

# インデックスファンド日本債券（1年決算型） 〈愛称 DC インデックス日本債券〉

## 運用報告書（全体版）

第21期（決算日 2022年10月26日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚くお礼申し上げます。

「インデックスファンド日本債券（1年決算型）」は、2022年10月26日に第21期の決算を行ないましたので、期中の運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引き立てを賜りますようお願い申し上げます。

### 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	2001年10月17日から原則無期限です。	
運用方針	主として「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券に投資を行ない、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。	
主要運用対象	インデックスファンド 日本債券（1年決算型）	「日本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。
	日本債券インデックス 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。
組入制限	インデックスファンド 日本債券（1年決算型）	株式への投資は、信託財産の総額の10%以下とします。 外貨建資産への投資は行ないません。
	日本債券インデックス マザーファンド	外貨建資産への投資は行ないません。
分配方針	毎決算時、原則として分配対象額のなかから、基準価額水準、市況動向などを勘案して分配を行なう方針です。 ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。	

<958360>

## 日興アセットマネジメント株式会社

東京都港区赤坂九丁目7番1号  
www.nikkoam.com/

### 当運用報告書に関するお問い合わせ先

コールセンター 電話番号：0120-25-1404  
午前9時～午後5時 土、日、祝・休日は除きます。

●お取引状況等についてはご購入された販売会社にお問い合わせください。

【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

○最近5期の運用実績

決 算 期	基 準 (分配落)	価 額			N O M U R A - B P I 総 合 (ベンチマーク)		債 券 組 入 比 率	純 資 産 総 額
		税 込 分 配	み 金 期 騰	中 率 落 率	期 騰 落 率	中 率		
	円	円	%			%	百万円	
17期(2018年10月26日)	12,050	10	△0.3	546.64	0.2	99.6	8,769	
18期(2019年10月28日)	12,366	10	2.7	564.07	3.2	99.4	9,526	
19期(2020年10月26日)	12,135	10	△1.8	556.49	△1.3	99.4	9,595	
20期(2021年10月26日)	12,042	10	△0.7	555.54	△0.2	99.6	9,317	
21期(2022年10月26日)	11,496	10	△4.5	532.71	△4.1	99.8	8,342	

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 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) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

## ○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		N O M U R A - B P I 総 合 (ベンチマーク)	騰 落 率		債 組 入 比 率
		円	%		%	%	
(期 首) 2021年10月26日	12,042	—	—	555.54	—	—	99.6
10月末	12,058	0.1	—	556.34	0.1	—	99.7
11月末	12,082	0.3	—	557.68	0.4	—	99.6
12月末	12,051	0.1	—	556.51	0.2	—	99.8
2022年1月末	11,963	△0.7	—	552.50	△0.5	—	99.7
2月末	11,899	△1.2	—	549.73	△1.0	—	99.7
3月末	11,861	△1.5	—	548.16	△1.3	—	99.9
4月末	11,829	△1.8	—	546.84	△1.6	—	99.8
5月末	11,807	△2.0	—	546.00	△1.7	—	99.7
6月末	11,697	△2.9	—	541.03	△2.6	—	99.8
7月末	11,771	△2.3	—	544.59	△2.0	—	99.7
8月末	11,740	△2.5	—	543.32	△2.2	—	99.7
9月末	11,613	△3.6	—	537.46	△3.3	—	99.8
(期 末) 2022年10月26日	11,506	△4.5	—	532.71	△4.1	—	99.8

(注) 期末の基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注) 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

(2021年10月27日～2022年10月26日)

## 期中の基準価額等の推移



- (注) 分配金再投資基準価額は、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。
- (注) 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。したがって、お客様の損益の状況を示すものではありません。
- (注) 分配金再投資基準価額およびNOMURA-BPI総合は、期首(2021年10月26日)の値が基準価額と同一となるように指数化しております。
- (注) 上記騰落率は、小数点以下第2位を四捨五入して表示しております。
- (注) NOMURA-BPI総合は当ファンドのベンチマークです。

## ○基準価額の主な変動要因

当ファンドは、主に、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券に投資を行ない、中長期的な信託財産の成長をめざして運用を行なっております。当作成期間中における基準価額の主な変動要因は、以下の通りです。

## 〈値上がり要因〉

- ・南アフリカで確認された新型コロナウイルスの新たな変異株の感染拡大に対する懸念や、ロシア軍のウクライナ侵攻を受けた地政学的リスクへの警戒感などから、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・日銀が指値オペを継続し長期金利の上昇を抑制したこと。

## 〈値下がり要因〉

- ・ウクライナ情勢を巡り供給混乱を受けた世界的なインフレ高進が懸念され金利先高観が強まったこと。
- ・中国の上海市がロックダウン（都市封鎖）を解除する方針を示し、経済正常化への期待から投資家のリスク回避姿勢が後退したこと。
- ・欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたこと。

## 投資環境

## （国内債券市況）

国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。

南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新たな変異株が確認され投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、ロシア軍のウクライナ侵攻を受けた地政学的リスクへの警戒感が高まったこと、日銀が指値オペを継続し長期金利の上昇を抑制したことなどから利回りが低下（債券価格は上昇）する局面があったものの、ウクライナ情勢を巡り、世界的なインフレ高進が懸念され金利先高観が強まったことや、中国の上海市がロックダウンを解除する方針を示し、経済正常化への期待から投資家のリスク回避姿勢が後退したこと、欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたことなどから、10年国債利回りは上昇しました。

## 当ファンドのポートフォリオ

## （当ファンド）

当ファンドは、「日本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て運用を行ないました。

## （日本債券インデックスマザーファンド）

債券のリスクコントロールモデルを利用して国債、政府保証債、地方債、金融債、電力債、事業債などによりポートフォリオを構築し、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないました。また、「NOMURA-BPI総合」採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しを行ない、債券組入比率を高位に維持しました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、4.5%（分配金再投資ベース）の値下がりとなり、ベンチマークである「NOMURA-BPI総合」の下落率4.1%を概ね0.3%下回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

