

ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド

運用報告書(全体版)

第7期

(決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022年11月30日)

★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	2016年3月14日～2026年11月30日		
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います。		
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	
	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30%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。		

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/>

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			
3 期末 (2018年11月30日)	円 9,917	円 0	% △ 0.2	523.683	% 0.3	% 99.5	% —	百万円 87
4 期末 (2019年12月 2 日)	10,102	0	1.9	536.068	2.4	99.5	—	117
5 期末 (2020年11月30日)	9,971	0	△ 1.3	531.781	△ 0.8	99.5	—	128
6 期末 (2021年11月30日)	9,933	0	△ 0.4	532.469	0.1	98.9	—	87
7 期末 (2022年11月30日)	9,470	0	△ 4.7	509.828	△ 4.3	99.2	—	86

(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。

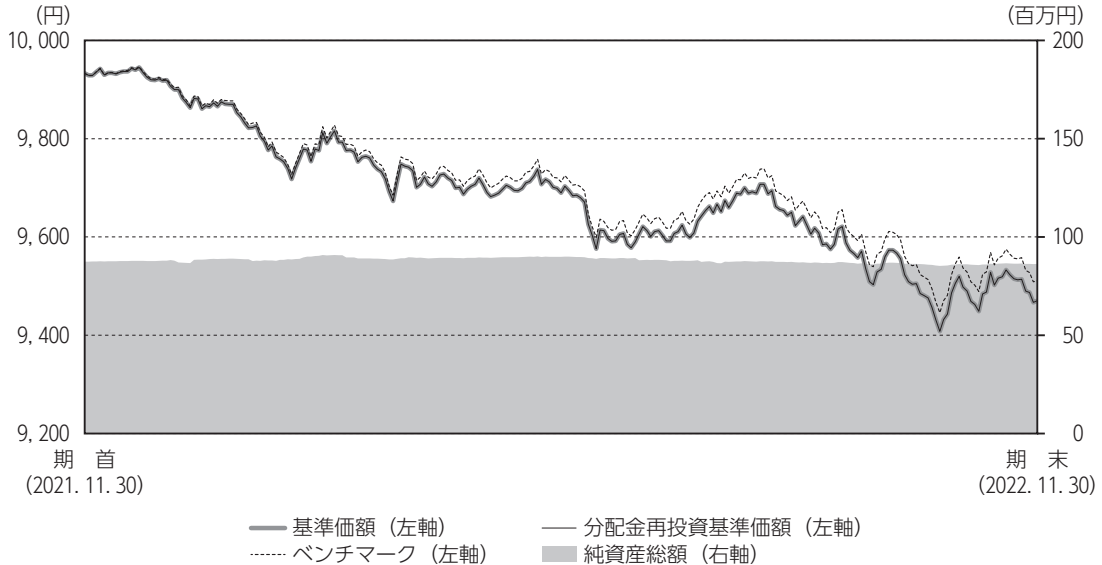
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(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) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成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：9,933円

期 末：9,470円（分配金0円）

騰落率：△4.7%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

わが国の公社債に投資した結果、金利が上昇（債券価格は下落）したことなどから、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。

ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド

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) 2021年11月30日	9,933	—	532.469	—	98.9	—
12月末	9,907	△ 0.3	531.310	△ 0.2	99.4	—
2022年 1月末	9,832	△ 1.0	527.510	△ 0.9	99.2	—
2月末	9,779	△ 1.6	524.780	△ 1.4	99.1	—
3月末	9,748	△ 1.9	523.357	△ 1.7	99.3	—
4月末	9,720	△ 2.1	522.056	△ 2.0	99.3	—
5月末	9,701	△ 2.3	521.104	△ 2.1	99.2	—
6月末	9,606	△ 3.3	516.250	△ 3.0	99.3	—
7月末	9,666	△ 2.7	519.643	△ 2.4	99.2	—
8月末	9,641	△ 2.9	518.539	△ 2.6	99.1	—
9月末	9,534	△ 4.0	513.014	△ 3.7	99.5	—
10月末	9,520	△ 4.2	512.423	△ 3.8	99.1	—
(期末) 2022年11月30日	9,470	△ 4.7	509.828	△ 4.3	99.2	—

(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

(2021. 12. 1 ~ 2022. 11. 30)

