

運用報告書（全体版）

第17期＜決算日2025年10月14日＞

D I AM国内債券パッシブ・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	2009年1月30日から無期限です。	
運用方針	NOMURA－BPI総合の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。	
主要投資対象	D I AM国内債券パッシブ・ファンド	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	原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持します。 マザーファンドにおいては、公社債（債券先物取引等を含みます。）の組入比率は、原則として高位を保ちます。	
組入制限	マザーファンド受益証券への投資割合には、制限を設けません。 株式への実質投資割合は信託財産の純資産総額の10%以内とします。 外貨建資産への投資は行いません。	
分配方針	決算日（原則として10月12日。休業日の場合は翌営業日。）に経費控除後の利子配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の中から、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場合があります。	

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、「D I AM国内債券パッシブ・ファンド」は、2025年10月14日に第17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国内債券パッシブ・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	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)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率				
13期(2021年10月12日)	円 11,455	円 0	% △0.4	ポイント 386.61	% △0.0	% 99.7	% —	% —	百万円 30,351
14期(2022年10月12日)	11,019	0	△3.8	372.73	△3.6	99.7	—	—	32,098
15期(2023年10月12日)	10,775	0	△2.2	365.27	△2.0	99.6	—	—	31,828
16期(2024年10月15日)	10,596	0	△1.7	360.16	△1.4	100.1	—	—	37,889
17期(2025年10月14日)	10,061	0	△5.0	342.78	△4.8	99.7	—	—	39,134

(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) 2024 年 10 月 15 日	円 10,596	% —	ポイント 360.16	% —	% 100.1	% —	% —
10 月 末	10,605	0.1	360.51	0.1	99.7	—	—
11 月 末	10,530	△0.6	357.99	△0.6	99.7	—	—
12 月 末	10,516	△0.8	357.61	△0.7	100.3	—	—
2025 年 1 月 末	10,438	△1.5	354.97	△1.4	99.7	—	—
2 月 末	10,365	△2.2	352.61	△2.1	99.6	—	—
3 月 末	10,261	△3.2	349.16	△3.1	100.3	—	—
4 月 末	10,319	△2.6	351.19	△2.5	101.4	—	—
5 月 末	10,185	△3.9	346.68	△3.7	99.6	—	—
6 月 末	10,238	△3.4	348.51	△3.2	99.7	—	—
7 月 末	10,131	△4.4	344.96	△4.2	99.7	—	—
8 月 末	10,098	△4.7	343.89	△4.5	99.6	—	—
9 月 末	10,088	△4.8	343.62	△4.6	99.8	—	—
(期 末) 2025 年 10 月 14 日	10,061	△5.0	342.78	△4.8	99.7	—	—

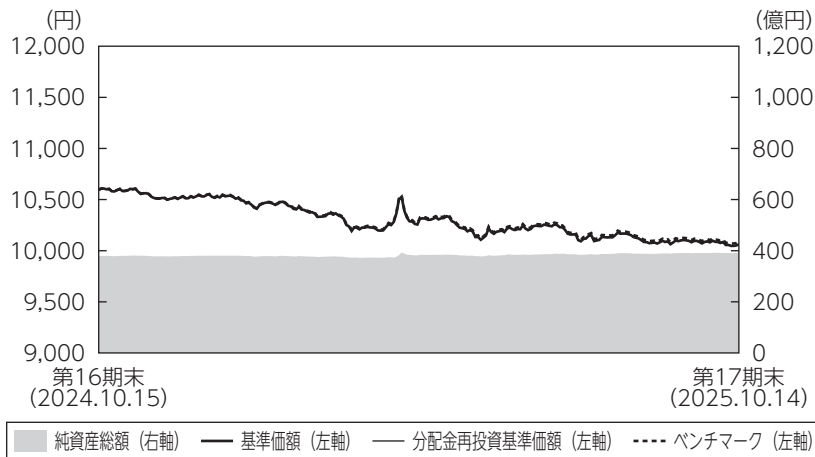
(注1) 騰落率は期首比です。

(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（2024年10月16日から2025年10月14日まで）

基準価額等の推移



第17期首： 10,596円
第17期末： 10,061円
(既払分配金 0円)
騰落率： △5.0%
(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を受けて、基準価額は下落しました。日銀の金融政策が複数回にわたって修正されたことなどをを受けて、利回りが上昇（価格は下落）したことが下落要因となりました。

投資環境

国内債券市場では、利回りが上昇しました。期初から2025年2月にかけては、米大統領選を受けた米国金利の上昇や、日銀の利上げ観測、2025年度の国債発行計画における発行増額などをを受けて利回りが上昇しました。3月から4月にかけては、米トランプ大統領の関税政策などを巡り、市場が混乱する中で、利回りが乱高下しました。5月から期末にかけては、米国債格下げを受けた米金利上昇、参院選後の財政悪化を懸念する見方などをを受けて利回りが上昇しました。

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。

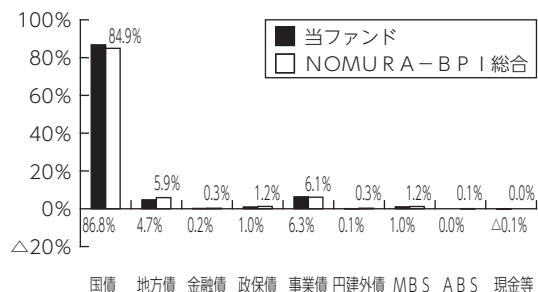
●国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

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。

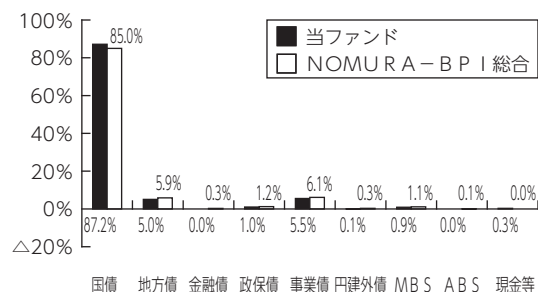
【運用状況】 (注) 比率は純資産総額に対する実質組入比率です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

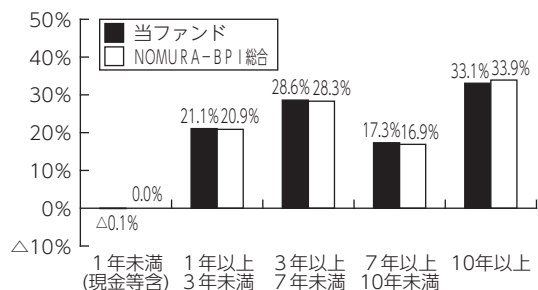


期末

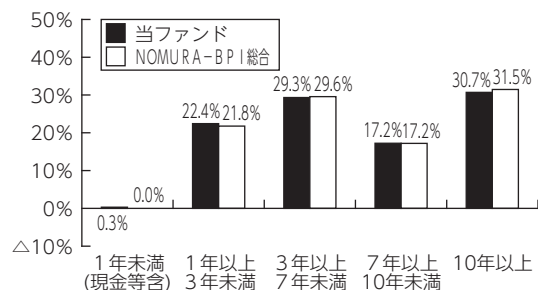


○残存年限別構成比

期首（前期末）

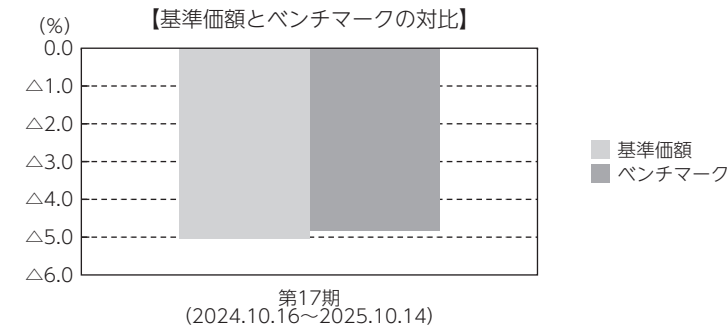


期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークは前期末比で4.8%下落しました。
当ファンドの騰落率はベンチマーク比で△0.2%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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきました。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
	2024年10月16日 ～2025年10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	1,866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17期		項目の概要
	(2024年10月16日 ～2025年10月14日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	23円	0.219%	(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10,300円です。
（投信会社）	(17)	(0.164)	投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各种書類の作成、基準価額の算出等の対価
（販売会社）	(2)	(0.022)	販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各种書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
（受託会社）	(3)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の保管・管理、投信会社からの運用指図の実行等の対価
(b) その他費用	0	0.001	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（監査費用）	(0)	(0.001)	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	23	0.220	

(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。

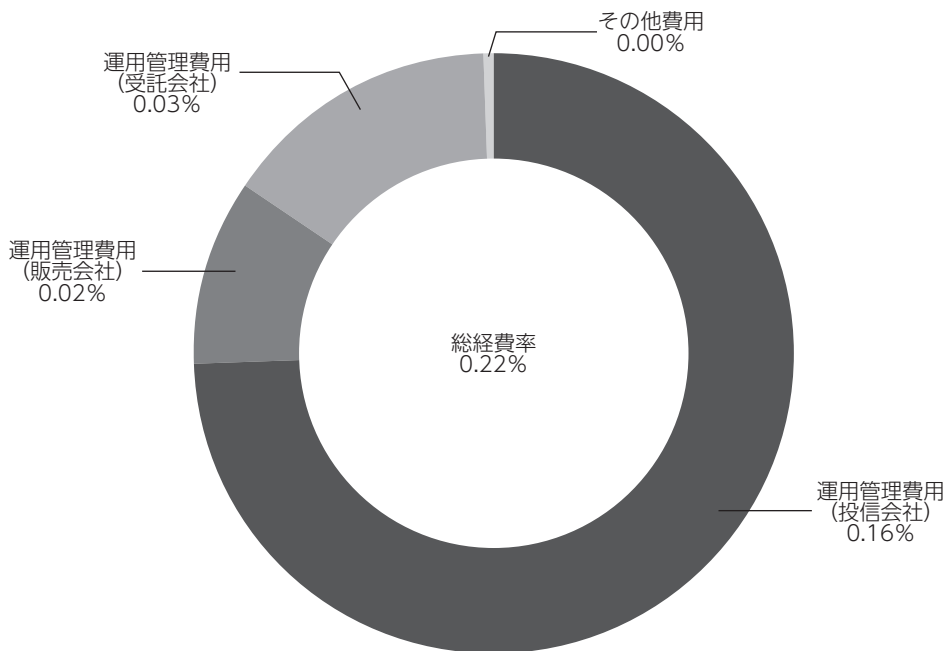
(注2) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(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0.22%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（2024年10月16日から2025年10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	千口 3,753,629	千円 4,448,655	千口 1,091,525	千円 1,290,176

