

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（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	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（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16期

(決算日 2015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、「ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス」は、このたび、第16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/>

<5831>

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
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
16期末(2015年11月30日)	12,413	0	1.0	503.440	1.4	98.3	—	8,047

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

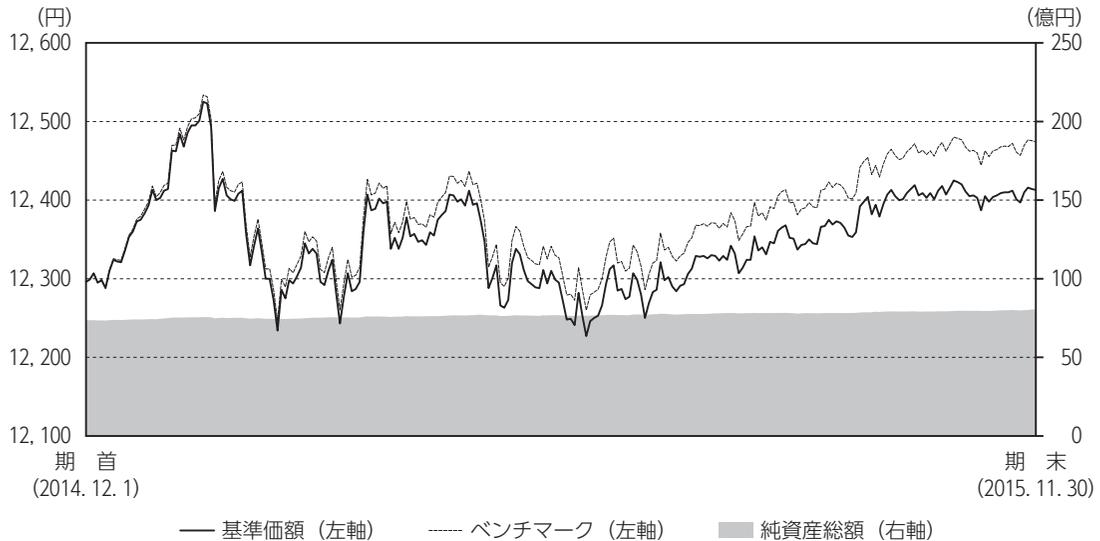
(注2) 公社債および債券先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《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：12,296円

期末：12,413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、ベンチマーク (DB I 総合指数) の騰落率は1.4%となりました。同指数への連動をめざす当ファンドも値上がりし、期末の基準価額は12,413円、騰落率は1.0%となりました。

ダイワ投信倶楽部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		
(期首)2014年12月1日	円	%		%	%	%
	12,296	—	496.247	—	99.2	—
12月末	12,412	0.9	501.199	1.0	99.3	—
2015年1月末	12,408	0.9	501.256	1.0	99.3	—
2月末	12,338	0.3	498.563	0.5	99.2	—
3月末	12,338	0.3	498.770	0.5	99.4	—
4月末	12,373	0.6	500.449	0.8	99.3	—
5月末	12,310	0.1	498.074	0.4	99.3	—
6月末	12,299	0.0	497.797	0.3	99.4	—
7月末	12,329	0.3	499.246	0.6	99.3	—
8月末	12,344	0.4	500.043	0.8	98.1	—
9月末	12,379	0.7	501.627	1.1	99.3	—
10月末	12,420	1.0	503.540	1.5	99.3	—
(期末)2015年11月30日	12,413	1.0	503.440	1.4	98.3	—

(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、期首から2015年1月中旬にかけて、世界経済の成長鈍化観測や原油価格急落によるインフレ圧力低下などを受けて欧米長期金利が大きく低下したことや、日銀の量的・質的金融緩和の強化により国債需給が一段と改善したことなどを背景に、低下基調を強めました。1月下旬以降は、株価の上昇や低調な国債入札などを受けて金利は上昇しました。3月半ばからは、ECB（欧州中央銀行）による国債買い入れの開始や、FOMC（米国連邦公開市場委員会）での低水準の政策金利見通しなどから欧米長期金利が低下したことを受けて、国内長期金利も低下しました。4月下旬以降は、欧米の早期金融引締め観測や国内景況感の改善、株価の上昇などにより、金利は上昇しました。6月半ばからは、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念や中国経済の先行き不透明感、新興国通貨安の進行、国内景況感の悪化、米国の利上げ先送り観測、株価の下落などを背景に、金利は低下基調が続きました。10月以降は、株価は上昇に転じましたが良好な国債需給が下支えとなり、金利は低位で推移しました。

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（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出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入れ、DB I 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。