国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

国内長期金利は、当作成期首より2021年末にかけて、世界的なインフレ懸念と先進各国での金融引き締めによる将来的なインフレ抑制観測とが綱引きする格好となり、0.05~0.1%程度で推移しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国金利の上昇を受けて日本の長期金利も上昇し、2月には0.2%台となりました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレ要因となり、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。4月以降も、世界的なインフレの進行と海外金利の上昇などにより日本の長期金利にも上昇圧力がかけられましたが、日銀がイールドカーブ・コントロールにおいて許容する長期金利の上限である0.25%を維持する姿勢を強く示したことで、7月にかけて0.2%台前半から半ばで推移しました。8月には、米国でのインフレ・ピークアウト観測などをを受けて一時0.1%台半ばまで低下しました。しかしその後は、米国の金融引き締めに対する警戒感から米国の長期金利が11月上旬まで上昇基調で推移したことに加え、日銀が金融政策を一部修正するのではないかとの思惑も根強く、当作成期末にかけて長期金利は0.25%付近で推移しました。

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

(2021. 12. 1 ~ 2022. 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。

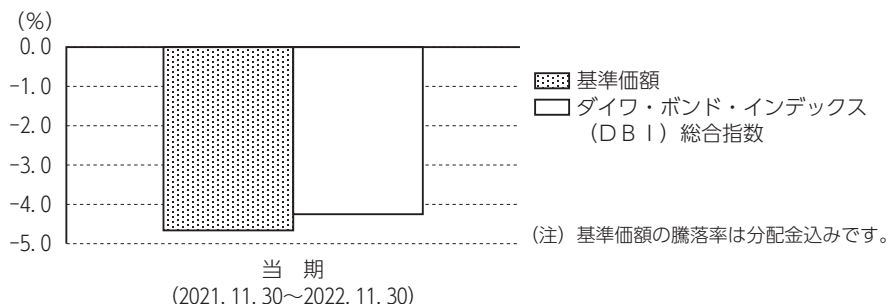
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数

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 $\Delta 4.3\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 4.7\%$ 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 $\Delta 0.4\%$ でした。差異の内訳は、運用管理費用等の要因によるベンチマークとの差異が $\Delta 0.5\%$ 程度となっており、運用管理費用要因を除くと、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	
	2021年12月1日 ～2022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）	83

（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 (2021. 12. 1～2022. 11. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	46円	0. 473%	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, 688円です。
(投 信 会 社)	(21)	(0. 220)	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)	(21)	(0. 220)	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)	(3)	(0. 033)	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
合 計	46	0. 478	

(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。

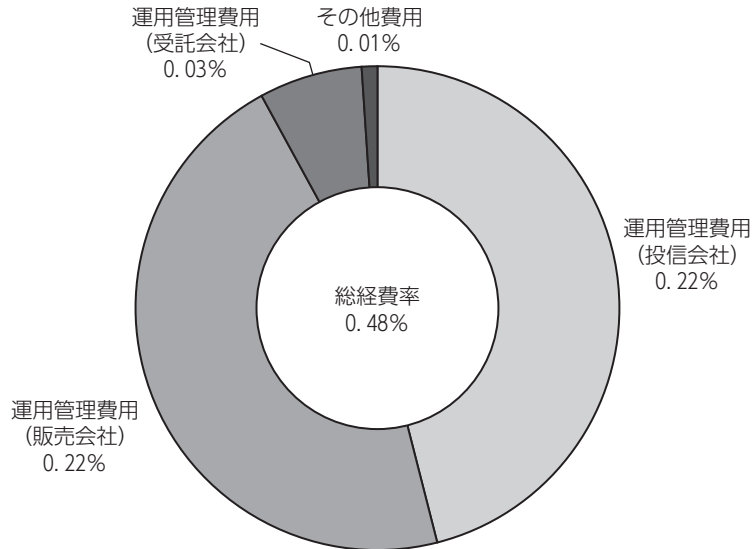
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.48%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

(2021年12月1日から2022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	8,284	11,558	6,442	8,949

(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

(2021年12月1日から2022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	41,486	—	—	18,023	302	1.7
コール・ローン	128,590	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.1%

※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

(2021年12月1日から2022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	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、大和証券株式会社です。

