

★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         | 約15年間（2013年11月18日～2028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（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                |
| マザーファンドの運用方法 | 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。                                                                  |                        |
| 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、分配を行わないことがあります。 |                        |

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

# ダイワ・インデックス セレクト 日本債券

## 運用報告書（全体版） 第1期

（決算日 2014年12月1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。

さて、「ダイワ・インデックスセレクト 日本債券」は、このたび、第1期の決算を行いました。

ここに、期中の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。

## 大和投資信託

Daiwa Asset Management

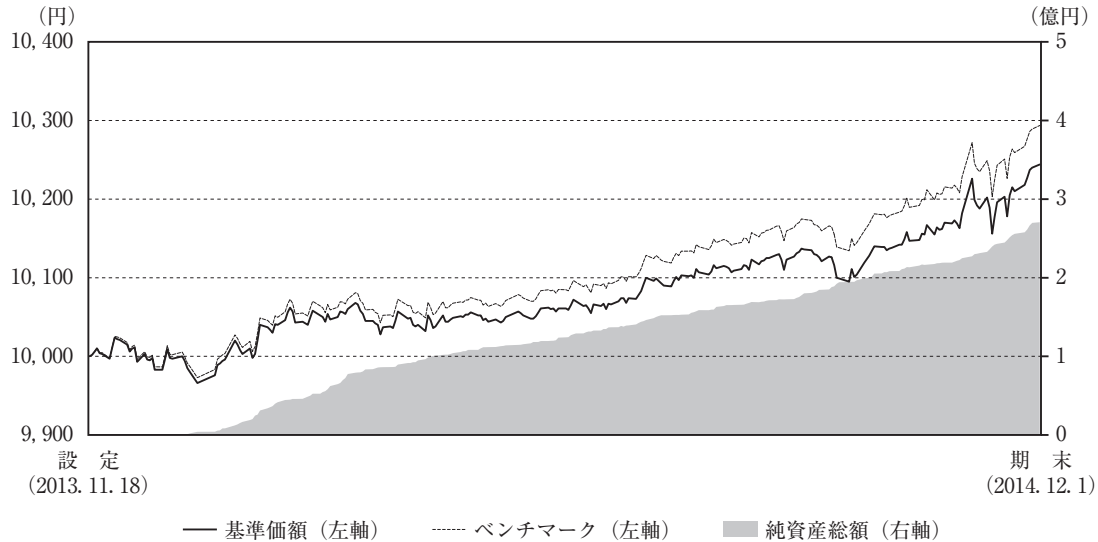
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号  
お問い合わせ先（コールセンター）  
TEL 0120-106212  
（営業日の9:00～17:00）  
<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■設定以来の運用実績

| 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<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 | 純 資 産<br>総 額 |
|--------------------|--------------|-----------|-----------|-------------------------|-----------|---------------|-------------|--------------|
|                    |              | 税 込 分 配 金 | 期 中 騰 落 率 | （ベンチマーク）                | 期 中 騰 落 率 |               |             |              |
| 1 期末(2014年12月 1 日) | 円<br>10, 244 | 円<br>0    | %<br>2. 4 | 496. 247                | %<br>2. 9 | %<br>99. 2    | %<br>—      | 百万円<br>270   |

- (注 1) ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数は、大和総研が開発した日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定する指数であり、対象となる債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。
- (注 2) 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 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。

■当期中の基準価額と市況の推移



(注) ベンチマークは、設定日の前営業日を10, 000として指数化したものです。

| 年 月 日           | 基 準 価 額 |       | ダイワ・bond・インデックス（D B I）総合指数 |       | 公 社 債<br>組入比率 | 債 券<br>先物比率 |
|-----------------|---------|-------|----------------------------|-------|---------------|-------------|
|                 |         | 騰落率   | (ベンチマーク)                   | 騰落率   |               |             |
| (設定)2013年11月18日 | 円       | %     | (11/15)                    | %     | %             | %           |
|                 | 10,000  | —     | 482.161                    | —     | —             | —           |
| 11月末            | 10,021  | 0.2   | 483.230                    | 0.2   | 99.1          | —           |
| 12月末            | 9,966   | △ 0.3 | 480.780                    | △ 0.3 | 99.3          | —           |
| 2014年1月末        | 10,040  | 0.4   | 484.488                    | 0.5   | 99.3          | —           |
| 2月末             | 10,060  | 0.6   | 485.597                    | 0.7   | 99.2          | —           |
| 3月末             | 10,032  | 0.3   | 484.449                    | 0.5   | 99.4          | —           |
| 4月末             | 10,043  | 0.4   | 485.162                    | 0.6   | 99.3          | —           |
| 5月末             | 10,070  | 0.7   | 486.633                    | 0.9   | 99.2          | —           |
| 6月末             | 10,096  | 1.0   | 488.087                    | 1.2   | 99.3          | —           |
| 7月末             | 10,107  | 1.1   | 488.906                    | 1.4   | 99.3          | —           |
| 8月末             | 10,136  | 1.4   | 490.484                    | 1.7   | 99.2          | —           |
| 9月末             | 10,139  | 1.4   | 490.811                    | 1.8   | 99.4          | —           |
| 10月末            | 10,182  | 1.8   | 493.096                    | 2.3   | 99.4          | —           |
| 11月末            | 10,240  | 2.4   | 496.026                    | 2.9   | 99.2          | —           |
| (期末)2014年12月1日  | 10,244  | 2.4   | 496.247                    | 2.9   | 99.2          | —           |

(注) 騰落率は設定比。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

設定時：10,000円 期末：10,244円 騰落率：2.4%

【基準価額の主な変動要因】

債券からの利息収入に加えて、金利水準の低下による債券の値上がり益が発生したため、ベンチマーク（D B I 総合指数）の騰落率は2.9%となりました。同指数への連動をめざす当ファンドの期末の基準価額は10,244円となり、騰落率は2.4%となりました。

◆投資環境について

国内債券市況は、欧米の長期金利の上昇や円安・株高の進行に加え、2014年度の国債発行計画やG P I F（年金積立金管理運用独立行政法人）の国内債券運用比率引下げが意識されたことなどから、国内長期金利は上昇基調で始まりました。2014年に入ると、欧米の長期金利の低下や円安の一服、軟調な株価推移などを受け、国内長期金利は2月まで低下傾向を続けました。その後の国内長期金利は横ばい圏での推移が続きましたが、世界的に金融資本市場のボラティリティ（価格変動性）が低下する中、6月半ば以降は国債市場の需給環境がいつそう引締まり、低下基調を強めました。9月に入ると、米国

の長期金利の上昇や円安・株高などをを受けて国内長期金利はいったん上昇しましたが、9月半ば以降は地政学的な緊張によりリスク回避傾向が世界的に強まる展開となり、再び低下基調をたどりしました。さらに10月末には、日銀が量的・質的金融緩和を拡大したことから国内長期金利は11月初めに一段と低下しました。その後は円安・株高を受けていったん上昇しましたが、引締まった国債需給が続く中で再度低下に転じ、期末を迎えました。

#### ◆ポートフォリオについて

##### ○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入れ、DBI総合指数に連動することをめざした運用を行ないました。

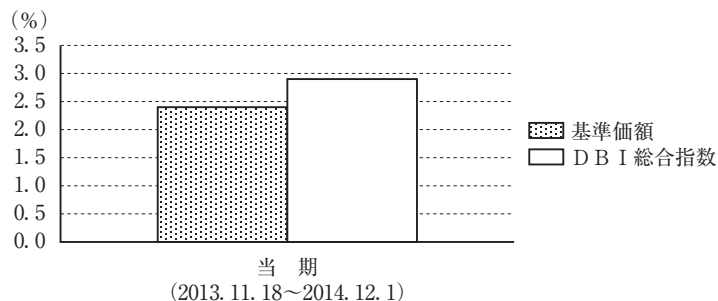
##### ○日本債券インデックスマザーファンド

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

#### ◆ベンチマークとの差異について

当ファンドとベンチマークとの騰落率の差は $\Delta 0.5\%$ でした。差異の内訳は、信託報酬要因によるベンチマークとの差異は $\Delta 0.4\%$ 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は $\Delta 0.1\%$ 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。なお、「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騰落率の差異は、信用スプレッドの変動によるものでした。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



◆分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が少額であったため、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                        |
|-------------------------|----------------------------|
|                         | 2013年11月18日<br>～2014年12月1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)   | 243                        |

(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入れ、D B I 総合指数に連動することをめざした運用を行ないます。

