

運用報告書 (全体版)

第15期<決算日2023年5月8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、2023年5月8日に第15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
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
15期(2023年5月8日)	11,760	0	△1.1	375.03	△1.0	121.8	-	29,447

(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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。
なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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)	円	%		%	%	%
2022年5月9日	11,890	-	378.69	-	99.6	-
5月末	11,915	0.2	379.54	0.2	86.5	-
6月末	11,804	△0.7	376.08	△0.7	99.6	-
7月末	11,880	△0.1	378.55	△0.0	99.2	-
8月末	11,851	△0.3	377.67	△0.3	99.4	-
9月末	11,724	△1.4	373.60	△1.3	103.4	-
10月末	11,710	△1.5	373.25	△1.4	99.4	-
11月末	11,653	△2.0	371.33	△1.9	99.6	-
12月末	11,500	△3.3	366.60	△3.2	99.6	-
2023年1月末	11,468	△3.5	365.59	△3.5	99.4	-
2月末	11,592	△2.5	369.57	△2.4	99.6	-
3月末	11,752	△1.2	374.74	△1.0	99.8	-
4月末	11,780	△0.9	375.61	△0.8	100.1	-
(期末)						
2023年5月8日	11,760	△1.1	375.03	△1.0	121.8	-

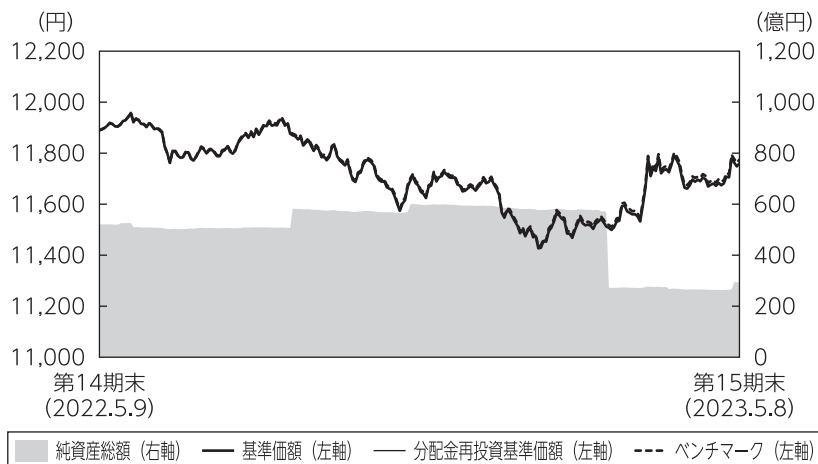
(注1) 騰落率は期首比です。

(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 (2022年5月10日から2023年5月8日まで)

基準価額等の推移



第15期首 : 11,890円
第15期末 : 11,760円
(既払分配金0円)
騰落率 : △1.1%
(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2022年12月は、各国の中央銀行の金融引き締めに伴う世界景気減速懸念や、米長期金利の上昇につれた動きなどが交錯し横ばいとなりましたが、日銀が長期金利の許容変動幅を拡大したことで利回りは大幅に上昇しました。その後、欧米の金融システム不安への警戒感などを背景に利回りが大きく低下する局面もありましたが、期末にかけて許容変動幅の上限付近で推移しました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

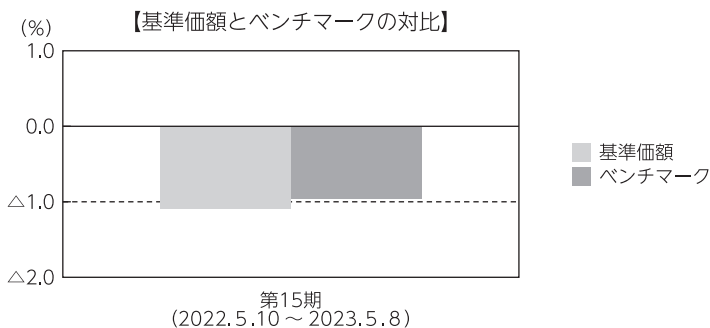
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●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1.0%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.1%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
	2022年5月10日 ～2023年5月8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	2,202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15期		項目の概要
	(2022年5月10日 ～2023年5月8日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	10円	0.088%	(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11,717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)	(6)	(0.055)	
(販売会社)	(1)	(0.011)	
(受託会社)	(3)	(0.022)	
(b) その他費用	0	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 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
(監査費用)	(0)	(0.001)	
(その他)	(0)	(0.000)	
合計	10	0.089	

(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。

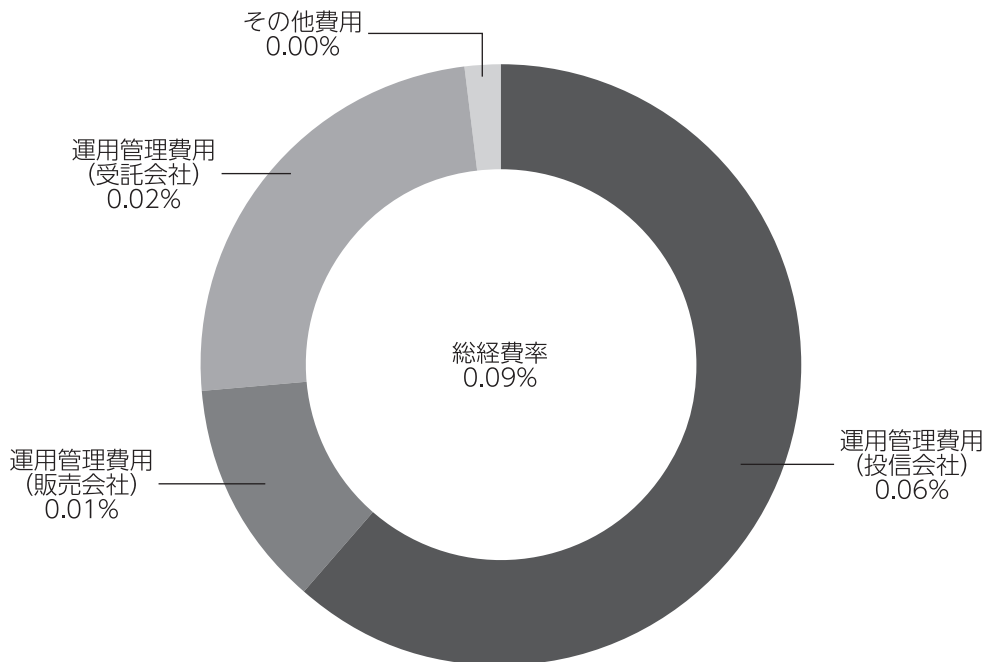
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.09%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（2022年5月10日から2023年5月8日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千口 12,104,386	千円 15,373,561	千口 29,586,493	千円 36,796,146

■利害関係人との取引状況等（2022年5月10日から2023年5月8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	$\frac{B}{A}$	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$
区 分						
金 銭 信 託	百万円 0.001547	百万円 0.001547	% 100.0	百万円 0.001547	百万円 0.001547	% 100.0

【国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当 期					
	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	$\frac{D}{C}$
区 分						
公 社 債	百万円 1,376,861	百万円 74,096	% 5.4	百万円 1,425,655	百万円 94,039	% 6.6
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

平均保有割合 8.3%

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

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行です。

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首 (前期末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	40,743,549	23,261,441	29,446,659

■投資信託財産の構成

2023年5月8日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	29,446,659	99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	83,104	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	29,529,763	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

