

運用報告書 (全体版)

第13期<決算日2022年11月10日>

日本債券ファンド

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	2010年2月16日から2024年11月11日までです。	
運用方針	NOMURA-BPI総合の動き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	日本債券ファンド	新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券。
	新光日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債。
運用方法	主として新光日本債券インデックスマザーファンド受益証券に投資し、NOMURA-BPI総合の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。公社債の実質組入比率については、原則として高位を保ちます。	
組入制限	日本債券ファンドの新光日本債券インデックスマザーファンド組入上限比率	制限を設けません。
	新光日本債券インデックスマザーファンド	株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権の行使により取得したものに限り、投資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行いません。
分配方針	分配対象額の範囲は、繰越分を含めた経費控除後の利子・配当収益と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案し、決定します。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があります。留保益の運用については、特に制限を設けず、運用の基本方針に基づいた運用を行います。	

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、「日本債券ファンド」は、2022年11月10日に第13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

<http://www.am-one.co.jp/>

日本債券ファンド

■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	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	騰落 中率	(ベンチマーク)	騰落 中率			
9期(2018年11月12日)	円 10,629	円 70	% △0.5	ポイント 379.669	% △0.2	% 99.2	% -	百万円 4,593
10期(2019年11月11日)	10,795	50	2.0	390.121	2.8	99.2	-	6,319
11期(2020年11月10日)	10,622	50	△1.1	386.816	△0.8	99.5	-	6,783
12期(2021年11月10日)	10,563	40	△0.2	387.538	0.2	99.6	-	6,619
13期(2022年11月10日)	10,084	30	△4.3	372.013	△4.0	99.4	-	5,432

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

(注4) NOMURA-BPI総合の知的財産権その他一切の権利は野村證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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5) △(白三角)はマイナスを意味しています（以下同じ）。

■当期中の基準価額と市況の推移

年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債券組入 比率	債券先物 比率
	騰落 率	騰落 率	(ベンチマーク)	騰落 率		
(期首) 2021年11月10日	円 10,563	% -	ポイント 387.538	% -	% 99.6	% -
11月末	10,566	0.0	387.655	0.0	99.4	-
12月末	10,539	△0.2	386.841	△0.2	99.6	-
2022年1月末	10,462	△1.0	384.056	△0.9	99.6	-
2月末	10,408	△1.5	382.128	△1.4	99.2	-
3月末	10,377	△1.8	381.037	△1.7	99.5	-
4月末	10,349	△2.0	380.119	△1.9	99.7	-
5月末	10,331	△2.2	379.538	△2.1	99.3	-
6月末	10,234	△3.1	376.081	△3.0	99.7	-
7月末	10,298	△2.5	378.553	△2.3	99.3	-
8月末	10,272	△2.8	377.670	△2.5	99.3	-
9月末	10,161	△3.8	373.602	△3.6	99.5	-
10月末	10,148	△3.9	373.249	△3.7	99.5	-
(期末) 2022年11月10日	10,114	△4.3	372.013	△4.0	99.4	-

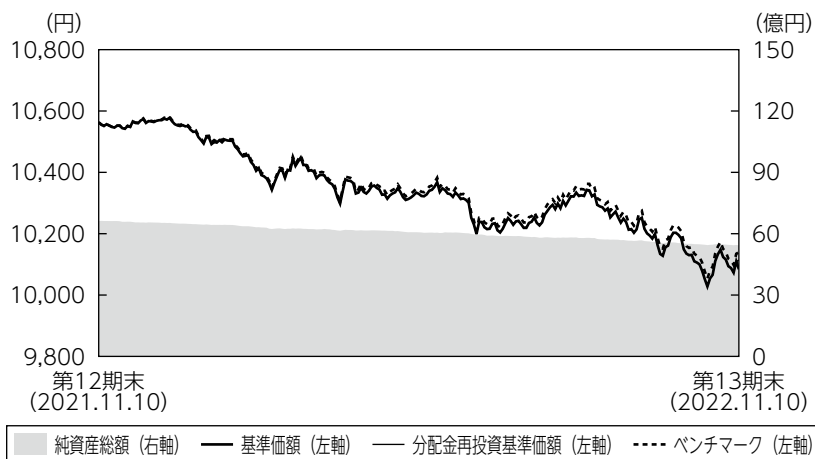
(注1) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比です。

(注2) 当ファンドはマザーファンドを組入れますので、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注3) 債券先物比率は、買建比率-売建比率です。

■当期の運用経過（2021年11月11日から2022年11月10日まで）

基準価額等の推移



第13期首： 10,563円

第13期末： 10,084円

(既払分配金30円)

騰落率： △4.3%

(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。

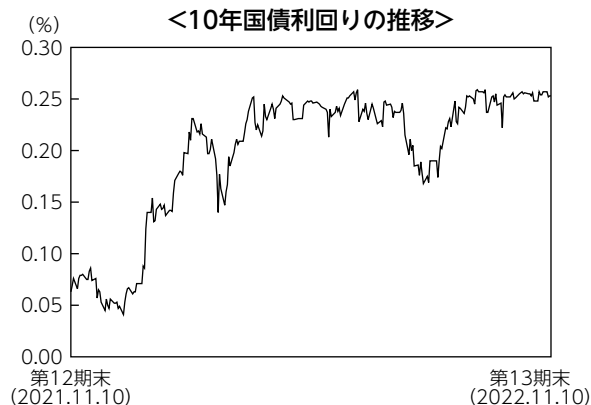
(注3) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、期首の基準価額に合わせて指数化しています。

