

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 自動継続投資専用	
信託期間	無期限（2013年12月20日設定）	
運用方針	国内債券パッシブ型マザーファンドを通じて、円建の公社債に投資し、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。	
主要運用対象	明治安田DC 日本債券 パッシブファンド	円建の公社債を主要投資対象とする「国内債券パッシブ型マザーファンド」（以下「マザーファンド」といいます。）受益証券を主な投資対象とします。なお、当該公社債に直接投資する場合があります。
	国内債券 パッシブ型 マザーファンド	円建の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	明治安田DC 日本債券 パッシブファンド	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5%以下とします。また、外貨建資産への投資は行いません。
	国内債券 パッシブ型 マザーファンド	株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。また、外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	毎年1回（原則10月27日。決算日が休業日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配を行います。 ①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。 ②収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。 ③収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。	

明治安田DC 日本債券パッシブファンド

運用報告書（全体版）

第10期

（決算日 2023年10月27日）

受益者のみなさまへ

平素は「明治安田DC日本債券パッシブファンド」にご投資いただき、厚くお礼申し上げます。

さて、当ファンドは、第10期の決算を行いましたので、期中の運用状況につきまして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。

MYAM 明治安田アセットマネジメント株式会社

東京都千代田区大手町二丁目3番2号
ホームページ <https://www.myam.co.jp/>

〈運用報告書のお問い合わせ先〉
サポートデスク 0120-565787
（受付時間：営業日の午前9時～午後5時）

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI総合		債組比	券入率	純資産額
	(分配落)	税金配分	み騰落率	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	円	%		%	%	百万円	
(第6期) 2019年10月28日	11,056	0	3.0	392.10	3.1	99.6	993	
(第7期) 2020年10月27日	10,895	0	△1.5	386.97	△1.3	99.5	1,140	
(第8期) 2021年10月27日	10,856	0	△0.4	386.26	△0.2	99.5	1,203	
(第9期) 2022年10月27日	10,437	0	△3.9	371.87	△3.7	99.6	1,189	
(第10期) 2023年10月27日	10,123	0	△3.0	361.09	△2.9	99.2	1,211	

(注1)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

(注2)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する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、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の知的財産です。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、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任はありません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

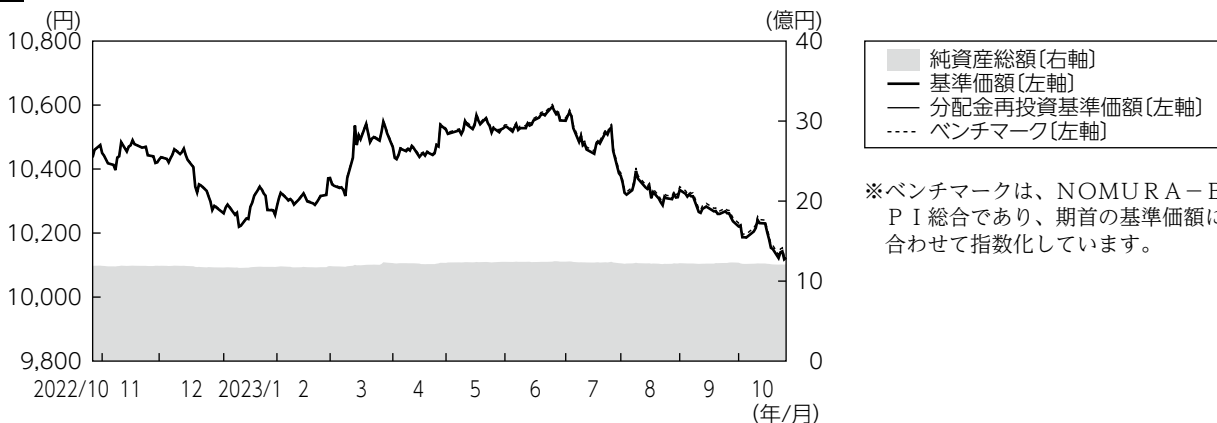
年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入率
	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	比	
(期首)2022年10月27日	円	%		%	%
	10,437	—	371.87	—	99.6
10月末	10,475	0.4	373.25	0.4	99.6
11月末	10,421	△0.2	371.33	△0.1	99.5
12月末	10,285	△1.5	366.60	△1.4	99.4
2023年 1月末	10,257	△1.7	365.59	△1.7	99.4
2月末	10,371	△0.6	369.57	△0.6	99.5
3月末	10,512	0.7	374.74	0.8	99.6
4月末	10,538	1.0	375.61	1.0	99.6
5月末	10,527	0.9	375.27	0.9	99.6
6月末	10,552	1.1	376.29	1.2	99.6
7月末	10,387	△0.5	370.43	△0.4	99.5
8月末	10,312	△1.2	367.76	△1.1	99.4
9月末	10,237	△1.9	365.13	△1.8	99.4
(期末)2023年10月27日	10,123	△3.0	361.09	△2.9	99.2

(注1)騰落率は期首比です。

(注2)当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「債券組入比率」は実質比率を記載しております。

運用経過の説明

■ 基準価額等の推移



第10期首(2022年10月27日)：10,437円

第10期末(2023年10月27日)：10,123円(既払分配金0円)

騰落率：△3.0%(分配金再投資ベース)

※分配金再投資基準価額は分配金実績があった場合、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。

※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。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

■ 基準価額の主な変動要因

ファンドの運用方針に従い、マザーファンドを通じて円建の公社債へ投資を行いました。投資対象資産の価格変動等による基準価額の変動要因は以下の通りとなりました。

(上昇要因)

- ・日銀が金融緩和継続姿勢を打ち出したことや日銀新総裁も同姿勢を継続したことを受けて、2023年1月中旬から6月末にかけて超長期国債(償還期間が10年超の国債)金利が低下(債券価格は上昇)したこと
- ・2023年3月中旬以降、クレジット環境の改善により社債の対国債スプレッド(社債の利回り－国債の利回り)が縮小したこと

(下落要因)

