

iFree 日本債券 インデックス

運用報告書（全体版） 第6期

（決算日 2021年11月30日）
（作成対象期間 2020年12月1日～2021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。

★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、分配を行なわないことがあります。		

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/>

最近 5 期の運用実績

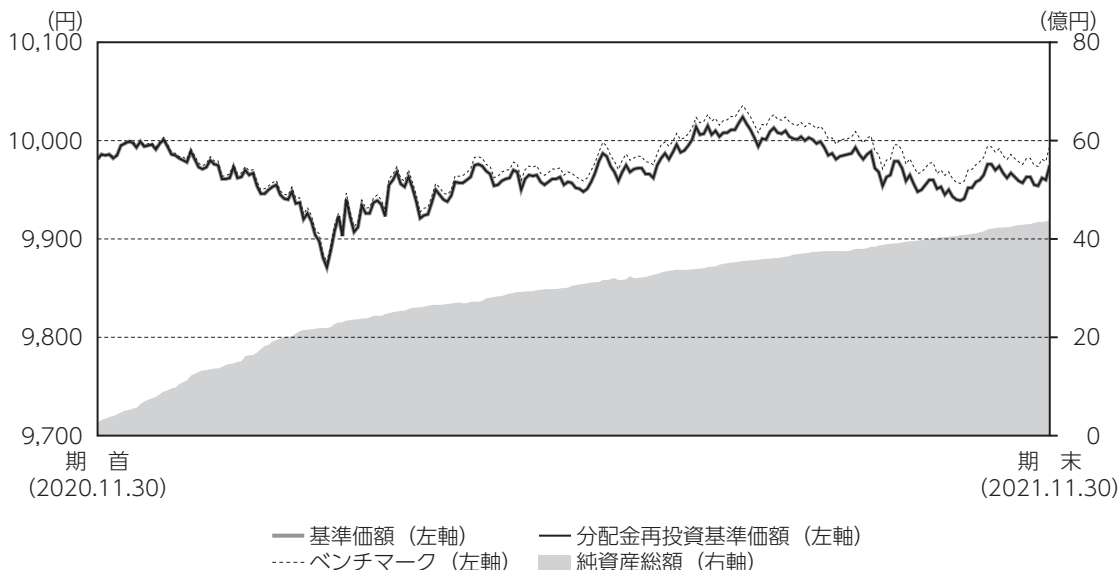
決 算 期	基 準 価 額			NOMURA-BPI 総 合 指 数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2 期末(2017年11月30日)	9,849	0	△0.7	9,876	△0.4	99.0	－	120
3 期末(2018年11月30日)	9,860	0	0.1	9,902	0.3	98.5	－	145
4 期末(2019年12月 2 日)	10,074	0	2.2	10,138	2.4	99.1	－	175
5 期末(2020年11月30日)	9,981	0	△0.9	10,055	△0.8	99.1	－	263
6 期末(2021年11月30日)	9,975	0	△0.1	10,068	0.1	98.8	－	4,386

- (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：9,981円

期末：9,975円（分配金0円）

騰落率：△0.1%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

金利は上昇（債券価格は下落）したものの、債券の利息収入を得たため、基準価額は当作成期首と同程度の水準となりました。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		公 社 債 率	債 券 先 物 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)		
(期首) 2020年11月30日	円 9,981	% -	10,055	% -	% -
12月末	9,980	△0.0	10,057	0.0	-
2021年 1 月末	9,954	△0.3	10,032	△0.2	-
2 月末	9,871	△1.1	9,949	△1.0	-
3 月末	9,938	△0.4	10,018	△0.4	-
4 月末	9,955	△0.3	10,037	△0.2	-
5 月末	9,958	△0.2	10,042	△0.1	-
6 月末	9,962	△0.2	10,049	△0.1	-
7 月末	10,011	0.3	10,098	0.4	-
8 月末	10,001	0.2	10,089	0.3	-
9 月末	9,965	△0.2	10,054	△0.0	-
10月末	9,952	△0.3	10,044	△0.1	-
(期末) 2021年11月30日	9,975	△0.1	10,068	0.1	-

(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

(2020.12.1～2021.11.30)

■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇後、当作成期首の水準まで一時低下しましたが、再び上昇しました。

国内長期金利は、日銀の長短金利操作の下、2020年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2021年に入ると、日銀が3月の金融政策決定会合での各種施策の点検において長期金利の許容変動幅を拡大するとの思惑や、米国長期金利の急上昇を受け、2月末にかけて0.1%台半ばまで上昇しました。3月の金融政策決定会合では長期金利の変動幅の明確化等が決定されましたが、政策の大枠に変更がなかったこともあり、長期金利は低下基調に転じました。その後も、米国長期金利の低下や新型コロナウイルスの感染拡大も重なり、8月には一時ゼロ%程度まで低下しました。9月以降は、商品市況の上昇などによる世界的なインフレ懸念を受けた先進各国の長期金利の上昇に連動して、国内長期金利は当作成期末にかけて上昇しました。