○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ないます。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なわれるベンチマークのユニバース変化に対しては、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ないます。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                         |                                             | 項 目 の 概 要                                                                                                                                                                                             |
|------------------------------------|----------------------------|---------------------------------------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|                                    | (2013. 11. 18～2014. 12. 1) |                                             |                                                                                                                                                                                                       |
|                                    | 金 額                        | 比 率                                         |                                                                                                                                                                                                       |
| 信託報酬<br>(投信会社)<br>(販売会社)<br>(受託銀行) | 45円<br>(21)<br>(21)<br>(3) | 0. 444％<br>(0. 205)<br>(0. 205)<br>(0. 033) | 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率<br>期中の平均基準価額（月末値の平均値）は10, 080円です。<br>投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目論見書・運用報告書の作成等の対価<br>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<br>受託銀行分は、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＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数<br>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＝期中の有価証券取引税／期中の平均受益権口数<br>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<br>(監査費用)                    | 1<br>(1)                   | 0. 005<br>(0. 005)                          | その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数<br>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                                | 45                         | 0. 449                                      |                                                                                                                                                                                                       |

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組入れている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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■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

(2013年11月18日から2014年12月1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<br>インデックス<br>マザーファンド | 205, 399 | 267, 537 | 1, 338 | 1, 747 |

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当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期中の利害関係人との取引状況

(2013年11月18日から2014年12月1日まで)

| 決 算 期   | 当 期       |                            |      |           |                            |      |
|---------|-----------|----------------------------|------|-----------|----------------------------|------|
|         | 買付額等<br>A | う ち 利 害<br>関係人との<br>取引状況 B | B/A  | 売付額等<br>C | う ち 利 害<br>関係人との<br>取引状況 D | D/C  |
|         | 百万円       | 百万円                        | %    | 百万円       | 百万円                        | %    |
| 公 社 債   | 19, 423   | 1, 166                     | 6. 0 | 19, 019   | 1, 832                     | 9. 6 |
| コール・ローン | 48, 389   | —                          | —    | —         | —                          | —    |

(注) 平均保有割合0. 2％  
 ※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

(2013年11月18日から2014年12月1日まで)

| 種 類   | 当 期                        |
|-------|----------------------------|
|       | 日本債券インデックスマザーファンド<br>買 付 額 |
| 公 社 債 | 百万円<br>100                 |

(注1) 金額は受渡し代金。  
 (注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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、当期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。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

| 設定時保有額 | 期中設定額 | 期中解約額 | 期末保有額 | 取引の理由            |
|--------|-------|-------|-------|------------------|
| 百万円    | 百万円   | 百万円   | 百万円   |                  |
| 1      | —     | 1     | —     | 当初設定時における取得とその処分 |

(注1) 金額は元本ベース。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表  
親投資信託残高

| 種 類                                  | 当 期 末   |         |
|--------------------------------------|---------|---------|
|                                      | 口 数     | 評 価 額   |
|                                      | 千口      | 千円      |
| 日 本 債 券 イ ン デ ッ ク ス<br>マ ザ ー フ ァ ン ド | 204,060 | 270,339 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2014年12月1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     | 270,339 | 99.7  |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等、そ の 他 | 693     | 0.3   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額       | 271,033 | 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

2014年12月1日現在

| 項 目                     | 当 期 末        |
|-------------------------|--------------|
| (A)資 産                  | 271,033,090円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等         | 693,723      |
| 日本債券インデックスマザーファンド(評価額)  | 270,339,367  |
| (B)負 債                  | 428,378      |
| 未 払 信 託 報 酬             | 423,152      |
| そ の 他 未 払 費 用           | 5,226        |
| (C)純 資 産 総 額 (A－B)      | 270,604,712  |
| 元 本                     | 264,162,433  |
| 次 期 繰 越 損 益 金           | 6,442,279    |
| (D)受 益 権 総 口 数          | 264,162,433口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C／D) | 10,244円      |

\* 設定時における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は271,753,955円、同解約元本額は8,591,522円です。  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,244円です。

■損益の状況

当期 自2013年11月18日 至2014年12月1日

| 項 目                  | 当 期        |
|----------------------|------------|
| (A)配 当 等 収 益         | 47円        |
| 受 取 利 息              | 47         |
| (B)有価証券売買損益          | 4,483,012  |
| 売 買 益                | 4,549,474  |
| 売 買 損                | △ 66,462   |
| (C)信 託 報 酬 等         | △ 547,289  |
| (D)当 期 損 益 金 (A＋B＋C) | 3,935,770  |
| (E)追加信託差損益金          | 2,506,509  |
| (売 買 損 益 相 当 額) (    | 2,506,509) |
| (F)合 計 (D＋E)         | 6,442,279  |
| 次期繰越損益金 (F)          | 6,442,279  |
| 追 加 信 託 差 損 益 金      | 2,506,509  |
| (売 買 損 益 相 当 額) (    | 2,506,509) |
| 分 配 準 備 積 立 金        | 3,935,770  |

(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7ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表を参照。

■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   | 47円          |
| (b) 経費控除後の有価証券売買等損益         | 3,935,723    |
| (c) 収 益 調 整 金               | 2,506,509    |
| (d) 分 配 準 備 積 立 金           | 0            |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 6,442,279    |
| (f) 分 配 金                   | 0            |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)       | 6,442,279    |
| (h) 受 益 権 総 口 数             | 264,162,433口 |

**復興特別所得税ならびに証券税制の軽減税率の廃止に関するお知らせ**  
2013年1月1日から普通分配金ならびに解約時または償還時の差益に対し、所得税に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が課されています。また、証券税制の軽減税率は2013年12月31日をもって廃止されています。そのため2013年1月1日から2013年12月31日まで10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%および地方税3%）、2014年1月1日以降は20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率が適用されます。

当ファンドは少額投資非課税制度「N I S A（ニーサ）」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《お知らせ》

- 運用報告書（全体版）の電子交付について  
2014年12月1日施行の法改正により、運用報告書は「交付運用報告書」と「運用報告書（全体版）」（本書）の2種類になりましたが、「運用報告書（全体版）」については、交付に代えて電子交付する旨を信託約款に定めました。
- 書面決議手続きの改正について  
重大な約款変更や繰上償還の際に行なう書面決議について、2014年12月1日施行の法改正により以下の点が変更されたことに伴い、信託約款の該当箇所の変更を行ないました。
  - ・書面決議の可決要件が、「受益者の半数以上の賛成かつ受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」から「受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」に変更されました。
  - ・投資信託の併合を行なう際、すべての場合で書面決議が必要とされてきましたが、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものであるときは、当該併合に関する書面決議が不要となりました。
  - ・書面決議に反対した受益者による受益権買取請求の規定について、一部解約請求に応じる投資信託（当ファンドは該当します。）には適用されなくなりました。

【本資料は、受益者のみなさまにファンドの運用状況をお知らせするためのものであり、投資の勧誘を目的としたものではありません。】



# 日本債券インデックスマザーファンド

## 運用報告書 第15期 (決算日 2014年12月 1 日)

(計算期間 2013年12月 3 日～2014年12月 1 日)

日本債券インデックスマザーファンドの第15期にかかる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                                                                      |
| 運 用 方 法 | 主として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。 |
| 株式組入制限  | 純資産総額の30%以下                                                                  |

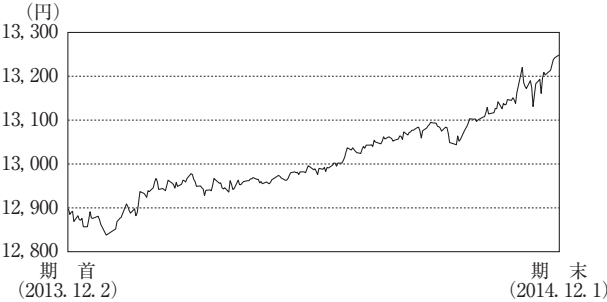
### 大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目 9 番 1 号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額と市況の推移



| 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 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)2013年12月2日 | 12,897  | —     | 482.946                     | —     | 99.3          | —           |
| 12月末           | 12,838  | △ 0.5 | 480.780                     | △ 0.4 | 99.4          | —           |
| 2014年1月末       | 12,937  | 0.3   | 484.488                     | 0.3   | 99.4          | —           |
| 2月末            | 12,967  | 0.5   | 485.597                     | 0.5   | 99.3          | —           |
| 3月末            | 12,936  | 0.3   | 484.449                     | 0.3   | 99.5          | —           |
| 4月末            | 12,955  | 0.4   | 485.162                     | 0.5   | 99.4          | —           |
| 5月末            | 12,994  | 0.8   | 486.633                     | 0.8   | 99.3          | —           |
| 6月末            | 13,032  | 1.0   | 488.087                     | 1.1   | 99.4          | —           |
| 7月末            | 13,052  | 1.2   | 488.906                     | 1.2   | 99.4          | —           |
| 8月末            | 13,094  | 1.5   | 490.484                     | 1.6   | 99.3          | —           |
| 9月末            | 13,103  | 1.6   | 490.811                     | 1.6   | 99.5          | —           |
| 10月末           | 13,163  | 2.1   | 493.096                     | 2.1   | 99.5          | —           |
| 11月末           | 13,242  | 2.7   | 496.026                     | 2.7   | 99.3          | —           |
| (期末)2014年12月1日 | 13,248  | 2.7   | 496.247                     | 2.8   | 99.3          | —           |

