

運用報告書 (全体版)

第21期<決算日2024年2月14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	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。	
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、2024年2月14日に第21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				
17期(2020年2月14日)	円 12,605	円 0	% 0.9	ポイント 390.72	% 1.2	% 99.4	% -	% -	百万円 18,549
18期(2021年2月15日)	12,403	0	△1.6	385.59	△1.3	99.2	-	-	19,035
19期(2022年2月14日)	12,227	0	△1.4	381.31	△1.1	99.6	-	-	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

(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 比率	新株予約権 付社債 (転換社債) 比率	債券先物 比率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率				
(期首) 2023年2月14日	円 11,756	% -	ポイント 367.66	% -	% 99.7	% -	% -
2月末	11,817	0.5	369.57	0.5	99.6	-	-
3月末	11,978	1.9	374.74	1.9	99.8	-	-
4月末	12,004	2.1	375.61	2.2	100.1	-	-
5月末	11,990	2.0	375.27	2.1	99.7	-	-
6月末	12,018	2.2	376.29	2.3	99.5	-	-
7月末	11,830	0.6	370.43	0.8	99.1	-	-
8月末	11,742	△0.1	367.76	0.0	96.7	-	-
9月末	11,656	△0.9	365.13	△0.7	99.5	-	-
10月末	11,468	△2.4	359.31	△2.3	99.7	-	-
11月末	11,706	△0.4	366.88	△0.2	99.4	-	-
12月末	11,752	△0.0	368.38	0.2	99.7	-	-
2024年1月末	11,662	△0.8	365.75	△0.5	99.6	-	-
(期末) 2024年2月14日	11,656	△0.9	365.56	△0.6	99.6	-	-

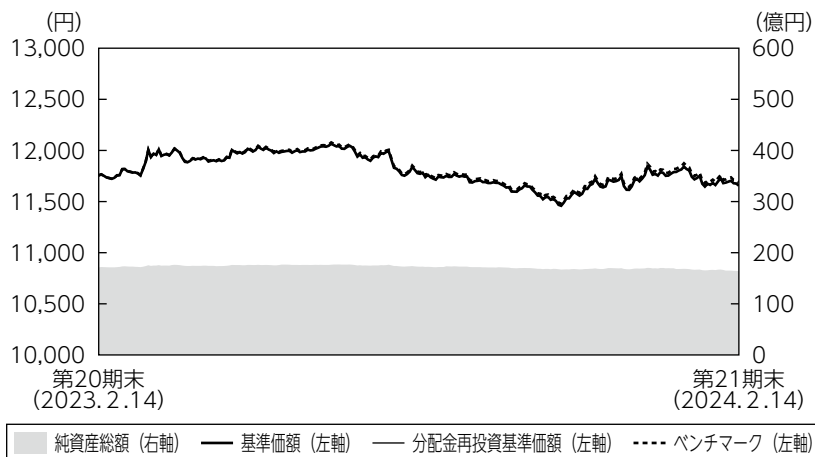
(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「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（2023年2月15日から2024年2月14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2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、基準価額は上昇しました。7月以降は、日銀が金融政策を修正する中で、基準価額は下落基調となりました。11月以降は国内債券に対する堅調な需要を受けて基準価額の上昇が見られましたが、2024年1月から期末にかけては日銀が金融政策を追加修正する可能性が高まっ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2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、利回りは大きく上下しました。7月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことを受けて、利回りは上昇しました。11月以降は、国内債券に対する堅調な需要を受けて利回りは低下しました。2024年1月から期末にかけては日銀のマイナス金利政策解除の観測が高まっ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

●当ファンド

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

●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

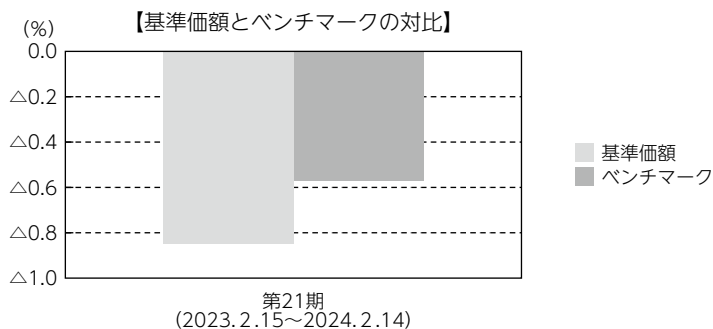
ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、資金の流入・流出に応じて適宜債券の売買を実施し、リスク特性をベンチマークに極力一致させたポートフォリオを構築しました。

※運用状況については13ページをご参照ください。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークは、前期末比で0.6%下落しました。

当ファンドの騰落率はベンチマーク比で $\Delta 0.3\%$ 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

当期の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
	2023年2月15日 ～2024年2月14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21期		項目の概要
	(2023年2月15日 ～2024年2月14日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	32円	0.275%	(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11,805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)	(14)	(0.121)	
(販売会社)	(14)	(0.121)	
(受託会社)	(4)	(0.033)	
(b) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.002 (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	33	0.276	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

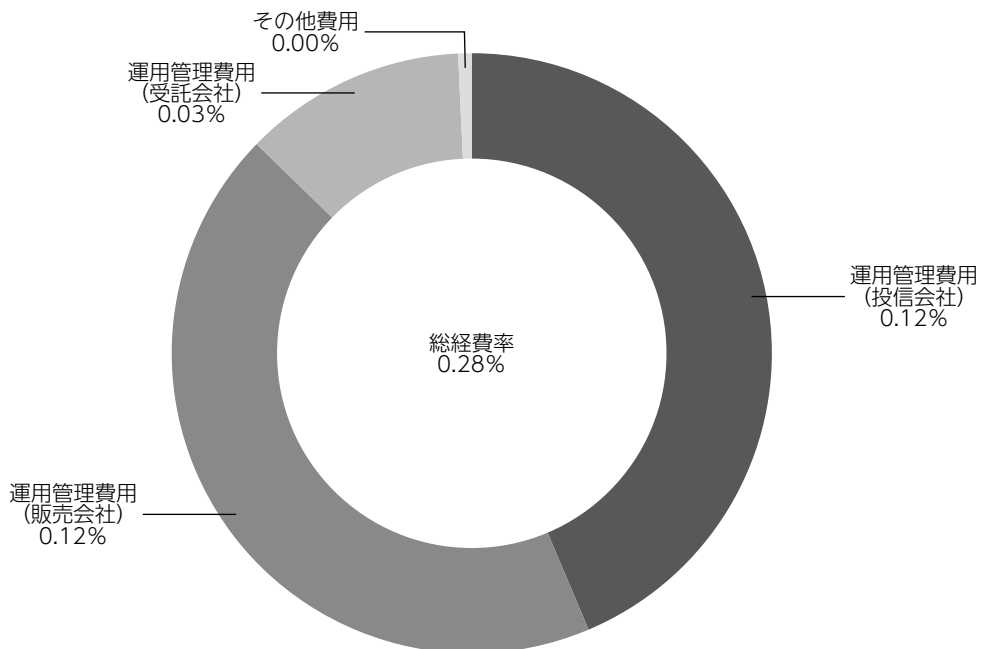
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は「1万口当たりのそれぞれの費用金額」を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報)

◆総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.28%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（2023年2月15日から2024年2月14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□ 1,090,974	千円 1,362,407	千□ 1,600,413	千円 1,989,933

■利害関係人との取引状況等（2023年2月15日から2024年2月14日まで）

【D I A M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】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 716,806	百万円 57,522	% 8.0	百万円 727,467	百万円 67,522	% 9.3

平均保有割合 3.4%

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

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□ 13,797,948	千□ 13,288,509	千円 16,396,691

■投資信託財産の構成

2024年2月14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	16,396,691	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	77,616	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	16,474,307	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

(2024年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	16,474,307,800円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	51,853,365
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	16,396,691,435
未 収 入 金	25,763,000
(B) 負 債	76,502,347
未 払 解 約 金	52,895,472
未 払 信 託 報 酬	23,464,311
そ の 他 未 払 費 用	142,564
(C) 純 資 産 総 額(A - B)	16,397,805,453
元 本	14,068,396,266
次 期 繰 越 損 益 金	2,329,409,187
(D) 受 益 権 総 口 数	14,068,396,266口
1 万 口 当 たり 基 準 価 額(C / D)	11,656円

(注) 期首における元本額は14,567,375,924円、当期中における追加設定元本額は2,206,023,410円、同解約元本額は2,705,003,068円です。

