

iFree 日本債券 インデックス

運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2020年11月30日）
（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の公社債等に投資し、投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況を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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
(営業日の9:00~17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★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	無期限	
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 総合指数		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
1 期末(2016年11月30日)	円 9,914	円 0	% △0.9	9,921	% △0.8	% 96.9	% -	百万円 49
2 期末(2017年11月30日)	9,849	0	△0.7	9,876	△0.4	99.0	-	120
3 期末(2018年11月30日)	9,860	0	0.1	9,902	0.3	98.5	-	145
4 期末(2019年12月 2 日)	10,074	0	2.2	10,138	2.4	99.1	-	175
5 期末(2020年11月30日)	9,981	0	△0.9	10,055	△0.8	99.1	-	263

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NOMURA-BPI 総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。NOMURA-BPI は、野村証券株式会社が公表している、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

NOMURA-BPI に関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注6) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- *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。
- *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（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。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。
- *ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数です。

■基準価額・騰落率

期首：10,074円

期末：9,981円（分配金0円）

騰落率：△0.9%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

金利の上昇により債券価格が下落したため、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合指数 (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2019年12月2日	円 10,074	% -	10,138	% -	% 99.1	% -
12月末	10,070	△0.0	10,133	△0.0	99.1	-
2020年1月末	10,114	0.4	10,175	0.4	98.4	-
2月末	10,194	1.2	10,253	1.1	99.1	-
3月末	10,029	△0.4	10,089	△0.5	99.2	-
4月末	10,062	△0.1	10,124	△0.1	99.1	-
5月末	10,014	△0.6	10,081	△0.6	98.8	-
6月末	9,973	△1.0	10,040	△1.0	99.3	-
7月末	10,006	△0.7	10,075	△0.6	99.2	-
8月末	9,959	△1.1	10,028	△1.1	98.8	-
9月末	9,986	△0.9	10,057	△0.8	99.1	-
10月末	9,969	△1.0	10,042	△0.9	99.2	-
(期末) 2020年11月30日	9,981	△0.9	10,055	△0.8	99.1	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2019.12.3～2020.11.30)

■国内債券市況

国内債券市場では、当作成期を通して見ると長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、市場のリスク回避姿勢が強まったことから、長期金利は低下しました。その後、日本政府の経済対策に伴う国債増発懸念などを受け、金利は上昇しました。2020年4月以降はおおむねレンジ内で推移しましたが、8月は米国の金利が上昇したことなどから、長期金利は上昇しました。9月には、米国の追加経済対策の協議難航や欧州での新型コロナウイルス感染再拡大への懸念などを背景に、国内金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）」の受益証券を中心に組み入れ、ベンチマーク（NOMURA-B P I総合指数）に連動することをめざした運用を行います。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

ベンチマーク（NOMURA-B P I総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入出や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

ポートフォリオについて

(2019.12.3～2020.11.30)

■当ファンド

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の受益証券を高位に組み入れ、ベンチマークに連動することをめざした運用を行いました。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

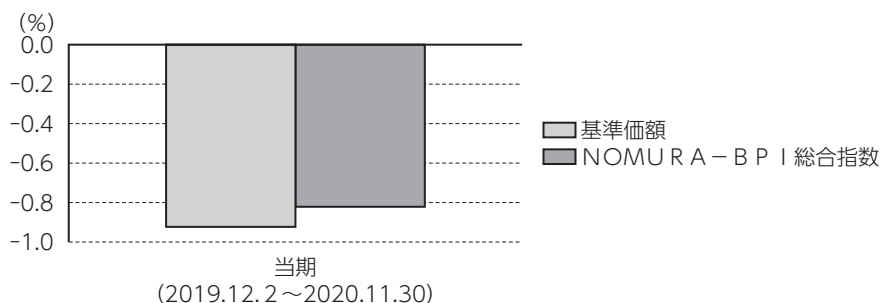
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 0.8\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 0.9\%$ となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は $\Delta 0.1\%$ でした。差異の内訳は、信託報酬要因によるベンチマークとの差異が $\Delta 0.1\%$ 程度となっており、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2019年12月3日 ～2020年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	49

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の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、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の受益証券を中心に組み入れ、ベンチマークに連動することをめざした運用を行います。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2019.12.3~2020.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	13円	0.131%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は10,021円です。
(投 信 会 社)	(5)	(0.049)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(7)	(0.071)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	—	—	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成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関するその他の費用
合 計	14	0.136	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の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を四捨五入してあります。

