

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4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)

★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

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/>

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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2016年11月30日)	10,035	0	0.4	524.807	0.7	98.4	—	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
4 期末 (2019年12月 2 日)	10,102	0	1.9	536.068	2.4	99.5	—	117

(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。

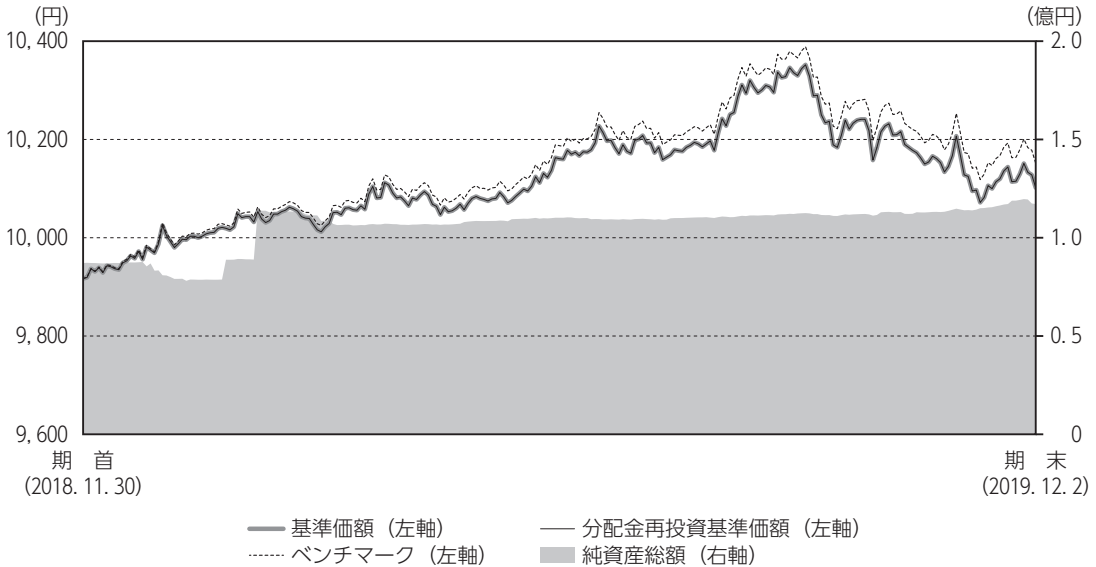
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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（DB I）総合指数です。

■ 基準価額・騰落率

期首：9,917円

期末：10,102円（分配金0円）

騰落率：1.9%（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・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
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2018年11月30日	円	%		%	%	%
	9,917	—	523.683	—	99.5	—
12月末	9,987	0.7	527.623	0.8	99.5	—
2019年1月末	10,022	1.1	529.658	1.1	99.4	—
2月末	10,039	1.2	530.781	1.4	99.4	—
3月末	10,107	1.9	534.623	2.1	99.4	—
4月末	10,070	1.5	532.961	1.8	99.5	—
5月末	10,131	2.2	536.316	2.4	99.2	—
6月末	10,189	2.7	539.597	3.0	99.1	—
7月末	10,197	2.8	540.217	3.2	99.3	—
8月末	10,336	4.2	547.729	4.6	99.4	—
9月末	10,218	3.0	541.725	3.4	99.5	—
10月末	10,167	2.5	539.302	3.0	99.5	—
11月末	10,128	2.1	537.478	2.6	99.0	—
(期末)2019年12月2日	10,102	1.9	536.068	2.4	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

(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。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

「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、ファンドの資金流出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、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

(2018. 12. 1 ~ 2019. 12. 2)