■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	61,401	63,243	86,011

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022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	86,011	99.5
コール・ローン等、その他	466	0.5
投資信託財産総額	86,478	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

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	86,478,322円
コール・ローン等	466,986
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	86,011,336
(B) 負債	209,380
未払信託報酬	207,030
その他未払費用	2,350
(C) 純資産総額 (A - B)	86,268,942
元本	91,100,179
次期繰越損益金	△ 4,831,237
(D) 受益権総口数	91,100,179口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,470円

*期首における元本額は88,036,440円、当作成期間中における追加設定元本額は14,315,960円、同解約元本額は11,252,221円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,470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4,831,237円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3円
支払利息	△ 3
(B) 有価証券売買損益	△ 3,534,438
売買益	217,920
売買損	△ 3,752,358
(C) 信託報酬等	△ 421,240
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 3,955,681
(E) 前期繰越損益金	△ 564,796
(F) 追加信託差損益金	△ 310,760
(配当等相当額)	(419,082)
(売買損益相当額)	(△ 729,842)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 4,831,237
次期繰越損益金 (G)	△ 4,831,237
追加信託差損益金	△ 310,760
(配当等相当額)	(419,082)
(売買損益相当額)	(△ 729,842)
分配準備積立金	339,116
繰越損益金	△ 4,859,593

(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せん。

(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	419,082
(d) 分配準備積立金	339,116
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	758,198
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	758,198
(h) 受益権総口数	91,100,179口

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第23期 (決算日 2022年11月30日)

(作成対象期間 2021年12月1日～2022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 (D B I) 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

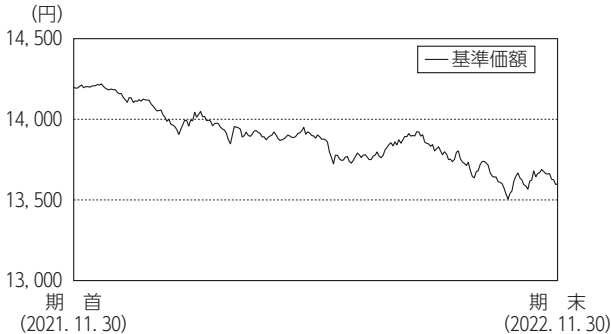
大和アセットマネジメント

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		騰落率		
(期首) 2021年11月30日	14,199	—	532.469	—	99.2	—
12月末	14,167	△ 0.2	531.310	△ 0.2	99.7	—
2022年1月末	14,066	△ 0.9	527.510	△ 0.9	99.5	—
2月末	13,995	△ 1.4	524.780	△ 1.4	99.4	—
3月末	13,956	△ 1.7	523.357	△ 1.7	99.6	—
4月末	13,921	△ 2.0	522.056	△ 2.0	99.6	—
5月末	13,900	△ 2.1	521.104	△ 2.1	99.5	—
6月末	13,768	△ 3.0	516.250	△ 3.0	99.6	—
7月末	13,860	△ 2.4	519.643	△ 2.4	99.5	—
8月末	13,830	△ 2.6	518.539	△ 2.6	99.4	—
9月末	13,681	△ 3.6	513.014	△ 3.7	99.8	—
10月末	13,667	△ 3.7	512.423	△ 3.8	99.4	—
(期末) 2022年11月30日	13,600	△ 4.2	509.828	△ 4.3	99.5	—

(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：14,199円 期末：13,600円 騰落率：△4.2%

【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、金利が上昇 (債券価格は下落) したことから、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。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

国内長期金利は、当作成期首より2021年末にかけて、世界的なインフレ懸念と先進各国での金融引き締めによる将来的なインフレ抑制観測とが綱引きする格好となり、0.05~0.1%程度で推移しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国金利の上昇を受けて日本の長期金利も上昇し、2月には0.2%台となりました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレ要因となり、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。4月以降も、世界的なインフレの進行と海外金利の上昇などにより日本の長期金利にも上昇圧力がかけられましたが、日銀がイールドカーブ・コントロールにおいて許容する長期金利の上限である0.25%を維持する姿勢を強く示したことで、7月にかけて0.2%台前半から半ばで推移しました。8月には、米国のインフレ・ピークアウト観測などを受けて一時0.1%台半ばまで低下しました。しかしその後は、米国の金融引き締めに対する警戒感から米国の長期金利が11月上旬まで上昇基調で推移したことに加え、日銀が金融政策を一部修正するのではないかの思惑も根強く、当作成期末にかけて長期金利は0.25%付近で推移しました。

