Ｄ－Ｉ's　日本債券インデックス

運用報告書（全体版）
第３期
（決算日　2016年11月30日）

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／債券／インデックス型	
信託期間	約15年間（2013年12月９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（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
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（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。	
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。	

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。

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、「Ｄ－Ｉ's　日本債券インデックス」は、このたび、第３期の決算を行ないました。

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/

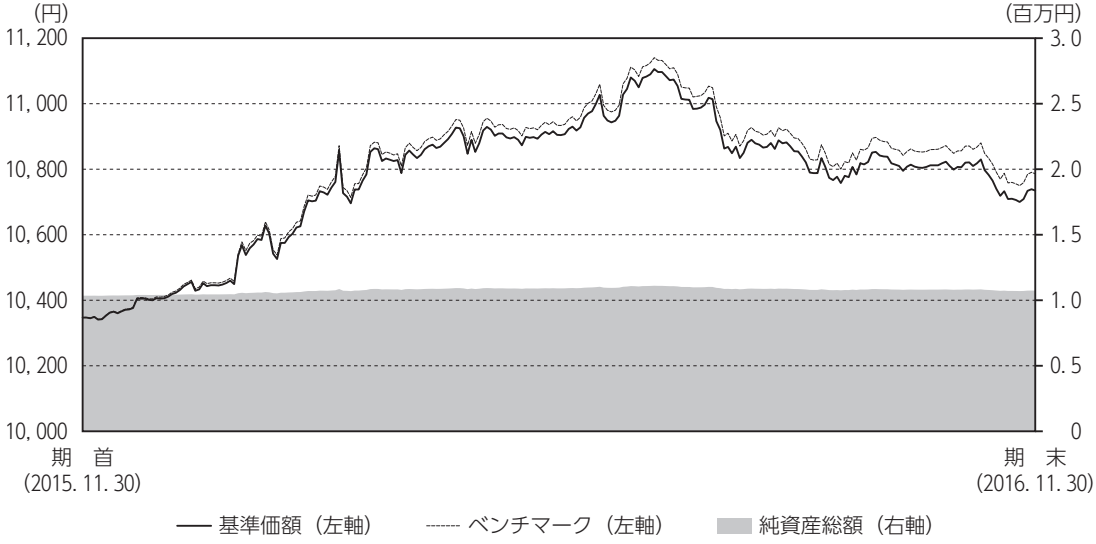
設定以来の運用実績

決　算　期	基　準　価　額			ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数		公社債組入比率	債　券先物比率	純資産総　額
		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
1期末(2014年12月1日)	10,248	0	2.5	496.247	3.0	99.2	—	1
2期末(2015年11月30日)	10,347	0	1.0	503.440	1.4	98.3	—	1
3期末(2016年11月30日)	10,735	0	3.7	524.807	4.2	98.5	—	1

(注1) ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。
(注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。

《運用経過》

基準価額等の推移について



（注）ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

＊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：10, 347円
期　末：10, 735円
騰落率：3. 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ことにより、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

D－I's　日本債券インデックス

年　月　日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2015年11月30日	10,347	—	503.440	—	98.3	—
12月末	10,406	0.6	506.583	0.6	99.3	—
2016年1月末	10,536	1.8	512.896	1.9	98.4	—
2月末	10,704	3.5	521.658	3.6	98.6	—
3月末	10,788	4.3	525.949	4.5	99.2	—
4月末	10,879	5.1	530.628	5.4	99.0	—
5月末	10,916	5.5	532.551	5.8	98.8	—
6月末	11,050	6.8	539.272	7.1	98.9	—
7月末	10,947	5.8	534.760	6.2	99.3	—
8月末	10,839	4.8	529.357	5.1	99.1	—
9月末	10,842	4.8	529.782	5.2	99.5	—
10月末	10,807	4.4	528.193	4.9	99.3	—
(期末)2016年11月30日	10,735	3.7	524.807	4.2	98.5	—

（注）騰落率は期首比。

投資環境について

○国内債券市況

国内長期金利は、2016年１月下旬に日銀がマイナス金利政策を導入したことを受け、２月にかけて大きく低下しました。その後、市場の追加金融緩和観測が根強かったことや、英国の国民投票でＥＵ（欧州連合）離脱派が勝利し金融市場全般にリスク回避の動きが広がったことから、長期金利は一段と低下しました。７月末には、日銀はＥＴＦ（上場投資信託）の買い入れの増額を主体とする金融緩和の強化を実施した上で、次回会合で経済・物価動向や政策効果について総括的な検証を行なうことを発表しました。しかし、金融緩和の強化が市場の期待を下回る規模であったほか、総括的な検証が日銀の金融緩和姿勢の後退につながる恐れがあるとの警戒感も高まったことから、国内長期金利は８月上旬にかけて急上昇した後、横ばいから上昇基調で推移しました。また11月には、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことで、今後の財政拡大などが意識された米国国債安に連れて、国内長期金利は一段と上昇しました。