■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

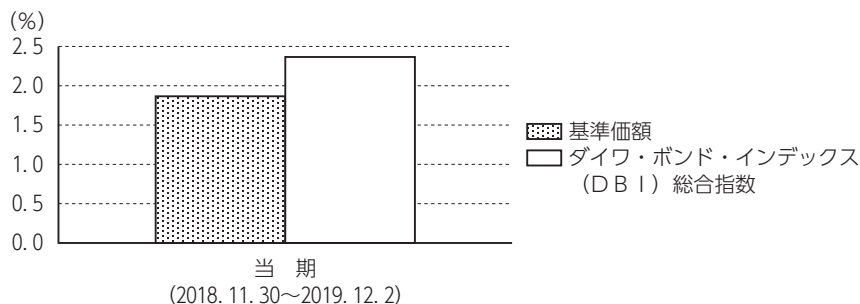
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッドの変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

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1.9%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、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)	101

(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 (2018. 12. 1～2019. 12. 2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	47円	0.468%	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10,122円です。
(投 信 会 社)	(22)	(0.218)	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)	(22)	(0.218)	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)	(0.033)	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
(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	48	0.474	

(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。

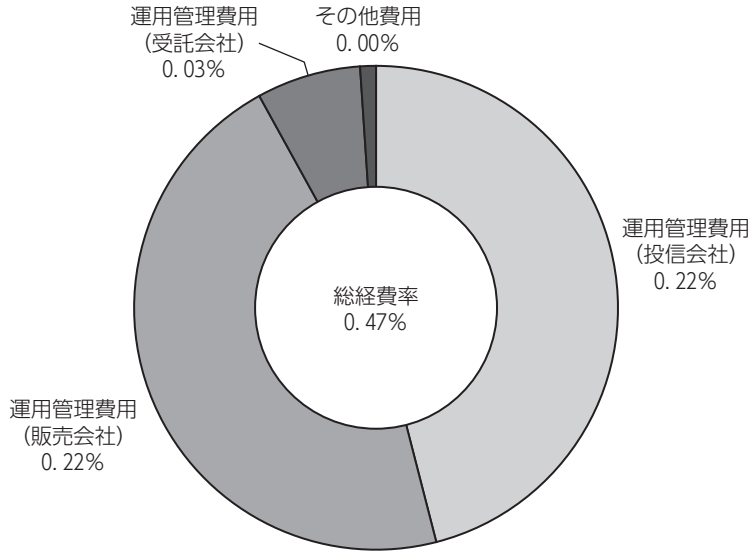
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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まず。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。

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0.47%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。

■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
日本債券 インデックス マザーファンド	38,549	54,743	19,015	26,927

(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 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	32,868	1,366	4.2	29,973	1,012	3.4
コール・ローン	106,762	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.1%

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

(3) 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

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 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とその処分

(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	62,288	81,822	117,031

(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	%
日本債券インデックス マザーファンド	117,031	98.0
コール・ローン等、その他	2,380	2.0
投資信託財産総額	119,411	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	119,411,763円
コール・ローン等	397,532
日本債券インデックス マザーファンド（評価額）	117,031,401
未収入金	1,982,830
(B) 負債	2,267,524
未払解約金	1,999,455
未払信託報酬	265,053
その他未払費用	3,016
(C) 純資産総額（A－B）	117,144,239
元本	115,964,639
次期繰越損益金	1,179,600
(D) 受益権総口数	115,964,639口
1万口当り基準価額（C／D）	10,102円

* 期首における元本額は87,860,702円、当作成期間中における追加設定元本額は59,027,121円、同解約元本額は30,923,184円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,102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	△ 13円
支払利息	△ 13
(B) 有価証券売買損益	1,864,546
売買益	2,171,318
売買損	△ 306,772
(C) 信託報酬等	△ 500,531
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	1,364,002
(E) 前期繰越損益金	△ 398,780
(F) 追加信託差損益金	214,378
（配当等相当額）	（△ 134）
（売買損益相当額）	（ 214,512）
(G) 合計（D＋E＋F）	1,179,600
次期繰越損益金（G）	1,179,600
追加信託差損益金	214,378
（配当等相当額）	（△ 134）
（売買損益相当額）	（ 214,512）
分配準備積立金	965,235
繰越損益金	△ 13