- ・日銀が2022年12月の金融政策決定会合で、長期金利の許容変動幅を±0.25%から±0.50%に拡大したことを受けて、国内金利が上昇(債券価格は下落)したこと
- ・日銀が2023年7月の金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの柔軟化を決定し、長期金利の変動幅の上限を事実上1.0%に変更したことから、超長期ゾーン主導で金利が上昇したこと

■ 投資環境

国内債券市場で長期金利（10年国債利回り）は上昇（債券価格は下落）しました。期首から2022年12月半ばにかけて日銀が許容する金利の上限（+0.25%）近辺で推移しました。日銀が12月の金融政策決定会合で長期金利の許容変動幅を従来の「±0.25%程度」から「±0.50%程度」に拡大すると大きく上昇し、2023年3月に乱高下する場面もありましたが、7月中旬にかけて概ね+0.50%近辺でのみ合いとなりました。7月下旬から期末にかけては米国長期金利の上昇に連動したこと、日銀がイールドカーブ・コントロールの運用柔軟化とともに毎営業日実施する指値オペ（公開市場操作）の上限を1.0%とし、投資家から実質的な金融引き締めと受け止められたことなどから上昇基調となりました。

■ 当該投資信託のポートフォリオ

明治安田DC日本債券パッシブファンド

期首の運用方針に基づき、期を通じて国内債券パッシブ型マザーファンドの投資比率を高位に保ちました。

国内債券パッシブ型マザーファンド

期首の運用方針に基づき、期間構成、種別構成とも、ベンチマークからの乖離を抑制したパッシブ型運用を行いました。また、複利最終利回りについても概ねベンチマーク並みを維持しました。

【ポートフォリオプロフィール】

	期首	期末
デュレーション（年）	9.0	8.9
残存年数（年）	10.1	10.2
複利最終利回り（%）	0.4	0.8
銘柄数	267	278

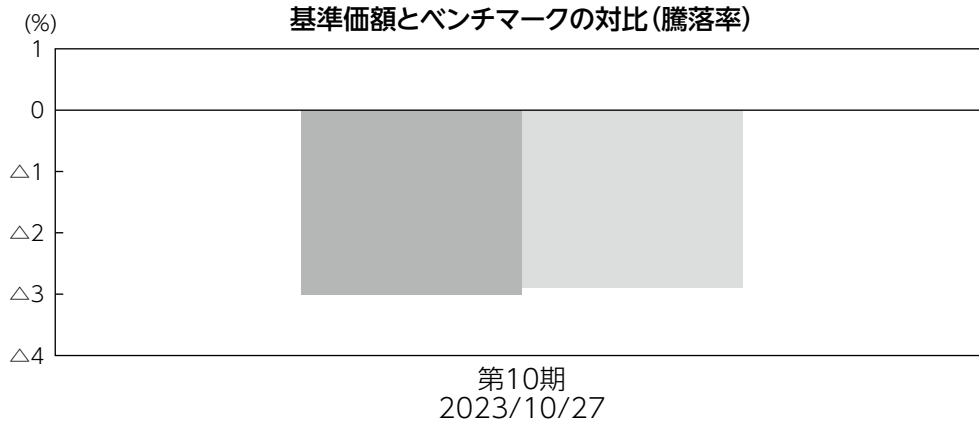
【債券種類】

（単位：%）

	期首	期末
国債	84.0	84.3
政府保証債	1.7	1.5
地方債	6.3	6.0
金融債	0.2	0.2
事業債等	7.5	7.3
合計	99.7	99.3

※純資産総額に対する比率

■ 当該投資信託のベンチマークとの差異



※ファンドの騰落率は分配金込み



当期の基準価額の騰落率(分配金込み)は $\Delta 3.0\%$ になりました。一方、ベンチマークの騰落率は $\Delta 2.9\%$ となり、騰落率の差異は $\Delta 0.1\%$ となりました。この差異は主に信託報酬等のファンド運用上の諸費用によるものです。

■ 分配金

- ・ 当期の収益分配は信託財産の長期的な成長を図るため見送りとさせていただきます。
- ・ 収益分配にあらず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託者の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

分配原資の内訳 (単位: 円・%、1万口当たり、税引前)

項目	第10期 (2022年10月28日~2023年10月27日)
当期分配金	-
(対基準価額比率)	-
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	1,113

(注1)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)に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注2)当期の収益、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合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

明治安田DC日本債券パッシブファンド

引き続き、国内債券パッシブ型マザーファンドの投資比率を高位に保ち、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合に連動する運用成果を目指して運用を行います。

国内債券パッシブ型マザーファンド

引き続き、円建の公社債に投資し、ベンチマークからの乖離を抑制したパッシブ型運用を行います。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2022年10月28日～2023年10月27日		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	14円	0.132%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×期末の信託報酬率 ※期中の平均基準価額は10,406円です。
(投信会社)	(6)	(0.055)	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
(販売会社)	(6)	(0.055)	購入後の情報提供、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)	(2)	(0.022)	ファンド財産の管理、投信会社からの指図の実行等の対価
(b) その他費用	1	0.006	(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)	(1)	(0.005)	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諸費用、信託財産に関する租税等
合計	15	0.138	

(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・解約により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、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

