

ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド

運用報告書(全体版) 第3期

(決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日~2018年11月30日)

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信/国内/債券/インデックス型		
信託期間	約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・ボンド・インデックス(DBI)総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。		
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券	
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

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。

当ファンドは、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おります。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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/>

<4614>

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
	(分配落)	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
3 期末 (2018年11月30日)	9,917	0	△ 0.2	523.683	0.3	99.5	—	87

(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、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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 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。

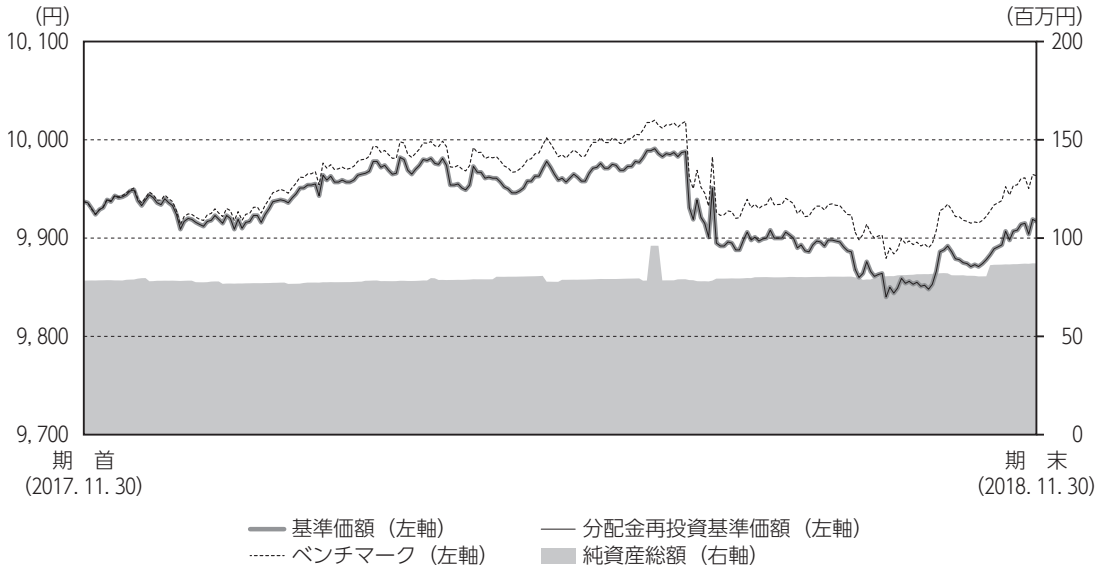
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券 (転換社債券) を除きます。

(注6) 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。

* 分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

* 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります(分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

* ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数です。

■ 基準価額・騰落率

期首：9,937円

期末：9,917円(分配金0円)

騰落率：△0.2%(分配金込み)

■ 基準価額の変動要因

金利の上昇(債券価格は下落)はマイナス要因となりましたが、債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額は横ばいとなりました。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) 2017年11月30日	9,937	—	522.295	—	99.3	—
12月末	9,940	0.0	522.656	0.1	99.4	—
2018年 1月末	9,919	△ 0.2	521.766	△ 0.1	99.4	—
2月末	9,954	0.2	523.788	0.3	99.4	—
3月末	9,965	0.3	524.618	0.4	99.3	—
4月末	9,954	0.2	524.225	0.4	99.6	—
5月末	9,972	0.4	525.397	0.6	99.1	—
6月末	9,973	0.4	525.663	0.6	99.1	—
7月末	9,951	0.1	524.694	0.5	99.3	—
8月末	9,893	△ 0.4	521.874	△ 0.1	98.9	—
9月末	9,866	△ 0.7	520.614	△ 0.3	99.5	—
10月末	9,879	△ 0.6	521.502	△ 0.2	99.4	—
(期末) 2018年11月30日	9,917	△ 0.2	523.683	0.3	99.5	—

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2017. 12. 1 ~ 2018. 11. 30)

国内債券市況

国内債券市場では、当作成期を通してみると長期金利は上昇しました。

当作成期首より、日銀の金融緩和策の縮小観測などから、長期金利は上昇しました。2018年2月以降は、政府が日銀の黒田総裁を再任する人事案を提示したことにより、金融緩和の縮小観測が後退したことなどから長期金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移が続きましたが、7月下旬に日銀が金融政策を修正するとの観測報道を受けて、長期金利は上昇しました。7月末に日銀は金融緩和継続のための枠組み強化を決定したものの、その後9月半ば以降は、米国金利の上昇や株高などを受けて長期金利は上昇しました。10月後半以降は、世界的な株安により市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期金利は低下しました。

