

運用報告書 (全体版)

第52期<決算日2023年9月19日>

公社債投信9月号

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	
信託期間	原則、無期限です。	
運用方針	公社債A号マザーファンド受益証券ならびに本邦通貨建の公社債への投資により、安定した収益の確保をめざした運用を行います。	
主要投資対象	公社債投信9月号	公社債A号マザーファンド受益証券ならびに本邦通貨建の公社債。
	公社債A号マザーファンド	本邦通貨建の公社債。
運用方法	公社債A号マザーファンド受益証券ならびにわが国の国債、地方債、政府保証債、金融債、電力債などを中心に、利息等安定収益の確保を目的とした運用を行います。組入公社債の選定に当たっては、残存期間、流動性、発行体の信用力を考慮し、価格変動リスクの低減を図ります。	
組入制限	公社債投信9月号の公社債A号マザーファンドの組入上限比率	制限なし。
	公社債A号マザーファンド	外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	決算時に、運用収益（純資産総額の元本超過額）の全額を分配します。	

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、「公社債投信9月号」は、2023年9月19日に第52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/>

公社債投信 9月号

■最近3期の運用実績

決算期	基準価額			債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
	(分配落)	税金 込配 み金	期騰 落率			
50期 (2021年9月21日)	円 10,000	円 銭 0.83	% 0.01	% 15.2	% -	百万円 2,161
51期 (2022年9月20日)	10,000	1.79	0.02	13.9	-	2,100
52期 (2023年9月19日)	10,000	2.76	0.03	32.4	-	2,018

(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) 当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

(注5) △ (白三角) はマイナスを意味しています (以下同じ)。

■当期中の基準価額の推移

年月日	基準価額		債券組入率 比	債券先物率 比
	騰落率	騰落率		
(期首) 2022年9月20日	円 銭 10,000	% -	% 13.9	% -
9月末	10,000	0.00	13.9	-
10月末	10,000	0.00	17.7	-
11月末	10,000	0.00	18.8	-
12月末	10,001	0.01	21.5	-
2023年1月末	10,001	0.01	21.6	-
2月末	10,001	0.01	27.8	-
3月末	10,002	0.02	29.0	-
4月末	10,002	0.02	29.0	-
5月末	10,002	0.02	38.3	-
6月末	10,003	0.03	30.0	-
7月末	10,003	0.03	30.9	-
8月末	10,003	0.03	35.8	-
(期末) 2023年9月19日	10,002.76	0.03	32.4	-

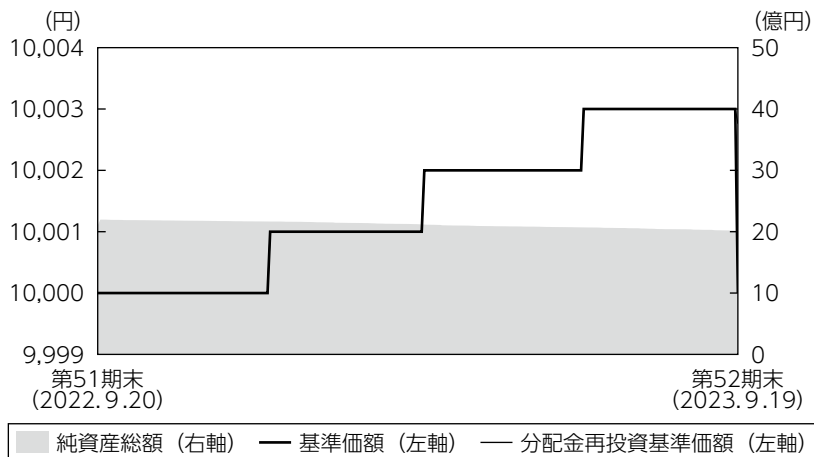
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(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9月21日から2023年9月19日まで）

基準価額等の推移



第52期首： 10,000円
第52期末： 10,000円
（既払分配金2円76銭）
騰落率： 0.03%
（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はありません。
- (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は、期首の基準価額に合わせて指数化しています。
- (注4) 当ファンドはベンチマークを定めておりません。

基準価額の主な変動要因

「公社債A号マザーファンド」受益証券への投資を通じて、残存期間が1年程度までの公社債やコマーシャルペーパー（以下、CP）などに実質的に投資を行った結果、公社債等の利息収入などから基準価額は上昇しました。

投資環境

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。日銀は、C Pや社債の買入も行っていることから、C Pや公社債の利回りも上昇しづらい環境となりました。