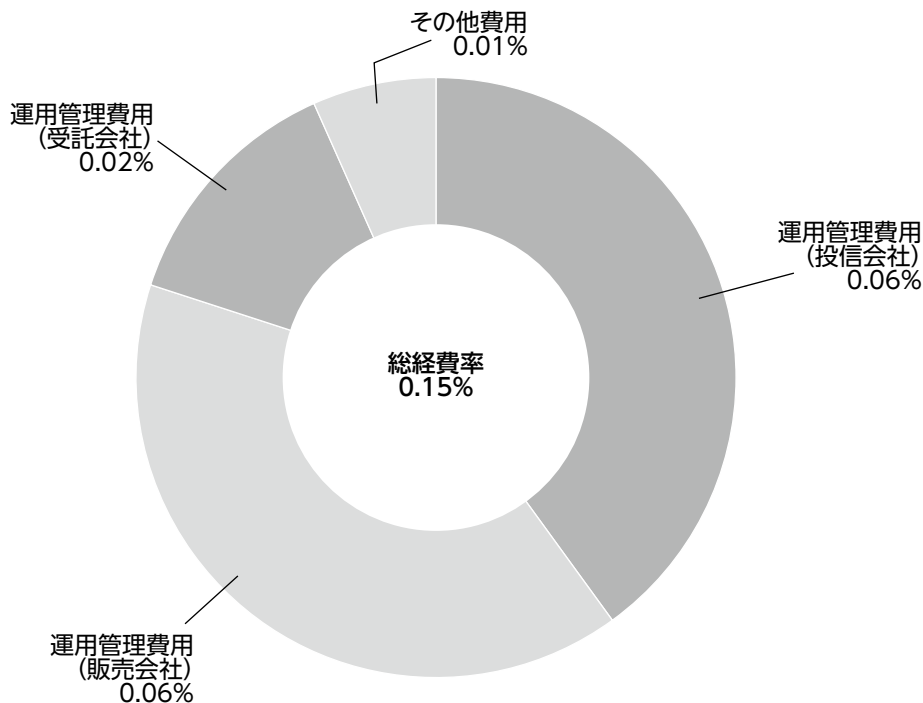
(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(注3) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報) 総経費率

期中の運用・管理にかかった費用の総額（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除く。）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0.15%です。



(注)費用は、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)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)各比率は、年率換算した値です。

(注)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は異なります。

◎売買及び取引の状況 (2022年10月28日～2023年10月27日)

○親投資信託の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
国内債券パッシブ型マザーファンド	千口 132,642	千円 160,970	千口 85,339	千円 103,360

(注) 単位未満は切り捨て。

◎利害関係人との取引状況等 (2022年10月28日～2023年10月27日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(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。

◎組入資産明細表

○親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
国内債券パッシブ型マザーファンド	千口 976,924	千口 1,024,227	千円 1,209,817

(注1) 口数・評価額の単位未満は切り捨て。

(注2) 国内債券パッシブ型マザーファンド全体の当期末受益権口数は(36,230,918千口)です。

◎投資信託財産の構成

2023年10月27日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
国内債券パッシブ型マザーファンド	千円 1,209,817	99.8 %
コール・ローン等、その他	3,007	0.2
投資信託財産総額	1,212,824	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年10月27日現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	1,212,824,685
コール・ローン等	3,007,400
国内債券パッシブ型 マザーファンド(評価額)	1,209,817,285
(B) 負 債	1,794,064
未払解約金	947,194
未払信託報酬	813,043
未払利息	8
その他未払費用	33,819
(C) 純資産総額(A-B)	1,211,030,621
元 本	1,196,272,857
次期繰越損益金	14,757,764
(D) 受益権総口数	1,196,272,857口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,123円

◎損益の状況

自 2022年10月28日
至 2023年10月27日

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	△ 811
支 払 利 息	△ 811
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 35,261,842
売 買 益	1,122,846
売 買 損	△ 36,384,688
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,663,386
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 36,926,039
(E) 前期繰越損益金	△ 31,279,695
(F) 追加信託差損益金	82,963,498
(配当等相当額)	(88,596,802)
(売買損益相当額)	(△ 5,633,304)
(G) 計 (D+E+F)	14,757,764
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	14,757,764
追加信託差損益金	82,963,498
(配当等相当額)	(88,731,798)
(売買損益相当額)	(△ 5,768,300)
分配準備積立金	44,466,271
繰越損益金	△112,672,005

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,139,487,256円、期中追加設定元本額は194,297,380円、期中一部解約元本額は137,511,779円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1,0123円です。

(注3) 損益の状況の中で(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4) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注5) 損益の状況の中で(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6) 計算期間末における費用控除後の配当等収益(7,736,038円)、費用控除後の有価証券等損益額(0円)、信託約款に規定する収益調整金(88,731,798円)および分配準備積立金(36,730,233円)より分配対象収益は133,198,069円(10,000口当たり1,113円)ですが、当期に分配した金額はありません。

国内債券パッシブ型マザーファンド

運用報告書

第16期

(決算日 2023年10月27日)

「国内債券パッシブ型マザーファンド」は、2023年10月27日に第16期決算を行いました。
以下、当マザーファンドの第16期の運用状況をご報告申し上げます。

当マザーファンドの仕組みは次の通りです。

運 用 方 針	円建の公社債を主要投資対象とし、ベンチマークであるNOMURA-BPI総合に連動する運用成果を目指して運用を行います。
主 要 運 用 対 象	円建の公社債を主要投資対象とします。
組 入 制 限	株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。また、外貨建資産への投資は行いません。

◎最近5期の運用実績

決算期	基準価額	騰落率	NOMURA-BPI総合		債組比	券入率	純資産額
			(ベンチマーク)	騰落率			
	円	%		%	%		百万円
(第12期)2019年10月28日	12,824	3.2	392.10	3.1	99.7		37,159
(第13期)2020年10月27日	12,659	△1.3	386.97	△1.3	99.6		37,957
(第14期)2021年10月27日	12,633	△0.2	386.26	△0.2	99.6		37,793
(第15期)2022年10月27日	12,162	△3.7	371.87	△3.7	99.7		44,752
(第16期)2023年10月27日	11,812	△2.9	361.09	△2.9	99.3		42,796

(注) 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する、国内で発行された公募利付債券の市場全体の動向を表す投資収益指数で、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の知的財産です。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、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任はありません。

◎当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	騰落率	NOMURA-BPI総合		債組比	券入率
			(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%		%
(期首)2022年10月27日	12,162	—	371.87	—	99.7	
10月末	12,206	0.4	373.25	0.4	99.7	
11月末	12,145	△0.1	371.33	△0.1	99.6	
12月末	11,987	△1.4	366.60	△1.4	99.5	
2023年 1月末	11,956	△1.7	365.59	△1.7	99.5	
2月末	12,090	△0.6	369.57	△0.6	99.6	
3月末	12,256	0.8	374.74	0.8	99.7	
4月末	12,288	1.0	375.61	1.0	99.7	
5月末	12,277	0.9	375.27	0.9	99.7	
6月末	12,307	1.2	376.29	1.2	99.7	
7月末	12,116	△0.4	370.43	△0.4	99.6	
8月末	12,030	△1.1	367.76	△1.1	99.5	
9月末	11,944	△1.8	365.13	△1.8	99.5	
(期末)2023年10月27日	11,812	△2.9	361.09	△2.9	99.3	