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（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

(2020.12.1～2021.11.30)

■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。

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

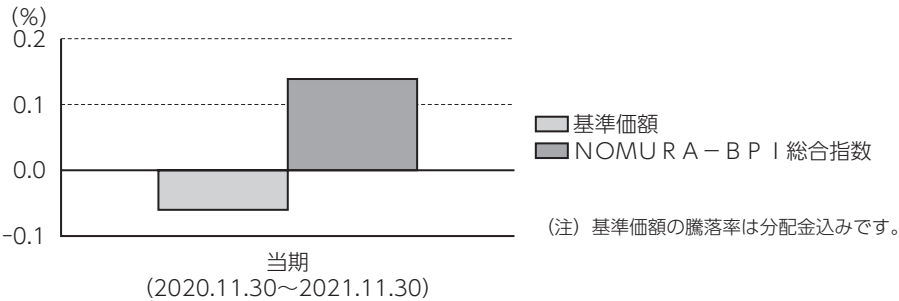
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	NOMURA－ＢＰＩ 総合指数

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0.1％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.1％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△0.2％でした。差異の内訳は、運用管理費用要因によるベンチマークとの差異が△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。



*ベンチマークはNOMURA－ＢＰＩ 総合指数です。

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（1万口当り）

項 目	(円)	当 期
		2020年12月1日 ～2021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)	52

(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

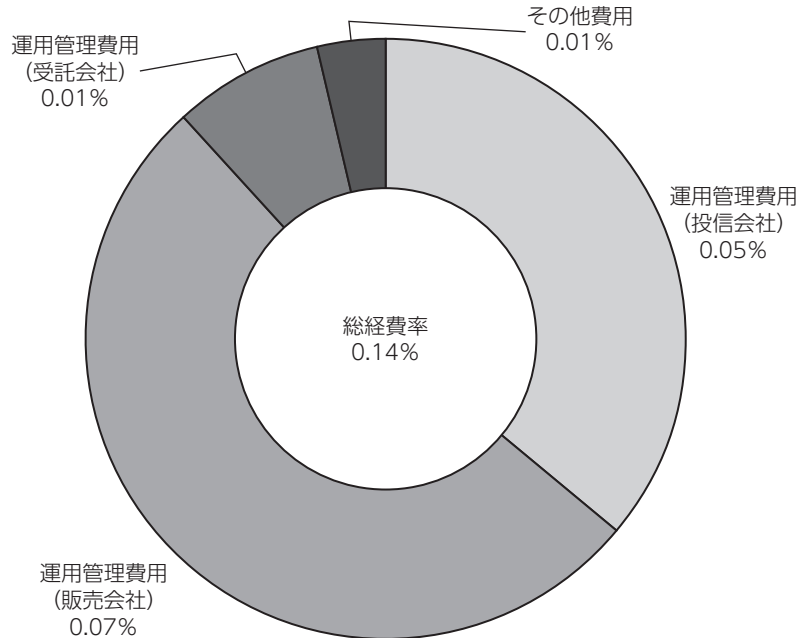
項 目	当期 (2020.12.1～2021.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	13円	0.132%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,968円です。
(投 信 会 社)	(5)	(0.049)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(7)	(0.071)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(1)	(0.011)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社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	0.137	

- (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近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

(2020年12月1日から2021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)	3,269,173	4,218,166	81,865	105,651

(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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	15,731	247	1.6	3,195	302	9.5
コール・ローン	50,140	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合9.8%

※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

(2020年12月1日から2021年11月30日まで)

種 類	当 期
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)
	買 付 額
公社債	百万円 200

(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	口 数	評 価 額
	千口	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)	203,623	3,390,931	4,382,100

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021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)	4,382,100	99.8
コール・ローン等、その他	7,050	0.2
投資信託財産総額	4,389,150	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

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,389,150,867円
コール・ローン等	7,050,706
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)	4,382,100,161
(B) 負債	2,687,425
未払解約金	137,595
未払信託報酬	2,447,928
その他未払費用	101,902
(C) 純資産総額(A－B)	4,386,463,442
元本	4,397,387,541
次期繰越損益金	△ 10,924,099
(D) 受益権総口数	4,397,387,541口
1万口当り基準価額(C / D)	9,975円