ポートフォリオについて

●当ファンド

「公社債A号マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。

●公社債A号マザーファンド

わが国の公社債やC Pへの投資により安定した収益の確保を目指した運用を行いました。期を通じて公社債、C Pを組み入れたポートフォリオを維持しました。

分配金

収益分配金は、原則として1万口当たりの当該元本（10,000円）超過額を全額分配するという分配方針に基づき、2円76銭といたしました。

今後の運用方針

●当ファンド

今後も当ファンドの運用方針に従い、「公社債A号マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持します。

●公社債A号マザーファンド

日銀は2023年7月の金融政策決定会合で、10年国債利回りの上限値を従来の0.5%から1.0%に引き上げました。しかし、日銀は消費者物価指数が前年比2%の上昇となる物価安定の目標達成には距離があるとしており、引き続き緩和的な金融政策を維持するものと見られます。マザーファンドでは今後も、安定した収益の確保を目指した運用を行うとの方針に基づき、わが国の残存1年以内の公社債やC Pを中心に投資を行う方針です。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	第52期		項目の概要
	(2022年9月21日 ～2023年9月19日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	0円	0.001%	(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10,001円です。
(投信会社)	(0)	(0.000)	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)	(0)	(0.000)	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)	(0)	(0.001)	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	0.000	(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)	(0.000)	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	0	0.001	

(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。

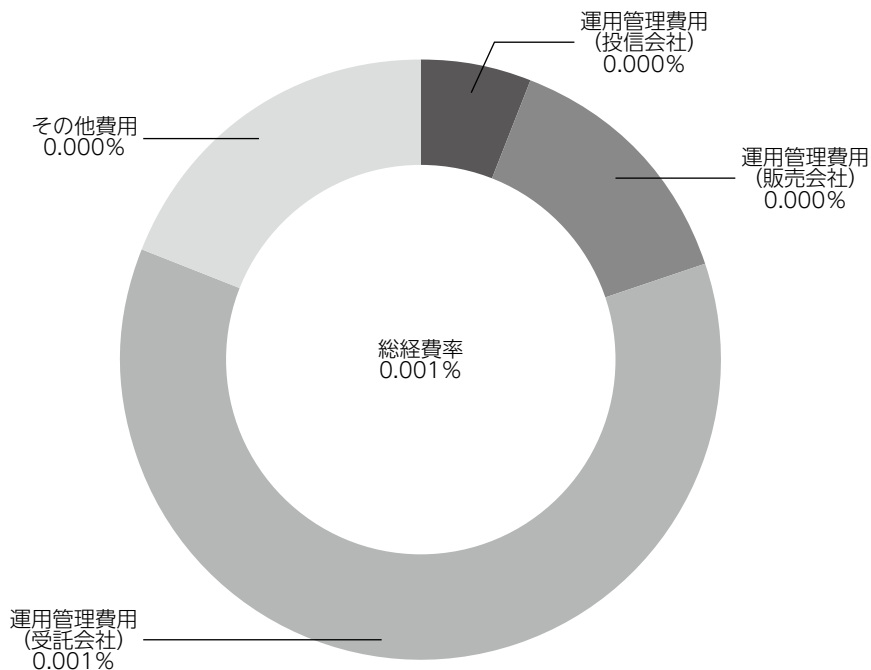
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.001%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9月21日から2023年9月19日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
公社債 A 号 マザーファンド	千□ 92,583	千円 96,000	千□ 173,364	千円 179,790

■利害関係人との取引状況等（2022年9月21日から2023年9月19日まで）

【公社債投信9月号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。

【公社債 A 号 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 13,221	百万円 3,591	% 27.2	百万円 -	百万円 -	% -

平均保有割合 7.3%

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

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

■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
公 社 債 A 号 マ ザ ー フ ァ ン ド	千□ 2,024,541	千□ 1,943,760	千円 2,016,068

<補足情報>

■公社債A号マザーファンドの組入資産の明細

下記は、公社債A号マザーファンド（27,383,205,799口）の内容です。

(1) 公社債

(A) 債券種類別開示

国内（邦貨建）公社債

区 分	2023年9月19日現在				残存期間別組入比率		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
特殊債券（除く金融債券）	1,000,000	999,985	3.5	—	—	—	3.5
普通社債券	8,212,000	8,215,742	28.9	—	—	—	28.9
合 計	9,212,000	9,215,728	32.4	—	—	—	32.4

