

iシェアーズ 国内債券
インデックス・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	無期限です。(設定日:2013年9月12日)				
決算日	8月2日(休業日の場合は翌営業日)				
運用方針	<p>①国内債券インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案して委託会社が決定します。</p> <p>②効率的な運用を目的として、公社債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行う場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。</p> <p>④ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ。(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑤資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>				
主要運用対象	<table border="1"> <tr> <td>子投資信託</td> <td>【iシェアーズ 国内債券インデックス・ファンド】国内債券インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。</td> </tr> <tr> <td>親投資信託</td> <td>【国内債券インデックス・マザーファンド】円建ての債券等を主要投資対象とします。</td> </tr> </table>	子投資信託	【iシェアーズ 国内債券インデックス・ファンド】国内債券インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。	親投資信託	【国内債券インデックス・マザーファンド】円建ての債券等を主要投資対象とします。
子投資信託	【iシェアーズ 国内債券インデックス・ファンド】国内債券インデックス・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。				
親投資信託	【国内債券インデックス・マザーファンド】円建ての債券等を主要投資対象とします。				
組入制限	<p>■株式への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</p>				
分配方針	<p>年1回の毎決算時(原則として8月2日。休業日の場合は翌営業日)に、原則として以下の方針に基づき、分配を行います。</p> <p>■経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買損益(繰越欠損補填後、評価損益を含みます。)等の全額を分配対象額の範囲として分配を行います。</p> <p>■分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。</p> <p>■留保益の運用については特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。</p> <p>※基準価額水準、市況動向等によっては分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。</p>				

第11期 運用報告書(全体版)

(決算日:2024年8月2日)

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、当ファンドは上記の通り決算を行いましたので、期中の運用状況と収益分配金をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますよう

お願い申し上げます。

ブラックロック・ジャパン株式会社

〒100-8217 東京都千代田区丸の内一丁目8番3号

丸の内トラストタワー本館

運用報告書に関するお問い合わせ先

電話番号:03-6703-4300

(受付時間 営業日の9:00~17:00)

ホームページアドレス

www.blackrock.com/jp/

CONTENTS

子投資信託(決算日:2024年8月2日)

「iシェアーズ 国内債券インデックス・ファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ 運用担当者コメント
- ◇ ファンド状況
- ◇ 資産状況

親投資信託(決算日:2024年8月2日)

「国内債券インデックス・マザーファンド」

- ◇ 基準価額の推移
- ◇ ファンド状況
- ◇ 運用内容
- ◇ 資産状況
- ◇ お知らせ

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			(ベンチマーク) NOMURA-BPI総合		公社債組入比率	債券先物組入比率	純資産
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率		期中騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
7期(2020年8月3日)	10,789	0	△2.0	387.39	△1.6	99.9	-	1,071
8期(2021年8月2日)	10,785	0	△0.0	388.78	0.4	99.9	-	1,056
9期(2022年8月2日)	10,476	0	△2.9	378.88	△2.5	100.0	-	673
10期(2023年8月2日)	10,190	0	△2.7	369.32	△2.5	99.9	-	706
11期(2024年8月2日)	9,894	0	△2.9	359.90	△2.6	99.9	-	484

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 債券先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) NOMURA-BPI総合は、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が公表している指数で、その知的財産権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、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注6) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI総合		公社債組入比率	債券先物組入比率
		騰落率		騰落率		
(期首) 2023年8月2日	円	%		%	%	%
	10,190	-	369.32	-	99.9	-
8月末	10,143	△0.5	367.76	△0.4	99.7	-
9月末	10,067	△1.2	365.13	△1.1	100.2	-
10月末	9,903	△2.8	359.31	△2.7	99.9	-
11月末	10,110	△0.8	366.88	△0.7	100.1	-
12月末	10,148	△0.4	368.38	△0.3	100.4	-
2024年1月末	10,072	△1.2	365.75	△1.0	100.3	-
2月末	10,102	△0.9	366.90	△0.7	100.3	-
3月末	10,088	△1.0	366.50	△0.8	102.8	-
4月末	9,970	△2.2	362.35	△1.9	99.8	-
5月末	9,807	△3.8	356.53	△3.5	100.3	-
6月末	9,831	△3.5	357.51	△3.2	101.0	-
7月末	9,818	△3.7	357.15	△3.3	99.9	-
(期末) 2024年8月2日	9,894	△2.9	359.90	△2.6	99.9	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

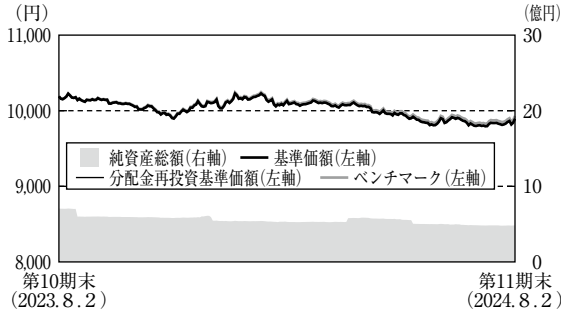
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 債券先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「公社債組入比率」、「債券先物組入比率」は実質組入比率を記載しています。

(注5) NOMURA-BPI総合は、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が公表している指数で、その知的財産権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、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■当期中の基準価額等の推移について(第11期:2023年8月3日~2024年8月2日)



第11期首：10,190円

第11期末：9,894円(既払分配金0円)

騰落率：-2.9%(分配金再投資ベース)

- *分配金再投資基準価額は、収益分配金(税込み)を分配時に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。
- *分配金を再投資するかどうかについてはお客様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、各個人のお客様の損益の状況を示すものではありません。
- *ベンチマークは、NOMURA-BPI総合です。
- *分配金再投資基準価額およびベンチマークは、前期末の基準価額に合わせて指数化しています。