（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	965,235
(c) 収益調整金	214,512
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	1,179,747
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	1,179,747
(h) 受益権総口数	115,964,639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20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)

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

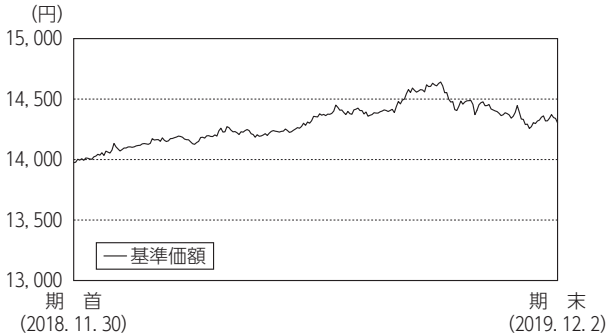
大和投資信託

Daiwa Asset Management

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



《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：13,974円 期末：14,303円 騰落率：2.4%

【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。

◆投資環境について

○国内債券市場

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。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」

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2.4%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0.01%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》

今後も、ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行います。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、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。

年月日	基準価額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数 (ベンチマーク)		公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率 %	総合指数	騰落率 %		
(期首) 2018年11月30日	13,974	—	523.683	—	99.6	—
12月末	14,078	0.7	527.623	0.8	99.6	—
2019年1月末	14,134	1.1	529.658	1.1	99.5	—
2月末	14,163	1.4	530.781	1.4	99.5	—
3月末	14,264	2.1	534.623	2.1	99.5	—
4月末	14,218	1.7	532.961	1.8	99.6	—
5月末	14,310	2.4	536.316	2.4	99.3	—
6月末	14,398	3.0	539.597	3.0	99.2	—
7月末	14,415	3.2	540.217	3.2	99.4	—
8月末	14,617	4.6	547.729	4.6	99.5	—
9月末	14,456	3.4	541.725	3.4	99.6	—
10月末	14,390	3.0	539.302	3.0	99.6	—
11月末	14,340	2.6	537.478	2.6	99.1	—
(期末) 2019年12月2日	14,303	2.4	536.068	2.4	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。

日本債券インデックスマザーファンド

■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)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国 内	国債証券	31,899,723	(28,250,264 —)
	地方債証券	556,957	(607,484 —)
	特殊債券	106,387	(404,282 —)
	社債券	305,424	(711,033 —)

(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)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	千円	銘 柄	千円
138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,829,518	124 5年国債 0.1% 2020/6/20	1,343,825
127 5年国債 0.1% 2021/3/20	1,106,169	130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,310,504
140 5年国債 0.1% 2024/6/20	1,020,813	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	1,219,380
130 5年国債 0.1% 2021/12/20	1,008,762	125 5年国債 0.1% 2020/9/20	943,600
355 10年国債 0.1% 2029/6/20	783,145	126 5年国債 0.1% 2020/12/20	892,662
345 10年国債 0.1% 2026/12/20	739,269	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	860,472
332 10年国債 0.6% 2023/12/20	735,894	345 10年国債 0.1% 2026/12/20	818,945
139 5年国債 0.1% 2024/3/20	710,096	332 10年国債 0.6% 2023/12/20	798,058
353 10年国債 0.1% 2028/12/20	709,640	123 5年国債 0.1% 2020/3/20	782,195
406 2年国債 0.1% 2021/11/1	703,822	339 10年国債 0.4% 2025/6/20	726,611

(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）

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	65,466,000	71,946,332	87.2	—	58.3	20.2	8.7
地方債証券	4,000,000	4,253,511	5.2	—	2.8	2.1	0.2
特殊債券（除く金融債券）	2,800,000	2,921,624	3.5	—	1.6	1.7	0.2
金融債券	100,000	99,005	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	2,800,000	2,898,205	3.5	—	2.1	1.0	0.4
合 計	75,166,000	82,118,679	99.6	—	64.9	25.1	9.6

