

# ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス

## 運用報告書(全体版)

### 第22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、わが国の公社債に投資し、投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)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うことを基本とします。

日本債券インデックスマザーファンドの受益証券およびわが国の公社債

わが国の公社債

ベビーファンドの  
実質株式組入上限比率

マザーファンドの  
株式組入上限比率

純資産総額の30%以下

純資産総額の30%以下

分配対象額は、経費控除後の利息等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、利息等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

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	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)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うことを基本とします。		
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券およびわが国の公社債	
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債	
組入制限	ベビーファンドの 実質株式組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	マザーファンドの 株式組入上限比率	純資産総額の30%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の利息等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、利息等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
18期末(2017年11月30日)	12,746	0	△ 1.0	522.295	△ 0.5	99.3	—	8,843
19期末(2018年11月30日)	12,717	0	△ 0.2	523.683	0.3	99.4	—	9,012
20期末(2019年12月2日)	12,952	0	1.8	536.068	2.4	99.5	—	9,831
21期末(2020年11月30日)	12,781	0	△ 1.3	531.781	△ 0.8	99.5	—	9,883
22期末(2021年11月30日)	12,730	0	△ 0.4	532.469	0.1	98.9	—	9,662

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

(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。

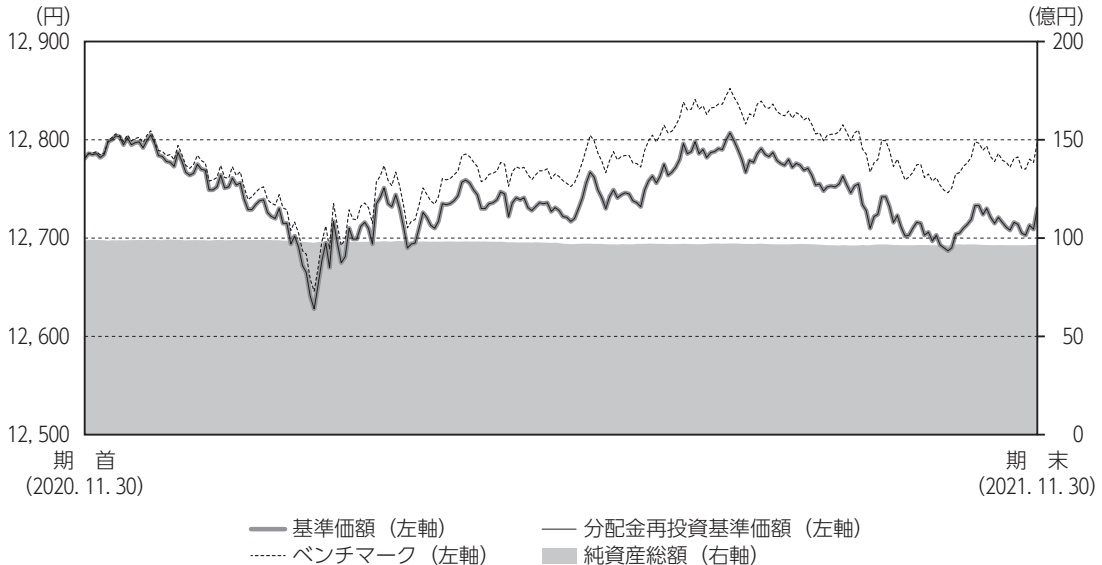
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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。

\* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DB I）総合指数です。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：12,781円

期末：12,730円（分配金0円）

騰落率：△0.4%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

わが国の公社債に投資した結果、金利は上昇（債券価格は下落）したものの、債券の利息収入がプラス要因となり、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。

# ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %		
(期首) 2020年11月30日	12,781	—	531.781	—	99.5	—
12月末	12,777	△ 0.0	531.946	0.0	99.5	—
2021年 1月末	12,740	△ 0.3	530.582	△ 0.2	99.5	—
2月末	12,628	△ 1.2	526.155	△ 1.1	99.0	—
3月末	12,712	△ 0.5	529.811	△ 0.4	99.1	—
4月末	12,730	△ 0.4	530.887	△ 0.2	99.1	—
5月末	12,731	△ 0.4	531.127	△ 0.1	98.8	—
6月末	12,732	△ 0.4	531.421	△ 0.1	99.3	—
7月末	12,791	0.1	534.087	0.4	98.9	—
8月末	12,774	△ 0.1	533.627	0.3	98.8	—
9月末	12,724	△ 0.4	531.730	△ 0.0	99.1	—
10月末	12,705	△ 0.6	531.186	△ 0.1	99.2	—
(期末) 2021年11月30日	12,730	△ 0.4	532.469	0.1	98.9	—

(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

「日本債券インデックスマザーファンド」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。

### 日本債券インデックスマザーファンド

今後も、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います。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、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を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

「日本債券インデックスマザーファンド」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。

## ■日本債券インデックスマザーファンド

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。

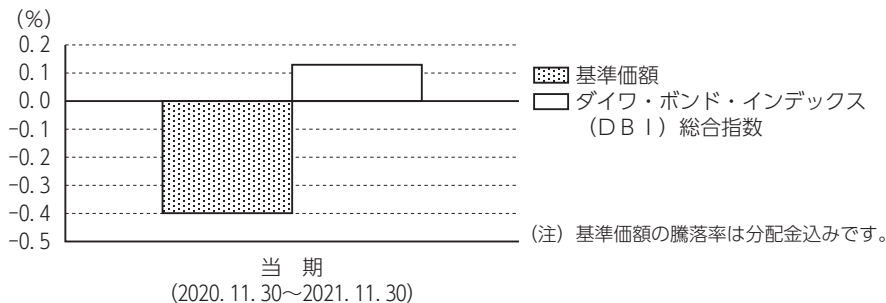
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

## 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△0.4%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0.5%でした。差異の内訳は、運用管理费用等の要因によるベンチマークとの差異が0.5%程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が0.0%程度となっており、信託報酬要因を除くと、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。



\* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）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	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）	2,859

（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

「日本債券インデックスマザーファンド」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。

### ■日本債券インデックスマザーファンド

今後も、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います。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、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を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	63円	0. 495%	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12, 742円です。
(投 信 会 社)	(22)	(0. 176)	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)	(29)	(0. 231)	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)	(11)	(0. 088)	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	64	0. 500	

(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。

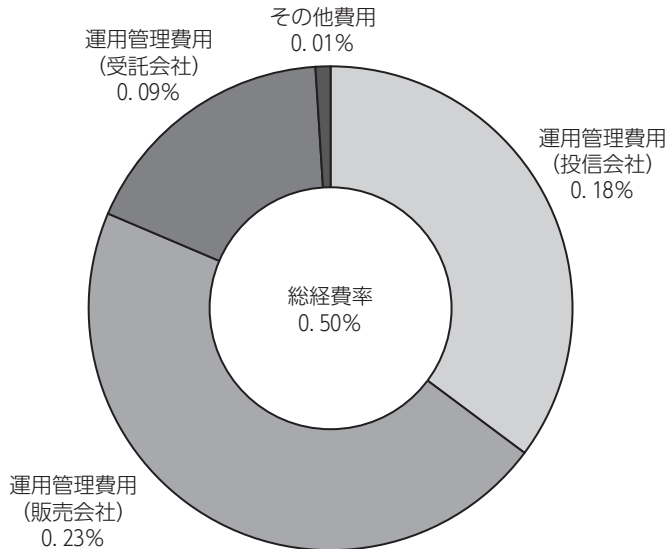
(注 4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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0.50%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
日本債券インデックス マザーファンド	524,531	743,758	700,868	993,313

(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					
	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	21,163	225	1.1	16,183	503	3.1
コール・ローン	91,036	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合10.7%