◇運用担当者コメント

投資環境について

当期(2023年8月3日から2024年8月2日)の日本債券市場は、日銀の金融政策の影響や海外からの外部要因などを受けて変動しましたが、期間を通してみると日本国債の金利(10年物)は上昇しました。

期初から2023年10月頃にかけて、日銀による利上げの観測が高まったことなどを背景に、日本国債の長期金利は上昇しました。しかし、2023年11月から年末にかけては、米国債市場が大幅な金利低下基調となった影響などをうけ、日本債券市場も利回り低下圧力を受けました。

2024年1月から7月にかけて、日銀による金融政策の変更などを背景に、日本国債の金利は上昇基調となり、10年金利は一時2011年以来の水準となる

1.1%に達しました。その後、期末にかけては金利が小幅低下し、期末時点の10年金利は0.95%となりました。

期中の日銀の政策変更に関しては、2024年3月の会合にて、マイナス金利解除やイールドカーブ・コントロール(YCC)撤廃などを決定しました。また、7月の会合では、政策金利の上限を0.25%に引き上げることなどを決定しました。

ポートフォリオについて

<当ファンド>

国内債券インデックス・マザーファンド受益証券を高位に組み入れた運用を行いました。

<国内債券インデックス・マザーファンド>

円建ての債券等(国債、社債等)を主要投資対象として、円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指し運用を行いました。組入比率については概ね100%程度を維持しました。

基準価額の主な変動要因

当期、当ファンドの基準価額は2.9%下落しました。当期、利回り上昇に伴う「国内債券インデックス・マザーファンド」の下落に加え、信託報酬等コスト負担発生によりファンドの基準価額は下落しました。

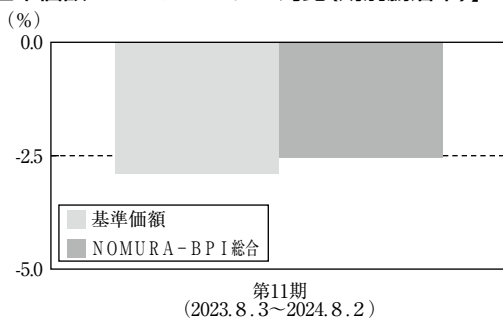
■組入ファンドの当期間中の騰落率

組入ファンド	騰落率
国内債券インデックス・マザーファンド	△2.6%

ベンチマークとの差異について

当期、当ファンドの基準価額は2.9%下落しました。また、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合は2.6%下落しました。ベンチマークとの差異については、当ファンドにおいて信託報酬等コスト負担が発生することなどが主なマイナス要因となりました。

【基準価額とベンチマークの対比(期別騰落率)】



分配金について

収益分配は基準価額水準、市場動向等を勘案して、見送りとさせていただきます。留保益の運用につきましては、運用の基本方針に基づき運用を行います。

■分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期 2023年8月3日 ~2024年8月2日
当期分配金(税込み)	-円
対基準価額比率	-%
当期の収益	-円
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	781

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。

また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切り捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)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。

今後の運用方針について

<当ファンド>

当ファンドの運用方針に従い、国内債券インデックス・マザーファンド受益証券への投資を通じて、円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

<国内債券インデックス・マザーファンド>

円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。

◇ファンド状況

■ 1万口当りの費用明細

項目	第11期		項目の概要
	(2023. 8. 3～2024. 8. 2)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	円 30	% 0.297	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10,023円です。
(投信会社)	(14)	(0.137)	投信会社分は、委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(14)	(0.137)	販売会社分は、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託銀行)	(2)	(0.022)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 売買委託手数料	－	－	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(c) 有価証券取引税	－	－	有価証券取引税＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(d) その他費用	6	0.058	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)	(6)	(0.057)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合計	36	0.355	

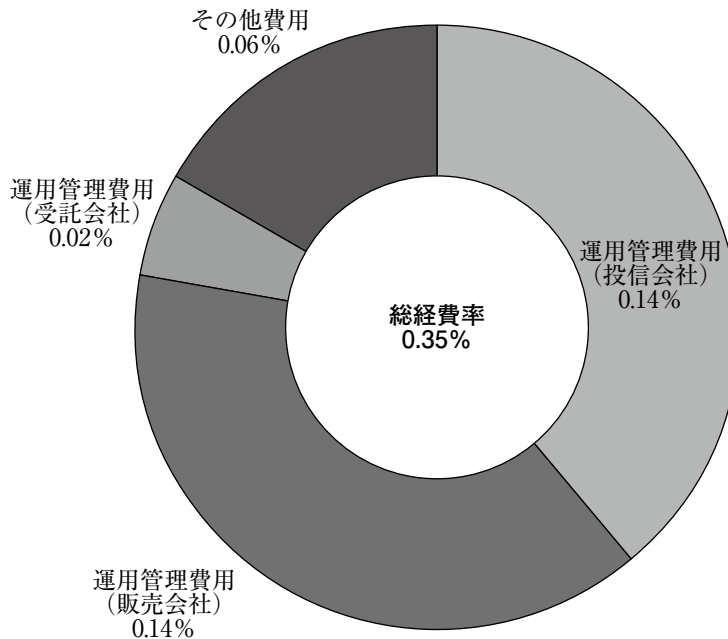
(注1) 期中の費用(消費税のかかるものは消費税を含む)は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各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0.35%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、売買委託手数料及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。

■親投資信託受益証券の設定、解約状況(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内債券インデックス・マザーファンド	千口 143,043	千円 150,182	千口 340,235	千円 357,162

(注) 単位未満は切捨て。

■親投資信託の株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合(2023年8月3日から2024年8月2日まで)
当期における株式の売買はありません。

■利害関係人との取引状況(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

上記期間における利害関係人との取引はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細

親投資信託残高

銘	柄	期 首(前期末)	当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額
国内債券インデックス・マザーファンド		千口 666,370	千口 469,178	千円 485,318