基準価額の主な変動要因

国内債券市場の下落（利回りは上昇）を受け、基準価額は下落しました。期初から2021年12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いでした。2022年に入ると米中央銀行が利上げに着手するとの観測から利回りは上昇し基準価額は下落しました。期末にかけては欧米の好調な経済指標がインフレ加速を意識させ、利回りは一段と上昇し、基準価額の下落要因となりました。

投資環境

国内債券市場は下落しました。期初から2021年12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いでした。2022年に入ると米中央銀行が利上げに着手するとの観測から利回りは上昇し、期末にかけては欧米の好調な経済指標がインフレ加速を意識させ、利回りは一段と上昇しました。



ポートフォリオについて

●当ファンド

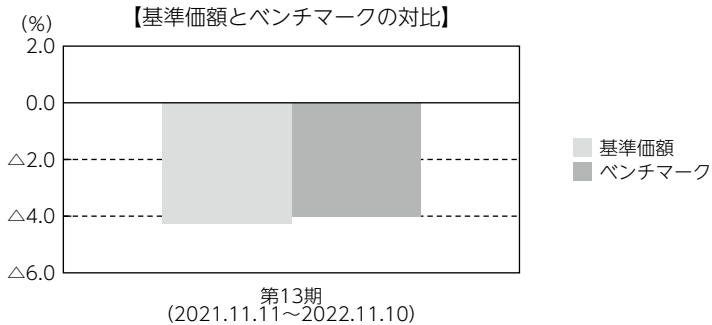
新光日本債券インデックスマザーファンドの組入比率を期を通じて高位に維持するよう運用しました。

●新光日本債券インデックスマザーファンド

ベンチマークであるNOMUR A-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。

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4.0%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基準価額水準・市況動向等を勘案し、以下の表の通りとさせていただきます。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
	2021年11月11日 ～2022年11月10日
当期分配金（税引前）	30円
対基準価額比率	0.30%
当期の収益	30円
当期の収益以外	-円
翌期繰越分配対象額	497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、新光日本債券インデックスマザーファンドの組入比率を高位に維持します。

●新光日本債券インデックスマザーファンド

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13期		項目の概要
	(2021年11月11日 ～2022年11月10日)		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	28円	0.272%	(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10,339円です。 投信会社分は、信託財産の運用、運用報告書等各種書類の作成、基準価額の算出等の対価 販売会社分は、購入後の情報提供、交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価 受託会社分は、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
(投信会社)	(9)	(0.089)	
(販売会社)	(14)	(0.133)	
(受託会社)	(5)	(0.050)	
(b) その他費用 (監査費用)	0 (0)	0.002 (0.002)	(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	28	0.273	

(注1) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は追加・解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。なお、その他費用は、このファンドが組入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 報酬率は可変型となっております。信託報酬は当期末時点の報酬率で計算しております。

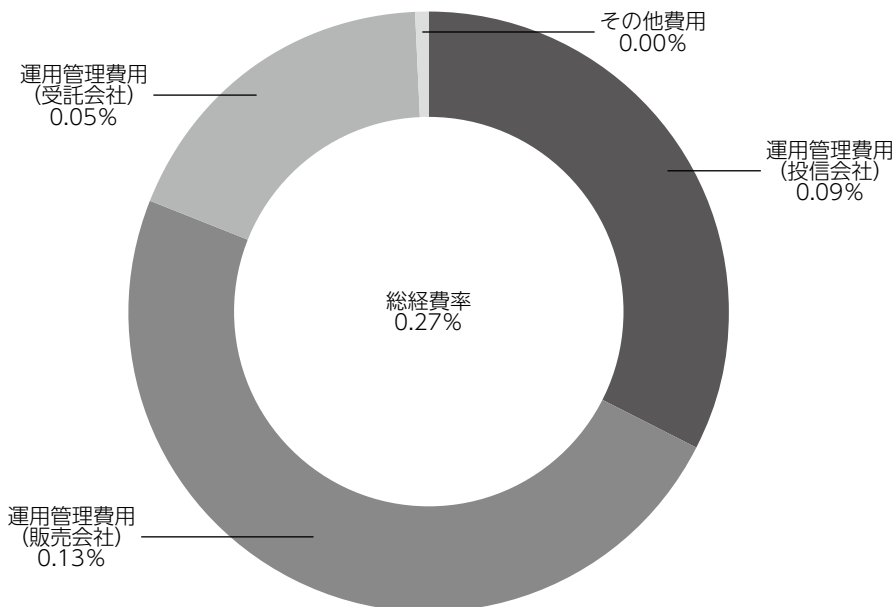
(注3) 金額欄は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注4) 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0.27%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（2021年11月11日から2022年11月10日まで）

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
新光日本債券インデックスマザーファンド	千□ 103,933	千円 131,511	千□ 850,371	千円 1,071,620

