

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9期

(決算日 2024年12月2日)

(作成対象期間 2023年12月1日～2024年12月2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

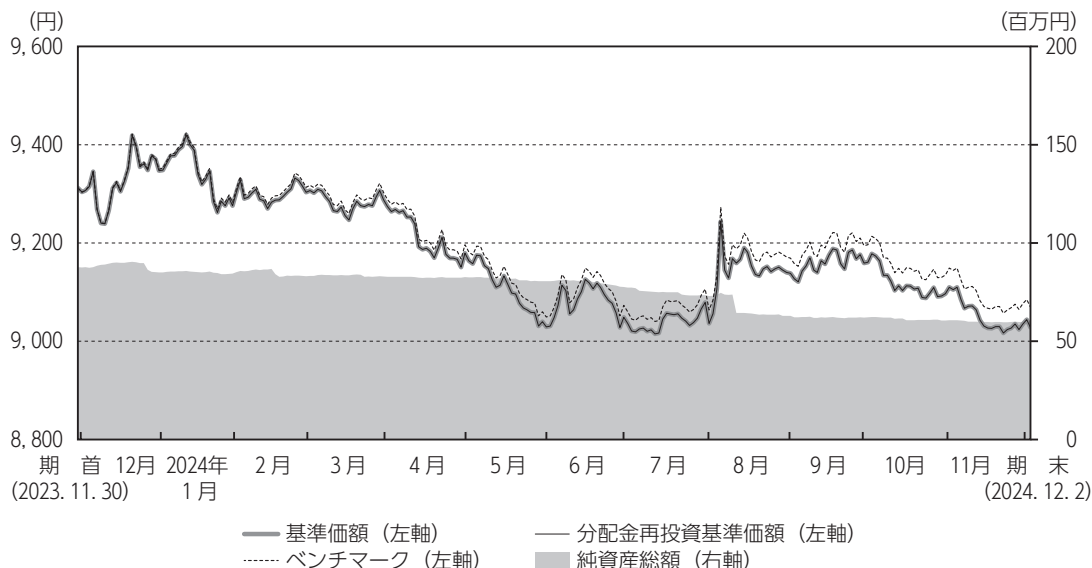
決 算 期	基 準 価 額			ダイワ・ボンド・インデックス (DB I) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純資産 総 額
	(分配落)	税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
5 期末 (2020年11月30日)	9,971	0	△ 1.3	531.781	△ 0.8	99.5	—	128
6 期末 (2021年11月30日)	9,933	0	△ 0.4	532.469	0.1	98.9	—	87
7 期末 (2022年11月30日)	9,470	0	△ 4.7	509.828	△ 4.3	99.2	—	86
8 期末 (2023年11月30日)	9,312	0	△ 1.7	503.781	△ 1.2	99.3	—	87
9 期末 (2024年12月 2 日)	9,028	0	△ 3.0	490.676	△ 2.6	99.5	—	59

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注 2) 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 3) 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 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



(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（DBI）総合指数です。

基準価額・騰落率

期 首：9,312円

期 末：9,028円（分配金 0円）

騰落率：△3.0%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を通じて、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。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2023年11月30日	円	%		%	%	%
	9,312	—	503.781	—	99.3	—
12月末	9,347	0.4	505.836	0.4	99.3	—
2024年 1 月末	9,276	△ 0.4	502.190	△ 0.3	99.3	—
2 月末	9,303	△ 0.1	503.843	0.0	99.3	—
3 月末	9,288	△ 0.3	503.272	△ 0.1	99.1	—
4 月末	9,179	△ 1.4	497.541	△ 1.2	99.1	—
5 月末	9,029	△ 3.0	489.572	△ 2.8	99.4	—
6 月末	9,049	△ 2.8	490.863	△ 2.6	99.1	—
7 月末	9,036	△ 3.0	490.338	△ 2.7	99.3	—
8 月末	9,138	△ 1.9	496.044	△ 1.5	99.1	—
9 月末	9,159	△ 1.6	497.435	△ 1.3	99.4	—
10月末	9,110	△ 2.2	494.967	△ 1.7	99.0	—
11月末	9,044	△ 2.9	491.493	△ 2.4	99.0	—
(期末) 2024年12月 2 日	9,028	△ 3.0	490.676	△ 2.6	99.5	—

(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

(2023. 12. 1 ~ 2024. 12. 2)

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、米国金利の低下（債券価格は上昇）を受けて低下基調で推移し、2023年12月後半には0.5%台半ばに達しました。2024年1月に入ると、米国金利の上昇に加え、春闘での大幅な賃上げ見通しなどを受けた日銀の政策修正観測の高まりから、上昇しました。3月の日銀金融政策決定会合では、マイナス金利政策の解除や長短金利操作の廃止などが決定されましたが、「当面、緩和的な金融環境が継続する」と日銀が明示したこともあり、反応は限定的でした。4月以降は、円安対策としての追加利上げ観測および国債買入れ減額観測が高まる中で大幅に上昇し、5月下旬には1%を上回りました。その後は値動きがやや大きくなる中、1%を挟んで推移しました。しかし、7月の金融政策決定会合後には、株価急落を受けたりスク回避の動きや米国金利の低下の影響で国内長期金利は急低下し、一時0.8%を割り込みました。その後は、米国金利が低下する一方で日銀の追加利上げ観測がくすぶる中、おおむね0.8%台で推移しました。10月以降は、米国金利が上昇したほか、為替相場で再度円安が進行したことで追加利上げ観測が高まり、1%を超える水準まで上昇しました。

