

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11期

（決算日 2024年10月28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11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	み騰	(ベンチマーク)	騰落率			
	円	円	%		%	%	百万円	
(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	
(第11期) 2024年10月28日	10,074	0	△0.5	359.73	△0.4	99.2	1,248	

(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

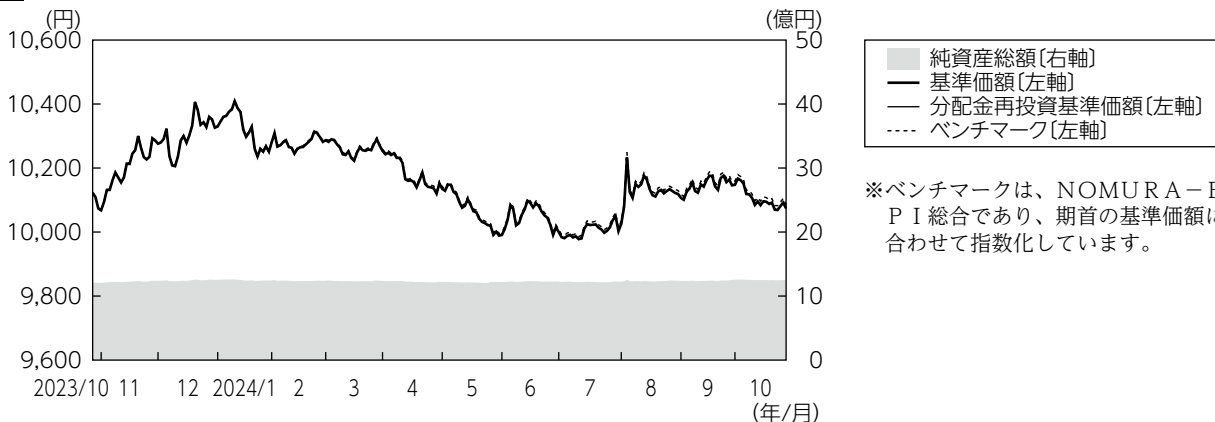
年月日	基準価額		NOMURA-BPI総合		債組入率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率	
	円	%		%	%
(期首)2023年10月27日	10,123	—	361.09	—	99.2
10月末	10,074	△0.5	359.31	△0.5	99.3
11月末	10,286	1.6	366.88	1.6	99.3
12月末	10,326	2.0	368.38	2.0	99.2
2024年 1月末	10,251	1.3	365.75	1.3	99.5
2月末	10,282	1.6	366.90	1.6	99.4
3月末	10,270	1.5	366.50	1.5	99.5
4月末	10,152	0.3	362.35	0.4	99.3
5月末	9,989	△1.3	356.53	△1.3	99.3
6月末	10,015	△1.1	357.51	△1.0	99.2
7月末	10,003	△1.2	357.15	△1.1	99.1
8月末	10,119	△0.0	361.33	0.1	99.1
9月末	10,146	0.2	362.34	0.3	99.3
(期末)2024年10月28日	10,074	△0.5	359.73	△0.4	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11期首(2023年10月27日)：10,123円

第11期末(2024年10月28日)：10,074円(既払分配金0円)

騰落率：△0.5%(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、分配金(税込み)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。

※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。

### ■ 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)

- 2023年11月初旬から2024年1月中旬にかけて、米国経済指標の悪化やFRB(米連邦準備制度理事会)高官のハト派発言などを背景とした米国金利の低下に追随し、国内金利が低下(債券価格は上昇)したこと
- 8月初旬から9月下旬にかけて、日銀の追加利上げ実施後の材料出尽くしに加え、米国の雇用統計の下振れに伴う海外金利の急低下を受けたりスクオフの動きから、国内金利が低下したこと

#### (下落要因)

- 2024年1月中旬から7月下旬にかけて、日銀は3月にマイナス金利解除を決定しましたが、その後も急速な円安などを背景に早期の更なる政策修正の思惑から国内金利が上昇(債券価格は下落)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2024年1月上旬にかけて海外長期金利の低下や、日銀が緩和的な金融政策を維持し、引き締め観測が後退したことなどから低下（債券価格は上昇）しました。1月中旬から7月初旬にかけては日銀がマイナス金利を解除するとの見通し（3月中旬に解除）の高まりや海外長期金利の上昇、マイナス金利解除後も日銀が追加利上げなどの金融正常化を進めるとの見方から上昇しました。8月初旬、追加利上げ実施後の材料出尽くしに加え、米国の雇用統計下振れに伴う海外長期金利の急低下を受けて大幅に低下する局面がありましたが、その後期末にかけては緩やかに上昇しました。

