

# 第10回 公社債投資信託

## 運用報告書(全体版)

第60期（決算日2021年10月19日）

作成対象期間（2020年10月20日～2021年10月19日）

### 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り、厚く御礼申し上げます。  
当作成対象期間の運用状況等についてご報告申し上げます。  
今後とも一層のお引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                                                                                                            |
| 信 託 期 間 | 無期限とします。                                                                                                               |
| 運 用 方 針 | 公社債への投資により、安定した収益の確保を目指して安定運用を行ないます。また、各前期末までに金利水準、想定されるポートフォリオのインカム収入等を基に、各期の目標分配額を定め、その目標分配額の実現を目指して運用を行なうことを基本とします。 |
| 主な投資対象  | 円建ての公社債（国債、政府保証債、地方債、金融債、事業債等）を主要投資対象とします。                                                                             |
| 主な投資制限  | 外貨建資産への投資割合には制限を設けません。                                                                                                 |
| 分 配 方 針 | 年1回決算を行ない、決算日の分配前の基準価額が元本（1万口当たり1万円）を超過する分を原則として全額分配します。決算日の分配前の基準価額が元本を下回っている場合、分配を行ないません。                            |

### 野村アセットマネジメント

東京都江東区豊洲二丁目2番1号



サポートダイヤル 0120-753104  
〈受付時間〉営業日の午前9時～午後5時

ホームページ <http://www.nomura-am.co.jp/>

## ○最近 3 期の運用実績

| 決 算 期            | 基 準<br>(分配落) | 価 額 |      |                | 新株予約権付社債<br>( 転 換 社 債 )<br>組 入 比 率 | 債 券<br>組 入 比 率 | 純 資 産<br>総 額 |
|------------------|--------------|-----|------|----------------|------------------------------------|----------------|--------------|
|                  |              | 税 分 | 込 配  | み 金<br>騰 落 中 率 |                                    |                |              |
|                  | 円            |     | 円 銭  | %              | %                                  | %              | 百万円          |
| 58期(2019年10月21日) | 9,996        |     | 0.00 | △0.0           | —                                  | 80.9           | 24,673       |
| 59期(2020年10月19日) | 9,995        |     | 0.00 | △0.0           | —                                  | 80.2           | 23,164       |
| 60期(2021年10月19日) | 9,995        |     | 0.00 | 0.0            | —                                  | 71.8           | 21,766       |

\*当ファンドは、決算時の元本の安定性に最大限配慮しつつ、目標分配額の実現を目指して運用を行なうことを基本としており、ベンチマーク等はありません。

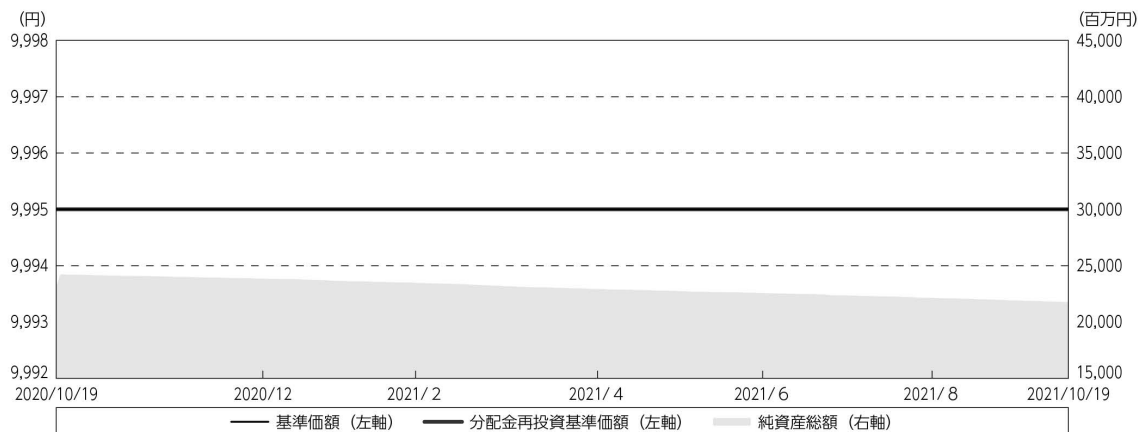
## ○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日                | 基 準   | 価 額 |     | 新株予約権付社債<br>( 転 換 社 債 )<br>組 入 比 率 | 債 券<br>組 入 比 率 |
|----------------------|-------|-----|-----|------------------------------------|----------------|
|                      |       | 騰 落 | 率   |                                    |                |
| (期 首)<br>2020年10月19日 | 円     |     | %   | %                                  | %              |
|                      | 9,995 |     | —   | —                                  | 80.2           |
| 10月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 76.9           |
| 11月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 77.6           |
| 12月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 76.9           |
| 2021年 1 月末           | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 75.0           |
| 2 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 76.4           |
| 3 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 72.2           |
| 4 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 73.8           |
| 5 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 73.0           |
| 6 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 71.0           |
| 7 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 71.2           |
| 8 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 70.5           |
| 9 月末                 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 70.3           |
| (期 末)<br>2021年10月19日 | 9,995 |     | 0.0 | —                                  | 71.8           |