※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っ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	
	日本債券インデックスマザーファンド	
	買 付 額	
	百万円	
公社債	600	

(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
日本債券インデックス マザーファンド	6,961,101	6,784,763	9,633,686

(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	%
日本債券インデックス マザーファンド	9,633,686	99.1
コール・ローン等、その他	83,272	0.9
投資信託財産総額	9,716,959	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	9,716,959,025円
コール・ローン等	76,265,993
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	9,633,686,272
未収入金	7,006,760
(B) 負債	54,464,143
未払解約金	30,181,514
未払信託報酬	24,015,883
その他未払費用	266,746
(C) 純資産総額 (A - B)	9,662,494,882
元本	7,590,469,161
次期繰越損益金	2,072,025,721
(D) 受益権総口数	7,590,469,161口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,730円

\* 期首における元本額は7,733,105,841円、当作成期間中における追加設定元本額は1,303,947,431円、同解約元本額は1,446,584,111円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,730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	△ 10,692円
受取利息	770
支払利息	△ 11,462
(B) 有価証券売買損益	14,655,458
売買益	13,184,307
売買損	1,471,151
(C) 信託報酬等	△ 48,859,466
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 34,214,700
(E) 前期繰越損益金	187,267,842
(F) 追加信託差損益金	1,918,972,579
(配当等相当額)	( 1,727,357,068)
(売買損益相当額)	( 191,615,511)
(G) 合計 (D + E + F)	2,072,025,721
次期繰越損益金 (G)	2,072,025,721
追加信託差損益金	1,918,972,579
(配当等相当額)	( 1,727,357,068)
(売買損益相当額)	( 191,615,511)
分配準備積立金	285,862,825
繰越損益金	△ 132,809,683

(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	1,884,768,571
(d) 分配準備積立金	285,862,825
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,170,631,396
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,170,631,396
(h) 受益権総口数	7,590,469,161口

# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第22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)

日本債券インデックスマザーファンド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	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 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うことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

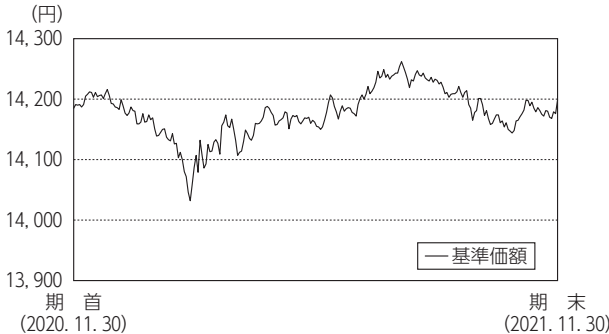
## 大和アセットマネジメント

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		ダイワ・ポンド・インデックス (DBI) 総合指数 (ベンチマーク)		公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率	総合指数	騰落率		
(期首) 2020年11月30日	14,185	—	531.781	—	99.6	—
12月末	14,186	0.0	531.946	0.0	99.6	—
2021年1月末	14,151	△ 0.2	530.582	△ 0.2	99.6	—
2月末	14,032	△ 1.1	526.155	△ 1.1	99.3	—
3月末	14,132	△ 0.4	529.811	△ 0.4	99.4	—
4月末	14,158	△ 0.2	530.887	△ 0.2	99.4	—
5月末	14,165	△ 0.1	531.127	△ 0.1	99.1	—
6月末	14,172	△ 0.1	531.421	△ 0.1	99.6	—
7月末	14,243	0.4	534.087	0.4	99.2	—
8月末	14,231	0.3	533.627	0.3	99.1	—
9月末	14,181	△ 0.0	531.730	△ 0.0	99.4	—
10月末	14,165	△ 0.1	531.186	△ 0.1	99.5	—
(期末) 2021年11月30日	14,199	0.1	532.469	0.1	99.2	—

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) ダイワ・ポンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

(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：14,185円 期末：14,199円 騰落率：0.1%

