です。

■損益の状況

当期 自2021年5月11日 至2022年5月9日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△8,216円
受 取 利 息	1,553
支 払 利 息	△9,769
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,101,047,734
売 買 損 益	188,939,984
売 買 損 益	△1,289,987,718
(C) 信 託 報 酬 等	△66,267,612
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△1,167,323,562
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	714,712,476
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	8,731,207,631
(配 当 等 相 当 額)	(7,134,309,150)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,596,898,481)
(G) 合 計(D+E+F)	8,278,596,545
次 期 繰 越 損 益 金(G)	8,278,596,545
追 加 信 託 差 損 益 金	8,731,207,631
(配 当 等 相 当 額)	(7,136,620,299)
(売 買 損 益 相 当 額)	(1,594,587,332)
分 配 準 備 積 立 金	2,283,628,397
繰 越 損 益 金	△2,736,239,483

(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	298,851,464円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	7,136,620,299
(d) 分 配 準 備 積 立 金	1,984,776,933
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	9,420,248,696
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	2,150.28
(g) 分 配 金	0
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

当期の収益分配金は、基準価額の水準や市況動向等を勘案した結果、分配を見送らせていただきました。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■主要投資対象を「MHAM日本債券インデックスマザーファンド」から「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」に変更しました。

(2021年7月2日)

■当ファンドが投資対象とする「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、信託金の限度額を1兆円から3兆円に変更しました。

(2022年3月15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19期 (決算日 2022年2月14日)

(計算期間 2021年2月16日～2022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	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				
15期 (2018年2月14日)	12,855	1.0	380.56	1.0	99.5	—	—	百万円 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
19期 (2022年2月14日)	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	—	—	553,303

(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)。

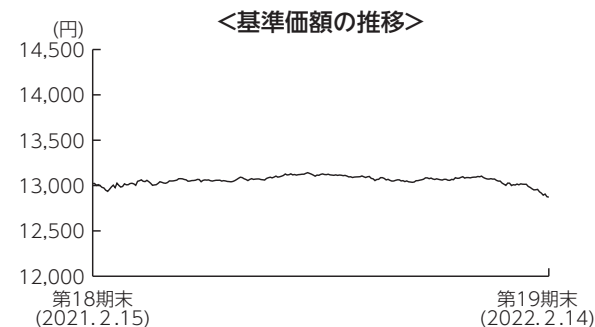
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2021年 2月15日	円 13,022	% -	ポイント 385.59	% -	% 99.2	% -	% -
2 月 末	12,936	△0.7	383.06	△0.7	99.5	-	-
3 月 末	13,025	0.0	385.72	0.0	99.7	-	-
4 月 末	13,049	0.2	386.44	0.2	99.8	-	-
5 月 末	13,054	0.2	386.62	0.3	99.9	-	-
6 月 末	13,061	0.3	386.90	0.3	99.8	-	-
7 月 末	13,125	0.8	388.81	0.8	99.7	-	-
8 月 末	13,114	0.7	388.46	0.7	99.4	-	-
9 月 末	13,069	0.4	387.12	0.4	105.3	-	-
10 月 末	13,054	0.2	386.72	0.3	100.2	-	-
11 月 末	13,086	0.5	387.65	0.5	99.6	-	-
12 月 末	13,057	0.3	386.84	0.3	100.4	-	-
2022年 1 月 末	12,964	△0.4	384.06	△0.4	99.3	-	-
(期 末) 2022年 2月14日	12,872	△1.2	381.31	△1.1	99.6	-	-

(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（2021年2月16日から2022年2月14日まで）

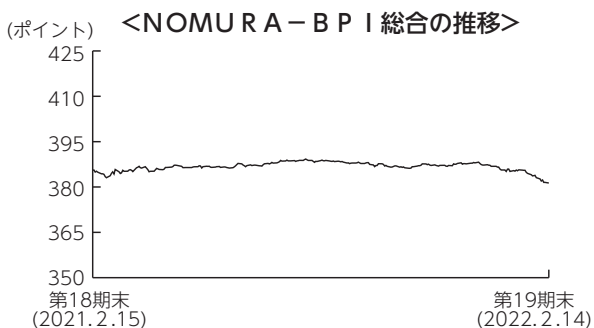


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,872円となり、前期末比で1.2%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。期初は株式市場の上昇などを受けて基準価額は下落しました。2021年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ず、国内景気の先行き不透明感が意識され基準価額は上昇しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手すると観測が広がり基準価額は下落しました。



投資環境

国内債券市場は下落（利回りは上昇）しました。期初は株式市場の上昇などを受けて利回りは上昇しました。2021年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ず、国内景気の先行き不透明感が意識され利回りは低下（価格

は上昇）しました。9月から12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いとなったものの、2022年に入ると各国の中央銀行が利上げに着手すると観測が広がり利回りは上昇しました。

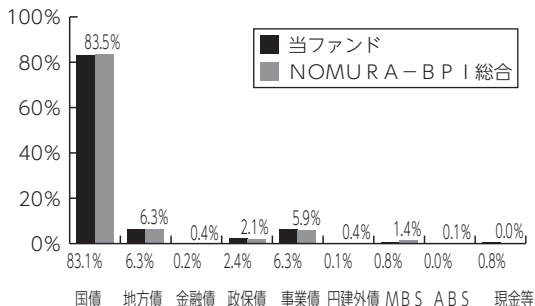
ポートフォリオについて

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。

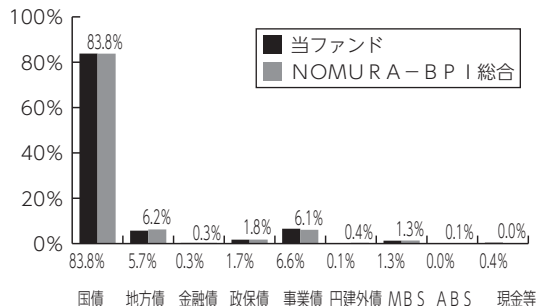
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