■損益の状況

当期 自2023年2月15日 至2024年2月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△12,063円
受 取 利 息	1,749
支 払 利 息	△13,812
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△104,901,615
売 買 益	22,783,624
売 買 損	△127,685,239
(C) 信 託 報 酬 等	△47,589,805
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△152,503,483
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△487,611,014
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	2,969,523,684
(配 当 等 相 当 額)	(2,602,644,835)
(売 買 損 益 相 当 額)	(366,878,849)
(G) 合 計(D + E + F)	2,329,409,187
次 期 繰 越 損 益 金(G)	2,329,409,187
追 加 信 託 差 損 益 金	2,969,523,684
(配 当 等 相 当 額)	(2,602,644,835)
(売 買 損 益 相 当 額)	(366,878,849)
分 配 準 備 積 立 金	388,917,144
繰 越 損 益 金	△1,029,031,641

(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	2,602,644,835
(d) 分配準備積立金	388,917,144
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	2,991,561,979
(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。

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21期 (決算日 2024年2月14日)

(計算期間 2023年2月15日～2024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21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				
17期 (2020年2月14日)	13,197	1.2	390.72	1.2	99.4	—	—	百万円 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
21期 (2024年2月14日)	12,339	△0.6	365.56	△0.6	99.6	—	—	535,043

(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)。

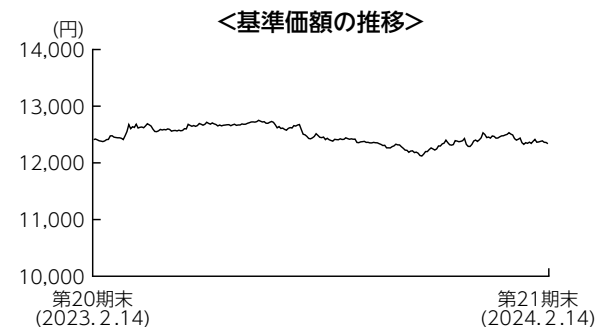
■当期中の基準価額と市況の推移

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) 2023年2月14日	円 12,411	% -	ポイント 367.66	% -	% 99.7	% -	% -
2月 末	12,476	0.5	369.57	0.5	99.6	-	-
3月 末	12,649	1.9	374.74	1.9	99.8	-	-
4月 末	12,680	2.2	375.61	2.2	100.1	-	-
5月 末	12,668	2.1	375.27	2.1	99.7	-	-
6月 末	12,700	2.3	376.29	2.3	99.5	-	-
7月 末	12,505	0.8	370.43	0.8	99.1	-	-
8月 末	12,415	0.0	367.76	0.0	96.7	-	-
9月 末	12,326	△0.7	365.13	△0.7	99.5	-	-
10月 末	12,130	△2.3	359.31	△2.3	99.8	-	-
11月 末	12,385	△0.2	366.88	△0.2	99.4	-	-
12月 末	12,436	0.2	368.38	0.2	99.7	-	-
2024年1月 末	12,344	△0.5	365.75	△0.5	99.6	-	-
(期末) 2024年2月14日	12,339	△0.6	365.56	△0.6	99.6	-	-

(注1) 騰落率は期首比です。

(注2) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2023年2月15日から2024年2月14日まで）

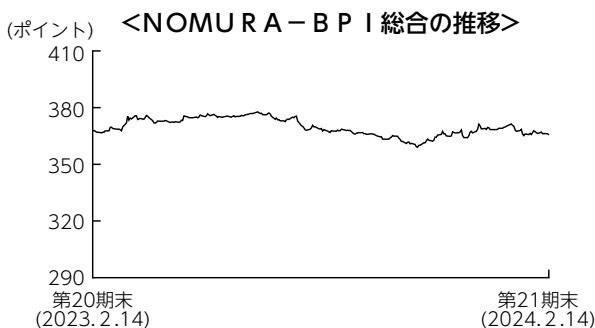


基準価額の推移

当期末の基準価額は12,339円となり、前期末比で0.6%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2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、基準価額は上昇しました。7月以降は、日銀が金融政策を修正する中で、基準価額は下落基調となりました。11月以降は国内債券に対する堅調な需要を受けて基準価額の上昇が見られましたが、2024年1月から期末にかけては日銀が金融政策を追加修正する可能性が高まっ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2023年6月にかけて、日銀の金融政策修正を巡る思惑から、利回りは大きく上下しました。7月以降は、日銀が長短金利操作の運用柔軟化を決めたことなどをを受けて、利回りは上昇しま

した。11月以降は、国内債券に対する堅調な需要を受けて利回りは低下しました。2024年1月から期末にかけては日銀のマイナス金利政策解除の観測が高まったことなどから利回りは上昇しました。

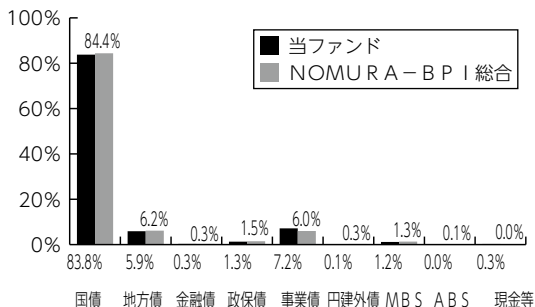
ポートフォリオについて

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。

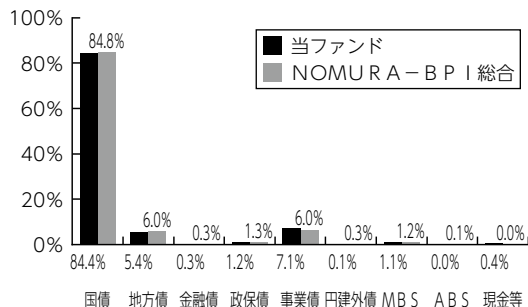
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首 (前期末)

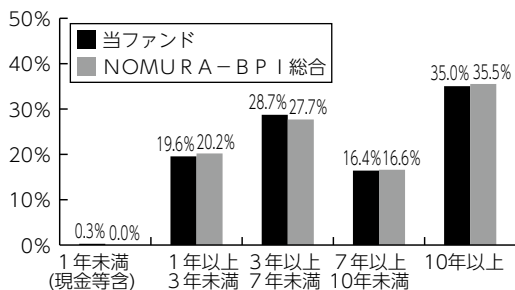


期末

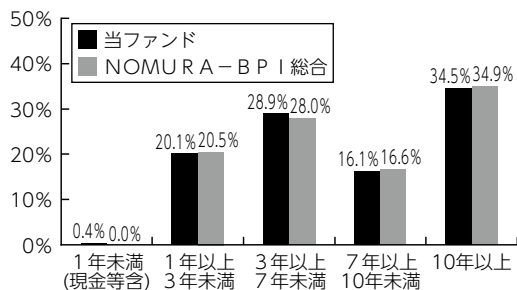


○残存年限別構成比

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0.6%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

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 (2023年2月15日から2024年2月14日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	716,806,028	720,895,402 (-)
	地方債証券	-	3,669,163 (-)
	特殊債証券	-	1,030,325 (316,495)
	社債証券	-	1,872,481 (-)

(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 (2023年2月15日から2024年2月14日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	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 716,806	百万円 57,522	% 8.0	百万円 727,467	百万円 67,522	% 9.3

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

■組入資産の明細

公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 格 以下組入比率	残 存 期 間 別 組 入 比 率		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	464,585,000	451,739,708	84.4	—	52.8	21.6	10.1
地 方 債 証 券	29,139,330	29,000,791	5.4	4.5	3.2	1.7	0.5
特 殊 債 証 券	27,236,846	27,002,386	5.0	—	3.3	1.3	0.5
金 融 債 証 券	1,600,000	1,591,110	0.3	—	—	0.2	0.1
普 通 社 債 証 券	24,520,000	23,641,007	4.4	0.1	2.1	1.8	0.4
合 計	547,081,176	532,975,004	99.6	4.6	61.4	26.7	11.6

(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			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
4 4 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,500,000	1,500,075	2025/03/01
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	3,700,000	3,704,033	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,230,000	3,244,082	2025/03/20
7 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	180,000	184,120	2025/03/20
7 6 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	70,000	71,449	2025/03/20
7 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	40,000	40,872	2025/03/20
4 4 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,000,000	999,940	2025/04/01
4 4 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,000,000	1,999,620	2025/05/01
4 4 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	1,800,000	1,799,406	2025/06/01
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,980,000	3,999,462	2025/06/20
7 8 回 利付国庫債券 (20年)	1.9000	250,000	256,255	2025/06/20
7 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	50,000	51,318	2025/06/20
8 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	90,000	92,493	2025/06/20
4 5 1 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	12,500,000	12,489,875	2025/08/01
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	7,300,000	7,303,431	2025/09/20
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	3,300,000	3,317,325	2025/09/20
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	400,000	412,292	2025/09/20
8 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	140,000	144,526	2025/09/20
4 5 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	2,900,000	2,894,548	2025/12/01
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	4,700,000	4,699,530	2025/12/20
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	3,620,000	3,632,959	2025/12/20
8 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	70,000	72,569	2025/12/20
8 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	170,000	175,927	2025/12/20