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

(2023. 12. 1 ~ 2024. 12. 2)

■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。

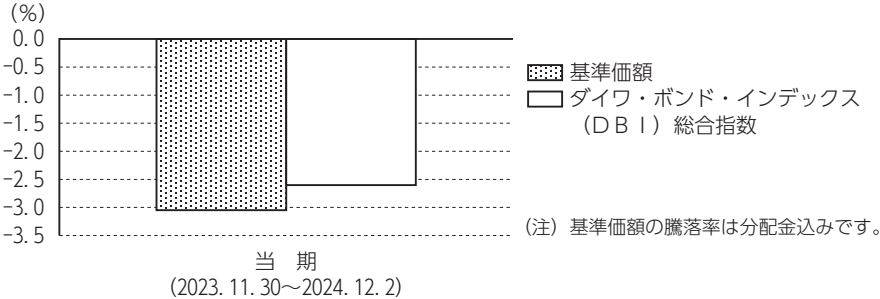
組入ファンド	ベンチマーク
日本債券インデックスマザーファンド	ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数

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△2.6％となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.0％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△0.4％でした。差異の内訳は運用管理费用等の要因によるもので、当影響を除くと、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	
	2023年12月1日 ～2024年12月2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。
- （注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



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 (2023. 12. 1～2024. 12. 2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	44円	0. 476%	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, 177円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0. 221)	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)	(20)	(0. 221)	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)	(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	0	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)	(0)	(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	44	0. 481	

(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。

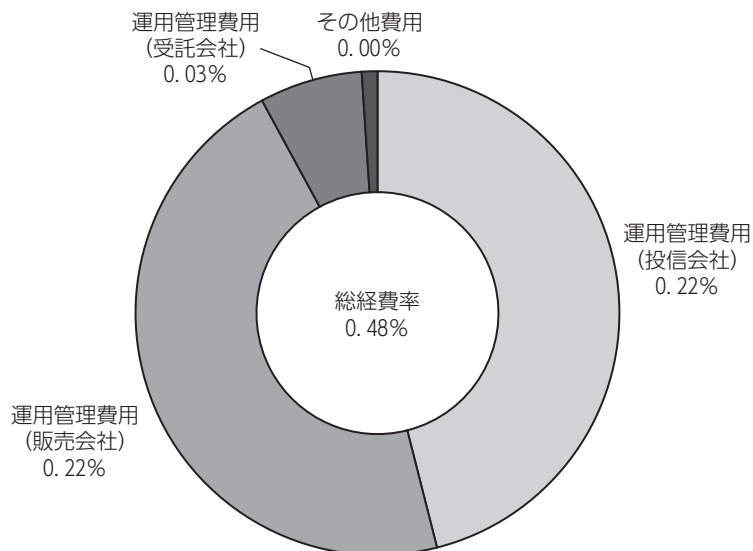
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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
(2023年12月 1 日から2024年12月 2 日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 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	7, 897	10, 561	27, 437	36, 451

(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

(2023年12月 1 日から2024年12月 2 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	50, 571	683	1. 4	28, 512	301	1. 1
コール・ローン	144, 183	—	—	—	—	—

(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

(2023年12月 1 日から2024年12月 2 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	1, 700	

(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	
	□ 数	□ 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	65, 102	45, 562	59, 637

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成
2024年12月 2 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	59, 637	99. 4
コール・ローン等、その他	340	0. 6
投資信託財産総額	59, 977	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
2024年12月 2 日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	59, 977, 586円
コール・ローン等	340, 405
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	59, 637, 181
(B) 負債	162, 982
未払信託報酬	161, 173
その他未払費用	1, 809
(C) 純資産総額 (A－B)	59, 814, 604
元本	66, 254, 240
次期繰越損益金	△ 6, 439, 636
(D) 受益権総口数	66, 254, 240口
1 万口当り基準価額 (C／D)	9, 028円

* 期首における元本額は94, 224, 379円、当作成期間中における追加設定元本額は
15, 969, 369円、同解約元本額は43, 939, 508円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は9, 028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6, 439, 636円です。

■損益の状況

当期 自 2023年12月 1 日 至 2024年12月 2 日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	201円
受取利息	201
(B) 有価証券売買損益	△ 1,419,494
売買益	440,202
売買損	△ 1,859,696
(C) 信託報酬等	△ 364,630
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,783,923
(E) 前期繰越損益金	△ 3,072,434
(F) 追加信託差損益金	△ 1,583,279
(配当等相当額)	(384,001)
(売買損益相当額)	(△ 1,967,280)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 6,439,636
次期繰越損益金 (G)	△ 6,439,636
追加信託差損益金	△ 1,583,279
(配当等相当額)	(384,001)
(売買損益相当額)	(△ 1,967,280)
分配準備積立金	167,417
繰越損益金	△ 5,023,774

- (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	384,001
(d) 分配準備積立金	167,417
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	551,418
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	551,418
(h) 受益権総口数	66,254,240口

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第25期（決算日 2024年12月2日）

（作成対象期間 2023年12月1日～2024年12月2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。

