

ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド

★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10年9カ月間（2016年3月14日～2026年11月30日）	
運用方針	投資成果をダイワ・bond・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・bond・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。

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2017年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

さて、「ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド」は、このたび、第2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				
1 期末 (2016年11月30日)	円 10.035	円 0	% 0.4	524.807	% 0.7	% 98.4	% —	百万円 44
2 期末 (2017年11月30日)	9.937	0	△ 1.0	522.295	△ 0.5	99.3	—	78

(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。

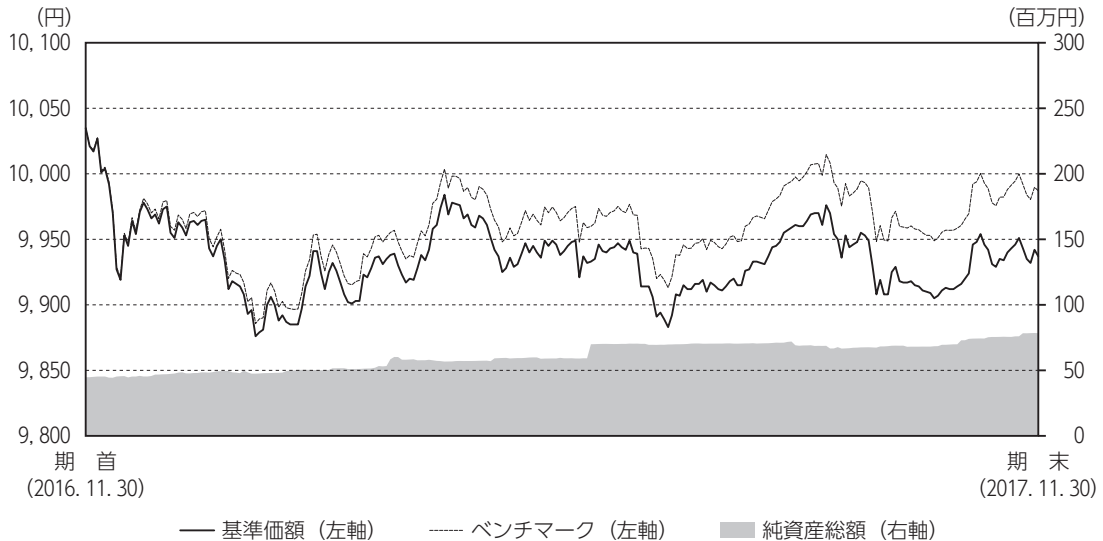
(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(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 (DB I) 総合指数です。

基準価額・騰落率

期首：10,035円

期末：9,937円

騰落率：△1.0%

基準価額の主な変動要因

債券からの利息収入を得た一方、金利水準の上昇による債券価格の下落により、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2016年11月30日	10,035	—	524.807	—	98.4	—
12月末	9,975	△ 0.6	521.909	△ 0.6	99.2	—
2017年 1月末	9,914	△ 1.2	518.958	△ 1.1	99.2	—
2月末	9,941	△ 0.9	520.564	△ 0.8	99.1	—
3月末	9,923	△ 1.1	519.891	△ 0.9	98.0	—
4月末	9,968	△ 0.7	522.469	△ 0.4	99.5	—
5月末	9,946	△ 0.9	521.440	△ 0.6	98.9	—
6月末	9,914	△ 1.2	519.979	△ 0.9	99.5	—
7月末	9,912	△ 1.2	520.066	△ 0.9	98.6	—
8月末	9,960	△ 0.7	522.848	△ 0.4	99.6	—
9月末	9,919	△ 1.2	520.909	△ 0.7	99.0	—
10月末	9,916	△ 1.2	520.920	△ 0.7	99.2	—
(期末) 2017年11月30日	9,937	△ 1.0	522.295	△ 0.5	99.3	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2016. 12. 1 ~ 2017. 11. 30)

国内債券市況

2016年12月から2017年1月にかけて、FOMC（米国連邦公開市場委員会）で政策金利が引き上げられたほか、政策金利の見通しが上方修正されたことで米国の金利が上昇したため、国内長期金利も上昇しました。その後、シリアや北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりを背景に市場のリスク回避姿勢が強まり国内長期金利は低下する一方で、金融緩和の縮小観測などを背景に欧米の長期金利が上昇したことに連れて国内長期金利も上昇するなど、金利は一定の範囲内での動きを繰り返しました。