(注1) 騰落率は期首比。  
(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) 総合指数は、大和総研が開発した日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定する指数であり、対象となる債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。  
(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：12,897円 期末：13,248円 騰落率：2.7%  
【基準価額の主な変動要因】  
債券からの利息収入に加えて、金利水準の低下による債券の値上がり益が発生したため、ベンチマーク (D B I 総合指数) の騰落率は2.8%となりました。同指数への連動をめざす当ファンドの期末の基準価額は13,248円となり、騰落率はベンチマークとほぼ同等の2.7%となりました。

◆投資環境について  
国内債券市況は、欧米の長期金利の上昇や円安・株高の進行に加え、2014年度の国債発行計画やG P I F (年金積立金管理運用独立行政法人) の国内債券運用比率引下げが意識されたことなどから、国内長期金利は上昇基調で始まりました。2014年に入ると、欧米の長期金利の低下や円安の一服、軟調な株価推移などを受け、国内長期金利は2月まで低下傾向を続けました。その後の国内長期金利は横ばい圏での推移が続きましたが、世界的に金融資本市場のボラティリティ (価格変動性) が低下する中、6月半ば以降は国債市場の需給環境が引っ張り締まり、低下基調を強めました。9月に入ると、米国の長期金利の上昇や円安・株高などを受けて国内長期金利はいったん上昇しましたが、9月半ば以降は地政学的な緊張によりリスク回避傾向が世界的に強まる展開となり、再び低下基調をたどりしました。さらに10月末には、日銀が量的・質的金融緩和を拡大したことから国内長期金利は11月初めに一段と低下しました。その後は円安・株高を受けていったん上昇しましたが、引締まった国債需給が続く中で再度低下に転じ、期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」  
ベンチマークであるD B I 総合指数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の変動に対する感応度を厳密に管理するとともに、ファンドへの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細やかなポートフォリオのリバランスを行います。なお、D B I 総合指数には投資適格格付 (B B B 格) 未満の債券も含まれておりますが、信用リスクの管理や流動性確保の観点から、今後もこれらの銘柄への投資は見送ります。

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

◆ベンチマークとの差異について  
当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差は△0.1%で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。企業業績の回復と堅調な株式市場を背景に、社債の信用スプレッドは多くの銘柄で縮小傾向となり社債価格は上昇しました。しかしこれらの社債の中には、信用リスク管理や流動性確保の観点から当ファンドでは投資を見送っている銘柄もあったことから、信用スプレッド変動要因で小幅の超過損失が発生する結果となりました。

《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ない  
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への感応  
度を厳密に管理するとともに、ファンドへの資金流入や毎月末に行な  
われるベンチマークのユニバース変化に対しては、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ないます。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 |
|---------|-----|
| 売買委託手数料 | —円  |
| 有価証券取引税 | —   |
| その他費用   | —   |
| 合 計     | —   |

(注) 費用の項目および算出法については 5 ページ（1 万口当りの費用の明細の項  
目と概要）をご参照ください。

■ 売買および取引の状況

公 社 債

(2013年12月 3 日から2014年12月 1 日まで)

|        |           | 買 付 額        | 売 付 額                 |
|--------|-----------|--------------|-----------------------|
|        |           | 千円           | 千円                    |
| 国<br>内 | 国 債 証 券   | 13, 659, 146 | 13, 139, 068<br>( — ) |
|        | 地 方 債 証 券 | 613, 212     | 810, 244<br>( — )     |
|        | 特 殊 債 券   | 816, 605     | 734, 104<br>( — )     |
|        | 社 債 券     | 1, 449, 656  | 1, 621, 310<br>( — )  |

(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

(2013年12月 3 日から2014年12月 1 日まで)

| 当 期                        |          | 期 付                       |          |
|----------------------------|----------|---------------------------|----------|
| 買 付                        | 金 額      | 売 付                       | 金 額      |
| 銘 柄                        | 千円       | 銘 柄                       | 千円       |
| 117 5年国債 0. 2% 2019/3/20   | 705, 631 | 329 2年国債 0. 2% 2015/6/15  | 580, 882 |
| 333 10年国債 0. 6% 2024/3/20  | 661, 177 | 337 2年国債 0. 1% 2016/2/15  | 500, 465 |
| 332 10年国債 0. 6% 2023/12/20 | 603, 545 | 332 2年国債 0. 1% 2015/9/15  | 476, 191 |
| 116 5年国債 0. 2% 2018/12/20  | 600, 165 | 338 2年国債 0. 1% 2016/3/15  | 474, 558 |
| 338 2年国債 0. 1% 2016/3/15   | 574, 616 | 327 2年国債 0. 1% 2015/4/15  | 445, 160 |
| 334 10年国債 0. 6% 2024/6/20  | 553, 918 | 268 10年国債 1. 5% 2015/3/20 | 433, 430 |
| 335 10年国債 0. 5% 2024/9/20  | 552, 300 | 91 5年国債 0. 4% 2015/9/20   | 401, 502 |
| 329 2年国債 0. 2% 2015/6/15   | 500, 820 | 335 2年国債 0. 1% 2015/12/15 | 400, 209 |
| 337 2年国債 0. 1% 2016/2/15   | 500, 328 | 331 2年国債 0. 1% 2015/8/15  | 390, 101 |
| 119 5年国債 0. 1% 2019/6/20   | 498, 662 | 328 2年国債 0. 1% 2015/5/15  | 380, 095 |

(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<br>以下組<br>入率 | 残 存 期 間 別 組 入 比 率 |           |          |
|               |                  |                  |           |                    | 5年以上              | 2年以上      | 2年未満     |
| 国 債 証 券       | 千円<br>38,156,000 | 千円<br>41,307,987 | %<br>73.8 | %<br>—             | %<br>49.2         | %<br>18.2 | %<br>6.4 |
| 地 方 債 証 券     | 4,266,000        | 4,454,870        | 8.0       | —                  | 3.9               | 2.9       | 1.1      |
| 特殊債券 (除く金融債券) | 4,031,000        | 4,222,224        | 7.5       | —                  | 3.2               | 3.2       | 1.1      |
| 金 融 債 券       | 600,000          | 603,545          | 1.1       | —                  | —                 | 0.5       | 0.5      |
| 普 通 社 債 券     | 4,806,000        | 4,981,866        | 8.9       | —                  | 2.1               | 5.2       | 1.6      |
| 合 計           | 51,859,000       | 55,570,494       | 99.3      | —                  | 58.5              | 30.1      | 10.8     |

（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。

(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  |
| 国債証券 | 338 2年国債   | %<br>0.1000 | 千円<br>100,000 | 千円<br>100,121 | 2016/03/15 |
|      | 95 5年国債    | 0.6000      | 300,000       | 302,307       | 2016/03/20 |
|      | 96 5年国債    | 0.5000      | 222,000       | 223,420       | 2016/03/20 |
|      | 277 10年国債  | 1.6000      | 133,000       | 135,742       | 2016/03/20 |
|      | 278 10年国債  | 1.8000      | 104,000       | 106,413       | 2016/03/20 |
|      | 279 10年国債  | 2.0000      | 106,000       | 108,733       | 2016/03/20 |
|      | 31 利付国債20年 | 3.5000      | 18,000        | 18,813        | 2016/03/21 |
|      | 32 利付国債20年 | 3.7000      | 16,000        | 16,764        | 2016/03/21 |
|      | 339 2年国債   | 0.1000      | 150,000       | 150,193       | 2016/04/15 |
|      | 340 2年国債   | 0.1000      | 255,000       | 255,349       | 2016/05/15 |
|      | 341 2年国債   | 0.1000      | 105,000       | 105,152       | 2016/06/15 |
|      | 97 5年国債    | 0.4000      | 160,000       | 160,976       | 2016/06/20 |
|      | 98 5年国債    | 0.3000      | 250,000       | 251,137       | 2016/06/20 |
|      | 280 10年国債  | 1.9000      | 237,000       | 243,936       | 2016/06/20 |
|      | 281 10年国債  | 2.0000      | 138,000       | 142,253       | 2016/06/20 |
|      | 343 2年国債   | 0.1000      | 290,000       | 290,466       | 2016/08/15 |
|      | 344 2年国債   | 0.1000      | 75,000        | 75,126        | 2016/09/15 |
|      | 99 5年国債    | 0.4000      | 45,000        | 45,319        | 2016/09/20 |
|      | 100 5年国債   | 0.3000      | 190,000       | 191,007       | 2016/09/20 |
|      | 282 10年国債  | 1.7000      | 100,000       | 103,046       | 2016/09/20 |
|      | 283 10年国債  | 1.8000      | 10,000        | 10,322        | 2016/09/20 |
|      | 33 利付国債20年 | 3.8000      | 22,000        | 23,498        | 2016/09/20 |
|      | 345 2年国債   | 0.1000      | 105,000       | 105,185       | 2016/10/15 |
|      | 346 2年国債   | 0.1000      | 400,000       | 400,740       | 2016/11/15 |
|      | 101 5年国債   | 0.4000      | 210,000       | 211,675       | 2016/12/20 |
|      | 102 5年国債   | 0.3000      | 235,000       | 236,393       | 2016/12/20 |
|      | 284 10年国債  | 1.7000      | 211,000       | 218,317       | 2016/12/20 |
|      | 103 5年国債   | 0.3000      | 170,000       | 171,128       | 2017/03/20 |
|      | 104 5年国債   | 0.2000      | 254,000       | 255,104       | 2017/03/20 |
|      | 285 10年国債  | 1.7000      | 123,000       | 127,779       | 2017/03/20 |
|      | 34 利付国債20年 | 3.5000      | 9,000         | 9,720         | 2017/03/20 |
|      | 35 利付国債20年 | 3.3000      | 22,000        | 23,659        | 2017/03/20 |
|      | 105 5年国債   | 0.2000      | 300,000       | 301,449       | 2017/06/20 |
|      | 286 10年国債  | 1.8000      | 220,000       | 230,049       | 2017/06/20 |
|      | 287 10年国債  | 1.9000      | 90,000        | 94,339        | 2017/06/20 |