(注1) 単位未満は切捨て。

(注2) 親投資信託の受益権総口数は41,987,918千口です。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券インデックス・マザーファンド	千円 485,318	% 100.0
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	96	0.0
投 資 信 託 財 産 総 額	485,415	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	485,415,272円
国内債券インデックス・マザーファンド(評価額)	485,318,359
未 収 入 金	96,913
(B) 負 債	1,026,963
未 払 解 約 金	96,913
未 払 信 託 報 酬	774,950
そ の 他 未 払 費 用	155,100
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	484,388,309
元 本	489,561,713
次 期 繰 越 損 益 金	△ 5,173,404
(D) 受 益 権 総 口 数	489,561,713口
1万口当り基準価額(C/D)	9,894円

<注記事項>

期首元本額	692,908,285円
期中追加設定元本額	149,286,702円
期中一部解約元本額	352,633,274円

■当期の分配金

当期の分配金は見送らせていただきました。

(注) 第11期計算期末における、費用控除後の配当等収益(2,452,378円)、費用控除及び繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益(0円)、収益調整金(有価証券売買等損益相当額)(0円)、収益調整金(その他収益調整金)(33,286,170円)、分配準備積立金(2,516,567円)により、分配対象収益は38,255,115円となりましたが、委託会社が基準価額水準・市況動向等を勘案し、当期は分配を見合わせました。なお留保金につきましては、引き続き元本部分と同一の運用をしていきます。

■損益の状況

自2023年8月3日 至2024年8月2日

項 目	当 期
(A) 有 価 証 券 売 買 損 益	△10,939,522円
売 買 益	3,219,154
売 買 損	△14,158,676
(B) 信 託 報 酬 等	△ 1,962,860
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△12,902,382
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	△11,963,147
(E) 追 加 信 託 差 損 益 金	19,692,125
(配 当 等 相 当 額)	(33,173,729)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,481,604)
(F) 合 計(C+D+E)	△ 5,173,404
次 期 繰 越 損 益 金(F)	△ 5,173,404
追 加 信 託 差 損 益 金	19,692,125
(配 当 等 相 当 額)	(33,286,170)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△13,594,045)
分 配 準 備 積 立 金	4,968,945
繰 越 損 益 金	△29,834,474

(注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中の信託報酬等には、信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

(注3) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。

運用報告書

－第11期－ 決算日 2024年8月2日
計算期間(2023年8月3日～2024年8月2日)

国内債券インデックス・マザーファンド

当ファンドの仕組みは次の通りです。

決 算 日	8月2日(原則)
運 用 方 針	<p>①円建ての債券市場を代表する指数に連動する運用成果を目指します。指数の選定および変更にあたっては、当ファンドの商品性および運用上の効率性等を勘案して委託会社が決定します。</p> <p>②効率的な運用を目的として、公社債を主要投資対象とする上場投資信託証券(ETF)への投資を行う場合があります。</p> <p>③対象指数との連動を維持するため、先物取引等を利用することがあります。その際、債券の実質投資比率(組入現物債券の時価総額に債券先物取引等の買建額を加算し、または債券先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)が100%を超える場合があります。</p> <p>④ブラックロック・インスティテューショナル・トラスト・カンパニー、エヌ・エイ、(BlackRock Institutional Trust Company, N.A.)に有価証券の貸付の指図に関する権限の全部または一部を委託します。</p> <p>⑤資金動向、市況動向、残存信託期間等によっては、上記のような運用ができない場合もあります。</p>
主要運用対象	円建ての債券等を主要投資対象とします。
組 入 制 限	<p>■株式への投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の30%以下とします。</p> <p>■外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の50%以下とします。</p>

◇基準価額の推移

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI総合		公社債 組入比率	債券先物 組入比率	純資産
	期中 騰落率	騰落率	期中 騰落率	騰落率			
7期(2020年8月3日)	円 11,127	% △1.6	387.39	% △1.6	% 99.7	% -	百万円 30,718
8期(2021年8月2日)	11,160	0.3	388.78	0.4	99.7	-	41,493
9期(2022年8月2日)	10,876	△2.5	378.88	△2.5	99.7	-	41,178
10期(2023年8月2日)	10,615	△2.4	369.32	△2.5	99.7	-	45,702
11期(2024年8月2日)	10,344	△2.6	359.90	△2.6	99.7	-	43,430

(注1) 基準価額は1万口当り。

(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) NOMURA-BPI総合は、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が公表している指数で、その知的財産権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、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

(注5) 純資産総額の単位未満は切捨て。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		(ベンチマーク) NOMURA-BPI総合		公社債 組入比率	債券先物 組入比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首) 2023年8月2日	円 10,615	% -	369.32	% -	% 99.7	% -
8月末	10,569	△0.4	367.76	△0.4	99.7	-
9月末	10,493	△1.1	365.13	△1.1	100.1	-
10月末	10,326	△2.7	359.31	△2.7	99.8	-
11月末	10,544	△0.7	366.88	△0.7	100.0	-
12月末	10,587	△0.3	368.38	△0.3	100.2	-
2024年1月末	10,511	△1.0	365.75	△1.0	100.1	-
2月末	10,545	△0.7	366.90	△0.7	100.3	-
3月末	10,533	△0.8	366.50	△0.8	102.8	-
4月末	10,414	△1.9	362.35	△1.9	99.8	-
5月末	10,247	△3.5	356.53	△3.5	100.2	-
6月末	10,274	△3.2	357.51	△3.2	100.8	-
7月末	10,264	△3.3	357.15	△3.3	99.7	-
(期末) 2024年8月2日	10,344	△2.6	359.90	△2.6	99.7	-