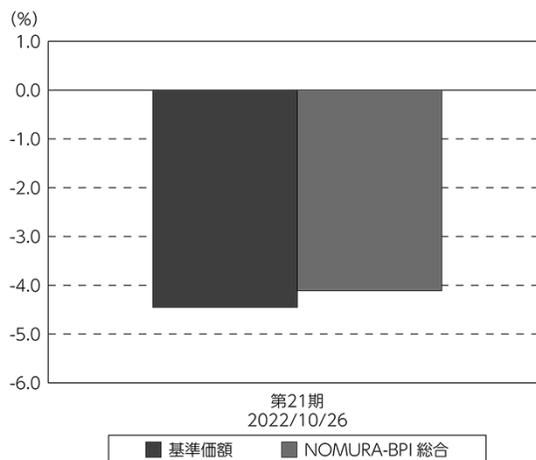
## 〈プラス要因〉

- ・金利効果。
- ・債券種別効果。
- ・売買要因。

## 〈マイナス要因〉

- ・個別銘柄効果。

基準価額とベンチマークの対比（期別騰落率）



(注) 基準価額の騰落率は分配金（税込み）込みです。  
(注) NOMURA-BPI総合は当ファンドのベンチマークです。

## 分配金

分配金は、基準価額水準、市況動向などを勘案し、以下のとおりといたしました。なお、分配金に充当しなかった収益につきましては、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

(単位：円、1万口当たり、税込み)

項 目	第21期
	2021年10月27日～ 2022年10月26日
当期分配金	10
(対基準価額比率)	0.087%
当期の収益	10
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,693

(注) 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) 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

---

（当ファンド）

引き続き、ファンドの基本方針に則り、「日本債券インデックスマザーファンド」受益証券を原則として高位に組み入れて運用を行いません。

（日本債券インデックスマザーファンド）

引き続き、原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度や残存期間別構成比率などを「NOMURA-BPI総合」と同程度に保つことで連動性を高めるよう努めます。また、ベンチマークの採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行ない、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

今後ともご愛顧賜りますよう、よろしくお願い申し上げます。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	円 59	% 0.495	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
（ 投 信 会 社 ）	(18)	(0.154)	委託した資金の運用の対価
（ 販 売 会 社 ）	(37)	(0.308)	運用報告書など各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供などの対価
（ 受 託 会 社 ）	( 4 )	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) そ の 他 費 用	1	0.004	(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 )	(0.004)	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
合 計	60	0.499	
期中の平均基準価額は、11,864円です。			

(注) 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。

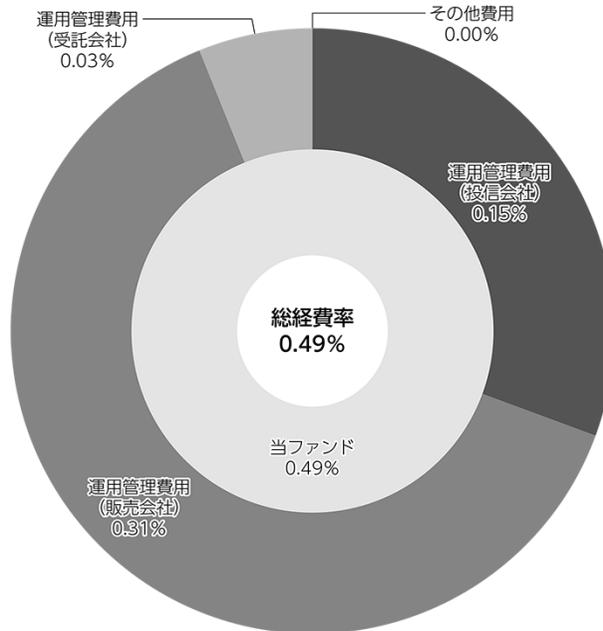
(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 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、売買委託手数料およ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0.49%です。



(注) 当ファンドの費用は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、売買委託手数料およ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) 当ファンドの費用は、親投資信託が支払った費用を含みます。

(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

(2021年10月27日～2022年10月26日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘 柄	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
日本債券インデックスマザーファンド	千口 398,833	千円 555,482	千口 844,698	千円 1,174,708

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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。

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

## ○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

## 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	6,607,446	6,161,581	8,342,165

(注) 親投資信託の2022年10月26日現在の受益権総口数は、35,139,813千口です。

## ○投資信託財産の構成

(2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	8,342,165	99.5
コール・ローン等、その他	42,251	0.5
投資信託財産総額	8,384,416	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年10月26日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,384,416,389
コール・ローン等	33,600,081
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	8,342,165,703
未収入金	8,650,605
(B) 負債	41,417,421
未払収益分配金	7,257,559
未払解約金	12,594,717
未払信託報酬	21,375,145
未払利息	54
その他未払費用	189,946
(C) 純資産総額(A-B)	8,342,998,968
元本	7,257,559,677
次期繰越損益金	1,085,439,291
(D) 受益権総口数	7,257,559,677口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,496円

(注) 当ファンドの期首元本額は7,737,718,680円、期中追加設定元本額は1,005,150,478円、期中一部解約元本額は1,485,309,481円です。

(注) 1口当たり純資産額は1.1496円です。

○損益の状況（2021年10月27日～2022年10月26日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3,876
支払利息	△ 3,876
(B) 有価証券売買損益	△ 328,501,551
売買益	21,810,034
売買損	△ 350,311,585
(C) 信託報酬等	△ 44,223,532
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 372,728,959
(E) 前期繰越損益金	133,538,085
(F) 追加信託差損益金	1,331,887,724
(配当等相当額)	( 1,533,549,167)
(売買損益相当額)	(△ 201,661,443)
(G) 計(D+E+F)	1,092,696,850
(H) 収益分配金	△ 7,257,559
次期繰越損益金(G+H)	1,085,439,291
追加信託差損益金	1,331,887,724
(配当等相当額)	( 1,533,931,439)
(売買損益相当額)	(△ 202,043,715)
分配準備積立金	420,554,210
繰越損益金	△ 667,002,643

(注) 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) 損益の状況の中で(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) 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) 分配金の計算過程（2021年10月27日～2022年10月26日）は以下の通りです。

項 目	2021年10月27日～ 2022年10月26日
a. 配当等収益(経費控除後)	27,234,401円
b. 有価証券売買等損益(経費控除後・繰越欠損金補填後)	0円
c. 信託約款に定める収益調整金	1,533,931,439円
d. 信託約款に定める分配準備積立金	400,577,368円
e. 分配対象収益(a+b+c+d)	1,961,743,208円
f. 分配対象収益(1万口当たり)	2,703円
g. 分配金	7,257,559円
h. 分配金(1万口当たり)	10円