■利害関係人との取引状況等（2021年11月11日から2022年11月10日まで）

【日本債券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。

【新光日本債券インデックスマザーファンドにおける利害関係人との取引状況等】

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期 区 分	当 期			期 末		
	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 3,668	百万円 190	% 5.2	百万円 2,358	百万円 698	% 29.6

平均保有割合 57.8%

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

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

■組入資産の明細

親投資信託残高

	期 首(前 期 末)	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
新光日本債券インデックスマザーファンド	千□ 5,141,495	千□ 4,395,056	千円 5,430,092

■投資信託財産の構成

2022年11月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
新光日本債券インデックスマザーファンド	5,430,092	99.3
コール・ローン等、その他	41,032	0.7
投資信託財産総額	5,471,125	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

(2022年11月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	5,471,125,439円
コール・ローン等	32,284,729
新光日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	5,430,092,710
未 収 入 金	8,748,000
(B) 負 債	38,357,274
未 払 収 益 分 配 金	16,162,002
未 払 解 約 金	14,218,262
未 払 信 託 報 酬	7,928,489
そ の 他 未 払 費 用	48,521
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	5,432,768,165
元 本	5,387,334,325
次 期 繰 越 損 益 金	45,433,840
(D) 受 益 権 総 口 数	5,387,334,325口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	10,084円

(注) 期首における元本額は6,266,489,176円、当期中における追加設定元本額は207,156,952円、同解約元本額は1,086,311,803円です。

■損益の状況

当期 自 2021年11月11日 至 2022年11月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	△2,242円
受 取 利 息	146
支 払 利 息	△2,388
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△221,572,970
売 買 損 益	21,492,253
売 買 損 益	△243,065,223
(C) 信 託 報 酬 等	△16,521,304
(D) 当 期 損 益 金(A+B+C)	△238,096,516
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△114,703,194
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	414,395,552
(配 当 等 相 当 額)	(254,619,079)
(売 買 損 益 相 当 額)	(159,776,473)
(G) 合 計(D+E+F)	61,595,842
(H) 収 益 分 配 金	△16,162,002
次 期 繰 越 損 益 金(G+H)	45,433,840
追 加 信 託 差 損 益 金	414,395,552
(配 当 等 相 当 額)	(254,675,960)
(売 買 損 益 相 当 額)	(159,719,592)
分 配 準 備 積 立 金	13,387,411
繰 越 損 益 金	△382,349,123

(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	21,011,783円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収 益 調 整 金	254,675,960
(d) 分 配 準 備 積 立 金	8,537,630
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	284,225,373
(f) 1 万 口 当 た り 当 期 分 配 対 象 額	527.58
(g) 分 配 金	16,162,002
(h) 1 万 口 当 た り 分 配 金	30

■分配金のお知らせ

1 万口当たり分配金

30円

※分配金を再投資する場合、分配金は税引後自動的に無手数料で再投資されます。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・追加型株式投資信託の分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - 分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、分配金から元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における受益者毎の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の受益者毎の個別元本となります。

新光日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書

第17期 (決算日 2022年11月10日)

(計算期間 2021年11月11日～2022年11月10日)

新光日本債券インデックスマザーファンドの第17期の運用状況をご報告申し上げます。

当ファンドの仕組みは次の通りです。

信託期間	原則、無期限とします。
運用方針	NOMURA-BPI 総合の動き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	株式への投資割合は、転換社債の転換および新株予約権の行使により取得したものに限り、投資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行いません。

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額		NOMURA-BPI 総合 (ベンチマーク)		債券 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	円	騰落率	ポイント	騰落率			
13期(2018年11月12日)	12,610	△0.2	379.669	△0.2	99.3	—	百万円 12,473
14期(2019年11月11日)	12,956	2.7	390.121	2.8	99.3	—	9,183
15期(2020年11月10日)	12,846	△0.8	386.816	△0.8	99.6	—	8,732
16期(2021年11月10日)	12,868	0.2	387.538	0.2	99.6	—	9,341
17期(2022年11月10日)	12,355	△4.0	372.013	△4.0	99.4	—	10,176

(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証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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)。

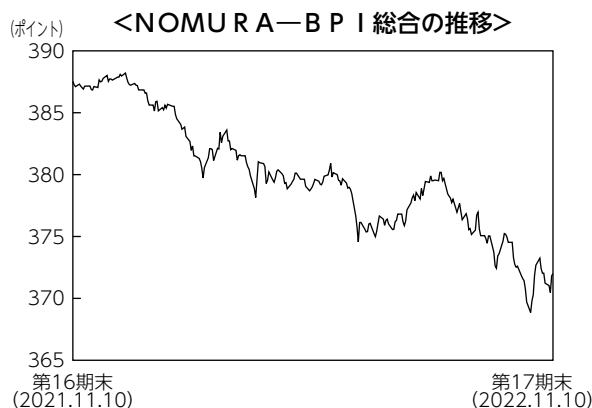
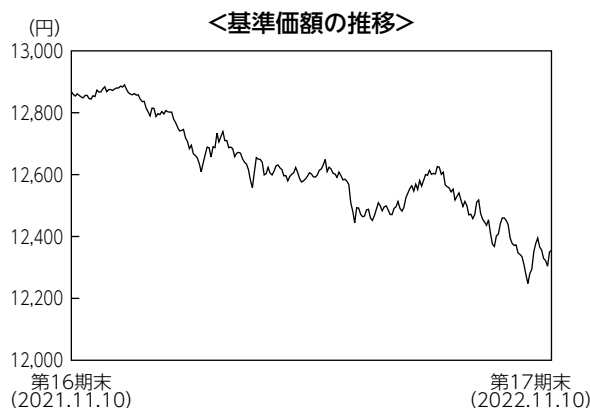
■当期中の基準価額と市況の推移