(注1) 基準価額は1万口当り。騰落率は期首比。

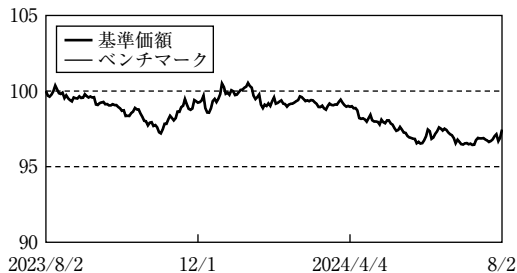
(注2) 公社債組入比率には新株予約権付社債は含まれていません。

(注3) 先物組入比率=買建比率-売建比率。

(注4) NOMURA-BPI総合は、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が公表している指数で、その知的財産権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、NOMURA-BPI総合の正確性、完全性、信頼性、有用性を保証するものではなく、NOMURA-BPI総合を用いて行われるブラックロック・ジャパン株式会社の事業活動・サービスに関し一切責任を負いません。

■基準価額の推移

(2023年8月2日～2024年8月2日)



(注1) 前期末を100とした指数値を使用しています。

(注2) ベンチマークはNOMURA-BPI総合です。

◇ファンド状況

■1万口当りの費用明細

項目	当期
	円
(a) 売買委託手数料	-
(b) 有価証券取引税	-
(c) その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

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

(a) 売買委託手数料=期中の売買委託手数料/期中の平均受益権口数

(b) 有価証券取引税=期中の有価証券取引税/期中の平均受益権口数

(c) その他費用=期中のその他費用/期中の平均受益権口数

(注2) 各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

◇運用内容

■売買及び取引の状況(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	30,794,120	31,488,067
	地方債証券	495,161	506,838 (390,000)
	特殊債券(除く金融債券)	307,381	613,253 (331,211)
	金融債券	100,042	- (100,000)
	社債券	1,000,000	499,879

(注1) 金額は受渡し代金(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。

(注4) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄(2023年8月3日から2024年8月2日まで)

公社債

買		付		売		付	
銘柄	金額	金額	銘柄	金額	銘柄	金額	金額
		千円				千円	
371 10年国債	724,169		451 2年国債	709,013			
451 2年国債	709,187		452 2年国債	698,732			
452 2年国債	698,970		370 10年国債	541,215			
372 10年国債	632,959		148 5年国債	519,576			
148 5年国債	597,990		355 10年国債	514,985			
158 5年国債	595,221		158 5年国債	508,836			
367 10年国債	576,793		340 10年国債	502,949			
368 10年国債	574,767		339 10年国債	502,887			
374 10年国債	501,361		362 10年国債	490,530			
366 10年国債	499,336		371 10年国債	458,239			

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産の明細

公社債

(A) 種別別開示

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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	38,202,000	37,304,839	85.9	-	58.0	19.1	8.8
地方債証券	1,800,800 (1,800,800)	1,798,577 (1,798,577)	4.1 (4.1)	- (-)	1.5 (1.5)	1.7 (1.7)	0.9 (0.9)
特殊債証券 (除く金融債券)	1,460,008 (1,460,008)	1,426,776 (1,426,776)	3.3 (3.3)	- (-)	1.3 (1.3)	0.8 (0.8)	1.2 (1.2)
金融債券	100,000 (100,000)	98,967 (98,967)	0.2 (0.2)	- (-)	- (-)	0.2 (0.2)	- (-)
普通社債券	2,710,000 (2,710,000)	2,680,828 (2,680,828)	6.2 (6.2)	- (-)	1.6 (1.6)	3.9 (3.9)	0.7 (0.7)
合計	44,272,808 (6,070,808)	43,309,990 (6,005,151)	99.7 (13.8)	- (-)	62.4 (4.4)	25.7 (6.6)	11.6 (2.8)

(注1) ()内は非上場債で内書き。

(注2) 組入比率は、純資産総額(ただし追加型公社債投信については資産総額)に対する評価額の割合。

(注3) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(B) 詳細開示(個別銘柄別)

国内(邦貨建)公社債

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
(国債証券)	%		千円	千円
454 2年国債	0.1000	2025/11/01	110,000	109,754
455 2年国債	0.0050	2025/12/01	175,000	174,329
146 5年国債	0.1000	2025/12/20	230,000	229,369
341 10年国債	0.3000	2025/12/20	340,000	340,000
456 2年国債	0.1000	2026/01/01	285,000	284,159
457 2年国債	0.1000	2026/02/01	370,000	368,760
458 2年国債	0.2000	2026/03/01	220,000	219,518
147 5年国債	0.0050	2026/03/20	220,000	218,809
342 10年国債	0.1000	2026/03/20	385,000	383,506
459 2年国債	0.2000	2026/04/01	290,000	289,260
460 2年国債	0.3000	2026/05/01	460,000	459,443
461 2年国債	0.4000	2026/06/01	120,000	120,043
148 5年国債	0.0050	2026/06/20	380,000	377,275
343 10年国債	0.1000	2026/06/20	200,000	198,920
88 20年国債	2.3000	2026/06/20	4,000	4,142
462 2年国債	0.4000	2026/07/01	50,000	50,004
149 5年国債	0.0050	2026/09/20	420,000	416,501
344 10年国債	0.1000	2026/09/20	220,000	218,607
91 20年国債	2.3000	2026/09/20	15,000	15,602
150 5年国債	0.0050	2026/12/20	310,000	307,045
345 10年国債	0.1000	2026/12/20	165,000	163,795
92 20年国債	2.1000	2026/12/20	100,000	104,000
151 5年国債	0.0050	2027/03/20	300,000	296,769
152 5年国債	0.1000	2027/03/20	300,000	297,510
346 10年国債	0.1000	2027/03/20	178,000	176,522
153 5年国債	0.0050	2027/06/20	330,000	325,970
347 10年国債	0.1000	2027/06/20	235,000	232,765
95 20年国債	2.3000	2027/06/20	100,000	105,323
154 5年国債	0.1000	2027/09/20	260,000	257,194
348 10年国債	0.1000	2027/09/20	180,000	178,057
97 20年国債	2.2000	2027/09/20	10,000	10,542
98 20年国債	2.1000	2027/09/20	100,000	105,118
155 5年国債	0.3000	2027/12/20	160,000	159,121
156 5年国債	0.2000	2027/12/20	70,000	69,383
349 10年国債	0.1000	2027/12/20	198,000	195,598
99 20年国債	2.1000	2027/12/20	50,000	52,734
157 5年国債	0.2000	2028/03/20	400,000	395,940
158 5年国債	0.1000	2028/03/20	300,000	295,887
350 10年国債	0.1000	2028/03/20	245,000	241,641
159 5年国債	0.1000	2028/06/20	140,000	137,845
160 5年国債	0.2000	2028/06/20	170,000	168,029
161 5年国債	0.3000	2028/06/20	300,000	297,663
351 10年国債	0.1000	2028/06/20	153,000	150,645
162 5年国債	0.3000	2028/09/20	80,000	79,288
163 5年国債	0.4000	2028/09/20	230,000	228,884
352 10年国債	0.1000	2028/09/20	230,000	226,142
106 20年国債	2.2000	2028/09/20	45,000	48,082
164 5年国債	0.2000	2028/12/20	235,000	231,583
165 5年国債	0.3000	2028/12/20	420,000	415,690