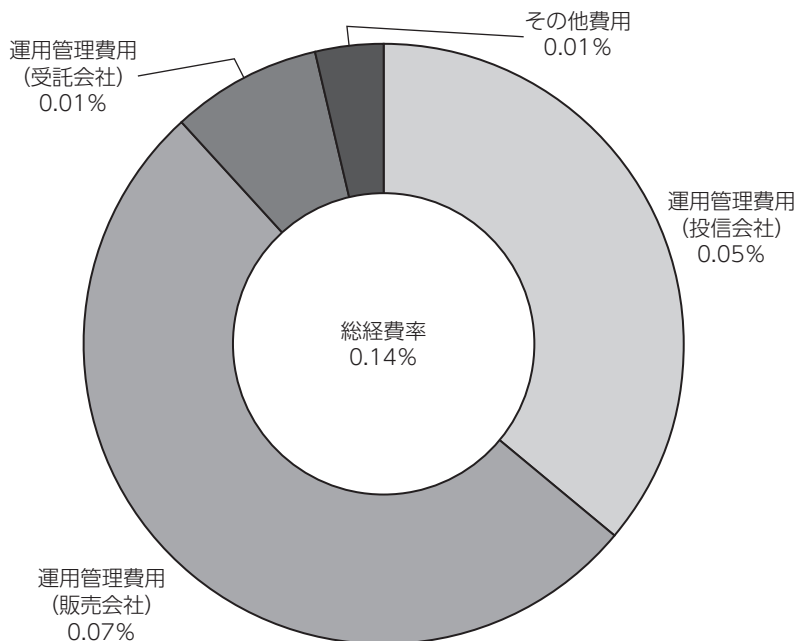
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直前の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・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口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.14%です。



(注1) 1万口当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。

■売買および取引の状況

親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I)	147,808	191,375	78,638	102,283

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C		
公社債	百万円 7,527	百万円 196	% 2.6	百万円 3,554	百万円 100	% 2.8
コール・ローン	35,622	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.8%

*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。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類	当 期	
	買 付 額	付 額
公社債		百万円 100

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当作成期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

*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あり、当作成期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首		当 期 末	
	口 数	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)	134,453	203,623	203,623	262,939

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I)	262,939	99.8
コール・ローン等、その他	505	0.2
投資信託財産総額	263,445	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	263,445,405円
コール・ローン等	505,900
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	262,939,505
(B) 負債	245,497
未払解約金	127,135
未払信託報酬	113,737
その他未払費用	4,625
(C) 純資産総額(A - B)	263,199,908
元本	263,701,548
次期繰越損益金	△ 501,640
(D) 受益権総口数	263,701,548口
1万口当り基準価額(C / D)	9,981円

*期首における元本額は173,888,340円、当作成期間中における追加設定元本額は211,303,020円、同解約元本額は121,489,812円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,981円です。

*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は501,640円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 20円
受取利息	1
支払利息	△ 21
(B) 有価証券売買損益	△1,073,340
売買益	498,893
売買損	△1,572,233
(C) 信託報酬等	△ 237,572
(D) 当期損益金(A + B + C)	△1,310,932
(E) 前期繰越損益金	395,659
(F) 追加信託差損益金	413,633
(配当等相当額)	(906,578)
(売買損益相当額)	(△ 492,945)
(G) 合計(D + E + F)	△ 501,640
次期繰越損益金(G)	△ 501,640
追加信託差損益金	413,633
(配当等相当額)	(906,578)
(売買損益相当額)	(△ 492,945)
分配準備積立金	395,689
繰越損益金	△1,310,962

(注1) 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おります。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程(総額)」をご参照ください。

■収益分配金の計算過程(総額)

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	906,578
(d) 分配準備積立金	395,689
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,302,267
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,302,267
(h) 受益権総口数	263,701,548口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

運用報告書 第16期（決算日 2020年11月30日）

（作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）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。