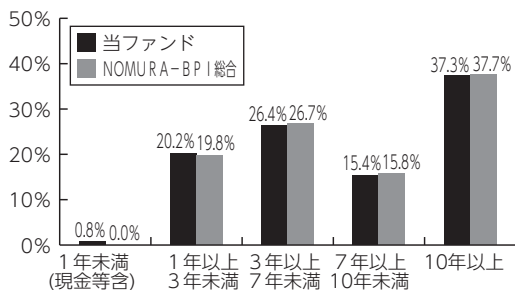


期末

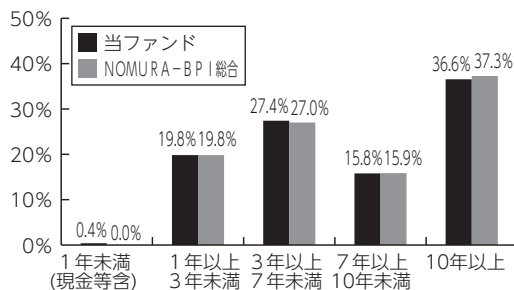


○残存年限別構成比

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1.1%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 (2021年2月16日から2022年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額	
国	内	千円	千円	
		国債証券	717,343,530	471,488,133 (-)
		地方債証券	18,975,569	4,218,721 (-)
		特殊債証券	14,592,716	2,073,694 (297,842)
	社債証券	19,760,179	2,338,632 (-)	

(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 (2021年2月16日から2022年2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		
	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 770,671	百万円 100,563	% 13.0	百万円 480,119	百万円 73,234	% 15.3

(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

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	447,045,000	463,797,306	83.8	—	53.6	19.7	10.5
地 方 債 証 券	30,445,330	31,523,404	5.7	4.7	3.6	1.4	0.7
特 殊 債 券	25,151,985	26,325,307	4.8	0.0	3.3	0.8	0.6
金 融 債 券	1,800,000	1,796,652	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 券	27,481,000	27,644,946	5.0	0.1	2.4	1.9	0.7
合 計	531,923,315	551,087,616	99.6	4.8	63.0	24.2	12.5

(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	
4 2 3 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,000,000	3,002,670	2023/04/01
4 2 4 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,100,000	3,102,976	2023/05/01
4 2 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,060	2023/06/01
1 3 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,850,000	4,861,058	2023/06/20
3 2 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	8,350,000	8,447,027	2023/06/20
4 2 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,100,000	2,102,163	2023/07/01
4 2 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,400,000	2,402,448	2023/08/01
4 2 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,500,000	2,502,500	2023/09/01
1 3 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,619,205	2023/09/20
3 3 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.8000	3,460,000	3,507,194	2023/09/20
3 3 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	1,950,000	1,970,377	2023/09/20
6 4 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	30,000	30,936	2023/09/20
4 2 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,100	2023/10/01
4 3 0 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	2,002,040	2023/11/01
4 3 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	4,000,000	4,003,920	2023/12/01
1 3 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,000,000	5,013,800	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,880,000	3,926,172	2023/12/20
6 5 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	60,000	62,153	2023/12/20
4 3 2 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	3,400,000	3,403,162	2024/01/01
1 3 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,750,000	3,760,950	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	3,630,000	3,678,206	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	50,000	52,023	2024/03/20
1 4 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,490,000	3,500,609	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.6000	4,240,000	4,302,582	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	50,000	52,841	2024/06/20