前期における「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（ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）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（ダイワ・ボンド・インデックス（ＤＢＩ）総合指数）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（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、ファンドの資金流出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。

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。

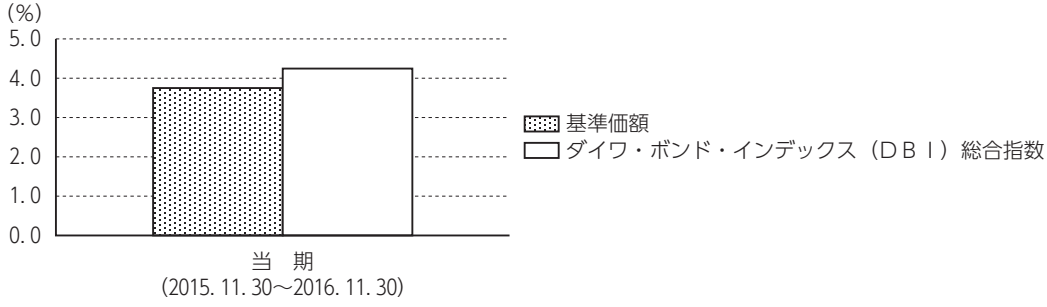
○日本債券インデックスマザーファンド

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、ファンドの資金流出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異は△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が△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が△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。

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 2015年12月1日 ～2016年11月30日
当期分配金（税込み）		(円)	—
	対基準価額比率	(%)	—
	当期の収益	(円)	—
	当期の収益以外	(円)	—
翌期繰越分配対象額		(円)	735

（注1）「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。
（注2）円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。
（注3）当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

《今後の運用方針》

○当ファンド

「日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券を中心に組み入れ、ベンチマークに連動することをめざした運用を行ないます。

○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、ファンドの資金流出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 (2015.12.1～2016.11.30)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信託報酬	47円	0.432%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 **期中の平均基準価額は10,772円です。**
（投信会社）	(22)	(0.200)	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
（販売会社）	(22)	(0.200)	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
（受託銀行）	(3)	(0.032)	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 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 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	4	0.034	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
（監査費用）	(4)	(0.034)	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	50	0.466	

（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、このファンドが組み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

（2015年12月１日から2016年11月30日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	—	—	3	5

（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

（2015年12月１日から2016年11月30日まで）

決算期	当期					
区分	買付額等A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	売付額等C	うち利害関係人との取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	10,036	686	6.8	13,522	1,749	12.9
コール・ローン	51,668	—	—	—	—	—

（注）平均保有割合0.0%
※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)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

期首保有額	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

（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	期首	当期末	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
日本債券インデックスマザーファンド	769	765	1,072

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
日本債券インデックスマザーファンド	1,072	99.7
コール・ローン等、その他	3	0.3
投資信託財産総額	1,075	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

2016年11月30日現在

項　　目	当　期　末
(A)資産	**1,075,926円**
コール・ローン等	3,310
日本債券インデックス マザーファンド（評価額）	1,072,616
(B)負債	**2,406**
未払信託報酬	2,223
その他未払費用	183
(C)純資産総額（A－B）	**1,073,520**
元本	1,000,000
次期繰越損益金	73,520
(D)受益権総口数	**1,000,000口**
1万口当り基準価額（C／D）	**10,735円**

＊期首における元本額は1,000,000円、当期中における追加設定元本額は０円、同解約元本額は０円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,735円です。

■損益の状況

当期　自2015年12月１日　至2016年11月30日

項　　目	当　　期
(A)有価証券売買損益	**43,628円**
売買益	43,628
(B)信託報酬等	△ **4,785**
(C)当期損益金（A＋B）	**38,843**
(D)前期繰越損益金	**34,677**
(E)合計（C＋D）	**73,520**
次期繰越損益金（E）	**73,520**
分配準備積立金	73,520

（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）収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■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	38,843
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	34,677
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	73,520
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	73,520
(h) 受益権総口数	1,000,000口

当ファンドは少額投資非課税制度「ＮＩＳＡ（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアＮＩＳＡ」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。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書　第17期　（決算日　2016年11月30日）