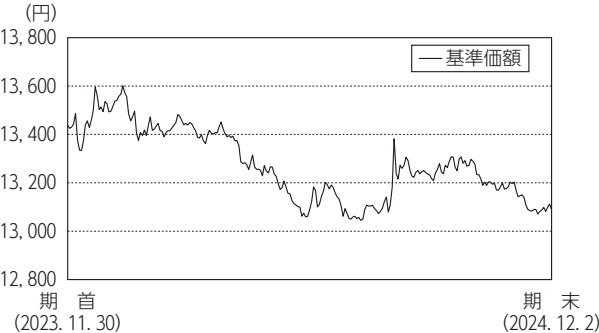
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（D B I）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。
主要投資対象	わが国の公社債
株式組入制限	純資産総額の30%以下

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・ボンド・インデックス (D B I) 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) 2023年11月30日	13,437	—	503.781	—	99.6	—
12月末	13,493	0.4	505.836	0.4	99.6	—
2024年 1 月末	13,396	△ 0.3	502.190	△ 0.3	99.6	—
2 月末	13,440	0.0	503.843	0.0	99.6	—
3 月末	13,424	△ 0.1	503.272	△ 0.1	99.4	—
4 月末	13,271	△ 1.2	497.541	△ 1.2	99.4	—
5 月末	13,059	△ 2.8	489.572	△ 2.8	99.7	—
6 月末	13,093	△ 2.6	490.863	△ 2.6	99.4	—
7 月末	13,079	△ 2.7	490.338	△ 2.7	99.6	—
8 月末	13,233	△ 1.5	496.044	△ 1.5	99.4	—
9 月末	13,269	△ 1.3	497.435	△ 1.3	99.7	—
10 月末	13,203	△ 1.7	494.967	△ 1.7	99.2	—
11 月末	13,112	△ 2.4	491.493	△ 2.4	99.3	—
(期末) 2024年12月2日	13,089	△ 2.6	490.676	△ 2.6	99.8	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) 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3) 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4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】
期首：13,437円 期末：13,089円 騰落率：△2.6%

【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。

◆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、米国金利の低下 (債券価格は上昇) を受けて低下基調で推移し、2023年12月後半には0.5%台半ばに達しました。2024年1月に入ると、米国金利の上昇に加え、春闘での大幅な賃上げ見通しなどを受けた日銀の政策修正観測の高まりから、上昇しました。3月の日銀金融政策決定会合では、マイナス金利政策の解除や長短金利操作の廃止などが決定されましたが、「当面、緩和的な金融環境が継続する」と日銀が明示したこともあり、反応は限定的でした。4月以降は、円安対策としての追加利上げ観測および国債買入れ減額観測が高まる中で大幅に上昇し、5月下旬には1%を上回りました。その後は値動きがやや大きくなる中、1%を挟んで推移しました。7月の金融政策決定会合後には、株価急落を受けたリスク回避の動きや米国金利の低下の影響で国内長期金利は急低下し、一時0.8%を割り込みました。その後は、米国金利が低下する一方で日銀の追加利上げ観測がくすぶる中、おおむね0.8%台で推移しました。10月以降は、米国金利が上昇したほか、為替相場で再度円安が進行したことで追加利上げ観測が高まり、1%を超える水準まで上昇しました。

◆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レシオン、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△2.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率も△2.6%となり、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。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、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・ボンド・インデックス (D B I) 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	—
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

(2023年12月 1 日から2024年12月 2 日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	46, 217, 058	(26, 709, 641 —)
	地方債証券	1, 336, 565	(801, 851 —)
	特殊債券	1, 618, 119	(400, 601 —)
	社債券	1, 400, 000	(599, 942 —)

(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

(2023年12月 1 日から2024年12月 2 日まで)

当 期		期	
買 付		売 付	
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
373 10年国債 0.6% 2033/12/20	1, 488, 277	143 5年国債 0.1% 2025/3/20	2, 471, 900
163 5年国債 0.4% 2028/9/20	1, 450, 551	145 5年国債 0.1% 2025/9/20	1, 766, 471
170 5年国債 0.6% 2029/6/20	1, 244, 291	144 5年国債 0.1% 2025/6/20	1, 497, 585
374 10年国債 0.8% 2034/3/20	1, 176, 441	146 5年国債 0.1% 2025/12/20	1, 175, 150
372 10年国債 0.8% 2033/9/20	1, 136, 959	148 5年国債 0.005% 2026/6/20	993, 004
456 2年国債 0.1% 2026/1/1	1, 098, 608	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	981, 274
375 10年国債 1.1% 2034/6/20	1, 067, 985	455 2年国債 0.005% 2025/12/1	926, 367
166 5年国債 0.4% 2028/12/20	974, 897	340 10年国債 0.4% 2025/9/20	761, 003
17 40年国債 2.2% 2064/3/20	943, 945	353 10年国債 0.1% 2028/12/20	688, 674
455 2年国債 0.005% 2025/12/1	927, 745	170 5年国債 0.6% 2029/6/20	642, 015

(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	当 期				末		
区 分	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年末満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	116,017,000	109,744,947	84.9	—	55.3	20.9	8.7
地方債証券	6,500,000	6,513,334	5.0	—	3.0	1.8	0.2
特殊債券（除く金融債券）	3,900,000	3,817,269	3.0	—	1.9	0.9	0.2
金融債券	100,000	98,757	0.1	—	—	—	0.1
普通社債券	9,000,000	8,798,639	6.8	—	1.9	4.0	0.9
合 計	135,517,000	128,972,947	99.8	—	62.2	27.5	10.1

(注 1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注 2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(注 3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

