

ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス

運用報告書(全体版)

第21期

(決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日～2020年11月30日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

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運用を行なうことを基本とします。

日本債券インデックスマザーファンドの受益証券およびわが国の公社債

わが国の公社債

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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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	投資成果をダイワ・ボンド・インデックス(DBI)総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行なうことを基本とします。		
主要投資対象	ベビーファンド	日本債券インデックスマザーファンドの受益証券およびわが国の公社債	
	日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債	
組入制限	ベビーファンドの実質株式組入上限比率	純資産総額の30%以下	
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の30%以下	
分配方針	分配対象額は、経費控除後の利息等収益と売買益(評価益を含みます。)等とし、原則として、利息等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(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
17期末(2016年11月30日)	12,874	0	3.7	524.807	4.2	98.4	—	9,177
18期末(2017年11月30日)	12,746	0	△ 1.0	522.295	△ 0.5	99.3	—	8,843
19期末(2018年11月30日)	12,717	0	△ 0.2	523.683	0.3	99.4	—	9,012
20期末(2019年12月2日)	12,952	0	1.8	536.068	2.4	99.5	—	9,831
21期末(2020年11月30日)	12,781	0	△ 1.3	531.781	△ 0.8	99.5	—	9,883

(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。

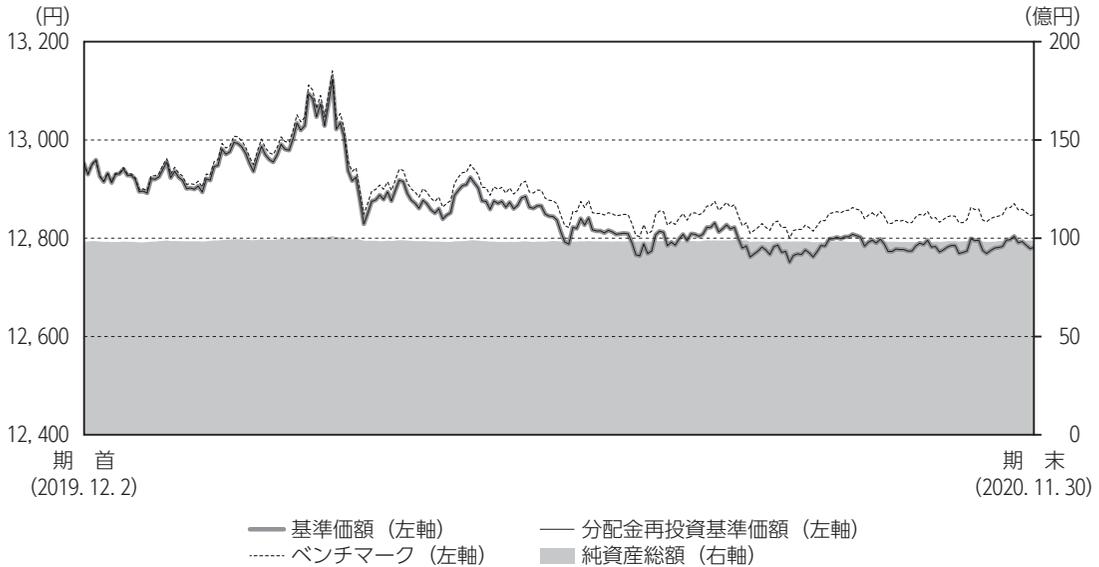
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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：12,952円

期末：12,781円（分配金0円）

騰落率：△1.3%（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）がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率
	円	騰 落 率 %	(ベンチマーク)	騰 落 率 %		
(期首)2019年12月2日	12,952	—	536.068	—	99.5	—
12月末	12,940	△ 0.1	535.929	△ 0.0	99.5	—
2020年1月末	12,993	0.3	538.313	0.4	99.2	—
2月末	13,094	1.1	542.689	1.2	99.3	—
3月末	12,876	△ 0.6	533.796	△ 0.4	99.4	—
4月末	12,913	△ 0.3	535.588	△ 0.1	99.4	—
5月末	12,849	△ 0.8	533.139	△ 0.5	99.4	—
6月末	12,791	△ 1.2	531.018	△ 0.9	99.4	—
7月末	12,831	△ 0.9	532.880	△ 0.6	99.4	—
8月末	12,765	△ 1.4	530.432	△ 1.1	99.2	—
9月末	12,796	△ 1.2	531.917	△ 0.8	99.3	—
10月末	12,769	△ 1.4	531.087	△ 0.9	99.5	—
(期末)2020年11月30日	12,781	△ 1.3	531.781	△ 0.8	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

(2019. 12. 3 ~ 2020. 11. 30)

国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

当作成期首より2019年末まで、米中通商協議の進展や英国総選挙の結果を受けて政治的な先行き不透明感が和らいだこと、また日銀の追加金融緩和観測が後退したことから、長期金利は上昇しました。しかし2020年1月後半から、中国での新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への悪影響が警戒され、金利は低下しました。2月から3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、世界経済の減速懸念が高まったことや市場のリスク回避姿勢が強まったことから、金利は一段と低下しました。3月中旬以降は、金融市場の混乱を受けて国債にも換金売りが広がったことや、日銀の利下げ観測が後退したことから、金利は急上昇しました。また、政府の経済対策に伴う国債増発懸念も金利上昇要因となりました。その後4月にかけて、日銀が上限を設けずに積極的な国債の買入れを行う方針を示したことから、金利は上昇幅を縮小させました。6月以降は、景気回復期待の高まりや国債増発による需給悪化懸念などが金利上昇要因となる一方、感染再拡大などが金利低下要因となり、長期金利はおおむね横ばい圏で推移しました。