銘 柄	当 期			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)	%	千円	千円	
4 5 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.1000	900,000	899,658	2026/01/01
1 4 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,750,000	5,736,200	2026/03/20
3 4 2 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,520,000	3,518,521	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	590,000	614,355	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	120,000	125,454	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	120,000	125,204	2026/03/20
1 4 8 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	3,610,000	3,599,855	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,090,000	4,087,586	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	590,000	619,966	2026/06/20
8 9 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	10,484	2026/06/20
1 4 9 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,680,000	1,674,556	2026/09/20
3 4 4 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	3,570,000	3,567,215	2026/09/20
9 0 回 利付国庫債券 (20年)	2.2000	470,000	495,154	2026/09/20
9 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.3000	110,000	116,172	2026/09/20
1 5 0 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,470,000	1,464,575	2026/12/20
3 4 5 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,890,000	4,885,110	2026/12/20
9 2 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	1,160,000	1,224,565	2026/12/20
1 5 1 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	1,900,000	1,891,507	2027/03/20
1 5 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	1,890,000	1,887,089	2027/03/20
3 4 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.1000	4,540,000	4,533,008	2027/03/20
9 3 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	370,000	391,115	2027/03/20
9 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.1000	670,000	710,293	2027/03/20
1 5 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	5,210,000	5,179,677	2027/06/20

銘柄	当	期		末
		利率	額面金額	
(国債証券)	%	千円	千円	
347回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,500,000	4,488,030	2027/06/20
95回 利付国庫債券(20年)	2.3000	550,000	588,835	2027/06/20
96回 利付国庫債券(20年)	2.1000	120,000	127,675	2027/06/20
154回 利付国庫債券(5年)	0.1000	1,400,000	1,394,750	2027/09/20
348回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,070,000	4,054,737	2027/09/20
97回 利付国庫債券(20年)	2.2000	660,000	707,104	2027/09/20
98回 利付国庫債券(20年)	2.1000	160,000	170,848	2027/09/20
155回 利付国庫債券(5年)	0.3000	5,700,000	5,715,162	2027/12/20
156回 利付国庫債券(5年)	0.2000	4,300,000	4,295,055	2027/12/20
349回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,850,000	5,820,984	2027/12/20
99回 利付国庫債券(20年)	2.1000	750,000	803,587	2027/12/20
157回 利付国庫債券(5年)	0.2000	4,400,000	4,389,308	2028/03/20
158回 利付国庫債券(5年)	0.1000	3,600,000	3,576,672	2028/03/20
350回 利付国庫債券(10年)	0.1000	6,600,000	6,557,232	2028/03/20
100回 利付国庫債券(20年)	2.2000	830,000	895,528	2028/03/20
101回 利付国庫債券(20年)	2.4000	230,000	250,021	2028/03/20
159回 利付国庫債券(5年)	0.1000	2,100,000	2,083,326	2028/06/20
160回 利付国庫債券(5年)	0.2000	900,000	896,715	2028/06/20
161回 利付国庫債券(5年)	0.3000	1,700,000	1,700,714	2028/06/20
351回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,400,000	2,380,944	2028/06/20
102回 利付国庫債券(20年)	2.4000	500,000	545,590	2028/06/20
103回 利付国庫債券(20年)	2.3000	160,000	173,902	2028/06/20
104回 利付国庫債券(20年)	2.1000	110,000	118,614	2028/06/20
162回 利付国庫債券(5年)	0.3000	1,400,000	1,398,726	2028/09/20
163回 利付国庫債券(5年)	0.4000	3,000,000	3,010,860	2028/09/20
352回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,950,000	4,900,648	2028/09/20
105回 利付国庫債券(20年)	2.1000	640,000	691,891	2028/09/20
106回 利付国庫債券(20年)	2.2000	500,000	542,805	2028/09/20
164回 利付国庫債券(5年)	0.2000	1,700,000	1,687,437	2028/12/20
353回 利付国庫債券(10年)	0.1000	3,690,000	3,646,900	2028/12/20
107回 利付国庫債券(20年)	2.1000	600,000	650,166	2028/12/20
108回 利付国庫債券(20年)	1.9000	690,000	741,115	2028/12/20
354回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,460,000	2,428,020	2029/03/20
109回 利付国庫債券(20年)	1.9000	350,000	377,223	2029/03/20
110回 利付国庫債券(20年)	2.1000	440,000	478,627	2029/03/20
355回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,130,000	4,072,634	2029/06/20
111回 利付国庫債券(20年)	2.2000	460,000	504,629	2029/06/20
112回 利付国庫債券(20年)	2.1000	740,000	807,909	2029/06/20
356回 利付国庫債券(10年)	0.1000	2,700,000	2,660,040	2029/09/20
1回 利付国庫債券(30年)	2.8000	110,000	124,787	2029/09/20
113回 利付国庫債券(20年)	2.1000	1,370,000	1,501,136	2029/09/20
357回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,800,000	5,707,142	2029/12/20
114回 利付国庫債券(20年)	2.1000	410,000	450,827	2029/12/20
115回 利付国庫債券(20年)	2.2000	360,000	397,911	2029/12/20
2回 利付国庫債券(30年)	2.4000	100,000	111,942	2030/02/20
358回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,150,000	5,059,617	2030/03/20
116回 利付国庫債券(20年)	2.2000	530,000	587,589	2030/03/20

銘柄	当	期		末
		利率	額面金額	
(国債証券)	%	千円	千円	
117回 利付国庫債券(20年)	2.1000	470,000	518,273	2030/03/20
359回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,050,000	3,971,146	2030/06/20
118回 利付国庫債券(20年)	2.0000	555,000	610,111	2030/06/20
119回 利付国庫債券(20年)	1.8000	470,000	510,857	2030/06/20
360回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,100,000	4,010,661	2030/09/20
121回 利付国庫債券(20年)	1.9000	640,000	700,774	2030/09/20
122回 利付国庫債券(20年)	1.8000	570,000	620,473	2030/09/20
4回 利付国庫債券(30年)	2.9000	200,000	232,534	2030/11/20
361回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,500,000	5,366,845	2030/12/20
123回 利付国庫債券(20年)	2.1000	350,000	388,598	2030/12/20
362回 利付国庫債券(10年)	0.1000	4,210,000	4,097,466	2031/03/20
125回 利付国庫債券(20年)	2.2000	600,000	671,682	2031/03/20
126回 利付国庫債券(20年)	2.0000	510,000	563,733	2031/03/20
127回 利付国庫債券(20年)	1.9000	540,000	593,184	2031/03/20
363回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,070,000	4,919,370	2031/06/20
128回 利付国庫債券(20年)	1.9000	370,000	406,974	2031/06/20
364回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,950,000	5,754,780	2031/09/20
130回 利付国庫債券(20年)	1.8000	910,000	995,094	2031/09/20
6回 利付国庫債券(30年)	2.4000	200,000	227,966	2031/11/20
365回 利付国庫債券(10年)	0.1000	5,430,000	5,236,366	2031/12/20
132回 利付国庫債券(20年)	1.7000	30,000	32,606	2031/12/20
133回 利付国庫債券(20年)	1.8000	630,000	689,472	2031/12/20
366回 利付国庫債券(10年)	0.2000	4,880,000	4,731,208	2032/03/20
134回 利付国庫債券(20年)	1.8000	200,000	219,108	2032/03/20
135回 利付国庫債券(20年)	1.7000	130,000	141,415	2032/03/20
136回 利付国庫債券(20年)	1.6000	360,000	388,825	2032/03/20
367回 利付国庫債券(10年)	0.2000	5,700,000	5,510,076	2032/06/20
137回 利付国庫債券(20年)	1.7000	480,000	522,571	2032/06/20
138回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,060,000	1,136,691	2032/06/20
139回 利付国庫債券(20年)	1.6000	980,000	1,058,694	2032/06/20
368回 利付国庫債券(10年)	0.2000	4,750,000	4,577,860	2032/09/20
140回 利付国庫債券(20年)	1.7000	850,000	925,658	2032/09/20
369回 利付国庫債券(10年)	0.5000	5,220,000	5,150,208	2032/12/20
141回 利付国庫債券(20年)	1.7000	1,060,000	1,155,007	2032/12/20
142回 利付国庫債券(20年)	1.8000	430,000	472,342	2032/12/20
370回 利付国庫債券(10年)	0.5000	4,900,000	4,822,384	2033/03/20
143回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,230,000	1,329,716	2033/03/20
144回 利付国庫債券(20年)	1.5000	750,000	804,367	2033/03/20
371回 利付国庫債券(10年)	0.4000	5,200,000	5,058,716	2033/06/20
11回 利付国庫債券(30年)	1.7000	250,000	272,517	2033/06/20
145回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,250,000	2,452,657	2033/06/20
372回 利付国庫債券(10年)	0.8000	5,300,000	5,338,001	2033/09/20
12回 利付国庫債券(30年)	2.1000	230,000	259,299	2033/09/20
146回 利付国庫債券(20年)	1.7000	2,240,000	2,442,473	2033/09/20
373回 利付国庫債券(10年)	0.6000	1,200,000	1,182,948	2033/12/20
13回 利付国庫債券(30年)	2.0000	150,000	167,725	2033/12/20
147回 利付国庫債券(20年)	1.6000	1,290,000	1,393,703	2033/12/20