(注) 騰落率は期首比です。

◎当期中の運用経過と今後の運用方針(2022年10月28日～2023年10月27日)

1 基準価額

(1) 基準価額の推移と主な変動要因



※ベンチマークはNOMURA-BPI総合であり、期首の基準価額に合わせて指数化しております。

基準価額は期首12,162円で始まり期末11,812円で終わりました。騰落率は $\Delta 2.9\%$ でした。基準価額の主な変動要因は以下の通りです。

(上昇要因)

- 日銀が金融緩和継続姿勢を打ち出したことや日銀新総裁も同姿勢を継続したことを受けて、2023年1月中旬から6月末にかけて超長期国債(償還期間が10年超の国債)金利が低下(債券価格は上昇)したこと
- 2023年3月中旬以降、クレジット環境の改善により社債の対国債スプレッド(社債の利回り-国債の利回り)が縮小したこと

(下落要因)

- 日銀が2022年12月の金融政策決定会合で、長期金利の許容変動幅を $\pm 0.25\%$ から $\pm 0.50\%$ に拡大したことを受けて、国内金利が上昇(債券価格は下落)したこと
- 日銀が2023年7月の金融政策決定会合においてイールドカーブ・コントロールの柔軟化を決定し、長期金利の変動幅の上限を事実上1.0%に変更したことから、超長期ゾーン主導で金利が上昇したこと

(2) ベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は $\Delta 2.9\%$ になりました。一方、ベンチマークの騰落率も $\Delta 2.9\%$ となり、ベンチマークとの高い運動性を維持しました。

2 運用経過

運用概況

期首の運用方針に基づき、期間構成、種別構成とも、ベンチマークからの乖離を抑制したパッシブ型運用を行いました。また、複利最終利回りについても概ねベンチマーク並みを維持しました。

【ポートフォリオプロフィール】

	期首	期末
デュレーション(年)	9.0	8.9
残存年数(年)	10.1	10.2
複利最終利回り(%)	0.4	0.8
銘柄数	267	278

【債券種類】

(単位: %)

	期首	期末
国債	84.0	84.3
政府保証債	1.7	1.5
地方債	6.3	6.0
金融債	0.2	0.2
事業債等	7.5	7.3
合計	99.7	99.3

※純資産総額に対する比率

3 今後の運用方針

引き続き、円建の公社債に投資し、ベンチマークからの乖離を抑制したパッシブ型運用を行います。

◎1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	2022年10月28日～2023年10月27日		
	金額	比率	
(a) その他費用	0円	0.000%	(a) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 ※期中の平均基準価額は12,133円です。
(その他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要する諸費用、信託財産に関する租税等
合計	0	0.000	

(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・解約により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) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

◎売買及び取引の状況(2022年10月28日～2023年10月27日)

○公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	22,268,915	22,352,732
	地方債証券	539,560	707,287
	特殊債証券	428,626	525,874 (41,804)
	社債券(投資法人債券を含む)	412,433	494,640

(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) 単位未満は切り捨て。

(注3) ()内は償還等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

(注4) 社債券(投資法人債券を含む)には新株予約権付社債(転換社債)は含まれておりません。

◎利害関係人との取引状況等(2022年10月28日～2023年10月27日)

期中の利害関係人との取引はございません。

(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。

◎組入資産明細表

○国内(邦貨建)公社債(種類別)

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	37,326,000	36,073,929	84.3	—	53.0	21.1	10.2
地 方 債 証 券	2,550,000	2,580,812	6.0	—	3.6	1.5	0.9
特 殊 債 券 (除 金 融 債)	1,896,369	1,980,401	4.6	—	3.4	1.2	—
金 融 債 券	100,000	99,029	0.2	—	—	0.2	—
普 通 社 債 券 (含 む 投 資 法 人 債 券)	1,800,000	1,781,745	4.2	—	1.6	2.3	0.2
合 計	43,672,369	42,515,917	99.3	—	61.7	26.3	11.4

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 単位未満は切り捨て。

(注3) —印は組み入れなし。

(注4) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

○国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

銘 柄 名	利 率	額 面 金 額	当 期		償 還 年 月 日
			評 価 額	債 還 年 月 日	
	%	千円	千円		
(国債証券)					
第449回 利付国債2年	0.005	1,903,000	1,902,238		2025/ 6/ 1
第451回 利付国債2年	0.005	145,000	144,936		2025/ 8/ 1
第453回 利付国債2年	0.005	20,000	19,969		2025/10/ 1
第143回 利付国債5年	0.1	445,000	445,614		2025/ 3/20
第144回 利付国債5年	0.1	480,000	480,585		2025/ 6/20
第145回 利付国債5年	0.1	550,000	550,462		2025/ 9/20
第146回 利付国債5年	0.1	680,000	680,285		2025/12/20
第147回 利付国債5年	0.005	635,000	633,558		2026/ 3/20
第148回 利付国債5年	0.005	180,000	179,454		2026/ 6/20
第149回 利付国債5年	0.005	340,000	338,629		2026/ 9/20
第150回 利付国債5年	0.005	320,000	318,348		2026/12/20
第151回 利付国債5年	0.005	360,000	357,696		2027/ 3/20
第153回 利付国債5年	0.005	340,000	337,300		2027/ 6/20
第154回 利付国債5年	0.1	490,000	487,167		2027/ 9/20
第155回 利付国債5年	0.3	300,000	300,243		2027/12/20
第156回 利付国債5年	0.2	220,000	219,278		2027/12/20
第157回 利付国債5年	0.2	30,000	29,856		2028/ 3/20
第158回 利付国債5年	0.1	610,000	604,455		2028/ 3/20
第159回 利付国債5年	0.1	245,000	242,368		2028/ 6/20
第 1回 利付国債40年	2.4	43,000	48,481		2048/ 3/20

