

ダイワつみたて インデックス日本債券

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2019年12月2日）
（作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2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。

当ファンドは、わが国の公社債に投資し、投資成果をNOMURA-BPI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

大和証券投資信託委託株式会社
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）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★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NOMURA-BPI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	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%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。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			NOMURA-BPI 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(2018年11月30日)	円 10,024	円 0	% 0.2	10,029	% 0.3	% 98.5	% -	百万円 4
2 期末(2019年12月 2 日)	10,240	0	2.2	10,268	2.4	99.1	-	179

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NOMURA-BPI 総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。NOMURA-BPI は、野村証券株式会社が公表している、日本の公債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。

NOMURA-BPI に関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村証券株式会社に帰属します。野村証券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。

(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。

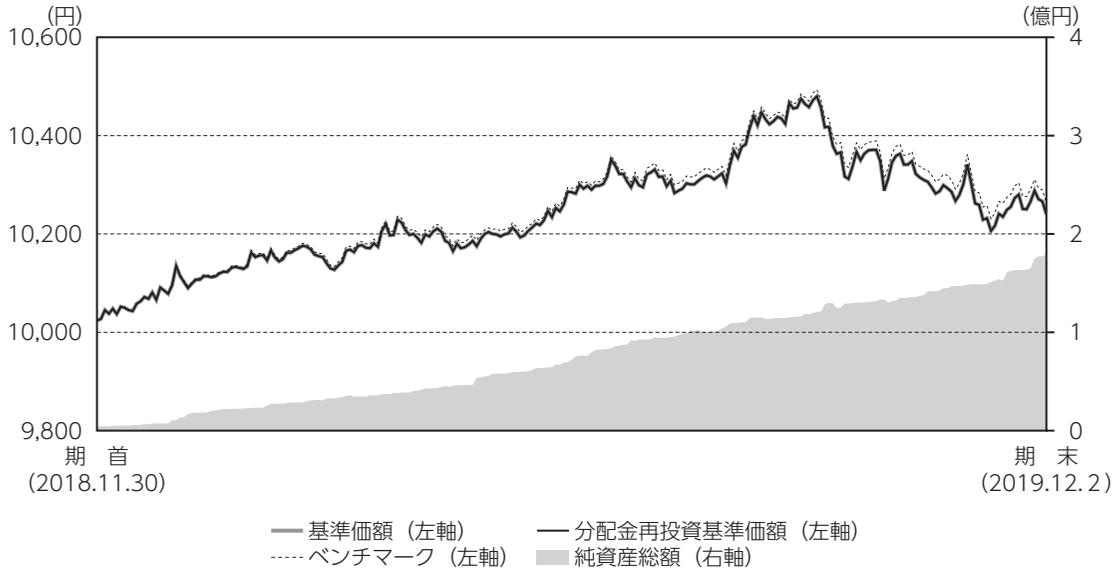
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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NOMURA-BPI総合指数です。

■基準価額・騰落率

期首：10,024円

期末：10,240円（分配金0円）

騰落率：2.2%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

金利の低下（債券価格は上昇）および債券の利息収入がいずれもプラス要因となり、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。

ダイワつみたてインデックス日本債券

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合指数 (ベンチマーク)		公 社 債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2018年11月30日	円	%		%	%	%
	10,024	—	10,029	—	98.5	—
12月末	10,096	0.7	10,105	0.8	99.0	—
2019年 1 月末	10,134	1.1	10,143	1.1	98.9	—
2 月末	10,153	1.3	10,165	1.4	98.8	—
3 月末	10,223	2.0	10,237	2.1	99.2	—
4 月末	10,190	1.7	10,205	1.8	99.1	—
5 月末	10,253	2.3	10,268	2.4	99.3	—
6 月末	10,313	2.9	10,330	3.0	99.0	—
7 月末	10,323	3.0	10,342	3.1	99.0	—
8 月末	10,464	4.4	10,483	4.5	99.4	—
9 月末	10,348	3.2	10,371	3.4	99.2	—
10月末	10,301	2.8	10,328	3.0	99.3	—
11月末	10,266	2.4	10,294	2.6	98.7	—
(期末) 2019年12月 2 日	10,240	2.2	10,268	2.4	99.1	—

(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

(2018.12.1～2019.12.2)