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

(2019. 12. 3 ~ 2020. 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

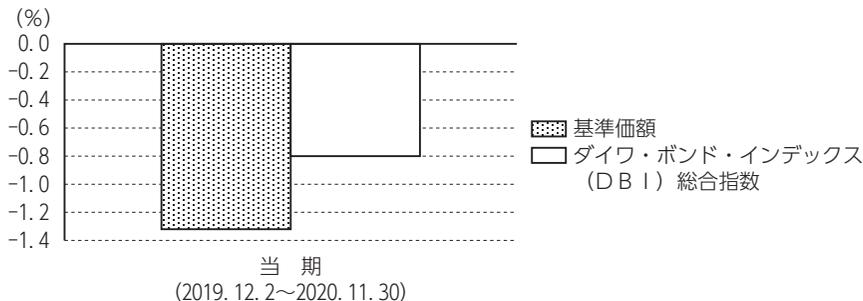
当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド（国債以外の債券における国債との利回り格差）の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変更に対応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

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 $\Delta 0.8\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 1.3\%$ 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 0.5% でした。差異の内訳は、運用管理费用等の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	
	2019年12月3日 ～2020年11月30日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,781

（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（国債以外の債券における国債との利回り格差）への感応度を厳密に管理するとともに、ファンドの資金流入出や毎月末に行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 (2019. 12. 3~2020. 11. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	63円	0.492%	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12,858円です。
(投 信 会 社)	(23)	(0.175)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(30)	(0.230)	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 会 社)	(11)	(0.087)	受託会社分は、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	64	0.498	

(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。

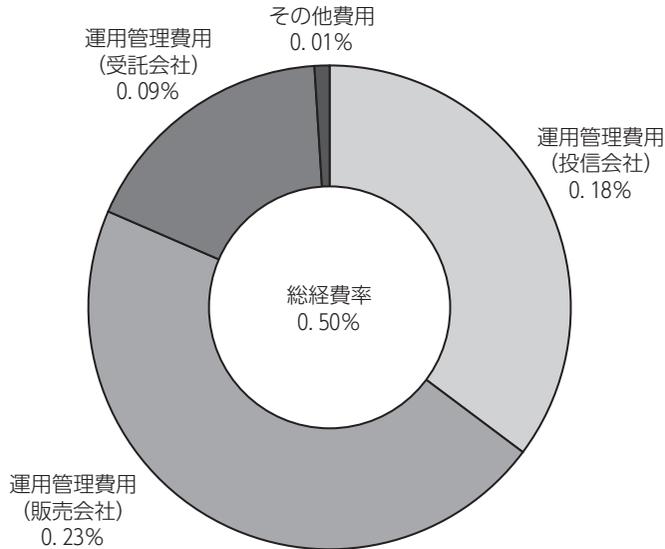
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.50%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。

ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス

■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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	697,916	994,101	603,740	858,984

(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

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	39,235	1,793	4.6	30,025	3,835	12.8
コール・ローン	127,895	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合11.0%

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

(3) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

種 類	当 期	
	日本債券インデックスマザーファンド	
	買 付 額	
	百万円	
公社債	197	

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本債券インデックス マザーファンド	6,866,925	6,961,101	9,874,322

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020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	9,874,322	99.4
コール・ローン等、その他	55,765	0.6
投資信託財産総額	9,930,087	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

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,930,087,569円
コール・ローン等	51,503,490
日本債券インデックス マザーファンド (評価額)	9,874,322,218
未収入金	4,261,861
(B) 負債	46,288,948
未払解約金	21,933,067
未払信託報酬	24,088,312
その他未払費用	267,569
(C) 純資産総額 (A - B)	9,883,798,621
元本	7,733,105,841
次期繰越損益金	2,150,692,780
(D) 受益権総口数	7,733,105,841口
1万口当り基準価額 (C / D)	12,781円

* 期首における元本額は7,590,686,477円、当作成期間中における追加設定元本額は1,637,319,455円、同解約元本額は1,494,900,091円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,781円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 10,825円
受取利息	1,138
支払利息	△ 11,963
(B) 有価証券売買損益	△ 69,979,749
売買益	10,271,400
売買損	△ 80,251,149
(C) 信託報酬等	△ 49,082,398
(D) 当期繰越損益金 (A + B + C)	△ 119,072,972
(E) 前期繰越損益金	345,260,408
(F) 追加信託差損益金	1,924,505,344
(配当等相当額)	(1,705,777,399)
(売買損益相当額)	(218,727,945)
(G) 合計 (D + E + F)	2,150,692,780
次期繰越損益金 (G)	2,150,692,780
追加信託差損益金	1,924,505,344
(配当等相当額)	(1,705,777,399)
(売買損益相当額)	(218,727,945)
分配準備積立金	345,273,269
繰越損益金	△ 119,085,833

(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	1,805,443,197
(d) 分配準備積立金	345,273,269
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	2,150,716,466
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	2,150,716,466
(h) 受益権総口数	7,733,105,841口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第21期 (決算日 2020年11月30日)