* 期首における元本額は263,701,548円、当作成期間中における追加設定元本額は4,318,448,107円、同解約元本額は184,762,114円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,975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10,924,099円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,013円
受取利息	11
支払利息	△ 1,024
(B) 有価証券売買損益	6,607,643
売買益	6,723,114
売買損	△ 115,471
(C) 信託報酬等	△ 3,930,127
(D) 当期繰越損益金(A + B + C)	2,676,503
(E) 前期繰越損益金	△ 855,724
(F) 追加信託差損益金	△12,744,878
(配当等相当額)	(21,345,914)
(売買損益相当額)	(△34,090,792)
(G) 合計(D + E + F)	△10,924,099
次期繰越損益金(G)	△10,924,099
追加信託差損益金	△12,744,878
(配当等相当額)	(21,345,914)
(売買損益相当額)	(△34,090,792)
分配準備積立金	1,821,792
繰越損益金	△ 1,013

(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	1,451,840
(c) 収益調整金	21,345,914
(d) 分配準備積立金	369,952
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	23,167,706
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	23,167,706
(h) 受益権総口数	4,397,387,541口

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

運用報告書 第17期（決算日 2021年11月30日）

（作成対象期間 2020年12月1日～2021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（ＢＰＩ）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。

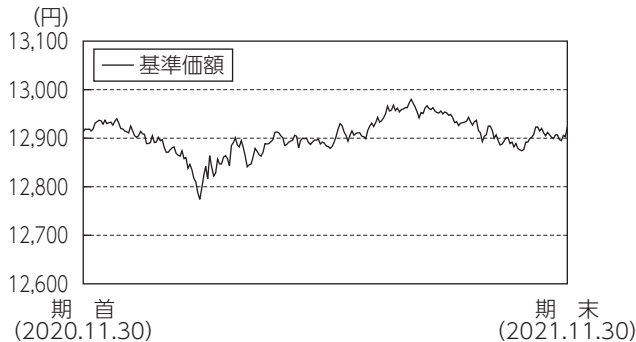
運 用 方 針	投資成果をNOMURA－BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主 要 投 資 対 象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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 債 券	
	円	騰落率	ベンチマーク	騰落率	組入比率	先物比率
(期首)2020年11月30日	12,913	—	12,936	—	99.2	—
12月末	12,913	0.0	12,939	0.0	98.9	—
2021年 1月末	12,881	△0.2	12,907	△0.2	99.3	—
2 月末	12,774	△1.1	12,800	△1.0	99.4	—
3 月末	12,863	△0.4	12,889	△0.4	99.5	—
4 月末	12,887	△0.2	12,913	△0.2	99.0	—
5 月末	12,892	△0.2	12,919	△0.1	99.5	—
6 月末	12,899	△0.1	12,929	△0.1	99.1	—
7 月末	12,963	0.4	12,993	0.4	99.2	—
8 月末	12,952	0.3	12,981	0.3	99.2	—
9 月末	12,907	△0.0	12,936	△0.0	99.4	—
10月末	12,892	△0.2	12,923	△0.1	99.1	—
(期末)2021年11月30日	12,923	0.1	12,954	0.1	98.9	—

(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：12,913円 期末：12,923円 騰落率：0.1%

【基準価額の主な変動要因】

金利は上昇（債券価格は下落）したものの、債券の利息収入を得たため、基準価額は当作成期首と同程度の水準となりました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇後、当作成期首の水準まで一時低下しましたが、再び上昇しました。

国内長期金利は、日銀の短長金利操作の下、2020年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2021年に入ると、日銀が3月の金融政策決定会合での各種施策の点検において長期金利の許容変動幅を拡大するとの思惑や、米国長期金利の急上昇を受け、2月末にかけて0.1%台半ばまで上昇しました。3月の金融政策決定会合では長期金利の変動幅の明確化等が決定されましたが、政策の大枠に変更がなかったこともあり、長期金利は低下基調に転じました。その後も、米国長期金利の低下や新型コロナウイルスの感染拡大も重なり、8月には一時ゼロ%程度まで低下しました。9月以降は、商品市況の上昇などによる世界的なインフレ懸念を受けた先進各国の長期金利の上昇に連動して、国内長期金利は当作成期末にかけて上昇しました。

◆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。

◆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0.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.1%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（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。

*ベンチマークはNOMURA-BPI 総合指数です。

《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
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しております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

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	15,001,750	2,892,501 (－)
	地方債証券	320,741	201,659 (－)
	特殊債券	107,841	100,953 (－)
	社債券	300,719	(－)

(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) ()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

(2020年12月 1 日から2021年11月30日まで)

当 期				
買 付		売 付		
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額	
	千円		千円	
145 5年国債 0.1% 2025/9/20	467,599	130 5年国債 0.1% 2021/12/20	247,526	
147 5年国債 0.005% 2026/3/20	408,046	133 5年国債 0.1% 2022/9/20	230,538	
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	352,941	132 5年国債 0.1% 2022/6/20	190,440	
419 2年国債 0.1% 2022/12/1	351,454	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	190,423	
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	341,952	413 2年国債 0.1% 2022/6/1	180,403	
363 10年国債 0.1% 2031/6/20	332,235	414 2年国債 0.1% 2022/7/1	170,363	
361 10年国債 0.1% 2030/12/20	329,948	325 10年国債 0.8% 2022/9/20	161,552	
362 10年国債 0.1% 2031/3/20	315,768	408 2年国債 0.1% 2022/1/1	160,349	
140 5年国債 0.1% 2024/6/20	312,102	418 2年国債 0.1% 2022/11/1	160,342	
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	281,762	319 10年国債 1.1% 2021/12/20	141,786	

