

運用報告書 (全体版)

第14期<決算日2023年11月10日>

日本債券ファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	2010年2月16日から2044年11月10日までです。	
運用方針	NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。	
主要投資対象	日本債券ファンド	新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券。
	新光日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債。
運用方法	主として新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。 公社債の実質組入比率については、原則として高位を保ちます。	
組入制限	日本債券ファンドの新光日本債券インデックスマザーファンド組入上限比率	制限を設けません。
	新光日本債券インデックスマザーファンド	株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案し、決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

受益者の皆さまへ

毎々格別のお引立てに預かり厚くお礼申し上げます。

さて、「日本債券ファンド」は、2023年11月10日に第14期の決算を行いました。ここに、運用経過等をご報告申し上げます。

今後とも一層のご愛顧を賜りますようお願い申し上げます。

<運用報告書に関するお問い合わせ先>

コールセンター：0120-104-694

受付時間：営業日の午前9時から午後5時まで

お客さまのお取引内容につきましては、購入された販売会社にお問い合わせください。

アセットマネジメントOne株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-2

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

日本債券ファンド

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率			
10期(2019年11月11日)	円 10,795	円 50	% 2.0	ポイント 390.121	% 2.8	% 99.2	% -	百万円 6,319
11期(2020年11月10日)	10,622	50	△1.1	386.816	△0.8	99.5	-	6,783
12期(2021年11月10日)	10,563	40	△0.2	387.538	0.2	99.6	-	6,619
13期(2022年11月10日)	10,084	30	△4.3	372.013	△4.0	99.4	-	5,432
14期(2023年11月10日)	9,748	40	△2.9	362.801	△2.5	99.5	-	4,120

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) 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5) △(白三角)はマイナスを意味しています(以下同じ)。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	債券先物 比率
	騰 落 率	騰 落 率				
(期首) 2022年11月10日	円 10,084	% -	ポイント 372.013	% -	% 99.4	% -
11月末	10,065	△0.2	371.326	△0.2	99.1	-
12月末	9,933	△1.5	366.595	△1.5	99.4	-
2023年1月末	9,903	△1.8	365.595	△1.7	99.4	-
2月末	10,013	△0.7	369.572	△0.7	99.4	-
3月末	10,146	0.6	374.743	0.7	99.5	-
4月末	10,165	0.8	375.608	1.0	99.3	-
5月末	10,144	0.6	375.266	0.9	99.1	-
6月末	10,163	0.8	376.290	1.1	99.5	-
7月末	10,002	△0.8	370.426	△0.4	99.1	-
8月末	9,927	△1.6	367.761	△1.1	99.4	-
9月末	9,854	△2.3	365.131	△1.8	99.6	-
10月末	9,695	△3.9	359.310	△3.4	98.5	-
(期末) 2023年11月10日	9,788	△2.9	362.801	△2.5	99.5	-

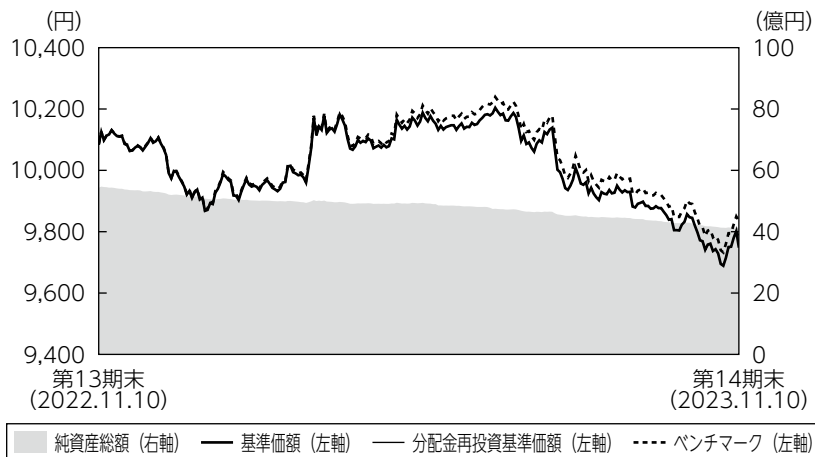
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

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

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2022年11月11日から2023年11月10日まで）

基準価額等の推移



第14期首： 10,084円
第14期末： 9,748円
(既払分配金40円)
騰落率： △2.9%
(分配金再投資ベース)

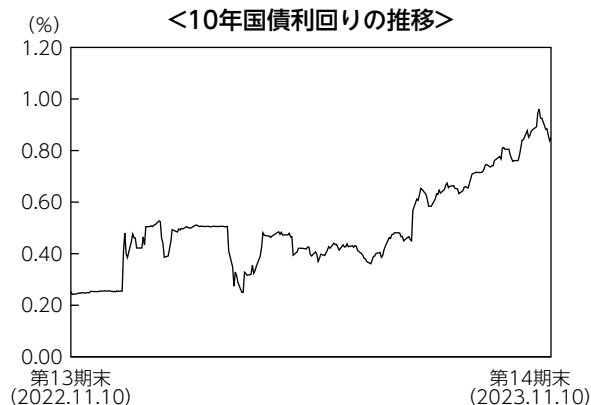
- (注1) 分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- (注2) 分配金を再投資するかどうかについてはお客さまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- (注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落（利回りは上昇）を受け、基準価額は下落しました。期初から2022年12月にかけて、利回りは横ばいで推移していましたが、日銀の金融政策変更を受けて急上昇しました。2023年に入ると日銀の新体制や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。2023年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、利回りは一段と上昇し、基準価額の下落要因となりました。