(2023年5月8日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	29,529,763,534円
コール・ローン等	39,759,390
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	29,446,659,144
未 収 入 金	43,345,000
(B) 負 債	82,465,161
未 払 解 約 金	58,529,661
未 払 信 託 報 酬	23,666,975
そ の 他 未 払 費 用	268,525
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	29,447,298,373
元 本	25,039,919,234
次 期 繰 越 損 益 金	4,407,379,139
(D) 受 益 権 総 口 数	25,039,919,234口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11,760円

(注) 期首における元本額は43,809,441,668円、当期中における追加設定元本額は14,213,213,098円、同解約元本額は32,982,735,532円です。

■損益の状況

当期 自2022年5月10日 至2023年5月8日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△5,655円
受 取 利 息	5,881
支 払 利 息	△11,536
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△196,231,848
売 買 損 益	963,020,301
売 買 損 益	△1,159,252,149
(C) 信 託 報 酬 等	△55,577,831
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△251,815,334
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△180,389,253
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,839,583,726
(配 当 等 相 当 額)	(4,474,000,256)
(売 買 損 益 相 当 額)	(365,583,470)
(G) 合 計(D+E+F)	4,407,379,139
次 期 繰 越 損 益 金(G)	4,407,379,139
追 加 信 託 差 損 益 金	4,839,583,726
(配 当 等 相 当 額)	(4,476,384,889)
(売 買 損 益 相 当 額)	(363,198,837)
分 配 準 備 積 立 金	1,038,019,754
繰 越 損 益 金	△1,470,224,341

(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	127,874,082円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	4,476,384,889
(d) 分 配 準 備 積 立 金	910,145,672
(e) 当 期 分 配 対 象 額(a+b+c+d)	5,514,404,643
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	2,202.25
(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

■信託報酬を年率0.08% (税込み0.088%) に引き下げる変更を行いました。

(2023年2月10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20期 (決算日 2023年2月14日)

(計算期間 2022年2月15日～2023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20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				
16期 (2019年2月14日)	13,042	1.5	386.15	1.5	99.3	—	—	百万円 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
20期 (2023年2月14日)	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	—	—	554,514

(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フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。
なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、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)。

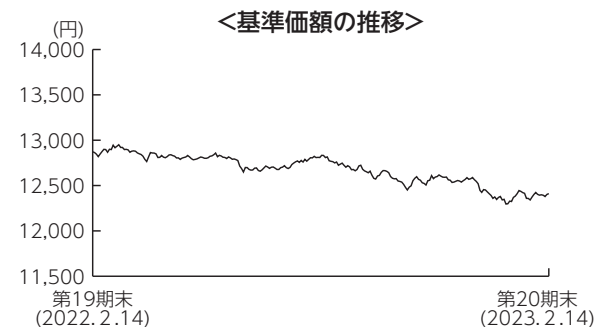
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2022年2月14日	円 12,872	% -	ポイント 381.31	% -	% 99.6	% -	% -
2月 末	12,900	0.2	382.13	0.2	99.8	-	-
3月 末	12,864	△0.1	381.04	△0.1	99.6	-	-
4月 末	12,832	△0.3	380.12	△0.3	99.2	-	-
5月 末	12,812	△0.5	379.54	△0.5	86.5	-	-
6月 末	12,694	△1.4	376.08	△1.4	99.6	-	-
7月 末	12,777	△0.7	378.55	△0.7	99.3	-	-
8月 末	12,747	△1.0	377.67	△1.0	99.4	-	-
9月 末	12,612	△2.0	373.60	△2.0	103.4	-	-
10月 末	12,598	△2.1	373.25	△2.1	99.4	-	-
11月 末	12,538	△2.6	371.33	△2.6	99.6	-	-
12月 末	12,374	△3.9	366.60	△3.9	99.6	-	-
2023年1月 末	12,341	△4.1	365.59	△4.1	99.4	-	-
(期末) 2023年2月14日	12,411	△3.6	367.66	△3.6	99.7	-	-

(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（2022年2月15日から2023年2月14日まで）

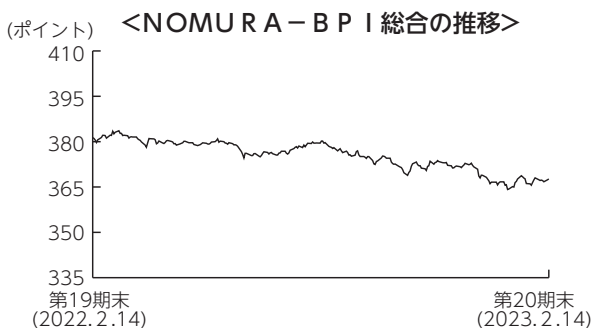


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,411円となり、前期末比で3.6%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。期初から2022年12月中旬にかけては、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢などを背景に基準価額は下落基調となりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行が長期金利の変動幅を従来の±0.25%から±0.5%に拡大したことなどから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。期初から2022年12月中旬にかけては、ウクライナ情勢を巡る不透明感などが意識された一方、高インフレ抑制に向けた欧米の主要中央銀行の金融引き締め姿勢が観測されたことなどを背景に、利回りは横ばいとなりました。2022年12月下旬から期末にかけては、日本銀行が長期金利の変動幅を従来の±0.25%から±0.5%に拡大したことなどから利回りは上昇しました。

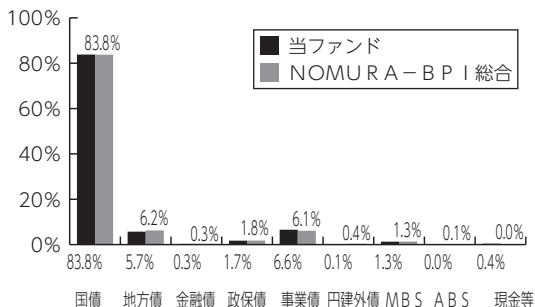
ポートフォリオについて

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。

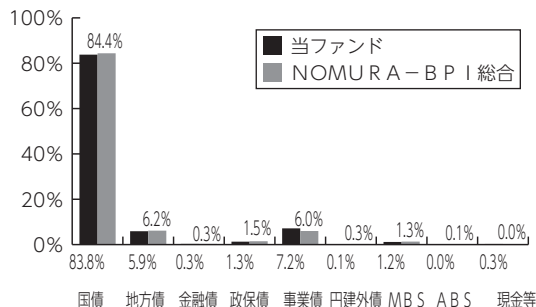
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

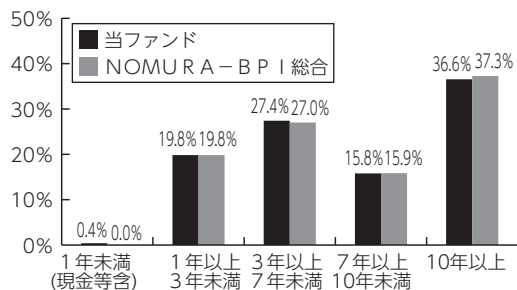


期末

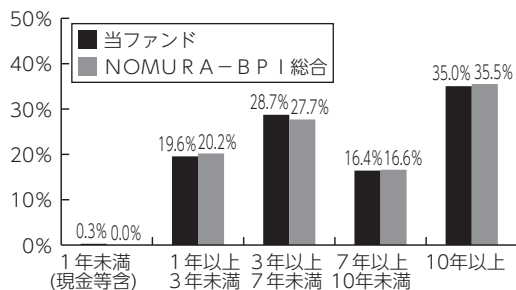


○残存年限別構成比

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3.6%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.0%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