\*騰落率は期首比です。

## ◎運用経過

### ○期中の基準価額等の推移



期 首：9,995円

期 末：9,995円（既払分配金（税込み）：0円00銭）

騰落率： 0.0%（分配金再投資ベース）

（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。作成期首（2020年10月19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）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、個々のお客様の損益の状況を示すものではありません。

（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。

### ○基準価額の主な変動要因

基準価額は一定で推移しました。

## ○投資環境

国内経済は、新型コロナウイルス感染症の影響により依然として厳しい状況にある中で、持ち直しの動きが続いているものの、一部消費や雇用環境に弱さが見られました。このような中、日本銀行は「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を継続し、2021年3月には、金融緩和の点検結果とその対応を公表しました。

1年国債金利は、期を通して概ね－0.1%前後で推移しました。

## ○当ファンドのポートフォリオ

決算時の元本の安定性に最大限配慮し、運用致しました。

ポートフォリオに関しては、A格以上の信用力の高い発行体が発行する債券やコマーシャル・ペーパー（CP）を中心に組み入れるとともに、コール・ローン等で流動性を確保しました。

期末時点における組入比率は債券71.8%、CP20.7%となり、ポートフォリオの平均残存期間は0.36年となりました。

## ○当ファンドのベンチマークとの差異

当ファンドは、決算時の元本の安定性に最大限配慮しつつ、目標分配額の実現を目指して運用を行なうことを基本としており、ベンチマーク等はありません。

グラフは、期中の当ファンドの期別基準価額騰落率です。



(注) 基準価額の騰落率は分配金込みです。

## ◎分配金

決算時の純資産総額が元本の額を下回ったことから、分配を行ないませんでした。

## ◎今後の運用方針

当ファンドは安定した収益の確保を目指し、安定運用を行なうという方針のもと、残存1年以内の公社債を中心にポートフォリオを構築することを基本とします。

日本銀行によるマイナス金利政策のもと、主要な投資対象となる公社債の利回りや余資運用の際のコール・ローンの金利もマイナスとなる中、残存期間1年以内の公社債を中心に短期金融資産も含めマイナス幅の小さい投資対象を選定し、運用することを目指します。

マイナス利回りの資産への投資等を通じて、基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

また、第61期の目標分配額は1万口当たり0円程度と致しました。

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。

※マイナス利回りの資産への投資等を通じてファンド全体の損益がマイナスとなった場合は、ファンドの基準価額が下落することが想定されますのでご注意ください。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

(2020年10月20日～2021年10月19日)

| 項 目                  | 当 期    |            | 項 目 の 概 要                                         |
|----------------------|--------|------------|---------------------------------------------------|
|                      | 金 額    | 比 率        |                                                   |
| (a) 信 託 報 酬          | 円<br>0 | %<br>0.001 | (a)信託報酬＝1万口当たり元本×信託報酬率                            |
| ( 投 信 会 社 )          | (0)    | (0.000)    | ファンドの運用とそれに伴う調査、受託会社への指図、法定書面等の作成、基準価額の算出等        |
| ( 販 売 会 社 )          | (0)    | (0.001)    | 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および事務手続き等      |
| ( 受 託 会 社 )          | (0)    | (0.000)    | ファンドの財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行等                       |
| (b) そ の 他 費 用        | 0      | 0.001      | (b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数                      |
| ( 保 管 費 用 )          | (0)    | (0.001)    | 保管費用は、海外における保管銀行等に支払う有価証券等の保管及び資金の送金・資産の移転等に要する費用 |
| ( 監 査 費 用 )          | (0)    | (0.000)    | 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)    | 信託事務の処理に要するその他の諸費用                                |
| 合 計                  | 0      | 0.002      |                                                   |
| 期中の平均基準価額は、9,995円です。 |        |            |                                                   |