投資環境

国内債券市場は下落しました。期初から2022年12月にかけて、利回りは横ばいで推移していましたが、日銀の金融政策変更を受けて急上昇しました。2023年に入ると日銀の新体制や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。2023年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受けて、利回りは一段と上昇しました。



ポートフォリオについて

●当ファンド

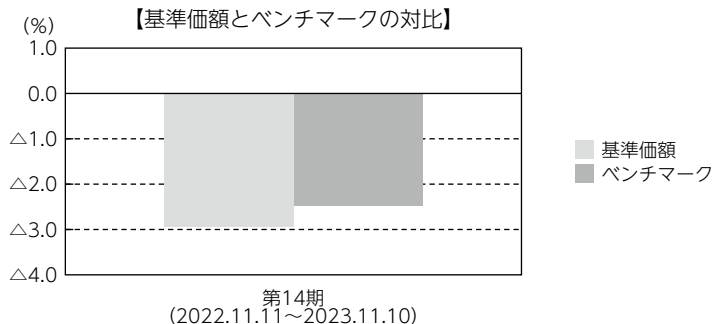
新光日本債券インデックスマザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●新光日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合の銘柄入れ替えや、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2.5%下落しました。当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.5%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、以下の表の通り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
	2022年11月11日 ～2023年11月10日
当期分配金（税引前）	40円
対基準価額比率	0.41%
当期の収益	10円
当期の収益以外	29円
翌期繰越分配対象額	467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、新光日本債券インデックスマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●新光日本債券インデックスマザーファンド

引き続き、ポートフォリオのリスク特性をベンチマークに極力一致させることにより、ベンチマークに連動する投資成果をめざしたパッシブ運用を行います。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第14期		項目の概要
	(2022年11月11日 ～2023年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	51円	0.507%	(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10,012円です。
(投信会社)	(18)	(0.183)	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)	(27)	(0.274)	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)	(5)	(0.050)	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	51	0.508	

(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) 報酬率は可変型となっております。信託報酬は当期末時点の報酬率で計算しております。

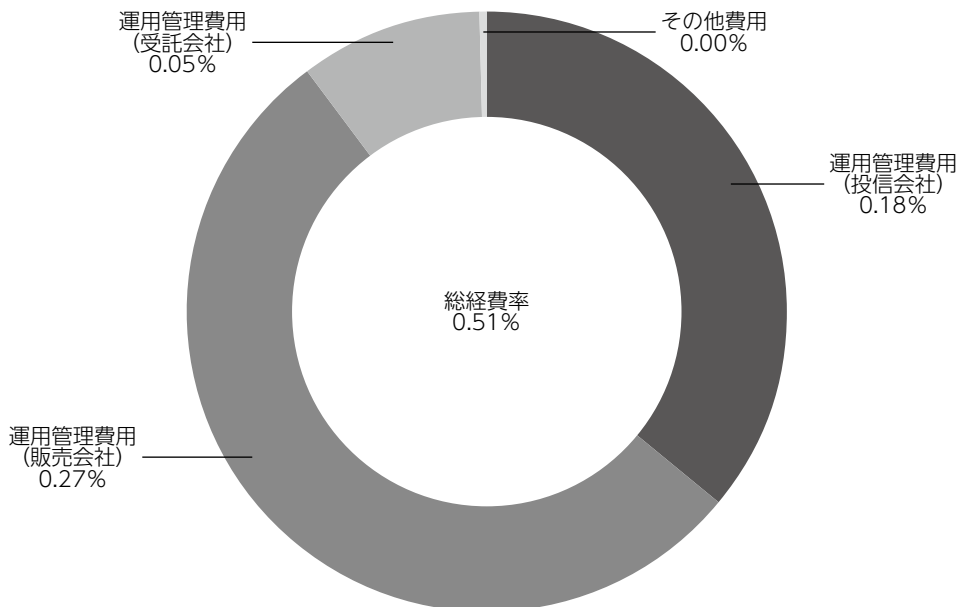
(注3) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 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0.51%です。



(注1) 1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

(注4) 上記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率と異なります。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況（2022年11月11日から2023年11月10日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
新光日本債券インデックスマザーファンド	千□ 37,381	千円 46,178	千□ 1,015,119	千円 1,247,621

■利害関係人との取引状況等（2022年11月11日から2023年11月10日まで）

【日本債券ファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引等はありません。

【新光日本債券インデックスマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期 末		
	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 2,293	百万円 234	% 10.2	百万円 1,755	百万円 189	% 10.8

平均保有割合 46.1%

(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。

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
新光日本債券インデックスマザーファンド	千□ 4,395,056	千□ 3,417,318	千円 4,118,894