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) その他費用 (その他)	0円 (0)	0.000% (0.000)	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 その他は、信託事務の処理に要する諸費用等
合 計	0	0.000	
期中の平均基準価額は12,671円です。			

(注1) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

■ 売買及び取引の状況 (2022年2月15日から2023年2月14日まで)

公社債

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国 債 証 券	1,481,029,349	1,452,519,943 (-)
	地 方 債 証 券	6,447,190	4,140,237 (-)
	特 殊 債 券	7,637,720	3,833,526 (369,528)
	社 債 券	3,368,168	4,648,915 (-)

(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 (2022年2月15日から2023年2月14日まで)

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 1,498,482	百万円 96,387	% 6.4	百万円 1,465,142	百万円 110,127	% 7.5
金 銭 信 託	6	6	100.0	6	6	100.0

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期における当ファンドにかかる利害関係人とは、みずほ証券、みずほ信託銀行です。

■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	469,265,000	464,530,535	83.8	—	52.3	20.8	10.7
地 方 債 証 券	32,839,330	32,767,927	5.9	4.9	3.9	1.4	0.5
特 殊 債 証 券	28,478,559	28,511,051	5.1	—	3.4	1.6	0.1
金 融 債 証 券	1,700,000	1,693,591	0.3	—	—	0.3	0.0
普 通 社 債 証 券	26,381,000	25,503,782	4.6	0.1	2.2	2.1	0.3
合 計	558,663,889	553,006,886	99.7	5.0	61.8	26.2	11.7

(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	
1 3 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,550,000	2,555,406	2024/03/20
6 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	50,000	51,088	2024/03/20
4 3 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,720,000	3,724,166	2024/04/01
4 3 6 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	6,100,000	6,107,320	2024/05/01
4 3 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,850,000	3,854,966	2024/06/01
1 4 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	6,990,000	7,007,824	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.6000	4,420,000	4,460,973	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	50,000	51,673	2024/06/20
7 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	40,000	41,230	2024/06/20
4 3 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,800,000	3,804,940	2024/07/01
4 3 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,300,000	1,301,703	2024/08/01
4 4 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,700,000	1,702,363	2024/09/01
1 4 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,810,000	2,818,064	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	4,610,000	4,652,688	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	460,000	476,008	2024/09/20
4 4 1 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,100,000	1,101,518	2024/10/01
4 4 2 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	1,500,000	1,502,175	2024/11/01
4 4 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	2,500,000	2,503,800	2024/12/01
1 4 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,930,000	2,939,463	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.5000	3,000,000	3,031,830	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	1,900,000	1,913,148	2024/12/20
7 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	380,000	394,557	2024/12/20
7 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	40,000	41,606	2024/12/20
4 4 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.0050	3,100,000	3,104,650	2025/01/01
1 4 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	3,100,000	3,110,354	2025/03/20

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	
3 3 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	5,430,000	5,482,236	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	180,000	188,136	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	70,000	72,871	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	40,000	41,724	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	5,900,000	5,920,060	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	5,980,000	6,043,089	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	250,000	261,400	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	50,000	52,397	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	90,000	94,526	2025/06/20
1 4 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,650,000	2,658,930	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.4000	3,040,000	3,073,926	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	400,000	421,080	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	140,000	147,742	2025/09/20
1 4 6 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	2,900,000	2,909,889	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.3000	4,420,000	4,460,222	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	70,000	74,222	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	170,000	179,769	2025/12/20
1 4 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	4,250,000	4,251,275	2026/03/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,520,000	4,534,644	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	590,000	628,385	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	120,000	128,548	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	120,000	128,178	2026/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	3,310,000	3,309,437	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,690,000	4,704,070	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	590,000	635,140	2026/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
89回 利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	10,731	2026/06/20
149回 利付国庫債券(5年)	0.0050	5,010,000	5,003,687	2026/09/20
344回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,570,000	5,581,975	2026/09/20
90回 利付国庫債券(20年)	2.2000	470,000	506,439	2026/09/20
91回 利付国庫債券(20年)	2.3000	110,000	118,922	2026/09/20
150回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,720,000	4,708,200	2026/12/20
345回 利付国庫債券(10年)	0.1000	6,080,000	6,086,992	2026/12/20
92回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,160,000	1,250,271	2026/12/20
151回 利付国庫債券(5年)	0.0050	4,200,000	4,182,864	2027/03/20
152回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,030,000	1,029,783	2027/03/20
346回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,690,000	4,689,015	2027/03/20
93回 利付国庫債券(20年)	2.0000	370,000	398,638	2027/03/20
94回 利付国庫債券(20年)	2.1000	670,000	724,584	2027/03/20
153回 利付国庫債券(5年)	0.0050	5,310,000	5,280,157	2027/06/20
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,130,000	5,122,202	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	601,535	2027/06/20
96回 利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	130,207	2027/06/20
154回 利付国庫債券(5年)	0.1000	4,300,000	4,287,229	2027/09/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,970,000	4,955,239	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	721,406	2027/09/20
98回 利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	174,156	2027/09/20
155回 利付国庫債券(5年)	0.3000	1,300,000	1,306,851	2027/12/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,250,000	4,231,640	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	818,947	2027/12/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,860,000	5,826,012	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	913,415	2028/03/20
101回 利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	255,433	2028/03/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,020,000	4,981,597	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	557,115	2028/06/20
103回 利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	177,432	2028/06/20
104回 利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	120,824	2028/06/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,260,000	4,220,083	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	705,126	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	553,640	2028/09/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,510,000	4,459,442	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	662,784	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	754,266	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,200,000	4,144,770	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	383,379	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	487,220	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,630,000	3,575,876	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	513,755	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	821,881	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,500,000	4,424,625	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	127,494	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,370,000	1,525,508	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,720,000	3,649,282	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	410,000	457,646	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	404,240	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	113,955	2030/02/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,750,000	3,676,200	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	597,214	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,070,000	1,198,303	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,952,629	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	618,336	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	516,746	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	670,000	727,084	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,200,000	5,060,744	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	640,000	708,665	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	626,965	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	236,836	2030/11/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,620,000	4,482,185	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,050,000	1,179,916	2030/12/20
124回 利付国庫債券(20年)	2.0000	600,000	669,696	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,360,000	5,189,230	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	680,634	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	570,368	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	599,713	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,899,698	2031/06/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	370,000	411,810	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,400,000	5,211,270	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	1,007,897	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	232,188	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,330,000	4,176,198	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	830,000	914,352	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,030,000	1,143,403	2031/12/20
366回 利付国庫債券(10年)	0.2000	2,780,000	2,707,469	2032/03/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	900,000	1,000,422	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,840,000	2,028,452	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	360,000	393,746	2032/03/20
367回 利付国庫債券(10年)	0.2000	3,000,000	2,959,290	2032/06/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,880,000	2,075,783	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,020,000	1,107,577	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	900,000	985,716	2032/06/20
368回 利付国庫債券(10年)	0.2000	3,750,000	3,742,950	2032/09/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,450,000	1,601,235	2032/09/20
369回 利付国庫債券(10年)	0.5000	1,400,000	1,400,000	2032/12/20
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,060,000	1,170,547	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,530,000	1,703,808	2032/12/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,730,000	1,893,692	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,450,000	1,573,409	2033/03/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	276,240	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,850,000	3,149,136	2033/06/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	263,446	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,340,000	2,584,810	2033/09/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	170,340	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	2,890,000	3,161,688	2033/12/20
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	400,720	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,060,000	2,230,732	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	309,501	2034/06/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)					
149回	利付国庫債券(20年)	1.5000	2,640,000	2,855,925	2034/06/20
160回	利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	286,020	2034/09/20
150回	利付国庫債券(20年)	1.4000	2,700,000	2,888,730	2034/09/20
17回	利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	318,978	2034/12/20
151回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,660,000	2,782,626	2034/12/20
18回	利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	468,468	2035/03/20
152回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,440,000	2,548,994	2035/03/20
19回	利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	328,101	2035/06/20
153回	利付国庫債券(20年)	1.3000	2,700,000	2,848,446	2035/06/20
20回	利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	394,864	2035/09/20
154回	利付国庫債券(20年)	1.2000	2,530,000	2,635,222	2035/09/20
21回	利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	363,732	2035/12/20
155回	利付国庫債券(20年)	1.0000	2,680,000	2,721,808	2035/12/20
22回	利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	347,594	2036/03/20
156回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,240,000	2,103,897	2036/03/20
23回	利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	419,706	2036/06/20
157回	利付国庫債券(20年)	0.2000	2,060,000	1,875,918	2036/06/20
24回	利付国庫債券(30年)	2.5000	470,000	564,159	2036/09/20
158回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,480,000	2,344,220	2036/09/20
25回	利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	388,063	2036/12/20
159回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,460,000	2,350,333	2036/12/20
26回	利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	737,211	2037/03/20
160回	利付国庫債券(20年)	0.7000	2,380,000	2,297,485	2037/03/20
161回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,410,000	2,287,644	2037/06/20
27回	利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	746,039	2037/09/20
162回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,170,000	2,051,604	2037/09/20
163回	利付国庫債券(20年)	0.6000	2,240,000	2,110,528	2037/12/20
28回	利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	926,902	2038/03/20
164回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,540,000	2,348,839	2038/03/20
165回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,130,000	1,960,941	2038/06/20
29回	利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,022,419	2038/09/20
166回	利付国庫債券(20年)	0.7000	1,680,000	1,588,423	2038/09/20
167回	利付国庫債券(20年)	0.5000	1,850,000	1,688,828	2038/12/20
30回	利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,032,829	2039/03/20
168回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,890,000	1,690,642	2039/03/20
169回	利付国庫債券(20年)	0.3000	2,060,000	1,804,209	2039/06/20
31回	利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	834,062	2039/09/20
170回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,700,000	1,482,111	2039/09/20
171回	利付国庫債券(20年)	0.3000	1,940,000	1,683,551	2039/12/20
32回	利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,137,451	2040/03/20
172回	利付国庫債券(20年)	0.4000	1,480,000	1,301,008	2040/03/20
173回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,220,000	1,942,722	2040/06/20
33回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,326,768	2040/09/20
174回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,170,000	1,890,330	2040/09/20
175回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,330,000	2,058,508	2040/12/20
34回	利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,385,568	2041/03/20
176回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,100,000	1,848,525	2041/03/20
177回	利付国庫債券(20年)	0.4000	2,050,000	1,764,968	2041/06/20
35回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,460,000	1,640,047	2041/09/20
178回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,400,000	2,099,904	2041/09/20