(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	額 面 金 額	
		千円	%	千円	千円	
国債証券	398 2年国債	250,000	0.1000	250,822	250,822	2021/03/01
	127 5年国債	1,580,000	0.1000	1,585,308	1,585,308	2021/03/20
	313 10年国債	200,000	1.3000	203,756	203,756	2021/03/20
	314 10年国債	260,000	1.1000	264,209	264,209	2021/03/20
	49 20年国債	64,000	2.1000	65,882	65,882	2021/03/22
	50 20年国債	107,000	1.9000	109,867	109,867	2021/03/22
	399 2年国債	100,000	0.1000	100,358	100,358	2021/04/01
	400 2年国債	200,000	0.1000	200,762	200,762	2021/05/01
	128 5年国債	1,000,000	0.1000	1,004,180	1,004,180	2021/06/20
	315 10年国債	221,000	1.2000	225,671	225,671	2021/06/20
	316 10年国債	250,000	1.1000	254,897	254,897	2021/06/20
	51 20年国債	82,000	2.0000	84,754	84,754	2021/06/21
	402 2年国債	150,000	0.1000	150,651	150,651	2021/07/01
	129 5年国債	1,340,000	0.1000	1,346,633	1,346,633	2021/09/20
	317 10年国債	214,000	1.1000	218,879	218,879	2021/09/20
	318 10年国債	200,000	1.0000	204,200	204,200	2021/09/20
	52 20年国債	52,000	2.1000	54,126	54,126	2021/09/21
	405 2年国債	150,000	0.1000	150,756	150,756	2021/10/01
	406 2年国債	700,000	0.1000	703,689	703,689	2021/11/01
	130 5年国債	580,000	0.1000	583,271	583,271	2021/12/20
	319 10年国債	100,000	1.1000	102,597	102,597	2021/12/20
	320 10年国債	230,000	1.0000	235,501	235,501	2021/12/20
	53 20年国債	66,000	2.1000	69,076	69,076	2021/12/20
	54 20年国債	65,000	2.2000	68,163	68,163	2021/12/20
	131 5年国債	1,170,000	0.1000	1,177,534	1,177,534	2022/03/20
	321 10年国債	175,000	1.0000	179,712	179,712	2022/03/20
	322 10年国債	130,000	0.9000	133,201	133,201	2022/03/20
	55 20年国債	140,000	2.0000	147,018	147,018	2022/03/21
	132 5年国債	880,000	0.1000	886,292	886,292	2022/06/20
	323 10年国債	380,000	0.9000	390,393	390,393	2022/06/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当	期	末			
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
			%	千円	千円	
	133 5年国債		0.1000	430,000	433,689	2022/09/20
	325 10年国債		0.8000	310,000	318,494	2022/09/20
	58 20年国債		1.9000	200,000	211,664	2022/09/20
	134 5年国債		0.1000	350,000	353,164	2022/12/20
	326 10年国債		0.7000	30,000	30,808	2022/12/20
	327 10年国債		0.8000	450,000	463,509	2022/12/20
	59 20年国債		1.7000	45,000	47,591	2022/12/20
	60 20年国債		1.4000	10,000	10,484	2022/12/20
	135 5年国債		0.1000	880,000	888,456	2023/03/20
	328 10年国債		0.6000	350,000	359,040	2023/03/20
	61 20年国債		1.0000	100,000	103,909	2023/03/20
	136 5年国債		0.1000	700,000	707,245	2023/06/20
	329 10年国債		0.8000	500,000	517,480	2023/06/20
	62 20年国債		0.8000	95,000	98,321	2023/06/20
	63 20年国債		1.8000	130,000	139,158	2023/06/20
	137 5年国債		0.1000	700,000	707,357	2023/09/20
	330 10年国債		0.8000	612,000	634,809	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	365,000	375,811	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	97,119	2023/09/20
	138 5年国債		0.1000	600,000	606,600	2023/12/20
	332 10年国債		0.6000	250,000	257,895	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	189,759	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	185,000	199,848	2023/12/20
	139 5年国債		0.1000	700,000	708,169	2024/03/20
	333 10年国債		0.6000	600,000	620,112	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	59,923	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	132,298	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	120,798	2024/03/20
	140 5年国債		0.1000	600,000	607,140	2024/06/20
	334 10年国債		0.6000	900,000	931,527	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	92,727	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	138,506	2024/06/20
	141 5年国債		0.1000	650,000	658,164	2024/09/20
	335 10年国債		0.5000	690,000	712,183	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	175,000	194,118	2024/09/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	284,377	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	300,000	307,176	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	133,220	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	81,413	2024/12/20
	338 10年国債		0.4000	580,000	597,492	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	89,651	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	56,608	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	144,989	2025/03/20
	339 10年国債		0.4000	590,000	608,649	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	68,030	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	56,042	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	59,701	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	700,000	723,149	2025/09/20
	81 20年国債		2.0000	76,000	85,605	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	98,504	2025/09/20