(注) 組入比率は、2023年9月19日現在のマザーファンド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。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	2023年9月19日現在			
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券（除く金融債券）)	%	千円	千円	
88回 日本政策金融公庫債券	0.0010	1,000,000	999,985	2023/11/10
小 計	—	1,000,000	999,985	—
(普通社債券)	%	千円	千円	
392回 中国電力社債	0.1300	1,000,000	1,000,013	2023/09/25
378回 中国電力社債	1.0040	90,000	90,085	2023/10/25
304回 北陸電力社債	0.9890	370,000	370,348	2023/10/25
7回 野村総合研究所社債	0.0100	400,000	399,996	2023/11/27
21回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1800	400,000	400,100	2023/11/27
87回 日立キャピタル社債	0.0600	900,000	899,819	2024/01/19
13回 オリエンタルランド社債	0.1200	200,000	200,075	2024/01/25
2回 伊藤園社債	0.2200	500,000	500,253	2024/02/23
6回 富士フィルムホールディングス社債	0.1800	600,000	600,424	2024/03/01
196回 オリックス社債	0.2100	282,000	282,140	2024/03/18
22回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2000	700,000	700,500	2024/04/12
5回 スタンレー電気社債	0.1500	400,000	400,165	2024/04/19
24回 東京電力パワーグリッド社債	0.6100	250,000	250,598	2024/04/24
66回 西日本高速道路債券	0.0800	800,000	800,254	2024/05/20
509回 東北電力社債	0.2000	70,000	70,067	2024/05/24
50回 西日本高速道路債券	0.0400	800,000	800,084	2024/06/20
4回 東京電力パワーグリッド社債	0.6900	150,000	150,520	2024/06/20
77回 トヨタファイナンス社債	0.1450	300,000	300,290	2024/07/25
小 計	—	8,212,000	8,215,742	—
合 計	—	9,212,000	9,215,728	—

(2) 国内その他有価証券

区 分	2023年9月19日現在	
	評 価 額	比 率
国内短期社債等	千円 11,998,668	(%) <42.2>

(注1) < >内は、2023年9月19日現在のマザーファンド純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 金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。

■投資信託財産の構成

2023年9月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債 A 号 マ ザ ー フ ァ ン ド	2,016,068	99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	4,213	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	2,020,282	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9月19日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	2,020,282,230円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,093,563
公社債A号マザーファンド(評価額)	2,016,068,667
未 収 入 金	2,120,000
(B) 負 債	1,552,360
未 払 収 益 分 配 金	557,169
未 払 解 約 金	969,281
未 払 信 託 報 酬	20,984
そ の 他 未 払 費 用	4,926
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	2,018,729,870
元 本	2,018,729,759
次 期 繰 越 損 益 金	111
(D) 受 益 権 総 口 数	2,018,729,759口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,000円

(注) 期首における元本額は2,100,008,395円、当期中における追加設定元本額は97,162,600円、同解約元本額は178,441,236円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月21日 至2023年9月19日

項 目	当 期
(A) 受 取 利 息 等 収 益	△861円
支 払 利 息	△861
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	611,932
売 買 益	611,932
(C) 信 託 報 酬 等	△25,910
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	585,161
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	1,554
(F) 解 約 差 損 益 金	△29,435
(G) 合 計(D+E+F)	557,280
(H) 収 益 分 配 金	△557,169
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	111

(注1) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注2) (F)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。

(注3) 分配金の計算過程

計算期間末における収益より、諸経費および信託報酬を控除した残額557,169円（1万口当たり2円76銭）を分配金額としております。

■分配金のお知らせ

1 万 口 当 た り 分 配 金 2 円 7 6 銭

※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。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■第18条の3（先物取引等の運用指図・目的・範囲）の付表「I.外国の証券先物市場等」および第18条の4（信託業務の委託等）の付表「II.外国での保管会社」を削除するため所要の変更を行いました。

(2023年1月4日)

■当ファンドが投資対象とする「公社債A号マザーファンド」において、第15条（先物取引等の運用指図・目的・範囲）の付表「I.外国の証券先物市場等」および第18条（保管業務の委任）の付表「II.外国での保管会社」を削除するため所要の変更を行いました。

(2023年1月4日)

公社債A号マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2023年4月19日）

（計算期間 2022年4月20日～2023年4月19日）

公社債A号マザーファンドの第22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、無期限です。
運用方針	わが国の公社債への投資により、安定した収益の確保を目指した運用を行います。
主要投資対象	本邦通貨建の公社債を投資対象とします。
主な組入制限	外貨建資産への投資は行いません。