当		期	末			
銘	柄	名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)			%	千円	千円	
第 2回	利付国債40年		2.2	51,000	55,423	2049/ 3/20
第 3回	利付国債40年		2.2	45,000	48,787	2050/ 3/20
第 4回	利付国債40年		2.2	77,000	83,337	2051/ 3/20
第 5回	利付国債40年		2.0	72,000	74,845	2052/ 3/20
第 6回	利付国債40年		1.9	72,000	73,242	2053/ 3/20
第 7回	利付国債40年		1.7	87,000	84,378	2054/ 3/20
第 8回	利付国債40年		1.4	103,000	92,329	2055/ 3/20
第 9回	利付国債40年		0.4	169,000	109,910	2056/ 3/20
第10回	利付国債40年		0.9	155,000	118,726	2057/ 3/20
第11回	利付国債40年		0.8	124,000	91,084	2058/ 3/20
第12回	利付国債40年		0.5	127,000	82,563	2059/ 3/20
第13回	利付国債40年		0.5	175,000	112,379	2060/ 3/20
第14回	利付国債40年		0.7	162,000	111,125	2061/ 3/20
第15回	利付国債40年		1.0	189,000	142,989	2062/ 3/20
第16回	利付国債40年		1.3	72,000	59,647	2063/ 3/20
第340回	利付国債10年		0.4	37,000	37,240	2025/ 9/20
第342回	利付国債10年		0.1	154,000	154,000	2026/ 3/20
第343回	利付国債10年		0.1	157,000	156,916	2026/ 6/20
第344回	利付国債10年		0.1	230,000	229,701	2026/ 9/20
第345回	利付国債10年		0.1	216,000	215,526	2026/12/20
第346回	利付国債10年		0.1	128,000	127,590	2027/ 3/20
第347回	利付国債10年		0.1	803,000	799,370	2027/ 6/20
第348回	利付国債10年		0.1	207,000	205,803	2027/ 9/20
第349回	利付国債10年		0.1	330,000	327,567	2027/12/20
第350回	利付国債10年		0.1	193,000	191,245	2028/ 3/20
第351回	利付国債10年		0.1	135,000	133,520	2028/ 6/20
第352回	利付国債10年		0.1	231,000	228,057	2028/ 9/20
第353回	利付国債10年		0.1	335,000	330,102	2028/12/20
第354回	利付国債10年		0.1	369,000	362,874	2029/ 3/20
第355回	利付国債10年		0.1	507,000	497,650	2029/ 6/20
第356回	利付国債10年		0.1	96,000	94,017	2029/ 9/20
第357回	利付国債10年		0.1	350,000	341,862	2029/12/20
第358回	利付国債10年		0.1	215,000	209,416	2030/ 3/20
第359回	利付国債10年		0.1	243,000	235,918	2030/ 6/20
第360回	利付国債10年		0.1	352,000	340,577	2030/ 9/20
第361回	利付国債10年		0.1	380,000	366,361	2030/12/20
第362回	利付国債10年		0.1	326,000	313,139	2031/ 3/20
第363回	利付国債10年		0.1	413,000	395,174	2031/ 6/20
第364回	利付国債10年		0.1	235,000	223,952	2031/ 9/20
第365回	利付国債10年		0.1	235,000	223,109	2031/12/20

当		期	末			
銘	柄	名	利	額	評	
			率	面	価	
			%	金	額	
				額	償	
				千円	還	
					年	
					月	
					日	
(国債証券)			%	千円	千円	
第366回	利付	国債10年	0.2	350,000	333,889	2032/ 3/20
第367回	利付	国債10年	0.2	256,000	243,392	2032/ 6/20
第368回	利付	国債10年	0.2	330,000	312,655	2032/ 9/20
第369回	利付	国債10年	0.5	462,000	448,472	2032/12/20
第370回	利付	国債10年	0.5	463,000	448,716	2033/ 3/20
第371回	利付	国債10年	0.4	325,000	311,415	2033/ 6/20
第 2回	利付	国債30年	2.4	10,000	11,175	2030/ 2/20
第 5回	利付	国債30年	2.2	20,000	22,247	2031/ 5/20
第 7回	利付	国債30年	2.3	60,000	67,529	2032/ 5/20
第 8回	利付	国債30年	1.8	85,000	92,221	2032/11/22
第11回	利付	国債30年	1.7	113,000	121,827	2033/ 6/20
第13回	利付	国債30年	2.0	55,000	60,875	2033/12/20
第15回	利付	国債30年	2.5	105,000	121,487	2034/ 6/20
第17回	利付	国債30年	2.4	90,000	103,302	2034/12/20
第19回	利付	国債30年	2.3	100,000	113,789	2035/ 6/20
第21回	利付	国債30年	2.3	105,000	119,517	2035/12/20
第23回	利付	国債30年	2.5	101,000	117,339	2036/ 6/20
第24回	利付	国債30年	2.5	50,000	58,132	2036/ 9/20
第25回	利付	国債30年	2.3	100,000	113,776	2036/12/20
第27回	利付	国債30年	2.5	91,000	105,713	2037/ 9/20
第28回	利付	国債30年	2.5	128,000	148,596	2038/ 3/20
第30回	利付	国債30年	2.3	102,000	115,373	2039/ 3/20
第31回	利付	国債30年	2.2	84,000	93,586	2039/ 9/20
第32回	利付	国債30年	2.3	75,000	84,447	2040/ 3/20
第33回	利付	国債30年	2.0	74,000	79,846	2040/ 9/20
第34回	利付	国債30年	2.2	89,000	98,404	2041/ 3/20
第35回	利付	国債30年	2.0	107,000	114,869	2041/ 9/20
第36回	利付	国債30年	2.0	117,000	125,249	2042/ 3/20
第37回	利付	国債30年	1.9	138,000	145,163	2042/ 9/20
第38回	利付	国債30年	1.8	146,000	150,654	2043/ 3/20
第39回	利付	国債30年	1.9	75,000	78,479	2043/ 6/20
第40回	利付	国債30年	1.8	76,000	78,057	2043/ 9/20
第41回	利付	国債30年	1.7	93,000	93,773	2043/12/20
第42回	利付	国債30年	1.7	97,000	97,739	2044/ 3/20
第43回	利付	国債30年	1.7	90,000	90,552	2044/ 6/20
第44回	利付	国債30年	1.7	87,000	87,471	2044/ 9/20
第45回	利付	国債30年	1.5	89,000	86,231	2044/12/20
第46回	利付	国債30年	1.5	131,000	126,691	2045/ 3/20
第47回	利付	国債30年	1.6	156,000	153,410	2045/ 6/20
第48回	利付	国債30年	1.4	130,000	122,993	2045/ 9/20