(作成対象期間 2019年12月3日～2020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

大和アセットマネジメント

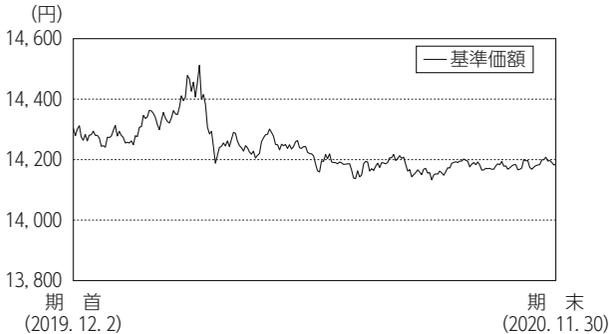
Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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》



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) 2019年12月2日	14,303	—	536.068	—	99.6	—
12月末	14,296	△ 0.0	535.929	△ 0.0	99.6	—
2020年1月末	14,361	0.4	538.313	0.4	99.3	—
2月末	14,478	1.2	542.689	1.2	99.4	—
3月末	14,243	△ 0.4	533.796	△ 0.4	99.5	—
4月末	14,290	△ 0.1	535.588	△ 0.1	99.5	—
5月末	14,224	△ 0.6	533.139	△ 0.5	99.5	—
6月末	14,166	△ 1.0	531.018	△ 0.9	99.5	—
7月末	14,217	△ 0.6	532.880	△ 0.6	99.5	—
8月末	14,149	△ 1.1	530.432	△ 1.1	99.3	—
9月末	14,190	△ 0.8	531.917	△ 0.8	99.4	—
10月末	14,166	△ 1.0	531.087	△ 0.9	99.6	—
(期末) 2020年11月30日	14,185	△ 0.8	531.781	△ 0.8	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。上記の指数は最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。

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：14,303円 期末：14,185円 騰落率：△0.8%

【基準価額の主な変動要因】

金利の上昇 (債券価格は下落) がマイナス要因となり、基準価額は下落しました。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

国内債券市場では、長期金利は上昇しました。

当作成期首より2019年末まで、米中通商協議の進展や英国総選挙の結果を受けて政治的な先行き不透明感が和らいだこと、また日銀の追加金融緩和観測が後退したこと、長期金利は上昇しました。しかし2020年1月後半から、中国での新型コロナウイルスの感染拡大による世界経済への悪影響が警戒され、金利は低下しました。2月から3月上旬にかけては、新型コロナウイルスの世界的な感染拡大を受け、世界経済の減速懸念が高まったことや市場のリスク回避姿勢が強まったことから、金利は一段と低下しました。3月中旬以降は、金融市場の混乱を受けて国債にも換金売りが広がったことや、日銀の利下げ観測が後退したこと、金利は急上昇しました。また、政府の経済対策に伴う国債増発懸念も金利上昇要因となりました。その後4月にかけて、日銀が上限を設けずに積極的な国債の買い入れを行う方針を示したこと、金利は上昇幅を縮小させました。6月以降は、景気回復期待の高まりや国債増発による需給悪化懸念などが金利上昇要因となる一方、感染再拡大などが金利低下要因となり、長期金利はおおむね横ばい圏で推移しました。

◆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 (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△0.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率も△0.8%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ほとんどなく、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。

日本債券インデックスマザーファンド

【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（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。

■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)
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。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

当 期		期	
買 付	金 額	売 付	金 額
銘 柄	金 額	銘 柄	金 額
	千円		千円
142 5年国債 0.1% 2024/12/20	2,781,325	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	2,344,108
135 5年国債 0.1% 2023/3/20	2,135,436	127 5年国債 0.1% 2021/3/20	1,585,150
410 2年国債 0.1% 2022/3/1	2,008,960	341 10年国債 0.3% 2025/12/20	1,536,095
357 10年国債 0.1% 2029/12/20	1,756,675	129 5年国債 0.1% 2021/9/20	1,344,375
341 10年国債 0.3% 2025/12/20	1,597,882	135 5年国債 0.1% 2023/3/20	1,307,939
144 5年国債 0.1% 2025/6/20	1,298,118	409 2年国債 0.1% 2022/2/1	1,054,347
359 10年国債 0.1% 2030/6/20	1,217,734	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	1,021,935
409 2年国債 0.1% 2022/2/1	1,107,601	128 5年国債 0.1% 2021/6/20	1,003,540
358 10年国債 0.1% 2030/3/20	1,050,236	117 20年国債 2.1% 2030/3/20	842,492
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	1,016,842	166 20年国債 0.7% 2038/9/20	745,500

(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。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2019年12月3日から2020年11月30日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	38,521,006	(29,215,529 —)
	地方債証券	108,903	(202,178 —)
内	特殊債券	405,948	(304,538 —)
	社債券	199,976	(302,796 —)

(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。

■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	74,339,000	79,869,797	88.5	—	58.2	22.1	8.2
地方債証券	3,900,000	4,128,711	4.6	—	2.2	1.5	0.9
特殊債券（除く金融債券）	2,900,000	2,997,196	3.3	—	1.4	1.2	0.7
金融債券	100,000	99,942	0.1	—	0.1	—	—
普通社債券	2,700,000	2,777,936	3.1	—	1.7	1.0	0.3
合 計	83,939,000	89,873,584	99.6	—	63.6	25.8	10.1