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

(2016. 12. 1 ~ 2017. 11. 30)

■当ファンド

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

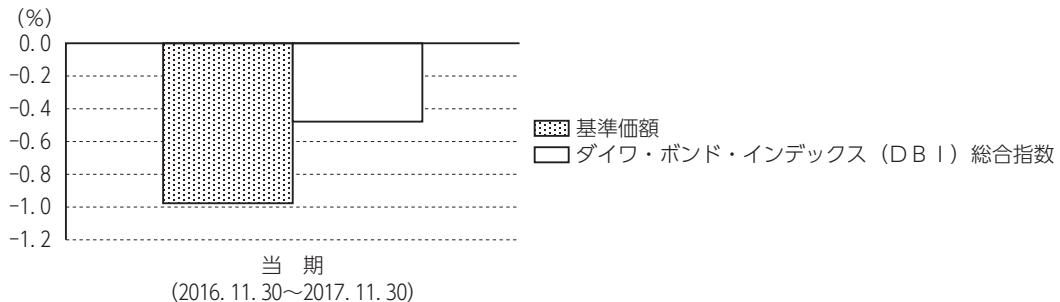
■日本債券インデックスマザーファンド

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ないました。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 $\Delta 0.5\%$ 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が $\Delta 0.5\%$ 程度、「日本債券インデックスマザーファンド」におけるベンチマークとの差異が 0.0% 程度となっており、信託報酬要因を除くと、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期は、分配対象額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。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2016年12月1日 ～2017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)	—

- (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 (2016. 12. 1~2017. 11. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	46円	0.464%	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9,935円です。
(投 信 会 社)	(21)	(0.216)	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)	(21)	(0.216)	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	0	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
(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	47	0.469	

(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

(2016年12月1日から2017年11月30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	42,365	58,888	18,113	25,189

(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

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	27,370	2,176	8.0	9,988	827	8.3
コール・ローン	77,365	—	—	—	—	—

(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) 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、当期中における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■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	
	□ 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	31,913	56,164	78,276

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017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	78,276	99.3
コール・ローン等、その他	539	0.7
投資信託財産総額	78,816	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

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	78,816,440円
コール・ローン等	445,360
日本債券インデックス マザーファンド（評価額）	78,276,997
未収入金	94,083
(B) 負債	462,062
未払解約金	298,090
未払信託報酬	162,164
その他未払費用	1,808
(C) 純資産総額（A－B）	78,354,378
元本	78,849,259
次期繰越損益金	△ 494,881
(D) 受益権総口数	78,849,259口
1万口当り基準価額（C/D）	9,937円

* 期首における元本額は44,593,679円、当期中における追加設定元本額は70,448,038円、同解約元本額は36,192,458円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,937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494,881円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 13円
受取利息	1
支払利息	△ 14
(B) 有価証券売買損益	74,986
売買益	145,820
売買損	△ 70,834
(C) 信託報酬等	△ 285,153
(D) 当期損益金（A + B + C）	△ 210,180
(E) 前期繰越損益金	△ 337,048
(F) 追加信託差損益金	52,347
（配当等相当額）	（△ 98）
（売買損益相当額）	（ 52,445）
(G) 合計（D + E + F）	△ 494,881
次期繰越損益金（G）	△ 494,881
追加信託差損益金	52,347
（配当等相当額）	（△ 98）
（売買損益相当額）	（ 52,445）
繰越損益金	△ 547,228

（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「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	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額（a + b + c + d）	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e - f）	0
(h) 受益権総口数	78,849,259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18期 (決算日 2017年11月30日)

(計算期間 2016年12月1日～2017年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの第18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