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

## ○分配金のお知らせ

---

1 万口当たり分配金（税込み）	10円
-----------------	-----

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。

当ファンドの主要投資対象先の直近の運用状況について、法令および諸規則に基づき、次ページ以降にご報告申し上げます。

# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書

第24期（決算日 2022年10月26日）  
（2021年10月27日～2022年10月26日）

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	1998年10月30日から原則無期限です。
運用方針	わが国の債券市場の動きをとらえることを目標に、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないます。
主要運用対象	わが国の公社債を主要投資対象とします。
組入制限	外貨建資産への投資は行ないません。

## ファンド概要

主としてわが国の公社債に投資し、「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ないます。運用の効率化をはかるため、債券先物取引などを活用することがあります。このため、債券の組入総額と債券先物取引などの買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。ただし、資金動向、市況動向の急激な変化が生じたときなどならびに信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。

## 【運用報告書の表記について】

・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI総合			債組入比率	純資産額
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	率		
20期(2018年10月26日)	13,870	0.2	546.64	0.2	99.6	38,466	
21期(2019年10月28日)	14,315	3.2	564.07	3.2	99.4	41,390	
22期(2020年10月26日)	14,128	△1.3	556.49	△1.3	99.4	43,807	
23期(2021年10月26日)	14,100	△0.2	555.54	△0.2	99.6	48,618	
24期(2022年10月26日)	13,539	△4.0	532.71	△4.1	99.8	47,577	

(注) NOMURA-BPI総合は、野村證券株式会社が公表している、わが国の債券市場の動きを示す投資収益指数で、一定の組み入れ基準に基づいて構成された債券ポートフォリオのパフォーマンスをもとに算出されます。国債、地方債、政府保証債、金融債、事業債、円建外債、MBS、ABSなど、国内で発行された円建公募利付債で構成されています。対象となる債券は残存期間1年以上、残存額面10億円以上で、事業債、円建外債、MBS、ABSについては、A格相当以上の格付を取得しているものに限られます。

## ○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			債組入比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	率	
(期首) 2021年10月26日	14,100	—	555.54	—	99.6	
10月末	14,120	0.1	556.34	0.1	99.7	
11月末	14,154	0.4	557.68	0.4	99.6	
12月末	14,123	0.2	556.51	0.2	99.8	
2022年1月末	14,026	△0.5	552.50	△0.5	99.8	
2月末	13,957	△1.0	549.73	△1.0	99.7	
3月末	13,918	△1.3	548.16	△1.3	99.9	
4月末	13,885	△1.5	546.84	△1.6	99.8	
5月末	13,866	△1.7	546.00	△1.7	99.7	
6月末	13,742	△2.5	541.03	△2.6	99.8	
7月末	13,835	△1.9	544.59	△2.0	99.7	
8月末	13,804	△2.1	543.32	△2.2	99.7	
9月末	13,661	△3.1	537.46	△3.3	99.8	
(期末) 2022年10月26日	13,539	△4.0	532.71	△4.1	99.8	

(注) 騰落率は期首比です。

## ○運用経過

(2021年10月27日～2022年10月26日)

## 基準価額の推移

期間の初め14,100円の基準価額は、期間末に13,539円となり、騰落率は△4.0%となりました。

## 基準価額の変動要因

期間中、基準価額に影響した主な要因は以下の通りです。

## &lt;値上がり要因&gt;

- ・南アフリカで確認された新型コロナウイルスの新たな変異株の感染拡大に対する懸念や、ロシア軍のウクライナ侵攻を受けた地政学的リスクへの警戒感などから、投資家のリスク回避姿勢が強まったこと。
- ・日銀が指値オペを継続し長期金利の上昇を抑制したこと。

## &lt;値下がり要因&gt;

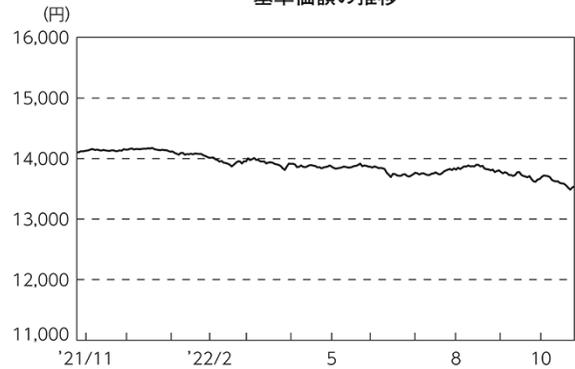
- ・ウクライナ情勢を巡り供給混乱を受けた世界的なインフレ高進が懸念され金利先高観が強まったこと。
- ・中国の上海市がロックダウン（都市封鎖）を解除する方針を示し、経済正常化への期待から投資家のリスク回避姿勢が後退したこと。
- ・欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたこと。

## (国内債券市況)

国内債券市場では、10年国債利回りは、期間の初めと比べて上昇（債券価格は下落）しました。

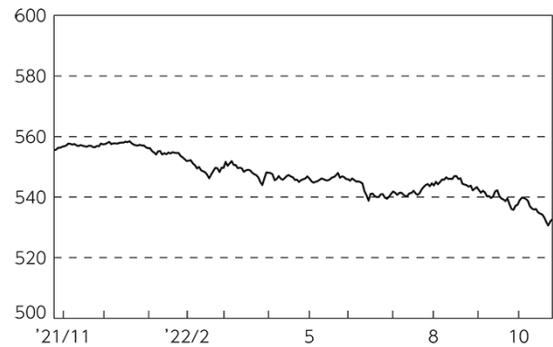
南アフリカにおいて新型コロナウイルスの新たな変異株が確認され投資家のリスク回避姿勢が強まったことや、ロシア軍のウクライナ侵攻を受けた地政学的リスクへの警戒感が高まったこと、日銀が指値オペを継続し長期金利の上昇を抑制したことなどから利回りが低下（債券価格は上昇）する局面があったものの、ウクライナ情勢を巡り、世界的なインフレ高進が懸念され金利先高観が強まったことや、中国の上海市がロックダウンを解除する方針を示し、経済正常化への期待から投資家のリスク回避姿勢が後退したこと、欧米の主要中央銀行による金融引き締め加速の動きが警戒されたことなどから、10年国債利回りは上昇しました。