## ■ 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】

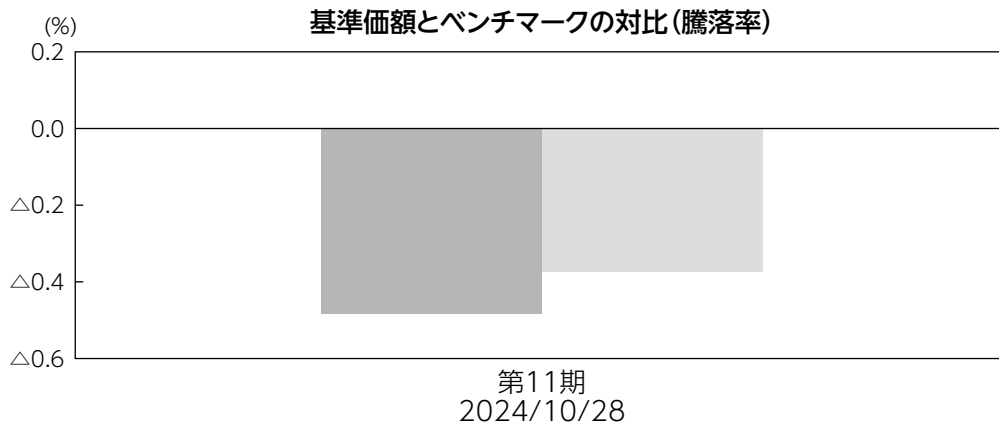
#### 期首

	デュレーション (年)	残存年数 (年)	複利最終利回り (%)
ファンド	8.9	10.2	0.8
ベンチマーク	8.8	10.2	0.8

#### 期末

	デュレーション (年)	残存年数 (年)	複利最終利回り (%)
ファンド	8.7	10.2	1.0
ベンチマーク	8.7	10.2	1.0

## ■ 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 $\Delta 0.5\%$ になりました。一方、ベンチマークの騰落率は $\Delta 0.4\%$ 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11期 (2023年10月28日～2024年10月28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	1,179

(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
	2023年10月28日～2024年10月28日		
	金額	比率	
(a) 信託報酬	13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10,159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	14	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まず。

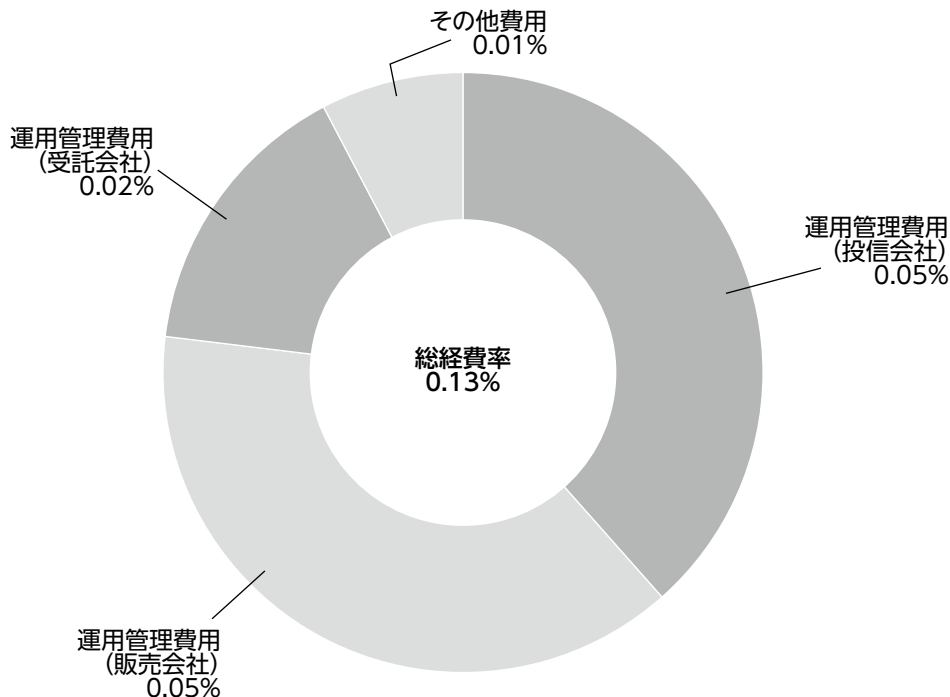
(注2) 消費税は報告日の税率を採用しています。

(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0.13%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 (2023年10月28日～2024年10月28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 132,024	千円 156,500	千口 96,786	千円 114,890

(注) 単位未満は切り捨て。

## ◎利害関係人との取引状況等 (2023年10月28日～2024年10月28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 1,024,227	千口 1,059,464	千円 1,246,989

(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(38,983,592千口)です。

## ◎投資信託財産の構成

2024年10月28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 1,246,989	99.7 %
コール・ローン等、その他	3,156	0.3
投資信託財産総額	1,250,145	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

2024年10月28日現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	1,250,145,050
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	2,195,284
国 内 債 券 パ ッ シ ブ 型 マ ザ ー フ ェ ン ド (評 価 額)	1,246,989,754
未 収 入 金	960,000
未 収 利 息	12
(B) 負 債	1,901,970
未 払 解 約 金	1,064,961
未 払 信 託 報 酬	803,585
そ の 他 未 払 費 用	33,424
(C) 純 資 産 総 額 (A - B)	1,248,243,080
元 本	1,239,133,436
次 期 繰 越 損 益 金	9,109,644
(D) 受 益 権 総 口 数	1,239,133,436口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,074円