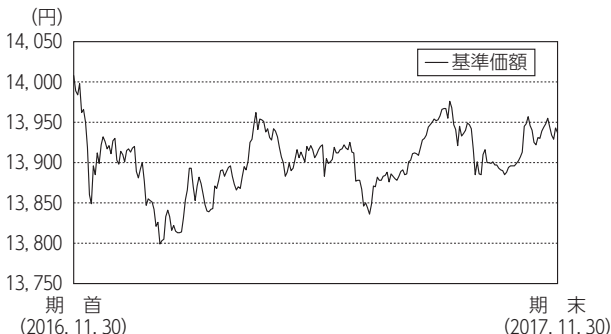
大和投資信託

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 (ベンチマーク)		公 社 債	債 券
	円	騰 落 率 (%)	騰 落 率 (%)	騰 落 率 (%)	組 入 比 率 (%)	先 物 比 率 (%)
(期首) 2016年11月30日	14,008	—	524.807	—	98.5	—
12月末	13,930	△ 0.6	521.909	△ 0.6	99.3	—
2017年 1月末	13,851	△ 1.1	518.958	△ 1.1	99.3	—
2月末	13,893	△ 0.8	520.564	△ 0.8	99.2	—
3月末	13,873	△ 1.0	519.891	△ 0.9	98.1	—
4月末	13,942	△ 0.5	522.469	△ 0.4	99.6	—
5月末	13,916	△ 0.7	521.440	△ 0.6	99.0	—
6月末	13,877	△ 0.9	519.979	△ 0.9	99.6	—
7月末	13,880	△ 0.9	520.066	△ 0.9	98.7	—
8月末	13,953	△ 0.4	522.848	△ 0.4	99.7	—
9月末	13,901	△ 0.8	520.909	△ 0.7	99.1	—
10月末	13,902	△ 0.8	520.920	△ 0.7	99.3	—
(期末) 2017年11月30日	13,937	△ 0.5	522.295	△ 0.5	99.4	—

(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：14,008円 期末：13,937円 騰落率：△0.5%

【基準価額の主な変動要因】

債券からの利息収入を得た一方、金利水準の上昇による債券価格の下落により、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

2016年12月から2017年1月にかけて、FOMC (米国連邦公開市場委員会) で政策金利が引き上げられたほか、政策金利の見通しが上方修正されたことで米国の金利が上昇したため、国内長期金利も上昇しました。その後、シリアや北朝鮮をめぐる地政学リスクの高まりを背景に市場のリスク回避姿勢が強まり国内長期金利は低下する一方で、金融緩和の縮小観測などを背景に欧米の長期金利が上昇したことに連れて国内長期金利も上昇するなど、金利は一定の範囲内での動きを繰り返しました。

◆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ないました。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ッション、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

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	25,194,385	(8,245,110 —)
	地方債証券	1,039,329	(405,522 —)
内	特殊債券	704,317	(830,597 —)
	社債券	432,260	(506,862 —)

(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

(2016年12月1日から2017年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
131 5年国債 0.1% 2022/3/20	1,010,475	368 2年国債 0.1% 2018/9/15	631,617
346 10年国債 0.1% 2027/3/20	844,805	366 2年国債 0.1% 2018/7/15	441,690
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	707,309	371 2年国債 0.1% 2018/12/15	381,227
324 10年国債 0.8% 2022/6/20	586,156	127 5年国債 0.1% 2021/3/20	262,350
371 2年国債 0.1% 2018/12/15	583,765	341 10年国債 0.3% 2025/12/20	256,429
347 10年国債 0.1% 2027/6/20	572,679	131 5年国債 0.1% 2022/3/20	252,170
345 10年国債 0.1% 2026/12/20	571,739	293 10年国債 1.8% 2018/6/20	242,905
129 5年国債 0.1% 2021/9/20	504,938	160 20年国債 0.7% 2037/3/20	231,899
121 5年国債 0.1% 2019/9/20	502,884	64 政保道路機構 1.6% 2018/8/29	222,882
160 20年国債 0.7% 2037/3/20	454,931	332 10年国債 0.6% 2023/12/20	209,246

(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。

日本債券インデックスマザーファンド

■組入資産明細表

(1)国内（邦貨建）公社債（種類別、新株予約権付社債券（転換社債券）を除く）

作成期 区分	当 期				末		
	額 面 金 額	評 価 額	組入比率	うちB B 格 以下組入 比 率	残存期間別組入比率		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	52,073,000	56,883,147	83.5	—	54.9	19.7	8.9
地方債証券	4,250,000	4,405,150	6.5	—	2.9	2.7	0.8
特殊債券（除く金融債券）	3,000,000	3,112,472	4.6	—	2.4	2.0	0.1
金融債券	100,000	98,784	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	3,100,000	3,212,890	4.7	—	1.2	2.0	1.5
合 計	62,523,000	67,712,446	99.4	—	61.6	26.3	11.4