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

区 分	当 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	456 2年国債	0.1000	600,000	597,390	2026/01/01
	457 2年国債	0.1000	160,000	159,220	2026/02/01
	458 2年国債	0.2000	680,000	677,184	2026/03/01
	147 5年国債	0.0050	1,430,000	1,420,161	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	710,000	705,981	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	59,165	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	81,812	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	56,175	2026/03/20
	459 2年国債	0.2000	550,000	547,464	2026/04/01
	460 2年国債	0.3000	300,000	298,887	2026/05/01
	461 2年国債	0.4000	700,000	698,180	2026/06/01
	148 5年国債	0.0050	800,000	792,952	2026/06/20
	343 10年国債	0.1000	780,000	774,259	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	53,000	54,318	2026/06/20
	462 2年国債	0.4000	250,000	249,277	2026/07/01
	463 2年国債	0.4000	150,000	149,518	2026/08/01
	464 2年国債	0.4000	420,000	418,546	2026/09/01
	149 5年国債	0.0050	1,480,000	1,464,341	2026/09/20
	344 10年国債	0.1000	780,000	773,058	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	20,000	20,572	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	100,000	103,041	2026/09/20
	465 2年国債	0.4000	250,000	249,072	2026/10/01
	466 2年国債	0.5000	900,000	898,128	2026/11/01
	150 5年国債	0.0050	1,600,000	1,580,752	2026/12/20
	345 10年国債	0.1000	950,000	940,395	2026/12/20
	92 20年国債	2.1000	310,000	319,464	2026/12/20
	151 5年国債	0.0050	850,000	838,457	2027/03/20
	152 5年国債	0.1000	600,000	593,142	2027/03/20
	346 10年国債	0.1000	780,000	771,084	2027/03/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	103,178	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	130,000	134,425	2027/03/20

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	
	153 5年国債	0.0050	600,000	590,826	2027/06/20
	347 10年国債	0.1000	1,100,000	1,085,799	2027/06/20
	95 20年国債	2.3000	50,000	52,130	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	55,000	57,068	2027/06/20
	154 5年国債	0.1000	1,050,000	1,034,838	2027/09/20
	348 10年国債	0.1000	1,050,000	1,034,838	2027/09/20
	97 20年国債	2.2000	40,000	41,749	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	320,000	333,110	2027/09/20
	155 5年国債	0.3000	730,000	722,685	2027/12/20
	156 5年国債	0.2000	770,000	759,982	2027/12/20
	349 10年国債	0.1000	1,250,000	1,230,012	2027/12/20
	99 20年国債	2.1000	100,000	104,425	2027/12/20
	157 5年国債	0.2000	200,000	197,098	2028/03/20
	158 5年国債	0.1000	950,000	933,147	2028/03/20
	350 10年国債	0.1000	800,000	785,808	2028/03/20
	100 20年国債	2.2000	155,000	162,850	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	350,000	369,985	2028/03/20
	27 メキシコ国債	1.0500	100,000	97,793	2028/04/20
	161 5年国債	0.3000	880,000	868,868	2028/06/20
	351 10年国債	0.1000	600,000	588,258	2028/06/20
	11 フィリピン共和国	0.9900	100,000	98,470	2028/08/15
	162 5年国債	0.3000	200,000	197,186	2028/09/20
	163 5年国債	0.4000	1,000,000	989,630	2028/09/20
	352 10年国債	0.1000	20,000	19,570	2028/09/20
	164 5年国債	0.2000	270,000	264,737	2028/12/20
	165 5年国債	0.3000	450,000	443,002	2028/12/20
	166 5年国債	0.4000	980,000	968,612	2028/12/20
	353 10年国債	0.1000	750,000	732,435	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	300,000	314,475	2028/12/20
	167 5年国債	0.4000	150,000	148,062	2029/03/20
	168 5年国債	0.6000	400,000	398,164	2029/03/20
	354 10年国債	0.1000	1,100,000	1,071,818	2029/03/20
	109 20年国債	1.9000	55,000	57,762	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	260,000	275,285	2029/03/20
	170 5年国債	0.6000	600,000	596,568	2029/06/20
	172 5年国債	0.5000	550,000	544,434	2029/06/20
	2 CT5年国債	0.5000	900,000	890,694	2029/06/20
	355 10年国債	0.1000	620,000	602,683	2029/06/20
	111 20年国債	2.2000	400,000	426,240	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	250,000	265,300	2029/06/20
	173 5年国債	0.6000	360,000	357,580	2029/09/20
	356 10年国債	0.1000	700,000	679,084	2029/09/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	17,547	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	310,000	329,759	2029/09/20
	357 10年国債	0.1000	860,000	832,815	2029/12/20
	114 20年国債	2.1000	70,000	74,704	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	180,000	193,019	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	184,000	199,590	2030/02/20
	358 10年国債	0.1000	600,000	579,996	2030/03/20
	116 20年国債	2.2000	200,000	215,092	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	200,000	214,072	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	32,490	2030/05/20
	359 10年国債	0.1000	840,000	810,499	2030/06/20
	118 20年国債	2.0000	95,000	101,456	2030/06/20