◎損益の状況

自 2023年10月28日  
至 2024年10月28日

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	653
受 取 利 息	1,424
支 払 利 息	△ 771
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 5,190,613
売 買 益	1,056,605
売 買 損	△ 6,247,218
(C) 信 託 報 酬 等	△ 1,700,415
(D) 当 期 損 益 金 (A + B + C)	△ 6,890,375
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	△ 58,582,274
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	74,582,293
(配 当 等 相 当 額)	( 99,777,825)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 25,195,532)
(G) 計 (D + E + F)	9,109,644
(H) 収 益 分 配 金	0
次 期 繰 越 損 益 金 (G + H)	9,109,644
追 加 信 託 差 損 益 金	74,582,293
(配 当 等 相 当 額)	( 99,929,754)
(売 買 損 益 相 当 額)	(△ 25,347,461)
分 配 準 備 積 立 金	46,227,572
繰 越 損 益 金	△111,700,221

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,196,272,857円、期中追加設定元本額は227,030,592円、期中一部解約元本額は184,170,013円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.0074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(8,035,248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(99,929,754円)および分配準備積立金(38,192,324円)より分配対象収益は146,157,326円(10,000口当たり1,179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17期

(決算日 2024年10月28日)

「国内債券パッシブ型マザーファンド」は、2024年10月28日に第17期決算を行いました。  
以下、当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	期騰 落率	NOMURA-BPI総合 (ベンチマーク)		債組 比率	券入 率	純資 産額
			騰落率	騰落率			
(第13期)2020年10月27日	円	%		%	%		百万円
	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
(第17期)2024年10月28日	11,770	△0.4	359.73	△0.4	99.3		45,883

(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 (ベンチマーク)		債組 比率	券入 率
			騰落率	騰落率		
(期首)2023年10月27日	円	%		%	%	
	11,812	—	361.09	—	99.3	
10月末	11,755	△0.5	359.31	△0.5	99.4	
11月末	12,004	1.6	366.88	1.6	99.4	
12月末	12,052	2.0	368.38	2.0	99.3	
2024年 1月末	11,965	1.3	365.75	1.3	99.6	
2月末	12,003	1.6	366.90	1.6	99.5	
3月末	11,990	1.5	366.50	1.5	99.6	
4月末	11,854	0.4	362.35	0.4	99.4	
5月末	11,664	△1.3	356.53	△1.3	99.4	
6月末	11,696	△1.0	357.51	△1.0	99.3	
7月末	11,684	△1.1	357.15	△1.1	99.2	
8月末	11,821	0.1	361.33	0.1	99.2	
9月末	11,854	0.4	362.34	0.3	99.4	
(期末)2024年10月28日	11,770	△0.4	359.73	△0.4	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(2023年10月28日～2024年10月28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11,812円で始まり期末11,770円で終わりました。騰落率は、 $\Delta 0.4\%$ 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)

- 2023年11月初旬から2024年1月中旬にかけて、米国経済指標の悪化やFRB（米連邦準備制度理事会）高官のハト派発言などを背景とした米国金利の低下に追随し、国内金利が低下（債券価格は上昇）したこと
- 8月初旬から9月下旬にかけて、日銀の追加利上げ実施後の材料出尽くしに加え、米国の雇用統計の下振れに伴う海外金利の急低下を受けたリスクオフの動きから、国内金利が低下したこと

## (下落要因)

- 2024年1月中旬から7月下旬にかけて、日銀は3月にマイナス金利解除を決定しましたが、その後も急速な円安などを背景に早期の更なる政策修正の思惑から国内の金利が上昇（債券価格は下落）したこと

## (2) ベンチマークとの差異

基準価額の騰落率は $\Delta 0.4\%$ になりました。一方、ベンチマークの騰落率も $\Delta 0.4\%$ となり、ベンチマークとの高い連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

	デュレーション (年)	残存年数 (年)	複利最終利回り (%)
ファンド	8.9	10.2	0.8
ベンチマーク	8.8	10.2	0.8

## 期末

	デュレーション (年)	残存年数 (年)	複利最終利回り (%)
ファンド	8.7	10.2	1.0
ベンチマーク	8.7	10.2	1.0

## 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
	2023年10月28日～2024年10月28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11,861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(2023年10月28日～2024年10月28日)

## ○公社債

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	20,946,108	17,722,122
	地方債証券	471,134	302,815
	特殊債証券	243,152	( 41,072)
	社債券(投資法人債券を含む)	479,803	499,714