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	
	341 10年国債		0.3000	440,000	452,491	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	105,800	2025/12/20
	342 10年国債		0.1000	1,000,000	1,016,850	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	66,311	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	92,480	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	63,231	2026/03/20
	343 10年国債		0.1000	700,000	712,271	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	116,233	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	90,145	2026/06/20
	344 10年国債		0.1000	700,000	712,502	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	23,227	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	60,000	70,094	2026/09/20
	345 10年国債		0.1000	650,000	662,044	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	359,674	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	700,000	713,426	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	115,853	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	151,568	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	500,000	509,730	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	59,326	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	55,000	64,419	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	600,000	611,832	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	47,378	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	320,000	376,505	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	1,050,000	1,070,937	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	100,000	118,181	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	270,000	275,319	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	185,198	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	350,000	424,056	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	99,011	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	800,000	815,192	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	205,341	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,906	2028/06/20
	11 フィリピン共和国		0.9900	100,000	103,251	2028/08/15
	352 10年国債		0.1000	690,000	702,558	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	150,668	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	180,699	2028/09/20
	353 10年国債		0.1000	250,000	254,447	2028/12/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	107,976	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	477,000	563,575	2028/12/20
	354 10年国債		0.1000	600,000	610,110	2029/03/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	65,165	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	260,000	312,920	2029/03/20
	355 10年国債		0.1000	460,000	467,286	2029/06/20
	111 20年国債		2.2000	200,000	243,392	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	150,000	181,104	2029/06/20
	356 10年国債		0.1000	420,000	426,199	2029/09/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	20,479	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	310,000	375,617	2029/09/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	85,067	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	220,559	2029/12/20

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	
	2 30年国債		2.4000	24,000	29,961	2030/02/20
	116 20年国債		2.2000	140,000	172,145	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	215,000	262,147	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	37,275	2030/05/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	115,217	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	110,827	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	280,000	327,759	2030/06/20
	121 20年国債		1.9000	170,000	204,984	2030/09/20
	122 20年国債		1.8000	160,000	191,198	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	47,420	2030/11/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	246,258	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	193,000	235,508	2030/12/20
	125 20年国債		2.2000	85,000	105,938	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	110,000	134,615	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	165,000	200,064	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	34,979	2031/05/20
	128 20年国債		1.9000	119,000	144,684	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	230,000	276,995	2031/06/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	169,129	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	179,446	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	30,762	2031/11/20
	133 20年国債		1.8000	370,000	448,070	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	80,000	97,104	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	110,546	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	200,000	237,874	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	70,324	2032/05/20
	138 20年国債		1.5000	100,000	118,003	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	300,000	357,747	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	300,000	362,250	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	33,024	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	50,393	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	200,000	242,146	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	240,000	293,678	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	51,037	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	251,983	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	300,000	356,031	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	48,650	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	380,000	462,178	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	76,383	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	230,000	280,273	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	94,738	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	150,000	181,167	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	108,499	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	330,000	394,544	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	100,000	134,119	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	272,000	325,660	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	336,507	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	200,000	237,046	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	173,678	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	370,000	428,108	2034/12/20