\* 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。

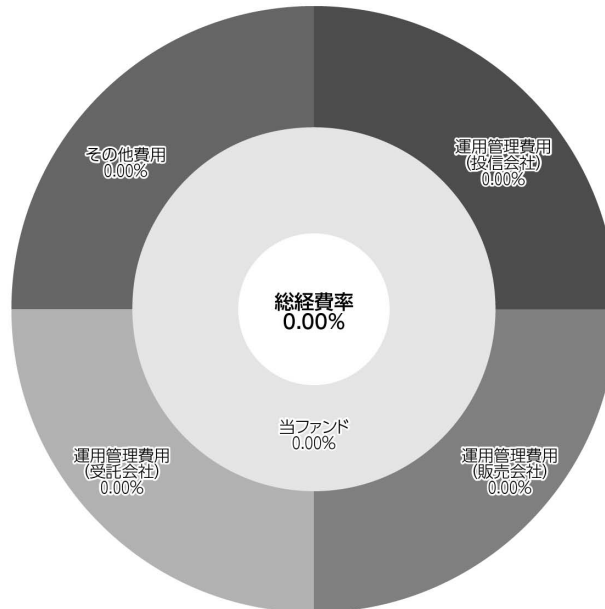
\* 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

\* 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

当期中の運用・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0.00%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

(2020年10月20日～2021年10月19日)

## 公社債

|        |                | 買 付 額           | 売 付 額                  |
|--------|----------------|-----------------|------------------------|
| 国<br>内 | 地方債証券          | 千円<br>1,004,793 | 千円<br>—<br>(5,525,000) |
|        | 特殊債券           | 11,421,577      | —<br>(8,700,000)       |
|        | 社債券（投資法人債券を含む） | 4,213,420       | —<br>(5,300,000)       |

\*金額は受け渡し代金。（経過利子分は含まれておりません。）

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

\*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。

## その他有価証券

|        |             | 買 付 額            | 売 付 額                   |
|--------|-------------|------------------|-------------------------|
| 国<br>内 | コマーシャル・ペーパー | 千円<br>20,999,805 | 千円<br>—<br>(19,000,000) |

\*金額は受け渡し代金。

\*単位未満は切り捨て。

\*（ ）内は償還等による増減分です。

## ○利害関係人との取引状況等

(2020年10月20日～2021年10月19日)

## 利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等<br>A |                    |                    | 売付額等<br>C | うち利害関係人<br>との取引状況D |                    |
|-----|-----------|--------------------|--------------------|-----------|--------------------|--------------------|
|     | 百万円       | うち利害関係人<br>との取引状況B | $\frac{B}{A}$<br>% |           | 百万円                | $\frac{D}{C}$<br>% |
| 公社債 | 16,639    | 203                | 1.2                | —         | —                  | —                  |

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、当ファンドに係る利害関係人とは野村證券株式会社です。



(2021年10月19日現在)

## ○組入資産の明細

## 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<br>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           | %       | %                  | %         | %    | %      |
| 地方債証券      | 1,900,000    | 1,902,893    | 8.7     | —                  | —         | —    | 8.7    |
|            | ( 1,900,000) | ( 1,902,893) | ( 8.7)  | (—)                | (—)       | (—)  | ( 8.7) |
| 特殊債券       | 6,700,000    | 6,708,930    | 30.8    | —                  | —         | —    | 30.8   |
| (除く金融債)    | ( 6,700,000) | ( 6,708,930) | (30.8)  | (—)                | (—)       | (—)  | (30.8) |
| 金融債券       | 3,300,000    | 3,300,548    | 15.2    | —                  | —         | —    | 15.2   |
|            | ( 3,300,000) | ( 3,300,548) | (15.2)  | (—)                | (—)       | (—)  | (15.2) |
| 普通社債券      | 3,700,000    | 3,713,006    | 17.1    | —                  | —         | —    | 17.1   |
| (含む投資法人債券) | ( 3,700,000) | ( 3,713,006) | (17.1)  | (—)                | (—)       | (—)  | (17.1) |
| 合 計        | 15,600,000   | 15,625,379   | 71.8    | —                  | —         | —    | 71.8   |
|            | (15,600,000) | (15,625,379) | (71.8)  | (—)                | (—)       | (—)  | (71.8) |