(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力しています。

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

区 分	当 期		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	額 面 金 額		評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券		千円	%	千円	千円	
	371 2年国債	200,000	0.1000	200,546	2018/12/15	
	116 5年国債	500,000	0.2000	501,880	2018/12/20	
	297 10年国債	70,000	1.4000	71,141	2018/12/20	
	298 10年国債	125,000	1.3000	126,907	2018/12/20	
	372 2年国債	130,000	0.1000	130,384	2019/01/15	
	373 2年国債	300,000	0.1000	300,954	2019/02/15	
	374 2年国債	320,000	0.1000	321,084	2019/03/15	
	117 5年国債	730,000	0.2000	733,299	2019/03/20	
	299 10年国債	250,000	1.3000	254,685	2019/03/20	
	300 10年国債	286,000	1.5000	292,100	2019/03/20	
	41 20年国債	136,000	1.5000	138,909	2019/03/20	
	42 20年国債	87,000	2.6000	90,092	2019/03/20	
	375 2年国債	60,000	0.1000	60,216	2019/04/15	
	376 2年国債	250,000	0.1000	250,957	2019/05/15	
	377 2年国債	150,000	0.1000	150,609	2019/06/15	
	118 5年国債	270,000	0.2000	271,460	2019/06/20	
	119 5年国債	480,000	0.1000	481,852	2019/06/20	
	301 10年国債	120,000	1.5000	123,060	2019/06/20	
	302 10年国債	240,000	1.4000	245,750	2019/06/20	
	380 2年国債	330,000	0.1000	331,560	2019/09/15	
	120 5年国債	180,000	0.2000	181,132	2019/09/20	
	121 5年国債	550,000	0.1000	552,469	2019/09/20	
	303 10年国債	60,000	1.4000	61,673	2019/09/20	
	304 10年国債	110,000	1.3000	112,869	2019/09/20	
	43 20年国債	100,000	2.9000	105,488	2019/09/20	
	122 5年国債	630,000	0.1000	633,162	2019/12/20	
	305 10年国債	500,000	1.3000	514,810	2019/12/20	
	123 5年国債	583,265	0.1000	583,265	2020/03/20	
	306 10年国債	255,000	1.4000	264,021	2020/03/20	
	307 10年国債	400,000	1.3000	413,232	2020/03/20	

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	末		償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	44 20年国債	2.5000	85,000	90,156	2020/03/20
	45 20年国債	2.4000	78,000	82,552	2020/03/20
	124 5年国債	0.1000	550,000	553,366	2020/06/20
	308 10年国債	1.3000	200,000	207,322	2020/06/20
	309 10年国債	1.1000	90,000	92,835	2020/06/20
	46 20年国債	2.2000	73,000	77,357	2020/06/22
	125 5年国債	0.1000	640,000	644,396	2020/09/20
	310 10年国債	1.0000	130,000	134,119	2020/09/20
	311 10年国債	0.8000	150,000	153,912	2020/09/20
	47 20年国債	2.2000	89,000	94,821	2020/09/21
	126 5年国債	0.1000	750,000	755,385	2020/12/20
	312 10年国債	1.2000	395,000	411,052	2020/12/20
	48 20年国債	2.5000	54,000	58,352	2020/12/21
	127 5年国債	0.1000	680,000	685,276	2021/03/20
	313 10年国債	1.3000	200,000	209,450	2021/03/20
	314 10年国債	1.1000	260,000	270,566	2021/03/20
	49 20年国債	2.1000	64,000	68,735	2021/03/22
	50 20年国債	1.9000	107,000	114,208	2021/03/22
	128 5年国債	0.1000	605,000	609,948	2021/06/20
	315 10年国債	1.2000	221,000	231,417	2021/06/20
	316 10年国債	1.1000	250,000	260,895	2021/06/20
	51 20年国債	2.0000	82,000	88,204	2021/06/21
	129 5年国債	0.1000	830,000	837,279	2021/09/20
	317 10年国債	1.1000	214,000	223,993	2021/09/20
	318 10年国債	1.0000	200,000	208,578	2021/09/20
	52 20年国債	2.1000	52,000	56,414	2021/09/21
	130 5年国債	0.1000	700,000	706,538	2021/12/20
	319 10年国債	1.1000	100,000	104,957	2021/12/20
	320 10年国債	1.0000	230,000	240,467	2021/12/20
	53 20年国債	2.1000	66,000	71,953	2021/12/20
	54 20年国債	2.2000	65,000	71,127	2021/12/20
	131 5年国債	0.1000	750,000	757,275	2022/03/20
	321 10年国債	1.0000	175,000	183,491	2022/03/20
	322 10年国債	0.9000	130,000	135,747	2022/03/20
	55 20年国債	2.0000	140,000	152,807	2022/03/21
	132 5年国債	0.1000	310,000	313,112	2022/06/20
	324 10年国債	0.8000	410,000	427,129	2022/06/20
	56 20年国債	2.0000	70,000	76,759	2022/06/20
	133 5年国債	0.1000	200,000	202,120	2022/09/20
	325 10年国債	0.8000	310,000	323,596	2022/09/20
	327 10年国債	0.8000	300,000	313,764	2022/12/20
	59 20年国債	1.7000	45,000	49,118	2022/12/20
	60 20年国債	1.4000	10,000	10,763	2022/12/20
	328 10年国債	0.6000	330,000	342,282	2023/03/20
	61 20年国債	1.0000	100,000	105,878	2023/03/20
	329 10年国債	0.8000	355,000	372,700	2023/06/20
	62 20年国債	0.8000	95,000	99,765	2023/06/20
	63 20年国債	1.8000	130,000	143,765	2023/06/20
	330 10年国債	0.8000	262,000	275,582	2023/09/20
	331 10年国債	0.6000	265,000	275,650	2023/09/20