■投資信託財産の構成

2023年11月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新光日本債券インデックスマザーファンド	4,118,894	99.1
コール・ローン等、その他	39,331	0.9
投資信託財産総額	4,158,225	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。％は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	4,158,225,422円
コール・ローン等	35,045,254
新光日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	4,118,894,168
未 収 入 金	4,286,000
(B) 負 債	37,298,066
未 払 収 益 分 配 金	16,908,981
未 払 解 約 金	9,168,710
未 払 信 託 報 酬	11,182,154
そ の 他 未 払 費 用	38,221
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	4,120,927,356
元 本	4,227,245,437
次 期 繰 越 損 益 金	△106,318,081
(D) 受 益 権 総 口 数	4,227,245,437口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	9,748円

(注) 期首における元本額は5,387,334,325円、当期中における追加設定元本額は80,650,380円、同解約元本額は1,240,739,268円です。

■損益の状況

当期 自2022年11月11日 至2023年11月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△4,201円
受 取 利 息	545
支 払 利 息	△4,746
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△100,358,058
売 買 益	14,114,748
売 買 損	△114,472,806
(C) 信 託 報 酬 等	△24,371,140
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△124,733,399
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△284,810,034
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	320,134,333
(配 当 等 相 当 額)	(200,005,455)
(売 買 損 益 相 当 額)	(120,128,878)
(G) 合 計(D+E+F)	△89,409,100
(H) 収 益 分 配 金	△16,908,981
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	△106,318,081
追 加 信 託 差 損 益 金	317,796,329
(配 当 等 相 当 額)	(197,690,037)
(売 買 損 益 相 当 額)	(120,106,292)
繰 越 損 益 金	△424,114,410

(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	4,236,927円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	200,028,041
(d) 分 配 準 備 積 立 金	10,334,050
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	214,599,018
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	507.66
(g) 分 配 金	16,908,981
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	40

■分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金

40円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

- 当ファンドが投資対象とする「新光日本債券インデックスマザーファンド」において、第26条（信託業務の委託等）の付表「I.外国での保管会社」を削除しました。

(2023年2月11日)

- 当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「新光日本債券インデックスマザーファンド」において、新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。

(2023年8月11日)

- 信託期間を延長し、償還日を2044年11月10日とする変更を行いました。

(2023年8月11日)

新光日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第18期 (決算日 2023年11月10日)

(計算期間 2022年11月11日～2023年11月10日)

新光日本債券インデックスマザーファンドの第18期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限とします。
運用方針	NOMURA-BPI 総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。
主要投資対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権の行使により取得したものに限り、投資信託財産の純資産総額の10%以下とします。外貨建資産への投資は行いません。

■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	債券 先物比率	純資産 総額
	円	期中 騰落率	ポイント	期中 騰落率			
14期(2019年11月11日)	12,956	2.7%	390.121	2.8%	99.3%	—	百万円 9,183
15期(2020年11月10日)	12,846	△0.8	386.816	△0.8	99.6	—	8,732
16期(2021年11月10日)	12,868	0.2	387.538	0.2	99.6	—	9,341
17期(2022年11月10日)	12,355	△4.0	372.013	△4.0	99.4	—	10,176
18期(2023年11月10日)	12,053	△2.4	362.801	△2.5	99.5	—	10,369

(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)。

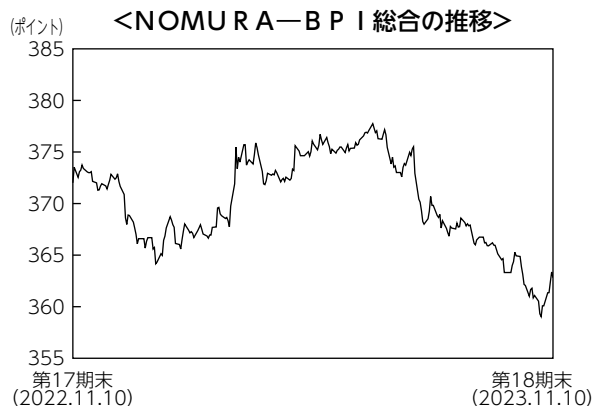
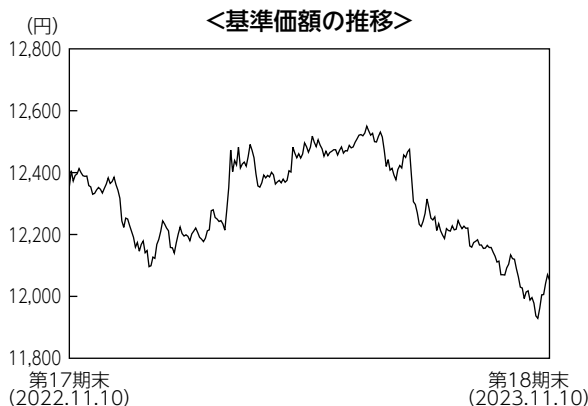
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債 券 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2022年11月10日	円 12,355	% -	ポイント 372.013	% -	% 99.4	% -
11 月 末	12,333	△0.2	371.326	△0.2	99.1	-
12 月 末	12,174	△1.5	366.595	△1.5	99.5	-
2023年1 月 末	12,140	△1.7	365.595	△1.7	99.4	-
2 月 末	12,277	△0.6	369.572	△0.7	99.4	-
3 月 末	12,448	0.8	374.743	0.7	99.5	-
4 月 末	12,482	1.0	375.608	1.0	99.3	-
5 月 末	12,469	0.9	375.266	0.9	99.1	-
6 月 末	12,500	1.2	376.290	1.1	99.5	-
7 月 末	12,306	△0.4	370.426	△0.4	99.2	-
8 月 末	12,217	△1.1	367.761	△1.1	99.4	-
9 月 末	12,130	△1.8	365.131	△1.8	99.7	-
10 月 末	11,937	△3.4	359.310	△3.4	98.5	-
(期 末) 2023年11月10日	12,053	△2.4	362.801	△2.5	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（2022年11月11日から2023年11月10日まで）