## 【基準価額の主な変動要因】

わが国の公社債に投資した結果、金利は上昇 (債券価格は下落) したものの、債券の利息収入がプラス要因となり、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。

## ◆投資環境について

## ○国内債券市場

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」

今後も、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います。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、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を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も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ほとんどなく、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。

\*ベンチマークはダイワ・ポンド・インデックス (DBI) 総合指数です。

## 《今後の運用方針》

今後も、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います。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、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

# 日本債券インデックスマザーファンド

## ■ 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	19,816,548	( 14,064,024 —)
	地方債証券	421,001	( 1,009,011 —)
	特殊債券	225,389	( 605,562 —)
	社債券	700,719	( 505,306 —)

(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		付	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
145 5年国債 0.1% 2025/9/20	1,110,680	410 2年国債 0.1% 2022/3/1	2,005,080
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,005,249	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	1,173,167
360 10年国債 0.1% 2030/9/20	895,581	132 5年国債 0.1% 2022/6/20	882,041
147 5年国債 0.005% 2026/3/20	872,273	415 2年国債 0.1% 2022/8/1	751,784
362 10年国債 0.1% 2031/3/20	745,643	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	709,633
363 10年国債 0.1% 2031/6/20	744,395	348 10年国債 0.1% 2027/9/20	608,574
361 10年国債 0.1% 2030/12/20	630,890	133 5年国債 0.1% 2022/9/20	551,287
421 2年国債 0.1% 2023/2/1	602,557	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	404,692
348 10年国債 0.1% 2027/9/20	557,039	144 5年国債 0.1% 2025/6/20	388,457
364 10年国債 0.1% 2031/9/20	520,914	323 10年国債 0.9% 2022/6/20	384,073

(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）

作成期 区分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちB B 格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	79,992,000	85,097,080	89.5	—	58.1	21.6	9.7
地方債証券	3,300,000	3,514,853	3.7	—	2.2	1.0	0.5
特殊債券（除く金融債券）	2,500,000	2,602,888	2.7	—	1.3	0.8	0.6
金融債券	100,000	100,201	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	2,900,000	2,976,109	3.1	—	1.6	1.4	0.1
合 計	88,792,000	94,291,133	99.2	—	63.3	24.8	11.0

(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	
<b>国債証券</b>	134 5年国債	0.1000	950,000	952,251	2022/12/20
	326 10年国債	0.7000	30,000	30,258	2022/12/20
	327 10年国債	0.8000	450,000	454,360	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	45,862	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,160	2022/12/20
	421 2年国債	0.1000	600,000	601,614	2023/02/01
	135 5年国債	0.1000	1,550,000	1,554,526	2023/03/20
	328 10年国債	0.6000	350,000	353,300	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	101,463	2023/03/20
	423 2年国債	0.0050	100,000	100,180	2023/04/01
	424 2年国債	0.0050	500,000	500,955	2023/05/01
	425 2年国債	0.0050	380,000	380,767	2023/06/01
	136 5年国債	0.1000	950,000	953,391	2023/06/20
	329 10年国債	0.8000	500,000	507,185	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	96,365	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	133,887	2023/06/20
	426 2年国債	0.0050	390,000	390,830	2023/07/01
	427 2年国債	0.0050	166,000	166,373	2023/08/01
	137 5年国債	0.1000	800,000	803,392	2023/09/20
	330 10年国債	0.8000	612,000	622,281	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	365,000	369,814	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	93,301	2023/09/20
	429 2年国債	0.0050	40,000	40,099	2023/10/01
	138 5年国債	0.1000	1,200,000	1,205,676	2023/12/20
	332 10年国債	0.6000	250,000	253,727	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	175,000	182,290	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	185,000	192,326	2023/12/20
	139 5年国債	0.1000	900,000	904,770	2024/03/20
	333 10年国債	0.6000	700,000	711,697	2024/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