銘柄	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)					
179回	利付国庫債券(20年)	0.5000	2,150,000	1,875,466	2041/12/20
36回	利付国庫債券(30年)	2.0000	1,370,000	1,540,222	2042/03/20
180回	利付国庫債券(20年)	0.8000	1,740,000	1,602,035	2042/03/20
181回	利付国庫債券(20年)	0.9000	2,000,000	1,872,000	2042/06/20
37回	利付国庫債券(30年)	1.9000	1,660,000	1,837,055	2042/09/20
182回	利付国庫債券(20年)	1.1000	1,980,000	1,916,659	2042/09/20
183回	利付国庫債券(20年)	1.4000	800,000	814,544	2042/12/20
38回	利付国庫債券(30年)	1.8000	1,550,000	1,685,532	2043/03/20
39回	利付国庫債券(30年)	1.9000	1,300,000	1,435,876	2043/06/20
40回	利付国庫債券(30年)	1.8000	1,130,000	1,227,637	2043/09/20
41回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,270,000	1,356,639	2043/12/20
42回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,420,000	1,515,267	2044/03/20
43回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,350,000	1,440,207	2044/06/20
44回	利付国庫債券(30年)	1.7000	1,500,000	1,598,460	2044/09/20
45回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,570,000	1,612,437	2044/12/20
46回	利付国庫債券(30年)	1.5000	1,670,000	1,714,071	2045/03/20
47回	利付国庫債券(30年)	1.6000	1,560,000	1,629,732	2045/06/20
48回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,480,000	1,487,651	2045/09/20
49回	利付国庫債券(30年)	1.4000	1,490,000	1,495,170	2045/12/20
50回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,460,000	1,290,245	2046/03/20
51回	利付国庫債券(30年)	0.3000	1,390,000	1,087,508	2046/06/20
52回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,430,000	1,171,599	2046/09/20
53回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,460,000	1,221,713	2046/12/20
54回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,450,000	1,269,257	2047/03/20
55回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,120,000	977,580	2047/06/20
56回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,360,000	1,183,635	2047/09/20
57回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,430,000	1,242,083	2047/12/20
1回	利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	132,266	2048/03/20
58回	利付国庫債券(30年)	0.8000	1,540,000	1,333,747	2048/03/20
59回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,220,000	1,027,569	2048/06/20
60回	利付国庫債券(30年)	0.9000	1,300,000	1,147,250	2048/09/20
61回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,140,000	954,145	2048/12/20
2回	利付国庫債券(40年)	2.2000	630,000	730,497	2049/03/20
62回	利付国庫債券(30年)	0.5000	1,120,000	886,692	2049/03/20
63回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,410,000	1,081,399	2049/06/20
64回	利付国庫債券(30年)	0.4000	1,030,000	786,930	2049/09/20
65回	利付国庫債券(30年)	0.4000	950,000	724,356	2049/12/20
3回	利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	626,691	2050/03/20
66回	利付国庫債券(30年)	0.4000	990,000	751,974	2050/03/20
67回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,570,000	1,257,020	2050/06/20
68回	利付国庫債券(30年)	0.6000	1,470,000	1,175,103	2050/09/20
69回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,530,000	1,256,283	2050/12/20
4回	利付国庫債券(40年)	2.2000	720,000	836,971	2051/03/20
70回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,410,000	1,155,100	2051/03/20
71回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,400,000	1,145,368	2051/06/20
72回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,490,000	1,222,112	2051/09/20
73回	利付国庫債券(30年)	0.7000	1,490,000	1,220,518	2051/12/20
5回	利付国庫債券(40年)	2.0000	710,000	798,054	2052/03/20
74回	利付国庫債券(30年)	1.0000	1,520,000	1,349,668	2052/03/20
75回	利付国庫債券(30年)	1.3000	1,620,000	1,550,809	2052/06/20