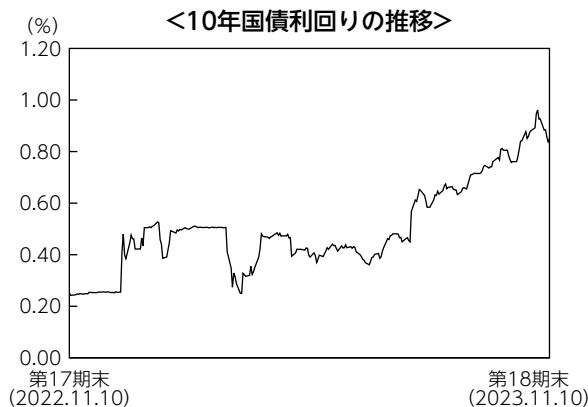
基準価額の推移

当ファンドの基準価額（1万口当たり）は12,053円となり、前期末比で2.4%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（利回りは上昇）を受け、基準価額は下落しました。期初から2022年12月にかけて、利回りは横ばいで推移していましたが、日銀の金融政策変更を受けて急上昇しました。2023年に入ると日銀の新体制や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。2023年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、利回りは一段と上昇し、基準価額の下落要因となりました。

投資環境



国内債券市場は下落しました。期初から2022年12月にかけて、利回りは横ばいで推移していましたが、日銀の金融政策変更を受けて急上昇しました。2023年に入ると日銀の新体制や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。2023年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、利回りは一段と上昇しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMUR A－B P I 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NOMUR A－B P I 総合は、前期末比で2.5%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 (2022年11月11日から2023年11月10日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	2,293,133	1,625,374 (-)
	地方債証券	-	30,174 (-)
	社債券	-	100,010 (-)

(注1) 金額は受渡代金です(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 社債券には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年11月11日から2023年11月10日まで)

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 2,293	百万円 234	% 10.2	百万円 1,755	百万円 189	% 10.8

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		残 存 期 間 別 組 入 比 率		
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	う ち B B 格 以 下 組 入 比 率	5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国 債 証 券	9,035,000	8,757,149	84.5	—	55.3	20.3	8.8
地 方 債 証 券	660,000	662,529	6.4	5.5	3.0	3.4	—
特 殊 債 券 (除 く 金 融 債 券)	600,000	604,266	5.8	—	2.9	1.9	1.0
普 通 社 債 券	300,000	294,292	2.8	—	0.9	1.0	1.0
合 計	10,595,000	10,318,236	99.5	5.5	62.2	26.5	10.8

(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		期 末		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		
1 4 2 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	60,000	60,088	2024/12/20	
3 3 6 回 利付国庫債券 (10年)	0.5000	30,000	30,176	2024/12/20	
3 3 7 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	80,000	80,295	2024/12/20	
4 4 4 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	30,000	30,010	2025/01/01	
4 4 5 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	20,000	20,004	2025/02/01	
4 4 6 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	30,000	30,003	2025/03/01	
1 4 3 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	50,000	50,070	2025/03/20	
3 3 8 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	80,000	80,436	2025/03/20	
4 4 7 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	40,000	40,002	2025/04/01	
4 4 8 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	40,000	40,000	2025/05/01	
4 4 9 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	20,000	19,996	2025/06/01	
1 4 4 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	100,000	100,135	2025/06/20	
3 3 9 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	120,000	120,738	2025/06/20	
4 5 2 回 利付国庫債券 (2年)	0.0050	30,000	29,967	2025/09/01	
1 4 5 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	90,000	90,074	2025/09/20	
3 4 0 回 利付国庫債券 (10年)	0.4000	80,000	80,510	2025/09/20	
8 1 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	10,000	10,359	2025/09/20	
1 4 6 回 利付国庫債券 (5年)	0.1000	120,000	120,037	2025/12/20	
3 4 1 回 利付国庫債券 (10年)	0.3000	70,000	70,315	2025/12/20	
8 4 回 利付国庫債券 (20年)	2.0000	10,000	10,401	2025/12/20	
1 4 7 回 利付国庫債券 (5年)	0.0050	120,000	119,690	2026/03/20	