| 区 分 | 当<br>銘 柄   | 期      |         | 末       |            |
|-----|------------|--------|---------|---------|------------|
|     |            | 年 利 率  | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
|     |            | %      | 千円      | 千円      |            |
|     | 106 5年国債   | 0.2000 | 370,000 | 371,964 | 2017/09/20 |
|     | 288 10年国債  | 1.7000 | 254,000 | 266,039 | 2017/09/20 |
|     | 36 利付国債20年 | 3.0000 | 21,000  | 22,752  | 2017/09/20 |
|     | 37利付国債20年  | 3.1000 | 23,000  | 24,980  | 2017/09/20 |
|     | 107 5年国債   | 0.2000 | 300,000 | 301,689 | 2017/12/20 |
|     | 108 5年国債   | 0.1000 | 155,000 | 155,399 | 2017/12/20 |
|     | 289 10年国債  | 1.5000 | 48,000  | 50,170  | 2017/12/20 |
|     | 109 5年国債   | 0.1000 | 250,000 | 250,657 | 2018/03/20 |
|     | 110 5年国債   | 0.3000 | 180,000 | 181,657 | 2018/03/20 |
|     | 111 5年国債   | 0.4000 | 220,000 | 222,750 | 2018/03/20 |
|     | 290 10年国債  | 1.4000 | 132,000 | 137,994 | 2018/03/20 |
|     | 291 10年国債  | 1.3000 | 179,000 | 186,539 | 2018/03/20 |
|     | 292 10年国債  | 1.7000 | 155,000 | 163,568 | 2018/03/20 |
|     | 38利付国債20年  | 2.7000 | 60,000  | 65,280  | 2018/03/20 |
|     | 39 20年国債   | 2.6000 | 90,000  | 97,624  | 2018/03/20 |
|     | 112 5年国債   | 0.4000 | 150,000 | 151,965 | 2018/06/20 |
|     | 113 5年国債   | 0.3000 | 550,000 | 555,258 | 2018/06/20 |
|     | 293 10年国債  | 1.8000 | 238,000 | 252,917 | 2018/06/20 |
|     | 294 10年国債  | 1.7000 | 147,000 | 155,693 | 2018/06/20 |
|     | 295 10年国債  | 1.5000 | 175,000 | 184,108 | 2018/06/20 |
|     | 114 5年国債   | 0.3000 | 140,000 | 141,379 | 2018/09/20 |
|     | 115 5年国債   | 0.2000 | 425,000 | 427,575 | 2018/09/20 |
|     | 296 10年国債  | 1.5000 | 25,000  | 26,378  | 2018/09/20 |
|     | 40 20年国債   | 2.3000 | 57,000  | 61,860  | 2018/09/20 |
|     | 116 5年国債   | 0.2000 | 570,000 | 573,448 | 2018/12/20 |
|     | 297 10年国債  | 1.4000 | 70,000  | 73,815  | 2018/12/20 |
|     | 298 10年国債  | 1.3000 | 125,000 | 131,310 | 2018/12/20 |
|     | 117 5年国債   | 0.2000 | 665,000 | 668,837 | 2019/03/20 |
|     | 299 10年国債  | 1.3000 | 270,000 | 284,334 | 2019/03/20 |
|     | 300 10年国債  | 1.5000 | 286,000 | 303,634 | 2019/03/20 |
|     | 41 20年国債   | 1.5000 | 136,000 | 144,293 | 2019/03/20 |
|     | 42 20年国債   | 2.6000 | 87,000  | 96,400  | 2019/03/20 |
|     | 118 5年国債   | 0.2000 | 140,000 | 140,760 | 2019/06/20 |
|     | 119 5年国債   | 0.1000 | 500,000 | 500,450 | 2019/06/20 |
|     | 301 10年国債  | 1.5000 | 120,000 | 127,744 | 2019/06/20 |
|     | 302 10年国債  | 1.4000 | 100,000 | 106,001 | 2019/06/20 |
|     | 120 5年国債   | 0.2000 | 310,000 | 311,553 | 2019/09/20 |
|     | 121 5年国債   | 0.1000 | 163,000 | 163,037 | 2019/09/20 |
|     | 303 10年国債  | 1.4000 | 10,000  | 10,625  | 2019/09/20 |
|     | 304 10年国債  | 1.3000 | 100,000 | 105,779 | 2019/09/20 |
|     | 43 20年国債   | 2.9000 | 100,000 | 113,422 | 2019/09/20 |
|     | 305 10年国債  | 1.3000 | 350,000 | 371,182 | 2019/12/20 |
|     | 306 10年国債  | 1.4000 | 255,000 | 272,526 | 2020/03/20 |
|     | 307 10年国債  | 1.3000 | 250,000 | 265,865 | 2020/03/20 |
|     | 44 20年国債   | 2.5000 | 85,000  | 95,766  | 2020/03/20 |
|     | 45 20年国債   | 2.4000 | 78,000  | 87,468  | 2020/03/20 |
|     | 308 10年国債  | 1.3000 | 150,000 | 159,882 | 2020/06/20 |
|     | 309 10年国債  | 1.1000 | 220,000 | 232,067 | 2020/06/20 |
|     | 46 20年国債   | 2.2000 | 73,000  | 81,484  | 2020/06/22 |
|     | 310 10年国債  | 1.0000 | 30,000  | 31,528  | 2020/09/20 |
|     | 311 10年国債  | 0.8000 | 110,000 | 114,338 | 2020/09/20 |
|     | 47 20年国債   | 2.2000 | 89,000  | 99,748  | 2020/09/21 |
|     | 312 10年国債  | 1.2000 | 495,000 | 526,932 | 2020/12/20 |
|     | 48 20年国債   | 2.5000 | 54,000  | 61,718  | 2020/12/21 |
|     | 313 10年国債  | 1.3000 | 260,000 | 278,813 | 2021/03/20 |
|     | 314 10年国債  | 1.1000 | 315,000 | 333,862 | 2021/03/20 |
|     | 49 20年国債   | 2.1000 | 64,000  | 71,854  | 2021/03/22 |