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	
	18 30年国債		2.3000	80,000	106,031	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	350,000	405,545	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	75,731	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	400,000	470,232	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	380,000	441,229	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	80,150	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	275,000	310,895	2035/12/20
	22 30年国債		2.5000	170,000	233,166	2036/03/20
	156 20年国債		0.4000	200,000	206,964	2036/03/20
	157 20年国債		0.2000	400,000	400,640	2036/06/20
	24 30年国債		2.5000	92,000	126,902	2036/09/20
	158 20年国債		0.5000	100,000	104,960	2036/09/20
	25 30年国債		2.3000	150,000	202,593	2036/12/20
	159 20年国債		0.6000	280,000	298,460	2036/12/20
	26 30年国債		2.4000	180,000	246,808	2037/03/20
	160 20年国債		0.7000	210,000	227,360	2037/03/20
	161 20年国債		0.6000	260,000	276,923	2037/06/20
	27 30年国債		2.5000	150,000	209,469	2037/09/20
	162 20年国債		0.6000	350,000	372,778	2037/09/20
	163 20年国債		0.6000	290,000	308,858	2037/12/20
	28 30年国債		2.5000	170,000	238,790	2038/03/20
	164 20年国債		0.5000	400,000	418,588	2038/03/20
	165 20年国債		0.5000	200,000	209,232	2038/06/20
	29 30年国債		2.4000	200,000	278,700	2038/09/20
	166 20年国債		0.7000	300,000	324,528	2038/09/20
	167 20年国債		0.5000	300,000	313,350	2038/12/20
	30 30年国債		2.3000	220,000	304,125	2039/03/20
	168 20年国債		0.4000	300,000	307,716	2039/03/20
	169 20年国債		0.3000	300,000	301,950	2039/06/20
	31 30年国債		2.2000	300,000	411,516	2039/09/20
	170 20年国債		0.3000	90,000	90,506	2039/09/20
	32 30年国債		2.3000	285,000	398,221	2040/03/20
	33 30年国債		2.0000	311,000	418,179	2040/09/20
	34 30年国債		2.2000	180,000	250,707	2041/03/20
	35 30年国債		2.0000	195,000	264,718	2041/09/20
	36 30年国債		2.0000	350,000	477,319	2042/03/20
	37 30年国債		1.9000	300,000	404,580	2042/09/20
	38 30年国債		1.8000	190,000	252,874	2043/03/20
	39 30年国債		1.9000	192,000	260,417	2043/06/20
	40 30年国債		1.8000	200,000	267,228	2043/09/20
	41 30年国債		1.7000	170,000	223,629	2043/12/20
	42 30年国債		1.7000	176,000	231,792	2044/03/20
	43 30年国債		1.7000	200,000	263,710	2044/06/20
	44 30年国債		1.7000	230,000	303,616	2044/09/20
	45 30年国債		1.5000	200,000	255,018	2044/12/20
	46 30年国債		1.5000	140,000	178,655	2045/03/20
	47 30年国債		1.6000	210,000	273,474	2045/06/20
	48 30年国債		1.4000	290,000	363,767	2045/09/20
	49 30年国債		1.4000	100,000	125,663	2045/12/20
	50 30年国債		0.8000	215,000	238,007	2046/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分		当	期	末		償還年月日