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	
7 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	40,000	42,086	2024/06/20
1 4 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,610,000	3,621,227	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	4,700,000	4,763,403	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	460,000	485,313	2024/09/20
1 4 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,530,000	3,541,543	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	2,100,000	2,130,765	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,010,000	3,036,969	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	380,000	401,724	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	40,000	42,400	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,200,000	3,210,880	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,030,000	6,106,400	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	191,710	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	74,121	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	42,478	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	5,400,000	5,418,954	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	6,510,000	6,598,080	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	265,830	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	53,333	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	96,300	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,350,000	4,365,616	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	4,410,000	4,473,371	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	428,676	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	150,540	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,900,000	3,914,235	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,820,000	3,863,280	2025/12/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
83回 利付国庫債券(20年)	2.1000	70,000	75,621	2025/12/20
84回 利付国庫債券(20年)	2.0000	170,000	182,998	2025/12/20
147回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,000,000	3,999,160	2026/03/20
342回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,980,000	3,994,606	2026/03/20
85回 利付国庫債券(20年)	2.1000	590,000	640,415	2026/03/20
86回 利付国庫債券(20年)	2.3000	120,000	131,235	2026/03/20
87回 利付国庫債券(20年)	2.2000	120,000	130,744	2026/03/20
148回 利付国庫債券(5年)	0.0050	3,900,000	3,898,284	2026/06/20
343回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,350,000	4,366,008	2026/06/20
88回 利付国庫債券(20年)	2.3000	590,000	648,504	2026/06/20
89回 利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	10,948	2026/06/20
149回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,200,000	4,196,136	2026/09/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,790,000	5,809,917	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	470,000	516,910	2026/09/20
91回 利付国庫債券(20年)	2.3000	110,000	121,484	2026/09/20
150回 利付国庫債券(5年)	0.0050	1,300,000	1,298,102	2026/12/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,190,000	5,206,296	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,160,000	1,275,826	2026/12/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,740,000	4,754,409	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	370,000	406,837	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	670,000	740,108	2027/03/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,030,000	5,044,737	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	616,099	2027/06/20
96回 利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	133,142	2027/06/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,990,000	5,003,872	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	739,160	2027/09/20
98回 利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	178,297	2027/09/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,430,000	4,441,606	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	839,340	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,210,000	5,221,045	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	937,783	2028/03/20
101回 利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	262,657	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,600,000	4,608,694	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	573,740	2028/06/20
103回 利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	182,587	2028/06/20
104回 利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	124,138	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,440,000	4,447,281	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	725,280	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	569,905	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,810,000	4,816,541	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	682,722	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	775,739	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,060,000	4,064,263	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	394,908	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	502,660	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,310,000	4,311,551	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	530,794	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	848,491	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,640,000	3,637,233	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	132,286	2029/09/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,170,000	1,345,862	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,690,000	3,684,243	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	820,000	946,895	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	418,510	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	118,144	2030/02/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,550,000	3,541,444	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	618,329	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,070,000	1,239,744	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,260,000	4,245,942	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	640,653	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	534,775	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	670,000	751,277	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,040,000	4,022,830	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	790,000	908,073	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	650,352	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	247,670	2030/11/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,000,000	3,977,320	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,050,000	1,228,164	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	600,000	696,576	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,750,000	4,715,990	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	709,350	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	593,813	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	623,905	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,800,000	4,760,304	2031/06/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,370,000	1,587,227	2031/06/20
129回 利付国庫債券(20年)	1.8000	760,000	873,521	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,400,000	4,356,528	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	1,048,047	2031/09/20
131回 利付国庫債券(20年)	1.7000	790,000	902,401	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	242,360	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	1,300,000	1,285,583	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	830,000	950,184	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,030,000	1,189,093	2031/12/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	800,000	925,224	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	640,000	733,862	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	660,000	750,274	2032/03/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	800,000	918,800	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,340,000	1,511,908	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	920,000	1,047,318	2032/06/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,290,000	2,634,072	2032/09/20
8回 利付国庫債券(30年)	1.8000	200,000	232,380	2032/11/22
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,580,000	1,819,938	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,500,000	1,743,615	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,480,000	1,691,033	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,310,000	1,482,697	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	288,867	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,350,000	2,715,354	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	276,696	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,280,000	2,639,122	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	179,062	2033/12/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	2,350,000	2,696,319	2033/12/20
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	422,810	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,210,000	2,512,084	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	327,298	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,270,000	2,583,441	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	302,973	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,440,000	2,750,685	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	338,447	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,460,000	2,713,675	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	497,632	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,340,000	2,582,494	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	349,154	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	2,620,000	2,926,068	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	420,977	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,690,000	2,969,356	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	388,023	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	2,460,000	2,650,133	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	371,727	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,550,000	2,538,142	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	449,694	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	2,430,000	2,346,553	2036/06/20
24回 利付国庫債券(30年)	2.5000	270,000	347,706	2036/09/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,690,000	2,706,543	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	416,394	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,480,000	2,526,475	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	792,521	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	2,010,000	2,073,676	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,890,000	1,919,654	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	805,206	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,820,000	1,846,317	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,070,000	2,097,303	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	1,003,825	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,680,000	2,668,074	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,310,000	2,296,116	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,112,083	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,830,000	1,873,151	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,970,000	1,950,300	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,126,734	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,680,000	1,632,976	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,950,000	1,858,096	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	912,038	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,420,000	1,348,971	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,649,206	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,248,263	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,510,000	1,453,586	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,120,000	2,036,472	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,462,456	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,990,000	1,907,454	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	1,930,000	1,879,820	2040/12/20
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,532,796	2041/03/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
176回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,080,000	2,021,843	2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,300,000	2,191,785	2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,460,000	1,818,371	2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,100,000	2,036,391	2041/09/20
179回 利付国庫債券(20年)	0.5000	800,000	776,176	2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	2,170,000	2,712,239	2042/03/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	2,260,000	2,788,297	2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,550,000	1,885,854	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,220,000	1,510,055	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	940,000	1,145,784	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,080,000	1,295,665	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,344,560	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,120,000	1,345,489	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,358,395	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,270,000	1,474,444	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,670,000	1,939,404	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,310,000	1,549,651	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,640,000	1,870,567	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,460,000	1,665,422	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,675,222	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,350,000	1,211,233	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,510,000	1,418,358	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,200,000	1,151,448	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,450,000	1,454,553	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,520,000	1,523,207	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,230,000	1,231,303	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,300,000	1,300,000	2047/12/20
1回 利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	151,087	2048/03/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,670,000	1,666,392	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,520,000	1,478,884	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	1,130,000	1,149,729	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,140,000	1,102,619	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	630,000	836,621	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,070,000	981,050	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,160,000	1,032,724	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,180,000	1,048,418	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,010,000	895,567	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	720,835	2050/03/20
66回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,090,000	965,631	2050/03/20
67回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,550,000	1,446,615	2050/06/20
68回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,340,000	1,249,992	2050/09/20
69回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,450,000	1,388,360	2050/12/20
4回 利付国庫債券(40年)	2.2000	720,000	966,996	2051/03/20
70回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,420,000	1,359,224	2051/03/20
71回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,600,000	1,531,040	2051/06/20
72回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,500,000	1,434,915	2051/09/20
73回 利付国庫債券(30年)	0.7000	600,000	573,792	2051/12/20
5回 利付国庫債券(40年)	2.0000	1,010,000	1,311,889	2052/03/20
6回 利付国庫債券(40年)	1.9000	1,030,000	1,317,009	2053/03/20
7回 利付国庫債券(40年)	1.7000	1,190,000	1,463,473	2054/03/20