(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 期		年 利 率	末		償還年月日
	銘 柄	評 価 額		額 面 金 額	評 価 額	
国債証券			%	千円	千円	
	407 2年国債		0.1000	100,000	100,230	2021/12/01
	319 10年国債		1.1000	100,000	101,279	2021/12/20
	53 20年国債		2.1000	66,000	67,539	2021/12/20
	54 20年国債		2.2000	65,000	66,584	2021/12/20
	408 2年国債		0.1000	150,000	150,382	2022/01/01
	409 2年国債		0.1000	50,000	50,137	2022/02/01
	410 2年国債		0.1000	2,000,000	2,006,360	2022/03/01
	131 5年国債		0.1000	1,170,000	1,173,346	2022/03/20
	321 10年国債		1.0000	175,000	177,548	2022/03/20
	322 10年国債		0.9000	130,000	131,723	2022/03/20
	55 20年国債		2.0000	140,000	143,868	2022/03/21
	413 2年国債		0.1000	60,000	60,225	2022/06/01
	132 5年国債		0.1000	880,000	883,071	2022/06/20
	323 10年国債		0.9000	380,000	386,049	2022/06/20
	415 2年国債		0.1000	750,000	753,067	2022/08/01
	133 5年国債		0.1000	550,000	552,381	2022/09/20
	325 10年国債		0.8000	310,000	315,208	2022/09/20
	58 20年国債		1.9000	200,000	207,336	2022/09/20
	417 2年国債		0.1000	100,000	100,450	2022/10/01
	134 5年国債		0.1000	870,000	874,289	2022/12/20
	326 10年国債		0.7000	30,000	30,512	2022/12/20
	327 10年国債		0.8000	450,000	458,608	2022/12/20
	59 20年国債		1.7000	45,000	46,694	2022/12/20
	60 20年国債		1.4000	10,000	10,314	2022/12/20
	135 5年国債		0.1000	1,700,000	1,709,401	2023/03/20
	328 10年国債		0.6000	350,000	355,890	2023/03/20
	61 20年国債		1.0000	100,000	102,617	2023/03/20
	136 5年国債		0.1000	950,000	955,709	2023/06/20
	329 10年国債		0.8000	500,000	511,900	2023/06/20
	62 20年国債		0.8000	95,000	97,273	2023/06/20

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	
	63 20年国債		1.8000	130,000	136,437	2023/06/20
	137 5年国債		0.1000	700,000	704,725	2023/09/20
	330 10年国債		0.8000	612,000	628,095	2023/09/20
	331 10年国債		0.6000	365,000	372,544	2023/09/20
	64 20年国債		1.9000	90,000	95,152	2023/09/20
	138 5年国債		0.1000	900,000	907,029	2023/12/20
	332 10年国債		0.6000	250,000	255,630	2023/12/20
	65 20年国債		1.9000	175,000	185,913	2023/12/20
	66 20年国債		1.8000	185,000	195,970	2023/12/20
	139 5年国債		0.1000	850,000	856,757	2024/03/20
	333 10年国債		0.6000	700,000	717,045	2024/03/20
	67 20年国債		1.9000	55,000	58,708	2024/03/20
	68 20年国債		2.2000	120,000	129,283	2024/03/20
	69 20年国債		2.1000	110,000	118,145	2024/03/20
	140 5年国債		0.1000	900,000	907,704	2024/06/20
	334 10年国債		0.6000	900,000	923,436	2024/06/20
	70 20年国債		2.4000	83,000	90,489	2024/06/20
	71 20年国債		2.2000	125,000	135,388	2024/06/20
	141 5年国債		0.1000	920,000	928,436	2024/09/20
	335 10年国債		0.5000	690,000	706,608	2024/09/20
	72 20年国債		2.1000	105,000	113,926	2024/09/20
	142 5年国債		0.1000	430,000	434,115	2024/12/20
	336 10年国債		0.5000	275,000	282,056	2024/12/20
	337 10年国債		0.3000	400,000	407,004	2024/12/20
	73 20年国債		2.0000	120,000	130,384	2024/12/20
	74 20年国債		2.1000	73,000	79,614	2024/12/20
	143 5年国債		0.1000	650,000	656,461	2025/03/20
	338 10年国債		0.4000	580,000	593,287	2025/03/20
	75 20年国債		2.1000	80,000	87,692	2025/03/20
	76 20年国債		1.9000	51,000	55,463	2025/03/20
	77 20年国債		2.0000	130,000	141,937	2025/03/20
	144 5年国債		0.1000	1,085,000	1,095,915	2025/06/20
	339 10年国債		0.4000	590,000	604,036	2025/06/20
	78 20年国債		1.9000	61,000	66,622	2025/06/20
	79 20年国債		2.0000	50,000	54,837	2025/06/20
	80 20年国債		2.1000	53,000	58,369	2025/06/20
	340 10年国債		0.4000	760,000	778,711	2025/09/20
	82 20年国債		2.1000	87,000	96,259	2025/09/20
	341 10年国債		0.3000	500,000	510,280	2025/12/20
	83 20年国債		2.1000	93,000	103,388	2025/12/20
	342 10年国債		0.1000	1,080,000	1,091,502	2026/03/20
	85 20年国債		2.1000	58,000	64,797	2026/03/20
	86 20年国債		2.3000	80,000	90,227	2026/03/20
	87 20年国債		2.2000	55,000	61,738	2026/03/20
	343 10年国債		0.1000	680,000	687,588	2026/06/20
	88 20年国債		2.3000	100,000	113,396	2026/06/20
	89 20年国債		2.2000	78,000	88,012	2026/06/20
	344 10年国債		0.1000	820,000	829,569	2026/09/20
	90 20年国債		2.2000	20,000	22,684	2026/09/20
	91 20年国債		2.3000	60,000	68,404	2026/09/20