前作成期末における「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

(2017. 12. 1 ~ 2018. 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

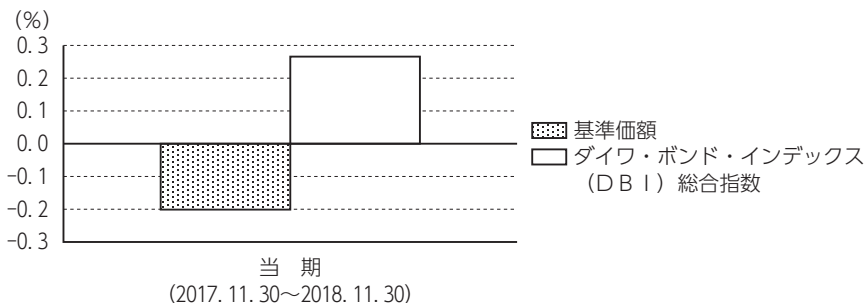
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行ないました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行なわれるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行ないました。

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.2%となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は△0.5%でした。差異の内訳は、信託報酬要因によるベンチマークとの差異が△0.5%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

当作成期は、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	
	2017年12月1日 ～2018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 (2017. 12. 1～2018. 11. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	46円	0.464%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,929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、法定書面等の作成等の対価
(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＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 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＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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＝当作成期中のその他費用／当作成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	47	0.469	

(注1) 当作成期中の費用（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。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■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

(2017年12月1日から2018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	28,820	40,331	22,696	31,792

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成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当作成期中の利害関係人との取引状況

(2017年12月1日から2018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
百万円		百万円	%			百万円
公社債	25,880	603	2.3	14,958	1,265	8.5
コール・ローン	83,878	—	—	—	—	—

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) 当作成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

当作成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、当作成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	56,164	62,288	87,042

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018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	87,042	99.7
コール・ローン等、その他	275	0.3
投資信託財産総額	87,317	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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	87,317,607円
コール・ローン等	275,115
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	87,042,492
(B) 負債	190,334
未払信託報酬	188,270
その他未払費用	2,064
(C) 純資産総額 (A - B)	87,127,273
元本	87,860,702
次期繰越損益金	△ 733,429
(D) 受益権総口数	87,860,702口
1万口当り基準価額 (C / D)	9,917円

* 期首における元本額は78,849,259円、当作成期間中における追加設定元本額は45,785,258円、同解約元本額は36,773,815円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,917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733,429円です。

■損益の状況

当期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 11円
受取利息	2
支払利息	△ 13
(B) 有価証券売買損益	173,736
売買益	268,314
売買損	△ 94,578
(C) 信託報酬等	△ 373,619
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 199,894
(E) 前期繰越損益金	△ 351,054
(F) 追加信託差損益金	△ 182,481
(配当等相当額)	(△ 105)
(売買損益相当額)	(△ 182,376)
(G) 合計 (D + E + F)	△ 733,429
次期繰越損益金 (G)	△ 733,429
追加信託差損益金	△ 182,481
(配当等相当額)	(△ 105)
(売買損益相当額)	(△ 182,376)
繰越損益金	△ 550,948

(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下記「収益分配金の計算過程 (総額)」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	87,860,702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19期 (決算日 2018年11月30日)

(作成対象期間 2017年12月1日～2018年11月30日)

日本債券インデックスマザーファンドの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
株式組入制限	純資産総額の30%以下