■最近3期の運用実績

決算期	基準 価額	期騰落		債券組入率 比	債券先物率 比	純資産額
		騰	落			
20期（2021年4月19日）	円 10,367	% 0.03		% 28.0	% -	百万円 30,524
21期（2022年4月19日）	10,368	0.01		11.6	-	29,508
22期（2023年4月19日）	10,371	0.03		29.2	-	28,565

（注1）債券先物比率は、買建比率－売建比率です。

（注2）当ファンドのコンセプトに適した指数が存在しないため、ベンチマークおよび参考指数を定めておりません。

（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

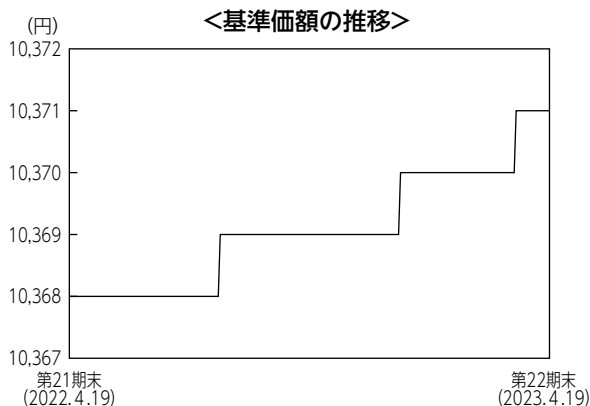
■当期中の基準価額の推移

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率		債 券 組 入 率 債 比	債 券 先 物 率 債 比
		騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2022年 4 月19日	円 10,368	% -	% -	% 11.6	% -
4 月 末	10,368	0.00	11.6	-	
5 月 末	10,368	0.00	10.1	-	
6 月 末	10,368	0.00	10.7	-	
7 月 末	10,368	0.00	11.8	-	
8 月 末	10,369	0.01	13.9	-	
9 月 末	10,369	0.01	13.9	-	
10 月 末	10,369	0.01	17.7	-	
11 月 末	10,369	0.01	18.8	-	
12 月 末	10,370	0.02	21.6	-	
2023年 1 月 末	10,370	0.02	21.6	-	
2 月 末	10,370	0.02	27.8	-	
3 月 末	10,371	0.03	29.0	-	
(期 末) 2023年 4 月19日	10,371	0.03	29.2	-	

(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4月20日から2023年4月19日まで）



基準価額の推移

当ファンドの基準価額は1万口あたり10,371円となり、前期末の同10,368円から0.03%上昇しました。

基準価額の変動要因

当ファンドでは、残存期間が1年程度までの公社債やコマーシャルペーパー（以下、CP）などに投資を行った結果、公社債等の利息収入などから基準価額は上昇しました。

投資環境

国内短期金融市場では、3ヵ月国庫短期証券利回りは日銀がマイナス金利政策を含む大規模な金融緩和政策を継続している影響により、マイナス圏で推移しました。日銀は、CPや社債の買入も行っていることから、CPや公社債の利回りも上昇しづらい環境となりました。

ポートフォリオについて

わが国の公社債やCPへの投資により安定した収益の確保を目指した運用を行いました。期を通じて公社債、CPを組み入れたポートフォリオを維持しました。

今後の運用方針

4月9日に植田和男氏が日銀総裁に就任しましたが、新体制発足後も急速な金融引き締めは見込みにくく、金融政策は緩和的な状態を維持するものと見られます。当ファンドでは今後も、安定した収益の確保を目指した運用を行うとの方針に基づき、わが国の残存1年以内の公社債やCPを中心に投資を行う方針です。

■ 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4月20日から2023年4月19日まで)

(1) 公社債

		買付額	売付額
国	内	千円	千円
		特殊債券	90,750 (-)
		社債券	9,859,564 (5,009,000)

(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。

(2) その他有価証券

		買付額	売付額
国	内	千円	千円
		国内短期社債等	71,994,279 (76,000,000)

(注1) 金額は受渡代金です。

(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。

■ 利害関係人との取引状況等 (2022年4月20日から2023年4月19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 9,950	百万円 4,182	% 42.0	百万円 -	百万円 -	% -

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

(1) 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BB格 以下組入比率	残 存 期 間	別 組 入 比 率	
	千円	千円	%	%	5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
特殊債券(除く金融債券)	90,000	90,131	0.3	—	—	—	0.3
普通社債券	8,248,800	8,252,816	28.9	—	—	—	28.9
合 計	8,338,800	8,342,948	29.2	—	—	—	29.2