基準価額の推移



期 首	期中高値	期中安値	期 末
2021/10/26	2021/12/20	2022/10/24	2022/10/26
14,100円	14,174円	13,488円	13,539円

NOMURA - BPI総合の推移



## ポートフォリオ

債券のリスクコントロールモデルを利用して国債、政府保証債、地方債、金融債、電力債、事業債などによりポートフォリオを構築し、「NOMURA-BPI総合」に連動する投資成果をめざして運用を行ないました。また、「NOMURA-BPI総合」採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しを行ない、債券組入比率を高位に維持しました。

## 当ファンドのベンチマークとの差異

期間中における基準価額は、4.0%の値下がりとなり、ベンチマークである「NOMURA-BPI総合」の下落率4.1%を概ね0.1%上回りました。

ベンチマークとの差異における主な要因は以下の通りです。

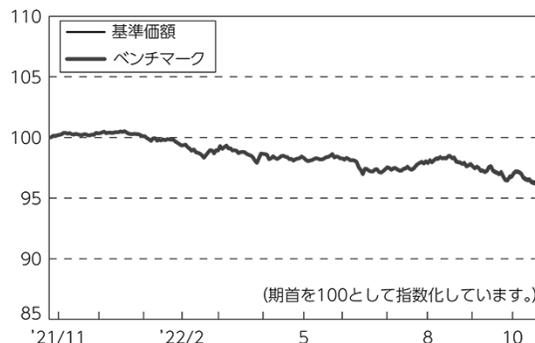
### <プラス要因>

- ・金利効果。
- ・債券種別効果。
- ・売買要因。

### <マイナス要因>

- ・個別銘柄効果。

基準価額とベンチマーク（指数化）の推移



## ○今後の運用方針

引き続き、原則として債券のリスクコントロールモデルを利用してポートフォリオを構築し、ポートフォリオの金利感応度や残存期間別構成比率などを「NOMURA-BPI総合」と同程度に保つことで連動性を高めるよう努めます。また、ベンチマークの採用銘柄の入替などに対応するために、毎月ポートフォリオの見直しなどを行ない、債券組入比率を高位に維持する方針です。

将来の市場環境の変動などにより、当該運用方針が変更される場合があります。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

## ○売買及び取引の状況

(2021年10月27日～2022年10月26日)

公社債
-----

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	7,662,675	2,290,132
	地方債証券	703,018	1,915,396 ( 10,000)
内	特殊債券	1,113,373	2,845,698
	社債券(投資法人債券を含む)	—	1,009,130

(注) 金額は受け渡し代金。(経過利子分は含まれておりません。)

(注) ( )内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

## ○利害関係人との取引状況等

(2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。

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。
---

## ○第一種金融商品取引業、第二種金融商品取引業又は商品取引受託業務を兼業している委託会社の自己取引状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

該当事項はございません。また委託会社に売買委託手数料は支払われておりません。

## ○組入資産の明細

(2022年10月26日現在)

## 国内公社債

## (A) 国内(邦貨建)公社債 種類別開示

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	39,154,000	39,782,689	83.6	—	62.0	18.9	2.7
	(16,129,000)	(16,207,969)	(34.1)	(—)	(22.4)	(10.0)	(1.7)
地方債証券	3,530,000	3,556,850	7.5	—	0.2	5.8	1.5
	(3,530,000)	(3,556,850)	(7.5)	(—)	(0.2)	(5.8)	(1.5)
特殊債券 (除く金融債)	3,300,000	3,329,171	7.0	—	1.1	4.2	1.7
	(3,300,000)	(3,329,171)	(7.0)	(—)	(1.1)	(4.2)	(1.7)
金融債券	200,000	199,448	0.4	—	—	0.2	0.2
	(200,000)	(199,448)	(0.4)	(—)	(—)	(0.2)	(0.2)
普通社債券 (含む投資法人債券)	600,000	603,631	1.3	—	—	0.4	0.8
	(600,000)	(603,631)	(1.3)	(—)	(—)	(0.4)	(0.8)
合 計	46,784,000 (23,759,000)	47,471,790 (23,897,070)	99.8 (50.2)	— (—)	63.3 (23.6)	29.5 (20.6)	7.0 (6.0)

(注) ( )内は非上場債で内書きです。

(注) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 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。