（計算期間　2015年12月１日～2016年11月30日）

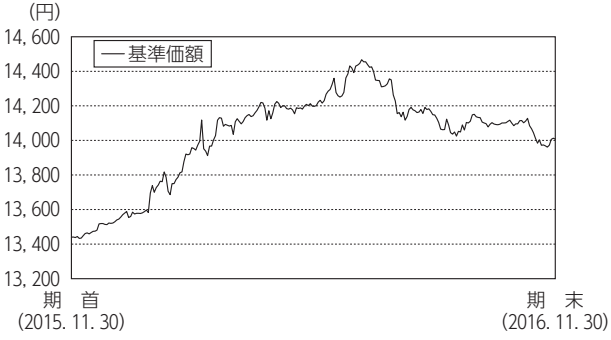
日本債券インデックスマザーファンドの第17期にかかる運用状況をご報告申し上げます。

★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(DBI)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		
	円	%		%	%	%
(期首)2015年11月30日	13,440	—	503.440	—	98.3	—
12月末	13,522	0.6	506.583	0.6	99.3	—
2016年1月末	13,696	1.9	512.896	1.9	98.5	—
2月末	13,921	3.6	521.658	3.6	98.6	—
3月末	14,035	4.4	525.949	4.5	99.2	—
4月末	14,159	5.3	530.628	5.4	99.0	—
5月末	14,213	5.8	532.551	5.8	98.9	—
6月末	14,392	7.1	539.272	7.1	99.1	—
7月末	14,263	6.1	534.760	6.2	99.4	—
8月末	14,128	5.1	529.357	5.1	99.2	—
9月末	14,137	5.2	529.782	5.2	99.5	—
10月末	14,096	4.9	528.193	4.9	99.3	—
(期末)2016年11月30日	14,008	4.2	524.807	4.2	98.5	—

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。
(注3) 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：13,440円　期末：14,008円　騰落率：4.2%
【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ことにより、基準価額は上昇しました。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
国内長期金利は、2016年1月下旬に日銀がマイナス金利政策を導入したことを受け、2月にかけて大きく低下しました。その後、市場の追加金融緩和観測が根強かったことや、英国の国民投票でEU(欧州連合)離脱派が勝利し、金融市場全般にリスク回避の動きが広がったことから、長期金利は一段と低下しました。7月末には、日銀はETF(上場投資信託)の買い入れの増額を主体とする金融緩和の強化を実施した上で、次回会合で経済・物価動向や政策効果について総括的な検証を行なうことを発表しました。しかし、金融緩和の強化が市場の期待を下回る規模であったほか、総括的な検証が日銀の金融緩和姿勢の後退につながる恐れがあるとの警戒感も高まったことから、国内長期金利は8月上旬にかけて急上昇した後、横ばいから上昇基調で推移しました。また11月には、米国の大統領選挙でトランプ氏が勝利したことで、今後の財政拡大などが意識された米国国債安に連れて、国内長期金利は一段と上昇しました。

◆前期における「今後の運用方針」
今後も、ベンチマーク(ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数)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(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、ファンドの資金流出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。

◆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、ファンドの資金流出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異は0.0%で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッドの変動に対する感応度を適切にコントロールしたことから、目立った超過損益は発生しませんでした。

《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、ファンドの資金流出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前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

■売買および取引の状況
公社債

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国内	国債証券	9,697,823	10,014,892 (—)
	地方債証券	120,813	831,101 (—)
	特殊債券	217,572	1,459,235 (—)
	社債券	—	1,217,684 (—)

(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

(2015年12月1日から2016年11月30日まで)

当期 買付 銘柄	金額	当期 売付 銘柄	金額
	千円		千円
342 10年国債 0.1% 2026/3/20	513,071	353 2年国債 0.1% 2017/6/15	401,609
368 2年国債 0.1% 2018/9/15	513,021	355 2年国債 0.1% 2017/8/15	361,518
343 10年国債 0.1% 2026/6/20	511,435	105 5年国債 0.2% 2017/6/20	301,555
125 5年国債 0.1% 2020/9/20	507,182	338 10年国債 0.4% 2025/3/20	277,905
127 5年国債 0.1% 2021/3/20	506,821	123 5年国債 0.1% 2020/3/20	272,960
366 2年国債 0.1% 2018/7/15	502,885	288 10年国債 1.7% 2017/9/20	259,387
341 10年国債 0.3% 2025/12/20	492,659	104 5年国債 0.2% 2017/3/20	254,763
128 5年国債 0.1% 2021/6/20	426,368	349 2年国債 0.1% 2017/2/15	250,337
126 5年国債 0.1% 2020/12/20	395,355	106 5年国債 0.2% 2017/9/20	241,381
340 10年国債 0.4% 2025/9/20	385,220	335 10年国債 0.5% 2024/9/20	230,826