当		期	末			
銘	柄	名	利	額	評	
			率	面	価	
			%	金	額	
				額	償	
				千円	還	
					年	
					月	
					日	
(国債証券)			%	千円	千円	
第 49回	利付国債30年		1.4	75,000	70,810	2045/12/20
第 50回	利付国債30年		0.8	132,000	109,797	2046/ 3/20
第 51回	利付国債30年		0.3	140,000	102,992	2046/ 6/20
第 52回	利付国債30年		0.5	91,000	70,061	2046/ 9/20
第 53回	利付国債30年		0.6	105,000	82,528	2046/12/20
第 54回	利付国債30年		0.8	101,000	83,010	2047/ 3/20
第 55回	利付国債30年		0.8	147,000	120,426	2047/ 6/20
第 56回	利付国債30年		0.8	94,000	76,756	2047/ 9/20
第 57回	利付国債30年		0.8	162,000	131,853	2047/12/20
第 58回	利付国債30年		0.8	137,000	111,143	2048/ 3/20
第 60回	利付国債30年		0.9	192,000	158,615	2048/ 9/20
第 61回	利付国債30年		0.7	111,000	86,932	2048/12/20
第 62回	利付国債30年		0.5	80,000	59,196	2049/ 3/20
第 63回	利付国債30年		0.4	90,000	64,447	2049/ 6/20
第 64回	利付国債30年		0.4	110,000	78,438	2049/ 9/20
第 65回	利付国債30年		0.4	101,000	71,781	2049/12/20
第 66回	利付国債30年		0.4	73,000	51,622	2050/ 3/20
第 67回	利付国債30年		0.6	101,000	75,312	2050/ 6/20
第 68回	利付国債30年		0.6	105,000	77,999	2050/ 9/20
第 69回	利付国債30年		0.7	105,000	80,002	2050/12/20
第 70回	利付国債30年		0.7	184,000	139,817	2051/ 3/20
第 71回	利付国債30年		0.7	83,000	62,898	2051/ 6/20
第 72回	利付国債30年		0.7	89,000	67,261	2051/ 9/20
第 73回	利付国債30年		0.7	231,000	174,259	2051/12/20
第 74回	利付国債30年		1.0	89,000	72,818	2052/ 3/20
第 75回	利付国債30年		1.3	87,000	76,890	2052/ 6/20
第 76回	利付国債30年		1.4	128,000	115,846	2052/ 9/20
第 77回	利付国債30年		1.6	132,000	125,394	2052/12/20
第 78回	利付国債30年		1.4	189,000	170,856	2053/ 3/20
第 80回	利付国債30年		1.8	6,000	5,959	2053/ 9/20
第 71回	利付国債20年		2.2	95,000	96,401	2024/ 6/20
第 74回	利付国債20年		2.1	80,000	81,942	2024/12/20
第 77回	利付国債20年		2.0	425,000	436,781	2025/ 3/20
第 78回	利付国債20年		1.9	65,000	66,995	2025/ 6/20
第 81回	利付国債20年		2.0	100,000	103,673	2025/ 9/20
第 84回	利付国債20年		2.0	100,000	104,101	2025/12/20
第 86回	利付国債20年		2.3	126,000	132,598	2026/ 3/20
第 88回	利付国債20年		2.3	75,000	79,299	2026/ 6/20
第 91回	利付国債20年		2.3	119,000	126,399	2026/ 9/20
第 92回	利付国債20年		2.1	206,000	218,450	2026/12/20

当		期	末			
銘	柄	名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(国債証券)			%	千円	千円	
第 95回	利付国債20年		2.3	160,000	172,011	2027/ 6/20
第 97回	利付国債20年		2.2	83,000	89,269	2027/ 9/20
第 99回	利付国債20年		2.1	113,000	121,464	2027/12/20
第101回	利付国債20年		2.4	155,000	169,091	2028/ 3/20
第103回	利付国債20年		2.3	132,000	143,911	2028/ 6/20
第106回	利付国債20年		2.2	144,000	156,769	2028/ 9/20
第108回	利付国債20年		1.9	30,000	32,306	2028/12/20
第110回	利付国債20年		2.1	94,000	102,452	2029/ 3/20
第112回	利付国債20年		2.1	134,000	146,439	2029/ 6/20
第113回	利付国債20年		2.1	131,000	143,526	2029/ 9/20
第114回	利付国債20年		2.1	164,000	180,004	2029/12/20
第116回	利付国債20年		2.2	115,000	127,177	2030/ 3/20
第120回	利付国債20年		1.6	70,000	74,802	2030/ 6/20
第121回	利付国債20年		1.9	85,000	92,556	2030/ 9/20
第123回	利付国債20年		2.1	59,000	65,103	2030/12/20
第124回	利付国債20年		2.0	85,000	93,211	2030/12/20
第126回	利付国債20年		2.0	100,000	109,746	2031/ 3/20
第128回	利付国債20年		1.9	212,000	231,198	2031/ 6/20
第130回	利付国債20年		1.8	86,000	93,143	2031/ 9/20
第132回	利付国債20年		1.7	120,000	129,091	2031/12/20
第133回	利付国債20年		1.8	100,000	108,345	2031/12/20
第134回	利付国債20年		1.8	49,000	53,101	2032/ 3/20
第135回	利付国債20年		1.7	86,000	92,518	2032/ 3/20
第137回	利付国債20年		1.7	203,000	218,379	2032/ 6/20
第139回	利付国債20年		1.6	32,000	34,151	2032/ 6/20
第140回	利付国債20年		1.7	262,000	282,037	2032/ 9/20
第141回	利付国債20年		1.7	128,000	137,752	2032/12/20
第144回	利付国債20年		1.5	74,000	78,385	2033/ 3/20
第145回	利付国債20年		1.7	55,000	59,296	2033/ 6/20
第146回	利付国債20年		1.7	219,000	236,198	2033/ 9/20
第147回	利付国債20年		1.6	181,000	193,309	2033/12/20
第148回	利付国債20年		1.5	128,000	135,358	2034/ 3/20
第149回	利付国債20年		1.5	205,000	216,521	2034/ 6/20
第150回	利付国債20年		1.4	259,000	270,502	2034/ 9/20
第152回	利付国債20年		1.2	88,000	89,752	2035/ 3/20
第153回	利付国債20年		1.3	179,000	184,117	2035/ 6/20
第154回	利付国債20年		1.2	120,000	121,902	2035/ 9/20
第155回	利付国債20年		1.0	317,000	314,108	2035/12/20
第156回	利付国債20年		0.4	131,000	120,412	2036/ 3/20
第157回	利付国債20年		0.2	85,000	75,796	2036/ 6/20