## 日本債券インデックスマザーファンド

| 区 分 | 当<br>銘 柄  | 期      |         | 末       |            |
|-----|-----------|--------|---------|---------|------------|
|     |           | 年 利 率  | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
|     |           | %      | 千円      | 千円      |            |
|     | 50 20年国債  | 1.9000 | 107,000 | 118,794 | 2021/03/22 |
|     | 315 10年国債 | 1.2000 | 221,000 | 235,963 | 2021/06/20 |
|     | 316 10年国債 | 1.1000 | 175,000 | 185,715 | 2021/06/20 |
|     | 51 20年国債  | 2.0000 | 82,000  | 91,866  | 2021/06/21 |
|     | 317 10年国債 | 1.1000 | 214,000 | 227,372 | 2021/09/20 |
|     | 318 10年国債 | 1.0000 | 380,000 | 401,192 | 2021/09/20 |
|     | 52 20年国債  | 2.1000 | 52,000  | 58,766  | 2021/09/21 |
|     | 319 10年国債 | 1.1000 | 100,000 | 106,290 | 2021/12/20 |
|     | 320 10年国債 | 1.0000 | 210,000 | 221,749 | 2021/12/20 |
|     | 53 20年国債  | 2.1000 | 66,000  | 74,791  | 2021/12/20 |
|     | 54 20年国債  | 2.2000 | 65,000  | 74,110  | 2021/12/20 |
|     | 321 10年国債 | 1.0000 | 175,000 | 184,796 | 2022/03/20 |
|     | 322 10年国債 | 0.9000 | 180,000 | 188,785 | 2022/03/20 |
|     | 55 20年国債  | 2.0000 | 140,000 | 158,006 | 2022/03/21 |
|     | 323 10年国債 | 0.9000 | 40,000  | 41,956  | 2022/06/20 |
|     | 324 10年国債 | 0.8000 | 70,000  | 72,905  | 2022/06/20 |
|     | 56 20年国債  | 2.0000 | 58,000  | 65,613  | 2022/06/20 |
|     | 57 20年国債  | 1.9000 | 85,000  | 95,527  | 2022/06/20 |
|     | 325 10年国債 | 0.8000 | 60,000  | 62,475  | 2022/09/20 |
|     | 58 20年国債  | 1.9000 | 112,000 | 126,133 | 2022/09/20 |
|     | 326 10年国債 | 0.7000 | 8,000   | 8,264   | 2022/12/20 |
|     | 59 20年国債  | 1.7000 | 110,000 | 122,387 | 2022/12/20 |
|     | 60 20年国債  | 1.4000 | 100,000 | 108,856 | 2022/12/20 |
|     | 328 10年国債 | 0.6000 | 153,000 | 156,713 | 2023/03/20 |
|     | 61 20年国債  | 1.0000 | 186,000 | 196,615 | 2023/03/20 |
|     | 329 10年国債 | 0.8000 | 300,000 | 312,105 | 2023/06/20 |
|     | 62 20年国債  | 0.8000 | 95,000  | 98,833  | 2023/06/20 |
|     | 63 20年国債  | 1.8000 | 130,000 | 146,246 | 2023/06/20 |
|     | 330 10年国債 | 0.8000 | 242,000 | 251,614 | 2023/09/20 |
|     | 331 10年国債 | 0.6000 | 223,000 | 227,950 | 2023/09/20 |
|     | 64 20年国債  | 1.9000 | 90,000  | 102,167 | 2023/09/20 |
|     | 332 10年国債 | 0.6000 | 565,000 | 576,876 | 2023/12/20 |
|     | 65 20年国債  | 1.9000 | 85,000  | 96,679  | 2023/12/20 |
|     | 66 20年国債  | 1.8000 | 135,000 | 152,297 | 2023/12/20 |
|     | 333 10年国債 | 0.6000 | 461,000 | 470,100 | 2024/03/20 |
|     | 67 20年国債  | 1.9000 | 55,000  | 62,616  | 2024/03/20 |
|     | 68 20年国債  | 2.2000 | 120,000 | 139,917 | 2024/03/20 |
|     | 69 20年国債  | 2.1000 | 110,000 | 127,267 | 2024/03/20 |
|     | 334 10年国債 | 0.6000 | 550,000 | 560,367 | 2024/06/20 |
|     | 70 20年国債  | 2.4000 | 83,000  | 98,579  | 2024/06/20 |
|     | 71 20年国債  | 2.2000 | 125,000 | 146,088 | 2024/06/20 |
|     | 335 10年国債 | 0.5000 | 550,000 | 554,136 | 2024/09/20 |
|     | 72 20年国債  | 2.1000 | 175,000 | 203,141 | 2024/09/20 |
|     | 73 20年国債  | 2.0000 | 120,000 | 138,410 | 2024/12/20 |
|     | 74 20年国債  | 2.1000 | 73,000  | 84,904  | 2024/12/20 |
|     | 75 20年国債  | 2.1000 | 70,000  | 81,562  | 2025/03/20 |
|     | 76 20年国債  | 1.9000 | 51,000  | 58,389  | 2025/03/20 |
|     | 77 20年国債  | 2.0000 | 55,000  | 63,511  | 2025/03/20 |
|     | 78 20年国債  | 1.9000 | 61,000  | 69,939  | 2025/06/20 |
|     | 79 20年国債  | 2.0000 | 50,000  | 57,860  | 2025/06/20 |
|     | 80 20年国債  | 2.1000 | 63,000  | 73,502  | 2025/06/20 |
|     | 81 20年国債  | 2.0000 | 76,000  | 88,038  | 2025/09/20 |
|     | 82 20年国債  | 2.1000 | 87,000  | 101,728 | 2025/09/20 |
|     | 83 20年国債  | 2.1000 | 93,000  | 108,918 | 2025/12/20 |
|     | 84 20年国債  | 2.0000 | 100,000 | 116,006 | 2025/12/20 |
|     | 85 20年国債  | 2.1000 | 58,000  | 67,992  | 2026/03/20 |
|     | 86 20年国債  | 2.3000 | 80,000  | 95,545  | 2026/03/20 |

| 区 分 | 当<br>銘 柄  | 期<br>年 利 率 | 額 面 金 額 | 末       |            |
|-----|-----------|------------|---------|---------|------------|
|     |           |            |         | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
|     |           | %          | 千円      | 千円      |            |
|     | 87 20年国債  | 2.2000     | 72,000  | 85,174  | 2026/03/20 |
|     | 88 20年国債  | 2.3000     | 100,000 | 119,647 | 2026/06/20 |
|     | 89 20年国債  | 2.2000     | 98,000  | 116,121 | 2026/06/20 |
|     | 90 20年国債  | 2.2000     | 120,000 | 142,328 | 2026/09/20 |
|     | 91 20年国債  | 2.3000     | 85,000  | 101,817 | 2026/09/20 |
|     | 92 20年国債  | 2.1000     | 190,000 | 223,523 | 2026/12/20 |
|     | 93 20年国債  | 2.0000     | 100,000 | 116,561 | 2027/03/20 |
|     | 94 20年国債  | 2.1000     | 106,000 | 124,845 | 2027/03/20 |
|     | 95 20年国債  | 2.3000     | 103,000 | 123,861 | 2027/06/20 |
|     | 96 20年国債  | 2.1000     | 97,000  | 114,308 | 2027/06/20 |
|     | 97 20年国債  | 2.2000     | 81,000  | 96,574  | 2027/09/20 |
|     | 98 20年国債  | 2.1000     | 130,000 | 153,357 | 2027/09/20 |
|     | 99 20年国債  | 2.1000     | 205,000 | 242,057 | 2027/12/20 |
|     | 100 20年国債 | 2.2000     | 142,000 | 169,448 | 2028/03/20 |
|     | 101 20年国債 | 2.4000     | 70,000  | 85,354  | 2028/03/20 |
|     | 102 20年国債 | 2.4000     | 80,000  | 97,610  | 2028/06/20 |
|     | 103 20年国債 | 2.3000     | 70,000  | 84,483  | 2028/06/20 |
|     | 104 20年国債 | 2.1000     | 95,000  | 112,288 | 2028/06/20 |
|     | 105 20年国債 | 2.1000     | 126,000 | 148,943 | 2028/09/20 |
|     | 106 20年国債 | 2.2000     | 105,000 | 125,526 | 2028/09/20 |
|     | 107 20年国債 | 2.1000     | 107,000 | 126,561 | 2028/12/20 |
|     | 108 20年国債 | 1.9000     | 138,000 | 159,585 | 2028/12/20 |
|     | 109 20年国債 | 1.9000     | 110,000 | 127,067 | 2029/03/20 |
|     | 110 20年国債 | 2.1000     | 120,000 | 141,920 | 2029/03/20 |
|     | 111 20年国債 | 2.2000     | 100,000 | 119,643 | 2029/06/20 |
|     | 112 20年国債 | 2.1000     | 162,000 | 191,560 | 2029/06/20 |
|     | 1 30年国債   | 2.8000     | 16,000  | 20,477  | 2029/09/20 |
|     | 113 20年国債 | 2.1000     | 163,000 | 192,692 | 2029/09/20 |
|     | 114 20年国債 | 2.1000     | 140,000 | 165,442 | 2029/12/20 |
|     | 115 20年国債 | 2.2000     | 124,000 | 148,310 | 2029/12/20 |
|     | 2 30年国債   | 2.4000     | 24,000  | 29,368  | 2030/02/20 |
|     | 116 20年国債 | 2.2000     | 89,000  | 106,412 | 2030/03/20 |
|     | 117 20年国債 | 2.1000     | 195,000 | 230,168 | 2030/03/20 |
|     | 3 30年国債   | 2.3000     | 30,000  | 36,266  | 2030/05/20 |
|     | 118 20年国債 | 2.0000     | 59,000  | 68,788  | 2030/06/20 |
|     | 119 20年国債 | 1.8000     | 93,000  | 105,711 | 2030/06/20 |
|     | 120 20年国債 | 1.6000     | 133,000 | 147,302 | 2030/06/20 |
|     | 121 20年国債 | 1.9000     | 175,000 | 201,292 | 2030/09/20 |
|     | 122 20年国債 | 1.8000     | 95,000  | 107,869 | 2030/09/20 |
|     | 4 30年国債   | 2.9000     | 36,000  | 46,735  | 2030/11/20 |
|     | 123 20年国債 | 2.1000     | 140,000 | 165,060 | 2030/12/20 |
|     | 124 20年国債 | 2.0000     | 140,000 | 162,964 | 2030/12/20 |
|     | 125 20年国債 | 2.2000     | 85,000  | 101,494 | 2031/03/20 |
|     | 126 20年国債 | 2.0000     | 70,000  | 81,461  | 2031/03/20 |
|     | 127 20年国債 | 1.9000     | 111,000 | 127,496 | 2031/03/20 |
|     | 5 30年国債   | 2.2000     | 28,000  | 33,385  | 2031/05/20 |
|     | 128 20年国債 | 1.9000     | 119,000 | 136,529 | 2031/06/20 |
|     | 129 20年国債 | 1.8000     | 130,000 | 147,166 | 2031/06/20 |
|     | 130 20年国債 | 1.8000     | 110,000 | 124,353 | 2031/09/20 |
|     | 131 20年国債 | 1.7000     | 150,000 | 167,265 | 2031/09/20 |
|     | 6 30年国債   | 2.4000     | 24,000  | 29,363  | 2031/11/20 |
|     | 132 20年国債 | 1.7000     | 72,000  | 80,156  | 2031/12/20 |
|     | 133 20年国債 | 1.8000     | 194,000 | 218,994 | 2031/12/20 |
|     | 134 20年国債 | 1.8000     | 50,000  | 56,354  | 2032/03/20 |
|     | 135 20年国債 | 1.7000     | 92,000  | 102,247 | 2032/03/20 |
|     | 136 20年国債 | 1.6000     | 128,000 | 140,253 | 2032/03/20 |
|     | 7 30年国債   | 2.3000     | 55,000  | 66,317  | 2032/05/20 |