国内債券インデックス・マザーファンド

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
353 10年国債	0.1000	2028/12/20	350,000	343,490
167 5年国債	0.4000	2029/03/20	240,000	238,322
168 5年国債	0.6000	2029/03/20	330,000	330,742
354 10年国債	0.1000	2029/03/20	285,000	279,154
109 20年国債	1.9000	2029/03/20	110,000	116,745
355 10年国債	0.1000	2029/06/20	275,000	268,804
111 20年国債	2.2000	2029/06/20	85,000	91,635
356 10年国債	0.1000	2029/09/20	383,000	373,754
113 20年国債	2.1000	2029/09/20	10,000	10,767
357 10年国債	0.1000	2029/12/20	319,000	310,772
114 20年国債	2.1000	2029/12/20	91,000	98,260
115 20年国債	2.2000	2029/12/20	100,000	108,501
358 10年国債	0.1000	2030/03/20	172,000	167,276
116 20年国債	2.2000	2030/03/20	3,000	3,265
117 20年国債	2.1000	2030/03/20	100,000	108,304
359 10年国債	0.1000	2030/06/20	252,000	244,641
118 20年国債	2.0000	2030/06/20	103,000	111,276
119 20年国債	1.8000	2030/06/20	180,000	192,364
360 10年国債	0.1000	2030/09/20	306,000	296,431
121 20年国債	1.9000	2030/09/20	100,000	107,681
122 20年国債	1.8000	2030/09/20	130,000	139,217
361 10年国債	0.1000	2030/12/20	355,000	343,150
123 20年国債	2.1000	2030/12/20	133,000	145,160
124 20年国債	2.0000	2030/12/20	150,000	162,793
362 10年国債	0.1000	2031/03/20	400,000	385,664
125 20年国債	2.2000	2031/03/20	80,000	88,012
126 20年国債	2.0000	2031/03/20	90,000	97,837
127 20年国債	1.9000	2031/03/20	120,000	129,687
363 10年国債	0.1000	2031/06/20	310,000	298,092
128 20年国債	1.9000	2031/06/20	100,000	108,224
129 20年国債	1.8000	2031/06/20	130,000	139,835
364 10年国債	0.1000	2031/09/20	264,000	253,160
130 20年国債	1.8000	2031/09/20	84,000	90,455
131 20年国債	1.7000	2031/09/20	155,000	165,857
6 30年国債	2.4000	2031/11/20	80,000	89,623
365 10年国債	0.1000	2031/12/20	383,000	366,109
132 20年国債	1.7000	2031/12/20	40,000	42,835
133 20年国債	1.8000	2031/12/20	160,000	172,464
366 10年国債	0.2000	2032/03/20	345,000	331,200
134 20年国債	1.8000	2032/03/20	126,000	135,880
135 20年国債	1.7000	2032/03/20	150,000	160,678
367 10年国債	0.2000	2032/06/20	300,000	287,091
137 20年国債	1.7000	2032/06/20	130,000	139,284
138 20年国債	1.5000	2032/06/20	135,000	142,580
139 20年国債	1.6000	2032/06/20	100,000	106,398
368 10年国債	0.2000	2032/09/20	350,000	333,847
140 20年国債	1.7000	2032/09/20	175,000	187,589
141 20年国債	1.7000	2032/12/20	287,000	307,635
142 20年国債	1.8000	2032/12/20	104,000	112,295
370 10年国債	0.5000	2033/03/20	368,000	357,795
143 20年国債	1.6000	2033/03/20	160,000	170,185
144 20年国債	1.5000	2033/03/20	100,000	105,560