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低下しました。

当作成期首より、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。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、長期金利はさらに低下しました。しかし2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で長期金利は上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の受益証券を中心に組み入れ、ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）に連動することをめざした運用を行います。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。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、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

ポートフォリオについて

(2018.12.1～2019.12.2)

■当ファンド

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」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いました。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

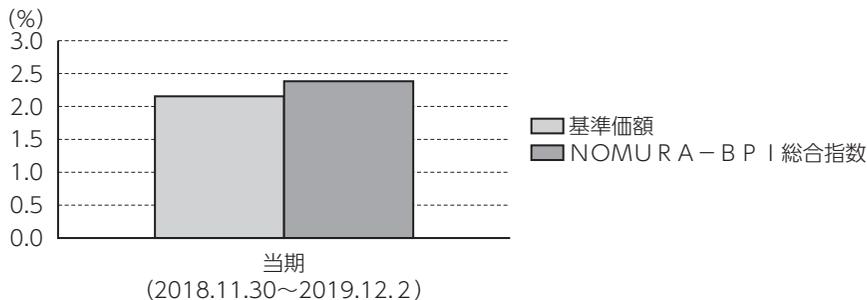
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

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2.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.2%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 $\Delta 0.2\%$ 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 $\Delta 0.1\%$ 程度、「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」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、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、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2018年12月1日 ～2019年12月2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）	240

(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

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」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います。

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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ってまいります。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、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は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 (2018.12.1～2019.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	13円	0.131%	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10,244円です。
(投 信 会 社)	(6)	(0.060)	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)	(6)	(0.060)	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)	(1)	(0.011)	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	0	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)	(0)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	14	0.135	

(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。

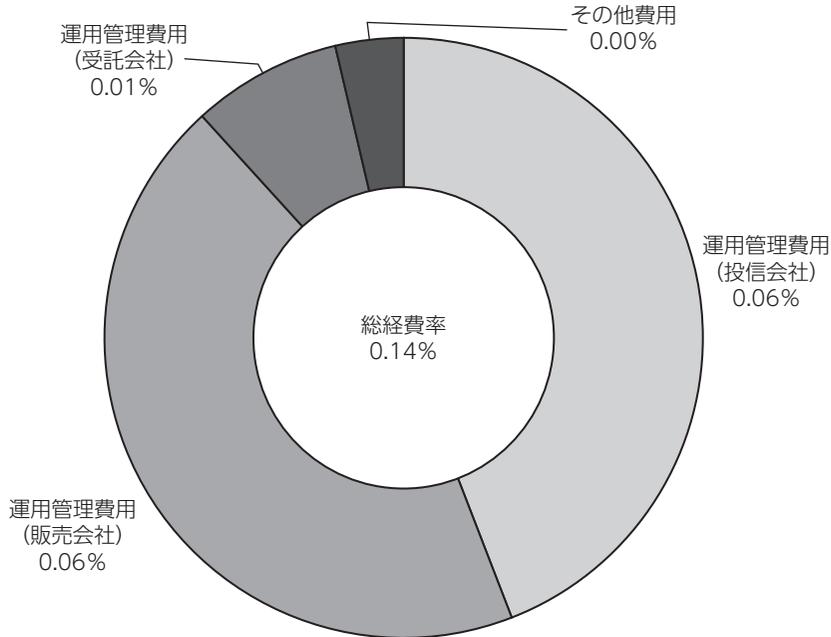
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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前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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.14%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

ダイワつみたてインデックス日本債券

■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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(BPI)	147,931	192,891	13,916	18,213

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 6,468	百万円 476	% 7.4	百万円 3,402	百万円 303	% 8.9
コール・ローン	28,737	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合0.4%

※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。

■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	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)	3,404	137,420	178,865			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(BPI)	178,865	99.9
コール・ローン等、その他	266	0.1
投資信託財産総額	179,132	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

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	179,132,602円
コール・ローン等	266,728
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(BPI)(評価額)	178,865,874
(B) 負債	89,230
未払信託報酬	85,994
その他未払費用	3,236
(C) 純資産総額(A - B)	179,043,372
元本	174,843,040
次期繰越損益金	4,200,332
(D) 受益権総口数	174,843,040口
1万口当り基準価額(C/D)	10,240円