(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 期				末		
	額面金額	評 価 額	組入比率	うち B B 格 以下	残存期間別組入比率		
				組入比率	5 年以上	2 年以上	2 年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	30,736,000	32,422,792	88.7	－	58.7	19.4	10.6
地方債証券	1,600,000	1,669,140	4.6	－	1.8	2.2	0.6
特殊債券 (除く金融債券)	800,000	836,281	2.3	－	0.6	1.4	0.3
普通社債券	1,200,000	1,226,423	3.4	－	1.4	1.9	－
合 計	34,336,000	36,154,637	98.9	－	62.5	24.9	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) 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 期			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	419 2年国債	0.1000	350,000	350,805	2022/12/01	
	134 5年国債	0.1000	170,000	170,402	2022/12/20	
	326 10年国債	0.7000	100,000	100,863	2022/12/20	
	327 10年国債	0.8000	90,000	90,872	2022/12/20	
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,057	2022/12/20	
	420 2年国債	0.1000	100,000	100,249	2023/01/01	
	421 2年国債	0.1000	130,000	130,349	2023/02/01	
	422 2年国債	0.1000	200,000	200,574	2023/03/01	
	135 5年国債	0.1000	420,000	421,226	2023/03/20	
	328 10年国債	0.6000	60,000	60,565	2023/03/20	
	61 20年国債	1.0000	40,000	40,585	2023/03/20	
	423 2年国債	0.0050	30,000	30,054	2023/04/01	
	424 2年国債	0.0050	150,000	150,286	2023/05/01	
	425 2年国債	0.0050	130,000	130,262	2023/06/01	
	136 5年国債	0.1000	380,000	381,356	2023/06/20	
	329 10年国債	0.8000	200,000	202,874	2023/06/20	
	62 20年国債	0.8000	16,000	16,229	2023/06/20	
	63 20年国債	1.8000	30,000	30,897	2023/06/20	
	426 2年国債	0.0050	60,000	60,127	2023/07/01	
	427 2年国債	0.0050	90,000	90,202	2023/08/01	
	428 2年国債	0.0050	170,000	170,401	2023/09/01	
	137 5年国債	0.1000	590,000	592,501	2023/09/20	
	330 10年国債	0.8000	81,000	82,360	2023/09/20	
	331 10年国債	0.6000	40,000	40,527	2023/09/20	
	64 20年国債	1.9000	35,000	36,283	2023/09/20	
	429 2年国債	0.0050	180,000	180,446	2023/10/01	
	138 5年国債	0.1000	560,000	562,648	2023/12/20	
	332 10年国債	0.6000	65,000	65,969	2023/12/20	
	65 20年国債	1.9000	42,000	43,749	2023/12/20	
	66 20年国債	1.8000	30,000	31,188	2023/12/20	
	139 5年国債	0.1000	500,000	502,650	2024/03/20	
	333 10年国債	0.6000	83,000	84,386	2024/03/20	
	67 20年国債	1.9000	19,000	19,884	2024/03/20	
	68 20年国債	2.2000	25,000	26,336	2024/03/20	
	69 20年国債	2.1000	12,000	12,614	2024/03/20	
	140 5年国債	0.1000	450,000	452,587	2024/06/20	
	334 10年国債	0.6000	320,000	325,936	2024/06/20	
	70 20年国債	2.4000	18,000	19,162	2024/06/20	
	71 20年国債	2.2000	17,000	18,011	2024/06/20	
	141 5年国債	0.1000	460,000	462,907	2024/09/20	
	335 10年国債	0.5000	210,000	213,689	2024/09/20	
	72 20年国債	2.1000	53,000	56,308	2024/09/20	
	142 5年国債	0.1000	200,000	201,378	2024/12/20	
	337 10年国債	0.3000	300,000	303,906	2024/12/20	