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	
8回 利付国庫債券 (40年)	1.4000	1,310,000	1,505,792	2055/03/20
9回 利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,950,000	1,675,966	2056/03/20
10回 利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,820,000	1,829,755	2057/03/20
11回 利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,480,000	1,441,638	2058/03/20
12回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,400,000	1,228,892	2059/03/20
13回 利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,730,000	1,512,244	2060/03/20
14回 利付国庫債券 (40年)	0.7000	1,700,000	1,585,624	2061/03/20
小計	-	447,045,000	463,797,306	-
(地方債証券)	%	千円	千円	
719回 東京都公募公債	0.8600	200,000	201,858	2023/03/20
121回 共同発行市場公募地方債	0.5700	500,000	503,335	2023/04/25
25年度4回 愛知県公募公債	0.8560	300,000	303,270	2023/05/30
720回 東京都公募公債	0.8700	300,000	303,474	2023/06/20
1回 東京都公募公債 20年	1.5400	100,000	102,059	2023/06/20
25年度4回 札幌市公募公債	0.8000	200,000	202,128	2023/06/20
25年度2回 横浜市公募公債	0.8880	400,000	404,956	2023/07/14
374回 大阪府公募公債	0.9380	300,000	304,038	2023/07/28
25年度5回 千葉県公募公債	0.8400	200,000	202,532	2023/08/25
25年度6回 千葉県公募公債	0.8000	100,000	101,271	2023/09/25
29回1号 宮城県公募公債 10年	0.6800	100,000	101,134	2023/10/25
127回 共同発行市場公募地方債	0.6800	100,000	101,134	2023/10/25
128回 共同発行市場公募地方債	0.6600	300,000	303,459	2023/11/24
25年度2回 島根県公募公債	0.6700	106,000	107,246	2023/11/27
726回 東京都公募公債	0.7300	400,000	405,316	2023/12/20
25年度8回 埼玉県公募公債	0.7030	100,000	101,289	2023/12/25
25年度11回 福岡県公募公債	0.6940	200,000	202,736	2024/02/26
25年度2回 新潟県公募公債	0.6700	100,000	101,322	2024/02/28
132回 共同発行市場公募地方債	0.6600	100,000	101,345	2024/03/25
208回 神奈川県公募公債	0.5510	300,000	303,732	2024/06/20
26年度4回 札幌市公募公債 10年	0.5400	100,000	101,219	2024/06/20
1回 兵庫県公募公債 (12年)	1.1000	300,000	307,608	2024/06/26
26年度4回 神戸市公募公債	0.6060	100,000	101,402	2024/07/18
26年度5回 埼玉県公募公債	0.6110	400,000	405,720	2024/07/29
488回 名古屋市公募公債 10年	0.5980	450,000	456,633	2024/09/20
26年度1回 相模原市公募公債	0.5290	100,000	101,295	2024/09/20
26年度1回 長崎県公募公債	0.5540	100,000	101,361	2024/09/30
26年度1回 静岡市公募公債	0.5150	100,000	101,332	2024/11/25
26年度11回 京都府公募公債	0.4760	350,000	354,382	2024/12/19
26年度1回 三重県公募公債	0.4560	100,000	101,188	2024/12/25
26年度1回 浜松市公募公債	0.3350	100,000	100,866	2025/01/23
142回 共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	504,480	2025/01/24
26年度3回 広島市公募公債	0.4290	100,000	101,177	2025/02/25
26年度17回 兵庫県公募公債	0.4600	200,000	202,544	2025/02/26
5回 東京都公募公債 20年	2.1100	100,000	106,390	2025/03/19
2133回 神奈川県公募公債	0.5340	100,000	101,524	2025/03/19
144回 共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	405,336	2025/03/25
146回 共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	610,044	2025/05/23
148回 共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	508,730	2025/07/25
7回 東京都公募公債 20年	2.1600	100,000	107,575	2025/09/19
1回 静岡県公募公債 20年	2.1800	100,000	107,627	2025/09/19