(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BB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	36,119,000	40,657,453	78.3	—	52.4	18.5	7.4
地方債証券	3,650,000	3,811,406	7.3	—	3.4	3.1	0.8
特殊債券（除く金融債券）	3,019,000	3,171,646	6.1	—	3.7	1.2	1.2
金融債券	200,000	200,916	0.4	—	—	—	0.4
普通社債券	3,200,000	3,308,223	6.4	—	1.6	3.8	1.0
合計	46,188,000	51,149,645	98.5	—	61.2	26.6	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
		%	千円	千円	
国債証券	107 5年国債	0.2000	190,000	190,908	2017/12/20
	108 5年国債	0.1000	115,000	115,423	2017/12/20
	289 10年国債	1.5000	48,000	48,880	2017/12/20
	360 2年国債	0.1000	130,000	130,503	2018/01/15
	362 2年国債	0.1000	40,000	40,162	2018/03/15
	109 5年国債	0.1000	50,000	50,211	2018/03/20
	110 5年国債	0.3000	80,000	80,545	2018/03/20
	111 5年国債	0.4000	120,000	120,974	2018/03/20
	290 10年国債	1.4000	132,000	134,769	2018/03/20
	291 10年国債	1.3000	109,000	111,145	2018/03/20
	292 10年国債	1.7000	155,000	158,856	2018/03/20
	38利付国債20年	2.7000	60,000	62,276	2018/03/20
	39 20年国債	2.6000	90,000	93,297	2018/03/20
	363 2年国債	0.1000	70,000	70,297	2018/04/15
	364 2年国債	0.1000	85,000	85,370	2018/05/15
	365 2年国債	0.1000	95,000	95,416	2018/06/15
	112 5年国債	0.4000	150,000	151,384	2018/06/20
	113 5年国債	0.3000	130,000	130,998	2018/06/20
	293 10年国債	1.8000	238,000	245,351	2018/06/20
	294 10年国債	1.7000	147,000	151,312	2018/06/20
	295 10年国債	1.5000	175,000	179,576	2018/06/20
	366 2年国債	0.1000	440,000	441,993	2018/07/15
	367 2年国債	0.1000	60,000	60,286	2018/08/15
	368 2年国債	0.1000	510,000	512,555	2018/09/15
	114 5年国債	0.3000	140,000	141,239	2018/09/20
	115 5年国債	0.2000	145,000	146,007	2018/09/20
	296 10年国債	1.5000	25,000	25,758	2018/09/20
	40 20年国債	2.3000	57,000	59,557	2018/09/20
	116 5年国債	0.2000	498,000	501,839	2018/12/20
	297 10年国債	1.4000	70,000	72,259	2018/12/20

