

運用報告書 (全体版)

第23期<決算日2026年2月16日>

DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>

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	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	DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	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	公社債 (債券先物取引等を含みます。) の実質組入比率は、原則として高位を保ちます。公社債の実質組入比率の調整には、債券先物取引等を活用します。	
組入制限	DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>	株式への実質投資割合は、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。
	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ません。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。
分配方針	決算日 (原則として2月14日。休業日の場合は翌営業日。) に経費控除後の利子、配当収入および売買益 (評価益を含みます。) 等より、基準価額水準、市況動向等を勘案して、分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合は分配を行わないことがあります。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>」は、2026年2月16日に第23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

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

DIAM国内債券インデックスファンド<DC年金>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率				
19期(2022年2月14日)	円 12,227	円 0	% △1.4	ポイント 381.31	% △1.1	% 99.6	% -	% -	百万円 18,379
20期(2023年2月14日)	11,756	0	△3.9	367.66	△3.6	99.7	-	-	17,125
21期(2024年2月14日)	11,656	0	△0.9	365.56	△0.6	99.6	-	-	16,397
22期(2025年2月14日)	11,219	0	△3.7	352.94	△3.5	99.1	-	-	14,884
23期(2026年2月16日)	10,572	0	△5.8	333.49	△5.5	99.5	-	-	13,320

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

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注3) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村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 率 比	新株予約権 付社債 (転換社債) 比 率	債 券 先 物 率 比
	円	騰 落 率	(ベンチマーク) ポイント	騰 落 率			
(期 首) 2025年 2月 14日	11,219	% -	ポイント 352.94	% -	% 99.1	% -	% -
2 月 末	11,206	△0.1	352.61	△0.1	99.6	-	-
3 月 末	11,092	△1.1	349.16	△1.1	100.3	-	-
4 月 末	11,155	△0.6	351.19	△0.5	101.4	-	-
5 月 末	11,009	△1.9	346.68	△1.8	99.6	-	-
6 月 末	11,066	△1.4	348.51	△1.3	99.7	-	-
7 月 末	10,950	△2.4	344.96	△2.3	99.7	-	-
8 月 末	10,914	△2.7	343.89	△2.6	99.6	-	-
9 月 末	10,903	△2.8	343.62	△2.6	99.8	-	-
10 月 末	10,919	△2.7	344.19	△2.5	99.9	-	-
11 月 末	10,793	△3.8	340.28	△3.6	99.5	-	-
12 月 末	10,657	△5.0	336.03	△4.8	99.8	-	-
2026年 1 月 末	10,520	△6.2	331.79	△6.0	99.6	-	-
(期 末) 2026年 2月 16日	10,572	△5.8	333.49	△5.5	99.5	-	-

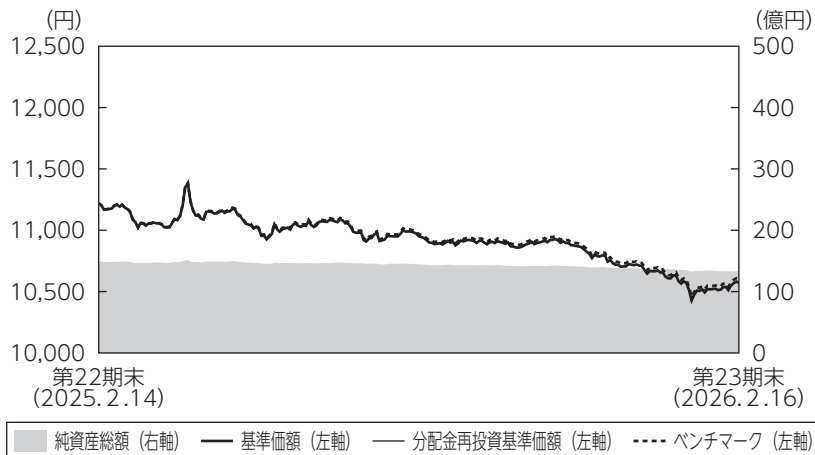
(注1) 騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

■当期の運用経過（2025年2月15日から2026年2月16日まで）

基準価額等の推移



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

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初から2025年4月にかけては、米トランプ大統領の関税政策などを巡り、市場が混乱する中で、基準価額は大きく変動しました。5月から11月にかけては、米国債格下げを受けた米金利上昇、軟調な入札結果、参院選後の財政悪化を懸念する見方などを受けて、基準価額は下落しました。12月から期末にかけては、日銀の利上げ観測、財政悪化懸念の高まり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2025年4月にかけては、米トランプ大統領の関税政策などを巡り、市場が混乱する中で、利回りは乱高下しました。5月から11月にかけては、米国債格下げを受けた米金利上昇、軟調な入札結果、参院選後の財政悪化を懸念する見方などを受けて、利回りは上昇しました。12月から期末にかけては、日銀の利上げ観測、財政悪化懸念の高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

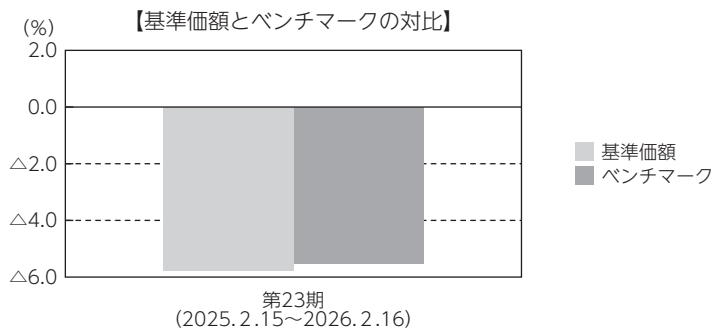
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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

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5.5%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比で $\Delta 0.3\%$ と、信託報酬の影響を除くとベンチマークに概ね連動した投資成果となりました。



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税引前）込みです。

分配金

収益分配金につきましては基準価額水準・市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。なお、収益分配金に充てなかった利益は信託財産内に留保し、運用の基本方針に基づいて運用いたします。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項目	当期
	2025年2月15日 ～2026年2月16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	2,126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23期		項目の概要
	(2025年2月15日 ～2026年2月16日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	30円	0.276%	(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10,916円です。
(投信会社)	(13)	(0.122)	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)	(13)	(0.122)	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)	(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	0	0.002	(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)	(0)	(0.002)	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	30	0.278	

(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。

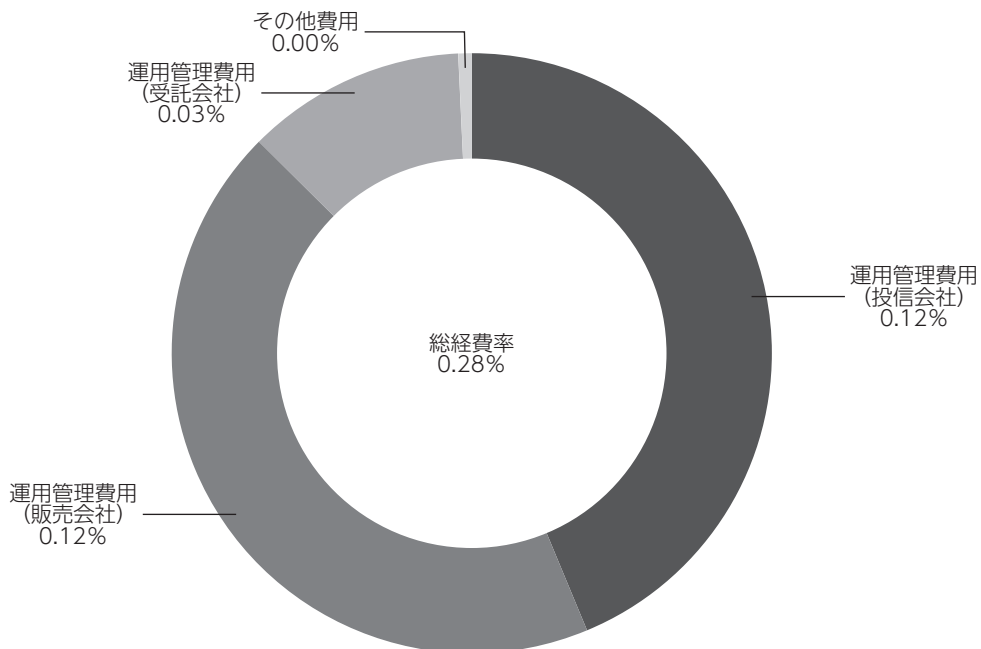
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.28%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（2025年2月15日から2026年2月16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□ 1,037,083	千円 1,207,140	千□ 1,699,182	千円 1,964,588