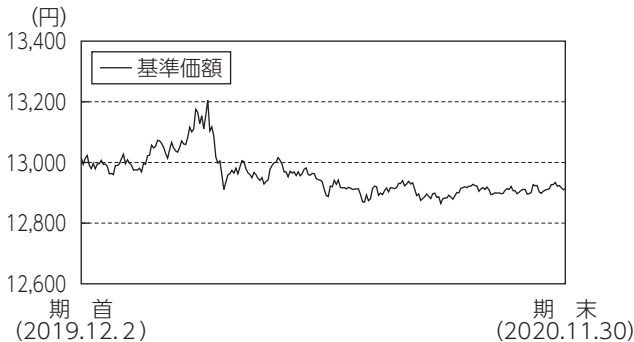
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成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 指 数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	%	ベンチマーク	%		
(期首)2019年12月2日	13,016	-	13,043	-	99.2	-
12月末	13,012	△0.0	13,037	△0.0	99.2	-
2020年1月末	13,071	0.4	13,092	0.4	98.5	-
2月末	13,175	1.2	13,191	1.1	99.2	-
3月末	12,963	△0.4	12,981	△0.5	99.3	-
4月末	13,007	△0.1	13,025	△0.1	99.2	-
5月末	12,947	△0.5	12,970	△0.6	98.9	-
6月末	12,895	△0.9	12,917	△1.0	99.4	-
7月末	12,940	△0.6	12,963	△0.6	99.2	-
8月末	12,880	△1.0	12,902	△1.1	98.9	-
9月末	12,917	△0.8	12,939	△0.8	99.2	-
10月末	12,896	△0.9	12,920	△0.9	99.3	-
(期末)2020年11月30日	12,913	△0.8	12,936	△0.8	99.2	-

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) NOMURA-BPI総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。

上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：13,016円 期末：12,913円 騰落率：△0.8%

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇により債券価格が下落したため、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場では、当作成期を通して見ると長期金利は上昇(債券価格は下落)しました。

当作成期首より、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、市場のリスク回避姿勢が強まったことから、長期金利は低下しました。その後、日本政府の経済対策に伴う国債増発懸念などを受けて、金利は上昇しました。2020年4月以降はおおむねレンジ内で推移しましたが、8月は米国の金利が上昇したことなどから、長期金利は上昇しました。9月には、米国の追加経済対策の協議難航や欧州での新型コロナウイルス感染再拡大への懸念などを背景に、国内金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移となりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマーク(NOMURA-BPI総合指数)との高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド(国債以外の債券における国債との利回り格差)への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニパース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

◆ポートフォリオについて

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド(国債以外の債券における国債との利回り格差)の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニパース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は△0.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.8%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差は0.0%程度で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

《今後の運用方針》

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド(国債以外の債券における国債との利回り格差)への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニパース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■ 1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	－円
有価証券取引税	－
その他費用 (その他)	0 (0)
合計	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。
 (注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況
 公社債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

国	内	債種	買付額		売付額	
			千円	千円	千円	千円
		国債証券	7,010,548	(3,252,923)		
		地方債証券	108,903	()		
		特殊債券	208,254	(100,053)		
		社債券	200,000	(201,857)		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利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券(転換社債券)は含まれておりません。
 (注4) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄
 公社債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
137 5年国債 0.1% 2023/9/20	272,248	128 5年国債 0.1% 2021/6/20	227,919
359 10年国債 0.1% 2030/6/20	241,516	129 5年国債 0.1% 2021/9/20	182,438
358 10年国債 0.1% 2030/3/20	237,383	406 2年国債 0.1% 2021/11/1	180,424
357 10年国債 0.1% 2029/12/20	219,296	403 2年国債 0.1% 2021/8/1	160,414
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	211,904	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	142,396
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	202,232	127 5年国債 0.1% 2021/3/20	140,456
144 5年国債 0.1% 2025/6/20	201,764	331 10年国債 0.6% 2023/9/20	123,546
337 10年国債 0.3% 2024/12/20	183,617	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	121,810
414 2年国債 0.1% 2022/7/1	170,810	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	121,120
142 5年国債 0.1% 2024/12/20	162,685	142 20年国債 1.8% 2032/12/20	109,696

(注1) 金額は受渡し代金(経過利分は含まれておりません)。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■ 組入資産明細表

(1) 国内(邦貨建)公社債(種類別、新株予約権付社債券(転換社債券)を除く)

区分	当			末			
	額面金額	評価額	組入比率	うち8B格以下組入比率	残存期間別組入比率	組入比率	
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	19,067,000	20,457,090	85.4	－	55.2	20.0	10.2
地方債証券	1,500,000	1,559,084	6.5	－	3.5	2.6	0.4
特殊債券 (除く金融債券)	800,000	833,568	3.5	－	1.4	1.7	0.4
普通社債券	900,000	928,776	3.9	－	2.6	1.3	－
合計	22,267,000	23,778,520	99.2	－	62.6	25.5	11.1

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。
 (注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。
 (注3) 評価額および格付情報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。

(2) 国内(邦貨建)公社債(銘柄別、新株予約権付社債券(転換社債券)を除く)