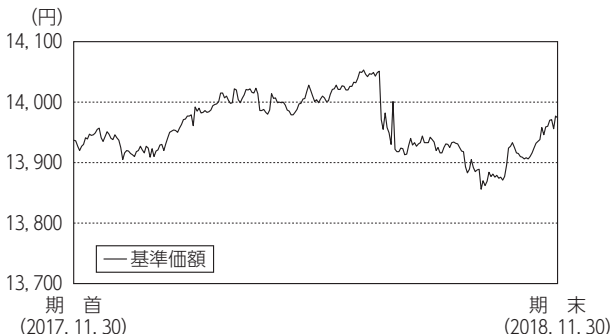
大和投資信託

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/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	%		%	%	%
(期首) 2017年11月30日	13,937	—	522.295	—	99.4	—
12月末	13,946	0.1	522.656	0.1	99.5	—
2018年 1 月末	13,923	△ 0.1	521.766	△ 0.1	99.5	—
2 月末	13,977	0.3	523.788	0.3	99.5	—
3 月末	13,998	0.4	524.618	0.4	99.4	—
4 月末	13,987	0.4	524.225	0.4	99.7	—
5 月末	14,019	0.6	525.397	0.6	99.2	—
6 月末	14,026	0.6	525.663	0.6	99.2	—
7 月末	14,001	0.5	524.694	0.5	99.4	—
8 月末	13,925	△ 0.1	521.874	△ 0.1	99.0	—
9 月末	13,892	△ 0.3	520.614	△ 0.3	99.6	—
10 月末	13,916	△ 0.2	521.502	△ 0.2	99.5	—
(期末) 2018年11月30日	13,974	0.3	523.683	0.3	99.6	—

- (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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (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。

《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：13,937円 期末：13,974円 騰落率：0.3%

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇 (債券価格は下落) はマイナス要因となりましたが、債券からの利息収入がプラス要因となり、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場では、当作成期を通してみると長期金利は上昇しました。

当作成期首より、日銀の金融緩和策の縮小観測などから、長期金利は上昇しました。2018年2月以降は、政府が日銀の黒田総裁を再任する人事案を提示したことにより、金融緩和の縮小観測が後退したことなどから長期金利は低下しました。その後はおおむねレンジ内での推移が続きましたが、7月下旬に日銀が金融政策を修正することの観測報道を受けて、長期金利は上昇しました。7月末に日銀は金融緩和継続のための枠組み強化を決定したものの、その後9月半ば以降は、米国金利の上昇や株高などを受けて長期金利は上昇しました。10月後半以降は、世界的な株安により市場のリスク回避姿勢が強まったことなどから、長期金利は低下しました。

◆前作成期末における「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。当作成期を通じて、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

当作成期のベンチマークの騰落率は0.3%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.3%となりました。

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1) 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。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2017年12月1日から2018年11月30日まで)

国	内	買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	23,825,721	(13,083,950 —)
	地方債証券	692,825	(761,442 —)
	特殊債券	234,179	(101,392 —)
	社債券	1,127,317	(1,011,646 —)

(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

(2017年12月1日から2018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
135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,141,819	117 5年国債 0.2% 2019/3/20	732,722
350 10年国債 0.1% 2028/3/20	916,238	120 5年国債 0.2% 2019/9/20	682,434
349 10年国債 0.1% 2027/12/20	854,384	121 5年国債 0.1% 2019/9/20	551,303
351 10年国債 0.1% 2028/6/20	798,948	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	503,049
124 5年国債 0.1% 2020/6/20	793,884	116 5年国債 0.2% 2018/12/20	501,870
136 5年国債 0.1% 2023/6/20	705,588	119 5年国債 0.1% 2019/6/20	481,214
383 2年国債 0.1% 2019/12/15	622,752	342 10年国債 0.1% 2026/3/20	463,132
342 10年国債 0.1% 2026/3/20	593,411	380 2年国債 0.1% 2019/9/15	330,795
339 10年国債 0.4% 2025/6/20	516,478	145 20年国債 1.7% 2033/6/20	322,350
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	515,168	374 2年国債 0.1% 2019/3/15	320,867

(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	62,354,000	67,198,735	85.6	—	55.9	20.9	8.8
地方債証券	4,100,000	4,305,812	5.5	—	2.5	2.5	0.5
特殊債券（除く金融債券）	3,100,000	3,227,508	4.1	—	1.6	2.0	0.5
金融債券	100,000	98,303	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	3,200,000	3,306,672	4.2	—	2.1	1.3	0.8
合 計	72,854,000	78,137,032	99.6	—	62.2	26.7	10.6