■利害関係人との取引状況等（2025年2月15日から2026年2月16日まで）

【D I AM国内債券インデックスファンド<DC年金>における利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 239,221	百万円 11,887	% 5.0	百万円 232,986	百万円 9,280	% 4.0

平均保有割合 3.1%

(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 599

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期首（前期末）	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド	千□ 12,497,772	千□ 11,835,673	千円 13,319,866

■投資信託財産の構成

2026年2月16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	13,319,866	99.4
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	75,298	0.6
投 資 信 託 財 産 総 額	13,395,165	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

(2026年2月16日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	13,395,165,738円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	61,334,909
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	13,319,866,829
未 収 入 金	13,964,000
(B) 負 債	74,393,125
未 払 解 約 金	54,717,277
未 払 信 託 報 酬	19,557,040
そ の 他 未 払 費 用	118,808
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	13,320,772,613
元 本	12,599,755,919
次 期 繰 越 損 益 金	721,016,694
(D) 受 益 権 総 口 数	12,599,755,919口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	10,572円

(注) 期首における元本額は13,268,045,243円、当期中における追加設定元本額は2,409,153,566円、同解約元本額は3,077,442,890円です。

■損益の状況

当期 自2025年2月15日 至2026年2月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	191,511円
受 取 利 息	191,511
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△711,598,733
売 買 益	86,955,158
売 買 損	△798,553,891
(C) 信 託 報 酬 等	△39,862,327
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△751,269,549
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△840,525,151
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,312,811,394
(配 当 等 相 当 額)	(2,430,755,844)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△117,944,450)
(G) 合 計(D+E+F)	721,016,694
次 期 繰 越 損 益 金(G)	721,016,694
追 加 信 託 差 損 益 金	2,312,811,394
(配 当 等 相 当 額)	(2,430,755,844)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△117,944,450)
分 配 準 備 積 立 金	248,506,025
繰 越 損 益 金	△1,840,300,725

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

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

(注4) 分配金の計算過程

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,430,755,844
(d) 分配準備積立金	248,506,025
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	2,679,261,869
(f) 1 万 口 当 たり 当 期 分 配 対 象 額	2,126.44
(g) 分配金	0
(h) 1 万 口 当 たり 分 配 金	0

■分配金のお知らせ

収益分配金につきましては基準価額水準・市況動向等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■当ファンドおよび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、投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

(2025年4月1日)

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第23期 (決算日 2026年2月16日)

(計算期間 2025年2月15日～2026年2月16日)

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンドの第23期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	2002年12月3日から無期限です。
運用方針	NOMURA-BPI総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合 (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	%	ポイント	%				
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
21期 (2024年2月14日)	12,339	△0.6	365.56	△0.6	99.6	—	—	535,043
22期 (2025年2月14日)	11,909	△3.5	352.94	△3.5	99.2	—	—	481,121
23期 (2026年2月16日)	11,254	△5.5	333.49	△5.5	99.5	—	—	454,767

(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)。

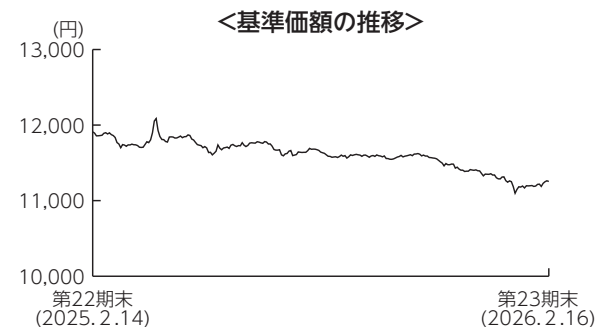
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2025年 2月14日	円 11,909	% -	ポイント 352.94	% -	% 99.2	% -	% -
2 月 末	11,897	△0.1	352.61	△0.1	99.6	-	-
3 月 末	11,779	△1.1	349.16	△1.1	100.3	-	-
4 月 末	11,848	△0.5	351.19	△0.5	101.4	-	-
5 月 末	11,696	△1.8	346.68	△1.8	99.6	-	-
6 月 末	11,759	△1.3	348.51	△1.3	99.7	-	-
7 月 末	11,639	△2.3	344.96	△2.3	99.7	-	-
8 月 末	11,603	△2.6	343.89	△2.6	99.6	-	-
9 月 末	11,594	△2.6	343.62	△2.6	99.8	-	-
10 月 末	11,614	△2.5	344.19	△2.5	99.9	-	-
11 月 末	11,482	△3.6	340.28	△3.6	99.5	-	-
12 月 末	11,340	△4.8	336.03	△4.8	99.8	-	-
2026年 1 月 末	11,197	△6.0	331.79	△6.0	99.6	-	-
(期 末) 2026年 2月16日	11,254	△5.5	333.49	△5.5	99.5	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2025年2月15日から2026年2月16日まで）

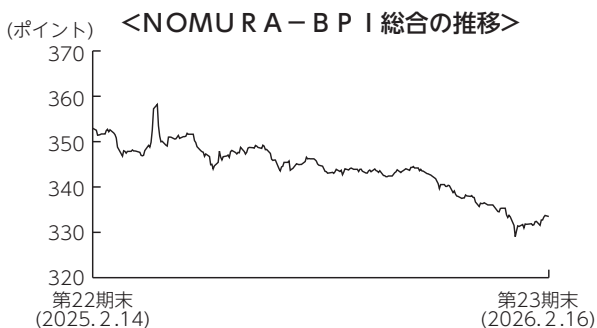


基準価額の推移

当期末の基準価額は11,254円となり、前期末比で5.5%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2025年4月にかけては、米トランプ大統領の関税政策などを巡り、市場が混乱する中で、基準価額は大きく変動しました。5月から11月にかけては、米国債格下げを受けた米金利上昇、軟調な入札結果、参院選後の財政悪化を懸念する見方などを受けて、基準価額は下落しました。12月から期末にかけては、日銀の利上げ観測、財政悪化懸念の高まり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2025年4月にかけては、米トランプ大統領の関税政策などを巡り、市場が混乱する中で、利回りは乱高下しました。5月から11月にかけては、米国債格下げを受けた米金利上昇、軟調な

入札結果、参院選後の財政悪化を懸念する見方などを受けて、利回りは上昇しました。12月から期末にかけては、日銀の利上げ観測、財政悪化懸念の高まりなどから利回りは上昇しました。