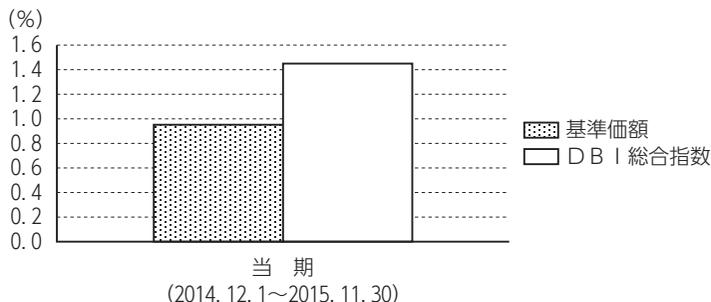
○日本債券インデックスマザーファンド

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 $\Delta 0.4\%$ 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、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	
	2014年12月2日 ～2015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)	2,413

- (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、ファンドの資金流入出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		項 目 の 概 要
	(2014. 12. 2~2015. 11. 30)		
	金 額	比 率	
信託報酬	60円	0. 485%	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12, 352円です。
(投信会社)	(21)	(0. 172)	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)	(28)	(0. 226)	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)	(11)	(0. 086)	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	1	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)	(1)	(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	61	0. 490	

(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

(2014年12月2日から2015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	806,979	1,076,887	370,754	494,206

(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

(2014年12月2日から2015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	10,935	411	3.8	13,665	1,116	8.2
コール・ローン	58,152	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合13.8%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

種 類	当 期	
	日本債券インデックスマザーファンド	買 付 額
		百万円
公社債		100

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

当期中における売買委託手数料の利害関係人への支払いはありません。

※利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当期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	5,546,060	5,982,286	8,040,192

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015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	8,040,192	99.5
コール・ローン等、その他	40,594	0.5
投資信託財産総額	8,080,787	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

2015年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,080,787,395円
コール・ローン等	40,594,819
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	8,040,192,576
(B) 負債	33,402,718
未払解約金	14,220,480
未払信託報酬	18,971,531
その他未払費用	210,707
(C) 純資産総額 (A - B)	8,047,384,677
元本	6,483,005,398
次期繰越損益金	1,564,379,279
(D) 受益権総口数	6,483,005,398口
1万口当り基準価額 (C/D)	12,413円

*期首における元本額は5,980,852,159円、当期中における追加設定元本額は1,769,009,229円、同解約元本額は1,266,855,990円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,413円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月2日 至2015年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	15,260円
受取利息	15,260
(B) 有価証券売買損益	104,637,387
売買益	110,394,762
売買損	△ 5,757,375
(C) 信託報酬等	△ 37,664,208
(D) 当期損益金 (A + B + C)	66,988,439
(E) 前期繰越損益金	354,094,224
(F) 追加信託差損益金	1,143,296,616
(配当等相当額)	(1,015,836,249)
(売買損益相当額)	(127,460,367)
(G) 合計 (D + E + F)	1,564,379,279
次期繰越損益金 (G)	1,564,379,279
追加信託差損益金	1,143,296,616
(配当等相当額)	(1,015,836,249)
(売買損益相当額)	(127,460,367)
分配準備積立金	421,082,663

(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せん。

(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	11,494円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	66,976,945
(c) 収益調整金	1,143,296,616
(d) 分配準備積立金	354,094,224
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	1,564,379,279
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	1,564,379,279
(h) 受益権総口数	6,483,005,398口

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。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2014年12月1日の交付運用報告書および運用報告書 (全体版) につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額 (月末値の平均値) は12,107円です。」

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第16期 (決算日 2015年11月30日)

(計算期間 2014年12月2日～2015年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの第16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

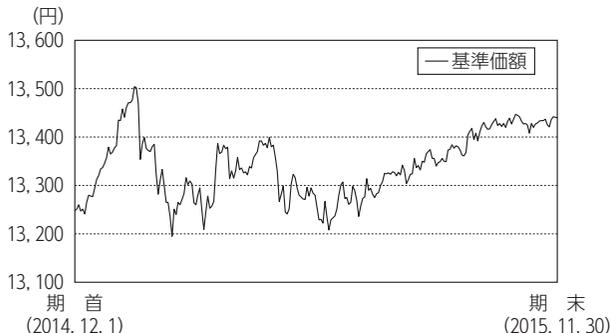
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

日本債券インデックスマザーファンド

■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 組入比率 先物比率	
	円	%	総合指数	騰落率	%	%
(期首) 2014年12月1日	13,248	—	496.247	—	99.3	—
12月末	13,378	1.0	501.199	1.0	99.4	—
2015年1月末	13,380	1.0	501.256	1.0	99.3	—
2月末	13,309	0.5	498.563	0.5	99.3	—
3月末	13,315	0.5	498.770	0.5	99.5	—
4月末	13,358	0.8	500.449	0.8	99.4	—
5月末	13,295	0.4	498.074	0.4	99.4	—
6月末	13,289	0.3	497.797	0.3	99.5	—
7月末	13,327	0.6	499.246	0.6	99.4	—
8月末	13,349	0.8	500.043	0.8	98.1	—
9月末	13,392	1.1	501.627	1.1	99.4	—
10月末	13,442	1.5	503.540	1.5	99.4	—
(期末) 2015年11月30日	13,440	1.4	503.440	1.4	98.3	—