## 日本債券インデックスマザーファンド

| 当   |           | 期      |         | 未       |            |
|-----|-----------|--------|---------|---------|------------|
| 区 分 | 銘 柄       | 年 利 率  | 額 面 金 額 | 評 価 額   | 償 還 年 月 日  |
|     |           | %      | 千円      | 千円      |            |
|     | 137 20年国債 | 1.7000 | 85,000  | 94,303  | 2032/06/20 |
|     | 138 20年国債 | 1.5000 | 102,000 | 109,858 | 2032/06/20 |
|     | 139 20年国債 | 1.6000 | 85,000  | 92,958  | 2032/06/20 |
|     | 140 20年国債 | 1.7000 | 280,000 | 310,080 | 2032/09/20 |
|     | 8 30年国債   | 1.8000 | 27,000  | 30,336  | 2032/11/22 |
|     | 9 30年国債   | 1.4000 | 43,000  | 45,455  | 2032/12/20 |
|     | 141 20年国債 | 1.7000 | 170,000 | 187,904 | 2032/12/20 |
|     | 142 20年国債 | 1.8000 | 111,000 | 124,575 | 2032/12/20 |
|     | 10 30年国債  | 1.1000 | 45,000  | 45,206  | 2033/03/20 |
|     | 143 20年国債 | 1.6000 | 180,000 | 195,642 | 2033/03/20 |
|     | 144 20年国債 | 1.5000 | 113,000 | 120,987 | 2033/03/20 |
|     | 11 30年国債  | 1.7000 | 40,000  | 44,070  | 2033/06/20 |
|     | 145 20年国債 | 1.7000 | 278,000 | 306,286 | 2033/06/20 |
|     | 12 30年国債  | 2.1000 | 60,000  | 70,054  | 2033/09/20 |
|     | 146 20年国債 | 1.7000 | 250,000 | 274,862 | 2033/09/20 |
|     | 13 30年国債  | 2.0000 | 65,000  | 74,623  | 2033/12/20 |
|     | 147 20年国債 | 1.6000 | 255,000 | 275,292 | 2033/12/20 |
|     | 14 30年国債  | 2.4000 | 82,000  | 99,759  | 2034/03/20 |
|     | 148 20年国債 | 1.5000 | 276,000 | 292,405 | 2034/03/20 |
|     | 15 30年国債  | 2.5000 | 100,000 | 123,314 | 2034/06/20 |
|     | 149 20年国債 | 1.5000 | 270,000 | 285,535 | 2034/06/20 |
|     | 16 30年国債  | 2.5000 | 60,000  | 73,896  | 2034/09/20 |
|     | 150 20年国債 | 1.4000 | 270,000 | 279,981 | 2034/09/20 |
|     | 17 30年国債  | 2.4000 | 65,000  | 78,813  | 2034/12/20 |
|     | 18 30年国債  | 2.3000 | 80,000  | 95,529  | 2035/03/20 |
|     | 19 30年国債  | 2.3000 | 57,000  | 68,063  | 2035/06/20 |
|     | 20 30年国債  | 2.5000 | 60,000  | 73,842  | 2035/09/20 |
|     | 21 30年国債  | 2.3000 | 60,000  | 71,631  | 2035/12/20 |
|     | 22 30年国債  | 2.5000 | 70,000  | 86,163  | 2036/03/20 |
|     | 23 30年国債  | 2.5000 | 75,000  | 92,403  | 2036/06/20 |
|     | 24 30年国債  | 2.5000 | 57,000  | 70,288  | 2036/09/20 |
|     | 25 30年国債  | 2.3000 | 68,000  | 81,323  | 2036/12/20 |
|     | 26 30年国債  | 2.4000 | 135,000 | 164,214 | 2037/03/20 |
|     | 27 30年国債  | 2.5000 | 115,000 | 142,397 | 2037/09/20 |
|     | 28 30年国債  | 2.5000 | 136,000 | 168,799 | 2038/03/20 |
|     | 29 30年国債  | 2.4000 | 155,000 | 189,430 | 2038/09/20 |
|     | 30 30年国債  | 2.3000 | 165,000 | 198,392 | 2039/03/20 |
|     | 31 30年国債  | 2.2000 | 155,000 | 183,394 | 2039/09/20 |
|     | 32 30年国債  | 2.3000 | 180,000 | 217,153 | 2040/03/20 |
|     | 33 30年国債  | 2.0000 | 223,000 | 254,877 | 2040/09/20 |
|     | 34 30年国債  | 2.2000 | 191,000 | 226,906 | 2041/03/20 |
|     | 35 30年国債  | 2.0000 | 213,000 | 243,599 | 2041/09/20 |
|     | 36 30年国債  | 2.0000 | 210,000 | 240,097 | 2042/03/20 |
|     | 37 30年国債  | 1.9000 | 223,000 | 249,809 | 2042/09/20 |
|     | 38 30年国債  | 1.8000 | 140,000 | 153,525 | 2043/03/20 |
|     | 39 30年国債  | 1.9000 | 136,000 | 152,354 | 2043/06/20 |
|     | 40 30年国債  | 1.8000 | 119,000 | 130,509 | 2043/09/20 |
|     | 41 30年国債  | 1.7000 | 115,000 | 123,268 | 2043/12/20 |
|     | 42 30年国債  | 1.7000 | 135,000 | 144,614 | 2044/03/20 |
|     | 43 30年国債  | 1.7000 | 160,000 | 171,284 | 2044/06/20 |
|     | 44 30年国債  | 1.7000 | 138,000 | 147,635 | 2044/09/20 |
|     | 1 40年国債   | 2.4000 | 85,000  | 106,477 | 2048/03/20 |
|     | 2 40年国債   | 2.2000 | 116,000 | 139,111 | 2049/03/20 |
|     | 3 40年国債   | 2.2000 | 74,000  | 88,717  | 2050/03/20 |
|     | 4 40年国債   | 2.2000 | 82,000  | 98,378  | 2051/03/20 |
|     | 5 40年国債   | 2.0000 | 125,000 | 142,850 | 2052/03/20 |