銘	柄	当		期		末
		利	額	評	償	還
		率	面	価	額	年月日
		%	金額	額	額	
(国債証券)			千円	千円		
3 4 2 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	80,000	79,971		2026/03/20
1 4 8 回	利付国庫債券 (5 年)	0.0050	100,000	99,650		2026/06/20
3 4 3 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	70,000	69,927		2026/06/20
8 8 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	10,000	10,560		2026/06/20
1 4 9 回	利付国庫債券 (5 年)	0.0050	80,000	79,636		2026/09/20
3 4 4 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	80,000	79,852		2026/09/20
9 0 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	10,000	10,579		2026/09/20
1 5 0 回	利付国庫債券 (5 年)	0.0050	90,000	89,486		2026/12/20
3 4 5 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	60,000	59,833		2026/12/20
9 2 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	20,000	21,181		2026/12/20
1 5 1 回	利付国庫債券 (5 年)	0.0050	30,000	29,785		2027/03/20
1 5 2 回	利付国庫債券 (5 年)	0.1000	50,000	49,800		2027/03/20
3 4 6 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	50,000	49,800		2027/03/20
1 5 3 回	利付国庫債券 (5 年)	0.0050	70,000	69,375		2027/06/20
3 4 7 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	70,000	69,612		2027/06/20
9 5 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	20,000	21,466		2027/06/20
1 5 4 回	利付国庫債券 (5 年)	0.1000	80,000	79,451		2027/09/20
3 4 8 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	90,000	89,382		2027/09/20
1 5 5 回	利付国庫債券 (5 年)	0.3000	20,000	19,991		2027/12/20
1 5 6 回	利付国庫債券 (5 年)	0.2000	50,000	49,777		2027/12/20
3 4 9 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	100,000	99,149		2027/12/20
9 9 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	30,000	32,187		2027/12/20
1 5 7 回	利付国庫債券 (5 年)	0.2000	30,000	29,813		2028/03/20
1 5 8 回	利付国庫債券 (5 年)	0.1000	50,000	49,475		2028/03/20
3 5 0 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	120,000	118,740		2028/03/20
1 5 9 回	利付国庫債券 (5 年)	0.1000	20,000	19,751		2028/06/20
1 6 0 回	利付国庫債券 (5 年)	0.2000	50,000	49,604		2028/06/20
1 6 1 回	利付国庫債券 (5 年)	0.3000	40,000	39,855		2028/06/20
3 5 1 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	120,000	118,507		2028/06/20
3 5 2 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	80,000	78,820		2028/09/20
1 0 5 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	20,000	21,623		2028/09/20
3 5 3 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	110,000	108,187		2028/12/20
1 0 8 回	利付国庫債券 (2 0 年)	1.9000	10,000	10,744		2028/12/20
3 5 4 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	80,000	78,537		2029/03/20
1 1 0 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	10,000	10,873		2029/03/20
3 5 5 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	80,000	78,384		2029/06/20
1 1 1 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	10,000	10,955		2029/06/20
1 1 2 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	20,000	21,802		2029/06/20
3 5 6 回	利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	70,000	68,446		2029/09/20
1 1 3 回	利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	30,000	32,794		2029/09/20

銘	柄	当		期		末
		利	額	評	償	還
		率	面	価	額	年月日
		%	金額	額	額	
			千円	千円	千円	
(国債証券)						
357回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	78,036		2029/12/20
114回	利付国庫債券(20年)	2.1000	10,000	10,953		2029/12/20
358回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	68,109		2030/03/20
116回	利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	11,039		2030/03/20
117回	利付国庫債券(20年)	2.1000	20,000	21,955		2030/03/20
359回	利付国庫債券(10年)	0.1000	90,000	87,336		2030/06/20
118回	利付国庫債券(20年)	2.0000	20,000	21,867		2030/06/20
120回	利付国庫債券(20年)	1.6000	20,000	21,351		2030/06/20
360回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	67,740		2030/09/20
121回	利付国庫債券(20年)	1.9000	20,000	21,768		2030/09/20
122回	利付国庫債券(20年)	1.8000	10,000	10,818		2030/09/20
361回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	77,170		2030/12/20
123回	利付国庫債券(20年)	2.1000	20,000	22,065		2030/12/20
124回	利付国庫債券(20年)	2.0000	10,000	10,964		2030/12/20
362回	利付国庫債券(10年)	0.1000	90,000	86,498		2031/03/20
125回	利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	11,118		2031/03/20
126回	利付国庫債券(20年)	2.0000	10,000	10,973		2031/03/20
127回	利付国庫債券(20年)	1.9000	10,000	10,903		2031/03/20
363回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	76,619		2031/06/20
128回	利付国庫債券(20年)	1.9000	20,000	21,818		2031/06/20
129回	利付国庫債券(20年)	1.8000	10,000	10,836		2031/06/20
364回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	76,341		2031/09/20
130回	利付国庫債券(20年)	1.8000	20,000	21,677		2031/09/20
131回	利付国庫債券(20年)	1.7000	10,000	10,764		2031/09/20
365回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	66,575		2031/12/20
132回	利付国庫債券(20年)	1.7000	10,000	10,766		2031/12/20
133回	利付国庫債券(20年)	1.8000	20,000	21,694		2031/12/20
366回	利付国庫債券(10年)	0.2000	80,000	76,483		2032/03/20
134回	利付国庫債券(20年)	1.8000	20,000	21,709		2032/03/20
135回	利付国庫債券(20年)	1.7000	10,000	10,771		2032/03/20
136回	利付国庫債券(20年)	1.6000	20,000	21,385		2032/03/20
367回	利付国庫債券(10年)	0.2000	60,000	57,195		2032/06/20
137回	利付国庫債券(20年)	1.7000	20,000	21,561		2032/06/20
138回	利付国庫債券(20年)	1.5000	30,000	31,843		2032/06/20
139回	利付国庫債券(20年)	1.6000	40,000	42,781		2032/06/20
368回	利付国庫債券(10年)	0.2000	80,000	76,032		2032/09/20
140回	利付国庫債券(20年)	1.7000	60,000	64,704		2032/09/20
369回	利付国庫債券(10年)	0.5000	60,000	58,423		2032/12/20
141回	利付国庫債券(20年)	1.7000	40,000	43,163		2032/12/20
142回	利付国庫債券(20年)	1.8000	40,000	43,504		2032/12/20