◆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運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、高い運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△4.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.2%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運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	—
合 計	—

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	41,386,966	(16,713,522 —)
	地方債証券	—	(503,611 —)
	特殊債券	—	(604,776 —)
	社債券	100,000	(201,825 —)

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
436 2年国債 0.005% 2024/5/1	2,404,306	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,552,681
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	1,807,965	148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,101,587
365 10年国債 0.1% 2031/12/20	1,357,117	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	952,223
150 5年国債 0.005% 2026/12/20	1,248,921	136 5年国債 0.1% 2023/6/20	951,833
151 5年国債 0.005% 2027/3/20	1,239,912	137 5年国債 0.1% 2023/9/20	801,920
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	1,151,027	330 10年国債 0.8% 2023/9/20	617,936
367 10年国債 0.2% 2032/6/20	1,068,864	421 2年国債 0.1% 2023/2/1	601,220
433 2年国債 0.005% 2024/2/1	1,000,854	431 2年国債 0.005% 2023/12/1	600,729
153 5年国債 0.005% 2027/6/20	1,000,403	358 10年国債 0.1% 2030/3/20	547,167
366 10年国債 0.2% 2032/3/20	996,557	329 10年国債 0.8% 2023/6/20	504,650

(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	104,450,000	104,845,798	92.7	—	59.0	22.4	11.3
地方債証券	2,800,000	2,911,753	2.6	—	1.3	1.1	0.2
特殊債券（除く金融債券）	1,900,000	1,917,206	1.7	—	1.0	0.6	0.1
金融債券	100,000	99,774	0.1	—	—	0.1	—
普通社債券	2,800,000	2,780,464	2.5	—	1.0	1.3	0.2
合 計	112,050,000	112,554,997	99.5	—	62.3	25.5	11.8

(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		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	額 面 金 額		評 価 額	額 面 金 額	
国債証券		千円	%	千円	千円	
	431 2年国債	300,000	0.0050	300,255	2023/12/01	
	138 5年国債	1,200,000	0.1000	1,202,328	2023/12/20	
	332 10年国債	250,000	0.6000	251,787	2023/12/20	
	65 20年国債	175,000	1.9000	178,647	2023/12/20	
	66 20年国債	185,000	1.8000	188,661	2023/12/20	
	433 2年国債	1,000,000	0.0050	1,000,870	2024/02/01	
	434 2年国債	100,000	0.0050	100,087	2024/03/01	
	139 5年国債	950,000	0.1000	951,966	2024/03/20	
	333 10年国債	700,000	0.6000	705,999	2024/03/20	
	67 20年国債	55,000	1.9000	56,400	2024/03/20	
	68 20年国債	120,000	2.2000	123,524	2024/03/20	
	69 20年国債	110,000	2.1000	113,087	2024/03/20	
	435 2年国債	100,000	0.0050	100,093	2024/04/01	
	436 2年国債	2,300,000	0.0050	2,302,277	2024/05/01	
	140 5年国債	1,120,000	0.1000	1,122,520	2024/06/20	
	334 10年国債	900,000	0.6000	909,000	2024/06/20	
	70 20年国債	83,000	2.4000	86,149	2024/06/20	
	71 20年国債	125,000	2.2000	129,353	2024/06/20	
	438 2年国債	130,000	0.0050	130,102	2024/07/01	
	439 2年国債	650,000	0.0050	650,487	2024/08/01	
	440 2年国債	180,000	0.0050	180,126	2024/09/01	
	141 5年国債	1,240,000	0.1000	1,243,013	2024/09/20	
	335 10年国債	690,000	0.5000	696,658	2024/09/20	
	72 20年国債	105,000	2.1000	109,043	2024/09/20	
	142 5年国債	1,040,000	0.1000	1,042,662	2024/12/20	
	336 10年国債	275,000	0.5000	277,961	2024/12/20	
	337 10年国債	400,000	0.3000	402,668	2024/12/20	
	73 20年国債	120,000	2.0000	124,988	2024/12/20	
	74 20年国債	73,000	2.1000	76,184	2024/12/20	