当		期		末		償還年月日
区	分	銘柄	年利	額面金額	評価額	
			%	千円	千円	
143	5年	国債	0.1000	550,000	554,097	2025/03/20
338	10年	国債	0.4000	80,000	81,377	2025/03/20
75	20年	国債	2.1000	14,000	15,029	2025/03/20
76	20年	国債	1.9000	25,000	26,672	2025/03/20
144	5年	国債	0.1000	400,000	403,136	2025/06/20
339	10年	国債	0.4000	135,000	137,502	2025/06/20
78	20年	国債	1.9000	17,000	18,221	2025/06/20
79	20年	国債	2.0000	14,000	15,055	2025/06/20
145	5年	国債	0.1000	480,000	483,940	2025/09/20
340	10年	国債	0.4000	190,000	193,773	2025/09/20
81	20年	国債	2.0000	65,000	70,237	2025/09/20
82	20年	国債	2.1000	28,000	30,362	2025/09/20
146	5年	国債	0.1000	170,000	171,451	2025/12/20
341	10年	国債	0.3000	15,000	15,253	2025/12/20
147	5年	国債	0.0050	406,000	407,924	2026/03/20
342	10年	国債	0.1000	140,000	141,269	2026/03/20
85	20年	国債	2.1000	31,000	33,958	2026/03/20
86	20年	国債	2.3000	6,000	6,624	2026/03/20
87	20年	国債	2.2000	35,000	38,491	2026/03/20
148	5年	国債	0.0050	340,000	341,706	2026/06/20
343	10年	国債	0.1000	270,000	272,592	2026/06/20
88	20年	国債	2.3000	33,000	36,628	2026/06/20
89	20年	国債	2.2000	15,000	16,580	2026/06/20
149	5年	国債	0.0050	70,000	70,337	2026/09/20
344	10年	国債	0.1000	90,000	90,868	2026/09/20
345	10年	国債	0.1000	410,000	414,161	2026/12/20
92	20年	国債	2.1000	60,000	66,702	2026/12/20
346	10年	国債	0.1000	250,000	252,662	2027/03/20
93	20年	国債	2.0000	18,000	20,013	2027/03/20
94	20年	国債	2.1000	45,000	50,273	2027/03/20
347	10年	国債	0.1000	400,000	404,352	2027/06/20
95	20年	国債	2.3000	30,000	34,009	2027/06/20
96	20年	国債	2.1000	63,000	70,716	2027/06/20
348	10年	国債	0.1000	360,000	364,093	2027/09/20
97	20年	国債	2.2000	25,000	28,339	2027/09/20
98	20年	国債	2.1000	34,000	38,343	2027/09/20
349	10年	国債	0.1000	250,000	252,965	2027/12/20
99	20年	国債	2.1000	53,000	60,062	2027/12/20
350	10年	国債	0.1000	350,000	354,210	2028/03/20
100	20年	国債	2.2000	35,000	40,064	2028/03/20
101	20年	国債	2.4000	18,000	20,832	2028/03/20
351	10年	国債	0.1000	350,000	354,263	2028/06/20
102	20年	国債	2.4000	10,000	11,633	2028/06/20
103	20年	国債	2.3000	21,000	24,291	2028/06/20
104	20年	国債	2.1000	64,000	73,187	2028/06/20
352	10年	国債	0.1000	390,000	394,933	2028/09/20
105	20年	国債	2.1000	38,000	43,666	2028/09/20
106	20年	国債	2.2000	16,000	18,495	2028/09/20
353	10年	国債	0.1000	320,000	324,198	2028/12/20
107	20年	国債	2.1000	40,000	46,184	2028/12/20
108	20年	国債	1.9000	68,000	77,548	2028/12/20
354	10年	国債	0.1000	330,000	334,359	2029/03/20
109	20年	国債	1.9000	60,000	68,696	2029/03/20
110	20年	国債	2.1000	27,000	31,309	2029/03/20
355	10年	国債	0.1000	250,000	253,320	2029/06/20
111	20年	国債	2.2000	35,000	41,030	2029/06/20
112	20年	国債	2.1000	40,000	46,588	2029/06/20
356	10年	国債	0.1000	270,000	273,493	2029/09/20
113	20年	国債	2.1000	70,000	81,885	2029/09/20
357	10年	国債	0.1000	250,000	253,132	2029/12/20
114	20年	国債	2.1000	45,000	52,843	2029/12/20
115	20年	国債	2.2000	42,000	49,659	2029/12/20
2	30年	国債	2.4000	9,000	10,820	2030/02/20
358	10年	国債	0.1000	310,000	313,741	2030/03/20
116	20年	国債	2.2000	27,000	32,049	2030/03/20
117	20年	国債	2.1000	77,000	90,757	2030/03/20
3	30年	国債	2.3000	4,000	4,793	2030/05/20
359	10年	国債	0.1000	340,000	343,787	2030/06/20