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	
27年度15回 愛知県公募公債 10年	0.4710	100,000	101,571	2025/11/27
153回 共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,575	2025/12/25
27年度9回 千葉県公募公債	0.0950	100,000	100,122	2026/03/25
157回 共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	120,074	2026/04/24
9回 東京都公募公債 20年	2.4400	200,000	220,570	2026/06/19
159回 共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,998	2026/06/25
1回 兵庫県公募公債 15年	1.6600	200,000	214,114	2026/07/29
28年度6回 北海道公募公債	0.0700	100,000	99,977	2026/08/31
760回 東京都公募公債	0.0450	100,000	99,862	2026/09/18
10回 東京都公募公債 20年	2.3300	300,000	330,960	2026/09/18
4回 京都市公募公債 20年	2.5100	100,000	111,143	2026/09/18
413回 福岡県公募公債 10年	0.0210	100,000	99,723	2026/10/28
166回 共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	502,335	2027/01/25
28年度8回 福岡県公募公債	0.2400	100,000	100,725	2027/02/24
419回 大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	100,392	2027/04/27
2回 静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	106,848	2027/06/25
5回 兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	103,010	2027/07/07
29年度4回 大阪市公募公債	0.1500	200,000	199,998	2027/09/21
174回 共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,972	2027/09/24
24年度1回 福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	106,797	2027/11/29
178回 共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	100,471	2028/01/25
179回 共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	502,535	2028/02/25
29年度6回 広島市公募公債	0.2300	300,000	301,341	2028/02/25
29年度13回 京都府公募公債	0.2000	109,330	109,626	2028/03/16
5回 兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	321,342	2028/05/26
783回 東京都公募公債	0.2200	110,000	110,413	2028/06/20
4回 静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	107,343	2028/06/23
30年度7回 神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	301,740	2028/09/20
第91回 川崎市公募公債	0.1850	200,000	200,260	2028/09/20
7回 静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	342,096	2028/09/21
30年度3回 広島県公募公債	0.2540	100,000	100,581	2028/09/25
30年度3回 堺市公募公債	0.1950	100,000	100,067	2028/12/19
237回 神奈川県公募公債	0.1350	200,000	199,458	2028/12/20
20回2号 福岡県公募公債	2.0500	100,000	112,685	2028/12/20
6回 大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	227,612	2028/12/20
17回 横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	112,820	2028/12/20
6回 北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	112,474	2028/12/20
30年度6回 福岡県公募公債	0.2000	200,000	200,406	2028/12/21
189回 共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	100,237	2028/12/25
30年度14回 北海道公募公債	0.1950	400,000	400,132	2028/12/28
18回 東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	114,282	2029/03/19
30年度19回 愛知県公募公債	0.1150	200,000	199,016	2029/03/28
30年度3回 岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	199,508	2029/03/29
194回 共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	298,275	2029/05/25
6回 川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	228,986	2029/05/25
令和元年度1回 福岡県公募公債	0.0290	200,000	197,594	2029/06/21
9回 兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	105,986	2029/07/13
11回 神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	113,800	2029/07/20
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	197,530	2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	197,680	2029/09/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)					
令和元年度3回	横浜市公募債	0.0500	400,000	395,316	2029/10/16
令和元年度16回	兵庫県公募債	0.0500	200,000	197,652	2029/10/23
21回	東京都公募債 20年	2.1900	100,000	115,284	2029/12/20
17回	さいたま市公募債	0.1100	200,000	198,376	2029/12/25
令和元年度第8回	埼玉県公募債	0.1350	200,000	198,670	2030/01/30
21年度2回	福岡県公募債(20年)	2.2300	100,000	115,890	2030/02/22
203回	共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	99,013	2030/02/25
802回	東京都公募債	0.1300	400,000	396,980	2030/03/19
511回	名古屋市公募債 10年	0.0750	200,000	197,608	2030/03/27
令和2年度1回	京都府公募債	0.1350	400,000	397,116	2030/04/12
令和2年2回	大阪府公募債	0.1310	300,000	297,588	2030/05/22
9回	埼玉県公募債 20年	2.1500	100,000	115,631	2030/05/24
8回	静岡県公募債 15年	0.8280	200,000	209,836	2030/06/07
令和2年度10回	静岡県公募債	0.1350	100,000	99,073	2030/09/20
令和2年5回	福岡県公募債	0.1350	100,000	99,522	2030/10/23
36回2号	宮城県公募債 10年	0.1350	250,000	247,050	2030/10/28
令和2年度1回	福島県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
令和2年度1回	高知県公募債	0.1350	200,000	197,936	2030/11/27
22年度14回	愛知県公募債	2.0870	300,000	347,595	2030/12/13
9回	京都市公募債 20年	2.1430	200,000	232,738	2030/12/17
813回	東京都公募債	0.1790	300,000	297,897	2030/12/20
16回	神奈川県公募債 20年	2.0900	300,000	348,129	2031/01/24
464回	大阪府公募債 10年	0.0720	200,000	196,622	2031/01/28
令和2年度19回	北海道公募債	0.1450	100,000	98,897	2031/02/26
令和2年度14回	京都府公募債	0.2140	200,000	199,184	2031/03/12
令和2年7回	広島県公募債	0.2140	200,000	199,182	2031/03/19
251回	神奈川県公募債 10年	0.1990	200,000	198,826	2031/03/20
令和2年度14回	静岡県公募債	0.1400	200,000	197,780	2031/03/20
令和3年度1回	長野県公募債 10年	0.1900	200,000	198,682	2031/04/16
令和3年度2回	兵庫県公募債	0.1750	100,000	99,165	2031/04/25
467回	大阪府公募債 10年	0.1640	200,000	197,956	2031/04/28
469回	大阪府公募債 10年	0.1280	200,000	197,136	2031/06/27
令和3年5回	千葉県公募債	0.1050	200,000	196,712	2031/09/25
472回	大阪府公募債 10年	0.1000	200,000	196,436	2031/09/29
19回	神奈川県公募債 20年	1.8180	100,000	114,954	2032/01/30
24年度2回	福岡県公募債(20年)	1.6350	300,000	340,239	2032/08/16
10回	大阪府公募債 20年	1.7200	200,000	228,482	2032/09/24
24年度12回	神戸市公募債	1.7110	200,000	228,902	2032/12/17
14回	千葉県公募債 20年	1.1370	100,000	108,398	2033/04/15
13回	埼玉県公募債 20年	1.5990	100,000	113,533	2033/05/20
1回	東京都公募債 30年	2.2100	200,000	240,730	2033/06/20
14回	埼玉県公募債 20年	1.5460	300,000	340,266	2034/05/08
29回	横浜市公募債 20年	1.5280	100,000	113,263	2034/05/26
16回	名古屋市公募債 20年	1.5200	100,000	113,143	2034/06/09
5回	群馬県公募債 20年	1.5290	100,000	113,268	2034/06/16
17回	北九州市公募債 20年	1.5290	100,000	113,146	2034/06/20
15回	埼玉県公募債 20年	1.1660	100,000	108,996	2035/02/16
2回	横浜市公募債 30年	2.4900	100,000	125,684	2035/03/20
18回	千葉県公募債 20年	1.1380	100,000	108,681	2035/04/13
17回	名古屋市公募債 20年	1.2030	100,000	109,504	2035/05/28

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(地方債証券)					
13回	大阪府公募債 20年	1.2030	100,000	109,382	2035/09/28
14回	大阪府公募債 20年	0.5400	100,000	100,067	2036/09/29
21回	千葉県公募債 20年	0.4240	100,000	98,557	2036/10/15
3回	神奈川県公募債 30年	2.6200	100,000	129,747	2037/03/19
29年度2回	広島市公募債	0.6160	200,000	201,596	2037/08/18
29年度5回	札幌市公募債 20年	0.5970	300,000	301,374	2037/09/18
30年度2回	仙台市公募債 20年	0.7290	100,000	101,875	2038/10/18
30年度7回	福岡市公募債	0.7010	200,000	202,748	2038/10/19
2019年度5回	福岡市公募債 20年	0.2860	100,000	94,215	2039/07/29
2回	兵庫県公募債 30年	2.3600	100,000	128,860	2040/03/19
22年度8回	福岡市公募債	2.2800	100,000	127,719	2040/09/20
令和2年2回	広島県公募債	0.4640	100,000	96,353	2040/09/21
23年度7回	札幌市公募債 30年	2.0970	100,000	125,408	2041/09/20
5回	川崎市公募債 30年	2.0970	100,000	125,839	2042/03/20
24年度12回	愛知県公募債 30年	2.1200	100,000	126,252	2042/09/19
14回	東京都公募債 30年	2.0500	100,000	125,309	2043/06/19
27年度8回	愛知県公募債 30年	1.5790	150,000	174,357	2045/06/20
27年度2回	広島県公募債 30年	0.7110	100,000	97,493	2046/03/22
6回	埼玉県公募債 30年	0.9570	200,000	204,822	2046/12/20
令和元年度1回	島根県公募債	0.2900	200,000	189,308	2049/09/17
5回	京都市公募債 30年定時償還	0.2900	200,000	189,826	2049/09/17
令和3年度6回	神戸市公募債 30年	0.7130	200,000	189,564	2051/06/20
小計		-	30,445,330	31,523,404	-
(特殊債券)					
19回	政保日本政策投資銀行社債	0.6680	100,000	100,742	2023/03/15
55回	鉄道建設運輸施設債	0.8420	500,000	504,550	2023/03/20
189回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5410	500,000	503,365	2023/04/28
18回	国際協力機構債券	0.8680	100,000	101,155	2023/06/20
193回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.8820	500,000	506,195	2023/06/30
50回	政保地方公共団体金融機構債券	0.9110	500,000	506,570	2023/07/14
195回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.9110	430,000	435,835	2023/07/31
116回	高速道路機構債	0.7220	100,000	101,136	2023/09/20
202回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6990	105,000	106,289	2023/10/31
56回	政保地方公共団体金融機構債券	0.7470	542,000	550,010	2024/01/19
7回	広島県、広島市折半保証広島高速道路債券	0.6940	100,000	101,052	2024/02/28
211回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,364	2024/02/29
218回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	101,533	2024/05/31
220回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6440	200,000	203,092	2024/06/28
64回	政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	304,170	2024/09/13
139回	日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	101,219	2024/09/20
71回	鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	101,362	2024/11/27
21回	政保中部国際空港債券	0.4500	100,000	101,357	2025/03/17
241回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4500	500,000	506,870	2025/03/31
71回	政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	101,199	2025/04/25
21回	沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,941	2025/06/20
254回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4400	100,000	101,487	2025/08/29
127回	日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,949	2025/09/19
85回	中日本高速道路債券	0.0700	300,000	299,841	2025/10/21
172回	住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,676	2025/11/20
23回	国際協力銀行債券	2.0900	100,000	107,806	2025/12/19