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	
	119 20年国債	1.8000	93,000	98,302	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	317,000	331,696	2030/06/20
	360 10年国債	0.1000	1,200,000	1,155,696	2030/09/20
	121 20年国債	1.9000	200,000	212,954	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	200,000	211,842	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	40,499	2030/11/20
	361 10年国債	0.1000	800,000	769,248	2030/12/20
	123 20年国債	2.1000	200,000	215,928	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	300,000	322,155	2030/12/20
	362 10年国債	0.1000	1,000,000	959,780	2031/03/20
	125 20年国債	2.2000	130,000	141,540	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	110,000	118,405	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	350,000	374,636	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	30,529	2031/05/20
	363 10年国債	0.1000	1,080,000	1,033,938	2031/06/20
	128 20年国債	1.9000	250,000	268,020	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	200,000	213,168	2031/06/20
	364 10年国債	0.1000	1,100,000	1,050,357	2031/09/20
	130 20年国債	1.8000	140,000	149,409	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	150,000	159,112	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	26,612	2031/11/20
	365 10年国債	0.1000	1,400,000	1,333,290	2031/12/20
	132 20年国債	1.7000	100,000	106,180	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	100,000	106,848	2031/12/20
	366 10年国債	0.2000	850,000	812,889	2032/03/20
	134 20年国債	1.8000	30,000	32,078	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	97,738	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	550,000	580,316	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	60,829	2032/05/20
	367 10年国債	0.2000	980,000	934,165	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	300,000	314,382	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	370,000	390,505	2032/06/20
	368 10年国債	0.2000	1,200,000	1,140,456	2032/09/20
	140 20年国債	1.7000	570,000	606,092	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	28,925	2032/11/22
	369 10年国債	0.5000	1,140,000	1,106,609	2032/12/20
	9 30年国債	1.4000	43,000	44,730	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	400,000	425,444	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	240,000	257,169	2032/12/20
	370 10年国債	0.5000	1,500,000	1,452,015	2033/03/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	45,711	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	210,000	221,684	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	140,000	146,708	2033/03/20
	371 10年国債	0.4000	960,000	918,624	2033/06/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	42,538	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	340,000	361,579	2033/06/20
	372 10年国債	0.8000	900,000	888,678	2033/09/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	65,815	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	20,000	21,260	2033/09/20
	373 10年国債	0.6000	1,200,000	1,161,132	2033/12/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	81,627	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	600,000	632,484	2033/12/20
	2 CT10年国債	1.0000	800,000	797,624	2034/03/20
	374 10年国債	0.8000	1,150,000	1,129,001	2034/03/20

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	
	14 30年国債	2.4000	82,000	92,113	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	400,000	417,536	2034/03/20
	375 10年国債	1.1000	800,000	804,512	2034/06/20
	15 30年国債	2.5000	50,000	56,633	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	432,000	450,230	2034/06/20
	376 10年国債	0.9000	270,000	265,809	2034/09/20
	16 30年国債	2.5000	250,000	283,207	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	400,000	412,252	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	130,000	146,081	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	400,000	403,984	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	89,164	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	600,000	604,704	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	500,000	557,220	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	280,000	284,348	2035/06/20
	154 20年国債	1.2000	580,000	581,943	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	66,894	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	530,000	519,659	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	170,000	193,035	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	480,000	438,969	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	710,000	630,962	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	104,466	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	580,000	531,720	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	166,926	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	400,000	369,488	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	300,000	337,119	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	450,000	419,157	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	570,000	522,171	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	170,215	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	620,000	565,551	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	500,000	453,870	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	350,000	396,704	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	570,000	508,229	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	470,000	416,852	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	223,902	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	680,000	617,106	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	500,000	438,930	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	242,858	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	610,000	524,844	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	540,000	455,020	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	326,616	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	520,000	435,728	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	450,000	374,737	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	385,000	423,049	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	170,000	143,089	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	550,000	460,383	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	280,000	295,237	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	800,000	665,928	2040/09/20
	175 20年国債	0.5000	520,000	437,741	2040/12/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	291,311	2041/03/20
	176 20年国債	0.5000	610,000	510,734	2041/03/20
	177 20年国債	0.4000	530,000	433,746	2041/06/20
	35 30年国債	2.0000	250,000	261,680	2041/09/20
	178 20年国債	0.5000	660,000	546,513	2041/09/20
	179 20年国債	0.5000	550,000	453,183	2041/12/20

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	
	36 30年国債	2.0000	350,000	365,008	2042/03/20
	180 20年国債	0.8000	580,000	501,195	2042/03/20
	181 20年国債	0.9000	500,000	437,660	2042/06/20
	37 30年国債	1.9000	450,000	461,034	2042/09/20
	182 20年国債	1.1000	530,000	478,378	2042/09/20
	183 20年国債	1.4000	490,000	463,299	2042/12/20
	38 30年国債	1.8000	260,000	261,437	2043/03/20
	184 20年国債	1.1000	550,000	492,943	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	270,000	275,092	2043/06/20
	185 20年国債	1.1000	550,000	491,007	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	240,000	240,000	2043/09/20
	186 20年国債	1.5000	530,000	504,830	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	250,000	245,582	2043/12/20
	187 20年国債	1.3000	400,000	367,204	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	320,000	313,395	2044/03/20
	188 20年国債	1.6000	350,000	337,078	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	300,000	293,118	2044/06/20
	189 20年国債	1.9000	480,000	484,488	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	300,000	291,996	2044/09/20
	190 20年国債	1.8000	600,000	593,928	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	300,000	281,352	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	300,000	280,575	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	350,000	332,272	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	400,000	365,016	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	220,000	200,151	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	350,000	280,777	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	370,000	263,010	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	400,000	296,756	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	350,000	264,505	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	400,000	315,060	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	300,000	235,107	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	340,000	265,312	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	350,000	271,943	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	100,000	106,865	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	510,000	394,265	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	225,309	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	300,000	235,587	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	300,000	223,260	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	112,950	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	400,000	281,212	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	300,000	204,012	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	330,000	223,063	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	310,000	208,127	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	195,000	198,549	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	270,000	180,049	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	350,000	245,563	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	340,000	237,197	2050/09/20
	69 30年国債	0.7000	410,000	292,658	2050/12/20
	4 40年国債	2.2000	180,000	181,663	2051/03/20
	70 30年国債	0.7000	420,000	297,931	2051/03/20
	71 30年国債	0.7000	390,000	275,133	2051/06/20
	72 30年国債	0.7000	350,000	245,749	2051/09/20
	73 30年国債	0.7000	360,000	251,578	2051/12/20
	5 40年国債	2.0000	185,000	177,779	2052/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