(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手しています。

(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		
国債証券		千円	%	千円	千円	
	383 2年国債	450,000	0.1000	451,138	451,138	2019/12/15
	122 5年国債	630,000	0.1000	631,581	631,581	2019/12/20
	305 10年国債	500,000	1.3000	507,490	507,490	2019/12/20
	385 2年国債	500,000	0.1000	501,505	501,505	2020/02/15
	123 5年国債	780,000	0.1000	782,472	782,472	2020/03/20
	306 10年国債	255,000	1.4000	260,087	260,087	2020/03/20
	307 10年国債	400,000	1.3000	407,460	407,460	2020/03/20
	44 20年国債	85,000	2.5000	87,912	87,912	2020/03/20
	45 20年国債	148,000	2.4000	152,879	152,879	2020/03/20
	124 5年国債	1,340,000	0.1000	1,345,078	1,345,078	2020/06/20
	308 10年国債	200,000	1.3000	204,458	204,458	2020/06/20
	309 10年国債	90,000	1.1000	91,728	91,728	2020/06/20
	46 20年国債	73,000	2.2000	75,654	75,654	2020/06/22
	391 2年国債	100,000	0.1000	100,416	100,416	2020/08/01
	125 5年国債	940,000	0.1000	944,145	944,145	2020/09/20
	310 10年国債	130,000	1.0000	132,670	132,670	2020/09/20
	311 10年国債	150,000	0.8000	152,539	152,539	2020/09/20
	47 20年国債	89,000	2.2000	92,757	92,757	2020/09/21
	126 5年国債	890,000	0.1000	894,467	894,467	2020/12/20
	312 10年国債	700,000	1.2000	719,173	719,173	2020/12/20
	48 20年国債	54,000	2.5000	56,929	56,929	2020/12/21
	127 5年国債	980,000	0.1000	985,409	985,409	2021/03/20
	313 10年国債	200,000	1.3000	206,600	206,600	2021/03/20
	314 10年国債	260,000	1.1000	267,384	267,384	2021/03/20
	49 20年国債	64,000	2.1000	67,297	67,297	2021/03/22
	50 20年国債	107,000	1.9000	112,020	112,020	2021/03/22
	128 5年国債	1,000,000	0.1000	1,006,000	1,006,000	2021/06/20
	315 10年国債	221,000	1.2000	228,505	228,505	2021/06/20
	316 10年国債	250,000	1.1000	257,850	257,850	2021/06/20
	51 20年国債	82,000	2.0000	86,464	86,464	2021/06/21

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
	129 5年国債		0.1000	1,020,000	1,026,579	2021/09/20
	317 10年国債		1.1000	214,000	221,357	2021/09/20
	318 10年国債		1.0000	200,000	206,314	2021/09/20
	52 20年国債		2.1000	52,000	55,250	2021/09/21
	130 5年国債		0.1000	880,000	886,186	2021/12/20
	319 10年国債		1.1000	100,000	103,746	2021/12/20
	320 10年国債		1.0000	230,000	237,912	2021/12/20
	53 20年国債		2.1000	66,000	70,490	2021/12/20
	54 20年国債		2.2000	65,000	69,621	2021/12/20
	131 5年国債		0.1000	920,000	926,992	2022/03/20
	321 10年国債		1.0000	175,000	181,510	2022/03/20
	322 10年国債		0.9000	130,000	134,405	2022/03/20
	55 20年国債		2.0000	140,000	149,844	2022/03/21
	132 5年国債		0.1000	580,000	584,645	2022/06/20
	324 10年国債		0.8000	410,000	423,427	2022/06/20
	133 5年国債		0.1000	550,000	554,719	2022/09/20
	325 10年国債		0.8000	310,000	320,877	2022/09/20
	58 20年国債		1.9000	200,000	215,410	2022/09/20
	134 5年国債		0.1000	510,000	514,666	2022/12/20
	326 10年国債		0.7000	30,000	31,000	2022/12/20
	327 10年国債		0.8000	450,000	466,834	2022/12/20
	59 20年国債		1.7000	45,000	48,330	2022/12/20
	60 20年国債		1.4000	10,000	10,618	2022/12/20
	135 5年国債		0.1000	950,000	959,015	2023/03/20
	328 10年国債		0.6000	350,000	360,874	2023/03/20
	61 20年国債		1.0000	100,000	104,810	2023/03/20
	136 5年国債		0.1000	700,000	706,874	2023/06/20
	329 10年国債		0.8000	500,000	520,900	2023/06/20
	62 20年国債		0.8000	95,000	98,948	2023/06/20
	63 20年国債		1.8000	130,000	141,341	2023/06/20
	137 5年国債		0.1000	80,000	80,790	2023/09/20
	330 10年国債		0.8000	612,000	638,854	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	365,000	377,497	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	98,700	2023/09/20
	332 10年国債		0.6000	310,000	321,085	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	192,752	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	135,000	148,009	2023/12/20
	333 10年国債		0.6000	700,000	726,068	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	60,837	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	134,650	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	122,844	2024/03/20
	334 10年国債		0.6000	800,000	830,992	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	94,517	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	140,952	2024/06/20
	335 10年国債		0.5000	780,000	806,816	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	175,000	197,275	2024/09/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	284,691	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	300,000	306,924	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	135,123	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	82,644	2024/12/20