銘柄	当	期		末
		利率	額面金額	
(国債証券)	%	千円	千円	
14回 利付国庫債券(30年)	2.4000	340,000	393,546	2034/03/20
148回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,730,000	2,922,055	2034/03/20
15回 利付国庫債券(30年)	2.5000	260,000	303,960	2034/06/20
149回 利付国庫債券(20年)	1.5000	2,290,000	2,450,139	2034/06/20
16回 利付国庫債券(30年)	2.5000	240,000	280,944	2034/09/20
150回 利付国庫債券(20年)	1.4000	2,930,000	3,103,192	2034/09/20
17回 利付国庫債券(30年)	2.4000	270,000	313,731	2034/12/20
151回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,160,000	3,279,574	2034/12/20
18回 利付国庫債券(30年)	2.3000	400,000	461,116	2035/03/20
152回 利付国庫債券(20年)	1.2000	2,440,000	2,529,108	2035/03/20
19回 利付国庫債券(30年)	2.3000	280,000	323,002	2035/06/20
153回 利付国庫債券(20年)	1.3000	2,740,000	2,866,067	2035/06/20
20回 利付国庫債券(30年)	2.5000	330,000	388,287	2035/09/20
154回 利付国庫債券(20年)	1.2000	3,020,000	3,121,653	2035/09/20
21回 利付国庫債券(30年)	2.3000	310,000	357,981	2035/12/20
155回 利付国庫債券(20年)	1.0000	2,280,000	2,301,933	2035/12/20
22回 利付国庫債券(30年)	2.5000	290,000	341,709	2036/03/20
156回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,280,000	2,140,509	2036/03/20
23回 利付国庫債券(30年)	2.5000	350,000	412,664	2036/06/20
157回 利付国庫債券(20年)	0.2000	2,580,000	2,353,218	2036/06/20
158回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,140,000	2,018,041	2036/09/20
25回 利付国庫債券(30年)	2.3000	330,000	381,212	2036/12/20
159回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,840,000	1,750,244	2036/12/20
26回 利付国庫債券(30年)	2.4000	620,000	724,240	2037/03/20
160回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,820,000	1,747,691	2037/03/20
161回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,760,000	1,662,443	2037/06/20
27回 利付国庫債券(30年)	2.5000	620,000	732,170	2037/09/20
162回 利付国庫債券(20年)	0.6000	1,930,000	1,816,940	2037/09/20
163回 利付国庫債券(20年)	0.6000	2,430,000	2,278,538	2037/12/20
28回 利付国庫債券(30年)	2.5000	770,000	909,832	2038/03/20
164回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,750,000	2,533,245	2038/03/20
165回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,250,000	2,063,587	2038/06/20
29回 利付国庫債券(30年)	2.4000	860,000	1,003,749	2038/09/20
166回 利付国庫債券(20年)	0.7000	1,540,000	1,447,061	2038/09/20
167回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,350,000	2,136,009	2038/12/20
30回 利付国庫債券(30年)	2.3000	880,000	1,014,041	2039/03/20
168回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,590,000	1,416,610	2039/03/20
169回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,520,000	1,326,412	2039/06/20
31回 利付国庫債券(30年)	2.2000	720,000	818,337	2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,900,000	1,649,352	2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)	0.3000	1,740,000	1,502,507	2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)	2.3000	970,000	1,114,646	2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,380,000	1,205,098	2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,360,000	2,050,202	2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,180,000	1,299,840	2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)	0.4000	2,400,000	2,074,008	2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,020,000	1,767,378	2040/12/20

銘柄	当	期		末
		利率	額面金額	
(国債証券)	%	千円	千円	
34回 利付国庫債券(30年)	2.2000	1,200,000	1,355,760	2041/03/20
176回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,500,000	2,177,675	2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)	0.4000	1,750,000	1,490,195	2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,060,000	1,162,088	2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,800,000	2,416,932	2041/09/20
179回 利付国庫債券(20年)	0.5000	2,200,000	1,890,306	2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)	2.0000	1,370,000	1,499,465	2042/03/20
180回 利付国庫債券(20年)	0.8000	2,520,000	2,277,072	2042/03/20
181回 利付国庫債券(20年)	0.9000	1,900,000	1,742,262	2042/06/20
37回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,360,000	1,464,638	2042/09/20
182回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,150,000	2,035,319	2042/09/20
183回 利付国庫債券(20年)	1.4000	1,700,000	1,688,661	2042/12/20
38回 利付国庫債券(30年)	1.8000	850,000	898,509	2043/03/20
184回 利付国庫債券(20年)	1.1000	1,880,000	1,769,700	2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)	1.9000	1,210,000	1,297,144	2043/06/20
185回 利付国庫債券(20年)	1.1000	2,100,000	1,969,632	2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)	1.8000	1,030,000	1,085,002	2043/09/20
186回 利付国庫債券(20年)	1.5000	1,900,000	1,904,313	2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,060,000	1,095,764	2043/12/20
187回 利付国庫債券(20年)	1.3000	500,000	482,860	2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,000,000	1,032,470	2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,410,000	1,453,949	2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)	1.7000	1,130,000	1,163,719	2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,150,000	1,141,835	2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)	1.5000	1,870,000	1,853,656	2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)	1.6000	1,340,000	1,349,661	2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,720,000	1,667,454	2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)	1.4000	1,300,000	1,257,906	2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,150,000	982,985	2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)	0.3000	1,520,000	1,153,011	2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)	0.5000	1,500,000	1,188,690	2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)	0.6000	1,220,000	986,199	2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,790,000	1,510,348	2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,080,000	908,452	2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,040,000	872,092	2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,730,000	1,446,193	2047/12/20
1回 利付国庫債券(40年)	2.4000	110,000	126,511	2048/03/20
58回 利付国庫債券(30年)	0.8000	1,660,000	1,383,377	2048/03/20
59回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,120,000	907,625	2048/06/20
60回 利付国庫債券(30年)	0.9000	1,330,000	1,126,895	2048/09/20
61回 利付国庫債券(30年)	0.7000	1,060,000	852,515	2048/12/20
2回 利付国庫債券(40年)	2.2000	330,000	365,445	2049/03/20
62回 利付国庫債券(30年)	0.5000	720,000	547,336	2049/03/20
63回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,100,000	810,128	2049/06/20
64回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	952,718	2049/09/20
65回 利付国庫債券(30年)	0.4000	1,300,000	948,844	2049/12/20
3回 利付国庫債券(40年)	2.2000	540,000	596,343	2050/03/20