銘	柄	当		期		末
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
(国債証券)						
370回	利付国庫債券(10年)	0.5000	80,000	77,709		2033/03/20
10回	利付国庫債券(30年)	1.1000	20,000	20,504		2033/03/20
143回	利付国庫債券(20年)	1.6000	30,000	32,101		2033/03/20
144回	利付国庫債券(20年)	1.5000	20,000	21,226		2033/03/20
371回	利付国庫債券(10年)	0.4000	70,000	67,233		2033/06/20
11回	利付国庫債券(30年)	1.7000	10,000	10,802		2033/06/20
145回	利付国庫債券(20年)	1.7000	70,000	75,616		2033/06/20
372回	利付国庫債券(10年)	0.8000	10,000	9,954		2033/09/20
12回	利付国庫債券(30年)	2.1000	10,000	11,182		2033/09/20
146回	利付国庫債券(20年)	1.7000	50,000	54,010		2033/09/20
147回	利付国庫債券(20年)	1.6000	50,000	53,538		2033/12/20
148回	利付国庫債券(20年)	1.5000	40,000	42,412		2034/03/20
15回	利付国庫債券(30年)	2.5000	10,000	11,604		2034/06/20
149回	利付国庫債券(20年)	1.5000	50,000	52,979		2034/06/20
150回	利付国庫債券(20年)	1.4000	60,000	62,903		2034/09/20
17回	利付国庫債券(30年)	2.4000	10,000	11,519		2034/12/20
151回	利付国庫債券(20年)	1.2000	50,000	51,306		2034/12/20
152回	利付国庫債券(20年)	1.2000	50,000	51,227		2035/03/20
19回	利付国庫債券(30年)	2.3000	10,000	11,428		2035/06/20
153回	利付国庫債券(20年)	1.3000	50,000	51,693		2035/06/20
20回	利付国庫債券(30年)	2.5000	10,000	11,657		2035/09/20
154回	利付国庫債券(20年)	1.2000	50,000	51,059		2035/09/20
21回	利付国庫債券(30年)	2.3000	10,000	11,440		2035/12/20
155回	利付国庫債券(20年)	1.0000	50,000	49,838		2035/12/20
22回	利付国庫債券(30年)	2.5000	10,000	11,680		2036/03/20
156回	利付国庫債券(20年)	0.4000	50,000	46,270		2036/03/20
23回	利付国庫債券(30年)	2.5000	10,000	11,685		2036/06/20
157回	利付国庫債券(20年)	0.2000	50,000	44,895		2036/06/20
158回	利付国庫債券(20年)	0.5000	60,000	55,789		2036/09/20
159回	利付国庫債券(20年)	0.6000	60,000	56,306		2036/12/20
26回	利付国庫債券(30年)	2.4000	10,000	11,573		2037/03/20
160回	利付国庫債券(20年)	0.7000	40,000	37,894		2037/03/20
161回	利付国庫債券(20年)	0.6000	40,000	37,259		2037/06/20
27回	利付国庫債券(30年)	2.5000	10,000	11,696		2037/09/20
162回	利付国庫債券(20年)	0.6000	50,000	46,381		2037/09/20
163回	利付国庫債券(20年)	0.6000	40,000	36,971		2037/12/20
28回	利付国庫債券(30年)	2.5000	20,000	23,411		2038/03/20
164回	利付国庫債券(20年)	0.5000	50,000	45,382		2038/03/20
165回	利付国庫債券(20年)	0.5000	50,000	45,174		2038/06/20
29回	利付国庫債券(30年)	2.4000	20,000	23,127		2038/09/20