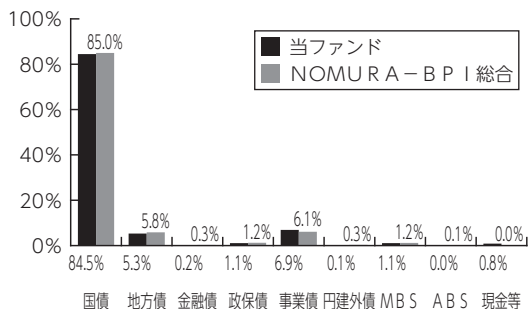
ポートフォリオについて

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。

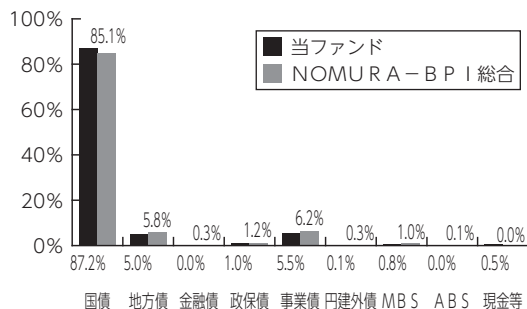
【運用状況】

○セクター別構成比

期首（前期末）

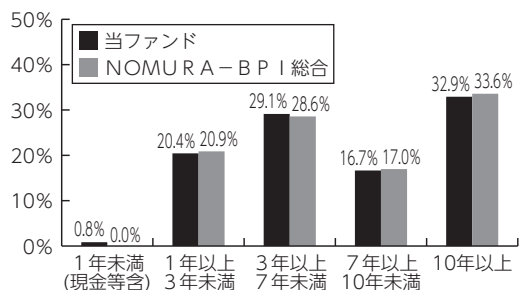


期末

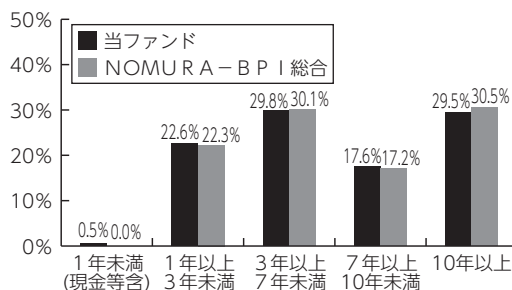


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



(注) 当ファンドの比率は純資産総額に対する評価額の割合です。

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5.5%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 (2025年2月15日から2026年2月16日まで)

公社債

		買付額	売付額	
国	内	千円	千円	
		国債証券	236,577,276	219,023,323 (-)
		地方債証券	1,133,780	3,212,824 (-)
		特殊債証券	448,502	4,376,113 (272,923)
	社債証券	1,062,126	6,374,340 (-)	

(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 (2025年2月15日から2026年2月16日まで)

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 239,221	百万円 11,887	% 5.0	百万円 232,986	百万円 9,280	% 4.0

(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 599

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				期末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	453,715,000	396,381,236	87.2	-	52.8	23.8	10.6
地方債証券	24,519,330	22,624,116	5.0	4.0	2.1	2.5	0.4
特殊債券 (除金融債券)	21,311,907	18,500,770	4.1	-	2.7	0.7	0.6
普通社債券	16,900,000	15,031,136	3.3	0.1	1.2	1.5	0.6
合計	516,446,237	452,537,259	99.5	4.1	58.8	28.5	12.2

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

(注2) 無格付銘柄については、BB格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内 (邦貨建) 公社債銘柄別

銘柄	当期				償還年月日
	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
(国債証券)	%	千円	千円		
470回 利付国庫債券 (2年)	0.8000	1,300,000	1,296,867	2027/03/01	
151回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,600,000	1,581,968	2027/03/20	
152回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,290,000	1,276,777	2027/03/20	
346回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	2,140,000	2,118,065	2027/03/20	
93回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	373,770	2027/03/20	
94回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	677,544	2027/03/20	
472回 利付国庫債券 (2年)	0.7000	1,800,000	1,791,882	2027/05/01	
473回 利付国庫債券 (2年)	0.8000	2,100,000	2,091,474	2027/06/01	
153回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,100,000	5,024,418	2027/06/20	
347回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,500,000	4,438,935	2027/06/20	
95回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	550,000	558,547	2027/06/20	
96回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	120,000	121,548	2027/06/20	
474回 利付国庫債券 (2年)	0.7000	1,400,000	1,391,614	2027/07/01	
475回 利付国庫債券 (2年)	0.9000	2,200,000	2,191,662	2027/08/01	
476回 利付国庫債券 (2年)	0.9000	2,800,000	2,787,932	2027/09/01	
154回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	2,700,000	2,653,884	2027/09/20	
348回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,370,000	4,295,360	2027/09/20	
97回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	660,000	670,494	2027/09/20	
98回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	160,000	162,296	2027/09/20	
477回 利付国庫債券 (2年)	1.0000	2,000,000	1,993,480	2027/10/01	
478回 利付国庫債券 (2年)	1.0000	2,400,000	2,391,168	2027/11/01	
155回 利付国庫債券 (5年)	0.3000	1,500,000	1,474,920	2027/12/20	
156回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	3,100,000	3,042,588	2027/12/20	
349回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,050,000	2,988,024	2027/12/20	

銘柄	当期				償還年月日
	利率	額面金額	評価額	償還年月日	
(国債証券)	%	千円	千円		
99回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	750,000	761,932	2027/12/20	
157回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	1,700,000	1,663,382	2028/03/20	
158回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,600,000	3,515,148	2028/03/20	
350回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,100,000	3,026,933	2028/03/20	
100回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	830,000	846,193	2028/03/20	
101回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	230,000	235,444	2028/03/20	
159回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,900,000	1,848,282	2028/06/20	
160回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	1,500,000	1,462,575	2028/06/20	
161回 利付国庫債券 (5年)	0.3000	3,200,000	3,127,392	2028/06/20	
351回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,400,000	4,280,232	2028/06/20	
102回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	500,000	512,765	2028/06/20	
103回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	160,000	163,721	2028/06/20	
104回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	110,000	112,046	2028/06/20	
162回 利付国庫債券 (5年)	0.3000	2,100,000	2,045,589	2028/09/20	
163回 利付国庫債券 (5年)	0.4000	4,850,000	4,736,510	2028/09/20	
352回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,370,000	3,265,428	2028/09/20	
105回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	640,000	652,659	2028/09/20	
106回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	500,000	511,140	2028/09/20	
164回 利付国庫債券 (5年)	0.2000	1,100,000	1,064,536	2028/12/20	
165回 利付国庫債券 (5年)	0.3000	1,200,000	1,164,600	2028/12/20	
166回 利付国庫債券 (5年)	0.4000	2,850,000	2,773,705	2028/12/20	
353回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,690,000	3,560,481	2028/12/20	
107回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	600,000	612,300	2028/12/20	
108回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	690,000	700,274	2028/12/20	