(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。

《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：13,248円 期末：13,440円 騰落率：1.4%

【基準価額の主な変動要因】

債券からの利息収入に加えて、金利水準の低下による債券の値上がり益が発生したことにより、ベンチマーク (DBI 総合指数) の騰落率は1.4%となりました。同指数への連動をめざす当ファンドも値上がりし、期末の基準価額は13,440円、騰落率はベンチマークとほぼ同等の1.4%となりました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内長期金利は、期首から2015年1月中旬にかけて、世界経済の成長鈍化観測や原油価格急落によるインフレ圧力低下などを受けて欧米長期金利が大きく低下したことや、日銀の量的・質的金融緩和の強化により国債需給が一段と改善したことなどを背景に、低下基調を強めました。1月下旬以降は、株価の上昇や低調な国債入札などを受けて金利は上昇しました。3月半ばからは、ECB (欧州中央銀行) による国債買入れの開始や、FOMC (米連邦公開市場委員会) での低水準の政策金利見通しなどから欧米長期金利が低下したことを受けて、国内長期金利も低下しました。4月下旬以降は、欧米の早期金融引締め観測や国内景況感の改善、株価の上昇などにより、金利は上昇しました。6月半ばからは、ギリシャのデフォルト (債務不履行) 懸念や中国経済の先行き不透明感、新興国通貨安の進行、国内景況感の悪化、米国の利上げ先送り観測、株価の下落などを背景に、金利は低下基調が続きました。10月以降は、株価は上昇に転じましたが良好な国債需給が下支えとなり、金利は低位で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

今後も、ベンチマーク (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ほか、社債の信用スプレッドも落ち着いた動きが続いたことから、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方法については前掲の「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

(2014年12月2日から2015年11月30日まで)

国	内	買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	8,134,526	(10,407,171 —)
	地方債証券	723,419	(610,530 —)
	特殊債券	1,059,853	(1,236,416 —)
	社債券	1,017,552	(1,411,686 —)

(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

(2014年12月2日から2015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
338 10年国債 0.4% 2025/3/20	641,495	343 2年国債 0.1% 2016/8/15	490,648
123 5年国債 0.1% 2020/3/20	640,266	346 2年国債 0.1% 2016/11/15	400,542
122 5年国債 0.1% 2019/12/20	631,025	113 5年国債 0.3% 2018/6/20	312,411
124 5年国債 0.1% 2020/6/20	605,493	95 5年国債 0.6% 2016/3/20	302,163
339 10年国債 0.4% 2025/6/20	540,011	115 5年国債 0.2% 2018/9/20	281,583
355 2年国債 0.1% 2017/8/15	450,836	344 2年国債 0.1% 2016/9/15	275,360
337 10年国債 0.3% 2024/12/20	403,913	332 10年国債 0.6% 2023/12/20	257,239
349 2年国債 0.1% 2017/2/15	400,728	340 2年国債 0.1% 2016/5/15	255,293
152 20年国債 1.2% 2035/3/20	297,675	98 5年国債 0.3% 2016/6/20	250,863
153 20年国債 1.3% 2035/6/20	286,554	280 10年国債 1.9% 2016/6/20	241,730

(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	36,068,000	39,271,633	72.9	—	49.6	18.2	5.1
地方債証券	4,366,000	4,537,340	8.4	—	3.9	3.6	1.0
特殊債券（除く金融債券）	3,631,000	3,785,565	7.0	—	3.5	2.2	1.4
金融債券	830,000	832,630	1.5	—	—	0.4	1.2
普通社債券	4,406,000	4,544,659	8.4	—	2.1	4.2	2.1
合 計	49,301,000	52,971,829	98.3	—	59.1	28.5	10.7