(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(2023年10月28日～2024年10月28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	40,829,000	38,807,723	84.6	—	53.0	21.5	10.1
地 方 債 証 券	2,750,000	2,735,301	6.0	—	3.9	1.6	0.4
特 殊 債 証 券 (除 金 融 債)	2,155,113	2,163,109	4.7	—	3.4	1.4	—
金 融 債 証 券	100,000	98,758	0.2	—	—	0.2	—
普 通 社 債 証 券 (含 む 投 資 法 人 債 証 券)	1,800,000	1,760,732	3.8	—	1.7	1.3	0.9
合 計	47,634,113	45,565,624	99.3	—	62.0	25.9	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	当 期	末		償 還 年 月 日
	利 率	額 面 金 額	評 価 額	
(国債証券)	%	千円	千円	
第460回 利付国債2年	0.3	650,000	648,979	2026/ 5/ 1
第461回 利付国債2年	0.4	200,000	199,936	2026/ 6/ 1
第462回 利付国債2年	0.4	369,000	368,815	2026/ 7/ 1
第464回 利付国債2年	0.4	195,000	194,838	2026/ 9/ 1
第146回 利付国債5年	0.1	680,000	678,136	2025/12/20
第147回 利付国債5年	0.005	635,000	631,704	2026/ 3/20
第148回 利付国債5年	0.005	380,000	377,397	2026/ 6/20
第149回 利付国債5年	0.005	735,000	728,995	2026/ 9/20
第150回 利付国債5年	0.005	570,000	564,676	2026/12/20
第151回 利付国債5年	0.005	600,000	593,754	2027/ 3/20
第153回 利付国債5年	0.005	410,000	405,235	2027/ 6/20
第154回 利付国債5年	0.1	540,000	534,448	2027/ 9/20
第155回 利付国債5年	0.3	300,000	298,419	2027/12/20
第156回 利付国債5年	0.2	180,000	178,493	2027/12/20
第157回 利付国債5年	0.2	330,000	326,861	2028/ 3/20
第158回 利付国債5年	0.1	410,000	404,735	2028/ 3/20
第159回 利付国債5年	0.1	385,000	379,490	2028/ 6/20
第163回 利付国債5年	0.4	275,000	273,740	2028/ 9/20
第165回 利付国債5年	0.3	705,000	698,281	2028/12/20
第167回 利付国債5年	0.4	75,000	74,517	2029/ 3/20
第168回 利付国債5年	0.6	230,000	230,492	2029/ 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171回	利付国債5年		0.4	230,000	228,231	2029/ 6/20
第172回	利付国債5年		0.5	90,000	89,714	2029/ 6/20
第 1回	利付国債40年		2.4	43,000	46,293	2048/ 3/20
第 2回	利付国債40年		2.2	51,000	52,628	2049/ 3/20
第 3回	利付国債40年		2.2	45,000	46,165	2050/ 3/20
第 4回	利付国債40年		2.2	77,000	78,373	2051/ 3/20
第 5回	利付国債40年		2.0	72,000	69,896	2052/ 3/20
第 6回	利付国債40年		1.9	72,000	67,928	2053/ 3/20
第 7回	利付国債40年		1.7	87,000	77,845	2054/ 3/20
第 8回	利付国債40年		1.4	109,000	89,845	2055/ 3/20
第 9回	利付国債40年		0.4	182,000	107,676	2056/ 3/20
第10回	利付国債40年		0.9	163,000	113,281	2057/ 3/20
第11回	利付国債40年		0.8	134,000	88,748	2058/ 3/20
第12回	利付国債40年		0.5	141,000	81,748	2059/ 3/20
第13回	利付国債40年		0.5	187,000	105,933	2060/ 3/20
第14回	利付国債40年		0.7	78,000	46,870	2061/ 3/20
第15回	利付国債40年		1.0	196,000	129,544	2062/ 3/20
第16回	利付国債40年		1.3	183,000	132,212	2063/ 3/20
第17回	利付国債40年		2.2	70,000	65,636	2064/ 3/20
第343回	利付国債10年		0.1	157,000	156,167	2026/ 6/20
第344回	利付国債10年		0.1	230,000	228,530	2026/ 9/20
第345回	利付国債10年		0.1	216,000	214,416	2026/12/20
第346回	利付国債10年		0.1	128,000	126,955	2027/ 3/20
第347回	利付国債10年		0.1	403,000	399,316	2027/ 6/20
第348回	利付国債10年		0.1	157,000	155,386	2027/ 9/20
第349回	利付国債10年		0.1	290,000	286,676	2027/12/20
第350回	利付国債10年		0.1	193,000	190,521	2028/ 3/20
第351回	利付国債10年		0.1	135,000	133,068	2028/ 6/20
第352回	利付国債10年		0.1	231,000	227,297	2028/ 9/20
第353回	利付国債10年		0.1	335,000	329,093	2028/12/20
第354回	利付国債10年		0.1	369,000	361,804	2029/ 3/20
第355回	利付国債10年		0.1	490,000	479,582	2029/ 6/20
第356回	利付国債10年		0.1	436,000	425,836	2029/ 9/20
第357回	利付国債10年		0.1	430,000	419,482	2029/12/20
第358回	利付国債10年		0.1	615,000	599,102	2030/ 3/20
第359回	利付国債10年		0.1	233,000	226,641	2030/ 6/20
第360回	利付国債10年		0.1	360,000	349,552	2030/ 9/20
第361回	利付国債10年		0.1	410,000	397,265	2030/12/20
第362回	利付国債10年		0.1	300,000	290,055	2031/ 3/20
第363回	利付国債10年		0.1	343,000	330,881	2031/ 6/20
第364回	利付国債10年		0.1	333,000	320,385	2031/ 9/20
第365回	利付国債10年		0.1	385,000	369,411	2031/12/20