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 1 回	住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	106,809	2025/12/19
4 0 回	政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,957	2026/03/13
1 1 回	独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	110,249	2026/03/20
1 8 7 回	住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	100,104	2026/04/20
8 3 回	地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	400,416	2026/04/28
8 0 回	住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	106,928	2026/09/18
3 2 1 回	住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	498,510	2026/09/18
7 9 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	320,157	2026/11/06
9 1 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	100,168	2026/12/14
3 0 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	100,296	2027/01/29
F 1 4 7 回	地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	211,904	2027/03/19
7 8 回	日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	301,767	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	801,656	2027/04/30
7 2 回	東日本高速道路社債	0.1200	200,000	199,734	2027/06/18
9 8 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	100,269	2027/07/16
2 2 2 回	住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	301,113	2027/11/19
1 0 3 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	100,231	2027/12/17
1 2 4 回	住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	107,376	2027/12/20
7 7 回	東日本高速道路社債	0.1100	300,000	299,130	2027/12/20
2 3 0 回	住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	301,425	2028/02/18
1 1 3 回	政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	100,521	2028/10/16
9 回	新関西国際空港社債	1.2310	200,000	213,926	2028/12/20
1 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	225,488	2028/12/20
9 3 4 回	都市再生債券	1.1020	100,000	106,336	2029/06/20
1 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	344,622	2029/06/28
2 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	345,489	2029/08/28
1 2 回	新関西国際空港社債	1.0670	200,000	212,340	2029/09/20
3 9 回	住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	228,672	2029/09/20
9 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	114,896	2029/12/28
7 8 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	104,386	2030/05/28
1 0 9 回	都市再生機構債券	0.9180	200,000	210,748	2030/06/20
1 5 回	日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	228,104	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	567,995	2030/10/31
1 3 回	地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	116,328	2031/01/28
9 0 回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	198,172	2031/05/30
7 5 回	住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	406,605	2031/06/13
7 9 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	115,414	2031/09/19
1 5 3 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	114,749	2031/12/26
1 9 回	地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	229,494	2031/12/26
2 3 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	113,574	2032/07/28
1 1 5 回	住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	114,784	2032/09/14
1 5 回	国際協力機構債券	1.7240	100,000	113,908	2032/09/17
2 4 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	227,792	2032/09/28
1 8 8 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	111,437	2033/04/28
2 8 回	日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	637,360	2033/12/20
1 2 4 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	112,737	2034/03/17
3 6 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	113,297	2034/04/28
2 3 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	327,033	2035/02/28
1 5 9 回	住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	107,835	2035/05/18
1 5 5 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	110,076	2035/06/20

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	
4 4 回	地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	220,534	2035/06/28
2 5 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	110,643	2035/06/29
1 7 2 回	高速道路機構債	0.2880	200,000	192,904	2036/06/20
5 9 回	地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	101,313	2037/04/28
6 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.2600	29,607	29,689	2037/05/10
8 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1500	20,706	20,925	2037/05/10
9 回	貸付債権担保5種住宅金融公庫債券	2.1900	31,623	31,961	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	202,422	2037/07/31
2 6 回	高速道路機構債	2.6700	200,000	261,262	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	33,411	34,022	2037/11/10
3 3 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	100,279	2038/01/29
2 3 3 回	住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	99,389	2038/04/20
2 1 0 回	高速道路機構債	0.6770	100,000	100,551	2038/09/17
2 8 8 回	政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	336,891	2040/07/27
1 1 6 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	119,376	2040/08/31
4 0 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	50,096	51,467	2041/03/10
4 3 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	11,209	11,425	2041/06/10
4 4 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	53,795	54,809	2041/07/10
5 1 回	貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	32,226	32,671	2042/02/10
1 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.1300	53,085	53,678	2042/05/10
4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	10,979	11,161	2042/08/10
1 4 8 回	住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	306,622	2043/12/18
2 7 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	18,671	19,689	2044/08/10
2 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	112,585	119,648	2044/10/10
3 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	173,976	183,008	2045/05/10
1 5 9 回	日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	115,645	2045/06/20
3 8 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	24,221	25,431	2045/07/10
2 6 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	224,626	2045/10/31
1 6 9 回	高速道路機構債	1.2000	100,000	106,929	2045/12/20
2 6 8 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	109,865	2046/01/31
4 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	21,048	22,067	2046/06/10
5 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	25,107	26,249	2046/09/10
5 3 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	26,331	27,540	2046/10/10
1 9 回	高速道路機構債	2.7500	150,000	211,822	2047/03/20
6 0 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	35,764	37,405	2047/05/10
6 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	80,552	83,805	2047/09/10
7 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	34,953	36,402	2048/09/10
8 2 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,074	42,429	2049/03/10
8 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	41,755	43,162	2049/05/10
8 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	45,545	47,063	2049/07/10
9 0 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	47,705	48,980	2049/11/10
9 3 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	52,914	53,535	2050/02/10
9 6 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	59,393	60,561	2050/05/10
1 3 1 回	日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	93,581	2050/06/20
1 6 5 回	都市再生機構債券	0.7090	200,000	187,562	2050/06/20
9 9 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	61,621	63,305	2050/08/10
4 1 8 回	高速道路機構債	0.6300	200,000	186,310	2051/08/31
4 2 0 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	189,248	2051/10/31
1 1 4 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	228,276	226,942	2051/11/10
1 1 7 回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,473	77,568	2052/02/10