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	
	67 20年国債		1. 9000	55, 000	57, 560	2024/03/20
	68 20年国債		2. 2000	120, 000	126, 416	2024/03/20
	69 20年国債		2. 1000	110, 000	115, 628	2024/03/20
	140 5年国債		0. 1000	700, 000	704, 025	2024/06/20
	334 10年国債		0. 6000	900, 000	916, 695	2024/06/20
	70 20年国債		2. 4000	83, 000	88, 362	2024/06/20
	71 20年国債		2. 2000	125, 000	132, 436	2024/06/20
	141 5年国債		0. 1000	1, 120, 000	1, 127, 078	2024/09/20
	335 10年国債		0. 5000	690, 000	702, 123	2024/09/20
	72 20年国債		2. 1000	105, 000	111, 555	2024/09/20
	142 5年国債		0. 1000	850, 000	855, 856	2024/12/20
	336 10年国債		0. 5000	275, 000	280, 263	2024/12/20
	337 10年国債		0. 3000	400, 000	405, 208	2024/12/20
	73 20年国債		2. 0000	120, 000	127, 792	2024/12/20
	74 20年国債		2. 1000	73, 000	77, 964	2024/12/20
	143 5年国債		0. 1000	700, 000	705, 215	2025/03/20
	338 10年国債		0. 4000	580, 000	589, 987	2025/03/20
	75 20年国債		2. 1000	80, 000	85, 881	2025/03/20
	76 20年国債		1. 9000	51, 000	54, 411	2025/03/20
	77 20年国債		2. 0000	130, 000	139, 126	2025/03/20
	144 5年国債		0. 1000	890, 000	896, 977	2025/06/20
	339 10年国債		0. 4000	590, 000	600, 938	2025/06/20
	78 20年国債		1. 9000	61, 000	65, 381	2025/06/20
	79 20年国債		2. 0000	50, 000	53, 770	2025/06/20
	80 20年国債		2. 1000	53, 000	57, 185	2025/06/20
	145 5年国債		0. 1000	1, 100, 000	1, 109, 031	2025/09/20
	340 10年国債		0. 4000	760, 000	775, 093	2025/09/20
	82 20年国債		2. 1000	87, 000	94, 341	2025/09/20
	146 5年国債		0. 1000	480, 000	484, 099	2025/12/20
	341 10年国債		0. 3000	500, 000	508, 445	2025/12/20
	83 20年国債		2. 1000	93, 000	101, 365	2025/12/20
	147 5年国債		0. 0050	840, 000	843, 981	2026/03/20
	342 10年国債		0. 1000	880, 000	887, 981	2026/03/20
	85 20年国債		2. 1000	58, 000	63, 536	2026/03/20
	86 20年国債		2. 3000	80, 000	88, 326	2026/03/20
	87 20年国債		2. 2000	55, 000	60, 487	2026/03/20
	148 5年国債		0. 0050	1, 000, 000	1, 005, 020	2026/06/20
	343 10年国債		0. 1000	780, 000	787, 488	2026/06/20
	88 20年国債		2. 3000	100, 000	110, 996	2026/06/20
	89 20年国債		2. 2000	78, 000	86, 220	2026/06/20
	149 5年国債		0. 0050	220, 000	221, 060	2026/09/20
	344 10年国債		0. 1000	780, 000	787, 527	2026/09/20
	90 20年国債		2. 2000	20, 000	22, 219	2026/09/20
	345 10年国債		0. 1000	900, 000	909, 135	2026/12/20
	92 20年国債		2. 1000	310, 000	344, 627	2026/12/20
	346 10年国債		0. 1000	780, 000	788, 307	2027/03/20
	93 20年国債		2. 0000	100, 000	111, 186	2027/03/20
	94 20年国債		2. 1000	130, 000	145, 234	2027/03/20
	347 10年国債		0. 1000	600, 000	606, 528	2027/06/20
	95 20年国債		2. 3000	50, 000	56, 682	2027/06/20