| 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           |            |
| 6 40年国債      |       | 1. 9000 | 105, 000     | 116, 776     | 2053/03/20 |
| 7 40年国債      |       | 1. 7000 | 75, 000      | 78, 805      | 2054/03/20 |
| 種 別 小 計      | 銘 柄 数 | 264銘柄   |              |              |            |
|              | 金 額   |         | 38, 156, 000 | 41, 307, 987 |            |
| 地方債証券        |       |         |              |              |            |
| 17-2 広島県公債   |       | 1. 5000 | 100, 000     | 101, 669     | 2016/01/29 |
| 139 神奈川県公債   |       | 1. 9400 | 100, 000     | 102, 429     | 2016/03/18 |
| 17-7 静岡県公債   |       | 1. 7000 | 100, 000     | 102, 159     | 2016/03/28 |
| 635 東京都公債    |       | 2. 0000 | 100, 000     | 103, 016     | 2016/06/20 |
| 41 共同発行地方    |       | 2. 0000 | 100, 000     | 103, 355     | 2016/08/25 |
| 639 東京都公債    |       | 1. 8300 | 100, 000     | 103, 196     | 2016/09/20 |
| 19-2 大阪市公債   |       | 1. 8500 | 100, 000     | 104, 363     | 2017/05/10 |
| 51 共同発行地方    |       | 1. 9000 | 100, 000     | 104, 722     | 2017/06/23 |
| 651 東京都公債    |       | 1. 6200 | 100, 000     | 104, 402     | 2017/09/20 |
| 54 共同発行地方    |       | 1. 7000 | 100, 000     | 104, 631     | 2017/09/25 |
| 308 大阪府公債    |       | 1. 7300 | 112, 000     | 117, 513     | 2017/11/29 |
| 654 東京都公債    |       | 1. 5800 | 104, 000     | 108, 829     | 2017/12/20 |
| 19-8 福岡県公債   |       | 1. 6200 | 100, 000     | 104, 752     | 2017/12/20 |
| 57 共同発行地方    |       | 1. 6500 | 100, 000     | 104, 863     | 2017/12/25 |
| 61 共同発行地方    |       | 1. 5500 | 100, 000     | 105, 040     | 2018/04/25 |
| 20-6 愛知県公債   |       | 1. 7100 | 100, 000     | 106, 449     | 2018/11/28 |
| 665 東京都公債    |       | 1. 4300 | 100, 000     | 105, 431     | 2018/12/20 |
| 21-2 千葉県公債   |       | 1. 5700 | 100, 000     | 106, 497     | 2019/05/24 |
| 163 神奈川県公債   |       | 1. 4000 | 100, 000     | 105, 812     | 2019/06/20 |
| 21-3 埼玉県公債   |       | 1. 6400 | 100, 000     | 106, 910     | 2019/06/25 |
| 76 共同発行地方    |       | 1. 4000 | 50, 000      | 52, 954      | 2019/07/25 |
| 21-6 千葉県公債   |       | 1. 4100 | 100, 000     | 106, 143     | 2019/09/25 |
| 81 共同発行地方    |       | 1. 3200 | 100, 000     | 105, 958     | 2019/12/25 |
| 21-3 広島市公債   |       | 1. 3400 | 100, 000     | 106, 037     | 2019/12/25 |
| 21-5 京都市公債   |       | 1. 4500 | 100, 000     | 106, 807     | 2020/02/25 |
| 688 東京都公債    |       | 0. 9400 | 100, 000     | 104, 546     | 2020/09/18 |
| 90 共同発行地方    |       | 1. 1200 | 100, 000     | 105, 532     | 2020/09/25 |
| 22-1 岡山県公債   |       | 1. 0500 | 100, 000     | 105, 205     | 2020/11/30 |
| 23-2 島根県公債   |       | 1. 0300 | 100, 000     | 105, 450     | 2021/11/25 |
| 108 共同発行地方   |       | 1. 0100 | 100, 000     | 105, 366     | 2022/03/25 |
| 24-1 北海道公債   |       | 0. 9900 | 100, 000     | 104, 981     | 2022/04/27 |
| 24-5 札幌市公債   |       | 0. 8300 | 100, 000     | 104, 051     | 2022/06/20 |
| 361 大阪府公債    |       | 0. 9200 | 100, 000     | 104, 466     | 2022/06/28 |
| 24-6 北海道公債   |       | 0. 8400 | 100, 000     | 103, 852     | 2022/08/31 |
| 713 東京都公債    |       | 0. 7700 | 100, 000     | 103, 591     | 2022/09/20 |
| 24-5 京都府公債   |       | 0. 8200 | 100, 000     | 103, 940     | 2022/09/20 |
| 24-10 神戸市公債  |       | 0. 7960 | 100, 000     | 103, 694     | 2022/10/21 |
| 117 共同発行地方   |       | 0. 7200 | 100, 000     | 103, 093     | 2022/12/22 |
| 24-3 横浜市公債   |       | 0. 7290 | 100, 000     | 103, 172     | 2022/12/22 |
| 24-16 愛知県公債  |       | 0. 7570 | 100, 000     | 103, 371     | 2023/01/31 |
| 24-4 福井県公債   |       | 0. 4600 | 100, 000     | 100, 810     | 2023/04/26 |
| 126 共同発行地方   |       | 0. 8100 | 100, 000     | 103, 631     | 2023/09/25 |
| 131 共同発行地方   |       | 0. 6600 | 100, 000     | 102, 159     | 2024/02/23 |
| 種 別 小 計      | 銘 柄 数 | 43銘柄    |              |              |            |
|              | 金 額   |         | 4, 266, 000  | 4, 454, 870  |            |
| 特殊債券（除く金融債券） |       |         |              |              |            |
| 3 政保道路機構     |       | 1. 5000 | 100, 000     | 101, 688     | 2016/01/29 |
| 19 公営企業      |       | 2. 0200 | 100, 000     | 102, 547     | 2016/03/24 |
| 13 道路機構      |       | 1. 9600 | 100, 000     | 102, 887     | 2016/06/20 |
| 27 日本政策投資 B  |       | 1. 9800 | 100, 000     | 103, 435     | 2016/09/20 |

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  |
|         |              | %      | 千円        | 千円        |            |
|         | 15 道路機構      | 2.0500 | 100,000   | 103,525   | 2016/09/20 |
|         | 868 政保公営企業   | 1.8000 | 100,000   | 103,315   | 2016/10/21 |
|         | 24 公営企業      | 1.9400 | 100,000   | 103,814   | 2016/12/20 |
|         | 23 政保道路機構    | 1.7000 | 100,000   | 103,435   | 2016/12/28 |
|         | 27 政保道路機構    | 1.8000 | 100,000   | 103,945   | 2017/02/28 |
|         | 27 国際協力銀行    | 1.7700 | 100,000   | 103,885   | 2017/03/17 |
|         | 2 住宅支援機構     | 1.8000 | 100,000   | 103,934   | 2017/03/17 |
|         | 30 政保道路機構    | 1.7000 | 112,000   | 116,307   | 2017/03/28 |
|         | 33 政保道路機構    | 1.7000 | 100,000   | 103,975   | 2017/04/25 |
|         | 28 道路機構      | 1.7700 | 100,000   | 104,693   | 2017/09/20 |
|         | 4 政保首都高速     | 1.7000 | 100,000   | 104,664   | 2017/09/25 |
|         | 47 政保道路機構    | 1.5000 | 100,000   | 104,444   | 2017/12/27 |
|         | 32 道路機構      | 1.6100 | 100,000   | 104,961   | 2018/03/20 |
|         | 64 政保道路機構    | 1.6000 | 219,000   | 231,491   | 2018/08/29 |
|         | 5 中日本高速道路    | 1.8600 | 100,000   | 106,477   | 2018/09/20 |
|         | 66 政保道路機構    | 1.5000 | 100,000   | 105,434   | 2018/09/28 |
|         | 2 政保地方公営機    | 1.6000 | 100,000   | 106,016   | 2018/11/16 |
|         | 24 政保中日本道    | 1.3000 | 100,000   | 105,047   | 2019/01/22 |
|         | 61 道路機構      | 1.2400 | 100,000   | 105,707   | 2020/06/19 |
|         | 110 政保道路機構   | 1.3000 | 100,000   | 106,444   | 2020/06/30 |
|         | 3 公営企業15年    | 2.2000 | 100,000   | 112,964   | 2021/05/21 |
|         | 29 地方公共団体    | 1.0250 | 100,000   | 105,183   | 2021/10/28 |
|         | 81 道路機構      | 1.0300 | 100,000   | 105,048   | 2021/12/20 |
|         | 33 地方公共団体    | 1.0350 | 100,000   | 105,263   | 2022/02/28 |
|         | 25 日本政策金融    | 0.9970 | 100,000   | 104,987   | 2022/05/10 |
|         | 39政保地方公共団    | 0.8010 | 100,000   | 103,921   | 2022/08/15 |
|         | 173 政保道路機構   | 0.8190 | 100,000   | 104,042   | 2022/09/30 |
|         | 175 政保道路機構   | 0.7910 | 100,000   | 103,812   | 2022/10/31 |
|         | 25 政保日本政策    | 0.8150 | 100,000   | 103,945   | 2023/02/24 |
|         | 19 政保政策投資 C  | 0.6680 | 100,000   | 102,742   | 2023/03/15 |
|         | 186 政保道路機構   | 0.6680 | 100,000   | 102,744   | 2023/03/17 |
|         | 48 地方公共団体    | 0.8130 | 100,000   | 103,490   | 2023/05/26 |
|         | 190 政保道路機構   | 0.6050 | 100,000   | 102,136   | 2023/05/31 |
|         | 51 地方公共団体    | 0.8410 | 100,000   | 103,659   | 2023/08/28 |
|         | 86 政保道路機構    | 2.0000 | 100,000   | 116,202   | 2029/07/31 |
| 種 別 小 計 | 銘 柄 数        | 39銘柄   |           |           |            |
|         | 金 額          |        | 4,031,000 | 4,222,224 |            |
| 金融債券    | 257 信金中金     | 0.7000 | 100,000   | 100,829   | 2016/04/27 |
|         | い736 利付商工債   | 0.4500 | 100,000   | 100,579   | 2016/09/27 |
|         | い736 利付農林債   | 0.5000 | 100,000   | 100,628   | 2016/09/27 |
|         | い742 利付商工債   | 0.4000 | 100,000   | 100,607   | 2017/03/27 |
|         | 272 信金中金     | 0.3000 | 100,000   | 100,515   | 2017/07/27 |
|         | い749 利付農林債   | 0.3000 | 100,000   | 100,384   | 2017/10/27 |
| 種 別 小 計 | 銘 柄 数        | 6銘柄    |           |           |            |
|         | 金 額          |        | 600,000   | 603,545   |            |
| 普通社債券   | 474 中部電力     | 1.6900 | 100,000   | 102,000   | 2016/03/25 |
|         | 99 三菱地所      | 0.5530 | 100,000   | 100,709   | 2016/06/14 |
|         | 16 電源開発      | 1.9900 | 100,000   | 102,808   | 2016/06/20 |
|         | 15 ダイキン工業    | 1.4200 | 100,000   | 102,152   | 2016/07/29 |
|         | 1 明治安田2011基  | 1.0500 | 100,000   | 101,256   | 2016/08/05 |
|         | 8 ウェストバツク BK | 1.0000 | 100,000   | 101,326   | 2016/08/12 |
|         | 23 丸井グループ    | 0.3420 | 100,000   | 100,290   | 2016/08/15 |
|         | 1フコク生命2011基金 | 0.9900 | 100,000   | 101,127   | 2016/09/12 |