(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		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	額 面 金 額		評 価 額	額 面 金 額	
国債証券		千円	%	千円	千円	
	349 2年国債	250,000	0.1000	250,345	250,345	2017/02/15
	350 2年国債	140,000	0.1000	140,214	140,214	2017/03/15
	103 5年国債	170,000	0.3000	170,693	170,693	2017/03/20
	104 5年国債	254,000	0.2000	254,706	254,706	2017/03/20
	285 10年国債	123,000	1.7000	125,725	125,725	2017/03/20
	34 利付国債20年	9,000	3.5000	9,409	9,409	2017/03/20
	35 利付国債20年	22,000	3.3000	22,943	22,943	2017/03/20
	353 2年国債	160,000	0.1000	160,281	160,281	2017/06/15
	105 5年国債	300,000	0.2000	300,996	300,996	2017/06/20
	286 10年国債	220,000	1.8000	226,182	226,182	2017/06/20
	287 10年国債	90,000	1.9000	92,668	92,668	2017/06/20
	355 2年国債	360,000	0.1000	360,702	360,702	2017/08/15
	106 5年国債	240,000	0.2000	240,928	240,928	2017/09/20
	288 10年国債	254,000	1.7000	261,840	261,840	2017/09/20
	36 利付国債20年	21,000	3.0000	22,135	22,135	2017/09/20
	37利付国債20年	23,000	3.1000	24,285	24,285	2017/09/20
	357 2年国債	100,000	0.1000	100,214	100,214	2017/10/15
	107 5年国債	290,000	0.2000	291,247	291,247	2017/12/20
	108 5年国債	115,000	0.1000	115,258	115,258	2017/12/20
	289 10年国債	48,000	1.5000	49,485	49,485	2017/12/20
	109 5年国債	150,000	0.1000	150,378	150,378	2018/03/20
	110 5年国債	180,000	0.3000	181,279	181,279	2018/03/20
	111 5年国債	210,000	0.4000	211,976	211,976	2018/03/20
	290 10年国債	132,000	1.4000	136,258	136,258	2018/03/20
	291 10年国債	179,000	1.3000	184,362	184,362	2018/03/20
	292 10年国債	155,000	1.7000	161,066	161,066	2018/03/20
	38利付国債20年	60,000	2.7000	63,726	63,726	2018/03/20
	39 20年国債	90,000	2.6000	95,382	95,382	2018/03/20
	112 5年国債	150,000	0.4000	151,566	151,566	2018/06/20
	113 5年国債	240,000	0.3000	241,896	241,896	2018/06/20
	293 10年国債	238,000	1.8000	248,945	248,945	2018/06/20
	294 10年国債	147,000	1.7000	153,385	153,385	2018/06/20

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	295 10年国債		1.5000	175,000	181,711	2018/06/20
	114 5年国債		0.3000	140,000	141,195	2018/09/20
	115 5年国債		0.2000	145,000	145,832	2018/09/20
	296 10年国債		1.5000	25,000	26,053	2018/09/20
	40 20年国債		2.3000	57,000	60,678	2018/09/20
	116 5年国債		0.2000	505,000	508,075	2018/12/20
	297 10年国債		1.4000	70,000	72,988	2018/12/20
	298 10年国債		1.3000	125,000	129,955	2018/12/20
	117 5年国債		0.2000	520,000	523,338	2019/03/20
	299 10年国債		1.3000	250,000	260,667	2019/03/20
	300 10年国債		1.5000	286,000	300,088	2019/03/20
	41 20年国債		1.5000	136,000	142,699	2019/03/20
	42 20年国債		2.6000	87,000	94,439	2019/03/20
	118 5年国債		0.2000	140,000	140,918	2019/06/20
	119 5年国債		0.1000	470,000	471,414	2019/06/20
	301 10年国債		1.5000	120,000	126,340	2019/06/20
	120 5年国債		0.2000	350,000	352,457	2019/09/20
	121 5年国債		0.1000	10,000	10,032	2019/09/20
	303 10年国債		1.4000	10,000	10,524	2019/09/20
	304 10年国債		1.3000	100,000	104,860	2019/09/20
	43 20年国債		2.9000	100,000	110,956	2019/09/20
	122 5年国債		0.1000	515,000	516,663	2019/12/20
	305 10年国債		1.3000	470,000	494,237	2019/12/20
	123 5年国債		0.1000	540,000	541,733	2020/03/20
	306 10年国債		1.4000	255,000	269,986	2020/03/20
	307 10年国債		1.3000	240,000	253,075	2020/03/20
	44 20年国債		2.5000	85,000	94,027	2020/03/20
	45 20年国債		2.4000	78,000	85,948	2020/03/20
	124 5年国債		0.1000	565,000	566,791	2020/06/20
	308 10年国債		1.3000	150,000	158,616	2020/06/20
	309 10年国債		1.1000	90,000	94,351	2020/06/20
	46 20年国債		2.2000	73,000	80,184	2020/06/22
	125 5年国債		0.1000	120,000	120,373	2020/09/20
	310 10年国債		1.0000	30,000	31,387	2020/09/20
	311 10年国債		0.8000	30,000	31,099	2020/09/20
	47 20年国債		2.2000	89,000	98,238	2020/09/21
	312 10年国債		1.2000	395,000	418,087	2020/12/20
	48 20年国債		2.5000	54,000	60,697	2020/12/21
	313 10年国債		1.3000	160,000	170,608	2021/03/20
	314 10年国債		1.1000	250,000	263,932	2021/03/20
	49 20年国債		2.1000	64,000	70,974	2021/03/22
	50 20年国債		1.9000	107,000	117,527	2021/03/22
	315 10年国債		1.2000	221,000	235,060	2021/06/20
	316 10年国債		1.1000	115,000	121,680	2021/06/20
	51 20年国債		2.0000	82,000	90,850	2021/06/21
	317 10年国債		1.1000	214,000	226,927	2021/09/20
	318 10年国債		1.0000	235,000	247,838	2021/09/20
	52 20年国債		2.1000	52,000	58,150	2021/09/21
	319 10年国債		1.1000	100,000	106,268	2021/12/20
	320 10年国債		1.0000	180,000	190,197	2021/12/20
	53 20年国債		2.1000	66,000	74,137	2021/12/20
	54 20年国債		2.2000	65,000	73,405	2021/12/20
	321 10年国債		1.0000	175,000	185,258	2022/03/20
	322 10年国債		0.9000	130,000	136,805	2022/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
			%	千円	千円	
	55 20年国債		2.0000	140,000	156,993	2022/03/21
	324 10年国債		0.8000	22,000	23,046	2022/06/20
	57 20年国債		1.9000	85,000	95,138	2022/06/20
	59 20年国債		1.7000	45,000	50,092	2022/12/20
	60 20年国債		1.4000	90,000	98,292	2022/12/20
	328 10年国債		0.6000	80,000	82,836	2023/03/20
	61 20年国債		1.0000	186,000	198,052	2023/03/20
	329 10年国債		0.8000	235,000	246,766	2023/06/20
	62 20年国債		0.8000	95,000	99,794	2023/06/20
	63 20年国債		1.8000	130,000	146,335	2023/06/20
	330 10年国債		0.8000	242,000	254,223	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	185,000	191,491	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	102,221	2023/09/20
	332 10年国債		0.6000	345,000	356,919	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	85,000	96,752	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	135,000	152,594	2023/12/20
	333 10年国債		0.6000	390,000	403,221	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	62,757	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	139,927	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	127,366	2024/03/20
	334 10年国債		0.6000	425,000	439,101	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	98,428	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	146,132	2024/06/20
	335 10年国債		0.5000	550,000	563,293	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	175,000	203,577	2024/09/20
	336 10年国債		0.5000	175,000	179,028	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	265,000	266,407	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	138,951	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	85,176	2024/12/20
	338 10年国債		0.4000	415,000	420,270	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	93,530	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	58,697	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	150,803	2025/03/20
	339 10年国債		0.4000	440,000	444,906	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	70,320	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	58,105	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	62,114	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	130,000	131,237	2025/09/20
	81 20年国債		2.0000	76,000	88,467	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	102,102	2025/09/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	109,382	2025/12/20
	84 20年国債		2.0000	100,000	116,583	2025/12/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	68,324	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	95,836	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	65,000	77,218	2026/03/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	120,080	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	92,867	2026/06/20
	90 20年国債		2.2000	120,000	143,176	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	85,000	102,301	2026/09/20
	92 20年国債		2.1000	190,000	225,131	2026/12/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	117,482	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	90,000	106,766	2027/03/20
	95 20年国債		2.3000	103,000	124,739	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	92,000	109,323	2027/06/20