当		期	末			
銘	柄	名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
(国債証券)						
第158回	利付国債20年		0.5	224,000	206,841	2036/ 9/20
第159回	利付国債20年		0.6	165,000	153,676	2036/12/20
第160回	利付国債20年		0.7	217,000	203,897	2037/ 3/20
第161回	利付国債20年		0.6	150,000	138,558	2037/ 6/20
第162回	利付国債20年		0.6	219,000	201,436	2037/ 9/20
第163回	利付国債20年		0.6	136,000	124,554	2037/12/20
第164回	利付国債20年		0.5	133,000	119,524	2038/ 3/20
第165回	利付国債20年		0.5	182,000	162,791	2038/ 6/20
第166回	利付国債20年		0.7	204,000	187,094	2038/ 9/20
第167回	利付国債20年		0.5	197,000	174,524	2038/12/20
第168回	利付国債20年		0.4	174,000	151,016	2039/ 3/20
第169回	利付国債20年		0.3	142,000	120,567	2039/ 6/20
第170回	利付国債20年		0.3	164,000	138,479	2039/ 9/20
第171回	利付国債20年		0.3	170,000	142,749	2039/12/20
第172回	利付国債20年		0.4	160,000	135,955	2040/ 3/20
第173回	利付国債20年		0.4	180,000	152,116	2040/ 6/20
第174回	利付国債20年		0.4	177,000	148,756	2040/ 9/20
第175回	利付国債20年		0.5	150,000	127,633	2040/12/20
第176回	利付国債20年		0.5	221,000	187,167	2041/ 3/20
第177回	利付国債20年		0.4	338,000	279,701	2041/ 6/20
第178回	利付国債20年		0.5	128,000	107,444	2041/ 9/20
第179回	利付国債20年		0.5	245,000	204,663	2041/12/20
第180回	利付国債20年		0.8	179,000	157,425	2042/ 3/20
第181回	利付国債20年		0.9	127,000	113,341	2042/ 6/20
第182回	利付国債20年		1.1	126,000	116,102	2042/ 9/20
第183回	利付国債20年		1.4	167,000	161,630	2042/12/20
第184回	利付国債20年		1.1	158,000	144,704	2043/ 3/20
第185回	利付国債20年		1.1	211,000	192,501	2043/ 6/20
小 計				37,326,000	36,073,929	
(地方債証券)						
第 1回	東京都公募公債 (30年)		0.982	100,000	83,006	2047/ 9/20
第 15回	東京都公募公債 (20年)		2.32	100,000	108,800	2028/ 9/20
第 11回	神奈川県公募公債		2.08	100,000	108,435	2029/ 7/20
第 7回	大阪府公募公債 (20年)		1.84	100,000	107,420	2031/ 9/26
令和 2年度第7回	京都府公募公債		0.15	100,000	96,222	2030/ 9/17
兵庫県第23回	20年公募公債		1.26	100,000	101,186	2034/12/ 8
第 11回	20年静岡県公募公債		1.841	100,000	107,486	2030/10/18
平成22年度第4回	愛知県公募公債		2.072	70,000	76,253	2030/ 6/14
平成27年度第3回	愛知県公募公債		1.115	100,000	99,393	2035/ 5/ 8
平成30年度第4回	埼玉県公募公債		0.205	100,000	98,792	2028/ 6/26

