

# ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス

★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	無期限	
運用方針	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス（D B I）総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。	
主要投資対象	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およびわが国の公社債
	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 実質株式 組入上限比率	純資産総額の30%以下
	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、経費控除後の利息等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、利息等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、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せん。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15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、「ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス」は、このたび、第15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/>

■最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	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
11期末(2010年11月30日)	11,421	0	1.5	451.375	1.9	99.1	—	4,402
12期末(2011年11月30日)	11,583	0	1.4	460.096	1.9	99.2	—	5,169
13期末(2012年11月30日)	11,836	0	2.2	472.662	2.7	99.2	—	6,039
14期末(2013年12月2日)	12,029	0	1.6	482.946	2.2	99.3	—	6,530
15期末(2014年12月1日)	12,296	0	2.2	496.247	2.8	99.2	—	7,354

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

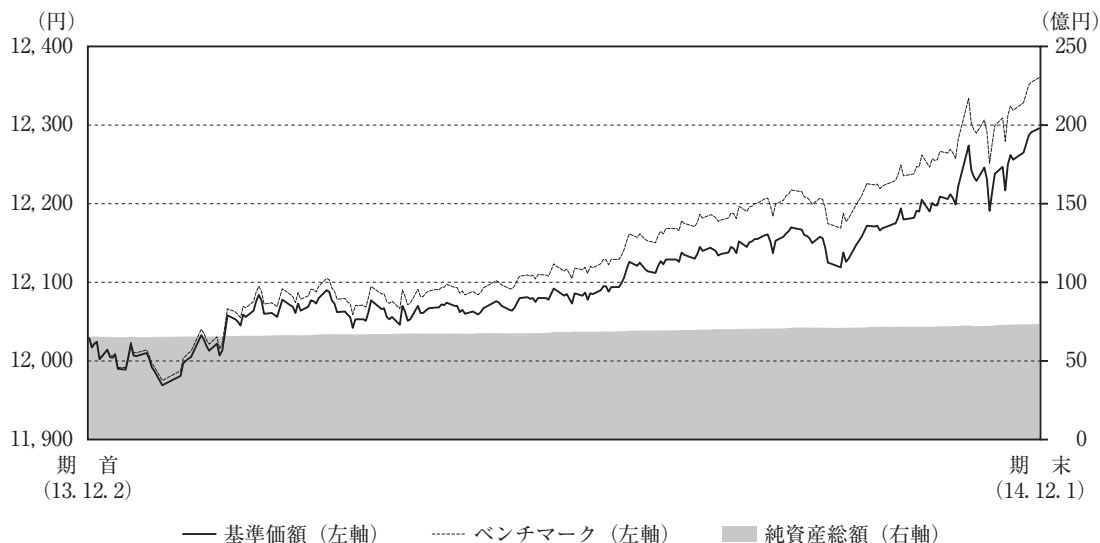
(注2) ダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数は、大和総研が開発した日本における確定利付債券市場のパフォーマンスを測定する指数であり、対象となる債券の時価総額加重方式による累積投資収益率指数です。

(注3) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注5) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

■当期中の基準価額と市況の推移



(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。

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 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	騰 落 率 %	騰 落 率 %		
(期首)2013年12月2日	12,029	—	482.946	—	99.3	—
12月末	11,969	△ 0.5	480.780	△ 0.4	99.4	—
2014年1月末	12,056	0.2	484.488	0.3	99.3	—
2月末	12,080	0.4	485.597	0.5	99.2	—
3月末	12,046	0.1	484.449	0.3	99.4	—
4月末	12,059	0.2	485.162	0.5	99.3	—
5月末	12,090	0.5	486.633	0.8	99.2	—
6月末	12,121	0.8	488.087	1.1	99.3	—
7月末	12,134	0.9	488.906	1.2	99.3	—
8月末	12,169	1.2	490.484	1.6	99.2	—
9月末	12,172	1.2	490.811	1.6	99.4	—
10月末	12,222	1.6	493.096	2.1	99.4	—
11月末	12,291	2.2	496.026	2.7	99.2	—
(期末)2014年12月1日	12,296	2.2	496.247	2.8	99.2	—

(注) 騰落率は期首比。

## 《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：12,029円 期末：12,296円 騰落率：2.2%

#### 【基準価額の変動要因】

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（DBI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12,296円となり、騰落率は2.2%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GPIF（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っそう引締まり、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」

「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、DBI総合指数に連動することをめざした運用を行なってまいります。

◆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。

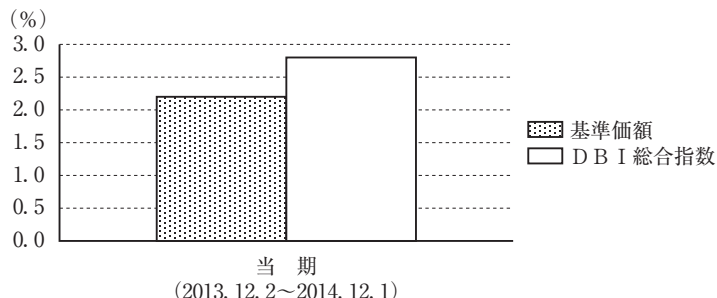
○日本債券インデックスマザーファンド

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 $\Delta 0.6\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ 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12月3日 ～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）	2,295