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366回	利付国債10年		0.2	510,000	491,736	2032/ 3/20
第367回	利付国債10年		0.2	270,000	259,548	2032/ 6/20
第368回	利付国債10年		0.2	500,000	479,325	2032/ 9/20
第369回	利付国債10年		0.5	562,000	550,372	2032/12/20
第370回	利付国債10年		0.5	328,000	320,387	2033/ 3/20
第371回	利付国債10年		0.4	351,000	338,964	2033/ 6/20
第372回	利付国債10年		0.8	508,000	506,105	2033/ 9/20
第373回	利付国債10年		0.6	487,000	475,258	2033/12/20
第374回	利付国債10年		0.8	200,000	198,096	2034/ 3/20
第375回	利付国債10年		1.1	315,000	319,737	2034/ 6/20
第 2回	利付国債30年		2.4	10,000	10,946	2030/ 2/20
第 5回	利付国債30年		2.2	20,000	21,997	2031/ 5/20
第 7回	利付国債30年		2.3	60,000	66,985	2032/ 5/20
第 8回	利付国債30年		1.8	85,000	91,927	2032/11/22
第11回	利付国債30年		1.7	113,000	121,366	2033/ 6/20
第13回	利付国債30年		2.0	55,000	60,416	2033/12/20
第15回	利付国債30年		2.5	105,000	120,116	2034/ 6/20
第17回	利付国債30年		2.4	90,000	102,167	2034/12/20
第19回	利付国債30年		2.3	100,000	112,502	2035/ 6/20
第21回	利付国債30年		2.3	40,000	45,010	2035/12/20
第23回	利付国債30年		2.5	101,000	115,770	2036/ 6/20
第24回	利付国債30年		2.5	50,000	57,331	2036/ 9/20
第25回	利付国債30年		2.3	75,000	84,279	2036/12/20
第27回	利付国債30年		2.5	19,000	21,757	2037/ 9/20
第28回	利付国債30年		2.5	128,000	146,434	2038/ 3/20
第30回	利付国債30年		2.3	102,000	113,674	2039/ 3/20
第31回	利付国債30年		2.2	45,000	49,436	2039/ 9/20
第32回	利付国債30年		2.3	75,000	83,229	2040/ 3/20
第33回	利付国債30年		2.0	74,000	78,798	2040/ 9/20
第34回	利付国債30年		2.2	89,000	97,003	2041/ 3/20
第35回	利付国債30年		2.0	57,000	60,231	2041/ 9/20
第36回	利付国債30年		2.0	117,000	123,198	2042/ 3/20
第37回	利付国債30年		1.9	138,000	142,667	2042/ 9/20
第38回	利付国債30年		1.8	146,000	148,044	2043/ 3/20
第39回	利付国債30年		1.9	75,000	77,013	2043/ 6/20
第40回	利付国債30年		1.8	76,000	76,702	2043/ 9/20
第41回	利付国債30年		1.7	58,000	57,460	2043/12/20
第42回	利付国債30年		1.7	97,000	95,811	2044/ 3/20
第43回	利付国債30年		1.7	90,000	88,629	2044/ 6/20
第44回	利付国債30年		1.7	87,000	85,412	2044/ 9/20
第45回	利付国債30年		1.5	140,000	132,323	2044/12/20
第46回	利付国債30年		1.5	141,000	132,807	2045/ 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 47回	利付国債30年		1.6	116,000	110,921	2045/ 6/20
第 48回	利付国債30年		1.4	100,000	91,903	2045/ 9/20
第 49回	利付国債30年		1.4	123,000	112,618	2045/12/20
第 50回	利付国債30年		0.8	141,000	113,861	2046/ 3/20
第 51回	利付国債30年		0.3	110,000	78,723	2046/ 6/20
第 52回	利付国債30年		0.5	140,000	104,522	2046/ 9/20
第 53回	利付国債30年		0.6	70,000	53,204	2046/12/20
第 54回	利付国債30年		0.8	77,000	61,012	2047/ 3/20
第 55回	利付国債30年		0.8	37,000	29,171	2047/ 6/20
第 56回	利付国債30年		0.8	94,000	73,794	2047/ 9/20
第 57回	利付国債30年		0.8	106,000	82,861	2047/12/20
第 58回	利付国債30年		0.8	125,000	97,298	2048/ 3/20
第 59回	利付国債30年		0.7	80,000	60,490	2048/ 6/20
第 60回	利付国債30年		0.9	193,000	152,510	2048/ 9/20
第 61回	利付国債30年		0.7	78,000	58,400	2048/12/20
第 62回	利付国債30年		0.5	110,000	77,727	2049/ 3/20
第 63回	利付国債30年		0.4	150,000	102,516	2049/ 6/20
第 64回	利付国債30年		0.4	110,000	74,726	2049/ 9/20
第 65回	利付国債30年		0.4	145,000	97,989	2049/12/20
第 66回	利付国債30年		0.4	103,000	69,191	2050/ 3/20
第 67回	利付国債30年		0.6	120,000	84,838	2050/ 6/20
第 68回	利付国債30年		0.6	127,000	89,282	2050/ 9/20
第 69回	利付国債30年		0.7	173,000	124,456	2050/12/20
第 70回	利付国債30年		0.7	110,000	78,768	2051/ 3/20
第 71回	利付国債30年		0.7	83,000	59,156	2051/ 6/20
第 72回	利付国債30年		0.7	149,000	105,699	2051/ 9/20
第 73回	利付国債30年		0.7	127,000	89,672	2051/12/20
第 74回	利付国債30年		1.0	89,000	68,070	2052/ 3/20
第 75回	利付国債30年		1.3	150,000	123,607	2052/ 6/20
第 76回	利付国債30年		1.4	151,000	127,258	2052/ 9/20
第 77回	利付国債30年		1.6	159,000	140,223	2052/12/20
第 78回	利付国債30年		1.4	229,000	191,952	2053/ 3/20
第 80回	利付国債30年		1.8	121,000	111,270	2053/ 9/20
第 81回	利付国債30年		1.6	152,000	132,971	2053/12/20
第 82回	利付国債30年		1.8	195,000	178,684	2054/ 3/20
第 83回	利付国債30年		2.2	42,000	42,037	2054/ 6/20
第 84回	利付国債20年		2.0	100,000	101,889	2025/12/20
第 86回	利付国債20年		2.3	126,000	129,351	2026/ 3/20
第 88回	利付国債20年		2.3	75,000	77,298	2026/ 6/20
第 91回	利付国債20年		2.3	119,000	123,166	2026/ 9/20
第 92回	利付国債20年		2.1	206,000	213,257	2026/12/20
第 95回	利付国債20年		2.3	160,000	167,769	2027/ 6/20