銘	柄	当		期		末
		利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
(国債証券)						
166回	利付国庫債券(20年)	0.7000	40,000	37,058	2038/09/20	
167回	利付国庫債券(20年)	0.5000	40,000	35,824	2038/12/20	
30回	利付国庫債券(30年)	2.3000	20,000	22,821	2039/03/20	
168回	利付国庫債券(20年)	0.4000	40,000	35,101	2039/03/20	
169回	利付国庫債券(20年)	0.3000	40,000	34,366	2039/06/20	
31回	利付国庫債券(30年)	2.2000	20,000	22,498	2039/09/20	
170回	利付国庫債券(20年)	0.3000	30,000	25,635	2039/09/20	
171回	利付国庫債券(20年)	0.3000	40,000	33,995	2039/12/20	
32回	利付国庫債券(30年)	2.3000	30,000	34,136	2040/03/20	
172回	利付国庫債券(20年)	0.4000	40,000	34,404	2040/03/20	
173回	利付国庫債券(20年)	0.4000	40,000	34,242	2040/06/20	
33回	利付国庫債券(30年)	2.0000	30,000	32,744	2040/09/20	
174回	利付国庫債券(20年)	0.4000	50,000	42,601	2040/09/20	
175回	利付国庫債券(20年)	0.5000	40,000	34,508	2040/12/20	
34回	利付国庫債券(30年)	2.2000	30,000	33,584	2041/03/20	
176回	利付国庫債券(20年)	0.5000	40,000	34,351	2041/03/20	
177回	利付国庫債券(20年)	0.4000	40,000	33,569	2041/06/20	
35回	利付国庫債券(30年)	2.0000	30,000	32,594	2041/09/20	
178回	利付国庫債券(20年)	0.5000	40,000	34,055	2041/09/20	
179回	利付国庫債券(20年)	0.5000	50,000	42,369	2041/12/20	
36回	利付国庫債券(30年)	2.0000	30,000	32,532	2042/03/20	
180回	利付国庫債券(20年)	0.8000	40,000	35,688	2042/03/20	
181回	利付国庫債券(20年)	0.9000	40,000	36,220	2042/06/20	
37回	利付国庫債券(30年)	1.9000	60,000	63,949	2042/09/20	
182回	利付国庫債券(20年)	1.1000	40,000	37,401	2042/09/20	
183回	利付国庫債券(20年)	1.4000	30,000	29,466	2042/12/20	
38回	利付国庫債券(30年)	1.8000	20,000	20,931	2043/03/20	
184回	利付国庫債券(20年)	1.1000	30,000	27,886	2043/03/20	
39回	利付国庫債券(30年)	1.9000	30,000	31,817	2043/06/20	
185回	利付国庫債券(20年)	1.1000	40,000	37,043	2043/06/20	
40回	利付国庫債券(30年)	1.8000	20,000	20,854	2043/09/20	
41回	利付国庫債券(30年)	1.7000	20,000	20,491	2043/12/20	
42回	利付国庫債券(30年)	1.7000	20,000	20,479	2044/03/20	
43回	利付国庫債券(30年)	1.7000	20,000	20,452	2044/06/20	
44回	利付国庫債券(30年)	1.7000	30,000	30,660	2044/09/20	
45回	利付国庫債券(30年)	1.5000	30,000	29,550	2044/12/20	
46回	利付国庫債券(30年)	1.5000	30,000	29,499	2045/03/20	
47回	利付国庫債券(30年)	1.6000	30,000	30,000	2045/06/20	
48回	利付国庫債券(30年)	1.4000	40,000	38,486	2045/09/20	
49回	利付国庫債券(30年)	1.4000	30,000	28,808	2045/12/20	

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		
50回	利付国庫債券(30年)	0.8000	30,000	25,401		2046/03/20
51回	利付国庫債券(30年)	0.3000	30,000	22,499		2046/06/20
52回	利付国庫債券(30年)	0.5000	40,000	31,402		2046/09/20
53回	利付国庫債券(30年)	0.6000	30,000	24,047		2046/12/20
54回	利付国庫債券(30年)	0.8000	30,000	25,150		2047/03/20
55回	利付国庫債券(30年)	0.8000	25,000	20,893		2047/06/20
56回	利付国庫債券(30年)	0.8000	20,000	16,662		2047/09/20
57回	利付国庫債券(30年)	0.8000	30,000	24,915		2047/12/20
1回	利付国庫債券(40年)	2.4000	10,000	11,472		2048/03/20
58回	利付国庫債券(30年)	0.8000	30,000	24,837		2048/03/20
59回	利付国庫債券(30年)	0.7000	20,000	16,097		2048/06/20
60回	利付国庫債券(30年)	0.9000	20,000	16,851		2048/09/20
61回	利付国庫債券(30年)	0.7000	20,000	15,988		2048/12/20
2回	利付国庫債券(40年)	2.2000	10,000	11,042		2049/03/20
62回	利付国庫債券(30年)	0.5000	20,000	15,106		2049/03/20
63回	利付国庫債券(30年)	0.4000	20,000	14,619		2049/06/20
64回	利付国庫債券(30年)	0.4000	30,000	21,838		2049/09/20
65回	利付国庫債券(30年)	0.4000	20,000	14,512		2049/12/20
3回	利付国庫債券(40年)	2.2000	20,000	22,040		2050/03/20
66回	利付国庫債券(30年)	0.4000	30,000	21,661		2050/03/20
67回	利付国庫債券(30年)	0.6000	30,000	22,866		2050/06/20
68回	利付国庫債券(30年)	0.6000	30,000	22,782		2050/09/20
69回	利付国庫債券(30年)	0.7000	40,000	31,162		2050/12/20
4回	利付国庫債券(40年)	2.2000	20,000	22,052		2051/03/20
70回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	23,311		2051/03/20
71回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	23,250		2051/06/20
72回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	23,189		2051/09/20
73回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	23,129		2051/12/20
5回	利付国庫債券(40年)	2.0000	20,000	21,188		2052/03/20
74回	利付国庫債券(30年)	1.0000	30,000	25,094		2052/03/20
75回	利付国庫債券(30年)	1.3000	30,000	27,091		2052/06/20
76回	利付国庫債券(30年)	1.4000	30,000	27,747		2052/09/20
77回	利付国庫債券(30年)	1.6000	30,000	29,104		2052/12/20
6回	利付国庫債券(40年)	1.9000	20,000	20,762		2053/03/20
78回	利付国庫債券(30年)	1.4000	20,000	18,463		2053/03/20
79回	利付国庫債券(30年)	1.2000	20,000	17,530		2053/06/20
7回	利付国庫債券(40年)	1.7000	30,000	29,702		2054/03/20
8回	利付国庫債券(40年)	1.4000	30,000	27,484		2055/03/20
9回	利付国庫債券(40年)	0.4000	40,000	26,695		2056/03/20
10回	利付国庫債券(40年)	0.9000	40,000	31,417		2057/03/20