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2021年11月10日	円 12,868	% -	ポイント 387.538	% -	% 99.6	% -
11 月 末	12,873	0.0	387.655	0.0	99.4	-
12 月 末	12,844	△0.2	386.841	△0.2	99.7	-
2022年1 月 末	12,753	△0.9	384.056	△0.9	99.7	-
2 月 末	12,690	△1.4	382.128	△1.4	99.3	-
3 月 末	12,655	△1.7	381.037	△1.7	99.5	-
4 月 末	12,623	△1.9	380.119	△1.9	99.7	-
5 月 末	12,604	△2.1	379.538	△2.1	99.3	-
6 月 末	12,488	△3.0	376.081	△3.0	99.8	-
7 月 末	12,569	△2.3	378.553	△2.3	99.4	-
8 月 末	12,541	△2.5	377.670	△2.5	99.4	-
9 月 末	12,408	△3.6	373.602	△3.6	99.6	-
10 月 末	12,395	△3.7	373.249	△3.7	99.6	-
(期 末) 2022年11月10日	12,355	△4.0	372.013	△4.0	99.4	-

(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（2021年11月11日から2022年11月10日まで）



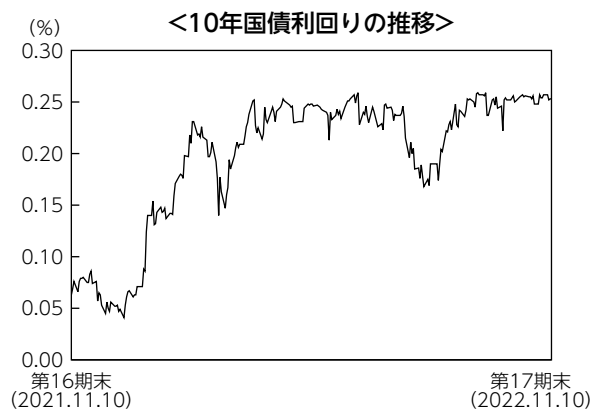
基準価額の推移

当ファンドの基準価額（1万口当たり）は12,355円となり、前期末比で4.0%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（利回りは上昇）を受け、基準価額は下落しました。期初から2021年12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いでした。2022年に入ると米中央銀行が利上げに着手するとの観測から利回りは上昇し基準価額は下落しました。期末にかけては欧米の好調な経済指標がインフレ加速を意識させ、利回りは一段と上昇し、基準価額の下落要因となりました。

投資環境



国内債券市場は下落しました。期初から2021年12月にかけては各国の中央銀行の金融政策などを注視する展開となり、もみ合いでした。2022年に入ると米中央銀行が利上げに着手するとの観測から利回りは上昇し、期末にかけては欧米の好調な経済指標がインフレ加速を意識させ、利回りは一段と上昇しました。

ポートフォリオについて

ベンチマークであるNOMUR A－B P I 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。

ベンチマークとの差異について

ベンチマークであるNOMUR A－B P I 総合は、前期末比で4.0%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 (2021年11月11日から2022年11月10日まで)

公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	3,162,337	1,717,805 (-)
	地方債証券	200,008	236,753 (-)
	特殊債証券	306,105	302,730 (-)
	社債証券	-	100,840 (-)

(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 (2021年11月11日から2022年11月10日まで)

期中の利害関係人との取引状況

決 算 期	当			期		
	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D/C
公 社 債	百万円 3,668	百万円 190	% 5.2	百万円 2,358	百万円 698	% 29.6

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				
	額 面 金 額	評 価 額	組 入 比 率	うち B B 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	8,360,000	8,396,068	82.5	—	54.8	17.8	9.9
地 方 債 証 券	690,000	705,170	6.9	6.0	3.2	3.4	0.3
特殊債券（除く金融債券）	600,000	616,263	6.1	—	3.1	3.0	—
普 通 社 債 券	400,000	399,195	3.9	—	0.9	2.0	1.0
合 計	10,050,000	10,116,696	99.4	6.0	62.0	26.2	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
	%	千円	千円	
(国債証券)				
1 3 8 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	110,000	110,237	2023/12/20
3 3 2 回 利付国庫債券（10年）	0.6000	110,000	110,847	2023/12/20
4 3 3 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	80,000	80,083	2024/02/01
1 3 9 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	60,000	60,138	2024/03/20
3 3 3 回 利付国庫債券（10年）	0.6000	80,000	80,725	2024/03/20
4 3 6 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	110,000	110,121	2024/05/01
1 4 0 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	70,000	70,179	2024/06/20
3 3 4 回 利付国庫債券（10年）	0.6000	60,000	60,636	2024/06/20
7 0 回 利付国庫債券（20年）	2.4000	20,000	20,790	2024/06/20
4 3 9 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	100,000	100,111	2024/08/01
1 4 1 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	40,000	40,115	2024/09/20
3 3 5 回 利付国庫債券（10年）	0.5000	90,000	90,927	2024/09/20
7 2 回 利付国庫債券（20年）	2.1000	20,000	20,801	2024/09/20
4 4 1 回 利付国庫債券（2年）	0.0050	50,000	50,070	2024/10/01
1 4 2 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	60,000	60,195	2024/12/20
3 3 6 回 利付国庫債券（10年）	0.5000	30,000	30,351	2024/12/20
3 3 7 回 利付国庫債券（10年）	0.3000	80,000	80,598	2024/12/20
1 4 3 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	50,000	50,182	2025/03/20
3 3 8 回 利付国庫債券（10年）	0.4000	80,000	80,857	2025/03/20
1 4 4 回 利付国庫債券（5年）	0.1000	80,000	80,323	2025/06/20
3 3 9 回 利付国庫債券（10年）	0.4000	70,000	70,830	2025/06/20