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	
	64 20年国債		1.9000	90,000	100,431	2023/09/20
	332 10年国債		0.6000	310,000	322,899	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	196,101	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	135,000	150,458	2023/12/20
	333 10年国債		0.6000	540,000	563,214	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	61,884	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	137,296	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	125,160	2024/03/20
	334 10年国債		0.6000	600,000	626,622	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	96,505	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	143,696	2024/06/20
	335 10年国債		0.5000	630,000	654,733	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	175,000	200,924	2024/09/20
	336 10年国債		0.5000	175,000	182,124	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	300,000	307,857	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	137,534	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	84,183	2024/12/20
	338 10年国債		0.4000	390,000	403,283	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	92,619	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	58,298	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	149,554	2025/03/20
	339 10年国債		0.4000	440,000	454,986	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	69,979	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	57,738	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	61,603	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	680,000	703,392	2025/09/20
	81 20年国債		2.0000	76,000	88,087	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	101,516	2025/09/20
	341 10年国債		0.3000	420,000	431,172	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	108,928	2025/12/20
	84 20年国債		2.0000	100,000	116,321	2025/12/20
	342 10年国債		0.1000	700,000	707,266	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	68,182	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	95,372	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	65,112	2026/03/20
	343 10年国債		0.1000	700,000	706,881	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	119,749	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	92,737	2026/06/20
	344 10年国債		0.1000	540,000	544,984	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	120,000	143,216	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	60,000	72,136	2026/09/20
	345 10年国債		0.1000	550,000	554,719	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	280,000	332,724	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	750,000	755,910	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	118,360	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	155,074	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	570,000	574,337	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	60,799	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	155,000	185,528	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	180,000	181,229	2027/09/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	97 20年国債		2.2000	40,000	48,452	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	120,000	144,187	2027/09/20
	99 20年国債		2.1000	200,000	241,214	2027/12/20
	100 20年国債		2.2000	55,000	67,106	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	75,000	93,043	2028/03/20
	102 20年国債		2.4000	80,000	99,559	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	70,000	86,381	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	110,000	133,437	2028/06/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	153,320	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	184,131	2028/09/20
	107 20年国債		2.1000	107,000	130,589	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	177,000	212,031	2028/12/20
	109 20年国債		1.9000	35,000	42,056	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	130,000	159,116	2029/03/20
	111 20年国債		2.2000	100,000	123,891	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	170,000	208,676	2029/06/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	20,986	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	230,000	282,962	2029/09/20
	114 20年国債		2.1000	130,000	160,368	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	160,000	199,273	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	30,531	2030/02/20
	116 20年国債		2.2000	89,000	111,151	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	215,000	265,914	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	37,887	2030/05/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	116,564	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	111,752	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	210,000	247,180	2030/06/20
	121 20年国債		1.9000	135,000	164,245	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	160,000	192,657	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	48,463	2030/11/20
	123 20年国債		2.1000	140,000	174,256	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	143,000	176,168	2030/12/20
	125 20年国債		2.2000	85,000	107,146	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	70,000	86,368	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	165,000	201,443	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	35,361	2031/05/20
	128 20年国債		1.9000	119,000	145,577	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	160,000	193,625	2031/06/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	169,727	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	130,000	155,758	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	31,086	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	120,000	143,997	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	210,000	254,851	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	50,000	60,776	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	110,481	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	155,000	183,997	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	70,830	2032/05/20
	137 20年国債		1.7000	85,000	102,222	2032/06/20
	138 20年国債		1.5000	87,000	102,116	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	125,000	148,575	2032/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	140	20年国債	1.7000	335,000	403,437	2032/09/20
	8	30年国債	1.8000	27,000	32,942	2032/11/22
	9	30年国債	1.4000	43,000	49,952	2032/12/20
	141	20年国債	1.7000	170,000	204,846	2032/12/20
	142	20年国債	1.8000	150,000	183,045	2032/12/20
	10	30年国債	1.1000	45,000	50,262	2033/03/20
	143	20年国債	1.6000	210,000	250,275	2033/03/20
	144	20年国債	1.5000	120,000	141,154	2033/03/20
	11	30年国債	1.7000	40,000	48,316	2033/06/20
	145	20年国債	1.7000	285,000	343,995	2033/06/20
	12	30年国債	2.1000	60,000	76,171	2033/09/20
	146	20年国債	1.7000	275,000	332,304	2033/09/20
	13	30年国債	2.0000	75,000	94,155	2033/12/20
	147	20年国債	1.6000	170,000	202,896	2033/12/20
	14	30年国債	2.4000	82,000	108,240	2034/03/20
	148	20年国債	1.5000	245,000	288,644	2034/03/20
	15	30年国債	2.5000	100,000	133,829	2034/06/20
	149	20年国債	1.5000	232,000	273,291	2034/06/20
	16	30年国債	2.5000	100,000	133,997	2034/09/20
	150	20年国債	1.4000	250,000	290,485	2034/09/20
	17	30年国債	2.4000	80,000	106,121	2034/12/20
	151	20年国債	1.2000	300,000	338,562	2034/12/20
	18	30年国債	2.3000	80,000	104,835	2035/03/20
	152	20年国債	1.2000	280,000	315,714	2035/03/20
	19	30年国債	2.3000	57,000	74,813	2035/06/20
	153	20年国債	1.3000	315,000	360,290	2035/06/20
	20	30年国債	2.5000	60,000	80,863	2035/09/20
	154	20年国債	1.2000	300,000	337,902	2035/09/20
	21	30年国債	2.3000	60,000	78,919	2035/12/20
	155	20年国債	1.0000	240,000	261,808	2035/12/20
	22	30年国債	2.5000	70,000	94,650	2036/03/20
	156	20年国債	0.4000	273,000	268,874	2036/03/20
	23	30年国債	2.5000	60,000	81,189	2036/06/20
	157	20年国債	0.2000	323,000	305,777	2036/06/20
	24	30年国債	2.5000	92,000	124,682	2036/09/20
	158	20年国債	0.5000	153,000	152,605	2036/09/20
	25	30年国債	2.3000	150,000	197,980	2036/12/20
	159	20年国債	0.6000	230,000	232,985	2036/12/20
	26	30年国債	2.4000	150,000	200,847	2037/03/20
	160	20年国債	0.7000	220,000	226,347	2037/03/20
	161	20年国債	0.6000	250,000	251,982	2037/06/20
	27	30年国債	2.5000	150,000	204,219	2037/09/20
	162	20年国債	0.6000	200,000	201,246	2037/09/20
	28	30年国債	2.5000	150,000	204,886	2038/03/20
	29	30年国債	2.4000	200,000	270,050	2038/09/20
	30	30年国債	2.3000	177,000	236,257	2039/03/20
	31	30年国債	2.2000	165,000	217,560	2039/09/20
	32	30年国債	2.3000	200,000	268,430	2040/03/20
	33	30年国債	2.0000	261,000	334,604	2040/09/20
	34	30年国債	2.2000	213,000	282,640	2041/03/20