銘	柄	当 期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)				
6 6回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,090,000	791,677 2050/03/20
6 7回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,270,000	971,626 2050/06/20
6 8回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,340,000	1,021,401 2050/09/20
6 9回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,360,000	1,062,323 2050/12/20
4回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	720,000	793,389 2051/03/20
7 0回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,400,000	1,089,788 2051/03/20
7 1回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,480,000	1,148,021 2051/06/20
7 2回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,290,000	997,118 2051/09/20
7 3回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,390,000	1,071,606 2051/12/20
5回	利付国庫債券 (40年)	2.0000	710,000	749,781 2052/03/20
7 4回	利付国庫債券 (30年)	1.0000	1,390,000	1,160,872 2052/03/20
7 5回	利付国庫債券 (30年)	1.3000	1,320,000	1,188,316 2052/06/20
7 6回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,320,000	1,215,733 2052/09/20
7 7回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,600,000	1,543,632 2052/12/20
6回	利付国庫債券 (40年)	1.9000	940,000	969,976 2053/03/20
7 8回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,800,000	1,653,048 2053/03/20
7 9回	利付国庫債券 (30年)	1.2000	1,600,000	1,396,880 2053/06/20
8 0回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,700,000	1,713,226 2053/09/20
8 1回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	200,000	192,046 2053/12/20
7回	利付国庫債券 (40年)	1.7000	880,000	864,503 2054/03/20
8回	利付国庫債券 (40年)	1.4000	990,000	900,286 2055/03/20
9回	利付国庫債券 (40年)	0.4000	1,890,000	1,252,408 2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (40年)	0.9000	1,930,000	1,499,783 2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (40年)	0.8000	1,040,000	775,236 2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	1,420,000	938,236 2059/03/20
1 3回	利付国庫債券 (40年)	0.5000	2,090,000	1,362,889 2060/03/20
1 4回	利付国庫債券 (40年)	0.7000	2,100,000	1,461,096 2061/03/20
1 5回	利付国庫債券 (40年)	1.0000	2,340,000	1,795,271 2062/03/20
1 6回	利付国庫債券 (40年)	1.3000	1,700,000	1,429,513 2063/03/20
小	計	-	464,585,000	451,739,708 -
(地方債証券)				
5回	東京都公募債 20年	2.1100	100,000	102,178 2025/03/19
2 1 3回	神奈川県公募債	0.5340	100,000	100,461 2025/03/19
1 4 4回	共同発行市場公募地方債	0.4700	400,000	401,568 2025/03/25
1 4 6回	共同発行市場公募地方債	0.5530	600,000	603,186 2025/05/23
2 7年度 4回	千葉県公募債	0.6020	200,000	201,294 2025/07/25
1 4 8回	共同発行市場公募地方債	0.5530	500,000	502,880 2025/07/25
7回	東京都公募債 20年	2.1600	100,000	103,173 2025/09/19
1回	静岡県公募債 20年	2.1800	100,000	103,196 2025/09/19
1 5 0回	共同発行市場公募地方債	0.5100	300,000	301,635 2025/09/25
2 7年度 1 5回	愛知県公募債 10年	0.4710	100,000	100,483 2025/11/27
1 5 3回	共同発行市場公募地方債	0.4690	100,000	100,479 2025/12/25
2 7年度 9回	千葉県公募債	0.0950	100,000	99,716 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,607 2026/04/24
9回	東京都公募債 20年	2.4400	200,000	210,298 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	199,224 2026/06/25
1 6 0回	共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	497,755 2026/07/24

銘	柄	当 期 末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(地方債証券)				
1回	兵庫県公募債 15年	1.6600	200,000	206,898 2026/07/29
2 8年度 6回	北海道公募債	0.0700	100,000	99,557 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募債	0.0450	100,000	99,497 2026/09/18
1 0回	東京都公募債 20年	2.3300	300,000	316,152 2026/09/18
4回	京都市公募債 20年	2.5100	100,000	105,820 2026/09/18
4 1 3回	大阪府公募債 10年	0.0210	100,000	99,385 2026/10/28
1 9 0回	大阪府公募債 5年	0.0010	300,000	297,792 2026/12/25
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	498,905 2027/01/25
令和3年度 3回	仙台市公募債 5年	0.0010	300,000	297,768 2027/01/28
2 8年度 8回	福岡県公募債	0.2400	100,000	99,941 2027/02/24
1 6 9回	共同発行市場公募地方債	0.2050	500,000	498,950 2027/04/23
4 1 9回	大阪府公募債 10年	0.1960	100,000	99,713 2027/04/27
2回	静岡県公募債 15年	1.4060	100,000	103,695 2027/06/25
5回	兵庫県公募債 12年	0.6870	100,000	101,282 2027/07/07
1 7 3回	共同発行市場公募地方債	0.2150	400,000	398,672 2027/08/25
2 9年度 4回	大阪市公募債	0.1500	200,000	198,716 2027/09/21
1 7 4回	共同発行市場公募地方債	0.1450	100,000	99,375 2027/09/24
2 4年度 1回	福岡県公募債 15年	1.3290	100,000	103,700 2027/11/29
1 7 8回	共同発行市場公募地方債	0.2300	100,000	99,513 2028/01/25
1 7 9回	共同発行市場公募地方債	0.2400	500,000	497,510 2028/02/25
2 9年度 6回	広島市公募債	0.2300	300,000	298,389 2028/02/25
2 9年度 1 3回	京都府公募債	0.2000	109,330	108,537 2028/03/16
5回	兵庫県公募債 15年	1.3100	300,000	311,415 2028/05/26
7 8 3回	東京都公募債	0.2200	110,000	109,153 2028/06/20
4回	静岡県公募債 15年	1.3380	100,000	104,014 2028/06/23
3 0年度 8回	北海道公募債	0.2490	400,000	396,768 2028/08/31
3 0年度 7回	神戸市公募債 30年	0.2540	300,000	297,681 2028/09/20
第 9 1回	川崎市公募債	0.1850	200,000	197,832 2028/09/20
7回	静岡県公募債 20年	2.3200	300,000	325,803 2028/09/21
3 0年度 3回	広島県公募債	0.2540	100,000	99,224 2028/09/25
3 0年度 3回	堺市公募債	0.1950	100,000	98,742 2028/12/19
2 3 7回	神奈川県公募債	0.1350	200,000	197,008 2028/12/20
2 0回 2号	福岡県公募債	2.0500	100,000	107,617 2028/12/20
6回	大阪市公募債 20年	2.2100	200,000	216,702 2028/12/20
1 7回	横浜市公募債 20年	2.0700	100,000	107,737 2028/12/20
6回	北九州市公募債 20年	2.0300	100,000	107,471 2028/12/20
3 0年度 6回	福岡県公募債	0.2000	200,000	197,622 2028/12/21
1 8 9回	共同発行市場公募地方債	0.2100	100,000	98,855 2028/12/25
3 0年度 1 4回	北海道公募債	0.1950	400,000	394,936 2028/12/28
1 8回	東京都公募債 20年	2.2200	100,000	108,736 2029/03/19
3 0年度 1 9回	愛知県公募債	0.1150	200,000	196,408 2029/03/28
3 0年度 3回	岡山県公募債 10年	0.1500	200,000	196,756 2029/03/29
1 9 4回	共同発行市場公募地方債	0.1100	300,000	294,294 2029/05/25
6回	川崎市公募債 20年	2.2100	200,000	217,928 2029/05/25
令和元年度 1回	福岡県公募債	0.0290	200,000	195,300 2029/06/21
9回	兵庫県公募債 15年	1.0200	100,000	102,798 2029/07/13
1 1回	神奈川県公募債 20年	2.0800	100,000	108,530 2029/07/20