銘	柄	当		期		末
		利	額	評	償	還
		率	面	価	年	日
		%	金	額	月	
			額		日	
(国債証券)			千円	千円		
78回	利付国庫債券(20年)	1.9000	20,000	21,020	2025/06/20	
145回	利付国庫債券(5年)	0.1000	80,000	80,354	2025/09/20	
340回	利付国庫債券(10年)	0.4000	80,000	81,041	2025/09/20	
81回	利付国庫債券(20年)	2.0000	10,000	10,588	2025/09/20	
146回	利付国庫債券(5年)	0.1000	150,000	150,723	2025/12/20	
341回	利付国庫債券(10年)	0.3000	70,000	70,772	2025/12/20	
84回	利付国庫債券(20年)	2.0000	10,000	10,639	2025/12/20	
147回	利付国庫債券(5年)	0.0050	120,000	120,220	2026/03/20	
342回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	80,402	2026/03/20	
148回	利付国庫債券(5年)	0.0050	40,000	40,064	2026/06/20	
343回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	70,353	2026/06/20	
88回	利付国庫債券(20年)	2.3000	10,000	10,844	2026/06/20	
149回	利付国庫債券(5年)	0.0050	80,000	80,076	2026/09/20	
344回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	80,370	2026/09/20	
90回	利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	10,857	2026/09/20	
150回	利付国庫債券(5年)	0.0050	50,000	50,010	2026/12/20	
345回	利付国庫債券(10年)	0.1000	60,000	60,246	2026/12/20	
92回	利付国庫債券(20年)	2.1000	20,000	21,724	2026/12/20	
151回	利付国庫債券(5年)	0.0050	20,000	19,986	2027/03/20	
346回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	70,242	2027/03/20	
153回	利付国庫債券(5年)	0.0050	60,000	59,889	2027/06/20	
347回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	70,192	2027/06/20	
95回	利付国庫債券(20年)	2.3000	20,000	22,077	2027/06/20	
348回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	70,118	2027/09/20	
349回	利付国庫債券(10年)	0.1000	100,000	100,127	2027/12/20	
99回	利付国庫債券(20年)	2.1000	30,000	33,090	2027/12/20	
350回	利付国庫債券(10年)	0.1000	120,000	120,094	2028/03/20	
351回	利付国庫債券(10年)	0.1000	120,000	120,032	2028/06/20	
352回	利付国庫債券(10年)	0.1000	70,000	69,979	2028/09/20	
105回	利付国庫債券(20年)	2.1000	20,000	22,329	2028/09/20	
353回	利付国庫債券(10年)	0.1000	110,000	109,865	2028/12/20	
108回	利付国庫債券(20年)	1.9000	10,000	11,082	2028/12/20	
354回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	79,823	2029/03/20	
110回	利付国庫債券(20年)	2.1000	10,000	11,244	2029/03/20	
355回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	79,764	2029/06/20	
111回	利付国庫債券(20年)	2.2000	10,000	11,351	2029/06/20	
112回	利付国庫債券(20年)	2.1000	20,000	22,573	2029/06/20	
356回	利付国庫債券(10年)	0.1000	80,000	79,700	2029/09/20	
113回	利付国庫債券(20年)	2.1000	30,000	33,982	2029/09/20	
357回	利付国庫債券(10年)	0.1000	60,000	59,683	2029/12/20	