当		期		末		償還年月日
区	分	銘柄	年利	額面金額	評価額	
			%	千円	千円	
118	20年	国債	2.0000	13,000	15,262	2030/06/20
119	20年	国債	1.8000	23,000	26,608	2030/06/20
120	20年	国債	1.6000	98,000	111,693	2030/06/20
360	10年	国債	0.1000	350,000	353,545	2030/09/20
4	30年	国債	2.9000	8,000	10,080	2030/11/20
361	10年	国債	0.1000	330,000	332,834	2030/12/20
123	20年	国債	2.1000	42,000	49,961	2030/12/20
124	20年	国債	2.0000	100,000	118,050	2030/12/20
362	10年	国債	0.1000	315,000	317,337	2031/03/20
125	20年	国債	2.2000	25,000	30,058	2031/03/20
126	20年	国債	2.0000	21,000	24,859	2031/03/20
127	20年	国債	1.9000	110,000	129,192	2031/03/20
5	30年	国債	2.2000	8,000	9,638	2031/05/20
363	10年	国債	0.1000	330,000	331,881	2031/06/20
128	20年	国債	1.9000	32,000	37,680	2031/06/20
129	20年	国債	1.8000	95,000	110,960	2031/06/20
364	10年	国債	0.1000	115,000	115,503	2031/09/20
130	20年	国債	1.8000	28,000	32,779	2031/09/20
131	20年	国債	1.7000	150,000	174,142	2031/09/20
6	30年	国債	2.4000	9,000	11,092	2031/11/20
132	20年	国債	1.7000	25,000	29,082	2031/12/20
133	20年	国債	1.8000	150,000	175,990	2031/12/20
134	20年	国債	1.8000	15,000	17,644	2032/03/20
135	20年	国債	1.7000	20,000	23,321	2032/03/20
136	20年	国債	1.6000	150,000	173,377	2032/03/20
7	30年	国債	2.3000	12,000	14,764	2032/05/20
137	20年	国債	1.7000	18,000	21,039	2032/06/20
139	20年	国債	1.6000	160,000	185,347	2032/06/20
140	20年	国債	1.7000	65,000	76,155	2032/09/20
141	20年	国債	1.7000	48,000	56,364	2032/12/20
142	20年	国債	1.8000	165,000	195,554	2032/12/20
10	30年	国債	1.1000	25,000	27,731	2033/03/20
143	20年	国債	1.6000	100,000	116,563	2033/03/20
144	20年	国債	1.5000	70,000	80,812	2033/03/20
11	30年	国債	1.7000	9,000	10,613	2033/06/20
145	20年	国債	1.7000	190,000	224,072	2033/06/20
12	30年	国債	2.1000	11,000	13,519	2033/09/20
146	20年	国債	1.7000	165,000	194,998	2033/09/20
13	30年	国債	2.0000	11,000	13,424	2033/12/20
147	20年	国債	1.6000	195,000	228,606	2033/12/20
14	30年	国債	2.4000	22,000	27,977	2034/03/20
148	20年	国債	1.5000	155,000	180,159	2034/03/20
15	30年	国債	2.5000	21,000	27,045	2034/06/20
149	20年	国債	1.5000	195,000	227,009	2034/06/20
16	30年	国債	2.5000	26,000	33,611	2034/09/20
150	20年	国債	1.4000	185,000	213,377	2034/09/20
17	30年	国債	2.4000	17,000	21,826	2034/12/20
151	20年	国債	1.2000	190,000	214,576	2034/12/20
18	30年	国債	2.3000	20,000	25,506	2035/03/20
152	20年	国債	1.2000	160,000	180,960	2035/03/20
19	30年	国債	2.3000	15,000	19,181	2035/06/20
153	20年	国債	1.3000	180,000	206,121	2035/06/20
20	30年	国債	2.5000	16,000	20,956	2035/09/20
154	20年	国債	1.2000	205,000	232,221	2035/09/20
21	30年	国債	2.3000	16,000	20,578	2035/12/20
155	20年	国債	1.0000	165,000	182,541	2035/12/20
22	30年	国債	2.5000	17,000	22,388	2036/03/20
156	20年	国債	0.4000	150,000	153,316	2036/03/20
23	30年	国債	2.5000	16,000	21,128	2036/06/20
157	20年	国債	0.2000	196,000	194,486	2036/06/20
24	30年	国債	2.5000	15,000	19,874	2036/09/20
158	20年	国債	0.5000	205,000	212,162	2036/09/20
25	30年	国債	2.3000	17,000	22,087	2036/12/20
159	20年	国債	0.6000	145,000	152,031	2036/12/20
26	30年	国債	2.4000	32,000	42,168	2037/03/20
160	20年	国債	0.7000	165,000	175,423	2037/03/20
161	20年	国債	0.6000	135,000	141,331	2037/06/20
27	30年	国債	2.5000	32,000	42,847	2037/09/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