| 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         |            |
|         | 306 中国電力        | 3.6000 | 100,000    | 106,513    | 2016/10/25 |
|         | 15 三菱 UFJ リース   | 0.6600 | 100,000    | 101,086    | 2016/12/14 |
|         | 28 東海旅客鉄道       | 1.8800 | 100,000    | 103,696    | 2016/12/20 |
|         | 22 大阪瓦斯         | 1.7900 | 100,000    | 103,467    | 2016/12/20 |
|         | 26 GE キヤピタル     | 0.3130 | 100,000    | 100,168    | 2017/02/13 |
|         | 148 オリックス       | 1.2600 | 100,000    | 102,369    | 2017/02/24 |
|         | 440 関西電力        | 1.5200 | 100,000    | 102,649    | 2017/02/24 |
|         | 29 みずほコーポレート    | 0.4600 | 100,000    | 100,686    | 2017/04/21 |
|         | 52 日産自動車        | 1.1700 | 100,000    | 102,481    | 2017/04/28 |
|         | 6 日本リテールファンド    | 2.1700 | 100,000    | 104,772    | 2017/05/23 |
|         | 19 ホンダファイナンス    | 0.3720 | 100,000    | 100,666    | 2017/06/20 |
|         | 81 住友不動産        | 0.5000 | 100,000    | 100,745    | 2017/09/11 |
|         | 10 首都高速道路       | 0.3360 | 100,000    | 100,634    | 2017/09/20 |
|         | 261 北海道電力       | 2.7750 | 6,000      | 6,440      | 2017/11/24 |
|         | 1 富士フイルムホールデイ   | 0.3300 | 100,000    | 100,605    | 2017/12/04 |
|         | 21 NTT データ      | 1.6000 | 100,000    | 104,890    | 2018/03/20 |
|         | 15 NTT ドコモ      | 1.9600 | 100,000    | 106,498    | 2018/06/20 |
|         | 1 明治安田2013基     | 0.8200 | 100,000    | 101,559    | 2018/08/08 |
|         | 9 ジャパンリアルエステイト  | 0.4970 | 100,000    | 100,995    | 2018/08/30 |
|         | 472 関西電力        | 1.7900 | 100,000    | 105,550    | 2018/11/22 |
|         | 18 西日本旅客鉄       | 1.7000 | 100,000    | 106,277    | 2018/12/11 |
|         | 4 りそな銀行劣後       | 2.7660 | 100,000    | 111,030    | 2019/06/20 |
|         | 46 NTT ファイナンス   | 0.2500 | 100,000    | 100,171    | 2019/06/20 |
|         | 14 武田薬品         | 0.5400 | 100,000    | 101,506    | 2019/07/19 |
|         | 20 三井住友 BK 劣    | 2.2100 | 100,000    | 108,866    | 2019/07/24 |
|         | 164 オリックス       | 1.1460 | 100,000    | 103,909    | 2019/08/07 |
|         | 24 太平洋セメント      | 0.3900 | 100,000    | 100,213    | 2019/09/11 |
|         | 423 九州電力        | 0.9590 | 100,000    | 102,949    | 2019/09/25 |
|         | 62東日本旅客鉄道       | 1.4240 | 100,000    | 105,952    | 2019/09/27 |
|         | 8ドイツ銀行 AG ロンドン  | 0.4700 | 100,000    | 100,145    | 2019/11/14 |
|         | 59 東芝           | 0.5670 | 100,000    | 101,122    | 2019/12/11 |
|         | 260 北陸電力        | 2.3300 | 100,000    | 110,874    | 2020/05/25 |
|         | 20 東京三菱銀行       | 2.5700 | 100,000    | 113,125    | 2020/07/27 |
|         | 15 トヨタファイナンス    | 1.8000 | 100,000    | 108,956    | 2020/08/21 |
|         | 17 シテイグループ・インク  | 2.0400 | 100,000    | 107,632    | 2020/09/16 |
|         | 72東日本旅客鉄道       | 1.2800 | 100,000    | 106,356    | 2020/12/22 |
|         | 9三菱 UFJ 信託 BK 劣 | 1.6800 | 100,000    | 108,128    | 2021/04/28 |
|         | 11三菱 UFJ 信託 BK  | 1.3600 | 100,000    | 106,404    | 2022/06/27 |
|         | 4 JX ホールディングス   | 1.1450 | 100,000    | 105,145    | 2022/12/14 |
|         | 30 大阪瓦斯         | 0.7590 | 100,000    | 103,019    | 2022/12/14 |
|         | 1 三菱 UFJFG 劣後   | 0.9400 | 100,000    | 101,928    | 2024/06/26 |
| 種 別 小 計 | 銘 柄 数           | 49銘柄   |            |            |            |
|         | 金 額             |        | 4,806,000  | 4,981,866  |            |
| 合 計     | 銘 柄 数           | 401銘柄  |            |            |            |
|         | 金 額             |        | 51,859,000 | 55,570,494 |            |

(注) 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

■投資信託財産の構成

2014年12月 1 日現在

| 項 目                | 当 期 末      |       |
|--------------------|------------|-------|
|                    | 評 価 額      | 比 率   |
|                    | 千円         | %     |
| 公 社 債              | 55,570,494 | 96.9  |
| コー ル ・ ロ ー ン 等、その他 | 1,793,035  | 3.1   |
| 投 資 信 託 財 産 総 額    | 57,363,530 | 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

2014年12月 1 日現在

| 項 目                     | 当 期 末           |
|-------------------------|-----------------|
| (A)資 産                  | 57,363,530,434円 |
| コ ー ル ・ ロ ー ン 等         | 282,577,606     |
| 公 社 債 (評価額)             | 55,570,494,671  |
| 未 収 入 金                 | 1,311,659,240   |
| 未 収 利 息                 | 194,741,505     |
| 前 払 費 用                 | 4,057,412       |
| (B)負 債                  | 1,412,444,424   |
| 未 払 金                   | 1,411,132,120   |
| 未 払 解 約 金               | 1,312,304       |
| (C)純 資 産 総 額 (A－B)      | 55,951,086,010  |
| 元 本                     | 42,232,877,887  |
| 次 期 繰 越 損 益 金           | 13,718,208,123  |
| (D)受 益 権 総 口 数          | 42,232,877,887口 |
| 1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C／D) | 13,248円         |

\*期首における元本額は42,573,047,799円、当期中における追加設定元本額は1,969,786,496円、同解約元本額は2,309,956,408円です。

\*当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募）382,037,783円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募）2,620,201,706円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募）293,365,466円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募）3,710,996,850円、D－I's 日本債券インデックス772,826円、DCダイワ日本債券インデックス3,672,713,156円、ダイワ・バランスファンド35VA20,764,426,177円、ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）3,183,424,694円、ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用）532,713,021円、ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用）513,994,155円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券204,060,513円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス5,546,060,674円、ダイワライフスタイル25 359,343,128円、ダイワライフスタイル50 353,171,587円、ダイワライフスタイル75 95,596,151円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は13,248円です。

■損益の状況

当期 自2013年12月 3 日 至2014年12月 1 日

| 項 目                | 当 期            |
|--------------------|----------------|
| (A)配 当 等 収 益       | 695,419,062円   |
| 受 取 利 息            | 695,419,062    |
| (B)有価証券売買損益        | 790,637,587    |
| 売 買 益 損            | 950,910,330    |
| 売 買 損              | △ 160,272,743  |
| (C)当 期 損 益 金 (A＋B) | 1,486,056,649  |
| (D)前期繰越損益金         | 12,334,137,377 |
| (E)解 約 差 損 益 金     | △ 698,822,592  |
| (F)追加信託差損益金        | 596,836,689    |
| (G)合 計 (C＋D＋E＋F)   | 13,718,208,123 |
| 次期繰越損益金 (G)        | 13,718,208,123 |

(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。