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 6回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,520,000	1,488,840 2052/09/20
7 7回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	600,000	614,268 2052/12/20
6 回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	1,040,000	1,139,236 2053/03/20
7 回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	1,210,000	1,266,676 2054/03/20
8 回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	1,190,000	1,156,703 2055/03/20
9 回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,950,000	1,386,723 2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,970,000	1,649,421 2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,380,000	1,113,135 2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,440,000	1,034,971 2059/03/20
1 3回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	2,070,000	1,483,010 2060/03/20
1 4回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	2,050,000	1,566,979 2061/03/20
1 5回	利付国庫債券 (40年)	1.0000	1,540,000	1,280,818 2062/03/20
小	計	-	469,265,000	464,530,535 -
(地方債証券)		%	千円	千円
2 0 8回	神奈川県公募債	0.5510	300,000	302,097 2024/06/20
2 6年度4回	札幌市公募債 10年	0.5400	100,000	100,684 2024/06/20
1 回	兵庫県公募債 (12年)	1.1000	300,000	304,362 2024/06/26
2 6年度4回	神戸市公募債	0.6060	100,000	100,808 2024/07/18
2 6年度5回	埼玉県公募債	0.6110	400,000	403,328 2024/07/29
4 8 8回	名古屋市公募債 10年	0.5980	450,000	454,014 2024/09/20
2 6年度1回	相模原市公募債	0.5290	100,000	100,782 2024/09/20
2 6年度1回	長崎県公募債	0.5540	100,000	100,827 2024/09/30
2 6年度1回	静岡県公募債	0.5150	100,000	100,835 2024/11/25
2 6年度1回	京都府公募債	0.4760	350,000	352,779 2024/12/19
2 6年度1回	三重県公募債	0.4560	100,000	100,755 2024/12/25
2 6年度1回	浜松市公募債	0.3350	100,000	100,545 2025/01/23
1 4 2回	共同発行市場公募地方債	0.3450	500,000	502,825 2025/01/24
2 6年度3回	広島市公募債	0.4290	100,000	100,754 2025/02/25
2 6年度17回	兵庫県公募債	0.4600	200,000	201,636 2025/02/26
5回	東京都公募債 20年	2.1100	100,000	104,277 2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募債	0.5340	100,000	100,987 2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	403,400 2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	606,564 2025/05/23
2 7年度4回	千葉県公募債	0.6020	200,000	202,546 2025/07/25
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	505,765 2025/07/25
7 回	東京都公募債 20年	2.1600	100,000	105,371 2025/09/19
1 回	静岡県公募債 20年	2.1800	100,000	105,410 2025/09/19
1 5 0回	共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	303,279 2025/09/25
2 7年度15回	愛知県公募債 10年	0.4710	100,000	101,029 2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	101,038 2025/12/25
2 7年度9回	千葉県公募債	0.0950	100,000	99,922 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,827 2026/04/24
9回	東京都公募債 20年	2.4400	200,000	215,374 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,564 2026/06/25
1 6 0回	共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	498,370 2026/07/24
1 回	兵庫県公募債 15年	1.6600	200,000	210,406 2026/07/29
2 8年度6回	北海道公募債	0.0700	100,000	99,665 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募債	0.0450	100,000	99,589 2026/09/18
1 0回	東京都公募債 20年	2.3300	300,000	323,247 2026/09/18
4 回	京都市公募債 20年	2.5100	100,000	108,373 2026/09/18

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
4 1 3回	大阪府公募債 10年	0.0210	100,000	99,389 2026/10/28
1 9 0回	大阪府公募債 5年	0.0010	300,000	297,654 2026/12/25
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	499,510 2027/01/25
令和3年度3回	仙台市公募債 5年	0.0010	300,000	297,540 2027/01/28
2 8年度8回	福岡県公募債	0.2400	100,000	100,079 2027/02/24
1 6 9回	共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	499,270 2027/04/23
4 1 9回	大阪府公募債 10年	0.1960	100,000	99,775 2027/04/27
2 回	静岡県公募債 15年	1.4060	100,000	104,939 2027/06/25
5 回	兵庫県公募債 12年	0.6870	100,000	101,854 2027/07/07
1 7 3回	共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,836 2027/08/25
2 9年度4回	大阪府公募債	0.1500	200,000	198,728 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,340 2027/09/24
2 4年度1回	福岡県公募債 15年	1.3290	100,000	104,808 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,547 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,495 2028/02/25
2 9年度6回	広島市公募債	0.2300	300,000	298,347 2028/02/25
2 9年度13回	京都府公募債	0.2000	109,330	108,536 2028/03/16
5 回	兵庫県公募債 15年	1.3100	300,000	314,676 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募債	0.2200	110,000	109,105 2028/06/20
4 回	静岡県公募債 15年	1.3380	100,000	105,053 2028/06/23
3 0年度8回	北海道公募債	0.2490	400,000	396,400 2028/08/31
3 0年度7回	神戸市公募債 30年	0.2540	300,000	297,438 2028/09/20
第 9 1 回	川崎市公募債	0.1850	200,000	197,536 2028/09/20
7 回	静岡県公募債 20年	2.3200	300,000	331,548 2028/09/21
3 0年度3回	広島県公募債	0.2540	100,000	99,144 2028/09/25
3 0年度3回	堺市公募債	0.1950	100,000	98,576 2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募債	0.1350	200,000	196,578 2028/12/20
2 0 回 2号	福岡県公募債	2.0500	100,000	109,208 2028/12/20
6 回	大阪府公募債 20年	2.2100	200,000	220,240 2028/12/20
1 7 回	横浜市公募債 20年	2.0700	100,000	109,322 2028/12/20
6 回	北九州市公募債 20年	2.0300	100,000	109,031 2028/12/20
3 0年度6回	福岡県公募債	0.2000	200,000	197,318 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,714 2028/12/25
3 0年度14回	北海道公募債	0.1950	400,000	394,280 2028/12/28
1 8 回	東京都公募債 20年	2.2200	100,000	110,361 2029/03/19
3 0年度19回	愛知県公募債	0.1150	200,000	195,720 2029/03/28
3 0年度3回	岡山県公募債 10年	0.1500	200,000	196,134 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	293,058 2029/05/25
6 回	川崎市公募債 20年	2.2100	200,000	221,006 2029/05/25
令和元年度1回	福岡県公募債	0.0290	200,000	194,264 2029/06/21
9 回	兵庫県公募債 15年	1.0200	100,000	103,236 2029/07/13
1 1 回	神奈川県公募債 20年	2.0800	100,000	109,884 2029/07/20
1 9 6回	共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	486,175 2029/07/25
7 9 6回	東京都公募債	0.0400	200,000	193,754 2029/09/20
令和元年度 9回	静岡県公募債	0.0500	200,000	193,944 2029/09/20
令和元年度3回	横浜市公募債	0.0500	400,000	387,512 2029/10/16
令和元年度16回	兵庫県公募債	0.0500	200,000	193,738 2029/10/23
2 1 回	東京都公募債 20年	2.1900	100,000	110,892 2029/12/20
1 7 回	さいたま市公募債	0.1100	200,000	194,190 2029/12/25
令和元年度第8回	埼玉県公募債	0.1350	200,000	194,434 2030/01/30