■利害関係人との取引状況等（2024年10月16日から2025年10月14日まで）

【D I AM国内債券パッシブ・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。

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

(1) 期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
区 分	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
	百万円 333,276	百万円 16,700	% 5.0	百万円 395,997	百万円 25,530	% 6.4

平均保有割合 8.0%

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

(2) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	当 期
	買 付 額
公 社 債	百万円 500

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	千口 31,177,828	千口 33,839,932	千円 39,132,497

■投資信託財産の構成

2025年10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	千円 39,132,497	% 99.8
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	58,987	0.2
投 資 信 託 財 産 総 額	39,191,485	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

(2025年10月14日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	39,191,485,146円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	52,193,498
国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド(評価額)	39,132,497,648
未 収 入 金	6,794,000
(B) 負 債	56,865,978
未 払 解 約 金	14,228,301
未 払 信 託 報 酬	42,393,307
そ の 他 未 払 費 用	244,370
(C) 純 資 産 総 額(A－B)	39,134,619,168
元 本	38,896,139,483
次 期 繰 越 損 益 金	238,479,685
(D) 受 益 権 総 口 数	38,896,139,483口
1 万口当たり基準価額(C／D)	10,061円

(注) 期首における元本額は35,757,597,443円、当期中における追加設定元本額は6,257,121,925円、同解約元本額は3,118,579,885円です。

■損益の状況

当期 自2024年10月16日 至2025年10月14日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	163,273円
受 取 利 息	163,273
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,821,197,430
売 買 益	87,446,699
売 買 損	△1,908,644,129
(C) 信 託 報 酬 等	△84,377,700
(D) 当 期 損 益 金(A + B + C)	△1,905,411,857
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△1,895,031,846
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	4,038,923,388
(配 当 等 相 当 額)	(5,955,564,813)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,916,641,425)
(G) 合 計(D + E + F)	238,479,685
次 期 繰 越 損 益 金(G)	238,479,685
追 加 信 託 差 損 益 金	4,038,923,388
(配 当 等 相 当 額)	(5,956,987,630)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△1,918,064,242)
分 配 準 備 積 立 金	1,304,057,111
繰 越 損 益 金	△5,104,500,814

(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	238,932,267円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	5,956,987,630
(d) 分配準備積立金	1,065,124,844
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	7,261,044,741
(f) 1 万口当たり当期分配対象額	1,866.78
(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運用実績等を勘案し、無分配とさせていただきます。

《お知らせ》

約款変更のお知らせ

■当ファンドおよび当ファンドが投資対象とする「国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド」において、投資信託及び投資法人に関する法律第14条の改正に伴い、「運用報告書の交付」を「運用状況にかかる情報の提供」に変更しました。

(2025年4月1日)

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

国内債券パッシブ・ファンド・マザーファンド

運用報告書

第22期（決算日 2025年2月14日）

（計算期間 2024年2月15日～2025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	2002年12月3日から無期限です。
運 用 方 針	NOMURA-BPI 総合に連動する投資成果を目標として運用を行います。
主 要 投 資 対 象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
主 な 組 入 制 限	株式への投資は、転換社債の転換、新株予約権の行使および社債権者割当等により取得するものに限りします。 株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

■最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額		NOMURA-BPI 総合		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	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
18期 (2021年2月15日)	13,022	△1.3	ポイント 385.59	△1.3	99.2	—	—	百万円 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
22期 (2025年2月14日)	11,909	△3.5	352.94	△3.5	99.2	—	—	481,121

（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）。

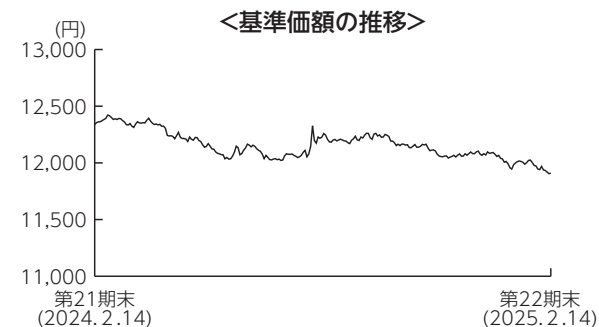
（注3）△（白三角）はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■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 比	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) 2024 年 2 月 14 日	円 12,339	% －	ポイント 365.56	% －	% 99.6	% －	% －
2 月 末	12,383	0.4	366.90	0.4	99.6	－	－
3 月 末	12,369	0.2	366.50	0.3	99.6	－	－
4 月 末	12,228	△0.9	362.35	△0.9	99.7	－	－
5 月 末	12,033	△2.5	356.53	△2.5	99.5	－	－
6 月 末	12,066	△2.2	357.51	△2.2	99.6	－	－
7 月 末	12,054	△2.3	357.15	△2.3	99.5	－	－
8 月 末	12,192	△1.2	361.33	△1.2	118.0	－	－
9 月 末	12,226	△0.9	362.34	△0.9	99.4	－	－
10 月 末	12,163	△1.4	360.51	△1.4	99.7	－	－
11 月 末	12,079	△2.1	357.99	△2.1	99.7	－	－
12 月 末	12,066	△2.2	357.61	△2.2	100.3	－	－
2025 年 1 月 末	11,978	△2.9	354.97	△2.9	99.7	－	－
(期 末) 2025 年 2 月 14 日	11,909	△3.5	352.94	△3.5	99.2	－	－

(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（2024年2月15日から2025年2月14日まで）

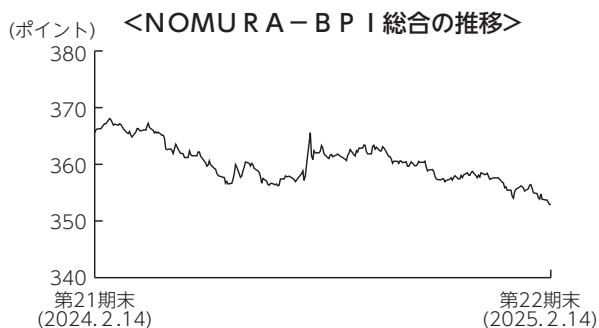


基準価額の推移

当期末の基準価額は11,909円となり、前期末比で3.5%下落しました。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落を受け、当ファンドの基準価額は下落しました。期初から2024年7月にかけては、マイナス金利政策解除などの日銀の金融政策正常化の動きの中で、基準価額は下落基調となりました。8月初に米景気後退懸念を背景としたリスク回避の動きから大幅に利回りが低下し、基準価額の上昇が見られましたが、期末にかけては米大統領選などを受けた米国金利の上昇や、2025年度の国債発行計画における発行増額、日銀の利上げ観測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2024年7月にかけては、マイナス金利政策解除などの日銀の金融政策正常化の動きの中で利回りは上昇しました。8月初に米景気後退懸念を背景としたリスク回避の動きから大幅に利回

りが低下した後、期末にかけては堅調な米雇用統計の結果や米大統領選を受けた米国金利の上昇、2025年度の国債発行計画における発行増額、日銀の利上げ観測などを受けて利回りが上昇しました。

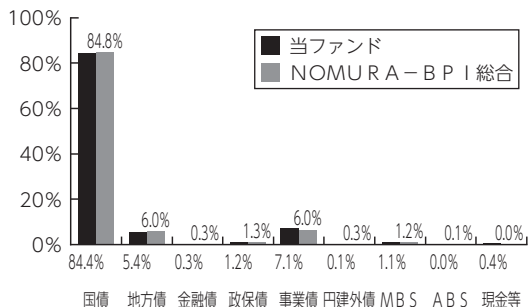
ポートフォリオについて

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

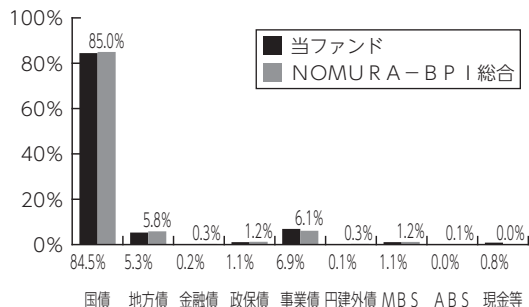
【運用状況】（注）比率は純資産総額に対する割合です。

○セクター別構成比

期首（前期末）

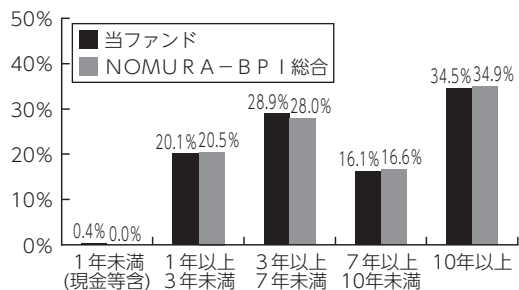


期末

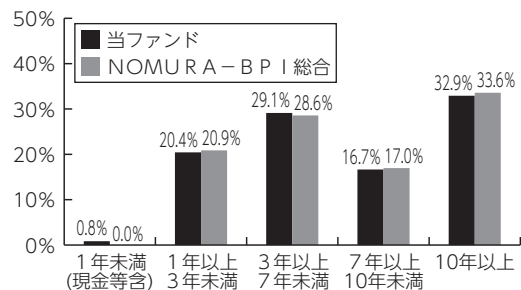


○残存年限別構成比

期首（前期末）



期末



ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は、前期末比で3.5%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（2024年 2 月15日から2025年 2 月14日まで）