## (B) 国内(邦貨建)公社債 銘柄別開示

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
国債証券	%	千円	千円		国債証券	%	千円	千円	
第153回利付国債 (5年)	0.005	300,000	299,025	2027/6/20	第366回利付国債 (10年)	0.2	400,000	400,000	2032/3/20
第1回利付国債 (40年)	2.4	70,000	84,619	2048/3/20	第367回利付国債 (10年)	0.2	350,000	348,512	2032/6/20
第2回利付国債 (40年)	2.2	125,000	145,111	2049/3/20	第1回利付国債 (30年)	2.8	50,000	58,866	2029/9/20
第3回利付国債 (40年)	2.2	85,000	98,855	2050/3/20	第3回利付国債 (30年)	2.3	70,000	80,649	2030/5/20
第4回利付国債 (40年)	2.2	95,000	110,441	2051/3/20	第5回利付国債 (30年)	2.2	80,000	92,842	2031/5/20
第5回利付国債 (40年)	2.0	75,000	83,847	2052/3/20	第6回利付国債 (30年)	2.4	50,000	59,345	2031/11/20
第6回利付国債 (40年)	1.9	110,000	119,810	2053/3/20	第8回利付国債 (30年)	1.8	80,000	91,107	2032/11/22
第7回利付国債 (40年)	1.7	80,000	83,236	2054/3/20	第14回利付国債 (30年)	2.4	108,000	130,120	2034/3/20
第8回利付国債 (40年)	1.4	95,000	91,531	2055/3/20	第15回利付国債 (30年)	2.5	147,000	178,962	2034/6/20
第9回利付国債 (40年)	0.4	130,000	91,278	2056/3/20	第16回利付国債 (30年)	2.5	35,000	42,645	2034/9/20
第10回利付国債 (40年)	0.9	125,000	103,520	2057/3/20	第17回利付国債 (30年)	2.4	50,000	60,429	2034/12/20
第11回利付国債 (40年)	0.8	140,000	111,539	2058/3/20	第18回利付国債 (30年)	2.3	110,000	131,649	2035/3/20
第12回利付国債 (40年)	0.5	175,000	124,153	2059/3/20	第19回利付国債 (30年)	2.3	40,000	47,936	2035/6/20
第13回利付国債 (40年)	0.5	180,000	126,707	2060/3/20	第20回利付国債 (30年)	2.5	40,000	48,952	2035/9/20
第14回利付国債 (40年)	0.7	150,000	112,666	2061/3/20	第21回利付国債 (30年)	2.3	70,000	84,040	2035/12/20
第15回利付国債 (40年)	1.0	140,000	115,112	2062/3/20	第22回利付国債 (30年)	2.5	70,000	85,850	2036/3/20
第333回利付国債 (10年)	0.6	210,000	211,934	2024/3/20	第23回利付国債 (30年)	2.5	55,000	67,499	2036/6/20
第334回利付国債 (10年)	0.6	120,000	121,274	2024/6/20	第24回利付国債 (30年)	2.5	68,000	83,503	2036/9/20
第335回利付国債 (10年)	0.5	490,000	494,929	2024/9/20	第25回利付国債 (30年)	2.3	60,000	72,126	2036/12/20
第336回利付国債 (10年)	0.5	180,000	182,030	2024/12/20	第26回利付国債 (30年)	2.4	170,000	206,575	2037/3/20
第337回利付国債 (10年)	0.3	230,000	231,605	2024/12/20	第27回利付国債 (30年)	2.5	89,000	109,358	2037/9/20
第338回利付国債 (10年)	0.4	390,000	393,970	2025/3/20	第28回利付国債 (30年)	2.5	144,000	176,945	2038/3/20
第339回利付国債 (10年)	0.4	570,000	576,338	2025/6/20	第29回利付国債 (30年)	2.4	176,000	213,609	2038/9/20
第340回利付国債 (10年)	0.4	620,000	627,551	2025/9/20	第30回利付国債 (30年)	2.3	147,000	176,023	2039/3/20
第341回利付国債 (10年)	0.3	700,000	706,944	2025/12/20	第31回利付国債 (30年)	2.2	120,000	141,634	2039/9/20
第342回利付国債 (10年)	0.1	530,000	531,976	2026/3/20	第32回利付国債 (30年)	2.3	160,000	191,243	2040/3/20
第343回利付国債 (10年)	0.1	545,000	546,885	2026/6/20	第33回利付国債 (30年)	2.0	135,000	154,672	2040/9/20
第344回利付国債 (10年)	0.1	500,000	501,460	2026/9/20	第34回利付国債 (30年)	2.2	180,000	212,076	2041/3/20
第345回利付国債 (10年)	0.1	610,000	611,384	2026/12/20	第35回利付国債 (30年)	2.0	128,000	146,712	2041/9/20
第346回利付国債 (10年)	0.1	690,000	691,207	2027/3/20	第36回利付国債 (30年)	2.0	135,000	154,668	2042/3/20
第347回利付国債 (10年)	0.1	580,000	580,800	2027/6/20	第37回利付国債 (30年)	1.9	161,000	181,434	2042/9/20
第348回利付国債 (10年)	0.1	500,000	500,240	2027/9/20	第38回利付国債 (30年)	1.8	135,000	149,494	2043/3/20
第349回利付国債 (10年)	0.1	640,000	639,667	2027/12/20	第39回利付国債 (30年)	1.9	115,000	129,281	2043/6/20
第350回利付国債 (10年)	0.1	640,000	638,969	2028/3/20	第40回利付国債 (30年)	1.8	130,000	143,631	2043/9/20
第351回利付国債 (10年)	0.1	535,000	533,646	2028/6/20	第41回利付国債 (30年)	1.7	160,000	173,640	2043/12/20
第352回利付国債 (10年)	0.1	590,000	587,929	2028/9/20	第42回利付国債 (30年)	1.7	135,000	146,365	2044/3/20
第353回利付国債 (10年)	0.1	400,000	398,172	2028/12/20	第43回利付国債 (30年)	1.7	155,000	167,883	2044/6/20
第354回利付国債 (10年)	0.1	325,000	323,251	2029/3/20	第44回利付国債 (30年)	1.7	150,000	162,301	2044/9/20
第355回利付国債 (10年)	0.1	350,000	347,816	2029/6/20	第45回利付国債 (30年)	1.5	120,000	124,986	2044/12/20
第356回利付国債 (10年)	0.1	350,000	347,378	2029/9/20	第46回利付国債 (30年)	1.5	120,000	124,812	2045/3/20
第357回利付国債 (10年)	0.1	560,000	555,072	2029/12/20	第47回利付国債 (30年)	1.6	125,000	132,255	2045/6/20
第358回利付国債 (10年)	0.1	600,000	593,460	2030/3/20	第48回利付国債 (30年)	1.4	85,000	86,422	2045/9/20
第359回利付国債 (10年)	0.1	420,000	414,493	2030/6/20	第49回利付国債 (30年)	1.4	140,000	142,111	2045/12/20
第360回利付国債 (10年)	0.1	580,000	571,485	2030/9/20	第50回利付国債 (30年)	0.8	95,000	84,805	2046/3/20
第361回利付国債 (10年)	0.1	270,000	265,809	2030/12/20	第51回利付国債 (30年)	0.3	90,000	70,962	2046/6/20
第362回利付国債 (10年)	0.1	400,000	393,448	2031/3/20	第52回利付国債 (30年)	0.5	130,000	107,318	2046/9/20
第363回利付国債 (10年)	0.1	300,000	294,816	2031/6/20	第53回利付国債 (30年)	0.6	105,000	88,482	2046/12/20
第364回利付国債 (10年)	0.1	300,000	294,543	2031/9/20	第54回利付国債 (30年)	0.8	110,000	96,852	2047/3/20
第365回利付国債 (10年)	0.1	300,000	295,050	2031/12/20	第55回利付国債 (30年)	0.8	110,000	96,578	2047/6/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円		<b>国債証券</b>	%	千円	千円	