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	
21年度2回 福岡県公債券(20年)	2.2300	100,000	111,371	2030/02/22
2030回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	96,840	2030/02/25
802回 東京都公債券公債	0.1300	400,000	388,276	2030/03/19
511回 名古屋市長公債券 10年	0.0750	200,000	193,306	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公債券公債	0.1350	400,000	388,048	2030/04/12
令和2年 2回 大阪市公債券公債	0.1310	300,000	290,415	2030/05/22
9回 埼玉県公債券公債 20年	2.1500	100,000	111,028	2030/05/24
8回 静岡県公債券公債 15年	0.8280	200,000	203,408	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公債券公債	0.1350	100,000	96,268	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公債券公債	0.1350	100,000	96,142	2030/10/23
362号 宮城県公債券 10年	0.1350	250,000	240,335	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公債券公債	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公債券公債	0.1350	200,000	192,022	2030/11/27
22年度14回 愛知県公債券公債	2.0870	300,000	331,965	2030/12/13
9回 京都市公債券公債 20年	2.1430	200,000	222,170	2030/12/17
813回 東京都公債券公債	0.1790	300,000	288,789	2030/12/20
16回 神奈川県公債券公債 20年	2.0900	300,000	332,343	2031/01/24
464回 大阪府公債券公債 10年	0.0720	200,000	190,528	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公債券公債	0.1450	100,000	95,702	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公債券公債	0.2140	200,000	192,564	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公債券公債	0.2140	200,000	192,474	2031/03/19
251回 神奈川県公債券公債 10年	0.1990	200,000	192,242	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公債券公債	0.1400	200,000	191,338	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公債券公債 10年	0.1900	200,000	192,040	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公債券公債	0.1750	100,000	95,856	2031/04/25
467回 大阪府公債券公債 10年	0.1640	200,000	191,388	2031/04/28
469回 大阪府公債券公債 10年	0.1280	200,000	190,590	2031/06/27
11回 北九州市公債券公債 20年	2.0190	300,000	331,587	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公債券公債	0.1050	200,000	189,864	2031/09/25
472回 大阪府公債券公債 10年	0.1000	200,000	189,618	2031/09/29
474回 大阪府公債券公債 10年	0.1190	300,000	284,616	2031/11/28
19回 神奈川県公債券公債 20年	1.8180	100,000	109,234	2032/01/30
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	479,015	2032/02/25
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	476,525	2032/03/25
258回 神奈川県公債券公債 10年	0.2900	300,000	286,713	2032/06/18
24年度2回 福岡県公債券公債(20年)	1.6350	300,000	323,976	2032/08/16
10回 大阪府公債券公債 20年	1.7200	200,000	218,262	2032/09/24
24年度12回 神戸市長公債券公債	1.7110	200,000	216,916	2032/12/17
14回 千葉県公債券公債 20年	1.1370	100,000	102,557	2033/04/15
13回 埼玉県公債券公債 20年	1.5990	100,000	107,254	2033/05/20
1回 東京都公債券公債 30年	2.2100	200,000	226,936	2033/06/20
14回 埼玉県公債券公債 20年	1.5460	300,000	320,910	2034/05/08
26年度4回 愛知県公債券公債 20年	1.5420	200,000	213,880	2034/05/15
29回 横浜市公債券公債 20年	1.5280	100,000	106,759	2034/05/26
16回 名古屋市公債券公債 20年	1.5200	100,000	106,642	2034/06/09
5回 群馬県公債券公債 20年	1.5290	100,000	106,745	2034/06/16
17回 北九州市公債券公債 20年	1.5290	100,000	106,477	2034/06/20
31回 東京都公債券公債 20年	1.2380	200,000	206,890	2034/09/20
15回 埼玉県公債券公債 20年	1.1660	100,000	102,444	2035/02/16
2回 横浜市公債券公債 30年	2.4900	100,000	117,335	2035/03/20

銘柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(地方債証券)	%	千円	千円	
18回 千葉県公債券公債 20年	1.1380	100,000	102,000	2035/04/13
17回 名古屋市公債券公債 20年	1.2030	100,000	102,676	2035/05/28
13回 大阪府公債券公債 20年	1.2030	100,000	102,213	2035/09/28
14回 大阪府公債券公債 20年	0.5400	100,000	93,260	2036/09/29
21回 千葉県公債券公債 20年	0.4240	100,000	91,920	2036/10/15
3回 神奈川県公債券公債 30年	2.6200	100,000	119,692	2037/03/19
29年度2回 広島市長公債券公債	0.6160	200,000	186,502	2037/08/18
29年度5回 札幌市長公債券公債 20年	0.5970	300,000	278,595	2037/09/18
30年度2回 仙台市長公債券公債 20年	0.7290	100,000	93,237	2038/10/18
30年度7回 福岡市長公債券公債	0.7010	200,000	185,616	2038/10/19
2019年度5回 福岡市長公債券公債 20年	0.2860	100,000	85,565	2039/07/29
2回 兵庫県公債券公債 30年	2.3600	100,000	115,928	2040/03/19
22年度8回 福岡市長公債券公債	2.2800	100,000	114,581	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公債券公債	0.4640	100,000	86,483	2040/09/21
23年度7回 札幌市長公債券公債 30年	2.0970	100,000	111,561	2041/09/20
5回 川崎市長公債券公債 30年	2.0970	100,000	111,758	2042/03/20
24年度12回 愛知県公債券公債 30年	2.1200	100,000	112,081	2042/09/19
14回 東京都公債券公債 30年	2.0500	100,000	110,745	2043/06/19
27年度8回 愛知県公債券公債 30年	1.5790	150,000	152,100	2045/06/20
27年度 2回 広島県公債券公債 30年	0.7110	100,000	84,226	2046/03/22
6回 埼玉県公債券公債 30年	0.9570	200,000	176,576	2046/12/20
令和元年度7回 愛知県公債券公債	0.3690	300,000	219,747	2049/06/18
令和元年3回 福岡市長公債券公債 30年	0.4320	200,000	149,236	2049/06/18
令和元年度1回 鳥取県公債券公債	0.2900	200,000	179,728	2049/09/17
5回 京都市公債券公債 30年定時償還	0.2900	200,000	178,096	2049/09/17
12回 埼玉県公債券公債 30年	0.4740	300,000	225,567	2049/12/20
令和3年度6回 神戸市長公債券公債 30年	0.7130	200,000	158,462	2051/06/20
小 計	-	32,839,330	32,767,927	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
218回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6600	100,000	100,856	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	201,760	2024/06/28
64回 政保地方公共団体金融機構債券	0.5440	300,000	302,556	2024/09/13
139回 日本高速道路保有・債務返済機構	0.5000	100,000	100,695	2024/09/20
71回 鉄道建設運輸施設債	0.5250	100,000	100,810	2024/11/27
21回 政保中部国際空港債	0.4500	100,000	100,893	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	504,500	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,790	2025/04/25
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	417,968	2025/06/20
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	101,197	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	101,001	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,780	2025/09/19
85回 中国日本高速道路債	0.0700	300,000	298,959	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	101,007	2025/11/20
23回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	105,523	2025/12/19
61回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	104,787	2025/12/19
F538回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	498,430	2025/12/25
40回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,825	2026/03/13
33回 政保日本政策投資銀行債	0.0200	300,000	299,490	2026/03/16
87回 中国日本高速道路債	0.0600	400,000	397,488	2026/03/18
11回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	107,368	2026/03/20

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	
271回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	299,439	2026/03/31
187回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,731	2026/04/20
83回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	399,108	2026/04/28
80回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	104,878	2026/09/18
321回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165	2026/09/18
325回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,165	2026/09/18
79回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	314,238	2026/11/06
91回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,753	2026/12/14
300回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	99,783	2027/01/29
F147回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	208,092	2027/03/19
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	298,890	2027/04/13
309回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	797,992	2027/04/30
96回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,570	2027/05/28
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	197,442	2027/06/18
98回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,715	2027/07/16
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,405	2027/11/19
103回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	99,450	2027/12/17
124回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	104,912	2027/12/20
77回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	294,948	2027/12/20
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	297,546	2028/02/18
113回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	99,189	2028/10/16
9回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	207,186	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	217,836	2028/12/20
93回 都市再生債券	1.1020	100,000	103,257	2029/06/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	331,575	2029/06/28
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	332,127	2029/08/28
12回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,952	2029/09/20
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	219,880	2029/09/20
97回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	110,813	2029/12/28
78回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	101,051	2030/05/28
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,616	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	217,810	2030/10/29
121回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	545,880	2030/10/31
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	110,778	2031/01/28
90回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	191,122	2031/05/30
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	386,540	2031/06/13
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	109,804	2031/09/19
153回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	110,088	2031/12/26
19回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	218,006	2031/12/26
156回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	381,724	2032/04/14
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	108,206	2032/07/28
115回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	109,974	2032/09/14
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	109,201	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	217,854	2032/09/28
188回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	105,581	2033/04/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	592,695	2033/12/20
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	106,286	2034/03/17
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	106,670	2034/04/28
39回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	524,325	2034/09/28
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	300,312	2035/01/26