\* ( )内は非上場債で内書きです。

\* 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

\* 残存期間が1年以内の公社債は原則として償却原価法により評価しています。

## (B) 国内（邦貨建）公社債 銘柄別開示

| 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        |             |
| 大阪府                         | 公募（5年）第140回     | 0.001 | 200,000   | 200,031   | 2022/ 7 /28 |
| 兵庫県                         | 公募平成24年度第1回     | 1.02  | 100,000   | 100,482   | 2022/ 4 /13 |
| 静岡県                         | 公募平成23年度第8回     | 1.025 | 100,000   | 100,018   | 2021/10/25  |
| 愛知県                         | 公募平成23年度第20回    | 1.082 | 100,000   | 100,474   | 2022/ 3 /29 |
| 埼玉県                         | 公募平成23年度第6回     | 1.02  | 200,000   | 200,046   | 2021/10/27  |
| 共同発行市場地方債 公募第103回           |                 | 1.0   | 200,000   | 200,046   | 2021/10/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第104回           |                 | 1.03  | 100,000   | 100,102   | 2021/11/25  |
| 共同発行市場地方債 公募第110回           |                 | 0.89  | 100,000   | 100,525   | 2022/ 5 /25 |
| 共同発行市場地方債（1年）公募第1回          |                 | 0.001 | 100,000   | 99,995    | 2022/ 4 /14 |
| 熊本県                         | 公募平成23年度第2回     | 1.0   | 100,000   | 100,033   | 2021/10/28  |
| 川崎市                         | 公募（15年）第4回      | 2.11  | 300,000   | 301,090   | 2021/12/20  |
| 広島市                         | 公募（5年）平成29年度第1回 | 0.01  | 100,000   | 100,002   | 2022/ 6 /24 |
| 仙台市                         | 公募平成28年度第1回     | 0.02  | 100,000   | 100,011   | 2022/ 1 /27 |
| 福井県                         | 公募平成23年度第1回     | 1.0   | 100,000   | 100,033   | 2021/10/28  |
| 小計                          |                 |       | 1,900,000 | 1,902,893 |             |
| 特殊債券(除く金融債)                 |                 |       |           |           |             |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第105回       |                 | 0.001 | 100,000   | 99,992    | 2022/ 6 /20 |
| 日本政策投資銀行社債 財投機関債第110回       |                 | 0.001 | 200,000   | 199,983   | 2022/ 9 /20 |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第81回 |                 | 1.03  | 300,000   | 300,538   | 2021/12/20  |
| 日本高速道路保有・債務返済機構債券 財投機関債第87回 |                 | 0.893 | 200,000   | 201,178   | 2022/ 6 /20 |
| 地方公共団体金融機構債券 第32回           |                 | 0.991 | 100,000   | 100,272   | 2022/ 1 /28 |
| 地方公共団体金融機構債券 第33回           |                 | 1.035 | 200,000   | 200,755   | 2022/ 2 /28 |
| 地方公共団体金融機構債券 第38回           |                 | 0.835 | 500,000   | 503,282   | 2022/ 7 /28 |
| 地方公共団体金融機構債券 F257回          |                 | 0.335 | 100,000   | 100,306   | 2022/ 9 /28 |
| 地方公共団体金融機構債券（5年）第20回        |                 | 0.001 | 200,000   | 199,999   | 2021/10/28  |
| 日本政策金融公庫社債 第81回財投機関債        |                 | 0.001 | 300,000   | 300,000   | 2021/11/8   |
| 日本政策金融公庫社債 第85回財投機関債        |                 | 0.001 | 600,000   | 600,122   | 2022/ 8 /8  |
| 国際協力銀行社債 財投機関債第3回           |                 | 0.03  | 100,000   | 100,011   | 2022/ 6 /20 |
| 福祉医療機構債券 第29回財投機関債          |                 | 1.145 | 100,000   | 100,199   | 2021/12/20  |
| 福祉医療機構債券 第55回財投機関債          |                 | 0.001 | 100,000   | 100,007   | 2021/12/20  |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第98回        |                 | 1.031 | 100,000   | 100,420   | 2022/ 3 /18 |
| 住宅金融支援機構債券 財投機関債第163回       |                 | 0.263 | 300,000   | 300,713   | 2022/ 8 /19 |
| 日本学生支援債券 財投機関債第57回          |                 | 0.001 | 100,000   | 100,003   | 2021/11/19  |
| 日本学生支援債券 財投機関債第58回          |                 | 0.001 | 700,000   | 700,043   | 2022/ 2 /18 |
| 日本学生支援債券 財投機関債第60回          |                 | 0.001 | 400,000   | 400,074   | 2022/ 9 /20 |
| 日本学生支援債券 財投機関債第61回          |                 | 0.001 | 200,000   | 199,980   | 2022/11/18  |
| 東日本高速道路 第39回                |                 | 0.03  | 300,000   | 300,037   | 2021/12/20  |
| 東日本高速道路 第42回                |                 | 0.07  | 100,000   | 100,056   | 2022/ 6 /20 |
| 東日本高速道路 第44回                |                 | 0.09  | 800,000   | 800,585   | 2022/ 6 /20 |
| 東日本高速道路 第82回                |                 | 0.001 | 100,000   | 99,992    | 2022/ 7 /15 |
| 中日本高速道路社債 第59回              |                 | 0.309 | 200,000   | 200,116   | 2021/12/20  |
| 中日本高速道路 第69回                |                 | 0.07  | 200,000   | 200,078   | 2022/ 3 /18 |
| 鉄道建設・運輸施設整備支援機構債券 財投機関債第45回 |                 | 1.05  | 100,000   | 100,176   | 2021/12/20  |
| 小計                          |                 |       | 6,700,000 | 6,708,930 |             |
| 金融債券                        |                 |       |           |           |             |
| 商工債券 利付第804回い号              |                 | 0.06  | 200,000   | 200,042   | 2022/ 5 /27 |