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	
196回 共同発行市場公募地方債	0.0600	500,000	488,870	2029/07/25
796回 東京都公募公債	0.0400	200,000	195,152	2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募公債	0.0500	200,000	195,262	2029/09/20
令和元年度3回 横浜市公募公債	0.0500	400,000	390,400	2029/10/16
令和元年度16回 兵庫県公募公債	0.0500	200,000	195,074	2029/10/23
21回 東京都公募公債 20年	2.1900	100,000	109,761	2029/12/20
17回 さいたま市公募公債	0.1100	200,000	195,662	2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募公債	0.1350	200,000	195,830	2030/01/30
21年度2回 福岡県公募公債 (20年)	2.2300	100,000	110,220	2030/02/22
203回 共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	97,629	2030/02/25
802回 東京都公募公債	0.1300	400,000	391,140	2030/03/19
511回 名古屋市長公募公債 10年	0.0750	200,000	194,898	2030/03/27
令和2年度1回 京都府公募公債	0.1350	400,000	390,784	2030/04/12
令和2年 2回 大阪府公募公債	0.1310	300,000	292,668	2030/05/22
9回 埼玉県公募公債 20年	2.1500	100,000	110,017	2030/05/24
8回 静岡県公募公債 15年	0.8280	200,000	203,708	2030/06/07
令和2年度 10回 静岡県公募公債	0.1350	100,000	97,296	2030/09/20
令和2年5回 福岡県公募公債	0.1350	100,000	97,228	2030/10/23
36回2年 宮城県公募公債 10年	0.1350	250,000	242,980	2030/10/28
令和2年度1回 福島県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
令和2年度1回 高知県公募公債	0.1350	200,000	194,252	2030/11/27
22年度14回 愛知県公募公債	2.0870	300,000	330,165	2030/12/13
9回 京都市公募公債 20年	2.1430	200,000	220,734	2030/12/17
813回 東京都公募公債	0.1790	300,000	292,077	2030/12/20
16回 神奈川県公募公債 20年	2.0900	300,000	330,453	2031/01/24
464回 大阪府公募公債 10年	0.0720	200,000	192,918	2031/01/28
令和2年度19回 北海道公募公債	0.1450	100,000	96,870	2031/02/26
令和2年度14回 京都府公募公債	0.2140	200,000	194,634	2031/03/12
令和2年 7回 広島県公募公債	0.2140	200,000	194,680	2031/03/19
251回 神奈川県公募公債 10年	0.1990	200,000	194,474	2031/03/20
令和2年度 14回 静岡県公募公債	0.1400	200,000	193,670	2031/03/20
令和3年度1回 長野県公募公債 10年	0.1900	200,000	194,180	2031/04/16
令和3年度2回 兵庫県公募公債	0.1750	100,000	96,880	2031/04/25
467回 大阪府公募公債 10年	0.1640	200,000	193,604	2031/04/28
469回 大阪府公募公債 10年	0.1280	200,000	192,658	2031/06/27
11回 北九州市公募公債 20年	2.0190	300,000	329,586	2031/07/18
令和3年 5回 千葉県公募公債	0.1050	200,000	191,810	2031/09/25
472回 大阪府公募公債 10年	0.1000	200,000	191,586	2031/09/29
474回 大阪府公募公債 10年	0.1190	300,000	287,223	2031/11/28
19回 神奈川県公募公債 20年	1.8180	100,000	108,645	2032/01/30
227回 共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	482,465	2032/02/25
228回 共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	480,210	2032/03/25
258回 神奈川県公募公債 10年	0.2900	300,000	289,497	2032/06/18
24年度2回 福岡県公募公債 (20年)	1.6350	300,000	321,906	2032/08/16
10回 大阪府公募公債 20年	1.7200	200,000	215,816	2032/09/24
24年度12回 神戸市公募公債	1.7110	200,000	215,950	2032/12/17
14回 千葉県公募公債 20年	1.1370	100,000	102,889	2033/04/15

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	
13回 埼玉県公募公債 20年	1.5990	100,000	106,953	2033/05/20
1回 東京都公募公債 30年	2.2100	200,000	224,866	2033/06/20
14回 埼玉県公募公債 20年	1.5460	300,000	318,219	2034/05/08
26年度4回 愛知県公募公債 20年	1.5420	200,000	212,100	2034/05/15
29回 横浜市公募公債 20年	1.5280	100,000	105,940	2034/05/26
16回 名古屋市長公募公債 20年	1.5200	100,000	105,842	2034/06/09
5回 群馬県公募公債 20年	1.5290	100,000	105,941	2034/06/16
17回 北九州市公募公債 20年	1.5290	100,000	105,799	2034/06/20
31回 東京都公募公債 20年	1.2380	200,000	205,728	2034/09/20
15回 埼玉県公募公債 20年	1.1660	100,000	101,888	2035/02/16
2回 横浜市公募公債 30年	2.4900	100,000	115,694	2035/03/20
18回 千葉県公募公債 20年	1.1380	100,000	101,490	2035/04/13
17回 名古屋市長公募公債 20年	1.2030	100,000	102,088	2035/05/28
13回 大阪府公募公債 20年	1.2030	100,000	101,743	2035/09/28
14回 大阪府公募公債 20年	0.5400	100,000	93,216	2036/09/29
21回 千葉県公募公債 20年	0.4240	100,000	91,915	2036/10/15
3回 神奈川県公募公債 30年	2.6200	100,000	117,612	2037/03/19
29年度2回 広島市公募公債	0.6160	200,000	185,874	2037/08/18
29年度5回 札幌市公募公債 20年	0.5970	300,000	277,719	2037/09/18
30年度2回 仙台市公募公債 20年	0.7290	100,000	92,618	2038/10/18
30年度7回 福岡市公募公債	0.7010	200,000	184,544	2038/10/19
2019年度5回 福岡市長公募公債 20年	0.2860	100,000	85,242	2039/07/29
2回 兵庫県公募公債 30年	2.3600	100,000	113,464	2040/03/19
22年度8回 福岡市公募公債	2.2800	100,000	112,418	2040/09/20
令和2年 2回 広島県公募公債	0.4640	100,000	85,941	2040/09/21
23年度7回 札幌市公募公債 30年	2.0970	100,000	109,178	2041/09/20
5回 川崎市公募公債 30年	2.0970	100,000	108,991	2042/03/20
24年度12回 愛知県公募公債 30年	2.1200	100,000	109,203	2042/09/19
14回 東京都公募公債 30年	2.0500	100,000	107,627	2043/06/19
27年度8回 愛知県公募公債 30年	1.5790	150,000	147,594	2045/06/20
27年度2回 広島県公募公債 30年	0.7110	100,000	81,807	2046/03/22
6回 埼玉県公募公債 30年	0.9570	200,000	171,040	2046/12/20
令和元年度7回 愛知県公募公債	0.3690	300,000	212,850	2049/06/18
令和元年3回 福岡県公募公債 30年	0.4320	200,000	144,450	2049/06/18
12回 埼玉県公募公債 30年	0.4740	300,000	217,158	2049/12/20
令和3年度6回 神戸市公募公債 30年	0.7130	200,000	151,146	2051/06/20
小 計	-	29,139,330	29,000,791	-
(特殊債券)	%	千円	千円	
21回 政保中部国際空港債	0.4500	100,000	100,401	2025/03/17
24回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4500	500,000	502,040	2025/03/31
71回 政保地方公共団体金融機構債券	0.3910	100,000	100,349	2025/04/25
6回 沖縄振興開発金融公庫債券	2.0400	400,000	409,928	2025/06/20
21回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.6210	100,000	100,571	2025/06/20
254回 政保日本高速道路保有・債務返済機構債	0.4400	100,000	100,469	2025/08/29
127回 日本政策投資銀行債券	0.0400	100,000	99,706	2025/09/19
85回 中日本高速道路債券	0.0700	300,000	298,986	2025/10/21
172回 住宅金融支援機構債券	0.5010	100,000	100,443	2025/11/20

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	
2 3 回 国際協力銀行債券	2.0900	100,000	103,358	2025/12/19
6 1 回 住宅金融支援機構債券	1.8300	100,000	102,881	2025/12/19
F 5 3 8 回 地方公共団体金融機構債券	0.0200	500,000	497,820	2025/12/25
4 0 回 政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,648	2026/03/13
3 3 回 政保日本政策投資銀行社債	0.0200	300,000	298,941	2026/03/16
8 7 回 中日本高速道路債券	0.0600	400,000	397,924	2026/03/18
1 1 回 独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	104,754	2026/03/20
2 7 1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	298,920	2026/03/31
1 8 7 回 住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,599	2026/04/20
8 3 回 地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	398,380	2026/04/28
8 0 回 住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	103,368	2026/09/18
3 2 1 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
3 2 5 回 住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	496,460	2026/09/18
7 9 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	309,873	2026/11/06
9 1 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	99,662	2026/12/14
3 0 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	99,707	2027/01/29
F 1 4 7 回 地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	206,076	2027/03/19
7 8 回 日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	299,007	2027/04/13
3 0 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	797,536	2027/04/30
9 6 回 地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	497,990	2027/05/28
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	198,316	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	99,661	2027/07/16
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	297,939	2027/11/19
1 0 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1550	100,000	99,449	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	103,914	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	296,307	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	298,044	2028/02/18
1 1 3 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.2190	100,000	99,208	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	206,138	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	214,862	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	102,925	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	327,294	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	328,032	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	204,900	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	217,514	2029/09/20
9 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	109,439	2029/12/28
7 8 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.8010	100,000	101,254	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	203,884	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	216,362	2030/10/29
1 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	541,375	2030/10/31
1 2 1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	109,893	2031/01/28
9 0 回 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券	0.2000	200,000	192,776	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	383,484	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	108,901	2031/09/19
1 5 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	108,696	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	216,450	2031/12/26
1 5 6 回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	384,036	2032/04/14