区分	銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
		%	千円	千円	
	298 10年国債	1.3000	125,000	128,778	2018/12/20
	117 5年国債	0.2000	400,000	403,408	2019/03/20
	299 10年国債	1.3000	250,000	258,410	2019/03/20
	300 10年国債	1.5000	286,000	296,939	2019/03/20
	41 20年国債	1.5000	136,000	141,234	2019/03/20
	42 20年国債	2.6000	87,000	92,554	2019/03/20
	118 5年国債	0.2000	140,000	141,306	2019/06/20
	119 5年国債	0.1000	330,000	332,237	2019/06/20
	301 10年国債	1.5000	120,000	125,095	2019/06/20
	120 5年国債	0.2000	180,000	181,796	2019/09/20
	121 5年国債	0.1000	50,000	50,358	2019/09/20
	303 10年国債	1.4000	10,000	10,435	2019/09/20
	304 10年国債	1.3000	60,000	62,446	2019/09/20
	43 20年国債	2.9000	100,000	108,591	2019/09/20
	122 5年国債	0.1000	340,000	342,550	2019/12/20
	305 10年国債	1.3000	470,000	490,722	2019/12/20
	123 5年国債	0.1000	300,000	302,331	2020/03/20
	306 10年国債	1.4000	255,000	267,956	2020/03/20
	307 10年国債	1.3000	240,000	251,400	2020/03/20
	44 20年国債	2.5000	85,000	92,399	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	84,531	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	340,000	342,723	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	150,000	157,617	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	93,928	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	79,043	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	400,000	403,356	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	30,000	31,276	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	30,000	31,047	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	96,869	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	360,000	363,146	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	416,045	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	59,736	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	500,000	504,530	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	180,000	190,953	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	273,577	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	70,097	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	116,269	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	420,000	423,931	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	234,125	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	55,000	58,015	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	89,831	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	330,000	333,260	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	226,330	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	210,560	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	57,506	2021/09/21
	319 10年国債	1.1000	100,000	106,063	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	120,000	126,666	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	73,368	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	72,586	2021/12/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	185,150	2022/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区分	銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
		%	千円	千円	
	322 10年国債	0.9000	50,000	52,634	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	155,535	2022/03/21
	325 10年国債	0.8000	170,000	178,768	2022/09/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	49,899	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,906	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	100,000	104,302	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	106,901	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	160,000	169,211	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	100,469	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	145,991	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	262,000	277,573	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	100,000	104,577	2023/09/20
	64 20年国債	1.9000	90,000	102,078	2023/09/20
	332 10年国債	0.6000	220,000	230,278	2023/12/20
	65 20年国債	1.9000	85,000	96,793	2023/12/20
	66 20年国債	1.8000	135,000	152,775	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	265,000	277,611	2024/03/20
	67 20年国債	1.9000	55,000	62,830	2024/03/20
	68 20年国債	2.2000	120,000	139,719	2024/03/20
	69 20年国債	2.1000	110,000	127,271	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	320,000	335,504	2024/06/20
	70 20年国債	2.4000	83,000	98,331	2024/06/20
	71 20年国債	2.2000	125,000	146,197	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	470,000	489,664	2024/09/20
	72 20年国債	2.1000	175,000	204,221	2024/09/20
	336 10年国債	0.5000	175,000	182,483	2024/12/20
	337 10年国債	0.3000	145,000	148,859	2024/12/20
	73 20年国債	2.0000	120,000	139,654	2024/12/20
	74 20年国債	2.1000	73,000	85,545	2024/12/20
	338 10年国債	0.4000	200,000	207,066	2025/03/20
	75 20年国債	2.1000	80,000	94,092	2025/03/20
	76 20年国債	1.9000	51,000	59,136	2025/03/20
	77 20年国債	2.0000	130,000	151,884	2025/03/20
	339 10年国債	0.4000	390,000	403,848	2025/06/20
	78 20年国債	1.9000	61,000	71,028	2025/06/20
	79 20年国債	2.0000	50,000	58,648	2025/06/20
	80 20年国債	2.1000	53,000	62,620	2025/06/20
	340 10年国債	0.4000	510,000	528,416	2025/09/20
	81 20年国債	2.0000	76,000	89,493	2025/09/20
	82 20年国債	2.1000	87,000	103,213	2025/09/20
	341 10年国債	0.3000	460,000	472,700	2025/12/20
	83 20年国債	2.1000	93,000	110,773	2025/12/20
	84 20年国債	2.0000	100,000	118,205	2025/12/20
	342 10年国債	0.1000	503,000	507,672	2026/03/20
	85 20年国債	2.1000	58,000	69,354	2026/03/20
	86 20年国債	2.3000	80,000	97,148	2026/03/20
	87 20年国債	2.2000	55,000	66,278	2026/03/20
	343 10年国債	0.1000	500,000	504,530	2026/06/20
	88 20年国債	2.3000	100,000	121,902	2026/06/20
	89 20年国債	2.2000	78,000	94,338	2026/06/20

区分	銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
		%	千円	千円	
	344 10年国債	0.1000	360,000	362,991	2026/09/20
	90 20年国債	2.2000	120,000	145,657	2026/09/20
	91 20年国債	2.3000	60,000	73,416	2026/09/20
	92 20年国債	2.1000	180,000	217,440	2026/12/20
	93 20年国債	2.0000	100,000	120,220	2027/03/20
	94 20年国債	2.1000	65,000	78,809	2027/03/20
	95 20年国債	2.3000	3,000	3,712	2027/06/20
	96 20年国債	2.1000	100,000	121,637	2027/06/20
	97 20年国債	2.2000	81,000	99,760	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	90,000	109,877	2027/09/20
	99 20年国債	2.1000	170,000	208,180	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	142,000	176,094	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	35,000	44,188	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	101,352	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	87,881	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	40,000	49,301	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	155,843	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	67,000	83,652	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	107,000	132,794	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	127,000	154,584	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	90,000	109,809	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	90,000	111,999	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	100,000	126,102	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	125,000	156,077	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	21,432	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	125,000	156,496	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	163,174	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	110,000	139,485	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	31,120	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	89,000	113,151	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	140,000	176,162	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	38,639	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	15,000	18,721	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	113,601	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	146,000	174,456	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	135,000	167,053	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	110,000	134,629	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	49,611	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	177,562	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	93,000	116,672	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	109,234	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	70,000	88,001	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	90,000	111,886	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	36,048	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	148,226	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	95,000	116,983	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	110,000	135,688	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	100,000	121,912	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	31,765	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	72,000	87,906	2031/12/20