*期首における元本額は4,325,015円、当作成期間中における追加設定元本額は197,555,476円、同解約元本額は27,037,451円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,240円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 26円
受取利息	2
支払利息	△ 28
(B) 有価証券売買損益	△ 394,959
売買益	164,920
売買損	△ 559,879
(C) 信託報酬等	△ 115,535
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 510,520
(E) 前期繰越損益金	14,116
(F) 追加信託差損益金	4,696,736
(配当等相当額)	(766,304)
(売買損益相当額)	(3,930,432)
(G) 合計(D + E + F)	4,200,332
次期繰越損益金(G)	4,200,332
追加信託差損益金	4,696,736
(配当等相当額)	(766,304)
(売買損益相当額)	(3,930,432)
分配準備積立金	14,116
繰越損益金	△ 510,520

- (注1) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。
(注2) 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	4,186,242
(d) 分配準備積立金	14,116
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	4,200,358
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	4,200,358
(h) 受益権総口数	174,843,040口

《お知らせ》

■信託報酬率の変更について

2019年8月24日に信託報酬率を次のとおり変更しました。

(純資産総額に対して年率)

	信託報酬率（税抜）				
	新発10年国債の利回り	委託会社	販売会社	受託会社	合計
変更前	1%未満の場合	0.070%	0.070%	0.01%	0.15%
	1%以上の場合	0.110%	0.110%	0.02%	0.24%
変更後	1%未満の場合	0.055%	0.055%	0.01%	0.12%
	1%以上の場合				

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。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

運用報告書 第15期（決算日 2019年12月2日）

（作成対象期間 2018年12月1日～2019年12月2日）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）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。

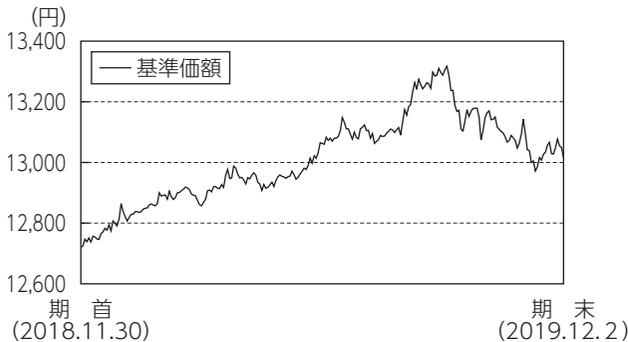
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和投資信託

Daiwa Asset Management

大和証券投資信託委託株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
<https://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		NOMURA-BPI 総 合 指 数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	%	ベンチマーク	%		
(期首)2018年11月30日	12,720	-	12,740	-	98.6	-
12月末	12,814	0.7	12,836	0.8	99.1	-
2019年1月末	12,864	1.1	12,885	1.1	99.0	-
2月末	12,890	1.3	12,913	1.4	98.9	-
3月末	12,981	2.1	13,004	2.1	99.3	-
4月末	12,940	1.7	12,964	1.8	99.2	-
5月末	13,022	2.4	13,043	2.4	99.4	-
6月末	13,100	3.0	13,122	3.0	99.1	-
7月末	13,115	3.1	13,138	3.1	99.1	-
8月末	13,296	4.5	13,316	4.5	99.5	-
9月末	13,150	3.4	13,175	3.4	99.3	-
10月末	13,092	2.9	13,119	3.0	99.4	-
11月末	13,049	2.6	13,077	2.6	98.8	-
(期末)2019年12月2日	13,016	2.3	13,043	2.4	99.2	-

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) NOMURA-BPI総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。NOMURA-BPIは、野村證券株式会社が公表している、日本の公算債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数であり、一定の組入基準に基づいて構成されたポートフォリオのパフォーマンスをもとに計算されます。NOMURA-BPIに関する一切の知的財産権その他一切の権利は、すべて野村證券株式会社に帰属します。野村證券株式会社は、ファンドの運用成果等に関し、一切責任ありません。
- (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：12,720円 期末：13,016円 騰落率：2.3%