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	
	96 20年国債		2.1000	55,000	61,736	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	550,000	556,253	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	45,343	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	320,000	360,876	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	1,050,000	1,062,453	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	100,000	113,326	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	500,000	506,015	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	177,426	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	350,000	405,076	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	99,550	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	800,000	809,744	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	196,642	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,435	2028/06/20
	11 フィリピン共和国		0.9900	100,000	101,955	2028/08/15
	352 10年国債		0.1000	700,000	708,855	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	144,787	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	173,392	2028/09/20
	353 10年国債		0.1000	580,000	587,609	2028/12/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	103,914	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	300,000	342,126	2028/12/20
	354 10年国債		0.1000	600,000	607,926	2029/03/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	62,971	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	260,000	301,498	2029/03/20
	355 10年国債		0.1000	690,000	699,163	2029/06/20
	111 20年国債		2.2000	200,000	234,462	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	150,000	174,708	2029/06/20
	356 10年国債		0.1000	510,000	516,599	2029/09/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	19,579	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	310,000	362,634	2029/09/20
	357 10年国債		0.1000	620,000	627,768	2029/12/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	82,200	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	212,828	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	28,854	2030/02/20
	358 10年国債		0.1000	660,000	667,966	2030/03/20
	116 20年国債		2.2000	200,000	237,400	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	200,000	235,734	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	35,947	2030/05/20
	359 10年国債		0.1000	930,000	940,360	2030/06/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	111,531	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	107,588	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	317,000	361,294	2030/06/20
	360 10年国債		0.1000	900,000	909,117	2030/09/20
	121 20年国債		1.9000	200,000	233,758	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	200,000	231,996	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	45,364	2030/11/20
	361 10年国債		0.1000	633,000	638,437	2030/12/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	237,910	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	300,000	354,150	2030/12/20
	362 10年国債		0.1000	710,000	715,268	2031/03/20
	125 20年国債		2.2000	130,000	156,302	2031/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

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	
	126 20年国債		2.0000	110,000	130,214	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	250,000	293,620	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	33,734	2031/05/20
	363 10年国債		0.1000	700,000	703,990	2031/06/20
	128 20年国債		1.9000	250,000	294,380	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	200,000	233,600	2031/06/20
	364 10年国債		0.1000	520,000	522,277	2031/09/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	163,899	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	174,142	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	29,580	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	40,000	46,531	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	430,000	504,506	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	30,000	35,288	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	107,278	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	300,000	346,755	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	67,672	2032/05/20
	138 20年国債		1.5000	100,000	114,796	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	370,000	428,615	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	300,000	351,486	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	31,965	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	49,056	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	200,000	234,850	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	240,000	284,443	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	49,915	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	244,782	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	240,000	277,072	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	47,173	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	420,000	495,318	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	73,740	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	350,000	413,633	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	91,533	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	320,000	375,148	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	104,279	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	530,000	616,029	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	50,000	64,395	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	402,000	467,988	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	323,187	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	180,000	207,610	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	166,909	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	400,000	451,740	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	102,026	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	460,000	520,260	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	72,888	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	430,000	492,401	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	550,000	623,034	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	77,168	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	350,000	387,208	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	170,000	223,884	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	270,000	275,969	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	360,000	357,220	2036/06/20