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
371 10年国債	0.4000	2033/06/20	430,000	413,178
145 20年国債	1.7000	2033/06/20	230,000	246,537
372 10年国債	0.8000	2033/09/20	185,000	183,671
12 30年国債	2.1000	2033/09/20	100,000	110,633
146 20年国債	1.7000	2033/09/20	130,000	139,298
373 10年国債	0.6000	2033/12/20	305,000	296,575
147 20年国債	1.6000	2033/12/20	200,000	212,470
374 10年国債	0.8000	2034/03/20	510,000	503,696
14 30年国債	2.4000	2034/03/20	100,000	113,483
148 20年国債	1.5000	2034/03/20	150,000	157,828
375 10年国債	1.1000	2034/06/20	40,000	40,523
15 30年国債	2.5000	2034/06/20	80,000	91,565
149 20年国債	1.5000	2034/06/20	65,000	68,288
16 30年国債	2.5000	2034/09/20	100,000	114,529
150 20年国債	1.4000	2034/09/20	111,000	115,400
17 30年国債	2.4000	2034/12/20	100,000	113,640
151 20年国債	1.2000	2034/12/20	95,000	96,740
18 30年国債	2.3000	2035/03/20	150,000	169,048
152 20年国債	1.2000	2035/03/20	72,000	73,171
19 30年国債	2.3000	2035/06/20	150,000	169,041
153 20年国債	1.3000	2035/06/20	140,000	143,414
20 30年国債	2.5000	2035/09/20	110,000	126,266
154 20年国債	1.2000	2035/09/20	110,000	111,310
21 30年国債	2.3000	2035/12/20	111,000	125,099
155 20年国債	1.0000	2035/12/20	160,000	158,142
22 30年国債	2.5000	2036/03/20	200,000	229,680
156 20年国債	0.4000	2036/03/20	76,000	69,941
23 30年国債	2.5000	2036/06/20	50,000	57,442
157 20年国債	0.2000	2036/06/20	135,000	120,718
24 30年国債	2.5000	2036/09/20	97,000	111,469
158 20年国債	0.5000	2036/09/20	105,000	96,962
25 30年国債	2.3000	2036/12/20	190,000	213,902
159 20年国債	0.6000	2036/12/20	62,000	57,711
26 30年国債	2.4000	2037/03/20	165,000	187,732
160 20年国債	0.7000	2037/03/20	170,000	159,631
161 20年国債	0.6000	2037/06/20	100,000	92,331
27 30年国債	2.5000	2037/09/20	260,000	298,667
162 20年国債	0.6000	2037/09/20	80,000	73,555
163 20年国債	0.6000	2037/12/20	50,000	45,777
28 30年国債	2.5000	2038/03/20	190,000	218,152
164 20年国債	0.5000	2038/03/20	115,000	103,395
165 20年国債	0.5000	2038/06/20	190,000	170,034
29 30年国債	2.4000	2038/09/20	264,000	299,550
166 20年国債	0.7000	2038/09/20	172,000	157,613
167 20年国債	0.5000	2038/12/20	85,000	75,304
30 30年国債	2.3000	2039/03/20	240,000	268,497
168 20年国債	0.4000	2039/03/20	60,000	52,085
169 20年国債	0.3000	2039/06/20	68,000	57,795
31 30年国債	2.2000	2039/09/20	187,000	206,188
170 20年国債	0.3000	2039/09/20	20,000	16,905
171 20年国債	0.3000	2039/12/20	70,000	58,843
32 30年国債	2.3000	2040/03/20	283,000	315,445

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
172 20年国債	0.4000	2040/03/20	20,000	17,000
173 20年国債	0.4000	2040/06/20	223,000	188,526
33 30年国債	2.0000	2040/09/20	252,000	269,408
174 20年国債	0.4000	2040/09/20	179,000	150,499
175 20年国債	0.5000	2040/12/20	38,000	32,324
34 30年国債	2.2000	2041/03/20	300,000	328,374
176 20年国債	0.5000	2041/03/20	140,000	118,456
177 20年国債	0.4000	2041/06/20	30,000	24,804
35 30年国債	2.0000	2041/09/20	210,000	222,938
178 20年国債	0.5000	2041/09/20	90,000	75,374
179 20年国債	0.5000	2041/12/20	109,000	90,785
36 30年国債	2.0000	2042/03/20	295,000	312,292
180 20年国債	0.8000	2042/03/20	90,000	78,749
181 20年国債	0.9000	2042/06/20	165,000	146,302
37 30年国債	1.9000	2042/09/20	300,000	311,769
182 20年国債	1.1000	2042/09/20	54,000	49,373
183 20年国債	1.4000	2042/12/20	172,000	164,889
38 30年国債	1.8000	2043/03/20	175,000	178,484
184 20年国債	1.1000	2043/03/20	30,000	27,242
39 30年国債	1.9000	2043/06/20	171,000	176,769
185 20年国債	1.1000	2043/06/20	120,000	108,548
40 30年国債	1.8000	2043/09/20	138,000	140,092
186 20年国債	1.5000	2043/09/20	30,000	28,987
41 30年国債	1.7000	2043/12/20	129,000	128,530
187 20年国債	1.3000	2043/12/20	160,000	148,934
42 30年国債	1.7000	2044/03/20	101,000	100,481
188 20年国債	1.6000	2044/03/20	120,000	117,370
43 30年国債	1.7000	2044/06/20	105,000	104,301
189 20年国債	1.9000	2044/06/20	45,000	46,199
44 30年国債	1.7000	2044/09/20	125,000	123,885
45 30年国債	1.5000	2044/12/20	154,000	147,002
46 30年国債	1.5000	2045/03/20	90,000	85,680
47 30年国債	1.6000	2045/06/20	107,000	103,439
48 30年国債	1.4000	2045/09/20	195,000	181,119
49 30年国債	1.4000	2045/12/20	104,000	96,314
50 30年国債	0.8000	2046/03/20	149,000	121,734
51 30年国債	0.3000	2046/06/20	84,000	60,789
52 30年国債	0.5000	2046/09/20	41,000	30,972
53 30年国債	0.6000	2046/12/20	161,000	123,953
54 30年国債	0.8000	2047/03/20	149,000	119,660
55 30年国債	0.8000	2047/06/20	22,000	17,594
56 30年国債	0.8000	2047/09/20	53,000	42,208
57 30年国債	0.8000	2047/12/20	45,000	35,687
1 40年国債	2.4000	2048/03/20	17,000	18,582
58 30年国債	0.8000	2048/03/20	230,000	181,640
59 30年国債	0.7000	2048/06/20	95,000	72,865
60 30年国債	0.9000	2048/09/20	221,000	177,255
61 30年国債	0.7000	2048/12/20	130,000	98,745
2 40年国債	2.2000	2049/03/20	100,000	104,856
62 30年国債	0.5000	2049/03/20	62,000	44,456
63 30年国債	0.4000	2049/06/20	39,000	27,040
64 30年国債	0.4000	2049/09/20	73,000	50,312