区分	当			末		
	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円		
国債証券	407 2年国債	0.1000	30,000	30,069	2021/12/01	
	130 5年国債	0.1000	247,000	247,531	2021/12/20	
	319 10年国債	1.1000	140,000	141,790	2021/12/20	
	320 10年国債	1.0000	35,000	35,410	2021/12/20	
	53 20年国債	2.1000	13,000	13,303	2021/12/20	
	54 20年国債	2.2000	14,000	14,341	2021/12/20	
	408 2年国債	0.1000	160,000	160,408	2022/01/01	
	409 2年国債	0.1000	40,000	40,110	2022/02/01	
	131 5年国債	0.1000	190,000	190,543	2022/03/20	
	321 10年国債	1.0000	65,000	65,946	2022/03/20	
	322 10年国債	0.9000	140,000	141,856	2022/03/20	
	55 20年国債	2.0000	41,000	42,132	2022/03/21	
	413 2年国債	0.1000	120,000	120,450	2022/06/01	
	132 5年国債	0.1000	190,000	190,663	2022/06/20	
	323 10年国債	0.9000	70,000	71,114	2022/06/20	
	324 10年国債	0.8000	80,000	81,149	2022/06/20	
	56 20年国債	2.0000	12,000	12,396	2022/06/20	
	57 20年国債	1.9000	24,000	24,755	2022/06/20	
	414 2年国債	0.1000	170,000	170,673	2022/07/01	
	415 2年国債	0.1000	100,000	100,409	2022/08/01	
	133 5年国債	0.1000	230,000	230,995	2022/09/20	
	325 10年国債	0.8000	160,000	162,688	2022/09/20	
	58 20年国債	1.9000	35,000	36,283	2022/09/20	
	417 2年国債	0.1000	130,000	130,585	2022/10/01	
	134 5年国債	0.1000	170,000	170,838	2022/12/20	
	326 10年国債	0.7000	20,000	20,341	2022/12/20	
	327 10年国債	0.8000	90,000	91,721	2022/12/20	
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,112	2022/12/20	
	135 5年国債	0.1000	310,000	311,714	2023/03/20	
	328 10年国債	0.6000	60,000	61,009	2023/03/20	
	61 20年国債	1.0000	40,000	41,046	2023/03/20	
	136 5年国債	0.1000	150,000	150,901	2023/06/20	
	329 10年国債	0.8000	200,000	204,760	2023/06/20	
62 20年国債	0.8000	16,000	16,382	2023/06/20		
63 20年国債	1.8000	30,000	31,485	2023/06/20		
137 5年国債	0.1000	410,000	412,767	2023/09/20		
330 10年国債	0.8000	81,000	83,130	2023/09/20		
331 10年国債	0.6000	10,000	10,206	2023/09/20		
64 20年国債	1.9000	35,000	37,003	2023/09/20		
138 5年国債	0.1000	280,000	282,186	2023/12/20		
332 10年国債	0.6000	65,000	66,463	2023/12/20		