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 97回	利付国債20年		2.2	83,000	87,147	2027/ 9/20
第 99回	利付国債20年		2.1	113,000	118,740	2027/12/20
第101回	利付国債20年		2.4	155,000	164,978	2028/ 3/20
第103回	利付国債20年		2.3	132,000	140,570	2028/ 6/20
第106回	利付国債20年		2.2	144,000	153,318	2028/ 9/20
第108回	利付国債20年		1.9	30,000	31,678	2028/12/20
第110回	利付国債20年		2.1	94,000	100,308	2029/ 3/20
第112回	利付国債20年		2.1	24,000	25,677	2029/ 6/20
第113回	利付国債20年		2.1	26,000	27,893	2029/ 9/20
第114回	利付国債20年		2.1	24,000	25,840	2029/12/20
第116回	利付国債20年		2.2	115,000	124,800	2030/ 3/20
第120回	利付国債20年		1.6	70,000	73,899	2030/ 6/20
第121回	利付国債20年		1.9	85,000	91,367	2030/ 9/20
第123回	利付国債20年		2.1	59,000	64,261	2030/12/20
第124回	利付国債20年		2.0	25,000	27,081	2030/12/20
第126回	利付国債20年		2.0	50,000	54,273	2031/ 3/20
第128回	利付国債20年		1.9	82,000	88,665	2031/ 6/20
第130回	利付国債20年		1.8	86,000	92,554	2031/ 9/20
第132回	利付国債20年		1.7	40,000	42,837	2031/12/20
第133回	利付国債20年		1.8	100,000	107,775	2031/12/20
第134回	利付国債20年		1.8	49,000	52,879	2032/ 3/20
第135回	利付国債20年		1.7	86,000	92,203	2032/ 3/20
第137回	利付国債20年		1.7	203,000	217,723	2032/ 6/20
第139回	利付国債20年		1.6	32,000	34,088	2032/ 6/20
第140回	利付国債20年		1.7	137,000	147,081	2032/ 9/20
第141回	利付国債20年		1.7	128,000	137,436	2032/12/20
第144回	利付国債20年		1.5	74,000	78,287	2033/ 3/20
第145回	利付国債20年		1.7	55,000	59,072	2033/ 6/20
第146回	利付国債20年		1.7	216,000	231,850	2033/ 9/20
第147回	利付国債20年		1.6	181,000	192,515	2033/12/20
第148回	利付国債20年		1.5	128,000	134,823	2034/ 3/20
第149回	利付国債20年		1.5	305,000	320,805	2034/ 6/20
第150回	利付国債20年		1.4	312,000	324,695	2034/ 9/20
第152回	利付国債20年		1.2	88,000	89,529	2035/ 3/20
第153回	利付国債20年		1.3	249,000	255,202	2035/ 6/20
第154回	利付国債20年		1.2	210,000	212,662	2035/ 9/20
第155回	利付国債20年		1.0	212,000	209,790	2035/12/20
第156回	利付国債20年		0.4	121,000	111,635	2036/ 3/20
第157回	利付国債20年		0.2	185,000	165,848	2036/ 6/20
第158回	利付国債20年		0.5	244,000	225,751	2036/ 9/20
第159回	利付国債20年		0.6	268,000	249,896	2036/12/20
第160回	利付国債20年		0.7	187,000	175,776	2037/ 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161回	利付国債20年		0.6	120,000	110,940	2037/ 6/20
第162回	利付国債20年		0.6	219,000	201,515	2037/ 9/20
第163回	利付国債20年		0.6	185,000	169,417	2037/12/20
第164回	利付国債20年		0.5	193,000	173,609	2038/ 3/20
第165回	利付国債20年		0.5	302,000	270,247	2038/ 6/20
第166回	利付国債20年		0.7	217,000	198,637	2038/ 9/20
第167回	利付国債20年		0.5	261,000	231,222	2038/12/20
第168回	利付国債20年		0.4	179,000	155,420	2039/ 3/20
第169回	利付国債20年		0.3	197,000	167,513	2039/ 6/20
第170回	利付国債20年		0.3	179,000	151,285	2039/ 9/20
第171回	利付国債20年		0.3	199,000	167,261	2039/12/20
第172回	利付国債20年		0.4	205,000	174,190	2040/ 3/20
第173回	利付国債20年		0.4	205,000	173,140	2040/ 6/20
第174回	利付国債20年		0.4	237,000	199,070	2040/ 9/20
第175回	利付国債20年		0.5	136,000	115,546	2040/12/20
第176回	利付国債20年		0.5	141,000	119,159	2041/ 3/20
第177回	利付国債20年		0.4	83,000	68,558	2041/ 6/20
第178回	利付国債20年		0.5	241,000	201,456	2041/ 9/20
第179回	利付国債20年		0.5	205,000	170,422	2041/12/20
第180回	利付国債20年		0.8	214,000	186,646	2042/ 3/20
第181回	利付国債20年		0.9	202,000	178,493	2042/ 6/20
第182回	利付国債20年		1.1	176,000	160,300	2042/ 9/20
第183回	利付国債20年		1.4	190,000	181,216	2042/12/20
第184回	利付国債20年		1.1	188,000	169,935	2043/ 3/20
第185回	利付国債20年		1.1	342,000	307,940	2043/ 6/20
第187回	利付国債20年		1.3	175,000	162,079	2043/12/20
第188回	利付国債20年		1.6	163,000	158,313	2044/ 3/20
第189回	利付国債20年		1.9	165,000	167,880	2044/ 6/20
小 計				40,829,000	38,807,723	
(地方債証券)						
第 1回	東京都公募公債 (30年)		0.982	100,000	80,056	2047/ 9/20
第 15回	東京都公募公債 (20年)		2.32	100,000	106,568	2028/ 9/20
第 11回	神奈川県公募公債		2.08	100,000	106,591	2029/ 7/20
第 7回	大阪府公募公債 (20年)		1.84	100,000	107,200	2031/ 9/26
令和 2年度第7回	京都府公募公債		0.15	100,000	96,810	2030/ 9/17
兵庫県第23回	20年公募公債		1.26	100,000	101,540	2034/12/ 8
第 11回	20年静岡県公募公債		1.841	100,000	106,607	2030/10/18
第 31回	20年静岡県公募公債		0.434	100,000	81,877	2041/ 6/20
平成22年度第4回	愛知県公募公債		2.072	70,000	75,302	2030/ 6/14
平成27年度第3回	愛知県公募公債		1.115	100,000	99,762	2035/ 5/ 8
平成30年度第4回	埼玉県公募公債		0.205	100,000	98,584	2028/ 6/26
第 27回	埼玉県公募公債 (20年)		0.44	100,000	82,947	2040/12/11