日本債券インデックスマザーファンド

区分	当期末 銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
	133 20年国債	1.8000	175,000	216,221	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	50,000	61,873	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	112,481	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	80,000	96,622	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	72,323	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	85,000	104,068	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	87,000	103,897	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	55,000	66,510	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	230,000	281,975	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	33,556	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	50,786	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	140,000	171,719	2032/12/20
	142 20年国債	1.8000	90,000	111,783	2032/12/20
	10 30年国債	1.1000	45,000	50,989	2033/03/20
	143 20年国債	1.6000	180,000	218,219	2033/03/20
	144 20年国債	1.5000	55,000	65,816	2033/03/20
	11 30年国債	1.7000	40,000	49,216	2033/06/20
	145 20年国債	1.7000	215,000	264,327	2033/06/20
	12 30年国債	2.1000	60,000	77,770	2033/09/20
	146 20年国債	1.7000	204,000	250,881	2033/09/20
	13 30年国債	2.0000	75,000	96,147	2033/12/20
	147 20年国債	1.6000	95,000	115,311	2033/12/20
	14 30年国債	2.4000	82,000	110,677	2034/03/20
	148 20年国債	1.5000	207,000	247,843	2034/03/20
	15 30年国債	2.5000	100,000	136,903	2034/06/20
	149 20年国債	1.5000	208,000	248,986	2034/06/20
	16 30年国債	2.5000	60,000	82,235	2034/09/20
	150 20年国債	1.4000	225,000	265,698	2034/09/20
	17 30年国債	2.4000	80,000	108,486	2034/12/20
	151 20年国債	1.2000	190,000	217,785	2034/12/20
	18 30年国債	2.3000	80,000	107,284	2035/03/20
	152 20年国債	1.2000	215,000	246,211	2035/03/20
	19 30年国債	2.3000	57,000	76,492	2035/06/20
	153 20年国債	1.3000	225,000	261,771	2035/06/20
	20 30年国債	2.5000	60,000	82,827	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	220,000	251,873	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	60,000	80,749	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	228,000	252,660	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	70,000	96,940	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	243,000	241,916	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	60,000	83,145	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	218,000	208,394	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	127,797	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	115,000	116,150	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	60,000	81,159	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	110,000	151,155	2037/03/20
	27 30年国債	2.5000	100,000	140,056	2037/09/20
	28 30年国債	2.5000	117,000	164,569	2038/03/20
	29 30年国債	2.4000	135,000	188,007	2038/09/20
	30 30年国債	2.3000	137,000	188,929	2039/03/20

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	
		31 30年国債	2.2000	130,000	177,409	2039/09/20
		32 30年国債	2.3000	155,000	215,916	2040/03/20
		33 30年国債	2.0000	185,000	246,379	2040/09/20
		34 30年国債	2.2000	158,000	218,556	2041/03/20
		35 30年国債	2.0000	195,000	261,847	2041/09/20
		36 30年国債	2.0000	181,000	244,159	2042/03/20
		37 30年国債	1.9000	201,000	267,137	2042/09/20
		38 30年国債	1.8000	119,000	155,857	2043/03/20
		39 30年国債	1.9000	116,000	154,969	2043/06/20
		40 30年国債	1.8000	103,000	135,283	2043/09/20
		41 30年国債	1.7000	113,000	145,829	2043/12/20
		42 30年国債	1.7000	111,000	143,508	2044/03/20
		43 30年国債	1.7000	124,000	160,611	2044/06/20
		44 30年国債	1.7000	120,000	155,715	2044/09/20
		45 30年国債	1.5000	125,000	155,940	2044/12/20
		46 30年国債	1.5000	152,000	189,677	2045/03/20
		47 30年国債	1.6000	147,000	187,629	2045/06/20
		48 30年国債	1.4000	162,000	198,454	2045/09/20
		49 30年国債	1.4000	139,000	170,515	2045/12/20
		50 30年国債	0.8000	150,000	159,864	2046/03/20
		51 30年国債	0.3000	145,000	134,758	2046/06/20
		52 30年国債	0.5000	111,000	109,019	2046/09/20
		1 40年国債	2.4000	85,000	129,228	2048/03/20
		2 40年国債	2.2000	116,000	171,069	2049/03/20
		3 40年国債	2.2000	74,000	110,064	2050/03/20
		4 40年国債	2.2000	82,000	122,809	2051/03/20
		5 40年国債	2.0000	125,000	180,440	2052/03/20
		6 40年国債	1.9000	105,000	149,014	2053/03/20
		7 40年国債	1.7000	121,000	164,316	2054/03/20
		8 40年国債	1.4000	21,000	26,478	2055/03/20
		9 40年国債	0.4000	102,000	93,578	2056/03/20
種別小計	銘柄数	261銘柄				
	金額			36,119,000	40,657,453	
地方債証券		61 共同発行地方	1.5500	100,000	102,206	2018/04/25
		660 東京都公債	1.5800	100,000	102,499	2018/06/20
		25-3 京都市5年	0.3120	100,000	100,637	2018/09/27
		20-6 愛知県公債	1.7100	100,000	103,503	2018/11/28
		665 東京都公債	1.4300	100,000	103,046	2018/12/20
		21-2 千葉県公債	1.5700	100,000	103,996	2019/05/24
		163 神奈川県公債	1.4000	100,000	103,678	2019/06/20
		21-3 埼玉県公債	1.6400	100,000	104,317	2019/06/25
		76 共同発行地方	1.4000	50,000	51,904	2019/07/25
		21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	104,068	2019/09/25
		81 共同発行地方	1.3200	100,000	104,129	2019/12/25
		21-3 広島市公債	1.3400	100,000	104,190	2019/12/25
		21-5 京都市公債	1.4500	100,000	104,757	2020/02/25
		471 名古屋市債	1.2700	100,000	104,524	2020/06/19
		688 東京都公債	0.9400	100,000	103,614	2020/09/18
		90 共同発行地方	1.1200	100,000	104,296	2020/09/25