- (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、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		項 目 の 概 要
	(2013.12.3~2014.12.1)		
	金 額	比 率	
信託報酬 (投信会社) (販売会社) (受託銀行)	58円 (21) (27) (10)	0.480% (0.171) (0.224) (0.085)	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 (月末値の平均値) は12,107円です。 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 (監査費用)	1 (1)	0.005 (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 監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	59	0.485	

(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12月3日から2014年12月1日まで)

	設 定		解 約	
	口 数 千口	金 額 千円	口 数 千口	金 額 千円
日本債券インデックスマザーファンド	762,877	993,480	276,101	359,120

(注) 単位未満は切捨て。

(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12月3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 買 付 額
公 社 債	百万円 100

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 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12月3日から2014年12月1日まで)

区 分	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	16,538	662	4.0	16,304	1,731	10.6
コール・ローン	46,332	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合12.5%

※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。

(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に対する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。

■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	5,059,284	5,546,060	7,347,421

(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	7,347,421	99.5
コール・ローン等、その他	35,790	0.5
投資信託財産総額	7,383,211	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	7,383,211,383円
コ ー ル ・ ロ ー ン 等	34,477,947
日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	7,347,421,180
未 収 入 金	1,312,256
(B)負 債	29,197,033
未 払 解 約 金	11,850,212
未 払 信 託 報 酬	17,156,279
そ の 他 未 払 費 用	190,542
(C)純 資 産 総 額 (A-B)	7,354,014,350
元 本	5,980,852,159
次 期 繰 越 損 益	1,373,162,191
(D)受 益 権 総 口 数	5,980,852,159口
1 万 口 当 り 基 準 価 額 (C/D)	12,296円

\*期首における元本額は5,429,513,658円、当期中における追加設定元本額は1,442,841,843円、同解約元本額は891,503,342円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は12,296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	12,594円
受 取 利 息	12,594
(B)有 価 証 券 売 買 損 益	181,322,537
売 買 益	188,508,184
売 買 損	△ 7,185,647
(C)信 託 報 酬 等	△ 33,365,324
(D)当 期 損 益 金 (A+B+C)	147,969,807
(E)前 期 繰 越 損 益 金	286,295,971
(F)追 加 信 託 差 損 益 金	938,896,413
(配 当 等 相 当 額)	( 829,553,723)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 109,342,690)
(G)合 計 (D+E+F)	1,373,162,191
次 期 繰 越 損 益 金 (G)	1,373,162,191
追 加 信 託 差 損 益 金	938,896,413
(配 当 等 相 当 額)	( 829,553,723)
(売 買 損 益 相 当 額)	( 109,342,690)
分 配 準 備 積 立 金	434,265,778

(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	9,257円
(b)経 費 控 除 後 の 有 価 証 券 売 買 等 損 益	147,960,550
(c)収 益 調 整 金	938,896,413
(d)分 配 準 備 積 立 金	286,295,971
(e)当 期 分 配 対 象 額 (a+b+c+d)	1,373,162,191
(f)分 配 金	0
(g)翌 期 繰 越 分 配 対 象 額 (e-f)	1,373,162,191
(h)受 益 権 総 口 数	5,980,852,159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日までは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。
- ・復興特別所得税に係る記載がされた目論見書の再交付をご希望される受益者の方につきましては、その旨を販売会社までお申し出ください。
- ・受益者が、確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（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。



# 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

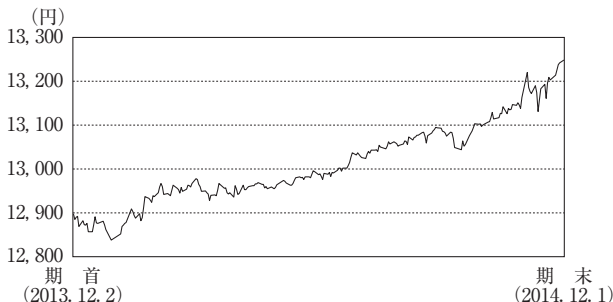
## 大和投資信託

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



《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（DBI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GPIF（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やすくなり、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DBI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、DBI総合指数には投資適格格付（BBB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。

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)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 (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。

◆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いません。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いません。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 内	国 債 証 券	13,659,146	13,139,068 (—)
	地 方 債 証 券	613,212	810,244 (—)
	特 殊 債 券	816,605	734,104 (—)
	社 債 証 券	1,449,656	1,621,310 (—)

(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	銘 柄	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。

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 以下組 入率 比	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	38,156,000	41,307,987	73.8	—	49.2	18.2	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	0.1000	100,000	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	171,000	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 期 銘 柄	年 利 率	末		償 還 年 月 日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	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	153,399	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 期 銘 柄	期		末		償 還 年 月 日
		年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	評 価 額	
	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 期 銘 柄	年 利 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	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

区 分	当 銘 柄	期		末	
		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 銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	末	
					評 価 額	償 還 年 月 日
		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 鳥根県公債	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

区 分	当 期	年 利 率	額 面 金 額	末	
				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 ウエストパック 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

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	末		
			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35VA 20,764,426,177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。