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

区 分	当 期	銘 柄	年 利 率	未		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額	
			%	千 円	千 円	
65	20年	国債	1.9000	42,000	44,619	2023/12/20
66	20年	国債	1.8000	30,000	31,779	2023/12/20
139	5年	国債	0.1000	320,000	322,544	2024/03/20
333	10年	国債	0.6000	83,000	85,021	2024/03/20
67	20年	国債	1.9000	19,000	20,280	2024/03/20
68	20年	国債	2.2000	25,000	26,934	2024/03/20
69	20年	国債	2.1000	12,000	12,888	2024/03/20
140	5年	国債	0.1000	140,000	141,198	2024/06/20
334	10年	国債	0.6000	320,000	328,332	2024/06/20
70	20年	国債	2.4000	18,000	19,624	2024/06/20
71	20年	国債	2.2000	17,000	18,412	2024/06/20
141	5年	国債	0.1000	210,000	211,925	2024/09/20
335	10年	国債	0.5000	210,000	215,054	2024/09/20
72	20年	国債	2.1000	53,000	57,505	2024/09/20
142	5年	国債	0.1000	40,000	40,382	2024/12/20
337	10年	国債	0.3000	230,000	234,027	2024/12/20
143	5年	国債	0.1000	200,000	201,988	2025/03/20
338	10年	国債	0.4000	80,000	81,832	2025/03/20
75	20年	国債	2.1000	14,000	15,346	2025/03/20
76	20年	国債	1.9000	25,000	27,187	2025/03/20
144	5年	国債	0.1000	200,000	202,012	2025/06/20
339	10年	国債	0.4000	115,000	117,735	2025/06/20
78	20年	国債	1.9000	17,000	18,566	2025/06/20
79	20年	国債	2.0000	14,000	15,354	2025/06/20
145	5年	国債	0.1000	17,000	17,168	2025/09/20
340	10年	国債	0.4000	175,000	179,308	2025/09/20
81	20年	国債	2.0000	65,000	71,604	2025/09/20
82	20年	国債	2.1000	28,000	30,980	2025/09/20
341	10年	国債	0.3000	15,000	15,308	2025/12/20
342	10年	国債	0.1000	20,000	20,213	2026/03/20
85	20年	国債	2.1000	31,000	34,632	2026/03/20
86	20年	国債	2.3000	6,000	6,767	2026/03/20
87	20年	国債	2.2000	35,000	39,287	2026/03/20
343	10年	国債	0.1000	132,000	133,473	2026/06/20
88	20年	国債	2.3000	33,000	37,420	2026/06/20
89	20年	国債	2.2000	15,000	16,925	2026/06/20
344	10年	国債	0.1000	50,000	50,583	2026/09/20
345	10年	国債	0.1000	280,000	283,407	2026/12/20
92	20年	国債	2.1000	45,000	51,027	2026/12/20
346	10年	国債	0.1000	40,000	40,506	2027/03/20
93	20年	国債	2.0000	18,000	20,395	2027/03/20
94	20年	国債	2.1000	45,000	51,274	2027/03/20
347	10年	国債	0.1000	235,000	238,097	2027/06/20
95	20年	国債	2.3000	30,000	34,747	2027/06/20
96	20年	国債	2.1000	23,000	26,336	2027/06/20
348	10年	国債	0.1000	240,000	243,285	2027/09/20
97	20年	国債	2.2000	25,000	28,928	2027/09/20
98	20年	国債	2.1000	34,000	39,109	2027/09/20
349	10年	国債	0.1000	250,000	253,460	2027/12/20
99	20年	国債	2.1000	53,000	61,237	2027/12/20
350	10年	国債	0.1000	230,000	233,208	2028/03/20
100	20年	国債	2.2000	35,000	40,873	2028/03/20
101	20年	国債	2.4000	18,000	21,285	2028/03/20
351	10年	国債	0.1000	180,000	182,460	2028/06/20
102	20年	国債	2.4000	10,000	11,879	2028/06/20
103	20年	国債	2.3000	21,000	24,787	2028/06/20
104	20年	国債	2.1000	64,000	74,570	2028/06/20
352	10年	国債	0.1000	230,000	233,065	2028/09/20
105	20年	国債	2.1000	38,000	44,452	2028/09/20
106	20年	国債	2.2000	16,000	18,842	2028/09/20
353	10年	国債	0.1000	210,000	212,717	2028/12/20
107	20年	国債	2.1000	20,000	23,495	2028/12/20
108	20年	国債	1.9000	68,000	78,783	2028/12/20