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	
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	308,823	2035/02/28
159回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	101,042	2035/05/18
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	102,964	2035/06/20
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	206,116	2035/06/28
250回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	104,095	2035/06/29
第262回 政保道路債	1.1090	500,000	509,045	2035/11/30
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	179,758	2036/06/20
286回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,470	2036/08/29
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,733	2037/04/28
319回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	188,402	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	237,358	2037/09/18
2回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2700	29,481	29,564	2037/11/10
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,927	2038/01/29
233回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	91,085	2038/04/20
F174回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	327,294	2038/05/28
210回 高速道路機構債	0.6770	100,000	91,875	2038/09/17
50回 高速道路機構債	0.5000	300,000	265,596	2039/03/18
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	250,305	2039/09/28
125回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	425,180	2040/04/20
288回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	303,009	2040/07/27
116回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	107,738	2040/08/31
40回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	44,416	45,090	2041/03/10
43回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2800	10,028	10,056	2041/06/10
44回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.3000	48,395	48,533	2041/07/10
51回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	2.2100	28,716	28,785	2042/02/10
4回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.2900	9,766	9,791	2042/08/10
148回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	267,802	2043/12/18
27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	16,224	16,963	2044/08/10
29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	101,085	106,357	2044/10/10
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	153,752	160,563	2045/05/10
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	99,702	2045/06/20
38回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	21,513	22,364	2045/07/10
1回 高速道路機構債	2.9900	300,000	374,067	2045/09/20
260回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	197,772	2045/10/31
169回 高速道路機構債	1.2000	100,000	91,630	2045/12/20
268回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	96,646	2046/01/31
49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	18,489	19,253	2046/06/10
52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	21,674	22,467	2046/09/10
53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	22,728	23,550	2046/10/10
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	180,889	2047/03/20
60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	27,955	28,894	2047/05/10
64回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	68,544	70,293	2047/09/10
36回 高速道路機構債	2.8400	300,000	367,482	2048/03/20
76回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	31,310	32,207	2048/09/10
82回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	37,252	37,929	2049/03/10
84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	37,866	38,564	2049/05/10
86回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	41,647	42,347	2049/07/10
90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	43,218	43,641	2049/11/10
398回 政保道路債	0.4220	300,000	225,969	2049/12/28
93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	48,571	48,186	2050/02/10

銘柄	当 利率	期 末		
		額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	0.5170	300,000	222,036	2050/04/28
96回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	54,967	54,920	2050/05/10
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	77,436	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	155,190	2050/06/20
99回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	56,873	57,164	2050/08/10
418回 高速道路機構債	0.6300	200,000	157,672	2051/08/31
420回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	159,878	2051/10/31
114回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	213,474	206,557	2051/11/10
117回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,432	70,469	2052/02/10
118回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	72,120	70,253	2052/03/10
119回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	72,281	70,341	2052/04/10
126回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	225,873	218,581	2052/11/10
128回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	226,248	218,802	2053/01/10
130回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	153,450	148,271	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	230,445	222,139	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	229,833	221,568	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	397,340	384,211	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	79,465	76,755	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	81,727	78,041	2054/03/10
164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	262,260	248,724	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	102,090	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	350,088	333,234	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	269,238	256,449	2055/09/10
164回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	276,114	263,056	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	838,701	795,759	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	149,016	2061/02/28
小 計	-	28,478,559	28,511,051	-
(金融債券)	%	千円	千円	
い第828号 利付商工債	0.1400	100,000	100,075	2024/05/27
い第843号 利付商工債	0.1200	100,000	99,912	2025/08/27
369回 利附信金中金債(5年)	0.0600	400,000	399,144	2025/08/27
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	298,761	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	298,617	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	298,308	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	198,774	2026/08/27
小 計	-	1,700,000	1,693,591	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
49回 住友化学社債	0.9440	100,000	100,870	2024/04/25
2回 BPCE SA円債社債(ソシヤルボンド)	0.3670	100,000	99,582	2024/06/28
428回 九州電力社債	0.9360	100,000	100,989	2024/07/25
29回 三菱重工業社債	0.6620	100,000	100,732	2024/09/03
25回 首都高速道路社債	0.0300	100,000	99,874	2024/09/20
72回 三菱地所社債	2.2800	100,000	103,370	2024/09/20
16回 成田国際空港社債	0.5700	100,000	100,756	2024/10/28
10回 三井住友信託銀行社債	0.5850	200,000	201,138	2024/10/28
4回 住友三井オートサービス社債	0.1500	100,000	99,729	2024/10/31
6回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債	0.8650	200,000	200,536	2024/11/28
25回 西日本高速道路社債	0.5240	200,000	201,488	2024/12/20
11回 セブン銀行社債	0.5360	200,000	201,280	2024/12/20
321回 北海道電力社債	0.8860	261,000	264,048	2024/12/25

銘柄	当 利率	期 末		
		額面金額	評価額	償還年月日
(普通社債券)	%	千円	千円	
10回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,834	2025/02/28
26回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	101,001	2025/05/21
29回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,306	2025/06/11
12回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	101,249	2025/06/20
39回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	312,741	2025/06/20
497回 関西電力社債	1.0020	100,000	101,459	2025/06/20
13回 電源開発社債	2.0400	200,000	208,004	2025/06/20
12回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,624	2025/07/09
42回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	209,534	2025/09/19
27回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,188	2025/12/19
14回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,478	2025/12/19
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,834	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	199,008	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,497	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,414	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	296,892	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	197,168	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	100,227	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,694	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	99,250	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	298,038	2026/06/05
11回 クレディ・アグリコル・エス・エー円債社債(2016)	0.4000	100,000	98,180	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,437	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	297,714	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,476	2026/06/19
61回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	496,025	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,771	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	128,152	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	102,035	2026/06/25
90回 中日本高速道路債券	0.0500	200,000	198,360	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	296,802	2026/07/27
3回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	295,548	2026/09/04
91回 中日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/17
62回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	495,115	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	100,183	2026/09/18
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,106	2026/10/16
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,035	2026/10/23
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	299,208	2026/12/14
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	199,682	2027/02/16
12回 りそな銀行劣後社債	2.4640	100,000	106,194	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	107,729	2027/04/20
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	297,735	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	297,435	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,384	2027/05/07
3回 東レ社債	0.3750	300,000	298,701	2027/07/16
30回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	108,120	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,858	2027/09/24
25回 フランス郵政公社銀行(BF CMI)円債社債(2017)	0.5100	300,000	292,086	2027/10/12
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,105	2027/10/22
525回 東北電力社債	0.2200	200,000	195,324	2027/10/25