銘	柄	当		期		末
		利	額	評	償	還
		率	面	価	額	年月日
		%	金額	額	額	
(国債証券)			千円	千円		
1 1 4回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	10,000	11,359		2029/12/20
3 5 8回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	70,000	69,492		2030/03/20
1 1 6回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	11,461		2030/03/20
1 1 7回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	20,000	22,778		2030/03/20
3 5 9回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	80,000	79,281		2030/06/20
1 1 8回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	10,000	11,339		2030/06/20
1 2 0回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	20,000	22,081		2030/06/20
3 6 0回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	80,000	79,196		2030/09/20
1 2 1回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	20,000	22,603		2030/09/20
1 2 2回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	10,000	11,224		2030/09/20
3 6 1回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	80,000	79,140		2030/12/20
1 2 3回	利付国庫債券 (20年)	2.1000	20,000	22,994		2030/12/20
1 2 4回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	10,000	11,417		2030/12/20
3 6 2回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	60,000	59,311		2031/03/20
1 2 5回	利付国庫債券 (20年)	2.2000	10,000	11,619		2031/03/20
1 2 6回	利付国庫債券 (20年)	2.0000	10,000	11,455		2031/03/20
1 2 7回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	10,000	11,373		2031/03/20
3 6 3回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	80,000	79,021		2031/06/20
1 2 8回	利付国庫債券 (20年)	1.9000	20,000	22,818		2031/06/20
1 2 9回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	10,000	11,324		2031/06/20
3 6 4回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	60,000	59,220		2031/09/20
1 3 0回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	20,000	22,715		2031/09/20
1 3 1回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	10,000	11,271		2031/09/20
3 6 5回	利付国庫債券 (10年)	0.1000	70,000	69,157		2031/12/20
1 3 2回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	10,000	11,306		2031/12/20
1 3 3回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	20,000	22,790		2031/12/20
3 6 6回	利付国庫債券 (10年)	0.2000	60,000	60,082		2032/03/20
1 3 4回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	20,000	22,843		2032/03/20
1 3 5回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	10,000	11,330		2032/03/20
1 3 6回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	20,000	22,477		2032/03/20
3 6 7回	利付国庫債券 (10年)	0.2000	60,000	59,774		2032/06/20
1 3 7回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	20,000	22,698		2032/06/20
1 3 8回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	30,000	33,486		2032/06/20
1 3 9回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	20,000	22,511		2032/06/20
3 6 8回	利付国庫債券 (10年)	0.2000	20,000	19,913		2032/09/20
1 4 0回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	50,000	56,810		2032/09/20
1 4 1回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	40,000	45,448		2032/12/20
1 4 2回	利付国庫債券 (20年)	1.8000	20,000	22,920		2032/12/20
1 0回	利付国庫債券 (30年)	1.1000	20,000	21,520		2033/03/20
1 4 3回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	30,000	33,797		2033/03/20

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 4 4回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	20,000	22,331		2033/03/20
1 1回	利付国庫債券 (30年)	1.7000	10,000	11,374		2033/06/20
1 4 5回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	40,000	45,498		2033/06/20
1 2回	利付国庫債券 (30年)	2.1000	10,000	11,799		2033/09/20
1 4 6回	利付国庫債券 (20年)	1.7000	40,000	45,505		2033/09/20
1 4 7回	利付国庫債券 (20年)	1.6000	60,000	67,620		2033/12/20
1 4 8回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	40,000	44,608		2034/03/20
1 5回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	10,000	12,274		2034/06/20
1 4 9回	利付国庫債券 (20年)	1.5000	40,000	44,583		2034/06/20
1 5 0回	利付国庫債券 (20年)	1.4000	40,000	44,078		2034/09/20
1 7回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	10,000	12,189		2034/12/20
1 5 1回	利付国庫債券 (20年)	1.2000	50,000	53,903		2034/12/20
1 5 2回	利付国庫債券 (20年)	1.2000	60,000	64,585		2035/03/20
1 9回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	10,000	12,084		2035/06/20
1 5 3回	利付国庫債券 (20年)	1.3000	50,000	54,356		2035/06/20
2 0回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	10,000	12,341		2035/09/20
1 5 4回	利付国庫債券 (20年)	1.2000	40,000	42,941		2035/09/20
2 1回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	10,000	12,109		2035/12/20
1 5 5回	利付国庫債券 (20年)	1.0000	50,000	52,366		2035/12/20
2 2回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	10,000	12,371		2036/03/20
1 5 6回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	40,000	38,747		2036/03/20
2 3回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	10,000	12,382		2036/06/20
1 5 7回	利付国庫債券 (20年)	0.2000	50,000	46,981		2036/06/20
1 5 8回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	50,000	48,767		2036/09/20
1 5 9回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	50,000	49,263		2036/12/20
2 6回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	10,000	12,265		2037/03/20
1 6 0回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	40,000	39,818		2037/03/20
1 6 1回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	40,000	39,132		2037/06/20
2 7回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	10,000	12,405		2037/09/20
1 6 2回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	40,000	38,989		2037/09/20
1 6 3回	利付国庫債券 (20年)	0.6000	60,000	58,264		2037/12/20
2 8回	利付国庫債券 (30年)	2.5000	20,000	24,818		2038/03/20
1 6 4回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	40,000	38,124		2038/03/20
1 6 5回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	40,000	37,966		2038/06/20
2 9回	利付国庫債券 (30年)	2.4000	20,000	24,503		2038/09/20
1 6 6回	利付国庫債券 (20年)	0.7000	30,000	29,228		2038/09/20
1 6 7回	利付国庫債券 (20年)	0.5000	40,000	37,616		2038/12/20
3 0回	利付国庫債券 (30年)	2.3000	30,000	36,271		2039/03/20
1 6 8回	利付国庫債券 (20年)	0.4000	30,000	27,644		2039/03/20
1 6 9回	利付国庫債券 (20年)	0.3000	40,000	36,063		2039/06/20