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		
	35 30年国債	2.0000	250,000	321,535	2041/09/20	
	36 30年国債	2.0000	226,000	291,225	2042/03/20	
	37 30年国債	1.9000	290,000	367,795	2042/09/20	
	38 30年国債	1.8000	159,000	198,284	2043/03/20	
	39 30年国債	1.9000	152,000	193,196	2043/06/20	
	40 30年国債	1.8000	140,000	174,792	2043/09/20	
	41 30年国債	1.7000	140,000	171,593	2043/12/20	
	42 30年国債	1.7000	146,000	179,013	2044/03/20	
	43 30年国債	1.7000	160,000	196,252	2044/06/20	
	44 30年国債	1.7000	140,000	171,781	2044/09/20	
	45 30年国債	1.5000	168,000	198,110	2044/12/20	
	46 30年国債	1.5000	180,000	212,508	2045/03/20	
	47 30年国債	1.6000	167,000	201,240	2045/06/20	
	48 30年国債	1.4000	190,000	219,413	2045/09/20	
	49 30年国債	1.4000	173,000	199,749	2045/12/20	
	50 30年国債	0.8000	185,000	185,212	2046/03/20	
	51 30年国債	0.3000	190,000	165,805	2046/06/20	
	52 30年国債	0.5000	205,000	189,057	2046/09/20	
	53 30年国債	0.6000	195,000	184,719	2046/12/20	
	54 30年国債	0.8000	188,000	187,332	2047/03/20	
	55 30年国債	0.8000	190,000	189,319	2047/06/20	
	56 30年国債	0.8000	130,000	129,377	2047/09/20	
	1 40年国債	2.4000	85,000	120,660	2048/03/20	
	2 40年国債	2.2000	116,000	159,029	2049/03/20	
	3 40年国債	2.2000	74,000	101,892	2050/03/20	
	4 40年国債	2.2000	107,000	147,740	2051/03/20	
	5 40年国債	2.0000	125,000	165,585	2052/03/20	
	6 40年国債	1.9000	105,000	136,223	2053/03/20	
	7 40年国債	1.7000	121,000	149,732	2054/03/20	
	8 40年国債	1.4000	155,000	171,418	2055/03/20	
	9 40年国債	0.4000	258,000	211,621	2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	165,000	160,571	2057/03/20	
種別小計	銘 柄 数 金 額	262銘柄		52,073,000	56,883,147	
地方債証券	665 東京都公債	1.4300	100,000	101,485	2018/12/20	
	21-2 千葉県公債	1.5700	100,000	102,270	2019/05/24	
	163 神奈川県公債	1.4000	100,000	102,120	2019/06/20	
	21-3 埼玉県公債	1.6400	100,000	102,510	2019/06/25	
	76 共同発行地方	1.4000	50,000	51,125	2019/07/25	
	21-6 千葉県公債	1.4100	100,000	102,498	2019/09/25	
	81 共同発行地方	1.3200	100,000	102,655	2019/12/25	
	21-3 広島市公債	1.3400	100,000	102,697	2019/12/25	
	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	103,156	2020/02/25	
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	103,134	2020/06/19	
	688 東京都公債	0.9400	100,000	102,512	2020/09/18	
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	103,018	2020/09/25	
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	103,017	2020/11/30	
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	103,716	2020/12/21	
	699 東京都公債	1.0200	100,000	103,758	2021/09/17	