当		期		末	
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	74 30年国債	1.0000	千円 380,000	千円 287,523	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	340,000	277,290	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	430,000	358,598	2052/09/20
	77 30年国債	1.6000	325,000	283,793	2052/12/20
	6 40年国債	1.9000	285,000	265,916	2053/03/20
	78 30年国債	1.4000	310,000	256,893	2053/03/20
	79 30年国債	1.2000	350,000	274,662	2053/06/20
	80 30年国債	1.8000	330,000	299,857	2053/09/20
	81 30年国債	1.6000	375,000	324,206	2053/12/20
	7 40年国債	1.7000	290,000	256,403	2054/03/20
	82 30年国債	1.8000	330,000	298,768	2054/03/20
	83 30年国債	2.2000	350,000	346,279	2054/06/20
	84 30年国債	2.1000	130,000	125,736	2054/09/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	186,707	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	127,881	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	230,000	157,087	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	207,929	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	380,000	215,771	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	360,000	199,389	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	430,000	252,453	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	410,000	264,737	2062/03/20
	16 40年国債	1.3000	900,000	635,265	2063/03/20
	17 40年国債	2.2000	1,000,000	916,020	2064/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	270銘柄			
	金 額		116,017,000	109,744,947	
地方債証券	153 共同発行地方	0.4690	200,000	199,720	2025/12/25
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,045	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	98,874	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	98,848	2027/03/25
	170 共同発行地方	0.1800	200,000	197,348	2027/05/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	197,285	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	98,679	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	98,443	2028/01/25
	14 横浜市20年	2.3200	100,000	105,088	2028/03/17
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	105,541	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	104,877	2028/12/20
	26-2 京都府15年	1.0710	100,000	101,101	2029/04/27
	6-1 大阪市5年	0.5800	100,000	98,956	2029/05/22
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	106,499	2029/06/20
	195 共同発行地方	0.0290	100,000	96,453	2029/06/25
	196 共同発行地方	0.0600	100,000	96,522	2029/07/25
	8 静岡県20年	2.2430	200,000	213,033	2029/08/17
	19 横浜市20年	2.2000	100,000	106,366	2029/08/31
	796 東京都公債	0.0400	100,000	96,331	2029/09/20
	26-5 札幌市15年	0.9610	100,000	100,609	2029/09/20
	1 北九州市15年	0.9360	100,000	100,507	2029/10/22
	1-1 山梨県公債	0.0500	100,000	96,256	2029/10/30
	11 名古屋市20年	2.1300	200,000	212,776	2029/12/14
	1-5 千葉市公債	0.0800	100,000	96,116	2030/02/25
	2-1 静岡県公債	0.1260	100,000	96,289	2030/03/19
	2-1 京都府公債	0.1350	200,000	192,581	2030/04/12
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	106,945	2030/05/24

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	
	206 共同発行地方	0.1310	100,000	96,178	2030/05/24
	808 東京都公債	0.1100	100,000	95,803	2030/09/20
	2-4 札幌市公債	0.1200	100,000	95,816	2030/09/20
	2-7 埼玉県公債	0.1250	100,000	95,795	2030/10/16
	27-12 愛知県15年	0.7590	100,000	99,411	2030/10/21
	2-2 岡山県公債	0.1200	100,000	95,579	2031/01/29
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	95,281	2031/06/30
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	106,570	2031/08/19
	7 大阪府20年	1.8400	200,000	212,606	2031/09/26
	37-2 宮城県公債	0.1350	100,000	94,953	2031/10/28
	10 京都市20年	1.8030	100,000	106,110	2031/11/21
	3-2 徳島県公債	0.1300	100,000	94,822	2031/11/26
	827 東京都公債	0.2940	100,000	95,643	2032/03/19
	12 埼玉県20年	1.7300	100,000	105,739	2032/05/24
	4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	95,840	2032/06/18
	13 千葉県20年	1.7010	100,000	105,570	2032/10/15
	5-1 福岡県公債	0.6810	100,000	97,206	2033/05/30
	244 共同発行地方	0.5900	200,000	192,602	2033/07/25
	25-1 広島県20年	1.7500	100,000	105,823	2033/09/13
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	104,299	2033/12/09
	262 神奈川県公債	1.0800	100,000	99,733	2034/03/17
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	103,849	2034/04/14
	26-4 愛知県20年	1.5420	100,000	103,666	2034/05/15
	6-2 大阪市公債	0.9950	100,000	98,758	2034/05/22
	17 北九州市20年	1.5290	100,000	103,465	2034/06/20
	255 共同発行地方	1.0810	100,000	99,423	2034/06/23
	27 神奈川県20年	1.3980	100,000	102,049	2034/09/20
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	96,952	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	104,544	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	88,137	2045/12/20
種 別 小 計	銘 柄 数	57銘柄			
	金 額		6,500,000	6,513,334	
特殊債券（除く金融債券）	127 都市再生	0.0750	100,000	98,778	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	101,476	2026/09/18
	F124地方公共団体	1.4180	100,000	101,552	2027/06/04
	97政保地方公共団	0.1300	100,000	98,562	2027/06/14
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	101,484	2027/08/25
	321 政保道路機構	0.1550	200,000	196,952	2027/08/31
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	101,612	2028/01/28
	F192地方公共団体	1.1670	100,000	101,194	2028/10/24
	F226地方公共団体	1.0960	100,000	100,907	2029/02/28
	4 国際協力銀行 CO	0.6390	100,000	98,982	2029/03/19
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	105,438	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	100,588	2029/09/20
	97 政保道路機構	2.1000	100,000	106,383	2029/12/28
	129 地方公共団体	0.0950	200,000	191,647	2030/02/28
	403 政保道路機構	0.0010	100,000	95,702	2030/03/29
	F221地方公共団体	1.1980	200,000	202,942	2030/04/26
	69 政保政策投資 C	0.0800	100,000	95,467	2030/12/16
	160 政保道路機構	1.8000	200,000	212,479	2032/03/19
	123 住宅支援機構	1.8010	100,000	105,698	2032/09/17
	174 日本政策投資	0.6490	300,000	288,514	2033/07/14
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	105,084	2033/09/28