公社債

		買付額	売付額
国	内	千円	千円
		国債証券	712,509,067
		地方債証券	739,856,220 (-)
		特殊債証券	2,613,036 (-)
		社債証券	3,046,652 (309,476)
		-	2,310,137 (-)

(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（2024年 2 月15日から2025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		
区 分	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 712,509	百万円 74,533	% 10.5	百万円 747,826	百万円 100,130	% 13.4

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				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
国 債 証 券	千円 435,325,000	千円 406,407,229	% 84.5	% －	% 54.2	% 21.9	% 8.4
地 方 債 証 券	26,539,330	25,560,160	5.3	4.4	2.7	1.9	0.6
特 殊 債 券	24,387,830	23,149,313	4.8	－	3.1	1.0	0.7
金 融 債 券	1,100,000	1,088,161	0.2	－	－	－	0.2
普 通 社 債 券	22,220,000	20,827,718	4.3	0.1	1.8	1.2	1.3
合 計	509,572,160	477,032,582	99.2	4.4	61.8	26.1	11.2

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

(注 2) 無格付銘柄については、B B 格以下に含めて表示しています。

(B) 個別銘柄開示

国内（邦貨建）公社債銘柄別

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
1 4 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	3,350,000	3,327,588	2026/03/20
8 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	590,000	599,404	2026/03/20
8 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	120,000	122,172	2026/03/20
8 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	120,000	122,042	2026/03/20
4 5 9 回 利付国庫債券 (2 年)	0.2000	2,300,000	2,289,006	2026/04/01
4 6 0 回 利付国庫債券 (2 年)	0.3000	2,500,000	2,489,425	2026/05/01
1 4 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	2,000,000	1,981,980	2026/06/20
3 4 3 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	1,590,000	1,577,661	2026/06/20
8 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	590,000	602,661	2026/06/20
8 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	10,000	10,201	2026/06/20
4 6 3 回 利付国庫債券 (2 年)	0.4000	2,700,000	2,687,580	2026/08/01
4 6 4 回 利付国庫債券 (2 年)	0.4000	600,000	596,940	2026/09/01
1 4 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	3,180,000	3,143,779	2026/09/20
3 4 4 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	3,570,000	3,534,657	2026/09/20
9 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	470,000	480,927	2026/09/20
9 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	110,000	112,730	2026/09/20
4 6 5 回 利付国庫債券 (2 年)	0.4000	2,000,000	1,988,800	2026/10/01
4 6 7 回 利付国庫債券 (2 年)	0.6000	800,000	797,600	2026/12/01
1 5 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	4,570,000	4,508,259	2026/12/20
3 4 5 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	5,060,000	5,000,342	2026/12/20
9 2 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	1,160,000	1,188,605	2026/12/20
4 6 8 回 利付国庫債券 (2 年)	0.6000	3,100,000	3,089,708	2027/01/01
1 5 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	1,600,000	1,574,720	2027/03/20

銘 柄	当 期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(国債証券)	%	千円	千円	
1 5 2 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,790,000	1,765,208	2027/03/20
3 4 6 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,540,000	4,477,121	2027/03/20
9 3 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.0000	370,000	379,375	2027/03/20
9 4 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	670,000	688,351	2027/03/20
1 5 3 回 利付国庫債券 (5 年)	0.0050	7,300,000	7,167,651	2027/06/20
3 4 7 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	4,500,000	4,428,225	2027/06/20
9 5 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.3000	550,000	569,184	2027/06/20
9 6 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	120,000	123,634	2027/06/20
1 5 4 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,200,000	1,178,244	2027/09/20
3 4 8 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	5,570,000	5,469,015	2027/09/20
9 7 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	660,000	683,436	2027/09/20
9 8 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	160,000	165,275	2027/09/20
1 5 5 回 利付国庫債券 (5 年)	0.3000	1,500,000	1,478,145	2027/12/20
3 4 9 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	6,050,000	5,928,334	2027/12/20
9 9 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.1000	750,000	776,842	2027/12/20
1 5 7 回 利付国庫債券 (5 年)	0.2000	4,500,000	4,412,070	2028/03/20
1 5 8 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,300,000	1,270,685	2028/03/20
3 5 0 回 利付国庫債券 (1 0 年)	0.1000	5,800,000	5,669,210	2028/03/20
1 0 0 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.2000	830,000	864,196	2028/03/20
1 0 1 回 利付国庫債券 (2 0 年)	2.4000	230,000	240,897	2028/03/20
1 5 9 回 利付国庫債券 (5 年)	0.1000	1,000,000	974,870	2028/06/20
1 6 0 回 利付国庫債券 (5 年)	0.2000	1,600,000	1,564,976	2028/06/20
1 6 1 回 利付国庫債券 (5 年)	0.3000	1,300,000	1,275,755	2028/06/20

銘	柄	当期末			
		利率	額面金額	評価額	償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円	
351回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,400,000	3,314,558	2028/06/20
102回 利付国庫債券 (20年)		2.4000	500,000	525,145	2028/06/20
103回 利付国庫債券 (20年)		2.3000	160,000	167,528	2028/06/20
104回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	110,000	114,442	2028/06/20
162回 利付国庫債券 (5年)		0.3000	1,600,000	1,566,608	2028/09/20
163回 利付国庫債券 (5年)		0.4000	3,650,000	3,586,526	2028/09/20
352回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,370,000	3,275,673	2028/09/20
105回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	640,000	667,161	2028/09/20
106回 利付国庫債券 (20年)		2.2000	500,000	523,050	2028/09/20
164回 利付国庫債券 (5年)		0.2000	1,500,000	1,459,410	2028/12/20
165回 利付国庫債券 (5年)		0.3000	1,000,000	976,650	2028/12/20
166回 利付国庫債券 (5年)		0.4000	2,600,000	2,548,910	2028/12/20
353回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,690,000	3,575,831	2028/12/20
107回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	600,000	626,592	2028/12/20
108回 利付国庫債券 (20年)		1.9000	690,000	715,461	2028/12/20
167回 利付国庫債券 (5年)		0.4000	1,600,000	1,565,392	2029/03/20
168回 利付国庫債券 (5年)		0.6000	1,800,000	1,775,574	2029/03/20
169回 利付国庫債券 (5年)		0.5000	1,000,000	982,300	2029/03/20
354回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	2,460,000	2,377,294	2029/03/20
109回 利付国庫債券 (20年)		1.9000	350,000	363,429	2029/03/20
110回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	440,000	460,438	2029/03/20
170回 利付国庫債券 (5年)		0.6000	2,600,000	2,559,414	2029/06/20
355回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,730,000	3,592,698	2029/06/20
111回 利付国庫債券 (20年)		2.2000	460,000	484,048	2029/06/20
112回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	740,000	775,446	2029/06/20
174回 利付国庫債券 (5年)		0.7000	3,300,000	3,257,265	2029/09/20
356回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,400,000	3,265,020	2029/09/20
1回 利付国庫債券 (30年)		2.8000	110,000	118,922	2029/09/20
113回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	2,470,000	2,592,610	2029/09/20
175回 利付国庫債券 (5年)		0.9000	1,500,000	1,492,725	2029/12/20
357回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,300,000	3,160,740	2029/12/20
2回 利付国庫債券 (30年)		2.4000	100,000	106,804	2030/02/20
358回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	2,950,000	2,818,105	2030/03/20
116回 利付国庫債券 (20年)		2.2000	530,000	561,317	2030/03/20
117回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	1,870,000	1,971,428	2030/03/20
359回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,850,000	3,667,933	2030/06/20
118回 利付国庫債券 (20年)		2.0000	955,000	1,003,886	2030/06/20
119回 利付国庫債券 (20年)		1.8000	470,000	489,171	2030/06/20
120回 利付国庫債券 (20年)		1.6000	500,000	515,195	2030/06/20
360回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	4,100,000	3,896,394	2030/09/20
121回 利付国庫債券 (20年)		1.9000	1,040,000	1,089,826	2030/09/20
122回 利付国庫債券 (20年)		1.8000	870,000	906,835	2030/09/20
4回 利付国庫債券 (30年)		2.9000	200,000	220,922	2030/11/20
361回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,900,000	3,696,147	2030/12/20
123回 利付国庫債券 (20年)		2.1000	1,450,000	1,537,971	2030/12/20
362回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,910,000	3,695,419	2031/03/20
125回 利付国庫債券 (20年)		2.2000	900,000	961,668	2031/03/20