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	101,366	2035/ 5/22
第 4回 千葉県公募公債	2.46	100,000	106,709	2028/ 6/20
令和 3年度第3回 新潟県公募公債	0.244	130,000	124,900	2032/ 2/27
第150回 共同発行市場公募地方債	0.51	100,000	100,117	2025/ 9/25
第176回 共同発行市場公募地方債	0.185	100,000	98,867	2027/11/25
第227回 共同発行市場公募地方債	0.244	150,000	144,120	2032/ 2/25
第254回 共同発行市場公募地方債	0.986	100,000	99,618	2034/ 5/25
令和元年度第1回 福島県公募公債	0.09	100,000	97,079	2029/11/29
令和 2年度第1回 静岡市公募公債	0.14	100,000	96,604	2030/11/18
第 19回 横浜市公募公債 (20年)	2.2	100,000	107,299	2029/ 8/31
第 23回 横浜市公募公債 (20年)	2.132	100,000	108,729	2031/ 3/20
平成23年度第9回 札幌市公募公債	1.493	100,000	102,169	2027/ 2/12
第 8回 地方公共団体金融機構債券	2.043	100,000	107,174	2030/ 6/28
F 149回 地方公共団体金融機構債券	1.145	100,000	100,772	2025/12/19
第144回 地方公共団体金融機構債券	0.16	100,000	95,934	2031/ 5/28
小 計		2,750,000	2,735,301	
(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	106,558	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	107,725	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	106,533	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	99,693	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	99,084	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	98,991	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	11,102	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	114,340	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	106,338	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	106,515	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	107,509	2031/ 9/19
第 21回 道路債券	2.75	100,000	114,621	2033/ 6/20
第 33回 日本高速道路保有 機構承継債	2.91	50,000	58,050	2034/ 6/20
第178回 都市再生債券	0.949	100,000	60,840	2061/ 3/18
第 51回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.64	17,056	17,473	2046/ 8/10
第 52回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.51	36,506	37,302	2046/ 9/10
第 53回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.48	19,344	19,767	2046/10/10
第 90回 住宅金融支援機構債券	1.595	100,000	102,111	2026/12/18
第 56回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.42	21,728	22,191	2047/ 1/10
第 60回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.34	23,444	23,866	2047/ 5/10
第125回 住宅金融支援機構債券	1.898	100,000	107,543	2033/ 1/25
第 84回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	1.01	32,269	32,241	2049/ 5/10
第 99回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.88	50,012	48,909	2050/ 8/10
第109回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.36	60,523	56,983	2051/ 6/10
第138回 貸付債権担保住宅金融支援機構債券	0.5	70,597	65,967	2053/11/10