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	
	345 10年国債		0.1000	650,000	657,910	2026/12/20
	92 20年国債		2.1000	310,000	351,524	2026/12/20
	346 10年国債		0.1000	700,000	708,869	2027/03/20
	93 20年国債		2.0000	100,000	113,310	2027/03/20
	94 20年国債		2.1000	130,000	148,127	2027/03/20
	347 10年国債		0.1000	950,000	962,521	2027/06/20
	95 20年国債		2.3000	50,000	57,912	2027/06/20
	96 20年国債		2.1000	55,000	62,978	2027/06/20
	348 10年国債		0.1000	600,000	608,214	2027/09/20
	97 20年国債		2.2000	40,000	46,285	2027/09/20
	98 20年国債		2.1000	320,000	368,092	2027/09/20
	349 10年国債		0.1000	1,050,000	1,064,532	2027/12/20
	99 20年国債		2.1000	100,000	115,542	2027/12/20
	350 10年国債		0.1000	700,000	709,765	2028/03/20
	100 20年国債		2.2000	155,000	181,010	2028/03/20
	101 20年国債		2.4000	350,000	413,875	2028/03/20
	27 メキシコ国債		1.0500	100,000	94,647	2028/04/20
	351 10年国債		0.1000	800,000	810,936	2028/06/20
	103 20年国債		2.3000	170,000	200,659	2028/06/20
	104 20年国債		2.1000	10,000	11,651	2028/06/20
	11 フィリピン共和国		0.9900	100,000	99,957	2028/08/15
	352 10年国債		0.1000	750,000	759,997	2028/09/20
	105 20年国債		2.1000	126,000	147,393	2028/09/20
	106 20年国債		2.2000	150,000	176,644	2028/09/20
	353 10年国債		0.1000	580,000	587,505	2028/12/20
	107 20年国債		2.1000	90,000	105,728	2028/12/20
	108 20年国債		1.9000	462,000	535,263	2028/12/20
	354 10年国債		0.1000	600,000	607,494	2029/03/20
	109 20年国債		1.9000	55,000	63,936	2029/03/20
	110 20年国債		2.1000	260,000	306,581	2029/03/20
	355 10年国債		0.1000	690,000	698,286	2029/06/20
	111 20年国債		2.2000	200,000	238,438	2029/06/20
	112 20年国債		2.1000	150,000	177,541	2029/06/20
	356 10年国債		0.1000	510,000	515,849	2029/09/20
	1 30年国債		2.8000	16,000	19,978	2029/09/20
	113 20年国債		2.1000	310,000	368,276	2029/09/20
	357 10年国債		0.1000	720,000	727,502	2029/12/20
	114 20年国債		2.1000	70,000	83,419	2029/12/20
	115 20年国債		2.2000	180,000	216,138	2029/12/20
	2 30年国債		2.4000	24,000	29,338	2030/02/20
	358 10年国債		0.1000	580,000	585,660	2030/03/20
	116 20年国債		2.2000	200,000	241,026	2030/03/20
	117 20年国債		2.1000	200,000	239,164	2030/03/20
	3 30年国債		2.3000	30,000	36,531	2030/05/20
	359 10年国債		0.1000	1,128,000	1,137,678	2030/06/20
	118 20年国債		2.0000	95,000	113,037	2030/06/20
	119 20年国債		1.8000	93,000	108,883	2030/06/20
	120 20年国債		1.6000	280,000	322,478	2030/06/20
	360 10年国債		0.1000	120,000	120,879	2030/09/20
	121 20年国債		1.9000	200,000	236,670	2030/09/20