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	
126回 利付国庫債券 (20年)		2.0000	910,000	961,642	2031/03/20
127回 利付国庫債券 (20年)		1.9000	840,000	882,856	2031/03/20
363回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	4,170,000	3,928,765	2031/06/20
128回 利付国庫債券 (20年)		1.9000	200,000	210,412	2031/06/20
364回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	4,110,000	3,859,824	2031/09/20
130回 利付国庫債券 (20年)		1.8000	1,110,000	1,162,369	2031/09/20
131回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	1,100,000	1,144,759	2031/09/20
6回 利付国庫債券 (30年)		2.4000	200,000	217,238	2031/11/20
365回 利付国庫債券 (10年)		0.1000	3,630,000	3,396,954	2031/12/20
132回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	530,000	551,624	2031/12/20
133回 利付国庫債券 (20年)		1.8000	1,630,000	1,707,441	2031/12/20
366回 利付国庫債券 (10年)		0.2000	4,040,000	3,794,772	2032/03/20
134回 利付国庫債券 (20年)		1.8000	900,000	943,263	2032/03/20
135回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	130,000	135,348	2032/03/20
136回 利付国庫債券 (20年)		1.6000	560,000	579,353	2032/03/20
367回 利付国庫債券 (10年)		0.2000	3,970,000	3,714,808	2032/06/20
137回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	480,000	499,718	2032/06/20
138回 利付国庫債券 (20年)		1.5000	1,060,000	1,088,779	2032/06/20
139回 利付国庫債券 (20年)		1.6000	680,000	703,079	2032/06/20
368回 利付国庫債券 (10年)		0.2000	4,750,000	4,427,285	2032/09/20
140回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	950,000	988,883	2032/09/20
369回 利付国庫債券 (10年)		0.5000	2,920,000	2,776,540	2032/12/20
141回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	1,560,000	1,622,852	2032/12/20
142回 利付国庫債券 (20年)		1.8000	730,000	764,937	2032/12/20
370回 利付国庫債券 (10年)		0.5000	4,150,000	3,932,996	2033/03/20
143回 利付国庫債券 (20年)		1.6000	2,130,000	2,198,458	2033/03/20
144回 利付国庫債券 (20年)		1.5000	1,050,000	1,075,588	2033/03/20
371回 利付国庫債券 (10年)		0.4000	3,600,000	3,372,768	2033/06/20
11回 利付国庫債券 (30年)		1.7000	250,000	259,965	2033/06/20
145回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	2,250,000	2,339,685	2033/06/20
372回 利付国庫債券 (10年)		0.8000	5,100,000	4,925,784	2033/09/20
12回 利付国庫債券 (30年)		2.1000	230,000	246,403	2033/09/20
146回 利付国庫債券 (20年)		1.7000	2,240,000	2,327,203	2033/09/20
1回 C T 利付国庫債券 (10年)		0.7000	1,700,000	1,617,856	2033/12/20
373回 利付国庫債券 (10年)		0.6000	4,400,000	4,164,072	2033/12/20
13回 利付国庫債券 (30年)		2.0000	150,000	159,460	2033/12/20
147回 利付国庫債券 (20年)		1.6000	1,290,000	1,328,571	2033/12/20
2回 C T 利付国庫債券 (10年)		1.0000	1,500,000	1,460,460	2034/03/20
374回 利付国庫債券 (10年)		0.8000	3,100,000	2,975,256	2034/03/20
14回 利付国庫債券 (30年)		2.4000	340,000	372,810	2034/03/20
148回 利付国庫債券 (20年)		1.5000	1,730,000	1,763,838	2034/03/20
375回 利付国庫債券 (10年)		1.1000	3,680,000	3,617,182	2034/06/20
15回 利付国庫債券 (30年)		2.5000	260,000	287,411	2034/06/20
149回 利付国庫債券 (20年)		1.5000	2,290,000	2,331,036	2034/06/20
376回 利付国庫債券 (10年)		0.9000	4,000,000	3,850,440	2034/09/20
16回 利付国庫債券 (30年)		2.5000	240,000	265,572	2034/09/20
150回 利付国庫債券 (20年)		1.4000	2,330,000	2,347,847	2034/09/20

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	
377回	利付国庫債券 (10年)	1.2000	1,500,000	1,480,455	2034/12/20
17回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	270,000	296,292	2034/12/20
151回	利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,360,000	2,329,249	2034/12/20
18回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	400,000	435,080	2035/03/20
152回	利付国庫債券 (20年)	1.2000	1,640,000	1,614,580	2035/03/20
19回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	280,000	304,404	2035/06/20
153回	利付国庫債券 (20年)	1.3000	2,660,000	2,637,150	2035/06/20
20回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	330,000	365,158	2035/09/20
154回	利付国庫債券 (20年)	1.2000	2,420,000	2,369,881	2035/09/20
21回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	310,000	336,886	2035/12/20
155回	利付国庫債券 (20年)	1.0000	2,280,000	2,180,820	2035/12/20
22回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	290,000	320,916	2036/03/20
156回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,280,000	2,034,854	2036/03/20
23回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	350,000	387,289	2036/06/20
157回	利付国庫債券 (20年)	0.2000	2,380,000	2,064,197	2036/06/20
158回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,390,000	2,138,189	2036/09/20
25回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	330,000	357,977	2036/12/20
159回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,340,000	1,207,822	2036/12/20
26回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	620,000	679,166	2037/03/20
160回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	1,520,000	1,380,752	2037/03/20
161回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,760,000	1,572,172	2037/06/20
27回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	620,000	685,286	2037/09/20
162回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,930,000	1,716,059	2037/09/20
163回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	1,730,000	1,531,067	2037/12/20
28回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	770,000	850,495	2038/03/20
164回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,570,000	2,233,895	2038/03/20
165回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,870,000	1,617,232	2038/06/20
29回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	860,000	938,363	2038/09/20
166回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	2,260,000	1,999,467	2038/09/20
167回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,950,000	1,669,141	2038/12/20
30回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	880,000	947,531	2039/03/20
168回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	2,200,000	1,846,658	2039/03/20
169回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,820,000	1,496,094	2039/06/20
31回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	720,000	764,316	2039/09/20
170回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,700,000	1,389,291	2039/09/20
171回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	1,540,000	1,251,157	2039/12/20
32回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	970,000	1,039,869	2040/03/20
172回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,780,000	1,461,807	2040/03/20
173回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,960,000	1,600,379	2040/06/20
33回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,180,000	1,213,889	2040/09/20
174回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,570,000	1,274,494	2040/09/20
175回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,020,000	1,657,531	2040/12/20
34回	利付国庫債券 (30年)	2.2000	1,200,000	1,263,012	2041/03/20
176回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	2,200,000	1,796,190	2041/03/20
177回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	1,500,000	1,197,090	2041/06/20
35回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,060,000	1,082,238	2041/09/20
178回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,900,000	1,534,478	2041/09/20

銘	柄	当 期 末			
		利 率	額面金額	評 価 額	
(国債証券)		%	千円	千円	
179回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	1,810,000	1,454,262	2041/12/20
36回	利付国庫債券 (30年)	2.0000	1,370,000	1,393,961	2042/03/20
180回	利付国庫債券 (20年)	0.8000	2,240,000	1,888,096	2042/03/20
181回	利付国庫債券 (20年)	0.9000	1,900,000	1,622,581	2042/06/20
37回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	1,360,000	1,358,204	2042/09/20
182回	利付国庫債券 (20年)	1.1000	1,750,000	1,540,052	2042/09/20
183回	利付国庫債券 (20年)	1.4000	1,800,000	1,659,078	2042/12/20
38回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	850,000	833,510	2043/03/20
184回	利付国庫債券 (20年)	1.1000	1,580,000	1,381,046	2043/03/20
39回	利付国庫債券 (30年)	1.9000	1,210,000	1,202,631	2043/06/20
185回	利付国庫債券 (20年)	1.1000	2,200,000	1,916,332	2043/06/20
40回	利付国庫債券 (30年)	1.8000	1,030,000	1,005,486	2043/09/20
186回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	2,300,000	2,138,356	2043/09/20
41回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,060,000	1,016,487	2043/12/20
187回	利付国庫債券 (20年)	1.3000	1,800,000	1,613,232	2043/12/20
42回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,000,000	956,580	2044/03/20
188回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	1,450,000	1,364,232	2044/03/20
43回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	710,000	677,460	2044/06/20
189回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	1,800,000	1,774,890	2044/06/20
44回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	1,130,000	1,076,223	2044/09/20
190回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	1,200,000	1,162,128	2044/09/20
45回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,250,000	1,147,375	2044/12/20
46回	利付国庫債券 (30年)	1.5000	1,540,000	1,409,469	2045/03/20
47回	利付国庫債券 (30年)	1.6000	1,340,000	1,245,396	2045/06/20
48回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,470,000	1,313,592	2045/09/20
49回	利付国庫債券 (30年)	1.4000	1,300,000	1,158,014	2045/12/20
50回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,250,000	982,362	2046/03/20
51回	利付国庫債券 (30年)	0.3000	620,000	431,706	2046/06/20
52回	利付国庫債券 (30年)	0.5000	2,450,000	1,780,415	2046/09/20
53回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,320,000	977,446	2046/12/20
54回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	900,000	694,647	2047/03/20
55回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,080,000	829,926	2047/06/20
56回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,140,000	872,179	2047/09/20
57回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	830,000	632,219	2047/12/20
1回	利付国庫債券 (40年)	2.4000	110,000	115,398	2048/03/20
58回	利付国庫債券 (30年)	0.8000	1,560,000	1,183,072	2048/03/20
59回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	1,220,000	899,652	2048/06/20
60回	利付国庫債券 (30年)	0.9000	1,030,000	793,697	2048/09/20
61回	利付国庫債券 (30年)	0.7000	960,000	701,366	2048/12/20
2回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	330,000	332,880	2049/03/20
62回	利付国庫債券 (30年)	0.5000	720,000	497,167	2049/03/20
63回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	850,000	568,301	2049/06/20
64回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	900,000	598,518	2049/09/20
65回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	1,000,000	661,480	2049/12/20
3回	利付国庫債券 (40年)	2.2000	540,000	541,749	2050/03/20
66回	利付国庫債券 (30年)	0.4000	890,000	584,730	2050/03/20
67回	利付国庫債券 (30年)	0.6000	1,190,000	822,682	2050/06/20