		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	
			%	千円	千円	
		51 30年国債	0.3000	240,000	235,368	2046/06/20
		52 30年国債	0.5000	300,000	309,129	2046/09/20
		53 30年国債	0.6000	250,000	263,812	2046/12/20
		54 30年国債	0.8000	218,000	241,236	2047/03/20
		55 30年国債	0.8000	200,000	221,220	2047/06/20
		56 30年国債	0.8000	300,000	331,677	2047/09/20
		57 30年国債	0.8000	230,000	254,483	2047/12/20
		1 40年国債	2.4000	70,000	107,356	2048/03/20
		58 30年国債	0.8000	320,000	353,881	2048/03/20
		59 30年国債	0.7000	200,000	215,924	2048/06/20
		60 30年国債	0.9000	180,000	204,030	2048/09/20
		61 30年国債	0.7000	200,000	215,612	2048/12/20
		2 40年国債	2.2000	110,000	164,067	2049/03/20
		62 30年国債	0.5000	200,000	204,706	2049/03/20
		63 30年国債	0.4000	230,000	228,790	2049/06/20
		64 30年国債	0.4000	100,000	99,338	2049/09/20
		3 40年国債	2.2000	74,000	111,342	2050/03/20
		4 40年国債	2.2000	107,000	162,371	2051/03/20
		5 40年国債	2.0000	125,000	184,040	2052/03/20
		6 40年国債	1.9000	105,000	152,618	2053/03/20
		7 40年国債	1.7000	121,000	169,458	2054/03/20
		8 40年国債	1.4000	230,000	301,596	2055/03/20
		9 40年国債	0.4000	220,000	216,568	2056/03/20
		10 40年国債	0.9000	275,000	317,047	2057/03/20
		11 40年国債	0.8000	320,000	358,339	2058/03/20
		12 40年国債	0.5000	200,000	202,662	2059/03/20
種 別 小 計	銘 柄 数	256銘柄				
	金 額			65,466,000	71,946,332	
地方債証券						
		699 東京都公債	1.0200	100,000	101,743	2021/09/17
		23-2 島根県公債	1.0300	100,000	101,940	2021/11/25
		108 共同発行地方	1.0100	100,000	102,210	2022/03/25
		24-1 北海道公債	0.9900	100,000	102,243	2022/04/27
		24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	102,003	2022/06/20
		361 大阪府公債	0.9200	100,000	102,229	2022/06/28
		24-6 北海道公債	0.8400	100,000	102,160	2022/08/31
		713 東京都公債	0.7700	100,000	102,016	2022/09/20
		24-5 京都府公債	0.8200	100,000	102,155	2022/09/20
		24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	102,149	2022/10/21
		117 共同発行地方	0.7200	100,000	102,049	2022/12/22
		24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	102,080	2022/12/22
		24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	102,246	2023/01/31
		24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,413	2023/04/26
		126 共同発行地方	0.8100	100,000	102,935	2023/09/25
		25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	205,212	2023/11/22
		131 共同発行地方	0.6600	100,000	102,625	2024/02/23
		26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	102,356	2024/11/25
		26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	102,101	2025/02/26
		3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	205,308	2025/04/16