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	
	122 20年国債		1.8000	160,000	187,771	2030/09/20
	4 30年国債		2.9000	36,000	46,270	2030/11/20
	123 20年国債		2.1000	200,000	241,368	2030/12/20
	124 20年国債		2.0000	300,000	359,049	2030/12/20
	125 20年国債		2.2000	130,000	158,798	2031/03/20
	126 20年国債		2.0000	110,000	132,112	2031/03/20
	127 20年国債		1.9000	165,000	196,475	2031/03/20
	5 30年国債		2.2000	28,000	34,285	2031/05/20
	128 20年国債		1.9000	250,000	298,540	2031/06/20
	129 20年国債		1.8000	100,000	118,366	2031/06/20
	130 20年国債		1.8000	140,000	166,145	2031/09/20
	131 20年国債		1.7000	150,000	176,403	2031/09/20
	6 30年国債		2.4000	24,000	30,103	2031/11/20
	132 20年国債		1.7000	40,000	47,150	2031/12/20
	133 20年国債		1.8000	430,000	511,583	2031/12/20
	134 20年国債		1.8000	200,000	238,518	2032/03/20
	135 20年国債		1.7000	92,000	108,687	2032/03/20
	136 20年国債		1.6000	145,000	169,679	2032/03/20
	7 30年国債		2.3000	55,000	68,833	2032/05/20
	138 20年国債		1.5000	100,000	116,118	2032/06/20
	139 20年国債		1.6000	370,000	433,869	2032/06/20
	140 20年国債		1.7000	400,000	474,656	2032/09/20
	8 30年国債		1.8000	27,000	32,412	2032/11/22
	9 30年国債		1.4000	43,000	49,597	2032/12/20
	141 20年国債		1.7000	200,000	237,824	2032/12/20
	142 20年国債		1.8000	240,000	288,242	2032/12/20
	10 30年国債		1.1000	45,000	50,314	2033/03/20
	143 20年国債		1.6000	210,000	247,667	2033/03/20
	144 20年国債		1.5000	240,000	280,140	2033/03/20
	11 30年国債		1.7000	40,000	47,755	2033/06/20
	145 20年国債		1.7000	380,000	453,674	2033/06/20
	12 30年国債		2.1000	60,000	74,837	2033/09/20
	146 20年国債		1.7000	280,000	334,936	2033/09/20
	13 30年国債		2.0000	75,000	92,820	2033/12/20
	147 20年国債		1.6000	300,000	355,686	2033/12/20
	14 30年国債		2.4000	82,000	105,986	2034/03/20
	148 20年国債		1.5000	280,000	328,854	2034/03/20
	15 30年国債		2.5000	50,000	65,517	2034/06/20
	149 20年国債		1.5000	402,000	473,129	2034/06/20
	16 30年国債		2.5000	250,000	328,777	2034/09/20
	150 20年国債		1.4000	200,000	233,018	2034/09/20
	17 30年国債		2.4000	130,000	169,669	2034/12/20
	151 20年国債		1.2000	400,000	455,604	2034/12/20
	18 30年国債		2.3000	80,000	103,569	2035/03/20
	152 20年国債		1.2000	300,000	341,940	2035/03/20
	19 30年国債		2.3000	57,000	73,976	2035/06/20
	153 20年国債		1.3000	400,000	461,884	2035/06/20
	154 20年国債		1.2000	550,000	627,715	2035/09/20
	21 30年国債		2.3000	60,000	78,239	2035/12/20
	155 20年国債		1.0000	400,000	444,808	2035/12/20

区 分	当 期 銘 柄	年 利 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	22 30年国債	2.5000	170,000	227,366	2036/03/20
	156 20年国債	0.4000	200,000	204,570	2036/03/20
	157 20年国債	0.2000	100,000	99,103	2036/06/20
	24 30年国債	2.5000	92,000	123,750	2036/09/20
	158 20年国債	0.5000	400,000	414,256	2036/09/20
	25 30年国債	2.3000	150,000	197,455	2036/12/20
	159 20年国債	0.6000	280,000	293,988	2036/12/20
	26 30年国債	2.4000	180,000	240,417	2037/03/20
	160 20年国債	0.7000	360,000	383,565	2037/03/20
	161 20年国債	0.6000	250,000	262,237	2037/06/20
	27 30年国債	2.5000	150,000	203,929	2037/09/20
	162 20年国債	0.6000	350,000	366,793	2037/09/20
	163 20年国債	0.6000	290,000	303,864	2037/12/20
	28 30年国債	2.5000	170,000	232,267	2038/03/20
	164 20年国債	0.5000	390,000	401,832	2038/03/20
	165 20年国債	0.5000	520,000	535,106	2038/06/20
	29 30年国債	2.4000	200,000	271,208	2038/09/20
	166 20年国債	0.7000	250,000	265,552	2038/09/20
	167 20年国債	0.5000	300,000	307,902	2038/12/20
	30 30年国債	2.3000	220,000	295,809	2039/03/20
	168 20年国債	0.4000	320,000	322,473	2039/03/20
	169 20年国債	0.3000	300,000	296,610	2039/06/20
	31 30年国債	2.2000	300,000	399,672	2039/09/20
	170 20年国債	0.3000	265,000	261,737	2039/09/20
	171 20年国債	0.3000	300,000	295,998	2039/12/20
	32 30年国債	2.3000	285,000	386,514	2040/03/20
	172 20年国債	0.4000	175,000	175,628	2040/03/20
	173 20年国債	0.4000	410,000	410,742	2040/06/20
	33 30年国債	2.0000	200,000	261,112	2040/09/20
	174 20年国債	0.4000	30,000	30,027	2040/09/20
	34 30年国債	2.2000	270,000	363,976	2041/03/20
	35 30年国債	2.0000	300,000	394,074	2041/09/20
	36 30年国債	2.0000	350,000	461,265	2042/03/20
	37 30年国債	1.9000	200,000	260,422	2042/09/20
	38 30年国債	1.8000	200,000	257,060	2043/03/20
	39 30年国債	1.9000	230,000	300,738	2043/06/20
	40 30年国債	1.8000	200,000	257,434	2043/09/20
	41 30年国債	1.7000	170,000	215,279	2043/12/20
	42 30年国債	1.7000	205,000	259,858	2044/03/20
	43 30年国債	1.7000	200,000	253,774	2044/06/20
	44 30年国債	1.7000	200,000	254,022	2044/09/20
	45 30年国債	1.5000	200,000	245,310	2044/12/20
	46 30年国債	1.5000	140,000	171,820	2045/03/20
	47 30年国債	1.6000	400,000	500,588	2045/06/20
	48 30年国債	1.4000	130,000	156,855	2045/09/20
	49 30年国債	1.4000	120,000	144,849	2045/12/20
	50 30年国債	0.8000	200,000	212,996	2046/03/20
	51 30年国債	0.3000	240,000	226,812	2046/06/20
	52 30年国債	0.5000	300,000	297,282	2046/09/20
	53 30年国債	0.6000	250,000	253,425	2046/12/20
	54 30年国債	0.8000	310,000	328,937	2047/03/20