区 分	当 期	銘 柄	年 利 率	未		償 還 年 月 日
				額 面 金 額	評 価 額	
			%	千 円	千 円	
354	10年	国債	0.1000	190,000	192,373	2029/03/20
109	20年	国債	1.9000	60,000	69,749	2029/03/20
110	20年	国債	2.1000	27,000	31,837	2029/03/20
355	10年	国債	0.1000	90,000	91,080	2029/06/20
111	20年	国債	2.2000	35,000	41,726	2029/06/20
112	20年	国債	2.1000	40,000	47,344	2029/06/20
356	10年	国債	0.1000	185,000	187,121	2029/09/20
113	20年	国債	2.1000	70,000	83,159	2029/09/20
357	10年	国債	0.1000	75,000	75,781	2029/12/20
114	20年	国債	2.1000	45,000	53,626	2029/12/20
115	20年	国債	2.2000	42,000	50,432	2029/12/20
2	30年	国債	2.4000	9,000	11,002	2030/02/20
358	10年	国債	0.1000	235,000	237,293	2030/03/20
116	20年	国債	2.2000	27,000	32,538	2030/03/20
117	20年	国債	2.1000	77,000	92,078	2030/03/20
3	30年	国債	2.3000	4,000	4,870	2030/05/20
359	10年	国債	0.1000	240,000	242,059	2030/06/20
118	20年	国債	2.0000	13,000	15,468	2030/06/20
119	20年	国債	1.8000	23,000	26,928	2030/06/20
120	20年	国債	1.6000	75,000	86,378	2030/06/20
360	10年	国債	0.1000	100,000	100,733	2030/09/20
4	30年	国債	2.9000	8,000	10,282	2030/11/20
123	20年	国債	2.1000	42,000	50,687	2030/12/20
124	20年	国債	2.0000	55,000	65,825	2030/12/20
125	20年	国債	2.2000	25,000	30,538	2031/03/20
126	20年	国債	2.0000	21,000	25,221	2031/03/20
127	20年	国債	1.9000	70,000	83,353	2031/03/20
5	30年	国債	2.2000	8,000	9,795	2031/05/20
128	20年	国債	1.9000	32,000	38,213	2031/06/20
129	20年	国債	1.8000	65,000	76,937	2031/06/20
130	20年	国債	1.8000	28,000	33,229	2031/09/20
131	20年	国債	1.7000	70,000	82,321	2031/09/20
6	30年	国債	2.4000	9,000	11,288	2031/11/20
132	20年	国債	1.7000	25,000	29,469	2031/12/20
133	20年	国債	1.8000	80,000	95,178	2031/12/20
134	20年	国債	1.8000	15,000	17,888	2032/03/20
135	20年	国債	1.7000	20,000	23,627	2032/03/20
136	20年	国債	1.6000	75,000	87,765	2032/03/20
7	30年	国債	2.3000	12,000	15,018	2032/05/20
137	20年	国債	1.7000	18,000	21,312	2032/06/20
139	20年	国債	1.6000	120,000	140,714	2032/06/20
141	20年	国債	1.7000	48,000	57,077	2032/12/20
142	20年	国債	1.8000	90,000	108,090	2032/12/20
10	30年	国債	1.7000	15,000	16,771	2033/03/20
143	20年	国債	1.6000	48,000	56,609	2033/03/20
144	20年	国債	1.5000	70,000	81,707	2033/03/20
11	30年	国債	1.7000	9,000	10,744	2033/06/20
145	20年	国債	1.7000	130,000	155,204	2033/06/20
12	30年	国債	2.1000	11,000	13,720	2033/09/20
146	20年	国債	1.7000	115,000	137,563	2033/09/20
13	30年	国債	2.0000	11,000	13,613	2033/12/20
147	20年	国債	1.6000	100,000	118,562	2033/12/20
14	30年	国債	2.4000	22,000	28,435	2034/03/20
148	20年	国債	1.5000	85,000	99,830	2034/03/20
15	30年	国債	2.5000	21,000	27,517	2034/06/20
149	20年	国債	1.5000	120,000	141,232	2034/06/20
16	30年	国債	2.5000	26,000	34,192	2034/09/20
150	20年	国債	1.4000	115,000	133,985	2034/09/20
17	30年	国債	2.4000	17,000	22,187	2034/12/20
151	20年	国債	1.2000	120,000	136,681	2034/12/20
18	30年	国債	2.3000	20,000	25,892	2035/03/20
152	20年	国債	1.2000	100,000	113,980	2035/03/20
19	30年	国債	2.3000	15,000	19,467	2035/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