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 1 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.8000	30,000	22,600	2058/03/20
1 2 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.5000	30,000	20,058	2059/03/20
1 3 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.5000	40,000	26,452	2060/03/20
1 4 回	利付国庫債券 (4 0 年)	0.7000	40,000	28,308	2061/03/20
1 5 回	利付国庫債券 (4 0 年)	1.0000	50,000	38,979	2062/03/20
1 6 回	利付国庫債券 (4 0 年)	1.3000	10,000	8,543	2063/03/20
小	計	—	9,035,000	8,757,149	—
(地方債証券)		%	千円	千円	
2 1 8 回	神奈川県公募公債	0.1950	100,000	100,000	2025/12/19
4 1 2 回	大阪府公募公債 1 0 年	0.0600	50,000	49,669	2026/09/29
1 9 0 回	大阪府公募公債 5 年	0.0010	100,000	99,028	2026/12/25
1 6 9 回	共同発行市場公募地方債	0.2050	100,000	99,516	2027/04/23
1 8 回	東京都公募公債 2 0 年	2.2200	100,000	108,658	2029/03/19
1 2 回	兵庫県公募公債 1 5 年	0.7810	100,000	100,177	2030/12/06
令和 3 年 度 1 1 回	愛知県公募公債	0.1450	100,000	94,669	2031/10/29
2 4 年 度 1 回	福岡県公募公債 3 0 年	2.1200	10,000	10,812	2042/09/19
小	計	—	660,000	662,529	—
(特殊債券 (除く金融債券))		%	千円	千円	
2 4 9 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4840	100,000	100,610	2025/06/30
8 7 回	中日本高速道路債券	0.0600	100,000	99,416	2026/03/18
3 2 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1700	100,000	99,140	2027/10/29
2 5 0 回	住宅金融支援機構	0.2890	100,000	98,459	2028/11/20
9 7 回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	108,809	2029/12/28
1 4 7 回	高速道路機構債	0.9550	100,000	97,832	2034/12/20
小	計	—	600,000	604,266	—
(普通社債券)		%	千円	千円	
3 6 回	東日本旅客鉄道社債	2.1100	100,000	102,114	2024/12/20
1 1 回	ブリヂストン社債	0.2950	100,000	99,013	2027/04/21
4 9 4 回	九州電力社債	0.3100	100,000	93,165	2031/05/23
小	計	—	300,000	294,292	—
合	計	—	10,595,000	10,318,236	—

■投資信託財産の構成

2023年11月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	10,318,236	99.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	56,853	0.5
投 資 信 託 財 産 総 額	10,375,090	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨ててあります。%は、小数点第2位を四捨五入しています。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

(2023年11月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,375,090,513円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	38,532,330
公 社 債(評価額)	10,318,236,700
未 収 利 息	17,899,339
前 払 費 用	422,144
(B) 負 債	5,510,000
未 払 解 約 金	5,510,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,369,580,513
元 本	8,603,456,312
次 期 繰 越 損 益 金	1,766,124,201
(D) 受 益 権 総 口 数	8,603,456,312口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,053円

(注1) 期首元本額 8,236,621,679円
追加設定元本額 1,716,935,396円
一部解約元本額 1,350,100,763円

(注2) 期末における元本の内訳
One DC 国内債券インデックスファンド 4,211,199,511円
新光7資産バランスファンド 504,434,964円
日本債券ファンド 3,417,318,650円
世界バランスファンド35VA (適格機関投資家私募) 470,503,187円
期末元本合計 8,603,456,312円

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■第26条 (信託業務の委託等) の付表「I.外国での保管会社」を削除しました。

(2023年2月11日)

■新NISA制度の成長投資枠の要件に沿った表記に改めるため、デリバティブの使用目的を明確化しました。

(2023年8月11日)

■損益の状況

当期 自2022年11月11日 至2023年11月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	70,060,996円
受 取 利 息	70,085,133
支 払 利 息	△24,137
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△336,033,750
売 買 損 益	1,963,551
売 買 損	△337,997,301
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△265,972,754
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	1,939,745,264
(E) 解 約 差 損 益 金	△305,612,913
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	397,964,604
(G) 合 計(C+D+E+F)	1,766,124,201
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,766,124,201

(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。