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	
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	103,941	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	104,175	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	104,123	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	103,585	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	103,955	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	103,695	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	103,481	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	103,701	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	103,628	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	103,391	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	103,431	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,633	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	102,115	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	104,299	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	207,313	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,608	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,982	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,573	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	206,608	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,001	2025/12/19
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,496	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,122	2027/06/23
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,231	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,411	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	106,966	2035/12/20
種別小計	銘柄数	40銘柄			
	金額		4,250,000	4,405,150	
特殊債券 (除く金融債券)	24 政保中日本道	1.3000	100,000	101,483	2019/01/22
	14政保地方公共6	0.1990	100,000	100,468	2020/06/18
	61 道路機構	1.2400	100,000	103,015	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	103,153	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	103,313	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	107,589	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	103,792	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	103,789	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	104,147	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	104,006	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	103,865	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	103,721	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,900	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,840	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	104,181	2023/02/24
	19 政保政策投資C	0.6680	100,000	103,435	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,449	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,982	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	103,191	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	104,313	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,941	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,021	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
		71 地方公共団体	0.4650 %	100,000 千円	102,562 千円	2025/04/28
		261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,847	2025/11/28
		F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,958	2027/08/25
		1 地方公共団15年	1.3340	100,000	111,039	2028/01/28
		86 政保道路機構	2.0000	100,000	120,509	2029/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	184,952	2036/07/31
種別小計	銘柄数	28銘柄				
	金額			3,000,000	3,112,472	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	98,784	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	98,784	
普通社債券		18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	101,725	2018/12/11
		4 リゾな銀行劣後	2.7660	100,000	104,117	2019/06/20
		46 NTT ファイナンス	0.2500	100,000	100,333	2019/06/20
		14 武田薬品	0.5400	100,000	100,783	2019/07/19
		20 三井住友BK劣	2.2100	100,000	103,487	2019/07/24
		164 オリックス	1.1460	100,000	101,821	2019/08/07
		24 太平洋セメント	0.3900	100,000	100,442	2019/09/11
		423 九州電力	0.9590	100,000	101,650	2019/09/25
		62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	102,529	2019/09/27
		8ドイツ銀行AGロンドン	0.4700	100,000	100,217	2019/11/14
		29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,257	2020/03/19
		260 北陸電力	2.3300	100,000	105,627	2020/05/25
		9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,392	2020/07/24
		20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	106,723	2020/07/27
		15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	104,724	2020/08/21
		17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	105,128	2020/09/16
		72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	103,695	2020/12/22
		44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,656	2021/02/25
		2 イオンFS	0.5720	100,000	100,638	2021/03/18
		9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	105,128	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,830	2022/06/20
		11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	105,283	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	104,967	2022/08/25
		4 JXホールディングス	1.1450	100,000	104,842	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,214	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	104,500	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,586	2023/12/20
		1 三菱UFJFG劣後	0.9400	100,000	103,503	2024/06/26
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,126	2026/08/21
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	120,258	2029/01/29
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	110,697	2045/01/27
種別小計	銘柄数	31銘柄				
	金額			3,100,000	3,212,890	
合 計	銘柄数	362銘柄				
	金額			62,523,000	67,712,446	