【基準価額の主な変動要因】

金利の低下により債券価格が上昇したことなどから、基準価額は上昇しました。

◆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低下（債券価格は上昇）しました。

当作成期首より、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。また、米国を中心とした世界的な景気悪化懸念や米国の利上げ停止観測の高まりも、金利の低下要因となりました。その後も、米国で利下げ観測が高まったことや米中貿易摩擦への懸念によるリスク回避姿勢などを受けて、長期金利はさらに低下しました。2019年9月に入ると、米中通商交渉などへの懸念が和らいだことなどから金利は上昇しました。当作成期末にかけても、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で長期金利は上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマーク（NOMURA-BPI総合指数）との高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。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、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は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いました。当作成期を通じて、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2.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.3%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は△0.1%程度で、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》

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ってまいります。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、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は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 (その他)	0 (0)
合計	0

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

国	内	債種	買付額	売付額
			千円	千円
		国債証券	5,821,557	2,897,276 (-)
		地方債証券	526,659	101,560 (-)
		特殊債券	120,665	302,579 (-)
		社債券	-	101,295 (-)

(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

(2018年12月1日から2019年12月2日まで)

買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	263,704	125 5年国債 0.1% 2020/9/20	371,417
345 10年国債 0.1% 2026/12/20	234,865	126 5年国債 0.1% 2020/12/20	233,636
354 10年国債 0.1% 2029/3/20	214,843	386 2年国債 0.1% 2020/3/15	170,462
140 5年国債 0.1% 2024/6/20	203,645	113 20年国債 2.1% 2029/9/20	123,400
139 5年国債 0.1% 2024/3/20	202,982	124 5年国債 0.1% 2020/6/20	120,330
356 10年国債 0.1% 2029/9/20	201,864	309 10年国債 1.1% 2020/6/20	104,368
406 2年国債 0.1% 2021/11/1	180,982	346 10年国債 0.1% 2027/3/20	103,638
346 10年国債 0.1% 2027/3/20	162,640	340 10年国債 0.4% 2025/9/20	103,624
352 10年国債 0.1% 2028/9/20	161,537	343 10年国債 0.1% 2026/6/20	103,083
403 2年国債 0.1% 2021/8/1	161,240	354 10年国債 0.1% 2029/3/20	102,514

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。
 (注2) 単位未満は切捨て。

■ 組入資産明細表

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

区分	当			末			
	額面金額	評価額	組入比率	うち8B格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	15,461,000	17,000,589	83.8	-	54.3	22.4	7.2
地方債証券	1,400,000	1,456,376	7.2	-	5.2	2.0	-
特殊債券 (除く金融債券)	600,000	629,845	3.1	-	1.6	1.5	-
金融債券	100,000	99,920	0.5	-	-	-	0.5
普通社債券	900,000	935,589	4.6	-	3.1	0.5	1.0
合	18,461,000	20,122,321	99.2	-	64.1	26.4	8.7

(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。
 (注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入力しています。

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

区分	当			末		
	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円		
国債証券	398 2年国債	0.1000	100,000	100,329	2021/03/01	
	127 5年国債	0.1000	140,000	140,470	2021/03/20	
	313 10年国債	1.3000	34,000	34,638	2021/03/20	
	314 10年国債	1.1000	77,000	78,246	2021/03/20	
	49 20年国債	2.1000	4,000	4,117	2021/03/22	
	50 20年国債	1.9000	30,000	30,804	2021/03/22	
	401 2年国債	0.1000	50,000	50,202	2021/06/01	
	128 5年国債	0.1000	227,948	227,948	2021/06/20	
	315 10年国債	1.2000	90,000	91,902	2021/06/20	
	316 10年国債	1.1000	56,000	57,097	2021/06/20	
	51 20年国債	2.0000	25,000	25,839	2021/06/21	
	403 2年国債	0.1000	160,000	160,731	2021/08/01	
	129 5年国債	0.1000	182,000	182,900	2021/09/20	
	317 10年国債	1.1000	40,000	40,912	2021/09/20	
	318 10年国債	1.0000	33,000	33,693	2021/09/20	
	52 20年国債	2.1000	19,000	19,776	2021/09/21	
	406 2年国債	0.1000	180,000	180,948	2021/11/01	
	130 5年国債	0.1000	217,000	218,223	2021/12/20	
	319 10年国債	1.1000	140,000	143,635	2021/12/20	
	320 10年国債	1.0000	35,000	35,837	2021/12/20	
	53 20年国債	2.1000	13,000	13,605	2021/12/20	
	54 20年国債	2.2000	14,000	14,681	2021/12/20	
	131 5年国債	0.1000	190,000	191,223	2022/03/20	
	321 10年国債	1.0000	65,000	66,750	2022/03/20	
	322 10年国債	0.9000	140,000	143,448	2022/03/20	
	55 20年国債	2.0000	41,000	43,055	2022/03/21	
	132 5年国債	0.1000	170,000	171,215	2022/06/20	
	323 10年国債	0.9000	70,000	71,914	2022/06/20	
	324 10年国債	0.8000	80,000	81,983	2022/06/20	
	56 20年国債	2.0000	12,000	12,667	2022/06/20	
	57 20年国債	1.9000	24,000	25,272	2022/06/20	
	133 5年国債	0.1000	200,000	201,716	2022/09/20	
	325 10年国債	0.8000	160,000	164,384	2022/09/20	
	58 20年国債	1.9000	35,000	37,041	2022/09/20	
	134 5年国債	0.1000	120,000	121,084	2022/12/20	
	326 10年国債	0.7000	20,000	20,539	2022/12/20	
	327 10年国債	0.8000	90,000	92,701	2022/12/20	
	59 20年国債	1.7000	3,000	3,172	2022/12/20	
	135 5年国債	0.1000	230,000	232,210	2023/03/20	
	328 10年国債	0.6000	60,000	61,549	2023/03/20	