当		期	末			
銘	柄	名	利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
(特殊債券(除く金融債))						
第152回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.33	78,356	71,823	2055/ 1/10
第178回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		0.48	87,196	80,433	2057/ 3/10
第205回	貸付債権担保住宅金融支援機構債券		1.3	98,082	98,032	2059/ 6/10
第149回	鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券		0.429	100,000	80,562	2041/ 8/30
小 計				2,155,113	2,163,109	
(金融債券)						
利附第387回	しんきん中金債券5年		0.09	100,000	98,758	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	99,202	2026/10/23
第552回	東北電力(一般担保付)		0.864	100,000	100,039	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	99,207	2027/ 4/26
第 18回	セブン&アイ・ホールディングス無担保社債		1.04	100,000	99,888	2030/11/ 1
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	96,324	2030/ 6/11
第 16回	武田薬品工業無担保社債		0.4	100,000	94,818	2031/10/14
第 23回	パナソニック無担保社債		0.39	100,000	95,905	2030/12/24
第 32回	いすゞ自動車無担保社債		0.11	100,000	98,783	2026/ 9/29
第 13回	住友信託銀行(劣後特約付)		2.341	100,000	101,814	2026/ 6/15
第 7回	みずほリース無担保社債		0.33	100,000	98,354	2028/ 1/20
第 38回	N T Tファイナンス無担保社債		1.398	100,000	101,907	2034/ 9/20
第 64回	三菱HCキャピタル無担保社債		0.474	100,000	98,250	2028/10/18
第 63回	三井不動産無担保社債		0.374	100,000	98,058	2028/10/30
第 46回	東海旅客鉄道無担保社債		2.157	100,000	106,464	2029/12/18
第 21回	東京地下鉄(一般担保付)		0.975	100,000	77,770	2047/ 1/31
第 50回	西日本鉄道無担保社債		0.395	100,000	98,391	2028/ 9/ 6
第 72回	電源開発無担保社債		0.35	100,000	95,541	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	100,017	2025/12/15
小 計				1,800,000	1,760,732	
合 計				47,634,113	45,565,624	

(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

2024年10月28日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公 社 債	45,565,624	99.1
コール・ローン等、その他	418,856	0.9
投資信託財産総額	45,984,480	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

2024年10月28日現在

項 目	当 期 末
	円
(A) 資 産	45,984,480,269
コール・ローン等	232,968,610
公社債(評価額)	45,565,624,720
未収入金	101,693,000
未収利息	79,876,690
前払費用	4,317,249
(B) 負 債	100,960,000
未払金	100,000,000
未払解約金	960,000
(C) 純資産総額(A-B)	45,883,520,269
元 本	38,983,592,105
次期繰越損益金	6,899,928,164
(D) 受益権総口数	38,983,592,105口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,770円

## ◎損益の状況

自 2023年10月28日  
至 2024年10月28日

項 目	当 期
	円
(A) 配 当 等 収 益	357,053,942
受 取 利 息	357,145,739
支 払 利 息	△ 91,797
(B) 有 価 証 券 売 買 損 益	△ 524,767,530
売 買 益	116,386,441
売 買 損	△ 641,153,971
(C) 信 託 報 酬 等	△ 5,940
(D) 当 期 損 益 金 (A+B+C)	△ 167,719,528
(E) 前 期 繰 越 損 益 金	6,566,001,769
(F) 追 加 信 託 差 損 益 金	953,385,254
(G) 解 約 差 損 益 金	△ 451,739,331
(H) 計 (D+E+F+G)	6,899,928,164
次 期 繰 越 損 益 金 (H)	6,899,928,164

- (注1) 当親ファンドの期首元本額は36,230,918,028円、期中追加設定元本額は5,100,064,746円、期中一部解約元本額は2,347,390,669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37,924,127,573円、明治安田DC日本債券パッシブファンド1,059,464,532円です。
- (注3) 1口当たり純資産額は1,1770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。