当		期	末			
銘	柄	名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
(地方債証券)						
福岡県平成27年度第1回	20年公募公債		1.285	100,000	101,174	2035/ 5/22
第 4回	千葉県公募公債		2.46	100,000	109,098	2028/ 6/20
令和 3年度第3回	新潟県公募公債		0.244	130,000	123,210	2032/ 2/27
第150回	共同発行市場公募地方債		0.51	100,000	100,657	2025/ 9/25
第176回	共同発行市場公募地方債		0.185	100,000	99,176	2027/11/25
第227回	共同発行市場公募地方債		0.244	150,000	142,171	2032/ 2/25
令和元年度第1回	福島県公募公債		0.09	100,000	96,891	2029/11/29
平成12年度第1回	名古屋市公募公債		1.033	100,000	101,467	2025/ 6/20
平成27年度第4回	神戸市公募公債		0.51	100,000	100,654	2025/ 9/12
第 19回	横浜市公募公債 (20年)		2.2	100,000	109,216	2029/ 8/31
平成23年度第9回	札幌市公募公債		1.493	100,000	103,860	2027/ 2/12
第 8回	地方公共団体金融機構債券		2.043	100,000	108,416	2030/ 6/28
F 128回	地方公共団体金融機構債券		1.024	100,000	101,036	2024/12/20
F 149回	地方公共団体金融機構債券		1.145	100,000	101,974	2025/12/19
第144回	地方公共団体金融機構債券		0.16	100,000	94,819	2031/ 5/28
小 計				2,550,000	2,580,812	
(特殊債券(除く金融債))						
政府保証第 79回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.1	100,000	108,445	2029/ 4/27
政府保証第 94回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.2	100,000	109,532	2029/11/30
政府保証第178回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.68	100,000	106,331	2032/11/30
政府保証第259回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.119	100,000	99,128	2035/10/31
政府保証第309回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.14	100,000	99,444	2027/ 4/30
政府保証第321回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		0.155	100,000	99,312	2027/ 8/31
第 19回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.75	10,000	11,483	2047/ 3/20
第 26回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.67	100,000	115,106	2037/ 9/18
第 37回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.42	100,000	108,693	2028/ 6/20
第 39回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		2.37	100,000	108,805	2028/ 9/20
第 75回	日本高速道路保有・債務返済機構債券		1.96	100,000	107,853	2031/ 9/19
第 21回	道路債券		2.75	100,000	115,041	2033/ 6/20
第 33回	日本高速道路保有 機構承継債		2.91	50,000	58,679	2034/ 6/20
第 51回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.64	18,758	19,380	2046/ 8/10
第 52回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.51	40,392	41,595	2046/ 9/10
第 53回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.48	21,175	21,791	2046/10/10
第 90回	住宅金融支援機構債券		1.595	100,000	103,905	2026/12/18
第 56回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.42	23,878	24,521	2047/ 1/10
第 60回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.34	25,956	26,557	2047/ 5/10
第125回	住宅金融支援機構債券		1.898	100,000	107,464	2033/ 1/25
第 84回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.01	35,734	35,854	2049/ 5/10
第 99回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.88	53,990	53,256	2050/ 8/10
第109回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.36	65,004	61,968	2051/ 6/10

当		期	末			
銘	柄	名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
(特殊債券(除く金融債))			%	千円	千円	
第138回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.5	75,544	71,815	2053/11/10
第152回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	83,271	77,626	2055/ 1/10
第178回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.48	92,667	86,812	2057/ 3/10
小 計				1,896,369	1,980,401	
(金融債券)						
利附第387回	しんきん中金債券5年		0.09	100,000	99,029	2027/ 2/26
(普通社債券(含む投資法人債券))						
第506回	関西電力(一般担保付)		0.33	100,000	99,352	2026/10/23
第552回	東北電力(一般担保付)		0.864	100,000	100,169	2028/12/25
第 49回	東京電力パワーグリッド(一般担保付)		0.6	100,000	99,402	2027/ 4/26
第 12回	セブン&アイ・ホールディングス無担保社債		0.781	100,000	100,820	2025/ 6/20
第 36回	三菱ケミカルホールディングス無担保社債		0.4	100,000	95,602	2030/ 6/11
第 16回	武田薬品工業無担保社債		0.4	100,000	93,711	2031/10/14
第 29回	ダイキン工業無担保社債		0.339	100,000	92,819	2032/ 3/11
第 23回	パナソニック無担保社債		0.39	100,000	93,865	2030/12/24
第 32回	いすゞ自動車無担保社債		0.11	100,000	98,984	2026/ 9/29
第 13回	住友信託銀行(劣後特約付)		2.341	100,000	103,471	2026/ 6/15
第 7回	みずほリース無担保社債		0.33	100,000	98,380	2028/ 1/20
第 2回	NTTファイナンス無担保社債		0.26	100,000	99,407	2026/12/18
第 64回	三菱HCキャピタル無担保社債		0.474	100,000	98,094	2028/10/18
第 66回	三井不動産無担保社債		0.28	100,000	99,672	2026/ 3/13
第 12回	西日本旅客鉄道無担保社債		2.49	100,000	105,814	2026/ 7/28
第 46回	東海旅客鉄道無担保社債		2.157	100,000	108,134	2029/12/18
第 72回	電源開発無担保社債		0.35	100,000	94,008	2031/ 1/20
第 29回	ビー・ピー・シー・イー・エス・エー円貨社債		0.899	100,000	100,041	2025/12/15
小 計				1,800,000	1,781,745	
合 計				43,672,369	42,515,917	

(注) 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

◎投資信託財産の構成

2023年10月27日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	42,515,917	99.1
コール・ローン等、その他	382,476	0.9
投資信託財産総額	42,898,393	100.0

(注) 評価額の単位未満は切り捨て。

◎資産、負債、元本及び基準価額の状況

2023年10月27日現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	42,898,393,867
コール・ローン等	169,747,890
公社債(評価額)	42,515,917,476
未収入金	135,353,960
未収利息	74,073,760
前払費用	3,300,781
(B) 負 債	101,474,070
未払金	101,473,050
未払利息	496
その他未払費用	524
(C) 純資産総額(A-B)	42,796,919,797
元 本	36,230,918,028
次期繰越損益金	6,566,001,769
(D) 受益権総口数	36,230,918,028口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,812円

◎損益の状況

自 2022年10月28日
至 2023年10月27日

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	337,698,533
受 取 利 息	337,786,527
支 払 利 息	△ 87,994
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△1,611,743,392
売 買 益	64,709,559
売 買 損	△1,676,452,951
(C) 信 託 報 酬 等	△ 99,409
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△1,274,144,268
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	7,956,650,589
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	1,080,542,347
(G) 解 約 差 損 益 金	△1,197,046,899
(H) 計 (D+E+F+G)	6,566,001,769
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	6,566,001,769

(注1) 当親ファンドの期首元本額は36,795,573,476円、期中追加設定元本額は4,739,237,653円、期中一部解約元本額は5,303,893,101円です。

(注2) 当親ファンドの当期末元本の内訳は、国内債券パッシブ型ファンド 適格機関投資家専用35,206,690,729円、明治安田DC日本債券パッシブファンド1,024,227,299円です。

(注3) 1口当たり純資産額は1,1812円です。

(注4) 損益の状況の中で(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5) 損益の状況の中で(C)信託報酬等には信託報酬等に対する消費税等相当額を含めて表示しています。

(注6) 損益の状況の中で(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7) 損益の状況の中で(G)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。