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	
478 政保道路機構		1.0900	100,000	99,618	2034/06/30
223 政保道路機構		1.4270	100,000	102,596	2034/07/31
33 沖縄振興開発		1.0680	200,000	196,218	2034/10/20
235 政保道路機構		1.2240	100,000	100,377	2034/12/28
F568地方公共団体		0.3260	200,000	179,919	2035/07/30
284 政保道路機構		0.1490	200,000	174,273	2036/07/31
298 政保道路機構		0.5470	100,000	90,795	2036/12/26
247 道路機構		0.3420	200,000	162,019	2040/03/19
種 別 小 計	銘 柄 数	29銘柄			
	金 額		3,900,000	3,817,269	
金融債券		0.1000	100,000	98,757	2026/09/18
種 別 小 計	銘 柄 数	1銘柄			
	金 額		100,000	98,757	
普通社債券					
11 ヒューリック		0.3200	100,000	99,227	2026/04/13
36 芙蓉総合リース		0.2700	100,000	99,116	2026/06/05
36 三井住友F&L		0.2600	200,000	198,230	2026/06/15
56 日産フィナンシャル		0.5200	100,000	98,518	2026/06/19
1 日生2021基金		0.2800	100,000	98,970	2026/08/03
20 成田国際空港		0.1050	100,000	98,853	2026/08/21
32大和ハウス工業		0.3100	300,000	297,316	2026/09/07
17 パナソニック		0.4700	100,000	99,185	2026/09/18
7 三井住友海上		0.1900	100,000	98,735	2026/11/13
6 楽天カード		0.6200	100,000	97,125	2026/12/17
22 イオンFS		0.4400	200,000	197,147	2027/01/04
509 関西電力		0.4700	100,000	98,991	2027/05/25
30 阪神高速道路		0.3390	100,000	98,861	2027/05/31
42 リコーリース		0.3900	100,000	98,622	2027/06/01
12 アサヒグループHD		0.3300	100,000	98,661	2027/06/11
15 デンソー		0.2450	100,000	98,413	2027/06/18
4 香港上海銀行		0.8080	100,000	99,398	2027/06/25
78 トヨタファイナンス		0.2650	100,000	98,399	2027/07/23
11 東京電力パワー		0.7900	100,000	98,885	2028/01/25
7 日本製鉄		0.5640	100,000	98,471	2028/03/17
16 フボタ		0.4790	100,000	98,528	2028/04/20
16 JERA		0.6400	100,000	98,617	2028/04/25
1 SOMPOHD		0.4790	100,000	98,507	2028/04/27
111 住友不動産		0.5200	100,000	98,407	2028/04/28
11サントリーホールディング		0.3890	100,000	98,227	2028/05/25
50 大阪瓦斯		0.3900	100,000	98,256	2028/06/02
82 三井不動産		0.3600	100,000	97,776	2028/06/06
22 積水ハウス		0.3600	100,000	97,964	2028/06/07
26 リソナホールデイン		0.4150	100,000	98,164	2028/06/07
1 レゾナックHD		0.6950	100,000	98,264	2028/06/15
31 豊田通商		0.3550	200,000	195,549	2028/06/15
81 ホンダファイナンス		0.3890	100,000	98,084	2028/06/20
34 沖縄電力		0.3650	100,000	98,122	2028/06/23
62 日本電気		0.3550	200,000	195,028	2028/07/11
3 オリックス銀行		0.4100	200,000	196,047	2028/07/12
68 名古屋鉄道		0.3750	200,000	195,609	2028/07/13
20 ZHD		0.4600	100,000	96,767	2028/07/28
101 中日本高速道		0.4390	400,000	393,908	2028/08/17