当		期		末			
区	分	銘	柄	年利率	額面金額	評 価 額	償還年月日
				%	千円	千円	
	162	20年国債		0.6000	175,000	183,058	2037/09/20
	163	20年国債		0.6000	120,000	125,416	2037/12/20
	28	30年国債		2.5000	34,000	45,765	2038/03/20
	164	20年国債		0.5000	185,000	190,305	2038/03/20
	165	20年国債		0.5000	155,000	159,259	2038/06/20
	29	30年国債		2.4000	43,000	57,490	2038/09/20
	166	20年国債		0.7000	170,000	180,013	2038/09/20
	167	20年国債		0.5000	125,000	128,120	2038/12/20
	30	30年国債		2.3000	56,000	74,235	2039/03/20
	168	20年国債		0.4000	155,000	156,009	2039/03/20
	169	20年国債		0.3000	115,000	113,578	2039/06/20
	31	30年国債		2.2000	76,000	99,896	2039/09/20
	170	20年国債		0.3000	125,000	123,228	2039/09/20
	171	20年国債		0.3000	130,000	127,918	2039/12/20
	32	30年国債		2.3000	45,000	60,142	2040/03/20
	172	20年国債		0.4000	165,000	165,000	2040/03/20
	173	20年国債		0.4000	150,000	149,740	2040/06/20
	33	30年国債		2.0000	95,000	122,221	2040/09/20
	174	20年国債		0.4000	195,000	194,319	2040/09/20
	175	20年国債		0.5000	135,000	136,783	2040/12/20
	34	30年国債		2.2000	110,000	145,864	2041/03/20
	176	20年国債		0.5000	150,000	151,735	2041/03/20
	177	20年国債		0.4000	128,000	126,963	2041/06/20
	35	30年国債		2.0000	120,000	155,229	2041/09/20
	178	20年国債		0.5000	60,000	60,545	2041/09/20
	36	30年国債		2.0000	118,000	153,158	2042/03/20
	37	30年国債		1.9000	135,000	173,057	2042/09/20
	38	30年国債		1.8000	85,000	107,615	2043/03/20
	39	30年国債		1.9000	88,000	113,401	2043/06/20
	40	30年国債		1.8000	70,000	88,850	2043/09/20
	41	30年国債		1.7000	65,000	81,299	2043/12/20
	42	30年国債		1.7000	73,000	91,398	2044/03/20
	43	30年国債		1.7000	70,000	87,733	2044/06/20
	44	30年国債		1.7000	75,000	94,095	2044/09/20
	45	30年国債		1.5000	80,000	97,036	2044/12/20
	46	30年国債		1.5000	90,000	109,236	2045/03/20
	47	30年国債		1.6000	105,000	129,881	2045/06/20
	48	30年国債		1.4000	110,000	131,197	2045/09/20
	49	30年国債		1.4000	75,000	89,492	2045/12/20
	50	30年国債		0.8000	85,000	89,843	2046/03/20
	51	30年国債		0.3000	95,000	89,475	2046/06/20
	52	30年国債		0.5000	102,000	100,556	2046/09/20
	53	30年国債		0.6000	95,000	95,729	2046/12/20
	54	30年国債		0.8000	84,000	88,467	2047/03/20
	55	30年国債		0.8000	96,000	101,036	2047/06/20
	56	30年国債		0.8000	88,000	92,448	2047/09/20
	57	30年国債		0.8000	90,000	94,481	2047/12/20
	1	40年国債		2.4000	30,000	43,147	2048/03/20
	58	30年国債		0.8000	140,000	146,860	2048/03/20
	59	30年国債		0.7000	97,000	99,221	2048/06/20
	60	30年国債		0.9000	80,000	85,540	2048/09/20
	61	30年国債		0.7000	70,000	71,297	2048/12/20
	2	40年国債		2.2000	48,000	66,797	2049/03/20
	62	30年国債		0.5000	82,000	79,239	2049/03/20
	63	30年国債		0.4000	85,000	79,847	2049/06/20
	64	30年国債		0.4000	90,000	84,304	2049/09/20
	65	30年国債		0.4000	76,000	71,069	2049/12/20
	3	40年国債		2.2000	19,000	26,579	2050/03/20
	66	30年国債		0.4000	115,000	107,484	2050/03/20
	67	30年国債		0.6000	90,000	88,596	2050/06/20
	68	30年国債		0.6000	96,000	94,490	2050/09/20
	69	30年国債		0.7000	106,000	107,163	2050/12/20
	4	40年国債		2.2000	54,000	76,097	2051/03/20
	70	30年国債		0.7000	166,000	167,630	2051/03/20
	71	30年国債		0.7000	66,000	66,652	2051/06/20
	72	30年国債		0.7000	43,000	43,374	2051/09/20
	5	40年国債		2.0000	35,000	47,745	2052/03/20
	6	40年国債		1.9000	40,000	53,772	2053/03/20