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

区 分	当 期		未		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千 円	千 円	
61	20年国債	1.0000	40,000	41,563	2023/03/20
136	5年国債	0.1000	100,000	101,035	2023/06/20
329	10年国債	0.8000	160,000	165,593	2023/06/20
62	20年国債	0.8000	16,000	16,559	2023/06/20
63	20年国債	1.8000	30,000	32,113	2023/06/20
137	5年国債	0.1000	170,000	171,786	2023/09/20
330	10年国債	0.8000	81,000	84,018	2023/09/20
331	10年国債	0.6000	130,000	133,850	2023/09/20
64	20年国債	1.9000	35,000	37,768	2023/09/20
138	5年国債	0.1000	190,000	192,090	2023/12/20
332	10年国債	0.6000	65,000	67,052	2023/12/20
65	20年国債	1.9000	42,000	45,542	2023/12/20
66	20年国債	1.8000	30,000	32,407	2023/12/20
139	5年国債	0.1000	200,000	202,334	2024/03/20
333	10年国債	0.6000	83,000	85,782	2024/03/20
67	20年国債	1.9000	19,000	20,700	2024/03/20
68	20年国債	2.2000	25,000	27,562	2024/03/20
69	20年国債	2.1000	12,000	13,178	2024/03/20
140	5年国債	0.1000	200,000	202,380	2024/06/20
334	10年国債	0.6000	220,000	227,706	2024/06/20
70	20年国債	2.4000	18,000	20,109	2024/06/20
71	20年国債	2.2000	17,000	18,836	2024/06/20
141	5年国債	0.1000	150,000	151,884	2024/09/20
335	10年国債	0.5000	210,000	216,751	2024/09/20
72	20年国債	2.1000	53,000	58,790	2024/09/20
337	10年国債	0.3000	50,000	51,196	2024/12/20
338	10年国債	0.4000	70,000	72,111	2025/03/20
75	20年国債	2.1000	14,000	15,688	2025/03/20
76	20年国債	1.9000	25,000	27,749	2025/03/20
339	10年国債	0.4000	25,000	25,790	2025/06/20
78	20年国債	1.9000	17,000	18,959	2025/06/20
79	20年国債	2.0000	14,000	15,691	2025/06/20
340	10年国債	0.4000	160,000	165,291	2025/09/20
81	20年国債	2.0000	65,000	73,215	2025/09/20
82	20年国債	2.1000	28,000	31,702	2025/09/20
341	10年国債	0.3000	15,000	15,425	2025/12/20
85	20年国債	2.1000	31,000	35,442	2026/03/20
86	20年国債	2.3000	6,000	6,936	2026/03/20
343	10年国債	0.1000	92,000	93,612	2026/06/20
88	20年国債	2.3000	33,000	38,356	2026/06/20
89	20年国債	2.2000	15,000	17,335	2026/06/20
344	10年国債	0.1000	38,000	38,678	2026/09/20
345	10年国債	0.1000	280,000	285,188	2026/12/20
92	20年国債	2.1000	45,000	52,210	2026/12/20
346	10年国債	0.1000	100,000	101,918	2027/03/20
93	20年国債	2.0000	18,000	20,853	2027/03/20
94	20年国債	2.1000	45,000	52,465	2027/03/20
347	10年国債	0.1000	180,000	183,502	2027/06/20
95	20年国債	2.3000	30,000	35,595	2027/06/20
96	20年国債	2.1000	23,000	26,938	2027/06/20
348	10年国債	0.1000	170,000	173,352	2027/09/20
97	20年国債	2.2000	25,000	29,611	2027/09/20
98	20年国債	2.1000	34,000	40,003	2027/09/20
349	10年国債	0.1000	170,000	173,389	2027/12/20
99	20年国債	2.1000	53,000	62,635	2027/12/20
350	10年国債	0.1000	185,000	188,644	2028/03/20
100	20年国債	2.2000	35,000	41,819	2028/03/20
101	20年国債	2.4000	18,000	21,808	2028/03/20
351	10年国債	0.1000	160,000	163,038	2028/06/20
102	20年国債	2.4000	10,000	12,165	2028/06/20
103	20年国債	2.3000	21,000	25,365	2028/06/20
104	20年国債	2.1000	64,000	76,200	2028/06/20
352	10年国債	0.1000	180,000	183,276	2028/09/20
105	20年国債	2.1000	38,000	45,439	2028/09/20