第56回利付国債 (30年)	0.8	90,000	78,721	2047/9/20	第105回利付国債 (20年)	2.1	77,000	85,778	2028/9/20
第57回利付国債 (30年)	0.8	100,000	87,138	2047/12/20	第106回利付国債 (20年)	2.2	2,000	2,239	2028/9/20
第58回利付国債 (30年)	0.8	100,000	86,808	2048/3/20	第107回利付国債 (20年)	2.1	130,000	145,308	2028/12/20
第59回利付国債 (30年)	0.7	170,000	143,481	2048/6/20	第108回利付国債 (20年)	1.9	134,000	148,149	2028/12/20
第60回利付国債 (30年)	0.9	120,000	105,976	2048/9/20	第109回利付国債 (20年)	1.9	27,000	29,945	2029/3/20
第61回利付国債 (30年)	0.7	100,000	83,639	2048/12/20	第110回利付国債 (20年)	2.1	98,000	109,929	2029/3/20
第62回利付国債 (30年)	0.5	120,000	94,712	2049/3/20	第111回利付国債 (20年)	2.2	25,000	28,307	2029/6/20
第63回利付国債 (30年)	0.4	90,000	68,795	2049/6/20	第112回利付国債 (20年)	2.1	80,000	90,058	2029/6/20
第64回利付国債 (30年)	0.4	100,000	76,215	2049/9/20	第113回利付国債 (20年)	2.1	290,000	327,494	2029/9/20
第65回利付国債 (30年)	0.4	110,000	83,826	2049/12/20	第114回利付国債 (20年)	2.1	52,000	58,920	2029/12/20
第66回利付国債 (30年)	0.4	180,000	136,902	2050/3/20	第115回利付国債 (20年)	2.2	125,000	142,517	2029/12/20
第67回利付国債 (30年)	0.6	110,000	87,820	2050/6/20	第116回利付国債 (20年)	2.2	135,000	154,280	2030/3/20
第68回利付国債 (30年)	0.6	140,000	111,595	2050/9/20	第117回利付国債 (20年)	2.1	343,000	389,493	2030/3/20
第69回利付国債 (30年)	0.7	110,000	89,999	2050/12/20	第118回利付国債 (20年)	2.0	10,000	11,304	2030/6/20
第70回利付国債 (30年)	0.7	110,000	89,794	2051/3/20	第119回利付国債 (20年)	1.8	30,000	33,463	2030/6/20
第71回利付国債 (30年)	0.7	120,000	97,729	2051/6/20	第120回利付国債 (20年)	1.6	170,000	187,078	2030/6/20
第72回利付国債 (30年)	0.7	160,000	130,128	2051/9/20	第121回利付国債 (20年)	1.9	22,000	24,763	2030/9/20
第73回利付国債 (30年)	0.7	120,000	97,562	2051/12/20	第122回利付国債 (20年)	1.8	17,000	19,004	2030/9/20
第74回利付国債 (30年)	1.0	130,000	114,519	2052/3/20	第123回利付国債 (20年)	2.1	195,000	223,360	2030/12/20
第75回利付国債 (30年)	1.3	90,000	85,428	2052/6/20	第124回利付国債 (20年)	2.0	90,000	102,372	2030/12/20
第65回利付国債 (20年)	1.9	100,000	102,286	2023/12/20	第125回利付国債 (20年)	2.2	50,000	57,873	2031/3/20
第66回利付国債 (20年)	1.8	34,000	34,738	2023/12/20	第126回利付国債 (20年)	2.0	105,000	119,811	2031/3/20
第67回利付国債 (20年)	1.9	34,000	34,929	2024/3/20	第127回利付国債 (20年)	1.9	50,000	56,643	2031/3/20
第68回利付国債 (20年)	2.2	78,000	80,460	2024/3/20	第128回利付国債 (20年)	1.9	65,000	73,858	2031/6/20
第70回利付国債 (20年)	2.4	104,000	108,189	2024/6/20	第129回利付国債 (20年)	1.8	85,000	95,866	2031/6/20
第72回利付国債 (20年)	2.1	112,000	116,531	2024/9/20	第130回利付国債 (20年)	1.8	150,000	169,647	2031/9/20
第73回利付国債 (20年)	2.0	113,000	117,916	2024/12/20	第131回利付国債 (20年)	1.7	92,000	103,252	2031/9/20
第74回利付国債 (20年)	2.1	118,000	123,387	2024/12/20	第132回利付国債 (20年)	1.7	135,000	151,895	2031/12/20
第75回利付国債 (20年)	2.1	10,000	10,509	2025/3/20	第133回利付国債 (20年)	1.8	30,000	34,021	2031/12/20
第76回利付国債 (20年)	1.9	21,000	21,968	2025/3/20	第134回利付国債 (20年)	1.8	120,000	136,321	2032/3/20
第77回利付国債 (20年)	2.0	40,000	41,940	2025/3/20	第135回利付国債 (20年)	1.7	30,000	33,806	2032/3/20
第79回利付国債 (20年)	2.0	160,000	168,579	2025/6/20	第136回利付国債 (20年)	1.6	220,000	245,905	2032/3/20
第82回利付国債 (20年)	2.1	60,000	63,688	2025/9/20	第137回利付国債 (20年)	1.7	200,000	225,720	2032/6/20
第87回利付国債 (20年)	2.2	130,000	139,755	2026/3/20	第138回利付国債 (20年)	1.5	120,000	133,188	2032/6/20
第88回利付国債 (20年)	2.3	300,000	325,101	2026/6/20	第139回利付国債 (20年)	1.6	230,000	257,427	2032/6/20
第90回利付国債 (20年)	2.2	16,000	17,355	2026/9/20	第140回利付国債 (20年)	1.7	358,000	404,235	2032/9/20
第91回利付国債 (20年)	2.3	250,000	272,150	2026/9/20	第141回利付国債 (20年)	1.7	195,000	220,149	2032/12/20
第92回利付国債 (20年)	2.1	60,000	65,104	2026/12/20	第142回利付国債 (20年)	1.8	125,000	142,343	2032/12/20
第93回利付国債 (20年)	2.0	60,000	65,101	2027/3/20	第143回利付国債 (20年)	1.6	94,000	105,151	2033/3/20
第94回利付国債 (20年)	2.1	50,000	54,470	2027/3/20	第144回利付国債 (20年)	1.5	370,000	410,204	2033/3/20
第95回利付国債 (20年)	2.3	82,000	90,468	2027/6/20	第145回利付国債 (20年)	1.7	315,000	355,543	2033/6/20
第96回利付国債 (20年)	2.1	248,000	271,314	2027/6/20	第146回利付国債 (20年)	1.7	135,000	152,373	2033/9/20
第97回利付国債 (20年)	2.2	45,000	49,642	2027/9/20	第147回利付国債 (20年)	1.6	98,000	109,498	2033/12/20
第98回利付国債 (20年)	2.1	94,000	103,239	2027/9/20	第148回利付国債 (20年)	1.5	90,000	99,487	2034/3/20
第99回利付国債 (20年)	2.1	117,000	128,950	2027/12/20	第149回利付国債 (20年)	1.5	115,000	127,026	2034/6/20
第100回利付国債 (20年)	2.2	30,000	33,335	2028/3/20	第150回利付国債 (20年)	1.4	140,000	152,947	2034/9/20
第101回利付国債 (20年)	2.4	66,000	74,045	2028/3/20	第151回利付国債 (20年)	1.2	140,000	149,510	2034/12/20
第102回利付国債 (20年)	2.4	81,000	91,255	2028/6/20	第152回利付国債 (20年)	1.2	300,000	319,842	2035/3/20
第103回利付国債 (20年)	2.3	11,000	12,331	2028/6/20	第153回利付国債 (20年)	1.3	270,000	290,846	2035/6/20
第104回利付国債 (20年)	2.1	33,000	36,623	2028/6/20	第154回利付国債 (20年)	1.2	160,000	170,168	2035/9/20