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	
	97 20年国債	2.2000	81,000	97,319	2027/09/20
	98 20年国債	2.1000	130,000	154,727	2027/09/20
	99 20年国債	2.1000	195,000	232,305	2027/12/20
	100 20年国債	2.2000	142,000	171,051	2028/03/20
	101 20年国債	2.4000	55,000	67,574	2028/03/20
	102 20年国債	2.4000	80,000	98,469	2028/06/20
	103 20年国債	2.3000	70,000	85,279	2028/06/20
	104 20年国債	2.1000	85,000	101,476	2028/06/20
	105 20年国債	2.1000	126,000	150,614	2028/09/20
	106 20年国債	2.2000	87,000	105,044	2028/09/20
	107 20年国債	2.1000	107,000	128,050	2028/12/20
	108 20年国債	1.9000	107,000	125,350	2028/12/20
	109 20年国債	1.9000	110,000	128,877	2029/03/20
	110 20年国債	2.1000	110,000	131,695	2029/03/20
	111 20年国債	2.2000	100,000	121,109	2029/06/20
	112 20年国債	2.1000	152,000	182,164	2029/06/20
	1 30年国債	2.8000	16,000	20,630	2029/09/20
	113 20年国債	2.1000	140,000	167,833	2029/09/20
	114 20年国債	2.1000	130,000	155,871	2029/12/20
	115 20年国債	2.2000	115,000	139,473	2029/12/20
	2 30年国債	2.4000	24,000	29,737	2030/02/20
	116 20年国債	2.2000	89,000	108,033	2030/03/20
	117 20年国債	2.1000	165,000	197,976	2030/03/20
	3 30年国債	2.3000	30,000	36,786	2030/05/20
	118 20年国債	2.0000	59,000	70,004	2030/06/20
	119 20年国債	1.8000	93,000	107,787	2030/06/20
	120 20年国債	1.6000	150,000	169,615	2030/06/20
	121 20年国債	1.9000	175,000	205,226	2030/09/20
	122 20年国債	1.8000	95,000	110,047	2030/09/20
	4 30年国債	2.9000	36,000	47,274	2030/11/20
	123 20年国債	2.1000	140,000	168,173	2030/12/20
	124 20年国債	2.0000	110,000	130,534	2030/12/20
	125 20年国債	2.2000	85,000	103,258	2031/03/20
	126 20年国債	2.0000	70,000	83,031	2031/03/20
	127 20年国債	1.9000	91,000	106,676	2031/03/20
	5 30年国債	2.2000	28,000	34,049	2031/05/20
	128 20年国債	1.9000	119,000	139,413	2031/06/20
	129 20年国債	1.8000	105,000	121,450	2031/06/20
	130 20年国債	1.8000	110,000	127,213	2031/09/20
	131 20年国債	1.7000	127,000	144,964	2031/09/20
	6 30年国債	2.4000	24,000	29,880	2031/11/20
	132 20年国債	1.7000	72,000	82,092	2031/12/20
	133 20年国債	1.8000	190,000	219,520	2031/12/20
	134 20年国債	1.8000	50,000	57,707	2032/03/20
	135 20年国債	1.7000	92,000	104,766	2032/03/20
	136 20年国債	1.6000	100,000	112,342	2032/03/20
	7 30年国債	2.3000	55,000	67,690	2032/05/20
	137 20年国債	1.7000	85,000	96,673	2032/06/20
	138 20年国債	1.5000	102,000	112,845	2032/06/20
	139 20年国債	1.6000	70,000	78,527	2032/06/20
	140 20年国債	1.7000	260,000	295,308	2032/09/20
	8 30年国債	1.8000	27,000	31,081	2032/11/22
	9 30年国債	1.4000	43,000	46,730	2032/12/20
	141 20年国債	1.7000	170,000	192,808	2032/12/20