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
	143 5年国債		0.1000	2,500,000	2,506,600	2025/03/20
	338 10年国債		0.4000	580,000	585,533	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	83,890	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	53,245	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	136,022	2025/03/20
	144 5年国債		0.1000	1,180,000	1,183,457	2025/06/20
	339 10年国債		0.4000	590,000	596,242	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	63,980	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	52,570	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	55,859	2025/06/20
	145 5年国債		0.1000	1,250,000	1,253,850	2025/09/20
	340 10年国債		0.4000	760,000	768,732	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	92,146	2025/09/20
	146 5年国債		0.1000	780,000	782,496	2025/12/20
	341 10年国債		0.3000	500,000	504,655	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	98,975	2025/12/20
	147 5年国債		0.0050	1,200,000	1,200,000	2026/03/20
	342 10年国債		0.1000	880,000	882,754	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	62,007	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	86,055	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	58,981	2026/03/20
	148 5年国債		0.0050	1,050,000	1,049,622	2026/06/20
	343 10年国債		0.1000	780,000	782,347	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	108,108	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	84,048	2026/06/20
	149 5年国債		0.0050	950,000	949,097	2026/09/20
	344 10年国債		0.1000	780,000	782,067	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	21,648	2026/09/20
	150 5年国債		0.0050	1,250,000	1,247,725	2026/12/20
	345 10年国債		0.1000	950,000	951,919	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	335,695	2026/12/20
	151 5年国債		0.0050	1,240,000	1,236,540	2027/03/20
	346 10年国債		0.1000	780,000	780,998	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	108,271	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	141,310	2027/03/20
	153 5年国債		0.0050	850,000	846,719	2027/06/20
	347 10年国債		0.1000	1,100,000	1,100,495	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	55,020	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	55,000	60,023	2027/06/20
	154 5年国債		0.1000	190,000	189,908	2027/09/20
	348 10年国債		0.1000	1,050,000	1,049,496	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	44,004	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	320,000	350,505	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	1,550,000	1,548,047	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	100,000	109,942	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	550,000	549,131	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	171,929	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	350,000	391,912	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	97,237	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	1,000,000	997,790	2028/06/20

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	
	103 20年国債		2.3000	170,000	190,275	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,082	2028/06/20
	11 フィリピン共和国		0.9900	100,000	100,244	2028/08/15
	352 10年国債		0.1000	1,500,000	1,496,115	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	140,214	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	167,785	2028/09/20
	353 10年国債		0.1000	930,000	926,931	2028/12/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	100,525	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	300,000	331,485	2028/12/20
	354 10年国債		0.1000	680,000	677,239	2029/03/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	60,986	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	260,000	291,543	2029/03/20
	355 10年国債		0.1000	1,580,000	1,571,815	2029/06/20
	111 20年国債		2.2000	200,000	226,302	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	150,000	168,754	2029/06/20
	356 10年国債		0.1000	710,000	705,470	2029/09/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	18,817	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	310,000	349,999	2029/09/20
	357 10年国債		0.1000	940,000	932,489	2029/12/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	79,248	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	205,032	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	27,738	2030/02/20
	358 10年国債		0.1000	900,000	891,594	2030/03/20
	116 20年国債		2.2000	200,000	228,526	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	200,000	227,090	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	34,570	2030/05/20
	359 10年国債		0.1000	1,180,000	1,166,878	2030/06/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	107,479	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	103,836	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	317,000	349,229	2030/06/20
	360 10年国債		0.1000	1,000,000	987,380	2030/09/20
	121 20年国債		1.9000	200,000	225,256	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	200,000	223,724	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	43,454	2030/11/20
	361 10年国債		0.1000	1,070,000	1,055,244	2030/12/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	229,022	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	300,000	341,169	2030/12/20
	362 10年国債		0.1000	760,000	748,600	2031/03/20
	125 20年国債		2.2000	130,000	150,425	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	110,000	125,496	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	250,000	283,190	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	32,485	2031/05/20
	363 10年国債		0.1000	1,200,000	1,180,968	2031/06/20
	128 20年国債		1.9000	250,000	284,057	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	200,000	225,574	2031/06/20
	364 10年国債		0.1000	1,210,000	1,189,744	2031/09/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	158,348	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	168,370	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	28,476	2031/11/20
	365 10年国債		0.1000	1,130,000	1,112,033	2031/12/20