(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

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	67,712,446	99.2
コール・ローン等、その他	515,486	0.8
投資信託財産総額	68,227,933	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

2017年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	68,227,933,193円
コール・ローン等	328,217,271
公社債 (評価額)	67,712,446,580
未収利息	181,873,953
前払費用	5,395,389
(B) 負債	88,741,204
未払解約金	88,741,204
(C) 純資産総額 (A - B)	68,139,191,989
元本	48,889,824,254
次期繰越損益金	19,249,367,735
(D) 受益権総口数	48,889,824,254口
1万口当り基準価額 (C/D)	13,937円

* 期首における元本額は37,053,043,176円、当期中における追加設定元本額は16,475,959,702円、同解約元本額は4,639,178,624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) 158,413,208円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募) 1,115,777,521円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募) 129,471,630円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募) 1,544,820,823円、D-1's 日本債券インデックス761,060円、DCダイワ日本債券インデックス5,048,119,641円、ダイワ・バランスファンド35VA14,793,606,425円、ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 2,332,093,501円、ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 315,508,234円、ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用) 427,330,074円、ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド56,164,883円、ダイワファンドラップ 日本債券インデックス13,311,941,351円、ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用) 17,276,903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988,470,113円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券1,245,052,313円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,339,363,709円、ダイワライフスタイル25 451,259,183円、ダイワライフスタイル50 481,361,512円、ダイワライフスタイル75 133,032,170円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,937円です。

■損益の状況

当期 自 2016年12月1日 至 2017年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	611,733,917円
受取利息	611,905,675
支払利息	△ 171,758
(B) 有価証券売買損益	△ 819,398,131
売買益	52,133,060
売買損	△ 871,531,191
(C) その他費用	△ 2,372
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 207,666,586
(E) 前期繰越損益金	14,852,652,444
(F) 解約差損益金	△ 1,815,204,560
(G) 追加信託差損益金	6,419,586,437
(H) 合計 (D + E + F + G)	19,249,367,735
次期繰越損益金 (H)	19,249,367,735

(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。