区 分	当 期		未		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千 円	千 円	
106	20年国債	2.2000	16,000	19,274	2028/09/20
353	10年国債	0.1000	130,000	132,312	2028/12/20
107	20年国債	2.1000	20,000	23,994	2028/12/20
108	20年国債	1.9000	68,000	80,342	2028/12/20
354	10年国債	0.1000	110,000	111,853	2029/03/20
109	20年国債	1.9000	60,000	71,089	2029/03/20
110	20年国債	2.1000	27,000	32,495	2029/03/20
355	10年国債	0.1000	30,000	30,475	2029/06/20
111	20年国債	2.2000	35,000	42,593	2029/06/20
112	20年国債	2.1000	40,000	48,294	2029/06/20
356	10年国債	0.1000	198,000	200,922	2029/09/20
113	20年国債	2.1000	70,000	84,816	2029/09/20
114	20年国債	2.1000	45,000	54,686	2029/12/20
115	20年国債	2.2000	42,000	51,463	2029/12/20
2	30年国債	2.4000	9,000	11,235	2030/02/20
116	20年国債	2.2000	27,000	33,199	2030/03/20
117	20年国債	2.1000	77,000	93,885	2030/03/20
3	30年国債	2.3000	4,000	4,970	2030/05/20
118	20年国債	2.0000	13,000	15,766	2030/06/20
119	20年国債	1.8000	23,000	27,408	2030/06/20
120	20年国債	1.6000	75,000	87,792	2030/06/20
4	30年国債	2.9000	8,000	10,537	2030/11/20
123	20年国債	2.1000	42,000	51,714	2030/12/20
124	20年国債	2.0000	45,000	54,911	2030/12/20
125	20年国債	2.2000	25,000	31,158	2031/03/20
126	20年国債	2.0000	21,000	25,699	2031/03/20
127	20年国債	1.9000	53,000	64,263	2031/03/20
5	30年国債	2.2000	8,000	9,994	2031/05/20
128	20年国債	1.9000	32,000	38,906	2031/06/20
129	20年国債	1.8000	45,000	54,194	2031/06/20
130	20年国債	1.8000	28,000	33,825	2031/09/20
131	20年国債	1.7000	70,000	83,741	2031/09/20
6	30年国債	2.4000	9,000	11,535	2031/11/20
132	20年国債	1.7000	25,000	29,975	2031/12/20
133	20年国債	1.8000	57,000	69,027	2031/12/20
134	20年国債	1.8000	15,000	18,207	2032/03/20
135	20年国債	1.7000	20,000	24,031	2032/03/20
136	20年国債	1.6000	65,000	77,309	2032/03/20
7	30年国債	2.3000	12,000	15,343	2032/05/20
137	20年国債	1.7000	18,000	21,689	2032/06/20
139	20年国債	1.6000	92,000	109,709	2032/06/20
141	20年国債	1.7000	48,000	58,115	2032/12/20
142	20年国債	1.8000	60,000	73,419	2032/12/20
10	30年国債	1.1000	15,000	17,012	2033/03/20
143	20年国債	1.6000	48,000	57,596	2033/03/20
144	20年国債	1.5000	60,000	71,206	2033/03/20
11	30年国債	1.7000	9,000	10,946	2033/06/20
145	20年国債	1.7000	100,000	121,626	2033/06/20
12	30年国債	2.1000	11,000	14,003	2033/09/20
146	20年国債	1.7000	86,000	104,797	2033/09/20
13	30年国債	2.0000	11,000	13,894	2033/12/20
147	20年国債	1.6000	89,000	107,492	2033/12/20
14	30年国債	2.4000	22,000	29,109	2034/03/20
148	20年国債	1.5000	74,000	88,473	2034/03/20
15	30年国債	2.5000	21,000	28,164	2034/06/20
149	20年国債	1.5000	100,000	119,728	2034/06/20
16	30年国債	2.5000	26,000	34,996	2034/09/20
150	20年国債	1.4000	75,000	88,892	2034/09/20
17	30年国債	2.4000	17,000	22,711	2034/12/20
151	20年国債	1.2000	104,000	120,333	2034/12/20
18	30年国債	2.3000	20,000	26,507	2035/03/20
152	20年国債	1.2000	100,000	115,870	2035/03/20
19	30年国債	2.3000	15,000	19,929	2035/06/20
153	20年国債	1.3000	100,000	117,558	2035/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