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
167回 利付国庫債券(5年)	0.4000	1,800,000	1,745,208	2029/03/20
168回 利付国庫債券(5年)	0.6000	1,100,000	1,073,182	2029/03/20
169回 利付国庫債券(5年)	0.5000	3,000,000	2,917,980	2029/03/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,660,000	2,555,089	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	355,173	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	449,108	2029/03/20
170回 利付国庫債券(5年)	0.6000	1,600,000	1,555,712	2029/06/20
172回 利付国庫債券(5年)	0.5000	2,100,000	2,034,879	2029/06/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,340,000	3,193,407	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	471,127	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	755,547	2029/06/20
173回 利付国庫債券(5年)	0.6000	1,100,000	1,065,548	2029/09/20
174回 利付国庫債券(5年)	0.7000	2,200,000	2,138,598	2029/09/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,400,000	3,234,556	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	114,987	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	2,270,000	2,317,556	2029/09/20
175回 利付国庫債券(5年)	0.9000	1,100,000	1,074,095	2029/12/20
176回 利付国庫債券(5年)	1.0000	700,000	686,175	2029/12/20
177回 利付国庫債券(5年)	1.1000	600,000	590,322	2029/12/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,300,000	3,124,374	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	103,266	2030/02/20
178回 利付国庫債券(5年)	1.0000	3,200,000	3,128,160	2030/03/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,750,000	3,532,950	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	543,234	2030/03/20
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,870,000	1,909,139	2030/03/20
179回 利付国庫債券(5年)	1.0000	2,300,000	2,241,741	2030/06/20
180回 利付国庫債券(5年)	1.1000	2,500,000	2,447,300	2030/06/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,850,000	3,607,719	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	955,000	970,681	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	473,811	2030/06/20
120回 利付国庫債券(20年)	1.6000	500,000	499,895	2030/06/20
181回 利付国庫債券(5年)	1.3000	3,340,000	3,290,100	2030/09/20
182回 利付国庫債券(5年)	1.4000	1,100,000	1,088,494	2030/09/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,800,000	3,543,424	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	1,040,000	1,051,980	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	870,000	876,124	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	211,350	2030/11/20
183回 利付国庫債券(5年)	1.6000	300,000	299,058	2030/12/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,900,000	3,617,796	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,450,000	1,479,232	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,210,000	3,885,619	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	900,000	922,356	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	910,000	923,850	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	840,000	848,652	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,170,000	2,910,408	2031/06/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(国債証券)	%	千円	千円	
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	200,000	201,906	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,910,000	3,570,612	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	1,110,000	1,113,674	2031/09/20
131回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,100,000	1,097,756	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	207,068	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,430,000	4,023,591	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	530,000	528,171	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	130,000	130,274	2031/12/20
366回 利付国庫債券(10年)	0.2000	4,780,000	4,345,067	2032/03/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	900,000	900,981	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	130,000	129,392	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	560,000	554,159	2032/03/20
367回 利付国庫債券(10年)	0.2000	4,500,000	4,068,450	2032/06/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	480,000	476,860	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,060,000	1,040,421	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	680,000	671,500	2032/06/20
368回 利付国庫債券(10年)	0.2000	4,350,000	3,911,215	2032/09/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	950,000	942,181	2032/09/20
369回 利付国庫債券(10年)	0.5000	4,420,000	4,038,156	2032/12/20
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,560,000	1,545,320	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	730,000	727,780	2032/12/20
370回 利付国庫債券(10年)	0.5000	4,430,000	4,028,863	2033/03/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	2,130,000	2,092,043	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,050,000	1,024,411	2033/03/20
371回 利付国庫債券(10年)	0.4000	4,900,000	4,398,338	2033/06/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	246,620	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,950,000	1,923,636	2033/06/20
372回 利付国庫債券(10年)	0.8000	3,900,000	3,589,248	2033/09/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	232,741	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,040,000	2,006,931	2033/09/20
1回 C T利付国庫債券(10年)	0.7000	500,000	453,035	2033/12/20
373回 利付国庫債券(10年)	0.6000	4,700,000	4,235,452	2033/12/20
147回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	150,355	2033/12/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,290,000	1,255,879	2033/12/20
2回 C T利付国庫債券(10年)	1.0000	500,000	461,985	2034/03/20
374回 利付国庫債券(10年)	0.8000	4,900,000	4,462,822	2034/03/20
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	350,070	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,730,000	1,665,730	2034/03/20
375回 利付国庫債券(10年)	1.1000	4,780,000	4,439,281	2034/06/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	269,287	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,290,000	2,197,186	2034/06/20
376回 利付国庫債券(10年)	0.9000	4,620,000	4,198,240	2034/09/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	248,157	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,230,000	2,114,084	2034/09/20
377回 利付国庫債券(10年)	1.2000	4,830,000	4,482,529	2034/12/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
17回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	270,000	276,655	2034/12/20
151回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	660,000	612,519	2034/12/20
378回 利付国庫債券 (10年)	1.4000	4,800,000	4,516,080	2035/03/20
18回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	400,000	405,948	2035/03/20
152回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	1,640,000	1,515,819	2035/03/20
379回 利付国庫債券 (10年)	1.5000	4,300,000	4,065,263	2035/06/20
19回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	280,000	283,595	2035/06/20
153回 利付国庫債券 (20年)	1.3000	2,660,000	2,470,714	2035/06/20
380回 利付国庫債券 (10年)	1.7000	4,540,000	4,355,040	2035/09/20
20回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	330,000	339,315	2035/09/20
154回 利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,420,000	2,216,937	2035/09/20
381回 利付国庫債券 (10年)	2.1000	600,000	594,666	2035/12/20
21回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	310,000	312,759	2035/12/20
155回 利付国庫債券 (20年)	1.0000	2,480,000	2,217,764	2035/12/20
22回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	290,000	297,055	2036/03/20
156回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,680,000	1,403,757	2036/03/20
23回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	350,000	357,787	2036/06/20
157回 利付国庫債券 (20年)	0.2000	1,680,000	1,362,597	2036/06/20
158回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,790,000	1,490,246	2036/09/20
25回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	330,000	329,283	2036/12/20
159回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	2,340,000	1,955,842	2036/12/20
26回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	620,000	622,994	2037/03/20
160回 利付国庫債券 (20年)	0.7000	1,820,000	1,528,345	2037/03/20
161回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,760,000	1,449,870	2037/06/20
27回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	620,000	625,332	2037/09/20
162回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,930,000	1,577,794	2037/09/20
163回 利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,930,000	1,566,407	2037/12/20
28回 利付国庫債券 (30年)	2.5000	770,000	772,502	2038/03/20
164回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,270,000	1,805,081	2038/03/20
165回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,470,000	1,159,433	2038/06/20
29回 利付国庫債券 (30年)	2.4000	860,000	848,106	2038/09/20
166回 利付国庫債券 (20年)	0.7000	1,760,000	1,414,652	2038/09/20
167回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,950,000	1,512,868	2038/12/20
30回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	880,000	852,139	2039/03/20
168回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,000,000	1,517,080	2039/03/20
169回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,820,000	1,348,692	2039/06/20
31回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	720,000	684,208	2039/09/20
170回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,800,000	1,321,902	2039/09/20
171回 利付国庫債券 (20年)	0.3000	2,240,000	1,631,033	2039/12/20
32回 利付国庫債券 (30年)	2.3000	970,000	927,087	2040/03/20
172回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,630,000	1,195,588	2040/03/20
173回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,460,000	1,789,182	2040/06/20
33回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,180,000	1,076,643	2040/09/20
174回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,290,000	1,651,433	2040/09/20
175回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,520,000	1,831,737	2040/12/20

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
34回 利付国庫債券 (30年)	2.2000	1,200,000	1,114,764	2041/03/20
176回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,650,000	1,189,485	2041/03/20
177回 利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,000,000	1,404,360	2041/06/20
35回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,060,000	950,438	2041/09/20
178回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,900,000	1,346,131	2041/09/20
179回 利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,810,000	1,271,597	2041/12/20
36回 利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,370,000	1,218,710	2042/03/20
180回 利付国庫債券 (20年)	0.8000	1,940,000	1,427,374	2042/03/20
181回 利付国庫債券 (20年)	0.9000	2,100,000	1,561,707	2042/06/20
37回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	1,360,000	1,183,145	2042/09/20
182回 利付国庫債券 (20年)	1.1000	1,750,000	1,338,697	2042/09/20
183回 利付国庫債券 (20年)	1.4000	2,000,000	1,599,940	2042/12/20
38回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	850,000	721,735	2043/03/20
184回 利付国庫債券 (20年)	1.1000	1,680,000	1,269,945	2043/03/20
39回 利付国庫債券 (30年)	1.9000	1,110,000	953,878	2043/06/20
185回 利付国庫債券 (20年)	1.1000	2,100,000	1,577,457	2043/06/20
40回 利付国庫債券 (30年)	1.8000	530,000	445,989	2043/09/20
186回 利付国庫債券 (20年)	1.5000	1,900,000	1,521,064	2043/09/20
41回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,060,000	873,482	2043/12/20
187回 利付国庫債券 (20年)	1.3000	1,800,000	1,384,110	2043/12/20
42回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,000,000	819,710	2044/03/20
188回 利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,750,000	1,409,852	2044/03/20
43回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	710,000	578,898	2044/06/20
189回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,600,000	1,349,488	2044/06/20
44回 利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,130,000	916,938	2044/09/20
190回 利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,630,000	1,345,972	2044/09/20
45回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,250,000	974,462	2044/12/20
191回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	1,600,000	1,361,536	2044/12/20
46回 利付国庫債券 (30年)	1.5000	540,000	419,061	2045/03/20
192回 利付国庫債券 (20年)	2.4000	1,600,000	1,448,336	2045/03/20
47回 利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,340,000	1,053,682	2045/06/20
193回 利付国庫債券 (20年)	2.5000	1,630,000	1,494,579	2045/06/20
48回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,470,000	1,107,380	2045/09/20
194回 利付国庫債券 (20年)	2.7000	1,370,000	1,292,184	2045/09/20
49回 利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,300,000	974,649	2045/12/20
195回 利付国庫債券 (20年)	3.2000	100,000	101,477	2045/12/20
50回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,250,000	820,500	2046/03/20
51回 利付国庫債券 (30年)	0.3000	1,620,000	934,189	2046/06/20
52回 利付国庫債券 (30年)	0.5000	1,350,000	811,930	2046/09/20
53回 利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,120,000	684,880	2046/12/20
54回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,100,000	700,986	2047/03/20
55回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,080,000	682,927	2047/06/20
56回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,140,000	715,304	2047/09/20
57回 利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,130,000	703,583	2047/12/20
1回 利付国庫債券 (40年)	2.4000	110,000	95,582	2048/03/20