区 分	当 期				未	
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
			千 円	千 円		
153	20年国債	1.3000	140,000	161,659	2035/06/20	
20	30年国債	2.5000	16,000	21,290	2035/09/20	
154	20年国債	1.2000	100,000	114,130	2035/09/20	
21	30年国債	2.3000	16,000	20,863	2035/12/20	
155	20年国債	1.0000	120,000	133,442	2035/12/20	
22	30年国債	2.5000	17,000	22,736	2036/03/20	
156	20年国債	0.4000	103,000	105,353	2036/03/20	
23	30年国債	2.5000	16,000	21,468	2036/06/20	
157	20年国債	0.2000	113,000	111,986	2036/06/20	
24	30年国債	2.5000	15,000	20,176	2036/09/20	
158	20年国債	0.5000	95,000	98,385	2036/09/20	
25	30年国債	2.3000	17,000	22,378	2036/12/20	
159	20年国債	0.6000	120,000	125,995	2036/12/20	
26	30年国債	2.4000	32,000	42,740	2037/03/20	
160	20年国債	0.7000	130,000	138,509	2037/03/20	
161	20年国債	0.6000	80,000	83,916	2037/06/20	
27	30年国債	2.5000	32,000	43,504	2037/09/20	
162	20年国債	0.6000	100,000	104,798	2037/09/20	
163	20年国債	0.6000	72,000	75,442	2037/12/20	
28	30年国債	2.5000	34,000	46,453	2038/03/20	
164	20年国債	0.5000	125,000	128,792	2038/03/20	
165	20年国債	0.5000	95,000	97,759	2038/06/20	
29	30年国債	2.4000	43,000	58,309	2038/09/20	
166	20年国債	0.7000	100,000	106,221	2038/09/20	
167	20年国債	0.5000	80,000	82,107	2038/12/20	
30	30年国債	2.3000	56,000	75,297	2039/03/20	
168	20年国債	0.4000	110,000	110,850	2039/03/20	
169	20年国債	0.3000	80,000	79,096	2039/06/20	
31	30年国債	2.2000	76,000	101,250	2039/09/20	
170	20年国債	0.3000	40,000	39,507	2039/09/20	
171	20年国債	0.3000	70,000	69,066	2039/12/20	
32	30年国債	2.3000	45,000	61,028	2040/03/20	
172	20年国債	0.4000	95,000	95,341	2040/03/20	
173	20年国債	0.4000	95,000	95,171	2040/06/20	
33	30年国債	2.0000	95,000	124,028	2040/09/20	
174	20年国債	0.4000	30,000	30,027	2040/09/20	
34	30年国債	2.2000	70,000	94,364	2041/03/20	
35	30年国債	2.0000	92,000	120,849	2041/09/20	
36	30年国債	2.0000	88,000	115,975	2042/03/20	
37	30年国債	1.9000	83,000	108,075	2042/09/20	
38	30年国債	1.8000	65,000	83,544	2043/03/20	
39	30年国債	1.9000	50,000	65,378	2043/06/20	
40	30年国債	1.8000	44,000	56,635	2043/09/20	
41	30年国債	1.7000	45,000	56,985	2043/12/20	
42	30年国債	1.7000	53,000	67,182	2044/03/20	
43	30年国債	1.7000	45,000	57,099	2044/06/20	
44	30年国債	1.7000	50,000	63,505	2044/09/20	
45	30年国債	1.5000	57,000	69,913	2044/12/20	
46	30年国債	1.5000	55,000	67,500	2045/03/20	
47	30年国債	1.6000	62,000	77,591	2045/06/20	
48	30年国債	1.4000	68,000	82,047	2045/09/20	
49	30年国債	1.4000	68,000	82,081	2045/12/20	
50	30年国債	0.8000	60,000	63,898	2046/03/20	
51	30年国債	0.3000	65,000	61,428	2046/06/20	
52	30年国債	0.5000	69,000	68,374	2046/09/20	
53	30年国債	0.6000	55,000	55,753	2046/12/20	
54	30年国債	0.8000	55,000	58,359	2047/03/20	
55	30年国債	0.8000	56,000	59,380	2047/06/20	
56	30年国債	0.8000	60,000	63,577	2047/09/20	
57	30年国債	0.8000	70,000	74,120	2047/12/20	
1	40年国債	2.4000	30,000	43,849	2048/03/20	
58	30年国債	0.8000	75,000	79,261	2048/03/20	
59	30年国債	0.7000	55,000	56,702	2048/06/20	
60	30年国債	0.9000	58,000	62,668	2048/09/20	