銘	柄	当		期		末
		利	額	評	償	還
		率	面	価	額	年月日
		%	金額	額	額	
(国債証券)			千円	千円		
31回 利付国庫債券(30年)		2.2000	20,000	23,840		2039/09/20
170回 利付国庫債券(20年)		0.3000	30,000	26,912		2039/09/20
171回 利付国庫債券(20年)		0.3000	50,000	44,658		2039/12/20
32回 利付国庫債券(30年)		2.3000	30,000	36,222		2040/03/20
172回 利付国庫債券(20年)		0.4000	30,000	27,157		2040/03/20
173回 利付国庫債券(20年)		0.4000	40,000	36,056		2040/06/20
33回 利付国庫債券(30年)		2.0000	30,000	34,729		2040/09/20
174回 利付国庫債券(20年)		0.4000	40,000	35,874		2040/09/20
175回 利付国庫債券(20年)		0.5000	50,000	45,504		2040/12/20
34回 利付国庫債券(30年)		2.2000	30,000	35,693		2041/03/20
176回 利付国庫債券(20年)		0.5000	40,000	36,279		2041/03/20
177回 利付国庫債券(20年)		0.4000	40,000	35,483		2041/06/20
35回 利付国庫債券(30年)		2.0000	30,000	34,677		2041/09/20
178回 利付国庫債券(20年)		0.5000	40,000	36,026		2041/09/20
179回 利付国庫債券(20年)		0.5000	30,000	26,945		2041/12/20
36回 利付国庫債券(30年)		2.0000	30,000	34,695		2042/03/20
180回 利付国庫債券(20年)		0.8000	30,000	28,427		2042/03/20
181回 利付国庫債券(20年)		0.9000	30,000	28,892		2042/06/20
37回 利付国庫債券(30年)		1.9000	60,000	68,267		2042/09/20
182回 利付国庫債券(20年)		1.1000	10,000	9,959		2042/09/20
38回 利付国庫債券(30年)		1.8000	20,000	22,384		2043/03/20
39回 利付国庫債券(30年)		1.9000	20,000	22,725		2043/06/20
40回 利付国庫債券(30年)		1.8000	20,000	22,337		2043/09/20
41回 利付国庫債券(30年)		1.7000	20,000	21,942		2043/12/20
42回 利付国庫債券(30年)		1.7000	20,000	21,923		2044/03/20
43回 利付国庫債券(30年)		1.7000	20,000	21,903		2044/06/20
44回 利付国庫債券(30年)		1.7000	30,000	32,824		2044/09/20
45回 利付国庫債券(30年)		1.5000	30,000	31,627		2044/12/20
46回 利付国庫債券(30年)		1.5000	30,000	31,586		2045/03/20
47回 利付国庫債券(30年)		1.6000	20,000	21,422		2045/06/20
48回 利付国庫債券(30年)		1.4000	40,000	41,213		2045/09/20
49回 利付国庫債券(30年)		1.4000	30,000	30,861		2045/12/20
50回 利付国庫債券(30年)		0.8000	30,000	27,166		2046/03/20
51回 利付国庫債券(30年)		0.3000	30,000	24,038		2046/06/20
52回 利付国庫債券(30年)		0.5000	30,000	25,148		2046/09/20
53回 利付国庫債券(30年)		0.6000	20,000	17,100		2046/12/20
54回 利付国庫債券(30年)		0.8000	40,000	35,738		2047/03/20
55回 利付国庫債券(30年)		0.8000	20,000	17,803		2047/06/20
56回 利付国庫債券(30年)		0.8000	20,000	17,738		2047/09/20
57回 利付国庫債券(30年)		0.8000	30,000	26,508		2047/12/20

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回	利付国庫債券(40年)	2.4000	10,000	12,225	2048/03/20
58回	利付国庫債券(30年)	0.8000	30,000	26,409	2048/03/20
59回	利付国庫債券(30年)	0.7000	20,000	17,103	2048/06/20
60回	利付国庫債券(30年)	0.9000	20,000	17,897	2048/09/20
61回	利付国庫債券(30年)	0.7000	20,000	16,966	2048/12/20
2回	利付国庫債券(40年)	2.2000	10,000	11,743	2049/03/20
62回	利付国庫債券(30年)	0.5000	20,000	16,010	2049/03/20
63回	利付国庫債券(30年)	0.4000	20,000	15,492	2049/06/20
64回	利付国庫債券(30年)	0.4000	40,000	30,866	2049/09/20
65回	利付国庫債券(30年)	0.4000	20,000	15,433	2049/12/20
3回	利付国庫債券(40年)	2.2000	20,000	23,513	2050/03/20
66回	利付国庫債券(30年)	0.4000	20,000	15,389	2050/03/20
67回	利付国庫債券(30年)	0.6000	30,000	24,209	2050/06/20
68回	利付国庫債券(30年)	0.6000	30,000	24,126	2050/09/20
69回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	24,765	2050/12/20
4回	利付国庫債券(40年)	2.2000	20,000	23,389	2051/03/20
70回	利付国庫債券(30年)	0.7000	20,000	16,457	2051/03/20
71回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	24,628	2051/06/20
72回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	24,572	2051/09/20
73回	利付国庫債券(30年)	0.7000	30,000	24,564	2051/12/20
5回	利付国庫債券(40年)	2.0000	20,000	22,496	2052/03/20
74回	利付国庫債券(30年)	1.0000	30,000	26,617	2052/03/20
75回	利付国庫債券(30年)	1.3000	30,000	28,681	2052/06/20
76回	利付国庫債券(30年)	1.4000	10,000	9,763	2052/09/20
6回	利付国庫債券(40年)	1.9000	20,000	21,850	2053/03/20
7回	利付国庫債券(40年)	1.7000	20,000	20,875	2054/03/20
8回	利付国庫債券(40年)	1.4000	20,000	19,353	2055/03/20
9回	利付国庫債券(40年)	0.4000	50,000	35,264	2056/03/20
10回	利付国庫債券(40年)	0.9000	30,000	24,930	2057/03/20
11回	利付国庫債券(40年)	0.8000	30,000	23,984	2058/03/20
12回	利付国庫債券(40年)	0.5000	30,000	21,336	2059/03/20
13回	利付国庫債券(40年)	0.5000	40,000	28,227	2060/03/20
14回	利付国庫債券(40年)	0.7000	40,000	30,153	2061/03/20
15回	利付国庫債券(40年)	1.0000	10,000	8,252	2062/03/20
小	計	-	8,360,000	8,396,068	-
(地方債証券)		%	千円	千円	
485回	名古屋市公募公債 10年	0.6700	30,000	30,206	2023/12/08
218回	神奈川県公募公債	0.1950	100,000	100,387	2025/12/19
412回	大阪府公募公債 10年	0.0600	50,000	49,883	2026/09/29