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	
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	107,062	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	107,963	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債	1.7240	100,000	107,271	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	214,502	2032/09/28
1 8 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.4000	100,000	105,383	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	586,595	2033/12/20
1 2 4 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.5500	100,000	105,372	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	105,597	2034/04/28
3 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	520,115	2034/09/28
4 2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	298,458	2035/01/26
2 3 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.1600	300,000	306,267	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	100,422	2035/05/18
1 5 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.3000	100,000	102,214	2035/06/20
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	204,606	2035/06/28
2 5 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2780	100,000	103,148	2035/06/29
第 2 6 2 回 政保道路債	1.1090	500,000	504,910	2035/11/30
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	179,802	2036/06/20
2 8 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.3100	200,000	182,272	2036/08/29
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	93,194	2037/04/28
3 1 9 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6300	200,000	187,104	2037/07/31
2 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	233,730	2037/09/18
3 3 7 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.5910	100,000	92,332	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	90,651	2038/04/20
F 1 7 4 回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	323,085	2038/05/28
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	91,457	2038/09/17
5 0 回 高速道路機構債	0.5000	300,000	261,801	2039/03/18
7 7 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	249,837	2039/09/28
1 2 5 回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	423,105	2040/04/24
2 8 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	1.4370	300,000	299,532	2040/07/27
1 1 6 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	100,000	105,683	2040/08/31
4 0 回 貸付債権担保住宅金融公庫債券	1.9300	39,840	39,922	2041/03/10
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	262,347	2043/12/18
2 7 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	14,543	15,049	2044/08/10
2 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	91,485	95,618	2044/10/10
3 6 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	137,552	142,813	2045/05/10
1 5 9 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.6070	100,000	97,988	2045/06/20
3 8 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	19,385	20,065	2045/07/10
1 回 高速道路機構債	2.9900	300,000	365,850	2045/09/20
2 6 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.3900	200,000	190,616	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	90,510	2045/12/20
2 6 8 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.2800	100,000	93,062	2046/01/31
4 9 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	16,717	17,291	2046/06/10
5 2 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	19,533	20,123	2046/09/10
5 3 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	20,588	21,207	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	176,331	2047/03/20
6 0 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	25,093	25,777	2047/05/10
6 4 回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	61,990	63,137	2047/09/10

銘 柄	当 期		末	
	利率	額面金額	評価額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
3 6 回 高速道路機構債	2.8400	300,000	357,984	2048/03/20
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	27,869	28,479	2048/09/10
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	34,215	34,555	2049/03/10
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	34,841	35,184	2049/05/10
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	38,462	38,743	2049/07/10
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	39,819	39,807	2049/11/10
3 9 8 回 政保道路債	0.4220	300,000	215,955	2049/12/28
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	45,186	44,313	2050/02/10
1 0 回 地方公共団体金融機構債券 3 0 年	0.5170	300,000	218,448	2050/04/28
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	50,831	50,142	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	76,186	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	152,808	2050/06/20
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	52,733	52,311	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	148,552	2051/08/31
4 2 0 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6800	200,000	150,504	2051/10/31
1 1 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3400	199,941	190,849	2051/11/10
1 1 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	67,846	65,087	2052/02/10
1 1 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	67,335	64,691	2052/03/10
1 1 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	67,696	64,966	2052/04/10
1 2 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4300	211,506	201,639	2052/11/10
1 2 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	211,575	201,595	2053/01/10
1 3 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	144,312	137,350	2053/03/10
1 3 1 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	215,997	205,032	2053/04/10
1 3 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	214,077	203,291	2053/05/10
1 3 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	373,440	355,589	2053/10/10
1 3 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	74,406	70,786	2053/12/10
1 4 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	76,806	72,208	2054/03/10
1 5 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	248,163	231,548	2055/03/10
1 6 2 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	97,883	2055/03/19
1 5 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	330,528	309,275	2055/05/10
1 6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	254,616	238,524	2055/09/10
1 6 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	260,364	243,979	2056/05/10
1 7 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	794,556	742,520	2056/07/10
4 1 3 回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	135,102	2061/02/28
小 計	-	27,236,846	27,002,386	-
(金融債券)	%	千円	千円	
い第 8 4 3 号 利付商工債	0.1200	100,000	99,735	2025/08/27
3 6 9 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0600	400,000	398,876	2025/08/27
い第 8 5 1 号 利付商工債	0.0900	300,000	298,101	2026/04/27
3 7 7 回 利附信金中金債 (5 年)	0.0400	300,000	298,296	2026/04/27
い第 8 5 4 号 利付商工債	0.0800	300,000	297,708	2026/07/27
い第 8 5 5 号 利付商工債	0.0800	200,000	198,394	2026/08/27
小 計	-	1,600,000	1,591,110	-
(普通社債券)	%	千円	千円	
1 0 回 キリンホールディングス社債	0.6030	100,000	100,381	2025/02/28
2 6 回 西日本高速道路社債	0.6040	100,000	100,504	2025/05/21
2 9 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1900	200,000	199,544	2025/06/11

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	
1 2 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.7810	100,000	100,653	2025/06/20
3 9 回 東日本旅客鉄道社債	2.0500	300,000	307,218	2025/06/20
4 9 7 回 関西電力社債	1.0020	100,000	100,872	2025/06/20
1 3 回 電源開発社債	2.0400	200,000	204,598	2025/06/20
1 2 回 新生銀行社債	0.3600	400,000	398,596	2025/07/09
4 2 回 東日本旅客鉄道社債	2.1100	200,000	205,810	2025/09/19
2 7 回 首都高速道路社債	0.0600	400,000	398,236	2025/12/19
1 4 回 セブン&アイ・ホールディングス社債	0.1900	200,000	199,314	2025/12/19
2 6 回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,672	2026/03/18
4 2 回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,504	2026/03/24
9 6 回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,312	2026/04/15
1 6 3 回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	298,002	2026/04/15
2 8 回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	297,675	2026/04/21
4 9 3 回 九州電力社債	0.1000	200,000	198,446	2026/05/25
1 0 6 回 住友不動産社債	0.4000	100,000	99,866	2026/05/26
2 4 回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	198,476	2026/06/03
4 0 回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	99,148	2026/06/03
3 5 回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	297,507	2026/06/05
1 1 回 グレディ・アグリコル・エス・エー債社債 (2016)	0.4000	100,000	99,016	2026/06/10
5 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,523	2026/06/19
7 9 回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	298,149	2026/06/19
8 3 回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	198,766	2026/06/19
6 1 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,800	2026/06/19
6 9 回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	297,672	2026/06/19
4 回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	125,644	2026/06/19
3 0 7 回 北陸電力社債	1.0550	100,000	101,459	2026/06/25
9 0 回 中日本高速道路債	0.0500	200,000	198,712	2026/07/27
2 0 回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	297,354	2026/07/27
3 回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	296,466	2026/09/04
9 1 回 中日本高速道路債	0.0400	500,000	496,400	2026/09/17
6 2 回 西日本高速道路債	0.0400	500,000	496,395	2026/09/18
1 7 回 パナソニック社債	0.4700	100,000	99,897	2026/09/18
2 7 回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	198,732	2026/10/16
4 8 8 回 東北電力社債	0.2900	100,000	99,574	2026/10/23
3 3 回 西日本高速道路債	0.2700	300,000	299,535	2026/12/14
3 4 回 西日本高速道路債	0.3350	200,000	199,972	2027/02/16
1 2 回 リソナ銀行劣後社債	2.4640	100,000	104,231	2027/03/15
8 8 回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	105,786	2027/04/20
5 0 8 回 関西電力社債	0.4550	300,000	299,376	2027/04/23
3 4 0 回 北海道電力社債	0.4800	300,000	299,703	2027/04/23
1 0 8 回 住友不動産社債	0.4000	200,000	199,262	2027/05/07
3 0 回 東レ社債	0.3750	300,000	298,335	2027/07/16
3 2 回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	106,514	2027/09/17
3 1 1 回 北陸電力社債	0.8470	100,000	100,996	2027/09/24
2 5 回 フランス相互信用金庫銀行 (BF CM) 円債債 (2017)	0.5100	300,000	295,200	2027/10/12
8 1 回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	99,148	2027/10/22
5 2 5 回 東北電力社債	0.2200	200,000	197,394	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	99,222	2027/11/19
1 7 回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	296,820	2027/12/20
5 6 回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	297,744	2028/01/18
1 2 回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	389,284	2028/06/02
7 回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	198,098	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	98,784	2028/10/25
2 1 回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	107,938	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	98,027	2029/04/12
1 4 回 プリザーストン社債	0.3750	300,000	294,570	2029/04/19
8 0 回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	102,704	2029/04/27
5 3 0 回 関西電力社債	0.4050	400,000	392,104	2029/06/20
7 3 回 三井物産社債	0.2900	400,000	390,344	2029/07/11
5 3 2 回 中部電力社債	0.2240	200,000	194,654	2029/07/25
7 回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	290,241	2029/10/11
8 0 回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	193,470	2029/10/19
6 5 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	108,359	2029/12/21
6 7 回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	195,508	2030/01/31
1 9 回 パナソニック社債	0.3700	100,000	97,017	2030/03/05
1 4 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	97,265	2030/04/22
6 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	194,260	2030/05/21
5 2 1 回 東北電力社債	0.4500	400,000	390,836	2030/05/24
4 2 5 回 中国電力社債	0.3700	100,000	97,185	2030/06/25
3 回 ガイドグループHD社債	0.5100	300,000	292,026	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	193,402	2030/08/09
6 回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	193,926	2030/09/17
1 8 回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	388,756	2030/09/20
7 1 回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	107,357	2030/09/27
1 7 回 ダイセル社債	0.5000	300,000	290,607	2030/12/13
8 6 回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	288,195	2030/12/20
7 3 回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	217,508	2030/12/20
2 3 回 パナソニック社債	0.3900	200,000	192,236	2030/12/24
3 0 回 光通信社債	0.9800	200,000	187,466	2031/01/31
7 4 回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	95,906	2031/04/22
4 9 1 回 九州電力社債	0.3400	300,000	287,508	2031/04/25
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	284,229	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	286,134	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	284,712	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	473,415	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	190,592	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	193,142	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	288,636	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	193,290	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	291,132	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	93,318	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	181,972	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	181,886	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	91,027	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	90,425	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	90,459	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	177,542	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	89,098	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	181,828	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	88,282	2038/07/12
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	87,864	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	85,896	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	170,884	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	82,501	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	84,566	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	168,514	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	168,008	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	82,981	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	91,760	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	84,283	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	74,850	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	146,124	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	191,754	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	68,471	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	66,718	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	68,042	2060/12/17
小 計	-	24,520,000	23,641,007	-
合 計	-	547,081,176	532,975,004	-