日本債券インデックスマザーファンド

区分		銘柄	当期末 年利率	当期末 額面金額	当期末 評価額	当期末 償還年月日
			%	千円	千円	
		22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	104,191	2020/11/30
		22-5 京都府公債	1.2600	100,000	105,099	2020/12/21
		699 東京都公債	1.0200	100,000	104,851	2021/09/17
		23-2 島根県公債	1.0300	100,000	105,015	2021/11/25
		108 共同発行地方	1.0100	100,000	105,222	2022/03/25
		24-1 北海道公債	0.9900	100,000	105,118	2022/04/27
		24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	104,441	2022/06/20
		361 大阪府公債	0.9200	100,000	104,877	2022/06/28
		24-6 北海道公債	0.8400	100,000	104,559	2022/08/31
		713 東京都公債	0.7700	100,000	104,312	2022/09/20
		24-5 京都府公債	0.8200	100,000	104,572	2022/09/20
		24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	104,491	2022/10/21
		117 共同発行地方	0.7200	100,000	104,149	2022/12/22
		24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	104,210	2022/12/22
		24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	104,453	2023/01/31
		24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,688	2023/04/26
		126 共同発行地方	0.8100	100,000	105,182	2023/09/25
		131 共同発行地方	0.6600	100,000	104,208	2024/02/23
		26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	103,324	2024/11/25
		26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,856	2025/02/26
		19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	118,209	2033/12/09
種別小計	銘柄数	37銘柄				
	金額			3,650,000	3,811,406	
特殊債券（除く金融債券）		32 道路機構	1.6100	100,000	102,046	2018/03/20
		64 政保道路機構	1.6000	219,000	225,179	2018/08/29
		5 中日本高速道路	1.8600	100,000	103,255	2018/09/20
		66 政保道路機構	1.5000	100,000	102,784	2018/09/28
		2 政保地方公営機	1.6000	100,000	103,195	2018/11/16
		24 政保中日本道	1.3000	100,000	102,855	2019/01/22
		61 道路機構	1.2400	100,000	104,258	2020/06/19
		13 地方公共団体	1.2780	100,000	104,458	2020/06/26
		110 政保道路機構	1.3000	100,000	104,716	2020/06/30
		3 公営企業15年	2.2000	100,000	109,851	2021/05/21
		29 地方公共団体	1.0250	100,000	104,934	2021/10/28
		81 道路機構	1.0300	100,000	105,004	2021/12/20
		33 地方公共団体	1.0350	100,000	105,265	2022/02/28
		25 日本政策金融	0.9970	100,000	105,172	2022/05/10
		168 政保道路機構	0.8390	100,000	104,701	2022/07/29
		39政保地方公共団	0.8010	100,000	104,523	2022/08/15
		173 政保道路機構	0.8190	100,000	104,728	2022/09/30
		175 政保道路機構	0.7910	100,000	104,631	2022/10/31
		25 政保日本政策	0.8150	100,000	105,046	2023/02/24
		19 政保政策投資Ｃ	0.6680	100,000	104,165	2023/03/15
		186 政保道路機構	0.6680	100,000	104,163	2023/03/17
		48 地方公共団体	0.8130	100,000	104,839	2023/05/26
		190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,857	2023/05/31
		51 地方公共団体	0.8410	100,000	105,164	2023/08/28
		65 地方公共団体	0.5350	100,000	103,259	2024/10/28
		236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,183	2025/01/31