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	
190回	大阪府公募公債 5年	0.0010	100,000	99,430	2026/12/25
169回	共同発行市場公募地方債	0.2050	100,000	100,229	2027/04/23
18回	東京都公募公債 20年	2.2200	100,000	112,282	2029/03/19
12回	兵庫県公募公債 15年	0.7810	100,000	103,260	2030/12/06
令和3年度11回	愛知県公募公債	0.1450	100,000	97,924	2031/10/29
24年度1回	福岡県公募公債 30年	2.1200	10,000	11,568	2042/09/19
小 計		—	690,000	705,170	—
(特殊債券(除く金融債券))		%	千円	千円	
249回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.4840	100,000	101,195	2025/06/30
87回	中日本高速道路債券	0.0600	100,000	99,597	2026/03/18
327回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	0.1700	100,000	100,123	2027/10/29
250回	住宅金融支援機構	0.2890	100,000	99,813	2028/11/20
97回	政保日本高速道路保有・債務返済機構	2.1000	100,000	112,915	2029/12/28
147回	高速道路機構債	0.9550	100,000	102,620	2034/12/20
小 計		—	600,000	616,263	—
(普通社債券)		%	千円	千円	
50回	西日本高速道路債券	0.0400	100,000	99,871	2024/06/20
36回	東日本旅客鉄道社債	2.1100	100,000	103,945	2024/12/20
11回	ブリヂストン社債	0.2950	100,000	99,932	2027/04/21
494回	九州電力社債	0.3100	100,000	95,447	2031/05/23
小 計		—	400,000	399,195	—
合 計		—	10,050,000	10,116,696	—

■投資信託財産の構成

2022年11月10日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比	率
公 社 債	千円		%
	10,116,696		99.1
コ ー ル ・ ロ ー ン 等 、 そ の 他	89,173		0.9
投 資 信 託 財 産 総 額	10,205,869		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

(2022年11月10日)現在

項 目	当 期 末
(A) 資 産	10,205,869,743円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	72,211,393
公 社 債(評価額)	10,116,696,300
未 収 利 息	16,590,346
前 払 費 用	371,704
(B) 負 債	29,502,800
未 払 金	19,354,800
未 払 解 約 金	10,148,000
(C) 純 資 産 総 額(A-B)	10,176,366,943
元 本	8,236,621,679
次 期 繰 越 損 益 金	1,939,745,264
(D) 受 益 権 総 口 数	8,236,621,679口
1 万 口 当 た り 基 準 価 額(C/D)	12,355円

(注1) 期首元本額	7,259,749,583円
追加設定元本額	2,064,736,690円
一部解約元本額	1,087,864,594円
(注2) 期末における元本の内訳	
One DC 国内債券インデックスファンド	2,719,157,589円
新光7資産バランスファンド	503,038,704円
日本債券ファンド	4,395,056,828円
世界バランスファンド35VA (適格機関投資家私募)	515,439,165円
新光ワールドバランスファンドVA (適格機関投資家私募)	26,030,079円
ワールドバランスファンド30VA (適格機関投資家私募)	49,580,293円
ワールドバランスファンド30VA2 (適格機関投資家私募)	28,319,021円
期末元本合計	8,236,621,679円

■損益の状況

当期 自2021年11月11日 至2022年11月10日

項 目	当 期
(A) 配 当 等 収 益	69,876,251円
受 取 利 息	69,885,907
支 払 利 息	△9,656
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△498,444,800
売 買 益	445,000
売 買 損	△498,889,800
(C) 当 期 損 益 金(A+B)	△428,568,549
(D) 前 期 繰 越 損 益 金	2,082,231,909
(E) 解 約 差 損 益 金	△283,725,406
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	569,807,310
(G) 合 計(C+D+E+F)	1,939,745,264
次 期 繰 越 損 益 金(G)	1,939,745,264

- (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。