日本債券インデックスマザーファンド

区 分	当 期		末		
	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千円	千円	
	55 30年国債	0.8000	260,000	275,696	2047/06/20
	56 30年国債	0.8000	100,000	105,963	2047/09/20
	57 30年国債	0.8000	230,000	243,540	2047/12/20
	1 40年国債	2.4000	70,000	102,314	2048/03/20
	58 30年国債	0.8000	370,000	391,023	2048/03/20
	59 30年国債	0.7000	300,000	309,285	2048/06/20
	60 30年国債	0.9000	210,000	226,902	2048/09/20
	61 30年国債	0.7000	200,000	205,542	2048/12/20
	2 40年国債	2.2000	110,000	155,778	2049/03/20
	62 30年国債	0.5000	200,000	194,924	2049/03/20
	63 30年国債	0.4000	230,000	217,724	2049/06/20
	64 30年国債	0.4000	330,000	311,493	2049/09/20
	65 30年国債	0.4000	200,000	188,472	2049/12/20
	3 40年国債	2.2000	150,000	212,988	2050/03/20
	66 30年国債	0.4000	235,000	220,810	2050/03/20
	67 30年国債	0.6000	164,000	162,571	2050/06/20
	68 30年国債	0.6000	70,000	69,212	2050/09/20
	4 40年国債	2.2000	107,000	152,652	2051/03/20
	5 40年国債	2.0000	125,000	172,705	2052/03/20
	6 40年国債	1.9000	105,000	143,091	2053/03/20
	7 40年国債	1.7000	121,000	158,820	2054/03/20
	8 40年国債	1.4000	230,000	282,336	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	220,000	201,889	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	345,000	370,875	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	320,000	333,408	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	350,000	329,353	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	310,000	291,338	2060/03/20
種別小計	銘柄数	258銘柄			
	金額		74,339,000	79,869,797	
地方債証券	108 共同発行地方	1.0100	100,000	101,290	2022/03/25
	24-1 北海道公債	0.9900	100,000	101,347	2022/04/27
	24-5 札幌市公債	0.8300	100,000	101,272	2022/06/20
	361 大阪府公債	0.9200	100,000	101,422	2022/06/28
	24-6 北海道公債	0.8400	100,000	101,433	2022/08/31
	713 東京都公債	0.7700	100,000	101,373	2022/09/20
	24-5 京都府公債	0.8200	100,000	101,453	2022/09/20
	24-10 神戸市公債	0.7960	100,000	101,467	2022/10/21
	117 共同発行地方	0.7200	100,000	101,425	2022/12/22
	24-3 横浜市公債	0.7290	100,000	101,446	2022/12/22
	24-16 愛知県公債	0.7570	100,000	101,593	2023/01/31
	24-4 福井県公債	0.4600	100,000	101,053	2023/04/26
	126 共同発行地方	0.8100	100,000	102,240	2023/09/25
	25-6 大阪市公債	0.6940	200,000	204,030	2023/11/22
	131 共同発行地方	0.6600	100,000	102,063	2024/02/23
	26-10 静岡県公債	0.5150	100,000	101,959	2024/11/25
	26-17 兵庫県公債	0.4600	100,000	101,851	2025/02/26
	3 兵庫県公債12年	0.5600	200,000	204,676	2025/04/16
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	108,150	2025/11/21

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	101,740	2025/12/19
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	100,121	2026/06/19
	28-2 新潟県公債	0.1800	100,000	100,761	2027/01/29
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	100,962	2027/03/25
	420 大阪府公債	0.1700	200,000	201,266	2027/05/28
	29-1 福岡県公債	0.2000	100,000	100,915	2027/06/23
	29-5 広島県公債	0.2450	100,000	101,267	2028/01/25
	20-1 神戸市20年	2.3800	100,000	117,165	2028/05/26
	16 東京都20年	2.0100	100,000	115,381	2028/12/20
	21-5 愛知県公債	2.2800	100,000	118,478	2029/06/20
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	118,098	2029/12/14
	23-4 福岡市20年	1.8900	100,000	118,447	2031/08/19
	19兵庫県公債20年	1.5700	100,000	116,738	2033/12/09
	16 千葉県20年	1.5550	100,000	116,983	2034/04/14
	31 神奈川県20年	1.0020	100,000	110,064	2035/12/20
	4 川崎市公債30年	2.1000	100,000	132,043	2041/09/20
	4 埼玉県30年	1.3270	100,000	116,726	2045/12/20
種別小計	銘柄数 金 額	36銘柄	3,900,000	4,128,711	
特殊債券 (除く金融債券)	33 地方公共団体	1.0350	100,000	101,238	2022/02/28
	25 日本政策金融	0.9970	100,000	101,390	2022/05/10
	168 政保道路機構	0.8390	100,000	101,372	2022/07/29
	39政保地方公共団	0.8010	100,000	101,342	2022/08/15
	173 政保道路機構	0.8190	100,000	101,471	2022/09/30
	175 政保道路機構	0.7910	100,000	101,474	2022/10/31
	25 政保日本政策	0.8150	100,000	101,759	2023/02/24
	19 政保政策投資 C	0.6680	100,000	101,475	2023/03/15
	186 政保道路機構	0.6680	100,000	101,477	2023/03/17
	48 地方公共団体	0.8130	100,000	101,927	2023/05/26
	190 政保道路機構	0.6050	100,000	101,426	2023/05/31
	51 地方公共団体	0.8410	100,000	102,222	2023/08/28
	65 地方公共団体	0.5350	100,000	101,956	2024/10/28
	236 政保道路機構	0.3200	100,000	101,321	2025/01/31
	71 地方公共団体	0.4650	100,000	101,900	2025/04/28
	261 政保道路機構	0.3810	200,000	203,702	2025/11/28
	127 都市再生	0.0750	100,000	100,023	2026/09/18
	F143地方公共団体	1.3510	100,000	108,469	2027/08/25
	1 地方公共団15年	1.3340	100,000	108,858	2028/01/28
	86 政保道路機構	2.0000	100,000	116,636	2029/07/31
	47日本政策投資 CO	1.0270	100,000	107,903	2029/09/20
	31 地方公共団20	1.7440	100,000	118,583	2033/09/28
	223 政保道路機構	1.4270	100,000	115,813	2034/07/31
	284 政保道路機構	0.1490	200,000	194,686	2036/07/31
	298 政保道路機構	0.5470	100,000	103,190	2036/12/26
	247 道路機構	0.3420	200,000	195,574	2040/03/19
種別小計	銘柄数 金 額	26銘柄	2,900,000	2,997,196	