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	
	132 20年国債		1.7000	100,000	112,585	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	430,000	487,916	2031/12/20
	366 10年国債		0.2000	900,000	901,233	2032/03/20
	134 20年国債		1.8000	30,000	34,132	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	103,838	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	550,000	615,791	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	65,184	2032/05/20
	367 10年国債		0.2000	960,000	956,860	2032/06/20
	138 20年国債		1.5000	400,000	444,564	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	370,000	414,659	2032/06/20
	368 10年国債		0.2000	220,000	218,946	2032/09/20
	140 20年国債		1.7000	500,000	565,310	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	30,803	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	47,361	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	400,000	452,436	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	190,000	216,752	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	48,234	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	235,624	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	490,000	544,929	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	45,286	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	450,000	509,476	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	70,452	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	350,000	396,294	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	87,330	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	400,000	448,664	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	99,138	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	450,000	499,725	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	50,000	61,086	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	532,000	590,413	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	305,895	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	530,000	581,860	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	157,717	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	480,000	515,260	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	96,237	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	460,000	493,304	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	68,630	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	680,000	736,841	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	570,000	609,934	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	72,346	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	440,000	459,078	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	170,000	209,392	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	370,000	357,146	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	560,000	524,367	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	92,000	113,485	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	350,000	340,116	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	181,167	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	310,000	304,280	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	219,915	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	460,000	456,145	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	420,000	409,315	2037/06/20

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	
	27 30年国債		2.5000	150,000	185,344	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	580,000	563,151	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	480,000	464,294	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	210,106	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	600,000	569,640	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	300,000	283,629	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	244,208	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	600,000	582,588	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	400,000	375,188	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	265,284	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	420,000	386,034	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	320,000	287,984	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	356,661	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	420,000	376,080	2039/09/20
	171 20年国債		0.3000	500,000	445,765	2039/12/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	343,179	2040/03/20
	172 20年国債		0.4000	200,000	180,704	2040/03/20
	173 20年国債		0.4000	510,000	459,168	2040/06/20
	33 30年国債		2.0000	280,000	323,780	2040/09/20
	174 20年国債		0.4000	600,000	538,272	2040/09/20
	175 20年国債		0.5000	400,000	364,124	2040/12/20
	34 30年国債		2.2000	270,000	321,108	2041/03/20
	176 20年国債		0.5000	580,000	526,187	2041/03/20
	177 20年国債		0.4000	530,000	470,300	2041/06/20
	35 30年国債		2.0000	250,000	289,107	2041/09/20
	178 20年国債		0.5000	420,000	378,672	2041/09/20
	179 20年国債		0.5000	380,000	341,665	2041/12/20
	36 30年国債		2.0000	350,000	404,652	2042/03/20
	180 20年国債		0.8000	490,000	464,745	2042/03/20
	181 20年国債		0.9000	500,000	482,355	2042/06/20
	37 30年国債		1.9000	450,000	511,866	2042/09/20
	182 20年国債		1.1000	140,000	139,433	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	300,000	335,400	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	230,000	261,059	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	150,000	167,349	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	210,000	230,160	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	205,000	224,481	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	260,000	284,450	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	300,000	327,903	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	250,000	263,307	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	210,000	220,886	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	370,000	395,914	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	280,000	288,218	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	220,000	226,107	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	310,000	280,773	2046/03/20
	51 30年国債		0.3000	340,000	272,550	2046/06/20
	52 30年国債		0.5000	385,000	322,849	2046/09/20
	53 30年国債		0.6000	250,000	213,820	2046/12/20
	54 30年国債		0.8000	310,000	277,028	2047/03/20
	55 30年国債		0.8000	260,000	231,496	2047/06/20