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	
	338 10年国債		0.4000	490,000	504,714	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	90,972	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	57,350	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	147,009	2025/03/20
	339 10年国債		0.4000	780,000	804,102	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	68,878	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	56,786	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	60,541	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	770,000	794,170	2025/09/20
	81 20年国債		2.0000	76,000	86,655	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	99,791	2025/09/20
	341 10年国債		0.3000	260,000	266,528	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	107,138	2025/12/20
	342 10年国債		0.1000	830,000	839,105	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	67,103	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	93,726	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	64,034	2026/03/20
	343 10年国債		0.1000	830,000	838,789	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	117,664	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	91,188	2026/06/20
	344 10年国債		0.1000	640,000	646,246	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	23,476	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	60,000	70,898	2026/09/20
	345 10年国債		0.1000	730,000	736,759	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	362,820	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	800,000	806,968	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	116,634	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	152,703	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	330,000	332,534	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	59,775	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	55,000	64,814	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	600,000	604,212	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	47,657	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	120,000	141,919	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	750,000	754,395	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	150,000	178,012	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	810,000	813,742	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	185,911	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	75,000	91,345	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	100,659	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	600,000	601,704	2028/06/20
	102 20年国債		2.4000	80,000	97,720	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	206,041	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,930	2028/06/20
	352 10年国債		0.1000	210,000	210,304	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	150,741	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	180,912	2028/09/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	108,010	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	177,000	208,897	2028/12/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	65,085	2029/03/20

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	
	110 20年国債		2.1000	130,000	156,488	2029/03/20
	111 20年国債		2.2000	80,000	97,428	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	130,000	156,967	2029/06/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	20,515	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	150,000	181,560	2029/09/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	84,970	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	220,455	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	29,989	2030/02/20
	116 20年国債		2.2000	140,000	171,966	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	215,000	261,702	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	37,245	2030/05/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	114,814	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	110,288	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	210,000	244,278	2030/06/20
	121 20年国債		1.9000	170,000	204,011	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	160,000	190,161	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	47,523	2030/11/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	245,276	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	193,000	234,415	2030/12/20
	125 20年国債		2.2000	85,000	105,523	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	110,000	133,835	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	165,000	198,773	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	34,807	2031/05/20
	128 20年国債		1.9000	119,000	143,668	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	230,000	274,866	2031/06/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	167,531	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	80,000	94,736	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	30,594	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	150,000	177,928	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	250,000	299,715	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	80,000	96,014	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	109,232	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	185,000	217,271	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	69,727	2032/05/20
	137 20年国債		1.7000	70,000	83,243	2032/06/20
	138 20年国債		1.5000	87,000	101,181	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	235,000	276,383	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	335,000	398,985	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	32,539	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	49,475	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	220,000	262,220	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	200,000	241,084	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	49,933	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	247,583	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	200,000	233,052	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	47,771	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	380,000	453,826	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	75,195	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	230,000	275,036	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	93,087	2033/12/20