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	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	101,818	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,812	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,618	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,847	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	200,895	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,721	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,147	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	119,074	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	116,982	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	120,402	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	119,997	2029/12/14
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	119,584	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	117,730	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	118,079	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	110,833	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	135,281	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	120,503	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	37銘柄	4,000,000	4,253,511	
特殊債券 (除く金融債券)	3 公営企業15年	2.2000	100,000	103,245	2021/05/21
	29 地方公共団体	1.0250	100,000	101,878	2021/10/28
	81 道路機構	1.0300	100,000	102,012	2021/12/20
	33 地方公共団体	1.0350	100,000	102,212	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	102,315	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	102,194	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	102,122	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	102,265	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	102,237	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	102,556	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	102,115	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	102,125	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	102,682	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	102,053	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	102,995	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	102,357	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,481	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	102,164	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	204,111	2025/11/28
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	109,700	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	110,161	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	118,467	2029/07/31
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	119,825	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	117,581	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	196,229	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	104,530	2036/12/26
種別小計	銘柄数 金 額	26銘柄	2,800,000	2,921,624	

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		
金融債券		19 利付商工債	0.1000	100,000	99,005	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄				
	金額		100,000	99,005		
普通社債券		44 野村ホールディング	0.7230	100,000	100,715	2021/02/25
		2 イオンFS	0.5720	100,000	100,554	2021/03/18
		9三菱UFJ信託BK劣	1.6800	100,000	102,173	2021/04/28
		11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	101,155	2022/06/20
		11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	103,096	2022/06/27
		372 中国電力	1.2040	100,000	103,118	2022/08/25
		4 JXホールディングス	1.1450	100,000	103,108	2022/12/14
		30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	102,151	2022/12/14
		175 オリックス	1.0640	100,000	103,655	2023/11/24
		21 西日本高速道	0.7540	100,000	102,745	2023/12/20
		1 三菱UFJFG劣後	0.9400	100,000	102,377	2024/06/26
		5 野村不動産HD	0.9240	100,000	103,370	2025/05/30
		11日本たばこ産業	0.5990	100,000	102,415	2025/07/15
		63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,778	2025/11/13
		4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	103,235	2025/12/18
		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
		509 関西電力	0.4700	100,000	100,636	2027/05/25
		12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,305	2027/06/11
		15 デンソー	0.2450	100,000	100,246	2027/06/18
		78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,404	2027/07/23
		11 東京電力パワー	0.7900	100,000	100,337	2028/01/25
		41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	117,722	2029/01/29
		18 エヌティティ都市開	1.0900	100,000	106,548	2029/09/20
		7 凸版印刷	1.1040	100,000	107,356	2029/12/12
		332 北海道電力	0.9070	100,000	104,473	2036/04/25
		23 森ビル	0.9700	100,000	101,800	2038/05/17
		107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	121,036	2045/01/27
種別小計	銘柄数	28銘柄				
	金額		2,800,000	2,898,205		
合 計	銘柄数	348銘柄				
	金額		75,166,000	82,118,679		

(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
公社債	82,118,679	97.2
コール・ローン等、その他	2,340,049	2.8
投資信託財産総額	84,458,729	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	84,458,729,704円
コール・ローン等	277,498,394
公社債(評価額)	82,118,679,960
未収入金	1,861,375,540
未収利息	188,754,567
前払費用	12,421,243
(B) 負債	1,970,494,415
未払金	1,951,218,000
未払解約金	19,276,281
その他未払費用	134
(C) 純資産総額 (A - B)	82,488,235,289
元本	57,670,399,195
次期繰越損益金	24,817,836,094
(D) 受益権総口数	57,670,399,195口
1万口当り基準価額 (C / D)	14,303円

* 期首における元本額は56,170,487,793円、当作成期間中における追加設定元本額は19,864,910,379円、同解約元本額は18,364,998,977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)109,396,910円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)596,838,676円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)82,263,337円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)882,267,553円、DCダイワ日本債券インデックス7,293,354,645円、ダイワ・バランスファンド35VA11,302,866,367円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)1,855,649,526円、ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)265,692,526円、ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)369,416,535円、ダイワ・ノーロード日本債券ファンド81,822,975円、ダイワファンドラップ日本債券インデックス21,258,481,478円、ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)3,005,941,387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1,491,311,778円、ダイワ・インデックスセレクト日本債券1,129,962,205円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,866,925,426円、ダイワライフスタイル25450,390,874円、ダイワライフスタイル50491,002,347円、ダイワライフスタイル75136,814,650円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,303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	668,724,518円
受取利息	669,001,286
支払利息	△ 276,768
(B) 有価証券売買損益	1,086,219,610
売買益	1,551,391,130
売買損	△ 465,171,520
(C) その他費用	△ 11,078
(D) 当期損益金 (A + B + C)	1,754,933,050
(E) 前期繰越損益金	22,319,404,672
(F) 解約差損益金	7,944,362,524
(G) 追加信託差損益金	△ 8,687,860,896
(H) 合計 (D + E + F + G)	24,817,836,094
次期繰越損益金 (H)	24,817,836,094

(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。