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		
	56 30年国債	0.8000	340,000	301,607	2047/09/20	
	57 30年国債	0.8000	330,000	291,654	2047/12/20	
	1 40年国債	2.4000	70,000	85,554	2048/03/20	
	58 30年国債	0.8000	400,000	352,200	2048/03/20	
	59 30年国債	0.7000	300,000	256,854	2048/06/20	
	60 30年国債	0.9000	410,000	366,966	2048/09/20	
	61 30年国債	0.7000	200,000	169,710	2048/12/20	
	2 40年国債	2.2000	110,000	129,148	2049/03/20	
	62 30年国債	0.5000	430,000	344,679	2049/03/20	
	63 30年国債	0.4000	300,000	232,914	2049/06/20	
	64 30年国債	0.4000	220,000	170,156	2049/09/20	
	65 30年国債	0.4000	200,000	154,980	2049/12/20	
	3 40年国債	2.2000	150,000	176,842	2050/03/20	
	66 30年国債	0.4000	200,000	154,694	2050/03/20	
	67 30年国債	0.6000	300,000	242,403	2050/06/20	
	68 30年国債	0.6000	290,000	233,519	2050/09/20	
	69 30年国債	0.7000	350,000	289,009	2050/12/20	
	4 40年国債	2.2000	180,000	210,465	2051/03/20	
	70 30年国債	0.7000	300,000	246,684	2051/03/20	
	71 30年国債	0.7000	260,000	213,096	2051/06/20	
	72 30年国債	0.7000	320,000	261,667	2051/09/20	
	73 30年国債	0.7000	363,000	296,440	2051/12/20	
	5 40年国債	2.0000	185,000	207,629	2052/03/20	
	74 30年国債	1.0000	320,000	283,395	2052/03/20	
	75 30年国債	1.3000	330,000	315,839	2052/06/20	
	76 30年国債	1.4000	40,000	39,095	2052/09/20	
	6 40年国債	1.9000	105,000	114,945	2053/03/20	
	7 40年国債	1.7000	121,000	126,557	2054/03/20	
	8 40年国債	1.4000	230,000	222,812	2055/03/20	
	9 40年国債	0.4000	220,000	155,551	2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	275,000	228,822	2057/03/20	
	11 40年国債	0.8000	320,000	255,900	2058/03/20	
	12 40年国債	0.5000	380,000	270,358	2059/03/20	
	13 40年国債	0.5000	360,000	254,142	2060/03/20	
	14 40年国債	0.7000	430,000	324,237	2061/03/20	
	15 40年国債	1.0000	850,000	699,924	2062/03/20	
種別小計	銘柄数 金額	265銘柄		104,450,000	104,845,798	
地方債証券	131 共同発行地方	0.6600	100,000	100,740	2024/02/23	
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	100,820	2024/11/25	
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	100,742	2025/02/26	
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	202,041	2025/04/16	
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	104,612	2025/11/21	
	27-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	101,064	2025/11/27	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,760	2025/12/19	
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,710	2026/06/19	
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	99,971	2027/01/29	

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	
		168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,051	2027/03/25
		420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,324	2027/05/28
		29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	99,928	2027/06/23
		29-5 広島県公債	0.2450	100,000	99,989	2028/01/25
		20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	111,451	2028/05/26
		16 東京都20年	2.0100	100,000	110,254	2028/12/20
		21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	112,696	2029/06/20
		11 名古屋市20年	2.1300	100,000	112,369	2029/12/14
		9 埼玉県20年	2.1500	100,000	112,943	2030/05/24
		2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	97,535	2031/01/29
		3-5 北海道公債	0.1400	100,000	97,322	2031/06/30
		23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	112,341	2031/08/19
		19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	109,591	2033/12/09
		16 千葉県20年	1.5550	100,000	109,576	2034/04/14
		31 神奈川県20年	1.0020	100,000	102,339	2035/12/20
		4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	114,919	2041/09/20
		4 埼玉県30年	1.3270	100,000	98,654	2045/12/20
種別小計	銘 柄 数	26銘柄				
	金 額			2,800,000	2,911,753	
特殊債券 (除く金融債券)		65 地方公共団体	0.5350	100,000	100,669	2024/10/28
		236 政保道路機構	0.3200	100,000	100,575	2025/01/31
		71 地方公共団体	0.4650	100,000	100,630	2025/04/28
		261 政保道路機構	0.3810	200,000	201,865	2025/11/28
		127 都市再生	0.0750	100,000	99,315	2026/09/18
		80 住宅支援機構	1.5890	100,000	105,060	2026/09/18
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	104,811	2027/08/25
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	105,046	2028/01/28
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	111,428	2029/07/31
		47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	103,878	2029/09/20
		123 住宅支援機構	1.8010	100,000	111,494	2032/09/17
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	110,146	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	108,959	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	183,621	2036/07/31
		298 政保道路機構	0.5470	100,000	96,276	2036/12/26
		247 道路機構	0.3420	200,000	173,425	2040/03/19
種別小計	銘 柄 数	16銘柄				
	金 額			1,900,000	1,917,206	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	99,774	2026/09/18
種別小計	銘 柄 数	1銘柄				
	金 額			100,000	99,774	
普通社債券		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	100,839	2024/06/26
		482 九州電力	0.1700	100,000	99,936	2024/08/23
		5 野村不動産 HD	0.9240	100,000	101,520	2025/05/30