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
<b>国債証券</b>	%	千円	千円		<b>地方債証券</b>	%	千円	千円	
第155回利付国債 (20年)	1.0	270,000	280,087	2035/12/20	第147回共同発行市場公募地方債	0.548	100,000	101,232	2025/6/25
第156回利付国債 (20年)	0.4	160,000	153,369	2036/3/20	第165回共同発行市場公募地方債	0.145	200,000	199,916	2026/12/25
第157回利付国債 (20年)	0.2	150,000	139,354	2036/6/20	平成28年度第1回長崎県公募公債	0.105	100,000	99,863	2026/9/30
第158回利付国債 (20年)	0.5	170,000	164,031	2036/9/20	平成27年度第1回佐賀県公募公債	0.476	100,000	101,190	2025/11/28
第159回利付国債 (20年)	0.6	150,000	146,187	2036/12/20	平成29年度第1回滋賀県公募公債	0.19	100,000	99,849	2027/11/30
第160回利付国債 (20年)	0.7	140,000	137,837	2037/3/20	平成27年度第2回熊本県公募公債 (10年)	0.476	100,000	101,160	2025/10/30
第161回利付国債 (20年)	0.6	120,000	116,091	2037/6/20	第2回名古屋市定時償還公募公債 (10年)	0.275	30,000	30,073	2025/7/17
第162回利付国債 (20年)	0.6	150,000	144,562	2037/9/20	平成27年度第5回札幌市公募公債 (10年)	0.47	100,000	101,086	2025/9/19
第163回利付国債 (20年)	0.6	165,000	158,400	2037/12/20	令和元年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.001	100,000	99,830	2024/10/31
第164回利付国債 (20年)	0.5	255,000	240,232	2038/3/20	令和2年度第1回鹿児島県公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,776	2025/10/30
第165回利付国債 (20年)	0.5	170,000	159,470	2038/6/20	<b>小 計</b>		3,530,000	3,556,850	
第166回利付国債 (20年)	0.7	150,000	144,520	2038/9/20	<b>特殊債券 (除く金融債)</b>				
第167回利付国債 (20年)	0.5	160,000	148,772	2038/12/20	第28回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	109,308	2027/2/26
第168回利付国債 (20年)	0.4	100,000	91,035	2039/3/20	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	2.3	100,000	110,517	2027/10/29
第169回利付国債 (20年)	0.3	160,000	142,491	2039/6/20	第220回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.644	100,000	101,000	2024/6/28
第170回利付国債 (20年)	0.3	140,000	124,040	2039/9/20	第288回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.386	100,000	100,967	2025/10/31
第171回利付国債 (20年)	0.3	170,000	149,946	2039/12/20	第273回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.02	100,000	99,805	2026/4/30
第172回利付国債 (20年)	0.4	230,000	205,590	2040/3/20	第324回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.09	200,000	199,170	2027/9/30
第173回利付国債 (20年)	0.4	150,000	133,495	2040/6/20	第351回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.145	100,000	99,547	2028/6/30
第174回利付国債 (20年)	0.4	200,000	177,340	2040/9/20	第22回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.693	100,000	100,804	2023/12/18
第175回利付国債 (20年)	0.5	140,000	125,958	2040/12/20	第35回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.01	200,000	199,264	2026/9/14
第176回利付国債 (20年)	0.5	160,000	143,446	2041/3/20	第60回政府保証株式会社日本政策投資銀行社債	0.001	100,000	99,432	2027/1/29
第177回利付国債 (20年)	0.4	150,000	131,614	2041/6/20	第69回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.414	200,000	201,672	2025/2/17
第178回利付国債 (20年)	0.5	120,000	106,976	2041/9/20	第77回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.386	100,000	100,968	2025/10/15
第179回利付国債 (20年)	0.5	190,000	168,896	2041/12/20	第96回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.11	200,000	199,622	2027/5/21
第180回利付国債 (20年)	0.8	190,000	178,182	2042/3/20	第97回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.13	100,000	99,906	2027/6/14
第181回利付国債 (20年)	0.9	190,000	181,081	2042/6/20	第105回政府保証地方公共団体金融機構債券	0.195	200,000	199,948	2028/2/15
<b>小 計</b>		39,154,000	39,782,689		第52回政府保証日本政策金融公庫債券	0.13	100,000	99,459	2028/7/19
<b>地方債証券</b>					第5回政府保証新聞関西国際空港債券	0.145	100,000	100,002	2027/3/30
第4回東京都公募公債 (東京グリーンボンド (5年))	0.02	100,000	99,786	2025/9/19	第13回関西国際空港株式会社社債 (一般担保付)	0.506	200,000	201,310	2024/12/20
第6回東京都公募公債 (20年)	2.0	100,000	104,588	2025/3/19	第123回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.69	100,000	100,837	2024/3/19
第32回東京都公募公債 (5年)	0.02	300,000	299,451	2025/6/20	第125回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.665	200,000	201,604	2024/3/19
第726回東京都公募公債	0.73	100,000	100,805	2023/12/20	第134回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.529	100,000	100,698	2024/6/20
第730回東京都公募公債	0.664	100,000	100,856	2024/3/19	第139回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.5	100,000	100,728	2024/9/20
第779回東京都公募公債	0.29	100,000	100,429	2024/12/20	第144回日本高速道路保有・債務返済機構債券	0.476	100,000	100,752	2024/12/20
第744回東京都公募公債	0.577	100,000	101,303	2025/6/20	第39回独立行政法人福祉医療機構債券	0.674	100,000	100,936	2024/6/20
令和2年度第2回北海道公募公債 (5年)	0.02	100,000	99,808	2025/5/29	第29回国際協力機構債券	0.583	100,000	101,225	2025/6/20
令和3年度第6回北海道公募公債 (5年)	0.005	100,000	99,514	2026/7/30	第37回国際協力機構債券	0.1	100,000	99,690	2026/9/18
第214回神奈川県公募公債	0.563	100,000	101,266	2025/6/20	<b>小 計</b>		3,300,000	3,329,171	
平成25年度第10回静岡県公募公債	0.669	100,000	100,869	2024/3/26	<b>金融債券</b>				
平成27年度第10回静岡県公募公債	0.461	200,000	202,120	2025/9/19	第357回信中金債 (5年)	0.02	100,000	99,778	2024/8/27
平成26年度第3回埼玉県公募公債	0.67	100,000	100,943	2024/5/20	第363回信中金債 (5年)	0.01	100,000	99,670	2025/2/27
平成22年度第1回福岡県公募公債 (15年)	1.67	100,000	104,823	2025/11/21	<b>小 計</b>		200,000	199,448	
平成26年度第2回新潟県公募公債	0.429	100,000	100,812	2025/2/27	<b>普通社債券 (含む投資法人債券)</b>				
第10回群馬県公募公債 (10年)	0.67	100,000	100,696	2023/11/24	第131回成田国際空港株式会社社債 (一般担保付)	0.739	100,000	100,823	2024/2/20
平成26年度第1回岐阜県公募公債 (10年)	0.554	100,000	100,901	2024/9/30	第55回西日本高速道路株式会社社債 (一般担保付、独立行政法人日本高速道路保有・債務返済機構基金の債権引当受弁)	0.524	100,000	100,780	2024/12/20
第133回共同発行市場公募地方債	0.689	100,000	100,943	2024/4/25	第11回株式会社セブン銀行無担保社債 (社債額定額に順応し発行)	0.536	100,000	100,639	2024/12/20
第140回共同発行市場公募地方債	0.505	100,000	100,872	2024/11/25	第8回三菱UFJ銀行無担保社債 (社債額定額に順応し発行)	0.757	100,000	100,727	2024/1/30
第142回共同発行市場公募地方債	0.345	200,000	201,152	2025/1/24					
第144回共同発行市場公募地方債	0.47	100,000	100,938	2025/3/25					