区 分	当 期				未	
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
			千 円	千 円		
61	30年国債	0.7000	50,000	51,385	2048/12/20	
2	40年国債	2.2000	38,000	53,814	2049/03/20	
62	30年国債	0.5000	46,000	44,832	2049/03/20	
63	30年国債	0.4000	55,000	52,064	2049/06/20	
64	30年国債	0.4000	50,000	47,196	2049/09/20	
65	30年国債	0.4000	55,000	51,829	2049/12/20	
3	40年国債	2.2000	19,000	26,978	2050/03/20	
66	30年国債	0.4000	102,000	95,841	2050/03/20	
67	30年国債	0.6000	59,000	58,486	2050/06/20	
68	30年国債	0.6000	18,000	17,797	2050/09/20	
4	40年国債	2.2000	30,000	42,799	2051/03/20	
5	40年国債	2.0000	35,000	48,357	2052/03/20	
6	40年国債	1.9000	28,000	38,157	2053/03/20	
7	40年国債	1.7000	31,000	40,689	2054/03/20	
8	40年国債	1.4000	33,000	40,509	2055/03/20	
9	40年国債	0.4000	40,000	36,707	2056/03/20	
10	40年国債	0.9000	91,000	97,825	2057/03/20	
11	40年国債	0.8000	85,000	88,561	2058/03/20	
12	40年国債	0.5000	99,000	93,159	2059/03/20	
13	40年国債	0.5000	109,000	102,438	2060/03/20	
種別	銘柄数		251銘柄			
小計	金額		19,067,000	20,457,090		
地方債証券	116	共同発行地方	0.8000	100,000	101,540	2022/11/25
	117	共同発行地方	0.7200	100,000	101,425	2022/12/22
	24-16	愛知県公債	0.7570	100,000	101,593	2023/01/31
	25-6	大阪市公債	0.6940	100,000	102,015	2023/11/22
	3	兵庫県公債12年	0.5600	100,000	102,338	2025/04/16
	401	大阪府公債	0.4770	100,000	102,163	2025/10/29
	22-1	福岡県15年	1.6700	100,000	108,150	2025/11/21
	751	東京都公債	0.3700	100,000	101,740	2025/12/19
	27-15	北海道公債	0.2200	100,000	100,939	2026/02/26
	28-1	静岡県公債	0.0800	100,000	100,237	2026/03/19
	222	神奈川県公債	0.0600	100,000	100,121	2026/06/19
	168	共同発行地方	0.2100	100,000	100,962	2027/03/25
	29-6	千葉県公債	0.2450	100,000	101,267	2028/01/25
	11	名古屋市20年	2.1300	100,000	118,098	2029/12/14
	11	兵庫県公債20年	1.8400	100,000	116,490	2030/08/16
種別	銘柄数		15銘柄			
小計	金額		1,500,000	1,559,084		
特殊債券 (除く金融債)	36	地方公共団体	0.8920	100,000	101,284	2022/05/27
	190	政保道路機構	0.6050	100,000	101,426	2023/05/31
	65	地方公共団体	0.5350	100,000	101,956	2024/10/28
	241	政保道路機構	0.4500	100,000	101,943	2025/03/31
	261	政保道路機構	0.3810	100,000	101,851	2025/11/28
	127	都市再生	0.0750	100,000	100,023	2026/09/18
	81	政保道路機構	2.1000	100,000	117,179	2029/05/31
	47	日本政策投資CO	1.0270	100,000	107,903	2029/09/20
種別	銘柄数		8銘柄			
小計	金額		800,000	833,568		
普通社債券	32	東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	107,232	2024/03/19
	25	西日本高速道	0.5240	100,000	101,876	2024/12/20
	497	関西電力	1.0020	100,000	103,721	2025/06/20
	14	セブアンドアイ	0.1900	100,000	100,009	2025/12/19
	20	成田国際空港	0.1050	100,000	99,909	2026/08/21
	17	パナソニック	0.4700	100,000	100,997	2026/09/18
	80	三菱地所	2.3050	100,000	113,044	2027/03/19
	9	ソフトバンク	0.4800	100,000	100,040	2027/12/03
	5	NTTファイナンス	0.4890	100,000	101,944	2032/09/17
種別	銘柄数		9銘柄			
小計	金額		900,000	928,776		
合計	銘柄数		283銘柄			
合計	金額		22,267,000	23,778,520		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	23,778,520	98.4
コール・ローン等、その他	383,997	1.6
投資信託財産総額	24,162,518	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	24,162,518,080円
コール・ローン等	331,720,502
公社債(評価額)	23,778,520,440
未収利息	50,884,824
前払費用	1,392,314
(B) 負債	200,100,000
未払金	200,000,000
未払解約金	100,000
(C) 純資産総額(A - B)	23,962,418,080
元本	18,557,007,274
次期繰越損益金	5,405,410,806
(D) 受益権総口数	18,557,007,274口
1万口当り基準価額(C/D)	12,913円

* 期首における元本額は15,576,806,254円、当作成期間中における追加設定元本額は5,111,345,542円、同解約元本額は2,131,144,522円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用) 338,783,717円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 2,224,076円、iFree 日本債券インデックス203,623,872円、iFree 8資産バランス2,301,456,849円、ダイワ・ライフ・バランス30 6,985,273,543円、ダイワ・ライフ・バランス50 4,274,421,319円、ダイワ・ライフ・バランス70 1,297,181,504円、DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース) 1,067,068,046円、DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース) 781,455,104円、DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース) 251,998,653円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 48,938,797円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 66,428,943円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 14,696,846円、ダイワつみたてインデックス日本債券407,539,350円、ダイワつみたてインデックスバランス30 25,894,956円、ダイワつみたてインデックスバランス50 9,096,977円、ダイワつみたてインデックスバランス70 4,422,197円、ダイワ世界バランスファンド40VA291,709,847円、ダイワ世界バランスファンド60VA184,792,678円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,913円です。

■損益の状況

当期 自2019年12月3日 至2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	166,420,250円
受取利息	166,486,387
支払利息	△ 66,137
(B) 有価証券売買損益	△ 316,673,080
売買益	11,041,720
売買損	△ 327,714,800
(C) その他費用	△ 1,598
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 150,254,428
(E) 前期繰越損益金	4,698,249,413
(F) 解約差損益金	△ 649,271,809
(G) 追加信託差損益金	1,506,687,630
(H) 合計(D + E + F + G)	5,405,410,806
次期繰越損益金(H)	5,405,410,806

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。