| 銘                              |                   | 柄 | 当 期 末 |            |            |             |
|--------------------------------|-------------------|---|-------|------------|------------|-------------|
|                                |                   |   | 利 率   | 額 面 金 額    | 評 価 額      | 償 還 年 月 日   |
| 金融債券                           |                   |   | %     | 千円         | 千円         |             |
| 商工債券                           | 利付第806回い号         |   | 0.1   | 100,000    | 100,084    | 2022/ 7 /27 |
| 商工債券                           | 利付第807回い号         |   | 0.1   | 100,000    | 100,092    | 2022/ 8 /26 |
| 農林債券                           | 利付第798回い号         |   | 0.03  | 200,000    | 200,010    | 2021/11/26  |
| しんきん中金債券                       | 利付第323回           |   | 0.03  | 200,000    | 200,007    | 2021/10/27  |
| しんきん中金債券                       | 利付第325回           |   | 0.04  | 100,000    | 100,011    | 2021/12/27  |
| しんきん中金債券                       | 利付第326回           |   | 0.05  | 500,000    | 500,057    | 2022/ 1 /27 |
| しんきん中金債券                       | 利付第327回           |   | 0.06  | 100,000    | 100,019    | 2022/ 2 /25 |
| しんきん中金債券                       | 利付第328回           |   | 0.06  | 600,000    | 600,170    | 2022/ 3 /25 |
| しんきん中金債券                       | 利付第330回           |   | 0.06  | 100,000    | 100,022    | 2022/ 5 /27 |
| 商工債券                           | 利付（3年）第230回       |   | 0.09  | 100,000    | 100,021    | 2022/ 3 /25 |
| 商工債券                           | 利付（3年）第234回       |   | 0.06  | 500,000    | 500,102    | 2022/ 7 /27 |
| 商工債券                           | 利付（3年）第236回       |   | 0.02  | 100,000    | 99,990     | 2022/ 9 /27 |
| 商工債券                           | 利付（3年）第237回       |   | 0.01  | 400,000    | 399,916    | 2022/10/27  |
| 小 計                            |                   |   |       | 3,300,000  | 3,300,548  |             |
| 普通社債券(含む投資法人債券)                |                   |   |       |            |            |             |
| 東京三菱銀行                         | 第57回特定社債間限定同順位特約付 |   | 2.22  | 100,000    | 102,216    | 2022/10/27  |
| 東日本旅客鉄道                        | 第21回社債間限定同順位特約付   |   | 2.02  | 500,000    | 509,208    | 2022/ 9 /20 |
| 東海旅客鉄道                         | 第9回社債間限定同順位特約付    |   | 1.74  | 100,000    | 101,582    | 2022/ 9 /20 |
| MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE |                   |   | 0.01  | 400,000    | 400,000    | 2021/11/5   |
| MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE |                   |   | 0.01  | 200,000    | 200,000    | 2021/11/18  |
| MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE |                   |   | 0.01  | 400,000    | 400,000    | 2021/11/19  |
| SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE |                   |   | 0.01  | 400,000    | 400,000    | 2021/11/24  |
| SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE |                   |   | 0.01  | 200,000    | 200,000    | 2021/12/14  |
| MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE |                   |   | 0.01  | 200,000    | 200,000    | 2022/ 1 /12 |
| MITSUBISHI UFJ LEASE & FINANCE |                   |   | 0.01  | 300,000    | 300,000    | 2022/ 1 /25 |
| SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE |                   |   | 0.01  | 100,000    | 100,000    | 2022/ 3 /24 |
| SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE |                   |   | 0.01  | 300,000    | 300,000    | 2022/ 6 /9  |
| MITSUBISHI HC CAPITAL INC      |                   |   | 0.01  | 100,000    | 100,000    | 2022/ 7 /5  |
| SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE |                   |   | 0.01  | 200,000    | 200,000    | 2022/ 7 /12 |
| SUMITOMO MITSUI FINANCE AND LE |                   |   | 0.01  | 100,000    | 100,000    | 2022/ 8 /2  |
| MITSUBISHI HC CAPITAL INC      |                   |   | 0.01  | 100,000    | 100,000    | 2022/ 8 /2  |
| 小 計                            |                   |   |       | 3,700,000  | 3,713,006  |             |
| 合 計                            |                   |   |       | 15,600,000 | 15,625,379 |             |