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	
	142 20年国債		1.8000	94,000	108,101	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	46,625	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	180,000	200,961	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	95,000	104,547	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	45,226	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	253,000	286,056	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	71,706	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	235,000	265,265	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	88,289	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	235,000	260,946	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	101,881	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	235,000	256,544	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	100,000	125,931	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	236,000	257,074	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	60,000	75,496	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	270,000	288,918	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	80,000	99,271	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	230,000	237,548	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	97,770	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	250,000	257,462	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	69,571	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	280,000	292,300	2035/06/20
	20 30年国債		2.5000	60,000	75,310	2035/09/20
	154 20年国債		1.2000	70,000	71,603	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	73,087	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	70,000	87,714	2036/03/20
	23 30年国債		2.5000	70,000	87,672	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	57,000	71,353	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	68,000	82,581	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	125,000	154,101	2037/03/20
	27 30年国債		2.5000	115,000	144,068	2037/09/20
	28 30年国債		2.5000	136,000	170,548	2038/03/20
	29 30年国債		2.4000	150,000	185,376	2038/09/20
	30 30年国債		2.3000	150,000	182,532	2039/03/20
	31 30年国債		2.2000	155,000	185,583	2039/09/20
	32 30年国債		2.3000	172,000	209,760	2040/03/20
	33 30年国債		2.0000	213,000	246,509	2040/09/20
	34 30年国債		2.2000	181,000	217,388	2041/03/20
	35 30年国債		2.0000	207,000	239,623	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	190,000	219,723	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	230,000	260,797	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	135,000	149,805	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	136,000	153,956	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	117,000	129,606	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	119,000	128,916	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	130,000	140,756	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	143,000	154,747	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	133,000	143,846	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	140,000	144,531	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	175,000	180,509	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	170,000	179,355	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	42,000	42,221	2045/09/20
	1 40年国債		2.4000	85,000	106,509	2048/03/20
	2 40年国債		2.2000	116,000	139,449	2049/03/20