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
5 8回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,460,000	902,104 2048/03/20
5 9回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	820,000	489,794 2048/06/20
6 0回	利付国庫債券 (30年)	0.9000	930,000	580,645 2048/09/20
6 1回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	960,000	564,374 2048/12/20
2 回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	330,000	272,094 2049/03/20
6 2回	利付国庫債券 (30年)	0.5000	920,000	507,048 2049/03/20
6 3回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,250,000	662,462 2049/06/20
6 4回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	900,000	472,356 2049/09/20
6 5回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	800,000	415,832 2049/12/20
3 回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	540,000	437,675 2050/03/20
6 6回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	890,000	458,180 2050/03/20
6 7回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,360,000	737,473 2050/06/20
6 8回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,040,000	558,074 2050/09/20
6 9回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,260,000	690,328 2050/12/20
4 回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	720,000	570,945 2051/03/20
7 0回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,200,000	650,784 2051/03/20
7 1回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,230,000	660,239 2051/06/20
7 2回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,290,000	686,163 2051/09/20
7 3回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,390,000	732,265 2051/12/20
5 回	利付国庫債券 (40年)	2.0000	710,000	528,389 2052/03/20
7 4回	利付国庫債券 (30年)	1.0000	1,170,000	671,755 2052/03/20
7 5回	利付国庫債券 (30年)	1.3000	1,620,000	1,008,547 2052/06/20
7 6回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,420,000	905,207 2052/09/20
7 7回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,580,000	1,058,363 2052/12/20
6 回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	940,000	676,771 2053/03/20
7 8回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,400,000	886,438 2053/03/20
7 9回	利付国庫債券 (30年)	1.2000	1,450,000	864,519 2053/06/20
8 0回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,280,000	895,974 2053/09/20
8 1回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,300,000	862,901 2053/12/20
7 回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	1,030,000	705,920 2054/03/20
8 2回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,310,000	914,890 2054/03/20
8 3回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	1,700,000	1,307,453 2054/06/20
8 4回	利付国庫債券 (30年)	2.1000	2,010,000	1,507,680 2054/09/20
8 5回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	1,400,000	1,099,686 2054/12/20
8 回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	890,000	557,540 2055/03/20
86回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	400,000	321,300 2055/03/20
87回	利付国庫債券 (30年)	2.8000	600,000	525,882 2055/06/20
88回	利付国庫債券 (30年)	3.2000	1,300,000	1,235,221 2055/09/20
89回	利付国庫債券 (30年)	3.4000	100,000	98,756 2055/12/20
9 回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,800,000	787,302 2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,430,000	747,875 2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,180,000	585,634 2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,420,000	609,435 2059/03/20
1 3回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,820,000	775,483 2060/03/20
1 4回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	1,720,000	782,342 2061/03/20

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
1 5回	利付国庫債券 (40年)	1.0000	1,870,000	935,149 2062/03/20
1 6回	利付国庫債券 (40年)	1.3000	2,040,000	1,111,269 2063/03/20
1 7回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	2,200,000	1,572,648 2064/03/20
18回	利付国庫債券 (40年)	3.1000	1,000,000	901,250 2065/03/20
小 計		-	453,715,000	396,381,236 -
(地方債証券)		%	千円	千円
169回	共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	494,120 2027/04/23
4 1 9回	大阪府公募公債 10年	0.1960	100,000	98,797 2027/04/27
2 回	静岡県公募公債 15年	1.4060	100,000	100,194 2027/06/25
5 回	兵庫県公募公債 12年	0.6870	100,000	99,198 2027/07/07
1 7 3回	共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	393,464 2027/08/25
2 9年度4回	大阪市公募公債	0.1500	200,000	196,312 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	98,139 2027/09/24
2 4年度1回	福岡県公募公債 15年	1.3290	100,000	99,968 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	97,836 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	488,720 2028/02/25
2 9年度6回	広島市公募公債	0.2300	300,000	293,145 2028/02/25
2 9年度13回	京都府公募公債	0.2000	109,330	106,692 2028/03/16
5 回	兵庫県公募公債 15年	1.3100	300,000	299,334 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募公債	0.2200	110,000	106,972 2028/06/20
4 回	静岡県公募公債 15年	1.3380	100,000	99,811 2028/06/23
3 0年度8回	北海道公募公債	0.2490	400,000	388,140 2028/08/31
3 0年度7回	神戸市公募公債 30年	0.2540	300,000	290,922 2028/09/20
第 9 1 回	川崎市公募公債	0.1850	200,000	193,604 2028/09/20
7 回	静岡県公募公債 20年	2.3200	300,000	306,633 2028/09/21
3 0年度3回	広島県公募公債	0.2540	100,000	96,947 2028/09/25
3 0年度3回	堺市公募公債	0.1950	100,000	96,408 2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募公債	0.1350	200,000	192,484 2028/12/20
2 0 回 2 号	福岡県公募公債	2.0500	100,000	101,540 2028/12/20
6 回	大阪市公募公債 20年	2.2100	200,000	203,980 2028/12/20
1 7 回	横浜市公募公債 20年	2.0700	100,000	101,595 2028/12/20
6 回	北九州市公募公債 20年	2.0300	100,000	101,486 2028/12/20
3 0年度6回	福岡県公募公債	0.2000	200,000	192,830 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	96,416 2028/12/25
3 0年度14回	北海道公募公債	0.1950	400,000	385,460 2028/12/28
1 8 回	東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	102,045 2029/03/19
3 0年度19回	愛知県公募公債	0.1150	200,000	191,368 2029/03/28
3 0年度3回	岡山県公募公債 10年	0.1500	200,000	191,568 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	286,110 2029/05/25
6 回	川崎市公募公債 20年	2.2100	200,000	204,068 2029/05/25
令和元年度1回	福岡県公募公債	0.0290	200,000	189,938 2029/06/21
9 回	兵庫県公募公債 15年	1.0200	100,000	98,126 2029/07/13
1 1 回	神奈川県公募公債 20年	2.0800	100,000	101,604 2029/07/20
1 9 6回	共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	474,450 2029/07/25
7 9 6 回	東京都公募公債	0.0400	200,000	189,014 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)		%	千円	千円	
令和元年度 9回 静岡県公募債		0.0500	200,000	189,082	2029/09/20
令和元年度3回 横浜市公募債		0.0500	400,000	377,624	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募債		0.0500	200,000	188,724	2029/10/23
2.1回 東京都公募債 20年		2.1900	100,000	101,984	2029/12/20
243回 神奈川県公募債 10年		0.0750	100,000	94,156	2029/12/20
17回 さいたま市公募債		0.1100	200,000	188,492	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募債		0.1350	200,000	188,298	2030/01/30
10回 兵庫県公募債 20年		2.2400	100,000	102,142	2030/02/22
21年度2回 福岡県公募債 (20年)		2.2300	100,000	102,104	2030/02/22
2.03回 共同発行市場公募地方債		0.0950	100,000	93,829	2030/02/25
8.02回 東京都公募債		0.1300	400,000	375,364	2030/03/19
5.11回 名古屋市長公募債 10年		0.0750	200,000	187,160	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募債		0.1350	400,000	374,904	2030/04/12
令和2年 2回 大阪市公募債		0.1310	300,000	280,476	2030/05/22
9回 埼玉県公募債 20年		2.1500	100,000	101,752	2030/05/24
8回 静岡県公募債 15年		0.8280	200,000	192,580	2030/06/07
806回 東京都公募債		0.1050	100,000	93,231	2030/06/20
令和2年度 10回 静岡県公募債		0.1350	100,000	92,857	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募債		0.1350	100,000	92,670	2030/10/23
3.6回2号 宮城県公募債 10年		0.1350	250,000	231,625	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募債		0.1350	200,000	184,944	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募債		0.1350	200,000	184,944	2030/11/27
2.2年度14回 愛知県公募債		2.0870	300,000	304,092	2030/12/13
9回 京都市公募債 20年		2.1430	200,000	203,232	2030/12/17
8.13回 東京都公募債		0.1790	300,000	277,671	2030/12/20
1.6回 神奈川県公募債 20年		2.0900	300,000	304,080	2031/01/24
4.64回 大阪府公募債 10年		0.0720	200,000	183,674	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募債		0.1450	100,000	92,030	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募債		0.2140	200,000	184,586	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公募債		0.2140	200,000	184,488	2031/03/19
816回 東京都公募債		0.0800	100,000	91,597	2031/03/20
2.51回 神奈川県公募債 10年		0.1990	200,000	184,342	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公募債		0.1400	200,000	183,794	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募債 10年		0.1900	200,000	183,878	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募債		0.1750	100,000	91,811	2031/04/25
4.67回 大阪府公募債 10年		0.1640	200,000	183,494	2031/04/28
4.69回 大阪府公募債 10年		0.1280	200,000	182,494	2031/06/27
1.1回 北九州市公募債 20年		2.0190	300,000	302,484	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公募債		0.1050	200,000	181,214	2031/09/25
222回 共同発行市場公募地方債		0.1150	300,000	271,971	2031/09/25
4.72回 大阪府公募債 10年		0.1000	200,000	181,130	2031/09/29
令和3年度第8回 埼玉県公募債		0.1250	100,000	90,531	2031/10/27
4.74回 大阪府公募債 10年		0.1190	300,000	270,897	2031/11/28
令和3年 4回 千葉市公募債		0.1350	100,000	90,252	2031/12/24
1.9回 神奈川県公募債 20年		1.8180	100,000	99,452	2032/01/30