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	
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	101,044	2025/07/15
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	100,946	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	101,329	2025/12/18
	14 セブリアンドアイ	0.1900	100,000	99,661	2025/12/19
	16 NTT ファイナンス	0.1800	100,000	99,570	2025/12/19
	1 日生2021基金	0.2800	100,000	99,745	2026/08/03
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,368	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,154	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,403	2026/11/13
	6 楽天カード	0.6200	100,000	95,907	2026/12/17
	509 関西電力	0.4700	100,000	99,650	2027/05/25
	12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	99,622	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	99,480	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,528	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	99,077	2028/01/25
	20 ZHD	0.4600	100,000	97,181	2028/07/28
	15 ソフトバンク	0.4100	100,000	97,226	2028/10/12
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	110,291	2029/01/29
	13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	103,230	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	103,542	2029/12/12
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	97,144	2030/09/10
	18 楽天グループ	1.0500	100,000	86,407	2031/12/02
	332 北海道電力	0.9070	100,000	96,030	2036/04/25
	23 森ビル	0.9700	100,000	93,675	2038/05/17
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	98,947	2045/01/27
種別小計	銘柄数	28銘柄			
	金額		2,800,000	2,780,464	
合計	銘柄数	336銘柄			
	金額		112,050,000	112,554,997	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	112,554,997	99.5
コール・ローン等、その他	620,840	0.5
投資信託財産総額	113,175,837	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

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	113,175,837,692円
コール・ローン等	298,172,503
公社債 (評価額)	112,554,997,510
未収入金	100,751,000
未収利息	218,481,441
前払費用	3,435,238
(B) 負債	99,099,215
未払解約金	99,099,215
(C) 純資産総額 (A - B)	113,076,738,477
元本	83,142,525,531
次期繰越損益金	29,934,212,946
(D) 受益権総口数	83,142,525,531口
1万口当り基準価額 (C / D)	13,600円

* 期首における元本額は66,960,247,306円、当作成期間中における追加設定元本額は28,030,628,143円、同解約元本額は11,848,349,918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)	52,917,204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)	281,234,952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)	46,312,087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)	572,435,304円
D Cダイワ日本債券インデックス	10,377,310,449円
ダイワ国内債券インデックス (ラップ専用)	1,548,164,674円
ダイワ・バランスファンド35V A	8,977,064,441円
ダイワ・バランスファンド25V A (適格機関投資家専用)	1,543,317,679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)	189,833,127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)	241,971,948円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	63,243,630円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	26,333,485,063円
ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用)	22,413,934,040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	2,111,247,399円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	872,287,058円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	6,396,124,679円
ダイワライフスタイル25	432,831,898円
ダイワライフスタイル50	548,823,097円
ダイワライフスタイル75	139,986,802円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,600円です。

■損益の状況

当期 自 2021年12月1日 至 2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	728,453,261円
受取利息	728,645,254
支払利息	△ 191,993
(B) 有価証券売買損益	△ 5,199,368,690
売買益	7,833,710
売買損	△ 5,207,202,400
(C) 当期損益金 (A + B)	△ 4,470,915,429
(D) 前期繰越損益金	28,119,363,665
(E) 解約差損益金	△ 4,563,391,416
(F) 追加信託差損益金	10,849,156,126
(G) 合計 (C + D + E + F)	29,934,212,946
次期繰越損益金 (G)	29,934,212,946

(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。