■投資信託財産の構成

2024年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	532,975,004	99.6
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	2,195,447	0.4
投 資 信 託 財 産 総 額	535,170,451	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

(2024年2月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	535,170,451,990円
一 公 司 債 券 (評価額)	1,146,537,036
一 社 債 (評価額)	532,975,004,601
一 未 払 利 費	851,415,151
(B) 負 債	127,352,000
一 未 払 金	127,352,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	535,043,099,990
一 元 本	433,635,920,893
一 次 期 繰 越 損 益	101,407,179,097
(D) 受 取 権 益 総 額	433,635,920,893円
一 万 口 当 たり 基 準 価 額(C/D)	12,393円
(注1) 期首元本額	446,785,885,792円
追加設定元本額	581,209,223,036円
一部解約元本額	594,359,187,935円
(注2) 期末における元本の内訳	
D I A M国内債券バッシブ・ファンド	26,445,559,786円
M I T O ラップ型ファンド (安定型)	56,606,049円
M I T O ラップ型ファンド (中立的型)	87,780,257円
M I T O ラップ型ファンド (積極型)	46,315,205円
グローバル8資産ラップファンド (安定型)	777,318,271円
グローバル8資産ラップファンド (中立的型)	271,566,704円
グローバル8資産ラップファンド (積極型)	40,009,486円
たわらノーロード 国内債券	19,198,371,011円
たわらノーロード バランス (8資産均等型)	5,643,042,131円
たわらノーロード バランス (堅実型)	1,562,213,631円
たわらノーロード バランス (標準型)	3,036,245,918円
たわらノーロード バランス (積極型)	418,452,135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)	192,215,501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)	2,441,981,254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)	2,731,291,553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)	824,901,392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)	243,747円
たわらノーロード 最適化バランス (保守型)	37,274,547円
たわらノーロード 最適化バランス (安定型)	20,761,641円
たわらノーロード 最適化バランス (安定成長型)	193,622,319円
たわらノーロード 最適化バランス (成長型)	6,019,391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国内債券インデックスファンド<DC年金>	13,288,509,146円
O n e グローバルバランス	99,032,940円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>1安定型	10,956,808,045円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>2安定・成長型	16,342,447,363円
D I A Mバランス・ファンド<DC年金>3成長型	7,495,480,579円
D I A M DCバランス30インデックスファンド	2,655,296,811円
D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,757,571,061円
D I A M DCバランス70インデックスファンド	520,501,398円
マネックス資産設計ファンド (隔月分配型)	74,055,112円
マネックス資産設計ファンド (育成型)	2,816,801,094円
マネックス資産設計ファンド エポリューション	4,416,875円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国10)	5,297,839,731円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国20)	2,349,035,825円
D I A M DC 8資産バランスファンド (新興国30)	482,650,017円
投資のソムリエ	90,500,056,135円
グルーズコントロール	1,148,797,889円
投資のソムリエ<DC年金>	8,880,659,007円
D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	6,325,921,180円
4資産分散投資・ハイクラス<DC年金>	2,157,585,678円
投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	10,420,751,107円
リスク抑制世界8資産バランスファンド	34,063,239,343円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2045)	514,904,079円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2055)	264,258,876円
リスク抑制世界8資産バランスファンド (DC)	91,237,587円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2035)	2,029,090,803円
4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	4,536,190,751円
リスクコントロール世界資産分散ファンド	12,558,314,912円
9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	6,200,480,373円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2040)	679,094,815円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2050)	280,353,329円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2060)	172,141,111円
4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	2,203,233,548円
投資のソムリエ (ターゲット・イヤー2065)	40,681,178円
O n e グローバル最適化バランス (安定型) <ラップ向け>	165,621,139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)	1,183,200,695円
インカム重視マルチアセット運用ファンド2020-06 (適格機関投資家限定)	1,182,101,124円
マルチアセット・インカム戦略ファンド2020-08 (適格機関投資家限定)	1,143,992,121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)	711,889,754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)	1,156,117,973円
インカム重視マルチアセット運用ファンド1 2021-04 (適格機関投資家限定)	3,005,245,833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)	1,992,568,129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)	1,048,536,393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)	2,040,423,197円
予約モデル活用型戦略ファンド2024-01 (適格機関投資家限定)	1,944,132,777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)	10,164,316,653円
O n eコアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	1,179,872,920円
投資のソムリエ・私塾 (適格機関投資家限定)	2,899,325,828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)	597,580,172円
D I A Mワールドバランス25VA (適格機関投資家限定)	267,019,349円
O n e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)	2,397,299,626円
O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドII I (適格機関投資家向け)	2,408,636,925円
O n e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)	2,381,224,582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)	1,953,854,751円
リスコントロール世界8資産バランスファンド (F O F 5用) (適格機関投資家専用)	38,996,223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)	465,443,530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)	149,736,384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)	96,780,040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)	21,757,666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)	57,519,512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)	30,515,732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)	383,617円
D I A M世界バランスファンド40VA (適格機関投資家限定)	2,811,312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)	93,208,060円
D I A Mバランスファンド25VA (適格機関投資家限定)	2,672,002,806円
D I A Mバランスファンド37.5VA (適格機関投資家限定)	2,146,463,178円
D I A Mバランスファンド50VA (適格機関投資家限定)	4,390,842,814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)	56,186,546円
D I A Mグローバル・アセット・バランスVA2 (適格機関投資家限定)	133,021,861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)	1,599,270,553円
D I A M世界アセットバランスファンドVA (適格機関投資家向け)	102,733,521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)	576,326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)	1,492,236,253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)	29,216,169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)	276,501,966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)	483,425,446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)	784,416,491円
D I A M世界バランス25VA (適格機関投資家限定)	205,921,080円
D I A M国内バランス30VA (適格機関投資家限定)	58,717,183円
コアポートフォリオ戦略ファンド (適格機関投資家限定)	387,569,601円
動的パッケージファンド<DC年金>	213,242,040円
コア資産形成ファンド	109,306,062円
たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	21,839,360,333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)	24,944,266,426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)	18,573,817,425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)	117,422,889円
期末元本合計	433,635,920,893円

■損益の状況

当期 自2023年2月15日 至2024年2月14日

項	目	当	期					
(A) 配	当	等	収	益	3,407,110,674円			
受	取		利	息	3,409,137,096			
支	払		利	息	△2,026,422			
(B) 有	証	券	売	買	損	益	△9,054,042,305	
売		買			益	4,732,773,783		
売		買			損	△13,786,816,088		
(C) 当	期	損	益	金(A + B)	△5,646,931,631			
(D) 前	期	繰	越	損	益	金	107,728,829,513	
(E) 解	約	差	損	益	金	△145,497,077,749		
(F) 追	加	信	託	差	損	益	金	144,822,358,964
(G) 合				計(C + D + E + F)	101,407,179,097			
次	期	繰	越	損	益	金(G)	101,407,179,097	

(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。