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(国債証券)		%	千円	千円
6 8回	利付国庫債券 (3 0年)	0.6000	1,240,000	852,376 2050/09/20
6 9回	利付国庫債券 (3 0年)	0.7000	1,360,000	956,188 2050/12/20
4回	利付国庫債券 (4 0年)	2.2000	720,000	716,436 2051/03/20
7 0回	利付国庫債券 (3 0年)	0.7000	1,300,000	909,012 2051/03/20
7 1回	利付国庫債券 (3 0年)	0.7000	1,030,000	716,787 2051/06/20
7 2回	利付国庫債券 (3 0年)	0.7000	1,590,000	1,101,218 2051/09/20
7 3回	利付国庫債券 (3 0年)	0.7000	1,290,000	889,197 2051/12/20
5回	利付国庫債券 (4 0年)	2.0000	710,000	672,767 2052/03/20
7 4回	利付国庫債券 (3 0年)	1.0000	1,670,000	1,246,321 2052/03/20
7 5回	利付国庫債券 (3 0年)	1.3000	1,820,000	1,464,135 2052/06/20
7 6回	利付国庫債券 (3 0年)	1.4000	1,320,000	1,085,581 2052/09/20
7 7回	利付国庫債券 (3 0年)	1.6000	1,380,000	1,188,814 2052/12/20
6回	利付国庫債券 (4 0年)	1.9000	940,000	866,228 2053/03/20
7 8回	利付国庫債券 (3 0年)	1.4000	1,300,000	1,064,050 2053/03/20
7 9回	利付国庫債券 (3 0年)	1.2000	1,450,000	1,124,286 2053/06/20
8 0回	利付国庫債券 (3 0年)	1.8000	1,680,000	1,507,800 2053/09/20
8 1回	利付国庫債券 (3 0年)	1.6000	1,000,000	854,190 2053/12/20
7回	利付国庫債券 (4 0年)	1.7000	1,030,000	900,333 2054/03/20
8 2回	利付国庫債券 (3 0年)	1.8000	1,310,000	1,172,345 2054/03/20
8 3回	利付国庫債券 (3 0年)	2.2000	1,400,000	1,369,466 2054/06/20
8 4回	利付国庫債券 (3 0年)	2.1000	1,110,000	1,061,559 2054/09/20
8 5回	利付国庫債券 (3 0年)	2.3000	300,000	299,469 2054/12/20
8回	利付国庫債券 (4 0年)	1.4000	990,000	795,494 2055/03/20
9回	利付国庫債券 (4 0年)	0.4000	1,780,000	1,024,870 2056/03/20
1 0回	利付国庫債券 (4 0年)	0.9000	1,730,000	1,171,469 2057/03/20
1 1回	利付国庫債券 (4 0年)	0.8000	1,380,000	890,679 2058/03/20
1 2回	利付国庫債券 (4 0年)	0.5000	1,420,000	803,450 2059/03/20
1 3回	利付国庫債券 (4 0年)	0.5000	1,820,000	1,009,463 2060/03/20
1 4回	利付国庫債券 (4 0年)	0.7000	1,420,000	835,982 2061/03/20
1 5回	利付国庫債券 (4 0年)	1.0000	1,870,000	1,210,264 2062/03/20
1 6回	利付国庫債券 (4 0年)	1.3000	1,940,000	1,369,581 2063/03/20
1 7回	利付国庫債券 (4 0年)	2.2000	1,800,000	1,649,232 2064/03/20
小	計	—	435,325,000	406,407,229 —
(地方債証券)		%	千円	千円
2 7年度9回	千葉県公募公債	0.0950	100,000	99,297 2026/03/25
1 5 7回	共同発行市場公募地方債	0.0800	120,000	119,047 2026/04/24
9回	東京都公募公債 2 0年	2.4400	200,000	204,420 2026/06/19
1 5 9回	共同発行市場公募地方債	0.0700	200,000	198,060 2026/06/25
1 6 0回	共同発行市場公募地方債	0.0500	500,000	494,625 2026/07/24
1回	兵庫県公募公債 1 5年	1.6600	200,000	202,452 2026/07/29
2 8年度6回	北海道公募公債	0.0700	100,000	98,849 2026/08/31
7 6 0回	東京都公募公債	0.0450	100,000	98,758 2026/09/18
1 0回	東京都公募公債 2 0年	2.3300	300,000	307,092 2026/09/18
4回	京都市公募公債 2 0年	2.5100	100,000	102,639 2026/09/18
4 1 3回	大阪府公募公債 1 0年	0.0210	100,000	98,621 2026/10/28
1 9 0回	大阪府公募公債 5年	0.0010	300,000	295,332 2026/12/25
1 6 6回	共同発行市場公募地方債	0.1800	500,000	493,475 2027/01/25

銘	柄	当 期 末		
		利 率	額面金額	評 価 額 償還年月日
(地方債証券)		%	千円	千円
令和3年度3回 仙台市公募債 5年		0.0010	300,000	295,038 2027/01/28
2 8年度8回 福岡県公募債		0.2400	100,000	98,748 2027/02/24
1 6 9回 共同発行市場公募地方債		0.2050	500,000	492,765 2027/04/23
4 1 9回 大阪府公募債 1 0年		0.1960	100,000	98,515 2027/04/27
2回 静岡県公募債 1 5年		1.4060	100,000	101,203 2027/06/25
5回 兵庫県公募債 1 2年		0.6870	100,000	99,512 2027/07/07
1 7 3回 共同発行市場公募地方債		0.2150	400,000	393,132 2027/08/25
2 9年度4回 大阪市公募債		0.1500	200,000	196,112 2027/09/21
1 7 4回 共同発行市場公募地方債		0.1450	100,000	98,038 2027/09/24
2 4年度1回 福岡県公募債 1 5年		1.3290	100,000	101,139 2027/11/29
1 7 8回 共同発行市場公募地方債		0.2300	100,000	97,978 2028/01/25
1 7 9回 共同発行市場公募地方債		0.2400	500,000	489,610 2028/02/25
2 9年度6回 広島市公募債		0.2300	300,000	293,679 2028/02/25
2 9年度1 3回 京都府公募債		0.2000	109,330	106,858 2028/03/16
5回 兵庫県公募債 1 5年		1.3100	300,000	303,333 2028/05/26
7 8 3回 東京都公募債		0.2200	110,000	107,290 2028/06/20
4回 静岡県公募債 1 5年		1.3380	100,000	101,211 2028/06/23
3 0年度8回 北海道公募債		0.2490	400,000	389,720 2028/08/31
3 0年度7回 神戸市公募債 3 0年		0.2540	300,000	292,176 2028/09/20
第9 1回 川崎市公募債		0.1850	200,000	194,304 2028/09/20
7回 静岡県公募債 2 0年		2.3200	300,000	314,034 2028/09/21
3 0年度3回 広島県公募債		0.2540	100,000	97,382 2028/09/25
3 0年度3回 堺市公募債		0.1950	100,000	96,893 2028/12/19
2 3 7回 神奈川県公募債		0.1350	200,000	193,338 2028/12/20
2 0回2号 福岡県公募債		2.0500	100,000	103,870 2028/12/20
6回 大阪市公募債 2 0年		2.2100	200,000	208,924 2028/12/20
1 7回 横浜市公募債 2 0年		2.0700	100,000	103,944 2028/12/20
6回 北九州市公募債 2 0年		2.0300	100,000	103,796 2028/12/20
3 0年度6回 福岡県公募債		0.2000	200,000	193,816 2028/12/21
1 8 9回 共同発行市場公募地方債		0.2100	100,000	96,936 2028/12/25
3 0年度1 4回 北海道公募債		0.1950	400,000	387,496 2028/12/28
1 8回 東京都公募債 2 0年		2.2200	100,000	104,691 2029/03/19
3 0年度1 9回 愛知県公募債		0.1150	200,000	192,504 2029/03/28
3 0年度3回 岡山県公募債 1 0年		0.1500	200,000	192,776 2029/03/29
1 9 4回 共同発行市場公募地方債		0.1100	300,000	288,132 2029/05/25
6回 川崎市公募債 2 0年		2.2100	200,000	209,594 2029/05/25
令和元年度1回 福岡県公募債		0.0290	200,000	191,194 2029/06/21
9回 兵庫県公募債 1 5年		1.0200	100,000	99,792 2029/07/13
1 1回 神奈川県公募債 2 0年		2.0800	100,000	104,340 2029/07/20
1 9 6回 共同発行市場公募地方債		0.0600	500,000	478,090 2029/07/25
7 9 6回 東京都公募債		0.0400	200,000	190,644 2029/09/20
令和元年度 9回 静岡県公募債		0.0500	200,000	190,730 2029/09/20
令和元年度3回 横浜市公募債		0.0500	400,000	381,124 2029/10/16
令和元年度1 6回 兵庫県公募債		0.0500	200,000	190,528 2029/10/23
2 1回 東京都公募債 2 0年		2.1900	100,000	105,136 2029/12/20
1 7回 さいたま市公募債		0.1100	200,000	190,644 2029/12/25
令和元年度第8回 埼玉県公募債		0.1350	200,000	190,718 2030/01/30