\* 額面・評価額の単位未満は切り捨て。

## 国内その他有価証券

| 区 分         | 当 期 末           |           |
|-------------|-----------------|-----------|
|             | 評 価 額           | 比 率       |
| コマーシャル・ペーパー | 千円<br>4,499,921 | %<br>20.7 |

\* 比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

\* 金額の単位未満は切り捨て。

(2021年10月19日現在)

## ○投資信託財産の構成

| 項 目          | 当 期 末            |           |
|--------------|------------------|-----------|
|              | 評 価 額            | 比 率       |
| 公社債          | 千円<br>15,625,379 | %<br>68.5 |
| その他有価証券      | 4,499,921        | 19.7      |
| コール・ローン等、その他 | 2,674,326        | 11.8      |
| 投資信託財産総額     | 22,799,626       | 100.0     |

\*金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 (2021年10月19日現在)

| 項 目             | 当 期 末           |
|-----------------|-----------------|
|                 | 円               |
| (A) 資産          | 22,799,626,243  |
| コール・ローン等        | 2,262,642,268   |
| 地方債証券(評価額)      | 1,902,893,885   |
| 特殊債証券(評価額)      | 10,009,478,673  |
| 社債証券(評価額)       | 3,713,006,973   |
| その他有価証券         | 4,499,921,221   |
| 未収入金            | 400,000,000     |
| 未収利息            | 8,637,178       |
| 前払費用            | 3,046,045       |
| (B) 負債          | 1,032,979,114   |
| 未払金             | 999,999,523     |
| 未払解約金           | 32,721,333      |
| 未払信託報酬          | 253,598         |
| 未払利息            | 2,275           |
| その他未払費用         | 2,385           |
| (C) 純資産総額(A-B)  | 21,766,647,129  |
| 元本              | 21,777,444,492  |
| 次期繰越損益金         | △ 10,797,363    |
| (D) 受益権総口数      | 21,777,444,492口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 9.995円          |

(注) 期首元本額は23,175,635,098円、期中追加設定元本額は1,073,847,046円、期中一部解約元本額は2,472,037,652円、1口当たり純資産額は0.9995円です。

## ○損益の状況 (2020年10月20日～2021年10月19日)

| 項 目             | 当 期         |
|-----------------|-------------|
|                 | 円           |
| (A) 受取利息等収益     | 61,517,214  |
| 受取利息            | 62,067,735  |
| 支払利息            | △ 550,521   |
| (B) 有価証券売買損益    | △61,772,468 |
| 売買益             | 464,534     |
| 売買損             | △62,237,002 |
| (C) 信託報酬等       | △ 568,735   |
| (D) 当期利益(A+B+C) | △ 823,989   |
| (E) 前期繰越損益金     | △ 9,919,324 |
| (F) 追加信託差損益金    | △ 1,050,615 |
| (G) 解約差損益金      | 996,565     |
| (H) 計(D+E+F+G)  | △10,797,363 |
| (I) 収益分配金       | 0           |
| 次期繰越損益金(H+I)    | △10,797,363 |

\*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。

## ○分配金のお知らせ

|                |         |
|----------------|---------|
| 1万口当たり分配金(税込み) | 0円00銭0厘 |
|----------------|---------|

## ○お知らせ

該当事項はございません。