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
	3 40年国債	2. 2000	74, 000	88, 953	2050/03/20
	4 40年国債	2. 2000	82, 000	98, 661	2051/03/20
	5 40年国債	2. 0000	125, 000	143, 395	2052/03/20
	6 40年国債	1. 9000	105, 000	117, 432	2053/03/20
	7 40年国債	1. 7000	114, 000	120, 868	2054/03/20
	8 40年国債	1. 4000	78, 000	75, 603	2055/03/20
種別小計	銘 柄 数 金 額	254銘柄	36, 068, 000	39, 271, 633	
地方債証券	19-2 大阪市公債	1. 8500	100, 000	102, 539	2017/05/10
	51 共同発行地方	1. 9000	100, 000	102, 843	2017/06/23
	651 東京都公債	1. 6200	100, 000	102, 787	2017/09/20
	54 共同発行地方	1. 7000	100, 000	102, 945	2017/09/25
	308 大阪府公債	1. 7300	112, 000	115, 618	2017/11/29
	654 東京都公債	1. 5800	104, 000	107, 211	2017/12/20
	19-8 福岡県公債	1. 6200	100, 000	103, 159	2017/12/20
	57 共同発行地方	1. 6500	100, 000	103, 238	2017/12/25
	61 共同発行地方	1. 5500	100, 000	103, 531	2018/04/25
	660 東京都公債	1. 5800	100, 000	103, 851	2018/06/20
	25-3 京都市5年	0. 3120	100, 000	100, 654	2018/09/27
	20-6 愛知県公債	1. 7100	100, 000	104, 896	2018/11/28
	665 東京都公債	1. 4300	100, 000	104, 161	2018/12/20
	21-2 千葉県公債	1. 5700	100, 000	105, 145	2019/05/24
	163 神奈川県公債	1. 4000	100, 000	104, 640	2019/06/20
	21-3 埼玉県公債	1. 6400	100, 000	105, 507	2019/06/25
	76 共同発行地方	1. 4000	50, 000	52, 374	2019/07/25
	21-6 千葉県公債	1. 4100	100, 000	104, 979	2019/09/25
	81 共同発行地方	1. 3200	100, 000	104, 902	2019/12/25
	21-3 広島市公債	1. 3400	100, 000	104, 961	2019/12/25
	21-5 京都市公債	1. 4500	100, 000	105, 634	2020/02/25
	471 名古屋市債	1. 2700	100, 000	105, 210	2020/06/19
	688 東京都公債	0. 9400	100, 000	103, 943	2020/09/18
	90 共同発行地方	1. 1200	100, 000	104, 803	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1. 0500	100, 000	104, 627	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1. 2600	100, 000	105, 730	2020/12/21
	699 東京都公債	1. 0200	100, 000	105, 073	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1. 0300	100, 000	105, 200	2021/11/25
	108 共同発行地方	1. 0100	100, 000	105, 283	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0. 9900	100, 000	104, 990	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0. 8300	100, 000	104, 277	2022/06/20
	361 大阪府公債	0. 9200	100, 000	104, 638	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0. 8400	100, 000	104, 151	2022/08/31
	713 東京都公債	0. 7700	100, 000	104, 001	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0. 8200	100, 000	104, 267	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0. 7960	100, 000	104, 121	2022/10/21
	117 共同発行地方	0. 7200	100, 000	103, 620	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0. 7290	100, 000	103, 682	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0. 7570	100, 000	103, 849	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0. 4600	100, 000	101, 610	2023/04/26
	126 共同発行地方	0. 8100	100, 000	104, 166	2023/09/25
	131 共同発行地方	0. 6600	100, 000	102, 842	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0. 5150	100, 000	101, 225	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0. 4600	100, 000	100, 436	2025/02/26
種別小計	銘 柄 数 金 額	44銘柄	4, 366, 000	4, 537, 340	

日本債券インデックスマザーファンド

当		期		末	
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
特殊債券 (除く金融債券)	27 政保道路機構	1.8000	100,000	102,154	2017/02/28
	27 国際協力銀行	1.7700	100,000	102,147	2017/03/17
	2 住宅支援機構	1.8000	100,000	102,176	2017/03/17
	30 政保道路機構	1.7000	112,000	114,417	2017/03/28
	33 政保道路機構	1.7000	100,000	102,279	2017/04/25
	28 道路機構	1.7700	100,000	102,987	2017/09/20
	4 政保首都高速	1.7000	100,000	102,966	2017/09/25
	47 政保道路機構	1.5000	100,000	102,959	2017/12/27
	32 道路機構	1.6100	100,000	103,421	2018/03/20
	64 政保道路機構	1.6000	219,000	228,205	2018/08/29
	5 中日本高速道路	1.8600	100,000	104,812	2018/09/20
	66 政保道路機構	1.5000	100,000	104,056	2018/09/28
	2 政保地方公営機	1.6000	100,000	104,543	2018/11/16
	24 政保中日本道	1.3000	100,000	103,876	2019/01/22
	61 道路機構	1.2400	100,000	104,761	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	105,048	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	105,428	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	111,326	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	104,806	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	104,858	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	105,062	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	104,873	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	104,584	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	104,357	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	104,524	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	104,360	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	104,587	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	103,517	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,520	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,870	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,998	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	104,122	2023/08/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	100,000	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	100,325	2025/04/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	117,622	2029/07/31
	種別小計	銘 柄 数 金 額	35銘柄	3,631,000	3,785,565
金融債券	い741 利付商工債	0.4500	100,000	100,405	2017/02/27
	い742 利付商工債	0.4000	100,000	100,358	2017/03/27
	269 信金中金	0.4000	130,000	130,496	2017/04/27
	272 信金中金	0.3000	100,000	100,247	2017/07/27
	274 信金中金	0.3000	100,000	100,257	2017/09/27
	い749 利付農林債	0.3000	100,000	100,225	2017/10/27
	い752 利付商工債	0.3000	100,000	100,244	2018/01/26
	い757 利付農林債	0.3500	100,000	100,394	2018/06/27
種別小計	銘 柄 数 金 額	8銘柄	830,000	832,630	
普通社債券	132三菱東京 UFJKB	0.4600	100,000	100,404	2017/01/24
	26 GE キャピタル	0.3130	100,000	100,146	2017/02/13
	148 オリックス	1.2600	100,000	101,339	2017/02/24
	440 関西電力	1.5200	100,000	101,559	2017/02/24
	29 みずほコーポレート	0.4600	100,000	100,411	2017/04/21
	52 日産自動車	1.1700	100,000	101,474	2017/04/28