区 分	当 期		未		償還年月日
	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	20 30年国債	2.5000	16,000	21,819	2035/09/20
	154 20年国債	1.2000	87,000	101,018	2035/09/20
	21 30年国債	2.3000	16,000	21,373	2035/12/20
	155 20年国債	1.0000	93,000	105,139	2035/12/20
	22 30年国債	2.5000	17,000	23,316	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	76,000	78,646	2036/03/20
	23 30年国債	2.5000	16,000	22,016	2036/06/20
	157 20年国債	0.2000	93,000	93,148	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	15,000	20,690	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	95,000	99,712	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	17,000	22,960	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	82,000	87,406	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	32,000	43,877	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	80,000	86,613	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	80,000	85,207	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	32,000	44,686	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	75,000	79,881	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	72,000	76,682	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	34,000	47,758	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	90,000	94,182	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	95,000	99,385	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	43,000	59,920	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	70,000	75,723	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	70,000	73,115	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	56,000	77,413	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	55,000	56,414	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	80,000	80,520	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	55,000	75,444	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	30,000	30,168	2039/09/20
	32 30年国債	2.3000	59,000	82,438	2040/03/20
	33 30年国債	2.0000	65,000	87,400	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	70,000	97,497	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	68,000	92,312	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	64,000	87,281	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	87,000	117,328	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	45,000	59,891	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	50,000	67,817	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	44,000	58,790	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	34,000	44,725	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	53,000	69,801	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	37,000	48,786	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	42,000	55,442	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	43,000	54,828	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	55,000	70,186	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	44,000	57,299	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	50,000	62,718	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	68,000	85,450	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	49,000	54,243	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	55,000	53,938	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	57,000	58,734	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	55,000	58,038	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	55,000	60,862	2047/03/20
	55 30年国債	0.8000	56,000	61,941	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	50,000	55,279	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	50,000	55,322	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	30,000	46,010	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	55,000	60,823	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	55,000	59,379	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	122,000	138,287	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	50,000	53,903	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	23,000	34,304	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	46,000	47,082	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	50,000	49,737	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	37,000	36,755	2049/09/20