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	
2.27回 共同発行市場公募地方債		0.2440	500,000	452,545	2032/02/25
2.28回 共同発行市場公募地方債		0.1990	500,000	450,415	2032/03/25
2.58回 神奈川県公募債 10年		0.2900	300,000	270,246	2032/06/18
2.4年度2回 福岡県公募債 (20年)		1.6350	300,000	293,781	2032/08/16
1.0回 大阪府公募債 20年		1.7200	200,000	196,728	2032/09/24
2.4年度1.2回 神戸市公募債		1.7110	200,000	196,284	2032/12/17
1.4回 千葉県公募債 20年		1.1370	100,000	94,006	2033/04/15
1.3回 埼玉県公募債 20年		1.5990	100,000	96,964	2033/05/20
1回 東京都公募債 30年		2.2100	200,000	201,960	2033/06/20
1.4回 埼玉県公募債 20年		1.5460	300,000	285,693	2034/05/08
2.6年度4回 愛知県公募債 20年		1.5420	200,000	190,382	2034/05/15
2.9回 横浜市公募債 20年		1.5280	100,000	95,041	2034/05/26
1.6回 名古屋市長公募債 20年		1.5200	100,000	94,926	2034/06/09
5回 群馬県公募債 20年		1.5290	100,000	94,944	2034/06/16
1.7回 北九州市公募債 20年		1.5290	100,000	94,936	2034/06/20
3.1回 東京都公募債 20年		1.2380	200,000	184,562	2034/09/20
1.5回 埼玉県公募債 20年		1.1660	100,000	91,034	2035/02/16
2回 横浜市公募債 30年		2.4900	100,000	101,695	2035/03/20
1.8回 千葉県公募債 20年		1.1380	100,000	90,528	2035/04/13
1.7回 名古屋市長公募債 20年		1.2030	100,000	90,848	2035/05/28
866回 東京都公募債		1.7140	300,000	285,057	2035/06/20
1.3回 大阪府公募債 20年		1.2030	100,000	90,262	2035/09/28
1.4回 大阪府公募債 20年		0.5400	100,000	82,210	2036/09/29
2.1回 千葉県公募債 20年		0.4240	100,000	81,023	2036/10/15
3回 神奈川県公募債 30年		2.6200	100,000	101,046	2037/03/19
2.9年度2回 広島市公募債		0.6160	200,000	161,436	2037/08/18
2.9年度5回 札幌市公募債 20年		0.5970	300,000	240,915	2037/09/18
3.0年度2回 仙台市公募債 20年		0.7290	100,000	78,971	2038/10/18
3.0年度7回 福岡市公募債		0.7010	200,000	157,278	2038/10/19
2.019年度5回 福岡市公募債 20年		0.2860	100,000	72,115	2039/07/29
2回 兵庫県公募債 30年		2.3600	100,000	94,111	2040/03/19
2.2年度8回 福岡市公募債		2.2800	100,000	92,568	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公募債		0.4640	100,000	71,113	2040/09/21
2.3年度7回 札幌市公募債 30年		2.0970	100,000	88,873	2041/09/20
5回 川崎市公募債 30年		2.0970	100,000	88,155	2042/03/20
2.4年度1.2回 愛知県公募債 30年		2.1200	100,000	87,734	2042/09/19
1.4回 東京都公募債 30年		2.0500	100,000	85,758	2043/06/19
2.7年度8回 愛知県公募債 30年		1.5790	150,000	114,138	2045/06/20
2.7年度 2回 広島県公募債 30年		0.7110	100,000	62,039	2046/03/22
6回 埼玉県公募債 30年		0.9570	200,000	127,440	2046/12/20
令和元年度7回 愛知県公募債		0.3690	300,000	148,803	2049/06/18
令和元年3回 福岡県公募債 30年		0.4320	200,000	101,204	2049/06/18
1.2回 埼玉県公募債 30年		0.4740	300,000	150,882	2049/12/20
令和3年度6回 神戸市公募債 30年		0.7130	200,000	101,892	2051/06/20
小	計	-	24,519,330	22,624,116	-