銘	柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
		%		千円	千円
65 30年国債		0.4000	2049/12/20	77,000	52,795
3 40年国債		2.2000	2050/03/20	50,000	52,091
66 30年国債		0.4000	2050/03/20	67,000	45,667
67 30年国債		0.6000	2050/06/20	100,000	71,841
68 30年国債		0.6000	2050/09/20	73,000	52,151
69 30年国債		0.7000	2050/12/20	55,000	40,223
4 40年国債		2.2000	2051/03/20	61,000	63,174
70 30年国債		0.7000	2051/03/20	22,000	16,015
71 30年国債		0.7000	2051/06/20	76,000	55,071
72 30年国債		0.7000	2051/09/20	103,000	74,291
73 30年国債		0.7000	2051/12/20	88,000	63,179
5 40年国債		2.0000	2052/03/20	148,000	146,178
74 30年国債		1.0000	2052/03/20	55,000	42,777
75 30年国債		1.3000	2052/06/20	115,000	96,449
76 30年国債		1.4000	2052/09/20	39,000	33,462
77 30年国債		1.6000	2052/12/20	110,000	98,901
6 40年国債		1.9000	2053/03/20	75,000	72,124
78 30年国債		1.4000	2053/03/20	96,000	82,007
79 30年国債		1.2000	2053/06/20	115,000	93,049
80 30年国債		1.8000	2053/09/20	295,000	276,754
81 30年国債		1.6000	2053/12/20	345,000	307,788
7 40年国債		1.7000	2054/03/20	60,000	54,766
82 30年国債		1.8000	2054/03/20	241,000	225,325
8 40年国債		1.4000	2055/03/20	101,000	84,972
9 40年国債		0.4000	2056/03/20	152,000	92,051
10 40年国債		0.9000	2057/03/20	58,000	41,325
11 40年国債		0.8000	2058/03/20	112,000	76,106
12 40年国債		0.5000	2059/03/20	62,000	36,963
13 40年国債		0.5000	2060/03/20	118,000	68,982
14 40年国債		0.7000	2061/03/20	155,000	96,582
15 40年国債		1.0000	2062/03/20	210,000	144,448
16 40年国債		1.3000	2063/03/20	327,000	246,263
17 40年国債		2.2000	2064/03/20	110,000	107,385
小	計	-	-	38,202,000	37,304,839
(地方債証券)					
26-8 埼玉県公債		0.3350	2025/01/28	100,000	100,025
149 共同発行地方		0.5000	2025/08/25	100,000	100,185
2-1 北九州市5年		0.0200	2025/09/30	30,000	29,894
27-5 福岡市公債		0.4760	2025/10/28	100,000	100,179
2-13 京都府5年		0.0100	2026/03/12	30,000	29,817
3-1 京都市5年		0.0050	2026/07/27	36,800	36,472
28-7 京都府公債		0.0850	2026/09/16	100,000	99,207
28-1 熊本市公債		0.0800	2026/11/30	100,000	99,112
225 神奈川県公債		0.2350	2026/12/18	70,000	69,631
4-1 広島市5年		0.0600	2027/06/25	30,000	29,625
4-3 広島市5年		0.1450	2027/10/25	30,000	29,643
774 東京都公債		0.1850	2027/12/20	10,000	9,886
5-4 静岡県5年		0.2600	2028/03/17	100,000	98,973
181 共同発行地方		0.1800	2028/04/25	100,000	98,619
30-5 横浜市公債		0.2690	2028/11/15	100,000	98,669
16 東京都20年		2.0100	2028/12/20	100,000	106,167
30-1 三重県公債		0.1950	2028/12/25	10,000	9,827

銘柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
	%		千円	千円
26-11 愛知県15年	0.9610	2029/10/16	100,000	101,621
9 兵庫県公債20年	2.2500	2029/11/19	100,000	108,342
26-1 福岡県15年	0.9200	2029/11/26	100,000	101,451
2-3 北海道公債	0.1250	2030/05/29	44,000	42,652
463 大阪府公債	0.0830	2030/12/25	30,000	28,840
817 東京都公債	0.0600	2031/06/20	50,000	47,682
473 大阪府公債	0.1150	2031/10/28	30,000	28,635
4-4 長野県公債	0.4390	2032/10/25	100,000	96,682
235 共同発行地方	0.4440	2032/10/25	100,000	96,728
小 計	-	-	1,800,800	1,798,577
(特殊債券(除く金融債券))				
225 政保道路機構	0.5560	2024/08/30	100,000	100,019
229 政保道路機構	0.5390	2024/10/31	20,000	20,015
42 道路債券	2.2200	2025/03/21	50,000	50,576
13 公営企業20年	2.1600	2025/06/20	150,000	152,288
28 地方公共団5年	0.0200	2025/11/28	100,000	99,470
276 政保道路機構	0.0200	2026/05/29	100,000	99,262
96 地方公共団体	0.2050	2027/05/28	30,000	29,683
F143地方公共団体	1.3510	2027/08/25	100,000	102,292
105政保地方公共	0.1950	2028/02/15	100,000	98,829
112 鉄道建設・運	0.2600	2028/02/25	100,000	98,688
76 政保政策投資C	0.3050	2030/06/14	100,000	98,035
135 住宅機構 R M B S	0.3900	2053/08/10	71,280	66,411
163 住宅機構 R M B S	0.3500	2055/12/10	84,162	77,370
168 住宅機構 R M B S	0.4000	2056/05/10	84,587	77,989
170 住宅機構 R M B S	0.3600	2056/07/10	86,090	79,159
182 住宅機構 R M B S	0.5000	2057/07/10	90,828	84,860
190 住宅機構 R M B S	1.0900	2058/03/10	93,061	91,823
小 計	-	-	1,460,008	1,426,776
(金融債券)				
401 信金中金	0.3600	2028/04/27	100,000	98,967
小 計	-	-	100,000	98,967
(普通社債券)				
29 西日本高速道	0.3100	2026/02/12	100,000	99,747
19 三井住友TB	0.1400	2026/04/28	100,000	99,197
21 積水ハウス	0.2000	2026/07/17	100,000	99,257
1 日本酸素HD	0.1100	2026/10/14	100,000	98,719
25 B P C E S . A .	0.3020	2026/12/16	100,000	98,359
13 西日本旅客鉄	2.3400	2027/02/19	100,000	104,272
14 クボタ	0.3000	2027/06/02	100,000	98,897
75 ホンダファイナンス	0.3000	2027/06/18	100,000	98,938
32 K D D I	0.6480	2027/07/09	100,000	99,804
17 小松製作所	0.6080	2027/07/16	100,000	99,713
6 T D K	0.3100	2027/07/28	100,000	98,553
25 ニチレイ	0.2400	2027/08/31	100,000	98,429
17 オリエンタルランド	0.2000	2027/09/17	100,000	98,452
400 中国電力	0.3400	2027/09/24	10,000	9,881
15 セブアンドアイ	0.2800	2027/12/20	100,000	98,426
34 東京センチュリー	0.2200	2028/07/21	100,000	97,400
101 中日本高速道	0.4390	2028/08/17	100,000	99,041
43 東洋紡	0.2500	2028/12/07	100,000	97,105
18 野村不動産HD	0.9130	2029/07/10	100,000	99,459