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	
		71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,803	2025/04/28
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	112,183	2027/08/25
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	122,416	2029/07/31
種別小計	銘柄数	29銘柄				
	金額			3,019,000	3,171,646	
金融債券		い752 利付商工債	0.3000	100,000	100,343	2018/01/26
		い757 利付農林債	0.3500	100,000	100,573	2018/06/27
種別小計	銘柄数	2銘柄				
	金額			200,000	200,916	
普通社債券		21 NTT データ	1.6000	100,000	102,006	2018/03/20
		15 NTT ドコモ	1.9600	100,000	102,920	2018/06/20
		1 明治安田2013基	0.8200	100,000	100,986	2018/08/08
		9 ジャパンリアルエステイト	0.4970	100,000	100,488	2018/08/30
		472 関西電力	1.7900	100,000	103,426	2018/11/22
		18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	103,287	2018/12/11
		4 りそな銀行劣後	2.7660	100,000	106,877	2019/06/20
		46 NTT ファイナンス	0.2500	100,000	100,284	2019/06/20
		14 武田薬品	0.5400	100,000	101,152	2019/07/19
		20 三井住友 BK 劣	2.2100	100,000	105,728	2019/07/24
		164 オリックス	1.1460	100,000	102,682	2019/08/07
		24 太平洋セメント	0.3900	100,000	99,964	2019/09/11
		423 九州電力	0.9590	100,000	102,472	2019/09/25
		62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	103,732	2019/09/27
		8ドイツ銀行 AG ロンドン	0.4700	100,000	95,269	2019/11/14
		29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,451	2020/03/19
		260 北陸電力	2.3300	100,000	107,805	2020/05/25
		9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,259	2020/07/24
		20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	109,284	2020/07/27
		15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	106,240	2020/08/21
		17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	105,966	2020/09/16
		72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	104,577	2020/12/22
		2 イオン FS	0.5720	100,000	100,743	2021/03/18
		9三菱 UFJ 信託 BK 劣	1.6800	100,000	106,667	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,819	2022/06/20
		11三菱 UFJ 信託 BK	1.3600	100,000	106,322	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	105,980	2022/08/25
		4 JX ホールデイングス	1.1450	100,000	105,418	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,212	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	104,624	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	104,457	2023/12/20
		1 三菱 UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,114	2024/06/26
種別小計	銘柄数	32銘柄				
	金額			3,200,000	3,308,223	
合計	銘柄数	361銘柄				
	金額			46,188,000	51,149,645	

（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

2016年11月30日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	51,149,645	98.4
コール・ローン等、その他	854,412	1.6
投資信託財産総額	52,004,058	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

2016年11月30日現在

項目	当期末
(A)資産	**52,004,058,045円**
コール・ローン等	281,934,187
公社債（評価額）	51,149,645,931
未収入金	411,031,640
未収利息	157,572,707
前払費用	3,873,580
(B)負債	**98,362,425**
未払金	91,609,550
未払解約金	6,752,875
(C)純資産総額（A－B）	**51,905,695,620**
元本	37,053,043,176
次期繰越損益金	14,852,652,444
(D)受益権総口数	**37,053,043,176口**
1万口当り基準価額（C／D）	**14,008円**

＊期首における元本額は40,077,387,149円、当期中における追加設定元本額は4,724,277,547円、同解約元本額は7,748,621,520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）216,435,072円、ダイワ国内重視バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）1,435,119,843円、ダイワ国際分散バランスファンド３０ＶＡ（一般投資家私募）154,601,241円、ダイワ国際分散バランスファンド５０ＶＡ（一般投資家私募）2,029,554,751円、Ｄ－Ｉ's 日本債券インデックス765,717円、ＤＣダイワ日本債券インデックス4,520,031,855円、ダイワ・バランスファンド３５ＶＡ15,037,977,112円、ダイワ・バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）2,380,007,134円、ダイワ国内バランスファンド２５ＶＡ（適格機関投資家専用）316,684,776円、ダイワ国内バランスファンド３０ＶＡ（適格機関投資家専用）432,222,563円、ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド31,913,378円、ダイワファンドラップ 日本債券インデックス2,148,394,984円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券881,186,341円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,545,146,286円、ダイワライフスタイル２５　420,509,022円、ダイワライフスタイル５０　398,353,270円、ダイワライフスタイル７５　104,139,831円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は14,008円です。

■損益の状況

当期　自2015年12月１日　至2016年11月30日

項目		当期
(A)配当等収益		**582,783,197円**
受取利息		582,857,295
支払利息	△	74,098
(B)有価証券売買損益		**1,664,523,752**
売買益		1,882,673,450
売買損	△	218,149,698
(C)その他費用	△	**578**
(D)当期損益金（A＋B＋C）		**2,247,306,371**
(E)前期繰越損益金		**13,787,531,066**
(F)解約差損益金	△	**3,093,308,167**
(G)追加信託差損益金		**1,911,123,174**
(H)合計（D＋E＋F＋G）		**14,852,652,444**
次期繰越損益金（H）		**14,852,652,444**

（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。