銘	柄	当期末		
		利率	額面金額	評価額 償還年月日
(地方債証券)		%	千円	千円
21年度2回	福岡県公債(20年)	2.2300	100,000	105,496 2030/02/22
203回	共同発行市場公募地方債	0.0950	100,000	95,090 2030/02/25
802回	東京都公債公債	0.1300	400,000	380,832 2030/03/19
511回	名古屋市公債 10年	0.0750	200,000	189,796 2030/03/27
令和2年度1回	京都府公債公債	0.1350	400,000	380,580 2030/04/12
令和2年 2回	大阪府公債公債	0.1310	300,000	285,051 2030/05/22
9回	埼玉県公債公債 20年	2.1500	100,000	105,318 2030/05/24
8回	静岡県公債公債 15年	0.8280	200,000	197,078 2030/06/07
令和2年度 10回	静岡県公債公債	0.1350	100,000	94,686 2030/09/20
令和2年5回	福岡県公債公債	0.1350	100,000	94,606 2030/10/23
36回2号	宮城県公債公債 10年	0.1350	250,000	236,485 2030/10/28
令和2年度1回	福島県公債公債	0.1350	200,000	189,042 2030/11/27
令和2年度1回	高知県公債公債	0.1350	200,000	189,042 2030/11/27
22年度14回	愛知県公債公債	2.0870	300,000	316,302 2030/12/13
9回	京都市公債公債 20年	2.1430	200,000	211,560 2030/12/17
813回	東京都公債公債	0.1790	300,000	284,118 2030/12/20
16回	神奈川県公債公債 20年	2.0900	300,000	316,566 2031/01/24
464回	大阪府公債公債 10年	0.0720	200,000	187,932 2031/01/28
令和2年度19回	北海道公債公債	0.1450	100,000	94,276 2031/02/26
令和2年度14回	京都府公債公債	0.2140	200,000	189,268 2031/03/12
令和2年 7回	広島県公債公債	0.2140	200,000	189,236 2031/03/19
251回	神奈川県公債公債 10年	0.1990	200,000	189,060 2031/03/20
令和2年度 14回	静岡県公債公債	0.1400	200,000	188,336 2031/03/20
令和3年度1回	長野県公債公債 10年	0.1900	200,000	188,778 2031/04/16
令和3年度2回	兵庫県公債公債	0.1750	100,000	94,255 2031/04/25
467回	大阪府公債公債 10年	0.1640	200,000	188,368 2031/04/28
469回	大阪府公債公債 10年	0.1280	200,000	187,544 2031/06/27
11回	北九州市公債公債 20年	2.0190	300,000	316,158 2031/07/18
令和3年 5回	千葉県公債公債	0.1050	200,000	186,584 2031/09/25
472回	大阪府公債公債 10年	0.1000	200,000	186,502 2031/09/29
474回	大阪府公債公債 10年	0.1190	300,000	279,384 2031/11/28
19回	神奈川県公債公債 20年	1.8180	100,000	104,203 2032/01/30
227回	共同発行市場公募地方債	0.2440	500,000	468,095 2032/02/25
228回	共同発行市場公募地方債	0.1990	500,000	466,150 2032/03/25
258回	神奈川県公債公債 10年	0.2900	300,000	280,542 2032/06/18
24年度2回	福岡県公債公債(20年)	1.6350	300,000	308,661 2032/08/16
10回	大阪府公債公債 20年	1.7200	200,000	206,890 2032/09/24
24年度12回	神戸市公債公債	1.7110	200,000	206,802 2032/12/17
14回	千葉県公債公債 20年	1.1370	100,000	98,864 2033/04/15
13回	埼玉県公債公債 20年	1.5990	100,000	102,380 2033/05/20
1回	東京都公債公債 30年	2.2100	200,000	214,346 2033/06/20
14回	埼玉県公債公債 20年	1.5460	300,000	304,200 2034/05/08
26年度4回	愛知県公債公債 20年	1.5420	200,000	202,656 2034/05/15
29回	横浜市公債公債 20年	1.5280	100,000	101,217 2034/05/26
16回	名古屋市公債公債 20年	1.5200	100,000	101,113 2034/06/09
5回	群馬県公債公債 20年	1.5290	100,000	101,148 2034/06/16
17回	北九州市公債公債 20年	1.5290	100,000	101,149 2034/06/20

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	
31回	東京都公債券 20年	1.2380	200,000	196,758	2034/09/20
15回	埼玉県公債券 20年	1.1660	100,000	97,263	2035/02/16
2回	横浜市公債券 30年	2.4900	100,000	109,542	2035/03/20
18回	千葉県公債券 20年	1.1380	100,000	96,808	2035/04/13
17回	名古屋市公債券 20年	1.2030	100,000	97,310	2035/05/28
13回	大阪府公債券 20年	1.2030	100,000	96,924	2035/09/28
14回	大阪府公債券 20年	0.5400	100,000	88,867	2036/09/29
21回	千葉県公債券 20年	0.4240	100,000	87,531	2036/10/15
3回	神奈川県公債券 30年	2.6200	100,000	110,828	2037/03/19
29年度2回	広島市公債券	0.6160	200,000	176,456	2037/08/18
29年度5回	札幌市公債券 20年	0.5970	300,000	263,481	2037/09/18
30年度2回	仙台市公債券 20年	0.7290	100,000	87,571	2038/10/18
30年度7回	福岡市公債券	0.7010	200,000	174,434	2038/10/19
2019年度5回	福岡市公債券 20年	0.2860	100,000	80,691	2039/07/29
2回	兵庫県公債券 30年	2.3600	100,000	106,573	2040/03/19
22年度8回	福岡市公債券	2.2800	100,000	105,196	2040/09/20
令和2年 2回	広島県公債券	0.4640	100,000	80,775	2040/09/21
23年度7回	札幌市公債券 30年	2.0970	100,000	102,028	2041/09/20
5回	川崎市公債券 30年	2.0970	100,000	101,682	2042/03/20
24年度12回	愛知県公債券 30年	2.1200	100,000	101,702	2042/09/19
14回	東京都公債券 30年	2.0500	100,000	100,127	2043/06/19
27年度8回	愛知県公債券 30年	1.5790	150,000	136,233	2045/06/20
27年度 2回	広島県公債券 30年	0.7110	100,000	75,402	2046/03/22
6回	埼玉県公債券 30年	0.9570	200,000	157,048	2046/12/20
令和元年度7回	愛知県公債券	0.3690	300,000	193,866	2049/06/18
令和元年3回	福岡県公債券 30年	0.4320	200,000	131,538	2049/06/18
12回	埼玉県公債券 30年	0.4740	300,000	197,601	2049/12/20
令和3年度6回	神戸市公債券 30年	0.7130	200,000	136,086	2051/06/20
小	計	—	26,539,330	25,560,160	—
(特殊債券)		%	千円	千円	
40回	政保日本政策金融公庫債券	0.0200	103,000	102,270	2026/03/13
33回	政保日本政策投資銀行社債	0.0200	300,000	297,858	2026/03/16
87回	中日本高速道路債券	0.0600	400,000	396,848	2026/03/18
11回	独立行政法人福祉医療機構	2.5700	100,000	101,945	2026/03/20
271回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.0200	300,000	297,744	2026/03/31
187回	住宅金融支援機構債券	0.0900	100,000	99,172	2026/04/20
83回	地方公共団体金融機構債券 10年	0.0900	400,000	396,700	2026/04/28
80回	住宅金融支援機構債券	1.5890	100,000	101,112	2026/09/18
321回	住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	493,130	2026/09/18
325回	住宅金融支援機構債券	0.0100	500,000	493,130	2026/09/18
79回	政保地方公共団体金融機構債券	1.5070	300,000	303,210	2026/11/06
91回	政保地方公共団体金融機構債券	0.0850	100,000	98,691	2026/12/14
300回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1150	100,000	98,639	2027/01/29
F147回	地方公共団体金融機構債券	1.2910	200,000	201,588	2027/03/19
78回	日本政策投資銀行債券	0.2250	300,000	295,527	2027/04/13
309回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1400	800,000	787,792	2027/04/30
96回	地方公共団体金融機構債券	0.2050	500,000	491,900	2027/05/28

銘 柄	期 末			
	利 率	額面金額	評 価 額	償還年月日
(特殊債券)	%	千円	千円	
7 2 回 東日本高速道路社債	0.1200	200,000	196,176	2027/06/18
9 8 回 政保地方公共団体金融機構債券	0.1600	100,000	98,342	2027/07/16
2 2 2 回 住宅金融支援機構債券	0.2100	300,000	293,865	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	97,978	2027/12/17
1 2 4 回 住宅金融支援機構債券	1.4280	100,000	101,296	2027/12/20
7 7 回 東日本高速道路社債	0.1100	300,000	292,647	2027/12/20
2 3 0 回 住宅金融支援機構債券	0.2600	300,000	293,550	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	97,338	2028/10/16
9 回 新関西国際空港社債	1.2310	200,000	200,668	2028/12/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.0700	200,000	207,580	2028/12/20
9 3 回 都市再生債券	1.1020	100,000	99,887	2029/06/20
1 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	314,589	2029/06/28
2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.2660	300,000	314,985	2029/08/28
1 2 回 新関西国際空港社債	1.0670	200,000	198,674	2029/09/20
3 9 回 住宅金融支援機構債券	2.1500	200,000	208,970	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	104,865	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	98,072	2030/05/28
1 0 9 回 都市再生機構債券	0.9180	200,000	197,264	2030/06/20
1 5 回 日本政策金融公庫債券	1.9110	200,000	207,980	2030/10/29
1 2 1 回政保日本高速道路保有・債務返済機構	1.8000	500,000	519,640	2030/10/31
1 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	2.1320	100,000	105,501	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	187,812	2031/05/30
7 5 回 住宅金融支援機構債券	2.0660	350,000	368,144	2031/06/13
7 5 回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.9600	100,000	104,612	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	104,267	2031/12/26
1 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.8400	200,000	207,984	2031/12/26
1 5 6 回 日本政策投資銀行債券	0.2990	400,000	373,396	2032/04/14
2 3 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.6800	100,000	102,860	2032/07/28
1 1 5 回 住宅金融支援機構債券	1.8110	100,000	103,597	2032/09/14
1 5 回 国際協力機構債	1.7240	100,000	102,964	2032/09/17
2 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.7020	200,000	205,930	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	101,035	2033/04/28
2 8 回 日本道路・機構承継債	2.8300	500,000	558,260	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	100,924	2034/03/17
3 6 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.5660	100,000	101,146	2034/04/28
3 9 回 地方公共団体金融機構債券	1.4250	500,000	497,890	2034/09/28
4 2 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.9990	300,000	285,750	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	291,990	2035/02/28
1 5 9 回 住宅金融支援機構債券	1.1250	100,000	95,942	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	97,510	2035/06/20
4 4 回 地方公共団体金融機構債券 20年	1.2980	200,000	195,062	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	98,316	2035/06/29
第 2 6 2 回 政保道路債	1.1090	500,000	481,165	2035/11/30
1 7 2 回 高速道路機構債	0.2880	200,000	171,994	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	173,914	2036/08/29
5 9 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.6690	100,000	88,731	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	177,728	2037/07/31