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	
	24 30年国債		2.5000	92,000	121,895	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	350,000	362,229	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	194,889	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	170,000	178,243	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	237,198	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	360,000	382,741	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	320,000	335,008	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	200,848	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	350,000	366,117	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	340,000	355,347	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	228,825	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	500,000	514,340	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	300,000	308,244	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	267,398	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	350,000	370,615	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	300,000	307,488	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	291,638	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	320,000	322,083	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	320,000	316,044	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	394,329	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	220,000	216,882	2039/09/20
	171 20年国債		0.3000	300,000	295,197	2039/12/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	380,899	2040/03/20
	172 20年国債		0.4000	100,000	100,000	2040/03/20
	173 20年国債		0.4000	410,000	409,290	2040/06/20
	33 30年国債		2.0000	280,000	360,231	2040/09/20
	174 20年国債		0.4000	420,000	418,534	2040/09/20
	175 20年国債		0.5000	400,000	405,284	2040/12/20
	34 30年国債		2.2000	270,000	358,030	2041/03/20
	176 20年国債		0.5000	340,000	343,933	2041/03/20
	177 20年国債		0.4000	365,000	362,043	2041/06/20
	35 30年国債		2.0000	250,000	323,395	2041/09/20
	178 20年国債		0.5000	150,000	151,363	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	310,000	402,364	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	350,000	448,668	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	250,000	316,517	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	230,000	296,389	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	180,000	228,472	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	212,629	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	205,000	256,668	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	200,000	250,668	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	200,000	250,922	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	200,000	242,592	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	140,000	169,923	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	400,000	494,788	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	160,000	190,832	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	120,000	143,187	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	260,000	274,814	2046/03/20
	51 30年国債		0.3000	240,000	226,044	2046/06/20
	52 30年国債		0.5000	260,000	256,321	2046/09/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		償還年月日
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	53 30年国債	0.6000	250,000	251,920	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	326,485	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	260,000	273,639	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	170,000	178,593	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	241,451	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	100,678	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	350,000	367,150	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	306,870	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	224,544	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	203,706	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	153,078	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	230,000	222,258	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	216,057	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	220,000	206,078	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	187,026	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	209,835	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	200,000	186,930	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	230,000	226,412	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	290,000	285,441	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	259,000	261,843	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	253,659	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	235,000	237,307	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	240,000	242,373	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	140,000	141,218	2051/09/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	141,153	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	156,797	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	279,128	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	200,910	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	275,000	293,053	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	330,697	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	354,897	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	430,000	400,394	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	300,000	298,161	2061/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	262銘柄			
	金 額		79,992,000	85,097,080	
地方債証券	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	100,888	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	100,639	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	101,485	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	202,723	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	101,460	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,504	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,447	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	203,686	2025/04/16
	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
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,482	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,259	2026/06/19

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	
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,916	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	101,119	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,625	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	101,039	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,351	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	115,199	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	113,930	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	116,763	2029/06/20
	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
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	100,154	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	100,139	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	117,121	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	115,382	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	115,827	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	109,600	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	130,694	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	115,929	2045/12/20
種別小計	銘柄数	30銘柄			
	金額		3,300,000	3,514,853	
特殊債券 (除く金融債券)	25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,061	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	100,916	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	100,927	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,190	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	100,960	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	101,467	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,524	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,108	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,547	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,284	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
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	107,540	2027/08/25
	1 地方公共団体15年	1.3340	100,000	107,919	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	115,190	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,254	2029/09/20
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	116,970	2032/09/17
	31 地方公共団体20	1.7440	100,000	117,162	2033/09/28
223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,844	2034/07/31	
284 政保道路機構	0.1490	200,000	195,373	2036/07/31	
298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,238	2036/12/26	
247 道路機構	0.3420	200,000	195,749	2040/03/19	
種別小計	銘柄数	22銘柄			
	金額		2,500,000	2,602,888	