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	
		4 アステラス製薬	0.5190	300,000	294,897	2028/08/31
		27 リソナホールディング	0.5190	200,000	196,714	2028/09/08
		15 ソフトバンク	0.4100	100,000	96,402	2028/10/12
		33 首都高速道路	0.5230	100,000	98,588	2028/12/20
		28 三井住友 TB	0.5440	300,000	294,892	2029/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	104,965	2029/01/29
		111 東日本高速道	0.6070	100,000	98,723	2029/04/25
		32 住友電工	0.4640	100,000	97,499	2029/07/13
		13 NTT ファイナンス	1.0900	100,000	100,141	2029/09/20
		85 電源開発	0.8720	100,000	99,340	2029/10/31
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	100,114	2029/12/12
		65 東京瓦斯	0.2250	100,000	95,603	2030/09/10
		18 セブンアンドアイ	1.0400	100,000	97,644	2030/11/01
		35 東レ	0.9730	300,000	296,916	2030/11/22
		538 関西電力	0.3900	100,000	95,896	2031/01/24
		88 西日本高速道	0.8580	100,000	99,251	2031/05/23
		33 NTT ファイナンス	1.1120	100,000	99,981	2031/06/20
		34 KDDI	1.0580	100,000	99,606	2031/07/11
		18 楽天グループ	1.0500	100,000	83,261	2031/12/02
		143 三菱地所	0.9000	100,000	96,885	2033/05/02
		448 中国電力	0.9200	100,000	96,348	2033/05/25
		31 トヨタ自動車	0.7350	100,000	96,244	2033/06/01
		2 AGC	0.7900	100,000	95,767	2033/06/08
		63 住友商事	0.8400	100,000	95,556	2033/06/15
		67 阪急阪神 HLDG	0.7740	100,000	95,512	2033/07/13
		560 東北電力	0.8700	200,000	191,472	2033/07/25
		87 電源開発	1.1060	100,000	97,212	2034/02/20
		41 ソニー G	1.0010	100,000	97,187	2034/03/07
		38 NTT ファイナンス	1.3980	200,000	198,307	2034/09/20
		332 北海道電力	0.9070	100,000	91,202	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	85,639	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	87,897	2045/01/27
種 別 小 計	銘 柄 数	70銘柄				
	金 額			9,000,000	8,798,639	
合 計	銘 柄 数	427銘柄				
	金 額			135,517,000	128,972,947	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年12月 2 日現在

項 目	当	期	末
	評 価 額	比	率
	千円	%	
公社債	128,972,947	97.3	
コール・ローン等、その他	3,623,703	2.7	
投資信託財産総額	132,596,650	100.0	

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2024年12月 2 日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	132, 596, 650, 754円
コール・ローン等	230, 120, 675
公社債（評価額）	128, 972, 947, 420
未収入金	3, 093, 325, 460
未収利息	283, 026, 681
前払費用	17, 230, 518
(B) 負債	3, 311, 720, 856
未払金	3, 254, 049, 550
未払解約金	57, 671, 306
(C) 純資産総額（A－B）	129, 284, 929, 898
元本	98, 770, 541, 951
次期繰越損益金	30, 514, 387, 947
(D) 受益権総口数	98, 770, 541, 951口
1万口当り基準価額（C／D）	13, 089円

* 期首における元本額は82, 851, 732, 167円、当作成期間中における追加設定元本額は31, 448, 033, 676円、同解約元本額は15, 529, 223, 892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）	32, 289, 249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）	201, 615, 694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）	37, 897, 876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）	468, 187, 324円
D Cダイワ日本債券インデックス	10, 539, 428, 229円
ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用）	21, 258, 385, 545円
ダイワ・バランスファンド35V A	7, 858, 051, 431円
ダイワ・バランスファンド25V A（適格機関投資家専用）	1, 399, 115, 999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）	177, 725, 433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）	194, 573, 887円
ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド	45, 562, 825円
ダイワファンドラップ 日本債券インデックス	29, 905, 466, 527円
ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用）	16, 966, 813, 386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	1, 716, 727, 168円
スタイル9（4資産分散・保守型）	5, 455, 841円
スタイル9（4資産分散・バランス型）	10, 801, 798円
スタイル9（4資産分散・積極型）	1, 135, 449円
スタイル9（6資産分散・保守型）	2, 608, 902円
スタイル9（6資産分散・バランス型）	22, 010, 458円
スタイル9（6資産分散・積極型）	1, 749, 661円
スタイル9（8資産分散・保守型）	3, 959, 704円
スタイル9（8資産分散・バランス型）	17, 084, 008円
スタイル9（8資産分散・積極型）	3, 408, 991円
ダイワ国内債券インデックス（投資一任専用）	7, 573, 847円
ダイワ・インデックスセレクト 日本債券	691, 503, 280円
ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス	5, 910, 886, 543円
ダイワライフスタイル25	451, 762, 455円
ダイワライフスタイル50	647, 337, 746円
ダイワライフスタイル75	191, 422, 695円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13, 089円です。

■損益の状況

当期 自 2023年12月 1 日 至 2024年12月 2 日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	920, 812, 419円
受取利息	920, 825, 749
支払利息	△ 13, 330
(B) 有価証券売買損益	△ 3, 985, 912, 270
売買益	55, 196, 250
売買損	△ 4, 041, 108, 520
(C) 当期繰越損益金（A＋B）	△ 3, 065, 099, 851
(D) 前期繰越損益金	28, 478, 325, 608
(E) 解約差損益金	△ 5, 078, 213, 910
(F) 追加信託差損益金	10, 179, 376, 100
(G) 合計（C＋D＋E＋F）	30, 514, 387, 947
次期繰越損益金（G）	30, 514, 387, 947

（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。