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券(除金融債券))	%	千円	千円	
F147回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	200,150	2027/03/19
78回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	296,469	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	790,248	2027/04/30
96回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	493,215	2027/05/28
72回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	196,840	2027/06/18
98回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	98,508	2027/07/16
222回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	293,865	2027/11/19
103回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	97,922	2027/12/17
124回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	100,039	2027/12/20
77回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	292,917	2027/12/20
230回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	293,127	2028/02/18
113回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	96,892	2028/10/16
9回 新聞西国際空港社債	1.2310	200,000	197,942	2028/12/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	202,912	2028/12/20
93回 都市再生債券	1.1020	100,000	98,216	2029/06/20
1回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	306,072	2029/06/28
387回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0010	200,000	189,628	2029/07/31
2回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	306,051	2029/08/28
12回 新聞西国際空港社債	1.0670	200,000	195,314	2029/09/20
39回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	203,178	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	101,834	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	95,921	2030/05/28
64回 政保日本政策投資銀行社債	0.0900	100,000	93,371	2030/06/17
109回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	192,662	2030/06/20
15回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	200,610	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	501,625	2030/10/31
13回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	101,277	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	182,928	2031/05/30
75回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	352,793	2031/06/13
75回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	100,123	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	99,574	2031/12/26
19回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	198,732	2031/12/26
156回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	360,920	2032/04/14
23回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	98,003	2032/07/28
115回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	98,641	2032/09/14
15回 国際協力機構債	1.7240	100,000	98,078	2032/09/17
24回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	195,998	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	96,012	2033/04/28
28回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	524,375	2033/12/20
124回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	95,185	2034/03/17
36回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	95,222	2034/04/28
39回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	467,365	2034/09/28
42回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	268,659	2035/01/26
239回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	273,702	2035/02/28
159回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	89,940	2035/05/18

銘柄	当期末			
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券(除金融債券))	%	千円	千円	
155回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	91,224	2035/06/20
44回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	182,522	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	91,631	2035/06/29
第262回 政保道路債	1.1090	500,000	447,275	2035/11/30
272回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4610	200,000	166,054	2036/03/31
172回 高速道路機構債	0.2880	200,000	160,164	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	161,200	2036/08/29
59回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	81,558	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	162,646	2037/07/31
26回 高速道路機構債	2.6700	200,000	200,718	2037/09/18
337回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	79,683	2038/01/29
233回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	78,133	2038/04/20
F174回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	274,533	2038/05/28
210回 高速道路機構債	0.6770	100,000	78,063	2038/09/17
50回 高速道路機構債	0.5000	300,000	224,559	2039/03/18
77回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	210,645	2039/09/28
125回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	352,930	2040/04/24
288回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	247,413	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	87,554	2040/08/31
148回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	208,617	2043/12/18
27回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	11,792	11,857	2044/08/10
29回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	74,935	75,005	2044/10/10
36回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	111,328	111,659	2045/05/10
159回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	75,765	2045/06/20
38回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	16,066	15,944	2045/07/10
1回 高速道路機構債	2.9900	300,000	285,546	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	147,076	2045/10/31
169回 高速道路機構債	1.2000	100,000	69,109	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	71,380	2046/01/31
49回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	13,855	13,880	2046/06/10
52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	16,150	15,983	2046/09/10
53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	17,128	16,886	2046/10/10
19回 高速道路機構債	2.7500	150,000	133,428	2047/03/20
60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	20,872	20,245	2047/05/10
64回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	52,118	49,409	2047/09/10
36回 高速道路機構債	2.8400	300,000	266,298	2048/03/20
76回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	23,315	22,262	2048/09/10
82回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	28,348	26,422	2049/03/10
84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	28,832	26,822	2049/05/10
86回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	32,266	29,582	2049/07/10
90回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	33,540	30,053	2049/11/10
398回 政保道路債	0.4220	300,000	148,569	2049/12/28
93回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	38,600	33,361	2050/02/10
10回 地方公共団体金融機構債券 30年	0.5170	300,000	147,591	2050/04/28
96回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	42,635	37,219	2050/05/10

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(特殊債券 (除く金融債券))	%	千円	千円	
131回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	51,778	2050/06/20
165回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	103,806	2050/06/20
99回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	44,741	38,917	2050/08/10
418回 高速道路機構債	0.6300	200,000	98,640	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	99,570	2051/10/31
114回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	173,682	138,363	2051/11/10
117回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	59,535	47,367	2052/02/10
118回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	59,015	47,074	2052/03/10
119回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	59,543	47,408	2052/04/10
126回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	186,789	146,343	2052/11/10
128回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	185,130	144,901	2053/01/10
130回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	127,304	99,266	2053/03/10
131回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	189,534	146,974	2053/04/10
132回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	186,921	145,097	2053/05/10
137回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	327,970	254,166	2053/10/10
139回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	65,226	50,448	2053/12/10
142回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	67,327	51,282	2054/03/10
154回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	220,071	165,103	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	65,608	2055/03/19
156回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	291,976	219,598	2055/05/10
160回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	226,227	167,883	2055/09/10
168回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	229,710	170,343	2056/05/10
170回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	699,426	516,071	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	83,218	2061/02/28
小 計	-	21,311,907	18,500,770	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
12回 リソな銀行劣後社債	2.4640	100,000	100,656	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	101,125	2027/04/20
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	296,757	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	296,811	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	197,604	2027/05/07
30回 東レ社債	0.3750	300,000	295,599	2027/07/16
32回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	101,369	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	98,961	2027/09/24
25回 フランス相互証券銀行 (BFCM) 円債社債 (2017)	0.5100	300,000	294,285	2027/10/12
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	98,034	2027/10/22
525回 東北電力社債	0.2200	200,000	195,660	2027/10/25
54回 電源開発社債	0.3800	100,000	98,020	2027/11/19
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	293,007	2027/12/20
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	293,664	2028/01/18
12回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	386,556	2028/06/02
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	194,940	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	96,769	2028/10/25
21回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	101,738	2029/03/21
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	95,717	2029/04/12

銘柄	当	期 末		
		利率	額面金額	評価額
(普通社債券)	%	千円	千円	
14回 ブリヂストン社債	0.3750	300,000	287,373	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	98,496	2029/04/27
530回 関西電力社債	0.4050	400,000	381,992	2029/06/20
73回 三井物産社債	0.2900	400,000	380,960	2029/07/11
532回 中部電力社債	0.2240	200,000	189,492	2029/07/25
7回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	282,612	2029/10/11
25回 アサヒグループホールディングス社債	0.8540	200,000	193,570	2029/10/17
80回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	188,472	2029/10/19
65回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	101,306	2029/12/21
67回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	188,396	2030/01/31
19回 パナソニック社債	0.3700	100,000	93,569	2030/03/05
147回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	93,663	2030/04/22
60回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	186,828	2030/05/21
521回 東北電力社債	0.4500	400,000	374,908	2030/05/24
425回 中国電力社債	0.3700	100,000	93,135	2030/06/25
3回 ダイドーグループHD社債	0.5100	300,000	279,273	2030/07/16
114回 中日本高速道路債	1.2590	200,000	195,330	2030/07/17
103回 西日本高速道路債	1.3210	200,000	195,822	2030/07/23
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	186,114	2030/08/09
6回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	185,882	2030/09/17
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	371,012	2030/09/20
71回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	99,955	2030/09/27
17回 ダイセル社債	0.5000	300,000	277,437	2030/12/13
86回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	276,165	2030/12/20
73回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	201,446	2030/12/20
23回 パナソニック社債	0.3900	200,000	183,468	2030/12/24
30回 光通信社債	0.9800	200,000	183,100	2031/01/31
74回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	91,457	2031/04/22
491回 九州電力社債	0.3400	300,000	273,828	2031/04/25
58回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	271,089	2031/07/15
22回 NTTファイナンス社債	0.2700	100,000	89,950	2031/09/19
541回 関西電力社債	0.3700	300,000	271,323	2031/09/19
536回 東北電力社債	0.2900	300,000	269,988	2031/09/25
16回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	447,975	2031/10/14
75回 電源開発社債	0.3500	200,000	180,386	2031/10/20
396回 中国電力社債	0.5540	200,000	181,244	2032/01/23
320回 四国電力社債	0.5340	300,000	270,522	2032/04/23
507回 九州電力社債	0.6440	200,000	180,912	2032/05/25
4回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	273,129	2032/06/15
115回 トヨタファイナンス社債	1.7080	100,000	97,394	2032/10/15
43回 ソニー社債	1.7090	100,000	94,023	2035/03/06
39回 成田国際空港社債	0.4090	100,000	82,437	2035/10/26
18回 本田技研工業社債	2.5780	100,000	99,626	2036/01/22
9回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	83,268	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	162,850	2036/06/09