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当		期		末	
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
<b>金融債券</b>	19 利付商工債		0.1000	100,000	100,201	2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄				
	金 額			100,000	100,201	
<b>普通社債券</b>	175 オリックス		1.0640	100,000	101,961	2023/11/24
	21 西日本高速道		0.7540	100,000	101,538	2023/12/20
	1 三菱 UFJFG 劣後		0.9400	100,000	101,659	2024/06/26
	482 九州電力		0.1700	100,000	100,233	2024/08/23
	5 野村不動産 HD		0.9240	100,000	102,551	2025/05/30
	11日本たばこ産業		0.5990	100,000	101,889	2025/07/15
	63 中日本高速道		0.5760	100,000	102,163	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング		0.7490	100,000	102,699	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ		0.1900	100,000	100,443	2025/12/19
	16 NTT ファイナンス		0.1800	100,000	100,241	2025/12/19
	1 日生2021基金		0.2800	100,000	100,018	2026/08/03
	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
	509 関西電力		0.4700	100,000	101,460	2027/05/25
	12 アサヒグループHD		0.3300	100,000	101,050	2027/06/11
	15 デンソー		0.2450	100,000	100,656	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス		0.2650	100,000	100,754	2027/07/23
	11 東京電力パワー		0.7900	100,000	102,792	2028/01/25
	20 ZHD		0.4600	100,000	99,967	2028/07/28
	15 ソフトバンク		0.4100	100,000	99,989	2028/10/12
	41 東海旅客鉄道		2.1660	100,000	114,360	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス		1.0900	100,000	106,692	2029/09/20
	7 凸版印刷		1.1040	100,000	106,876	2029/12/12
	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
	332 北海道電力		0.9070	100,000	104,791	2036/04/25
	23 森ビル		0.9700	100,000	102,592	2038/05/17
	107東日本旅客鉄		1.4150	100,000	116,343	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	29銘柄				
	金 額			2,900,000	2,976,109	
合 計	銘 柄 数	344銘柄				
	金 額			88,792,000	94,291,133	

(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
公社債	94,291,133	99.0
コール・ローン等、その他	905,947	1.0
投資信託財産総額	95,197,080	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	95,197,080,993円
コール・ローン等	304,345,621
公社債 (評価額)	94,291,133,700
未収入金	403,578,000
未収利息	195,282,238
前払費用	2,741,434
(B) 負債	117,470,022
未払金	100,000,000
未払解約金	17,470,022
(C) 純資産総額 (A - B)	95,079,610,971
元本	66,960,247,306
次期繰越損益金	28,119,363,665
(D) 受益権総口数	66,960,247,306口
1万口当り基準価額 (C / D)	14,199円

\* 期首における元本額は63,632,169,674円、当作成期間中における追加設定元本額は13,191,022,279円、同解約元本額は9,862,944,647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：

ダイワ国内重視バランスファンド30V A (一般投資家私募)	59,050,508円
ダイワ国内重視バランスファンド50V A (一般投資家私募)	412,666,474円
ダイワ国際分散バランスファンド30V A (一般投資家私募)	49,180,012円
ダイワ国際分散バランスファンド50V A (一般投資家私募)	693,952,196円
D Cダイワ日本債券インデックス	9,573,099,389円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	704,912円
ダイワ・バランスファンド35V A	10,117,083,683円
ダイワ・バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	1,686,540,655円
ダイワ国内バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	219,254,803円
ダイワ国内バランスファンド30V A (適格機関投資家専用)	314,922,939円
ダイワ・ノーロード日本債券ファンド	61,401,829円
ダイワファンドラップ日本債券インデックス	26,594,045,062円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	6,074,653,568円
ダイワファンドラップオンライン日本債券インデックス	2,139,796,937円
ダイワ・インデックスセレクト日本債券	965,018,800円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,784,763,908円
ダイワライフスタイル25	477,075,499円
ダイワライフスタイル50	581,511,996円
ダイワライフスタイル75	155,524,136円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,199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	676,821,899円
受取利息	676,924,268
支払利息	△ 102,369
(B) 有価証券売買損益	△ 562,204,040
売買益	73,052,280
売買損	△ 635,256,320
(C) その他費用	△ 221
(D) 当期損益金 (A + B + C)	114,617,638
(E) 前期繰越損益金	26,626,976,422
(F) 解約差損益金	△ 4,127,794,494
(G) 追加信託差損益金	5,505,564,099
(H) 合計 (D + E + F + G)	28,119,363,665
次期繰越損益金 (H)	28,119,363,665

(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。