銘 柄	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 6 回 高速道路機構債	2.6700	200,000	220,904	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	87,576	2038/01/29
2 3 3 回 住宅金融支援機構債券	0.5830	100,000	85,894	2038/04/20
F 1 7 4 回 地方公共団体金融機構債券	1.8890	300,000	303,681	2038/05/28
2 1 0 回 高速道路機構債	0.6770	100,000	86,322	2038/09/17
5 0 回 高速道路機構債	0.5000	300,000	247,812	2039/03/18
7 7 回 地方公共団体金融機構債券 20年	0.2000	300,000	236,109	2039/09/28
1 2 5 回 日本政策投資銀行債券	0.3790	500,000	398,150	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	280,218	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	99,091	2040/08/31
1 4 8 回 住宅金融支援機構債券	1.9750	250,000	243,795	2043/12/18
2 7 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	2.0500	13,084	13,305	2044/08/10
2 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.9500	82,575	84,342	2044/10/10
3 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.8100	123,800	126,159	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	89,586	2045/06/20
3 8 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.6100	17,764	18,009	2045/07/10
1 回 高速道路機構債	2.9900	300,000	335,916	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	175,576	2045/10/31
1 6 9 回 高速道路機構債	1.2000	100,000	82,301	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	85,636	2046/01/31
4 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.7600	15,181	15,447	2046/06/10
5 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.5100	17,730	17,923	2046/09/10
5 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.4800	18,810	18,994	2046/10/10
1 9 回 高速道路機構債	2.7500	150,000	161,046	2047/03/20
6 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.3400	22,851	22,913	2047/05/10
6 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.1600	56,672	56,182	2047/09/10
3 6 回 高速道路機構債	2.8400	300,000	325,884	2048/03/20
7 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.2100	25,449	25,315	2048/09/10
8 2 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	30,977	30,345	2049/03/10
8 4 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0100	31,401	30,744	2049/05/10
8 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.0000	34,801	33,911	2049/07/10
9 0 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8700	36,455	35,257	2049/11/10
3 9 8 回 政保道路債	0.4220	300,000	195,834	2049/12/28
9 3 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.6000	41,690	39,386	2050/02/10
1 0 回 地方公共団体金融機構債券 30年	0.5170	300,000	193,542	2050/04/28
9 6 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.7400	46,781	44,434	2050/05/10
1 3 1 回 日本政策投資銀行債券	0.7000	100,000	67,609	2050/06/20
1 6 5 回 都市再生機構債券	0.7090	200,000	134,600	2050/06/20
9 9 回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.8800	48,966	46,716	2050/08/10
4 1 8 回 高速道路機構債	0.6300	200,000	133,222	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	134,802	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	186,138	169,767	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	63,483	58,121	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	62,993	57,774	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	63,493	58,153	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	197,616	179,417	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	197,166	178,890	2053/01/10

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	
136回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4200	135,408	122,645	2053/03/10
131回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	202,101	182,430	2053/04/10
132回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	199,938	180,591	2053/05/10
137回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4700	348,765	315,621	2053/10/10
139回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4600	69,280	62,624	2053/12/10
142回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3200	71,692	63,972	2054/03/10
154回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3000	233,613	206,642	2055/03/10
162回 日本高速道路保有・債務返済機構	1.8610	100,000	84,745	2055/03/19
156回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3500	310,296	275,248	2055/05/10
160回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3700	239,043	211,940	2055/09/10
168回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.4000	244,734	217,382	2056/05/10
170回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.3600	744,084	659,087	2056/07/10
413回 政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.6880	200,000	113,712	2061/02/28
小 計	—	24,387,830	23,149,313	—
(金融債券)	%	千円	千円	
い第851号 利付商工債	0.0900	300,000	297,318	2026/04/27
377回 利附信金中金債(5年)	0.0400	300,000	297,246	2026/04/27
い第854号 利付商工債	0.0800	300,000	296,271	2026/07/27
い第855号 利付商工債	0.0800	200,000	197,326	2026/08/27
小 計	—	1,100,000	1,088,161	—
(普通社債券)	%	千円	千円	
26回 トヨタ自動車社債	0.0500	200,000	198,232	2026/03/18
42回 王子ホールディングス社債	0.0800	200,000	198,108	2026/03/24
96回 トヨタファイナンス社債	0.0600	100,000	99,056	2026/04/15
163回 東日本旅客鉄道社債	0.0500	300,000	297,165	2026/04/15
28回 芙蓉総合リース社債	0.1400	300,000	297,141	2026/04/21
493回 九州電力社債	0.1000	200,000	197,866	2026/05/25
106回 住友不動産社債	0.4000	100,000	99,274	2026/05/26
24回 大和ハウス工業社債	0.0800	200,000	197,804	2026/06/03
40回 三菱ケミカルホールディングス社債	0.0900	100,000	98,877	2026/06/03
35回 三菱マテリアル社債	0.1100	300,000	296,463	2026/06/05
11回 フレディ・アグリコル・エス・エー円貨社債(2016)	0.4000	100,000	98,973	2026/06/10
57回 東日本高速道路社債	0.1100	100,000	99,016	2026/06/19
79回 東日本高速道路社債	0.0500	300,000	296,808	2026/06/19
83回 東日本高速道路社債	0.0500	200,000	197,872	2026/06/19
61回 東日本高速道路債券	0.0400	500,000	494,615	2026/06/19
69回 ホンダファイナンス社債	0.0900	300,000	296,517	2026/06/19
4回 東京地下鉄社債	2.3800	120,000	122,353	2026/06/19
307回 北陸電力社債	1.0550	100,000	100,126	2026/06/25
90回 中日本高速道路債券	0.0500	200,000	197,654	2026/07/27
20回 三井住友信託銀行社債	0.1300	300,000	296,172	2026/07/27
3回 野村ホールディングス社債	0.2800	300,000	295,725	2026/09/04
91回 中日本高速道路債券	0.0400	500,000	493,300	2026/09/17
62回 西日本高速道路債券	0.0400	500,000	493,285	2026/09/18
17回 パナソニック社債	0.4700	100,000	99,030	2026/09/18
27回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.2200	200,000	197,294	2026/10/16
488回 東北電力社債	0.2900	100,000	98,783	2026/10/23

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	
33回 西日本高速道路債券	0.2700	300,000	296,541	2026/12/14
34回 西日本高速道路債券	0.3350	200,000	197,666	2027/02/16
12回 リソナ銀行劣後社債	2.4640	100,000	101,607	2027/03/15
88回 三菱東京UFJ銀行社債	2.3400	100,000	102,628	2027/04/20
508回 関西電力社債	0.4550	300,000	295,998	2027/04/23
340回 北海道電力社債	0.4800	300,000	296,031	2027/04/23
108回 住友不動産社債	0.4000	200,000	196,962	2027/05/07
30回 東レ社債	0.3750	300,000	295,017	2027/07/16
2回 東海旅客鉄道社債	2.3100	100,000	103,215	2027/09/17
311回 北陸電力社債	0.8470	100,000	99,320	2027/09/24
25回 フランス郵政公社銀行(BFCM)円貨社債(2017)	0.5100	300,000	293,121	2027/10/12
81回 トヨタファイナンス社債	0.2650	100,000	97,847	2027/10/22
525回 東北電力社債	0.2200	200,000	195,292	2027/10/25
54回 電源開発社債	0.3800	100,000	97,998	2027/11/19
17回 NTTファイナンス社債	0.2800	300,000	292,950	2027/12/20
56回 三菱UFJリース社債	0.4550	300,000	293,625	2028/01/18
12回 ソフトバンク社債	0.4200	400,000	385,940	2028/06/02
7回 ファーストリテイリング社債	0.4050	200,000	194,940	2028/06/06
5回 三井住友トラスト・パナソニックファイナンス社債	0.4940	100,000	96,992	2028/10/25
21回 西日本旅客鉄道社債	2.2470	100,000	104,148	2029/03/21
23回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	100,000	96,156	2029/04/12
14回 プリズストン社債	0.3750	300,000	289,041	2029/04/19
80回 東京急行電鉄社債	1.2110	100,000	99,895	2029/04/27
530回 関西電力社債	0.4050	400,000	384,968	2029/06/20
73回 三井物産社債	0.2900	400,000	383,104	2029/07/11
532回 中部電力社債	0.2240	200,000	190,888	2029/07/25
7回 ニッコンHD社債	0.2800	300,000	284,619	2029/10/11
80回 日立キャピタル社債	0.2800	200,000	190,034	2029/10/19
65回 東日本旅客鉄道普通社債	2.1490	100,000	104,063	2029/12/21
67回 東日本高速道路社債	0.2200	200,000	190,572	2030/01/31
19回 パナソニック社債	0.3700	100,000	94,715	2030/03/05
147回 東日本旅客鉄道社債	0.2650	100,000	94,895	2030/04/22
60回 西日本旅客鉄道社債	0.2550	200,000	189,530	2030/05/21
521回 東北電力社債	0.4500	400,000	380,804	2030/05/24
425回 中国電力社債	0.3700	100,000	94,652	2030/06/25
3回 ダイードグループHD社債	0.5100	300,000	284,349	2030/07/16
31回 三井住友ファイナンス&リース社債	0.3900	200,000	188,764	2030/08/09
6回 横浜高速鉄道社債	0.4500	200,000	189,182	2030/09/17
18回 NTTファイナンス社債	0.3800	400,000	379,044	2030/09/20
71回 東日本旅客鉄道社債	1.9050	100,000	103,301	2030/09/27
17回 ダイセル社債	0.5000	300,000	283,569	2030/12/13
86回 日立キャピタル社債	0.4000	300,000	282,135	2030/12/20
73回 東日本旅客鉄道普通社債	2.0980	200,000	208,956	2030/12/20
23回 パナソニック社債	0.3900	200,000	187,508	2030/12/24
30回 光通信社債	0.9800	200,000	184,486	2031/01/31
74回 西日本旅客鉄道社債	0.2300	100,000	93,580	2031/04/22
491回 九州電力社債	0.3400	300,000	280,044	2031/04/25