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	
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	77,103	77,288	2052/03/10
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	77,191	77,317	2052/04/10
120回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	241,122	240,948	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	241,002	240,671	2053/01/10
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	163,316	163,084	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,409	244,643	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	245,211	244,521	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	424,330	425,004	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	84,346	84,415	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	87,002	86,223	2054/03/10
154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	276,159	273,005	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	122,990	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	369,132	366,160	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	283,044	281,119	2055/09/10
168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	290,907	289,478	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	881,010	873,486	2056/07/10
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	183,480	2061/02/28
小計	-	25,151,985	26,325,307	-
(金融債券)	%	千円	千円	
342回 利附信金中金債(5年)	0.1100	100,000	100,077	2023/05/26
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,101	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	100,002	2025/08/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	399,584	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	299,247	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	299,247	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	299,070	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	199,324	2026/08/27
小計	-	1,800,000	1,796,652	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
14回 トヨタ自動車社債	0.9630	200,000	201,960	2023/03/20
10回 セブン銀行社債	0.8030	100,000	100,813	2023/03/20
47回 日立キャピタル社債	0.8740	200,000	201,714	2023/03/20
301回 北陸電力社債	1.1580	100,000	101,144	2023/03/24
5回 ファーストリテイリング社債	0.1100	100,000	100,014	2023/06/06
23回 東京瓦斯社債	1.0100	300,000	303,507	2023/06/09
27回 NTTデータ社債	0.9000	200,000	202,124	2023/06/20
253回 四国電力社債	1.0000	200,000	202,312	2023/06/23
6回 JXホールディングス社債	1.1190	100,000	101,399	2023/07/19
377回 中国電力社債	1.1210	400,000	406,036	2023/08/25
10回 西日本旅客鉄道社債	2.0400	300,000	309,228	2023/09/20
26回 フランキ銀行定期預金債(8/FCM) 円銀社債(2018)	0.4430	100,000	100,225	2023/10/12
48回 クレディセゾン社債	1.0380	100,000	101,521	2023/10/20
47回 住友商事社債	0.8580	100,000	101,166	2023/10/23
424回 九州電力社債	1.2330	200,000	203,762	2023/11/24
56回 中日本高速道路社債	0.7590	100,000	101,345	2023/12/20
13回 東海旅客鉄道社債	2.0150	200,000	206,906	2023/12/20
38回 電源開発社債	0.9780	300,000	304,485	2023/12/20
471回 東北電力社債	1.1680	400,000	407,364	2023/12/25
426回 九州電力社債	1.0640	400,000	407,084	2024/02/23
13回 新生銀行社債	0.1500	200,000	199,664	2024/03/12

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	
16回 トヨタ自動車社債	0.6450	200,000	202,226	2024/03/19
14回 東海旅客鉄道社債	2.2000	100,000	104,259	2024/03/19
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	101,598	2024/04/25
2回 BPCE SA円貸社債(ソーシャルボンド)	0.3670	100,000	99,964	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	101,795	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	101,123	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,909	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	105,384	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	101,361	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	202,522	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,794	2024/10/31
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸社債	0.8650	200,000	202,624	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	202,578	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	202,466	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	265,865	2024/12/25
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	101,257	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,738	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,822	2025/06/11
12回 セン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,975	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	318,549	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	102,562	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	212,108	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	400,780	2025/07/09
27回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	213,564	2025/09/19
42回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	399,540	2025/12/19
14回 セン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,792	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	199,146	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,840	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,565	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,954	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	298,170	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,520	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,410	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,954	2026/06/03
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,434	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,050	2026/06/05
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円貸社債(2016)	0.4000	100,000	99,418	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	100,064	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	299,349	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	199,566	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	298,221	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	131,178	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	103,449	2026/06/25
90回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	199,556	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	299,763	2026/07/27
91回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/17
62回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	498,510	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,801	2026/09/18
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,999	2026/10/23
33回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	302,304	2026/12/14

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
3 4 回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	201,988	2027/02/16
1 2 回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	109,385	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	110,997	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	302,142	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	301,983	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	200,320	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	299,919	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	111,110	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	102,875	2027/09/24
25回 フランス相互証券銀行 (BF C/M) 円債社債 (2017)	0.5100	300,000	300,165	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,776	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	198,714	2027/10/25
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	100,062	2027/11/19
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	300,276	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	301,581	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	396,368	2028/06/02
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	200,934	2028/06/06
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	100,028	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	113,448	2029/03/21
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	99,654	2029/04/12
1 4 回 プリダストーン社債	0.3750	300,000	299,688	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	106,046	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	398,716	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	397,692	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	197,242	2029/07/25
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	197,254	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	114,048	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	199,608	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	99,336	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	99,442	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	198,552	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	400,636	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	99,435	2030/06/25
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	198,448	2030/08/09
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	399,996	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	113,148	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	300,510	2030/12/13

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	297,459	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	230,196	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	198,218	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	201,078	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	98,948	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	296,484	2031/04/25
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	296,946	2031/09/19
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	493,755	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	197,668	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	201,890	2032/01/23
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	99,513	2036/06/02
23回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	202,224	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	197,974	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	101,283	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	99,688	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	100,776	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	198,848	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	100,101	2038/05/25
8回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	200,640	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	97,663	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	98,977	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	95,902	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	193,860	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	92,270	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	94,387	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	193,374	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	192,742	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	96,298	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	109,475	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	103,649	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	93,961	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	189,550	2051/07/14
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	93,754	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	91,698	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	93,516	2060/12/17
小 計	-	27,481,000	27,644,946	-
合 計	-	531,923,315	551,087,616	-

■投資信託財産の構成

2022年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円	%
コーポレートローン等、その他	551,087,616	91.6
投資信託財産総額	50,748,215	8.4
	601,835,832	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