(注) 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。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期		末	
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	%	千円	千円	
(特殊債券(除く金融債券))				
19回 沖縄振興開発金融公庫債券	0.8680	90,000	90,131	2023/06/20
小 計	—	90,000	90,131	—
(普通社債券)				
375回 中国電力社債	1.0490	62,000	62,010	2023/04/25
21回 SBIホールディングス社債	0.8000	100,000	100,033	2023/06/02
34回 大和証券グループ本社社債	0.3000	500,000	500,122	2023/06/02
37回 東京電力パワーグリッド社債	0.2900	1,300,000	1,300,264	2023/06/09
2回 パーソルホールディングス社債	0.1900	400,000	400,054	2023/06/14
19回 ジャックス社債	0.2500	100,000	100,016	2023/06/15
470回 東北電力社債	1.5500	102,800	103,071	2023/06/23
311回 四国電力社債	0.1400	224,000	224,034	2023/06/23
333回 北海道電力社債	0.2500	70,000	70,025	2023/06/23
14回 東京電力パワーグリッド社債	0.4300	700,000	700,377	2023/07/24
4回 三越伊勢丹HD社債	1.0710	300,000	301,025	2023/09/01
46回 IHI社債	0.2200	500,000	500,032	2023/09/01
26回 三菱重工業社債	0.8770	300,000	300,886	2023/09/04
83回 東海旅客鉄道社債	0.0010	1,000,000	999,893	2023/09/19
392回 中国電力社債	0.1300	1,000,000	1,000,344	2023/09/25
378回 中国電力社債	1.0040	90,000	90,449	2023/10/25
21回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.1800	100,000	100,077	2023/11/27
87回 日立キャピタル社債	0.0600	900,000	899,593	2024/01/19
2回 伊藤園社債	0.2200	500,000	500,502	2024/02/23
小 計	—	8,248,800	8,252,816	—
合 計	—	8,338,800	8,342,948	—

(2) 国内その他有価証券

区 分	当 期		末	
	評 価 額	比 率		
	千円	(%)		
国内短期社債等	12,998,594	<45.5>		

(注1) < >内は、期末の純資産総額に対する評価額の比率です。

(注2) 金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。

■投資信託財産の構成

2023年4月19日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	8,342,948	29.2
そ の 他 有 価 証 券	12,999,213	45.5
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	7,234,628	25.3
投 資 信 託 財 産 総 額	28,576,789	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4月19日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	28,576,789,785円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	7,228,367,532
そ の 他 有 価 証 券(評価額)	12,999,213,372
特 殊 債 券(評価額)	90,131,198
社 債 券(評価額)	8,252,816,920
未 収 利 息	5,572,962
前 払 費 用	687,801
(B) 負 債	11,070,000
未 払 解 約 金	11,070,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	28,565,719,785
元 本	27,544,289,171
次 期 繰 越 損 益 金	1,021,430,614
(D) 受 益 権 総 口 数	27,544,289,171口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,371円

(注1) 期首元本額 28,460,809,116円

追加設定元本額 1,837,646,055円

一部解約元本額 2,754,166,000円

(注2) 期末における元本の内訳

公社債投信1月号 2,446,419,927円

公社債投信2月号 2,118,111,084円

公社債投信3月号 2,239,821,416円

公社債投信4月号 1,608,747,829円

公社債投信5月号 1,700,368,390円

公社債投信6月号 2,606,598,636円

公社債投信7月号 2,959,530,336円

公社債投信8月号 2,204,546,996円

公社債投信9月号 2,021,839,070円

公社債投信10月号 1,815,811,320円

公社債投信11月号 2,146,830,689円

公社債投信12月号 3,675,663,478円

期末元本合計 27,544,289,171円

■損益の状況

当期 自2022年4月20日 至2023年4月19日

項 目	当 期
(A) 受 取 利 息 等 収 益	18,769,185円
受 取 利 息	20,879,376
支 払 利 息	△2,110,191
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△10,676,482
売 買 益	140,373
売 買 損	△10,816,855
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	8,092,703
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	1,047,207,966
(E) 解 約 差 損 益 金	△101,664,000
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	67,793,945
(G) 合 計(C+D+E+F)	1,021,430,614
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,021,430,614

(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

■第15条（先物取引等の運用指図・目的・範囲）の付表「I. 外国の証券先物市場等」および第18条（保管業務の委任）の付表「II. 外国での保管会社」を削除するため所要の変更を行いました。

(2023年1月4日)