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 4 回 電源開発社債	0.3800	100,000	98,587	2027/11/19
1 7 回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	297,567	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	297,483	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,612	2028/06/02
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,710	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	98,283	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	109,267	2029/03/21
2 3 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	97,601	2029/04/12
1 4 回 プリヂストーン社債	0.3750	300,000	295,032	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,734	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	385,108	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	389,616	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	190,862	2029/07/25
7 回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	289,911	2029/10/11
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	192,826	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	109,292	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	194,078	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	96,955	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	96,435	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	192,592	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	382,644	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	95,100	2030/06/25
3 回 ガイドグループHD社債	0.5100	300,000	291,630	2030/07/16
3 1 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	192,492	2030/08/09
6 回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	192,698	2030/09/17
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	389,456	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,766	2030/09/27
1 7 回 デイセル社債	0.5000	300,000	291,198	2030/12/13
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	287,298	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	218,502	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	191,796	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	181,328	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	94,712	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	279,612	2031/04/25
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	286,257	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	279,180	2031/09/19

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
5 3 6 回 東北電力社債	0.2900	300,000	277,605	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	470,495	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	186,218	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	188,732	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	282,738	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	189,720	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	295,416	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	94,311	2036/06/02
2 3 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.8500	200,000	185,404	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	180,940	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	89,875	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,153	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	92,653	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	176,628	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	88,572	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	184,228	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	89,806	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	87,393	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,241	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	169,598	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	81,752	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	83,714	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,538	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,014	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	81,836	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	94,254	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	87,052	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	77,848	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	153,760	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	206,034	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	75,020	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	74,006	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	74,560	2060/12/17
小 計	-	26,381,000	25,503,782	-
合 計	-	558,663,889	553,006,886	-

■投資信託財産の構成

2023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	553,006,886	99.7
投資信託財産総額	1,668,486	0.3
	554,675,373	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

(2023年2月14日)現在

項 目	当 期 末		
(A) 資 産	554,675,373,305円		
コ ー ー ン 等	617,814,346		
公 社 債(評価額)	553,006,886,952		
未 収 利 息	696,325,613		
前 払 金	354,346,394		
(B) 負 債	160,658,000		
未 払 解 約 金	160,658,000		
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	554,514,715,305		
元 本	446,785,885,792		
次 期 繰 越 損 益	107,728,829,513		
(D) 受 益 権 総 口 数	446,785,885,792口		
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,411円		
(注1) 期首元本額	429,840,166,151円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	1,242,098,929円
追加設定元本額	1,193,021,056,559円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	33,649,224円
一部解約元本額	1,176,075,336,918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)	1,918,361,466円
(注2) 期末における元本の内訳		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)	1,966,575,557円
D I A M国内債券バッシブ・ファンド	25,377,106,533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)	1,522,865,115円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	57,586,017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)	1,201,586,454円
M I T O ラップ型ファンド (中立型)	103,700,225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)	1,897,755,847円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	66,758,277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)	4,911,402,998円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	754,422,213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・シグナルヘッジ付き) 2021-06 (適格機関投資家限定)	1,872,779,890円
グローバル8資産ラップファンド (中立型)	180,875,125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)	1,712,159,046円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	51,325,733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・シグナルヘッジ付き) 2022-05 (適格機関投資家限定)	1,920,698,394円
たわらノーロード 国内債券	17,498,683,959円	D I A M国内債券バッシブファンド (適格機関投資家向け)	9,123,052,184円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	3,806,010,006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)	2,647,924,770円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,251,955,017円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	2,161,052,848円
たわらノーロード バランス (標準型)	2,226,167,410円	A M O n e マルチアセット・インカム戦略ファンド (シグナルヘッジ付き) (適格機関投資家限定)	572,870,714円
たわらノーロード バランス (積極型)	289,053,050円	D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	262,362,220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)	128,198,441円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I (適格機関投資家限定)	5,397,074,453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)	1,726,237,986円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I (適格機関投資家限定)	5,408,411,752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)	1,815,055,749円	One収益追求型マルチアセット戦略ファンドI V (適格機関投資家限定)	5,364,968,629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)	501,958,943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)	3,271,484,674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)	2,448,954円	リスクコントロール世界8資産(バランスファンド (F O F s用) (適格機関投資家専用)	41,605,092円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	27,062,997円	A M O n eコアポートフォリオ・プラス戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,052,664,270円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	18,479,351円	しあわせの一步・私募 (適格機関投資家限定)	74,795,895円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	155,346,253円	D I A Mグローバル・バランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	146,999,752円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	4,911,502円	D I A Mグローバル・バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	96,492,643円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	62,284円	D I A M国際分散(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	19,332,957円
D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,797,948,481円	D I A M国際分散(バランスファンド)50VA (適格機関投資家限定)	72,848,637円
Oneグローバルバランス	26,722,380円	D I A M国内重視(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	27,734,823円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	9,748,438,004円	D I A M国内重視(バランスファンド)50VA (適格機関投資家限定)	327,700円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	13,721,614,185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)	23,873,600円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	5,826,988,427円	D I A M世界(バランスファンド)25VA (適格機関投資家限定)	107,055,264円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	2,358,619,228円	D I A M世界(バランスファンド)37.5VA (適格機関投資家限定)	3,016,439,998円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,427,324,525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)	2,100,621,220円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	411,372,305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)	4,138,221,952円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	97,387,528円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA (適格機関投資家限定)	64,082,448円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	3,564,928,239円	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2 (適格機関投資家限定)	143,932,786円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	13,441,521円	D I A M 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)	1,815,004,927円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	4,632,204,263円	D I A M アセット(バランスファンド)VA (適格機関投資家向け)	133,615,087円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	1,967,220,079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)	532,578円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	377,779,353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)	1,989,249,669円
投資のソムリエ	80,243,319,715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)	43,566,296円
グループコントロール	973,146,033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)	293,969,678円
投資のソムリエ<DC年金>	5,911,038,890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)	445,411,075円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	5,610,654,070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)	771,111,794円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	1,317,826,922円	D I A M世界(バランスファンド)25VA (適格機関投資家限定)	250,595,165円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	6,499,330,383円	D I A M国内(バランスファンド)30VA (適格機関投資家限定)	95,877,683円
リスク抑制世界8資産(バランスファンド)	27,485,903,692円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	905,339,373円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	470,764,235円	動的パッケージファンド<DC年金>	366,377,124円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	236,380,237円	コア資産形成ファンド	245,142,281円
リスク抑制世界8資産(バランスファンド) (DC)	45,753,552円	M H A M日本債券インデックスファンド (ファンドラップ)	46,520,562,169円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	1,970,386,655円	M H A M動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	47,766,276,797円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	3,435,483,967円	M H A M日本債券バッシブファンド [適格機関投資家限定]	11,297,006,099円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,471,865,998円	M H A M動的パッケージ4資産ファンド [適格機関投資家限定]	1,689,593,873円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	5,499,704,588円	期末元本合計	446,785,885,792円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	663,974,989円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	253,415,299円		
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	155,546,201円		

■損益の状況

当期 自2022年2月15日 至2023年2月14日

項	目	当	期
(A)	配当等収益	3,860,461,249	円
	受取利息	3,866,858,522	
	支払利息	△6,397,273	
(B)	有価証券売買損益	△31,051,006,500	
	売却益	919,953,577	
	売却損	△31,970,960,077	
(C)	その他費用	△20	
(D)	当期損益金(A+B+C)	△27,190,545,271	
(E)	前期繰越損益金	123,463,010,360	
(F)	解約差損益金	△306,962,982,017	
(G)	追加信託差損益金	318,419,346,441	
(H)	計(D+E+F+G)	107,728,829,513	
	次期繰越損益金(H)	107,728,829,513	

(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) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

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

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■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)