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	
	147 20年国債		1.6000	250,000	295,722	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	106,788	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	300,000	350,589	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	100,000	131,989	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	252,000	294,507	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	100,000	132,283	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	250,000	288,645	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	80,000	104,757	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	370,000	415,572	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	103,725	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	350,000	393,127	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	73,978	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	380,000	432,736	2035/06/20
	20 30年国債		2.5000	60,000	79,957	2035/09/20
	154 20年国債		1.2000	360,000	404,056	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	78,130	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	275,000	299,420	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	70,000	93,548	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	330,000	326,043	2036/03/20
	23 30年国債		2.5000	60,000	80,327	2036/06/20
	157 20年国債		0.2000	400,000	380,948	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	92,000	123,381	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	100,000	100,081	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	196,317	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	280,000	284,398	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	238,921	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	270,000	278,348	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	320,000	323,779	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	202,242	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	300,000	302,811	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	290,000	292,247	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	229,824	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	400,000	394,788	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	330,000	325,079	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	267,488	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	35,000	35,714	2038/09/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	290,813	2039/03/20
	31 30年国債		2.2000	180,000	235,207	2039/09/20
	32 30年国債		2.3000	235,000	312,493	2040/03/20
	33 30年国債		2.0000	311,000	396,070	2040/09/20
	34 30年国債		2.2000	233,000	306,905	2041/03/20
	35 30年国債		2.0000	295,000	377,443	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	320,000	410,297	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	300,000	378,846	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	220,000	273,365	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	172,000	217,739	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	140,000	174,195	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	207,775	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	176,000	215,205	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	170,000	207,964	2044/06/20

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	
	44 30年国債	1.7000	165,000	201,936	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	235,506	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	180,000	211,975	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	190,000	228,533	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	250,000	288,510	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	93,000	107,315	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	215,000	216,453	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	240,000	211,718	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	235,000	218,470	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	185,000	176,321	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	218,000	218,503	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	200,000	200,232	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	210,000	210,000	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	250,000	249,705	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	99,047	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	300,000	299,289	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	200,000	194,060	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	35,000	35,756	2048/09/20
	2 40年国債	2.2000	186,000	254,459	2049/03/20
	3 40年国債	2.2000	74,000	101,710	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	147,717	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	165,962	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	136,632	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	150,350	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	264,718	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	183,893	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	375,000	371,298	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	160,000	152,478	2058/03/20
種別小計	銘柄数	258銘柄			
	金額		62,354,000	67,198,735	
地方債証券	21-5 京都市公債	1.4500	100,000	101,782	2020/02/25
	471 名古屋市債	1.2700	100,000	101,959	2020/06/19
	688 東京都公債	0.9400	100,000	101,686	2020/09/18
	90 共同発行地方	1.1200	100,000	102,028	2020/09/25
	22-1 岡山県公債	1.0500	100,000	102,095	2020/11/30
	22-5 京都府公債	1.2600	100,000	102,588	2020/12/21
	699 東京都公債	1.0200	100,000	102,847	2021/09/17
	23-2 島根県公債	1.0300	100,000	103,057	2021/11/25
	108 共同発行地方	1.0100	100,000	103,337	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	103,311	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	102,912	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	103,200	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	103,061	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	102,910	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	103,081	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	103,060	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	102,890	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	102,918	2022/12/22

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	
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	103,119	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,971	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	103,827	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	206,709	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	103,306	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,710	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,277	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	205,899	2025/04/16
	751 東京都公債	0.3700	100,000	102,005	2025/12/19
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	199,836	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,295	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	100,413	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	120,317	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	117,573	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	120,885	2029/06/20
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	118,610	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	115,088	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	115,205	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	106,831	2035/12/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	110,197	2045/12/20
種別小計	銘 柄 数	38銘柄			
	金 額		4,100,000	4,305,812	
特殊債券 (除く金融債券)	14政保地方公共6	0.1990	100,000	100,419	2020/06/18
	61 道路機構	1.2400	100,000	101,889	2020/06/19
	13 地方公共団体	1.2780	100,000	101,969	2020/06/26
	110 政保道路機構	1.3000	100,000	102,168	2020/06/30
	3 公営企業15年	2.2000	100,000	105,595	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	102,898	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	103,058	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	103,259	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	103,310	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	103,225	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	103,125	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	103,297	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	103,256	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	103,630	2023/02/24
	19 政保政策投資C	0.6680	100,000	103,044	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	103,044	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	103,434	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,879	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	103,756	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,700	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	102,005	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,351	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	205,126	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	110,078	2027/08/25
	1 地方公共団体15年	1.3340	100,000	110,154	2028/01/28