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	
	6 日本リテールファンド	2.1700	100,000	102,899	2017/05/23
	19 ホンダファイナンス	0.3720	100,000	100,356	2017/06/20
	12 三菱東京UFJ劣	2.1600	100,000	103,232	2017/07/28
	81 住友不動産	0.5000	100,000	100,557	2017/09/11
	10 首都高速道路	0.3360	100,000	100,378	2017/09/20
	261 北海道電力	2.7750	6,000	6,299	2017/11/24
	1 富士フィルムホールデイ	0.3300	100,000	100,360	2017/12/04
	21 NTT データ	1.6000	100,000	103,441	2018/03/20
	15 NTT ドコモ	1.9600	100,000	104,729	2018/06/20
	1 明治安田2013基	0.8200	100,000	101,340	2018/08/08
	9 ジャパンリアルエステイト	0.4970	100,000	100,822	2018/08/30
	472 関西電力	1.7900	100,000	104,436	2018/11/22
	18 西日本旅客鉄	1.7000	100,000	104,857	2018/12/11
	4 リソな銀行劣後	2.7660	100,000	108,593	2019/06/20
	46 NTT ファイナンス	0.2500	100,000	100,310	2019/06/20
	14 武田薬品	0.5400	100,000	101,456	2019/07/19
	20 三井住友BK劣	2.2100	100,000	107,016	2019/07/24
	164 オリックス	1.1460	100,000	103,083	2019/08/07
	24 太平洋セメント	0.3900	100,000	100,479	2019/09/11
	423 九州電力	0.9590	100,000	102,286	2019/09/25
	62東日本旅客鉄道	1.4240	100,000	104,879	2019/09/27
	8ドイツ銀行AGロンドン	0.4700	100,000	99,513	2019/11/14
	29 東日本高速道	0.1800	100,000	99,961	2020/03/19
	260 北陸電力	2.3300	100,000	109,226	2020/05/25
	9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,450	2020/07/24
	20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	110,919	2020/07/27
	15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	107,531	2020/08/21
	17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	107,462	2020/09/16
	72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	105,473	2020/12/22
	2 イオンFS	0.5720	100,000	101,572	2021/03/18
	9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	106,884	2021/04/28
	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,303	2022/06/20
	11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	105,809	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	105,549	2022/08/25
	4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	104,435	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	103,391	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	103,637	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,100	2023/12/20
	1 三菱UFJFG劣後	0.9400	100,000	101,282	2024/06/26
種別小計	銘柄数	45銘柄			
	金額		4,406,000	4,544,659	
合計	銘柄数	386銘柄			
	金額		49,301,000	52,971,829	

(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

2015年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	52,971,829	98.2
コール・ローン等、その他	954,432	1.8
投資信託財産総額	53,926,261	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

2015年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	53,926,261,217円
コール・ローン等	773,613,981
公社債(評価額)	52,971,829,059
未収利息	177,835,149
前払費用	2,983,028
(B) 負債	61,343,002
未払金	40,390,200
未払解約金	20,952,802
(C) 純資産総額 (A - B)	53,864,918,215
元本	40,077,387,149
次期繰越損益金	13,787,531,066
(D) 受益権総口数	40,077,387,149口
1万口当り基準価額 (C/D)	13,440円

* 期首における元本額は42,232,877,887円、当期中における追加設定元本額は2,256,319,749円、同解約元本額は4,411,810,487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)346,538,523円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)2,113,073,470円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)202,491,555円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)2,951,519,418円、D-1's 日本債券インデックス769,428円、DCダイワ日本債券インデックス3,986,330,780円、ダイワ・バランスファンド35VA19,222,294,155円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)2,878,951,953円、ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)416,763,462円、ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)500,900,872円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券531,534,291円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス5,982,286,143円、ダイワライフスタイル25 419,178,583円、ダイワライフスタイル50 415,206,042円、ダイワライフスタイル75 109,548,474円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,440円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月2日 至2015年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	668,963,702円
受取利息	668,963,702
(B) 有価証券売買損益	131,788,268
売買益	367,216,030
売買損	△ 235,427,762
(C) 当期損益金 (A + B)	800,751,970
(D) 前期繰越損益金	13,718,208,123
(E) 解約差損益金	△ 1,484,546,343
(F) 追加信託差損益金	753,117,316
(G) 合計 (C + D + E + F)	13,787,531,066
次期繰越損益金 (G)	13,787,531,066

(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。