銘柄	当 期 末				銘柄	当 期 末			
	利率	額面金額	評 価 額	償還年月日		利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円		普通社債券(含む投資法人債券)	%	千円	千円	
第0回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特付)	0.803	100,000	100,748	2023/12/20	第0回KDDI株式会社無担保社債(社債間限定同順位特付)	0.13	100,000	99,914	2024/4/26
					小 計		600,000	603,631	
					合 計		46,784,000	47,471,790	

## ○投資信託財産の構成

(2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 47,471,790	% 99.7
コール・ローン等、その他	120,490	0.3
投資信託財産総額	47,592,280	100.0

(注) 比率は、投資信託財産総額に対する割合です。

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年10月26日現在)

項 目	当 期 末	円
(A) 資産	47,592,280,774	
コール・ローン等	38,142,474	
公社債(評価額)	47,471,790,020	
未収利息	81,611,164	
前払費用	737,116	
(B) 負債	14,845,618	
未払解約金	14,845,556	
未払利息	62	
(C) 純資産総額(A-B)	47,577,435,156	
元本	35,139,813,158	
次期繰越損益金	12,437,621,998	
(D) 受益権総口数	35,139,813,158口	
1万口当たり基準価額(C/D)	13,539円	

(注) 当ファンドの期首元本額は34,479,945,047円、期中追加設定元本額は4,247,701,412円、期中一部解約元本額は3,587,833,301円です。

(注) 2022年10月26日現在の元本の内訳は以下の通りです。

・インデックスファンド日本債券(1年決算型)	6,161,581,877円
・DCインデックスバランス(株式20)	4,815,944,655円
・世界の財産3分法ファンド(不動産・債券・株式)毎月分配型	4,488,925,161円
・DCインデックスバランス(株式40)	4,446,314,480円
・国際分散型ファンド40(適格機関投資家向け)	3,381,046,243円
・DCインデックスバランス(株式60)	3,280,760,207円
・インデックスファンド日本債券(DC専用)	2,209,280,459円
・インデックス・アセットバランス・オープン(適格機関投資家向け)	1,615,057,133円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式20)	1,480,910,178円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式40)	1,423,718,543円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式60)	807,219,661円
・DCインデックスバランス(株式80)	537,618,854円
・日本債券インデックスファンド(個人型年金向け)	372,392,108円
・年金積立アセット・ナビゲーション・ファンド(株式80)	119,043,599円

(注) 1口当たり純資産額は1.3539円です。

上記各資産の評価基準及び評価方法、また収益及び費用の計上区分等については、法律及び諸規則に基づき、一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して評価計上処理しています。

## ○損益の状況 (2021年10月27日～2022年10月26日)

項 目	当 期	円
(A) 配当等収益	403,967,654	
受取利息	403,990,521	
支払利息	△ 22,867	
(B) 有価証券売買損益	△ 2,364,035,883	
売買益	1,877,927	
売買損	△ 2,365,913,810	
(C) 当期損益金(A+B)	△ 1,960,068,229	
(D) 前期繰越損益金	14,138,082,141	
(E) 追加信託差損益金	1,646,564,078	
(F) 解約差損益金	△ 1,386,955,992	
(G) 計(C+D+E+F)	12,437,621,998	
次期繰越損益金(G)	12,437,621,998	

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

## ○お知らせ

---

### 約款変更について

2021年10月27日から2022年10月26日までの期間に実施いたしました約款変更はございません。