国内債券インデックス・マザーファンド

銘	柄	年 利 率	償 還 年 月 日	額 面 金 額	評 価 額
		%		千円	千円
73	三井物産	0.2900	2029/07/11	100,000	97,216
114	東日本高速道	0.7580	2029/07/25	100,000	100,009
41	京王電鉄	0.3700	2030/05/24	100,000	97,058
65	東京瓦斯	0.2250	2030/09/10	100,000	96,042
140	三菱地所	0.6440	2032/07/22	100,000	96,284
30	N T Tファイナンス	1.2130	2033/09/20	100,000	99,143
21	西部ガスHD	1.2150	2033/10/12	100,000	99,359
35	沖縄電力	1.2760	2034/06/23	100,000	100,079
30	三井住友TB	1.4660	2034/07/21	100,000	101,977
	小 計	—	—	2,710,000	2,680,828
	合 計	—	—	44,272,808	43,309,990

(注) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

◇資産状況

■投資信託財産の構成

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公 社 債	千円 43,309,990	% 99.7
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	120,321	0.3
投 資 信 託 財 産 総 額	43,430,311	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年8月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	43,430,311,544円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	17,192,066
公 社 債(評価額)	43,309,990,465
未 収 利 息	92,309,250
前 払 費 用	10,819,763
(B) 負 債	101,299
未 払 解 約 金	101,299
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	43,430,210,245
元 本	41,987,918,233
次 期 繰 越 損 益 金	1,442,292,012
(D) 受 益 権 総 口 数	41,987,918,233口
1万口当り基準価額(C/D)	10,344円

<注記事項>

期首元本額	43,056,027,654円
期中追加設定元本額	25,834,499,701円
期中一部解約元本額	26,902,609,122円

期末における元本の内訳

iシェアーズ 国内債券インデックス・ファンド	469,178,615円
国内債券インデックス・ファンド(適格機関投資家限定)	6,243,063,916円
国内債券インデックス・ファンドV A(適格機関投資家限定)	4,973,639円
ブラックロック 世界分散投資ファンド	141,357,719円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(適格機関投資家限定)	2,684,764,215円
ブラックロックLifePathファンド2055	805,183,702円
ブラックロックLifePathファンド2045	1,768,393,276円
ブラックロックLifePathファンド2035	4,986,723,467円
G T A Aセレクト・ベガ(適格機関投資家限定)	1,422,537,972円
G T A Aセレクト・ベガ 2019-03(適格機関投資家限定)	1,205,368,078円
G T A Aセレクト・ベガ 2020-06(適格機関投資家限定)	1,585,054,347円
ブラックロック・つみたて・グローバルバランスファンド	2,262,856,128円
ブラックロックLifePathファンド2030	5,327,927,791円
ブラックロックLifePathファンド2040	3,040,452,102円
ブラックロックLifePathファンド2050	870,970,604円
マルチ・アセット投資戦略ファンド(年1回決算型/適格機関投資家限定)	5,872,428,611円
ブラックロックLifePathファンド2025	1,889,004,898円
マルチ・アセット投資戦略ファンド3(適格機関投資家限定)	807,661,302円
ブラックロックLifePathファンド2060	234,977,498円
ブラックロックLifePathファンド2065	365,040,353円
合計	41,987,918,233円

■損益の状況

自2023年8月3日 至2024年8月2日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	367,718,906円
受 取 利 息	367,718,906
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,023,139,596
売 買 益	123,581,966
売 買 損	△1,146,721,562
(C) そ の 他 費 用	△ 121,407
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△ 655,542,097
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	2,646,289,577
(F) 解 約 差 損 益 金	△1,686,545,971
(G) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,138,090,503
(H) 合 計(D+E+F+G)	1,442,292,012
次 期 繰 越 損 益 金(H)	1,442,292,012

- (注1) 損益の状況の中で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) 損益の状況の中で追加信託差損益金とは追加信託の際、追加代金と元本の差額をいいます。
- (注3) 損益の状況の中で解約差損益金とは中途解約の際、解約代金と元本の差額をいいます。

◇お知らせ

国内債券インデックス・マザーファンド

以下のとおりの投資信託約款の変更を行いました。

1. 成長投資枠NISAに適合する投資制限で運用していることを明確に記述するため、投資制限の文言を追記しました。

(変更日:2024年5月3日)