(2022年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	601,835,832,511円
コ ー ー ン 等	49,696,366,967
公 社 債(評価額)	551,087,616,706
未 収 利 息	809,631,617
前 払 費	242,217,221
(B) 負 債	48,532,656,000
未 払 解 約 債 金	48,532,656,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	553,303,176,511
元 本	429,840,166,151
次 期 繰 越 損 益	123,463,010,360
(D) 受 益 権 総 口 数	429,840,166,151口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,872円

(注1) 期首元本額	209,919,027,595円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	37,377,953円
追加設定元本額	611,239,283,321円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	15,418,280円
一部解約元本額	391,318,144,765円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	12,877,158円
(注2) 期末における元本の内訳		4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	327,852,051円
DIAM国内債券パッシブ・ファンド	23,682,506,030円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	851,076円
MITO ラップ型ファンド(安定型)	83,095,931円	DIAMエマージング債券ファンド	9,450,010円
MITO ラップ型ファンド(中立型)	153,860,446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)	1,570,192,380円
MITO ラップ型ファンド(積極型)	119,506,919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)	1,607,821,940円
グローバル8資産ラップファンド(安定型)	687,384,295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)	1,368,128,834円
グローバル8資産ラップファンド(中立型)	133,587,952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)	982,094,880円
グローバル8資産ラップファンド(積極型)	23,730,893円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	1,551,466,786円
たわらノーロード 国内債券	15,834,399,947円	インカム重視マルチアセット運用ファンドI 2021-04 (適格機関投資家限定)	2,239,773,338円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	2,521,507,162円	マルチアセット・インカム戦略ファンド(内外株式債券型) 21-06	1,216,964,056円
たわらノーロード バランス (堅実型)	886,604,365円	インカム重視マルチアセット運用ファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	1,398,783,514円
たわらノーロード バランス (標準型)	1,507,222,733円	DIAM国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	8,901,727,961円
たわらノーロード バランス (積極型)	189,908,936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)	463,351,202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)	74,774,735円	投資のソムリエ・私費 (適格機関投資家限定)	2,068,944,514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)	1,322,091,006円	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略 (債券動的アロケーション)	379,250,637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)	1,225,069,364円	DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	276,996,912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)	327,185,576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)	3,244,504,751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)	22,506,242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)	3,251,938,545円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	17,145,320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)	3,223,328,742円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	13,611,444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)	2,685,868,185円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	90,707,115円	リスクコントロール世界8資産(バランスファンド) (FoF 用) (適格機関投資家専用)	51,300,165円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	5,060,786円	DIAMグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	165,802,939円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	414,272円	DIAMグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	98,585,137円
DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	14,277,651,015円	DIAM国際分散(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	27,788,034円
Oneグローバルバランス	8,911,633円	DIAM国際分散(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	97,096,530円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>1安定型	8,982,923,753円	DIAM国内重視(バランス)ファンド30VA (適格機関投資家限定)	34,365,367円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	12,483,500,015円	DIAM国内重視(バランス)ファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,318,042円
DIAMバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,178,995,984円	DIAM世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	25,972,068円
DIAM DCバランス30インデックスファンド	2,189,166,701円	DIAM世界バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	126,573,725円
DIAM DCバランス50インデックスファンド	2,329,357,704円	DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	3,587,635,563円
DIAM DCバランス70インデックスファンド	390,282,840円	DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,301,884,615円
マネックス資産設計ファンド(隔月分配型)	87,660,620円	DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,374,149,034円
マネックス資産設計ファンド(育成型)	3,040,981,442円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	113,717,345円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	11,707,847円	DIAMグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	190,263,848円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国10)	4,303,883,102円	DIAM アクア グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	2,187,734,764円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国20)	1,576,117,456円	DIAM世界アセット(バランス)ファンドVA (適格機関投資家向け)	180,904,488円
DIAM DC 8資産バランスファンド(新興国30)	340,130,669円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	10,231,460円
投資のソムリエ	86,470,476,048円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド2VA (適格機関投資家限定)	2,254,611,473円
クルーズコントロール	331,216,116円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド40VA (適格機関投資家限定)	49,059,889円
投資のソムリエ<DC年金>	5,215,918,149円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド25VA (適格機関投資家限定)	354,407,860円
DIAM 8資産バランスファンドN<DC年金>	4,612,393,810円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド3VA (適格機関投資家限定)	558,346,963円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	738,611,977円	DIAM世界アセット(バランス)ファンド4VA (適格機関投資家限定)	950,183,773円
DIAMコア資産設計ファンド(堅実型)	1,459,012円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	298,351,041円
DIAMコア資産設計ファンド(積極型)	4,619,684円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	101,646,068円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,424,858,123円	Oneコアポートフォリオ・プラス戦略ファンドI (適格機関投資家限定)	1,043,766,370円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	44,101,884,740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
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	35,684,515円	動的パッケージファンド<DC年金>	333,573,020円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	17,735,957円	コア資産形成ファンド	227,460,602円
リスク抑制世界8資産バランスファンド(DC)	53,072,038円	MHAM日本債券インデックスファンド(ファンドラップ)	42,573,117,520円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	176,635,602円	MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	46,106,741,798円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	2,233,253,084円	MHAM日本債券パッシブファンド [適格機関投資家限定]	14,232,766,340円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	8,448,159,838円	MHAM動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,641,455,600円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,330,495,531円	期末元本合計	429,840,166,151円

■損益の状況

当期 自2021年2月16日 至2022年2月14日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	2,936,984,033	円
	受取利息	2,933,836,057	
	その他の収益	4,106,122	
	支払利息	△958,146	
(B)	有価証券売買損益	△10,450,257,321	
	売買益	660,402,300	
	売買損	△11,110,659,621	
(C)	当期損益金(A+B)	△7,513,273,288	
(D)	前期繰越損益金	63,427,095,992	
(E)	解約差損益金	△119,188,902,023	
(F)	追加信託差損益金	186,738,089,679	
(G)	計(C+D+E+F)	123,463,010,360	
	次期繰越損益金(G)	123,463,010,360	

(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。