		当 期		末		
区 分	銘 柄	年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日	
		%	千円	千円		
	7 40年国債	1.7000	41,000	53,129	2054/03/20	
	8 40年国債	1.4000	33,000	40,048	2055/03/20	
	9 40年国債	0.4000	40,000	36,529	2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	91,000	96,974	2057/03/20	
	11 40年国債	0.8000	85,000	87,841	2058/03/20	
	12 40年国債	0.5000	99,000	92,460	2059/03/20	
	13 40年国債	0.5000	252,000	234,649	2060/03/20	
	14 40年国債	0.7000	225,000	223,620	2061/03/20	
種別	銘柄数	256銘柄				
小計	金 額		30,736,000	32,422,792		
地方債証券	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	100,888	2023/01/31	
	25-6 大阪市公債	0.6940	100,000	101,361	2023/11/22	
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	101,843	2025/04/16	
	40-1 大阪府公債	0.4770	100,000	101,830	2025/10/29	
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	106,623	2025/11/21	
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,874	2025/11/27	
	75-1 東京都公債	0.3700	100,000	101,482	2025/12/19	
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,901	2026/02/26	
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	100,347	2026/03/19	
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,259	2026/06/19	
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,119	2027/03/25	
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	101,351	2028/01/25	
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	116,484	2029/12/14	
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	117,498	2030/05/24	
	11 兵庫県公債20年	1.8400	100,000	115,133	2030/08/16	
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	100,139	2031/06/30	
種別	銘柄数	16銘柄				
小計	金 額		1,600,000	1,669,140		
特殊債券 除く金融債券	190 政保道路機構	0.6050	100,000	100,960	2023/05/31	
	645 地方公団団体	0.5350	100,000	101,524	2024/10/28	
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	101,599	2025/03/31	
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	101,642	2025/11/28	
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,191	2026/09/18	
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	107,467	2026/09/18	
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	115,643	2029/05/31	
	47 日本政策投資CO	1.0270	100,000	107,254	2029/09/20	
種別	銘柄数	8銘柄				
小計	金 額		800,000	836,281		
普通社債券	32 東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	105,124	2024/03/19	
	25 西日本高速道	0.5240	100,000	101,504	2024/12/20	
	497 関西電力	1.0020	100,000	103,128	2025/06/20	
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,443	2025/12/19	
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	100,249	2026/08/21	
	17 パナソニック	0.4700	100,000	101,500	2026/09/18	
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	100,049	2026/11/13	
	80 三菱地所	2.3050	100,000	111,514	2027/03/19	
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	100,741	2027/12/03	
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	100,444	2030/09/10	
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	100,138	2031/12/02	
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	101,583	2032/09/17	
種別	銘柄数	12銘柄				
小計	金 額		1,200,000	1,226,423		
合計	銘柄数	292銘柄				
	金 額		34,336,000	36,154,637		

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	36,154,637	98.2
コール・ローン等、その他	668,811	1.8
投資信託財産総額	36,823,449	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

2021年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	36,823,449,026円
コール・ローン等	501,425,122
公社債(評価額)	36,154,637,480
未収入金	100,780,000
未収利息	63,459,509
前払費用	3,146,915
(B) 負債	255,573,050
未払金	255,573,050
(C) 純資産総額(A－B)	36,567,875,976
元本	28,295,749,520
次期繰越損益金	8,272,126,456
(D) 受益権総口数	28,295,749,520口
1万口当り基準価額(C／D)	12,923円

* 期首における元本額は18,557,007,274円、当作成期間中における追加設定元本額は10,127,411,494円、同解約元本額は388,669,248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：

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）	770,013,279円
iFree 日本債券インデックス	3,390,931,023円
iFree 8資産バランス	3,530,311,974円
ダイワ・ライフ・バランス30	8,635,471,870円
ダイワ・ライフ・バランス50	5,874,053,364円
ダイワ・ライフ・バランス70	1,922,377,924円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／安定コース）	1,413,238,761円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／6分散コース）	1,072,161,188円
DCダイワ・ワールドアセット（六つの羽／成長コース）	392,417,838円
ダイワつみたてインデックス日本債券	753,843,841円
ダイワつみたてインデックスバランス30	30,126,272円
ダイワつみたてインデックスバランス50	14,185,342円
ダイワつみたてインデックスバランス70	9,313,400円
ダイワ世界バランスファンド40VA	287,546,791円
ダイワ世界バランスファンド60VA	199,756,653円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,923円です。

■損益の状況

当期 自2020年12月1日 至2021年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	203,032,215円
受取利息	203,089,007
支払利息	△ 56,792
(B) 有価証券売買損益	△ 159,820,700
売買益	28,848,030
売買損	△ 188,668,730
(C) その他費用	△ 126
(D) 当期損益金(A + B + C)	43,211,389
(E) 前期繰越損益金	5,405,410,806
(F) 解約差損益金	△ 113,476,438
(G) 追加信託差損益金	2,936,980,699
(H) 合計(D + E + F + G)	8,272,126,456
次期繰越損益金(H)	8,272,126,456

(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。