区 分	当 期		未		償還年月日
	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額	
		%	千円	千円	
	3 40年国債	2.2000	19,000	28,587	2050/03/20
	4 40年国債	2.2000	30,000	45,524	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	35,000	51,531	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	28,000	40,698	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	31,000	43,414	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	23,000	30,159	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	40,000	39,376	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	91,000	104,913	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	85,000	95,183	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	60,000	60,798	2059/03/20
種別	銘柄数				
小計	金額		242銘柄	15,461,000	17,000,589
地方債証券					
	116 共同発行地方	0.8000	100,000	102,233	2022/11/25
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	102,049	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	102,246	2023/01/31
	25-6 大阪市公債	0.6940	100,000	102,606	2023/11/22
	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	102,654	2025/04/16
	401 大阪府公債	0.4770	100,000	102,340	2025/10/29
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,818	2025/12/19
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,831	2026/02/26
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	100,025	2026/03/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,812	2026/06/19
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,847	2027/03/25
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	101,147	2028/01/25
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	119,997	2029/12/14
	11 兵庫県公債20年	1.8400	100,000	117,766	2030/08/16
種別	銘柄数				
小計	金額		14銘柄	1,400,000	1,456,376
特殊債券 (除く金融債券)					
	36 地方公共団体	0.8920	100,000	102,109	2022/05/27
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,053	2023/05/31
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,357	2024/10/28
	241 政保道路機構	0.4500	100,000	102,195	2025/03/31
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	102,055	2025/11/28
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	119,074	2029/05/31
種別	銘柄数				
小計	金額		6銘柄	600,000	629,845
金融債券					
	い789 利付商工債	0.0500	100,000	99,920	2021/02/26
種別	銘柄数				
小計	金額		1銘柄		
普通社債券					
	44 野村ホールディング	0.7230	100,000	100,715	2021/02/25
	33 中日本高速道	1.0840	100,000	101,854	2021/09/17
	32 東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	109,369	2024/03/19
	25 西日本高速道	0.5240	100,000	102,196	2024/12/20
	497 関西電力	1.0020	100,000	103,938	2025/06/20
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,811	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,878	2026/09/18
	80 三菱地所	2.3050	100,000	114,686	2027/03/19
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	102,139	2032/09/17
種別	銘柄数				
小計	金額		9銘柄	900,000	935,589
合計					
種別	銘柄数				
小計	金額		272銘柄	18,461,000	20,122,321

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	20,122,321	96.7
コール・ローン等、その他	679,093	3.3
投資信託財産総額	20,801,415	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

2019年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	20,801,415,143円
コール・ローン等	170,206,989
公社債(評価額)	20,122,321,570
未収入金	459,240,410
未収利息	47,258,112
前払費用	2,388,062
(B) 負債	526,359,476
未払金	526,178,400
未払解約金	181,000
その他未払費用	76
(C) 純資産総額(A - B)	20,275,055,667
元本	15,576,806,254
次期繰越損益金	4,698,249,413
(D) 受益権総口数	15,576,806,254口
1万口当り基準価額(C/D)	13,016円

*期首における元本額は13,410,003,789円、当作成期間中における追加設定元本額は3,201,161,525円、同解約元本額は1,034,359,060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、日本債券インデックスファンド(FOFs用) (適格機関投資家専用) 123,192,640円、DCダイワ・ターゲットイヤー2050 691,398円、iFree 日本債券インデックス134,453,522円、iFree 8資産バランス1,690,475,354円、ダイワ・ライフ・バランス30 6,291,935,054円、ダイワ・ライフ・バランス50 3,575,170,128円、ダイワ・ライフ・バランス70 1,121,697,462円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/安定コース) 922,883,677円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/6分散コース) 708,809,544円、DCダイワ・ワールドアセット(六つの羽/成長コース) 235,377,772円、DCダイワ・ターゲットイヤー2020 52,424,242円、DCダイワ・ターゲットイヤー2030 64,246,441円、DCダイワ・ターゲットイヤー2040 8,584,189円、ダイワつみたてインデックス日本債券137,420,002円、ダイワつみたてインデックスバランス30 1,009,335円、ダイワつみたてインデックスバランス50 358,023円、ダイワつみたてインデックスバランス70 876,781円、ダイワ世界バランスファンド4.0VA310,734,470円、ダイワ世界バランスファンド6.0VA196,466,220円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は13,016円です。

■損益の状況

当期 自2018年12月1日 至2019年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	155,928,839円
受取利息	156,004,923
支払利息	△ 76,084
(B) 有価証券売買損益	236,650,960
売買益	327,270,280
売買損	△ 90,619,320
(C) その他費用	△ 4,944
(D) 当期損益金(A + B + C)	392,574,855
(E) 前期繰越損益金	3,647,972,046
(F) 解約差損益金	△ 309,199,646
(G) 追加信託差損益金	966,902,158
(H) 合計(D + E + F + G)	4,698,249,413
次期繰越損益金(H)	4,698,249,413

(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。