区 分		当 期		末		
		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		86 政保道路機構	2.0000 %	100,000 千円	118,832 千円	2029/07/31
		31 地方公共団20	1.7440	100,000	117,488	2033/09/28
		223 政保道路機構	1.4270	100,000	114,840	2034/07/31
		284 政保道路機構	0.1490	200,000	186,665	2036/07/31
種別小計	銘柄数	29銘柄				
	金額			3,100,000	3,227,508	
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	98,303	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額			100,000	98,303	
普通社債券		29 東日本高速道	0.1800	100,000	100,193	2020/03/19
		260 北陸電力	2.3300	100,000	103,386	2020/05/25
		9 AUST・NZ 銀行	0.3430	100,000	100,282	2020/07/24
		20 東京三菱銀行	2.5700	100,000	104,214	2020/07/27
		15 トヨタファイナンス	1.8000	100,000	103,016	2020/08/21
		17 シティグループ・インク	2.0400	100,000	103,327	2020/09/16
		72東日本旅客鉄道	1.2800	100,000	102,548	2020/12/22
		44 野村ホールディング	0.7230	100,000	101,318	2021/02/25
		2 イオンFS	0.5720	100,000	100,459	2021/03/18
		9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	103,810	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,552	2022/06/20
		11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	104,310	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	104,149	2022/08/25
		4 JX ホールディングス	1.1450	100,000	104,148	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	102,720	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	104,250	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	103,403	2023/12/20
		1 三菱UFJFG 劣後	0.9400	100,000	103,423	2024/06/26
		5 野村不動産HD	0.9240	100,000	103,776	2025/05/30
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	103,016	2025/11/13
		4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	103,693	2025/12/18
		20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,504	2026/08/21
		17 パナソニック	0.4700	100,000	101,133	2026/09/18
		509 関西電力	0.4700	100,000	100,585	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,394	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	99,917	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	99,974	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,817	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	118,447	2029/01/29
		18 エヌティティ都市開	1.0900	100,000	106,649	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	107,302	2029/12/12
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	110,940	2045/01/27
種別小計	銘柄数	32銘柄				
	金額			3,200,000	3,306,672	
合 計	銘柄数	358銘柄				
	金額			72,854,000	78,137,032	

(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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	78,137,032	99.2
コール・ローン等、その他	629,637	0.8
投資信託財産総額	78,766,669	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

2018年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	78,766,669,145円
コール・ローン等	228,171,491
公社債 (評価額)	78,137,032,000
未収入金	202,835,000
未収利息	193,828,008
前払費用	4,802,646
(B) 負債	276,776,680
未払解約金	276,774,272
その他未払費用	2,408
(C) 純資産総額 (A - B)	78,489,892,465
元本	56,170,487,793
次期繰越損益金	22,319,404,672
(D) 受益権総口数	56,170,487,793口
1万口当り基準価額 (C/D)	13,974円

* 期首における元本額は48,889,824,254円、当作成期間中における追加設定元本額は15,940,542,707円、同解約元本額は8,659,879,168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) 129,097,081円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA (一般投資家私募) 795,274,382円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA (一般投資家私募) 105,597,525円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA (一般投資家私募) 1,111,264,823円、DCダイワ日本債券インデックス5,920,239,246円、ダイワ・バランスファンド35VA13,051,578,465円、ダイワ・バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 2,124,813,517円、ダイワ国内バランスファンド25VA (適格機関投資家専用) 293,362,664円、ダイワ国内バランスファンド30VA (適格機関投資家専用) 405,138,528円、ダイワ・ノーロード日本債券ファンド62,288,888円、ダイワファンドラップ 日本債券インデックス19,210,529,646円、ダイワ日本債券インデックス (ダイワSMA専用) 2,623,576,618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1,545,313,319円、ダイワ・インデックスセレクト 日本債券1,266,064,865円、ダイワ投信倶楽部 日本債券インデックス6,443,095,280円、ダイワライフスタイル25 452,397,864円、ダイワライフスタイル50 492,380,016円、ダイワライフスタイル75 138,475,066円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,974円です。

■損益の状況

当期 自 2017年12月1日 至 2018年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	667,283,574円
受取利息	667,528,566
支払利息	△ 244,992
(B) 有価証券売買損益	△ 497,026,750
売買益	58,461,020
売買損	△ 555,487,770
(C) その他費用	△ 37,123
(D) 当期損益金 (A + B + C)	170,219,701
(E) 前期繰越損益金	19,249,367,735
(F) 解約差損益金	△ 3,424,219,960
(G) 追加信託差損益金	6,324,037,196
(H) 合計 (D + E + F + G)	22,319,404,672
次期繰越損益金 (H)	22,319,404,672

(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。