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	
5 8 回 川崎重工業社債	0.3000	300,000	277,434	2031/07/15
5 4 1 回 関西電力社債	0.3700	300,000	278,733	2031/09/19
5 3 6 回 東北電力社債	0.2900	300,000	277,164	2031/09/25
1 6 回 武田薬品工業社債	0.4000	500,000	462,970	2031/10/14
7 5 回 電源開発社債	0.3500	200,000	185,390	2031/10/20
3 9 6 回 中国電力社債	0.5540	200,000	186,990	2032/01/23
3 2 0 回 四国電力社債	0.5340	300,000	279,657	2032/04/23
5 0 7 回 九州電力社債	0.6440	200,000	187,296	2032/05/25
4 回 ENEOSホールディングス社債	0.8340	300,000	282,666	2032/06/15
9 回 野村不動産ホールディングス社債	0.9900	100,000	88,892	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	173,964	2036/06/09
4 1 回 東京瓦斯社債	0.5700	200,000	173,792	2036/11/28
5 2 7 回 中部電力社債	0.8060	100,000	86,259	2037/10/23
1 2 7 回 東日本旅客鉄道社債	0.6750	100,000	85,978	2038/01/26
2 6 回 豊田通商社債	0.8970	100,000	85,909	2038/03/05
3 5 0 回 北海道電力社債	0.7540	200,000	168,180	2038/03/25
4 6 3 回 九州電力社債	0.7920	100,000	84,541	2038/05/25
8 回 ファーストリテイリング社債	0.8800	200,000	172,730	2038/06/04
4 3 回 京浜急行電鉄社債	0.6760	100,000	83,481	2038/07/12

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	
4 6 6 回 九州電力社債	0.7200	100,000	83,445	2038/07/23
5 2 回 東京瓦斯社債	0.4860	100,000	81,297	2039/05/23
5 3 1 回 関西電力社債	0.6720	200,000	162,252	2039/06/20
5 5 回 東京瓦斯社債	0.2800	100,000	78,117	2039/09/13
3 7 回 成田国際空港社債	0.4240	100,000	79,749	2040/01/27
1 6 5 回 東日本旅客鉄道社債	0.5960	200,000	158,626	2041/04/15
7 5 回 西日本旅客鉄道社債	0.5820	200,000	158,172	2041/04/22
4 9 2 回 九州電力社債	0.6500	100,000	77,384	2041/04/25
1 0 7 回 東日本旅客鉄道普通社債	1.4150	100,000	86,197	2045/01/27
1 2 5 回 東日本旅客鉄道社債	1.1330	100,000	76,861	2047/07/26
7 0 回 西日本旅客鉄道社債	0.7980	100,000	67,537	2049/12/24
1 7 1 回 東日本旅客鉄道社債	0.8080	200,000	130,682	2051/07/14
5 7 回 東京瓦斯社債	0.6930	300,000	164,868	2057/12/25
7 1 回 西日本旅客鉄道社債	0.9560	100,000	58,219	2059/12/24
4 7 回 東京地下鉄社債	0.9090	100,000	56,772	2060/09/17
1 6 0 回 東日本旅客鉄道社債	0.9700	100,000	57,313	2060/12/17
小 計	-	22,220,000	20,827,718	-
合 計	-	509,572,160	477,032,582	-

■投資信託財産の構成

2025年2月14日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	477,032,582	99.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	5,012,575	1.0
投 資 信 託 財 産 総 額	482,045,158	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

(2025年2月14日)現在

項	目	当 期 末
(A) 資	産	482,045,158,093円
コ	ー ル ・ コ	3,846,590,539
公	社	477,032,582,515
未	収 払	964,300,209
前	利 費	201,684,830
(B) 負	債	923,477,000
未	払 解 約	923,477,000
(C) 純	資 産 総 額(A-B)	481,121,681,093
元	次 期 繰 越 損 益	404,007,998,697
(D) 受	1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	77,113,682.396
		404,007,998,697円
		11,909円
(注1)	期首元本額	433,635,920,893円
	追加設定元本額	581,276,366,462円
	一部解約元本額	610,904,288,658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	31,658,360,244円
	M I T O ラップ型ファンド(安定型)	44,590,897円
	M I T O ラップ型ファンド(中立的)	87,642,668円
	M I T O ラップ型ファンド(積極型)	49,294,815円
	グローバル8資産ラップファンド(安定型)	558,672,868円
	グローバル8資産ラップファンド(中立的)	248,210,332円
	グローバル8資産ラップファンド(積極型)	25,376,126円
	たわらノーロード 国内債券	20,562,302,249円
	たわらノーロード バランス(8資産均等型)	8,279,998,102円
	たわらノーロード バランス(堅実型)	1,814,688,919円
	たわらノーロード バランス(標準型)	4,088,679,604円
	たわらノーロード バランス(積極型)	636,065,990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)	185,422,625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)	2,582,242,712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)	3,153,768,301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)	828,132,492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)	242,747円
	たわらノーロード 最適化バランス(保守型)	57,839,254円
	たわらノーロード 最適化バランス(安定型)	23,033,050円
	たわらノーロード 最適化バランス(安定成長型)	193,685,085円
	たわらノーロード 最適化バランス(成長型)	11,091,875円
	たわらノーロード 最適化バランス(積極型)	62,284円
	マスターズ・マルチアセット・ファンド(安定型)	16,586円
	マスターズ・マルチアセット・ファンド(バランス型)	109,815円
	D I A M国内債券インデックスファンド<DC年金>	12,497,772,453円
	O n eグローバルバランス	295,356,428円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 1安定型	12,680,873,553円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 2安定・成長型	19,236,346,735円
	D I A Mバランス・ファンド<DC年金> 3成長型	9,153,654,701円
	D I A M DCバランス50インデックスファンド	2,662,375,537円
	D I A M DCバランス50インデックスファンド	3,031,710,169円
	D I A M DCバランス70インデックスファンド	611,488,243円
	マネックス資産設計ファンド<隔月分配型>	89,984,128円
	マネックス資産設計ファンド<育成型>	3,493,217,908円
	マネックス資産設計ファンド エポリューション	4,772,050円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国10)	5,958,334,899円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国20)	2,778,010,421円
	D I A M DC 8資産バランスファンド(新興国30)	600,160,258円
	投資のソムリエ	46,508,174,557円
	フルズコントロール	652,167,540円
	投資のソムリエ<DC年金>	6,353,662,906円
	D I A M 8資産バランスファンドN<DC年金>	8,619,903,376円
	4資産分散投資<ハイクラス><DC年金>	3,193,424,911円
	投資のソムリエ<DC年金>リスク抑制型	11,723,540,837円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド	29,332,660,055円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2045)	391,696,981円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2055)	210,978,590円
	リスク抑制世界8資産バランスファンド(D C)	122,224,545円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2035)	1,548,823,378円
	4資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,067,958,867円
	リスクコントロール世界資産分散ファンド	10,701,026,732円
	9資産分散投資・スタンダード<DC年金>	7,056,421,126円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2040)	556,908,674円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2050)	231,247,703円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2060)	139,791,623円
	4資産分散投資・ミドルクラス<DC年金>	3,881,210,358円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2065)	39,993,250円
	O n eグローバル最適化バランス(安定型)<ラップ向け>	170,377,029円
	投資のソムリエ(ターゲット・イヤー2070)	236,734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)	1,202,686,427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)	1,201,939,732円
	マルチアセット・インカム戦略ファンド20-08(適格機関投資家限定)	785,904,666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)	723,537,954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)	1,195,602,744円
	インカム重視マルチアセット運用ファンドI I 2021-04(適格機関投資家限定)	3,052,618,812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)	2,054,831,837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)	833,467,028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)	2,088,942,570円
	予兆モデル活用型戦略シグナルヘッジ付き 2022-05(適格機関投資家限定)	1,333,693,399円
	D I A M国内債券シグナルヘッジ付きファンド(適格機関投資家限定)	8,978,360,500円
	O n eコアポर्टフォリオ戦略ファンド(適格機関投資家限定)	42,158,175円
	投資のソムリエ・私募(適格機関投資家限定)	927,013,322円
	A M O n eマルチアセット・インカム戦略ファンド	202,070,291円
	シグナルヘッジ付き(適格機関投資家限定)	
	D I A Mワールドバッシブ25VA(適格機関投資家限定)	261,951,283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)	82,625,295円
	O n e収益追求型マルチアセット戦略ファンドI I I(適格機関投資家限定)	85,373,971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)	82,365,873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)	2,004,839,123円
	リスクコントロール8資産バランスファンド(E O F 5用)(適格機関投資家専用)	23,704,697円
	A M O n eコアポर्टフォリオ・プラス戦略ファンド(適格機関投資家限定)	16,647,602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)	139,105,386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)	97,930,374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)	20,990,875円
	D I A M国際分散バランスファンド35VA(適格機関投資家限定)	54,904,125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)	29,213,972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)	424,649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)	253,706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)	5,927,475円
	D I A Mバランスファンド25VA(適格機関投資家限定)	2,197,661,321円
	D I A Mバランスファンド37.5VA(適格機関投資家限定)	2,097,143,470円
	D I A Mバランスファンド50VA(適格機関投資家限定)	4,416,962,097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)	5,367,688円
	D I A Mグローバル・アセット・バランスVA 2(適格機関投資家限定)	125,568,707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)	1,329,446,060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)	90,778,035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)	626,489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)	1,015,637,554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)	27,926,143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)	164,815,959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)	232,752,163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)	392,491,350円
	D I A M世界バランス25VA(適格機関投資家限定)	193,129,961円
	D I A M国内バランス30VA(適格機関投資家限定)	48,817,660円
	コアサテライト戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,250,989円
	動的パッケージファンド<DC年金>	342,867,218円
	コア資産形成ファンド	138,387,843円
	たわらノーロード 国内債券<ラップ専用>	13,398,457,633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]	36,574,008,371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]	26,779,316,551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]	170,877,688円
	期末元本合計	404,007,998,697円

■損益の状況

当期 自2024年2月15日 至2025年2月14日

項 目					当 期
(A) 配 当 等 収 益					3,829,955,017円
受 取 利 息					3,830,021,102
支 払 利 息					△66,085
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益					△20,315,967,914
売 買 益					1,632,107,940
売 買 損					△21,948,075,854
(C) 当 期 損 益 金(A + B)					△16,486,012,897
(D) 前 期 繰 越 損 益 金					101,407,179,097
(E) 解 約 差 損 益 金					△133,012,505,342
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金					125,205,021,538
(G) 合 計(C + D + E + F)					77,113,682,396
次 期 繰 越 損 益 金(G)					77,113,682,396

(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。