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	
41回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	161,646	2036/11/28
527回 中部電力社債	0.8060	100,000	79,102	2037/10/23
127回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	78,965	2038/01/26
26回 豊田通商社債	0.8970	100,000	78,878	2038/03/05
350回 北海道電力社債	0.7540	200,000	153,568	2038/03/25
463回 九州電力社債	0.7920	100,000	76,919	2038/05/25
8回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	157,926	2038/06/04
43回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	76,361	2038/07/12
466回 九州電力社債	0.7200	100,000	75,740	2038/07/23
52回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	73,429	2039/05/23
531回 関西電力社債	0.6720	200,000	145,586	2039/06/20
55回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	70,304	2039/09/13
37回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	71,307	2040/01/27

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	
165回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	139,974	2041/04/15
75回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	139,720	2041/04/22
492回 九州電力社債	0.6500	100,000	68,409	2041/04/25
107回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	73,011	2045/01/27
125回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	62,947	2047/07/26
70回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	53,219	2049/12/24
171回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	100,764	2051/07/14
57回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	128,001	2057/12/25
71回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	46,411	2059/12/24
47回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	44,926	2060/09/17
160回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	45,574	2060/12/17
小計	-	16,900,000	15,031,136	-
合計	-	516,446,237	452,537,259	-

■投資信託財産の構成

2026年2月16日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
公社債	千円 452,537,259	% 98.7
コール・ローン等、その他	5,916,703	1.3
投資信託財産総額	458,453,962	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

(2026年2月16日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	458,453,962,706円
コ ー ル ・ ロ ー ン 債 等	4,528,938,190
公 社 債(評価額)	452,537,259,443
未 収 利 息	1,306,019,165
前 払 費 用	81,745,908
(B) 負 債	3,686,056,521
未 払 金	434,302,000
未 払 解 約 金	3,251,754,521
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	454,767,906,185
元 本	404,092,805,530
次 期 繰 越 損 益 金	50,675,100,655
(D) 受 益 権 総 口 数	404,092,805,530口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	11,254円

(注1) 期首元本額	404,007,998,697円	マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,566,349,905円
追加設定元本額	225,893,546,730円	マネックス資産設計ファンド エボリューション	6,475,193円
一部解約元本額	225,808,739,897円	D I A M D C 8 資産バランスファンド (新興国10)	6,531,532,697円
(注2) 期末における元本の内訳		D I A M D C 8 資産バランスファンド (新興国20)	3,374,183,806円
D I A M 国内債券パッシブ・ファンド	35,488,577,381円	D I A M D C 8 資産バランスファンド (新興国30)	774,976,222円
たわらノーロード 国内債券	21,474,842,537円	投資のソムリエ	34,852,232,244円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	12,741,994,746円	グローバルコントロール	470,165,195円
たわらノーロード バランス (堅実型)	2,176,671,405円	投資のソムリエ<DC年金>	6,840,760,565円
たわらノーロード バランス (標準型)	5,564,944,134円	D I A M 8 資産バランスファンドN<DC年金>	9,576,548,612円
たわらノーロード バランス (積極型)	980,108,473円	4 資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	4,562,678,991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)	205,670,919円	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	12,663,394,117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)	3,088,253,846円	リスク抑制世界8資産バランスファンド	23,036,037,675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)	3,994,440,856円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2045)	620,095,633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)	1,033,765,381円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2055)	336,033,539円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	69,365,253円	リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	153,390,987円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	31,533,335円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2035)	2,097,886,353円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	284,843,246円	4 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	9,375,746,116円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	29,681,478円	リスクコントロール世界資産分散ファンド	7,673,422,191円
たわらノーロード 最適化バランス (積極型)	62,284円	9 資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,832,972,237円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (安定型)	17,119,374円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2040)	789,809,968円
マスターズ・マルチアセット・ファンド (バランス型)	25,806,163円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2050)	369,966,405円
D I A M 国内債券インデックスファンド<DC年金>	11,835,673,387円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2060)	213,528,130円
Oneグローバルバランス	460,327,421円	4 資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	5,999,369,658円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/~1972年生まれ向け)	4,746,109円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2065)	83,703,822円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/1973~1977年生まれ)	2,458,540円	Oneグローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	156,817,193円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/1978~1982年生まれ)	696,864円	投資のソムリエ (ターゲット・イヤ-2070)	2,903,558円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/1983~1987年生まれ)	409,539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)	197,203,786円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/1988~1992年生まれ)	74,145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)	487,583,501円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/1993~1997年生まれ)	70,612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)	441,681,180円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/1998~2002年生まれ)	64,337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)	1,261,831,511円
未来のわたし (ターゲット・イヤ-/2003~2007年生まれ)	96,503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)	722,454,169円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 1 安定型	14,154,256,404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)	545,919,849円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 2 安定・成長型	22,429,585,139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)	983,356,487円
D I A M バランス・ファンド<DC年金> 3 成長型	10,805,294,205円	予兆モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	1,324,690,368円
D I A M D C バランス30インデックスファンド	2,925,917,746円	D I A M 国内債券パッシブファンド (適格機関投資家向け)	7,740,467,284円
D I A M D C バランス50インデックスファンド	3,208,301,507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)	892,585,947円
D I A M D C バランス70インデックスファンド	742,300,799円	投資のソムリエ・私募 (適格機関投資家限定)	443,616,366円
マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	83,548,503円		

DIAMワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	243,537,787円	DIAM世界バランスファンド55VA (適格機関投資家限定)	705,124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)	863,897,742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)	991,276,326円
リスクコントロール世界8資産バランスファンド (FOF5用) (適格機関投資家専用)	23,942,182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)	28,862,571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)	92,421,116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)	151,273,769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)	106,728,585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)	232,301,492円
DIAM国際分散バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	21,896,835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)	352,769,173円
DIAM国際分散バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	59,302,824円	DIAM世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	178,117,904円
DIAM国内重視バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	30,114,923円	DIAM国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	49,787,741円
DIAM国内重視バランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	502,151円	コアサテライト戦略ファンド (適格機関投資家限定)	456,244,779円
DIAMバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	1,881,299,245円	動的パッケージファンド<DC年金>	377,237,663円
DIAMバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,153,221,503円	コア資産形成ファンド	131,636,060円
DIAMバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,724,955,890円	たわらノーロード 国内債券<クラブ専用>	11,592,312,772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)	50,142,544円	MHAM動的パッケージファンド [適格機関投資家限定]	36,630,095,349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)	130,335,363円	MHAM日本債券バジッパファンド [適格機関投資家限定]	30,377,277,694円
DIAM アクサ グローバル バランスファンド30VA (適格機関投資家限定)	1,056,062,426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]	163,834,729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)	76,593,490円	期末元本合計	404,092,805,530円

■損益の状況

当期 自2025年2月15日 至2026年2月16日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	4,279,846,852円
受 取 利 息	4,279,846,852
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△30,457,482,282
売 買 益	635,011,023
売 買 損	△31,092,493,305
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△26,177,635,430
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	77,113,682,396
(E) 解 約 差 損 益 金	△38,904,285,581
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	38,643,339,270
(G) 合 計(C+D+E+F)	50,675,100,655
次 期 繰 越 損 益 金(G)	50,675,100,655

(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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

(2025年4月1日)