日本債券インデックスマザーファンド

当		期		末	
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
金融債券	19 利付商工債	0.1000 %	100,000 千円	99,942 千円	2026/09/18
種別小計	銘柄数	1銘柄			
	金額		100,000	99,942	
普通社債券	11 セブンアンドアイ	0.5140	100,000	100,715	2022/06/20
	11三菱UFJ信託BK	1.3600	100,000	101,789	2022/06/27
	372 中国電力	1.2040	100,000	101,990	2022/08/25
	4 JXホールディングス	1.1450	100,000	102,104	2022/12/14
	30 大阪瓦斯	0.7590	100,000	101,426	2022/12/14
	175 オリックス	1.0640	100,000	102,662	2023/11/24
	21 西日本高速道	0.7540	100,000	102,091	2023/12/20
	1 三菱UFJFG 劣後	0.9400	100,000	101,696	2024/06/26
	482 九州電力	0.1700	100,000	100,278	2024/08/23
	5 野村不動産HD	0.9240	100,000	102,723	2025/05/30
	11日本たばこ産業	0.5990	100,000	102,243	2025/07/15
	63 中日本高速道	0.5760	100,000	102,447	2025/11/13
	4 ファーストリテイリング	0.7490	100,000	102,949	2025/12/18
	14 セブンアンドアイ	0.1900	100,000	100,009	2025/12/19
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,909	2026/08/21
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,997	2026/09/18
	509 関西電力	0.4700	100,000	100,869	2027/05/25
	12 アサヒグループHD	0.3300	100,000	100,552	2027/06/11
	15 デンソー	0.2450	100,000	100,232	2027/06/18
	78 トヨタファイナンス	0.2650	100,000	100,334	2027/07/23
	11 東京電力パワー	0.7900	100,000	101,026	2028/01/25
	41 東海旅客鉄道	2.1660	100,000	115,988	2029/01/29
	13 NTTファイナンス	1.0900	100,000	106,475	2029/09/20
	7 凸版印刷	1.1040	100,000	106,929	2029/12/12
	332 北海道電力	0.9070	100,000	102,876	2036/04/25
	23 森ビル	0.9700	100,000	100,631	2038/05/17
	107東日本旅客鉄	1.4150	100,000	115,983	2045/01/27
種別小計	銘柄数	27銘柄			
	金額		2,700,000	2,777,936	
合 計	銘柄数	348銘柄			
	金額		83,939,000	89,873,584	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	89,873,584	99.3
コール・ローン等、その他	628,308	0.7
投資信託財産総額	90,501,893	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

2020年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	90,501,893,234円
コール・ローン等	327,212,168
公社債(評価額)	89,873,584,460
未収入金	101,092,000
未収利息	196,593,327
前払費用	3,411,279
(B) 負債	242,747,138
未払金	100,000,000
未払解約金	142,747,138
(C) 純資産総額 (A - B)	90,259,146,096
元本	63,632,169,674
次期繰越損益金	26,626,976,422
(D) 受益権総口数	63,632,169,674口
1万口当り基準価額 (C/D)	14,185円

* 期首における元本額は57,670,399,195円、当作成期間中における追加設定元本額は27,218,615,082円、同解約元本額は21,256,844,603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)65,126,538円、ダイワ国内重視バランスファンド50VA(一般投資家私募)505,967,183円、ダイワ国際分散バランスファンド30VA(一般投資家私募)62,478,037円、ダイワ国際分散バランスファンド50VA(一般投資家私募)718,126,297円、DCダイワ日本債券インデックス8,503,141,748円、ダイワ・バランスファンド35VA10,269,709,415円、ダイワ・バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)1,737,338,049円、ダイワ国内バランスファンド25VA(適格機関投資家専用)226,910,962円、ダイワ国内バランスファンド30VA(適格機関投資家専用)339,059,642円、ダイワ・ノーロード日本債券ファンド90,548,180円、ダイワファンドラップ日本債券インデックス23,601,367,986円、ダイワ日本債券インデックス(ダイワSMA専用)6,701,446,457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1,691,971,743円、ダイワ・インデックスセレクト日本債券1,058,268,870円、ダイワ投信倶楽部日本債券インデックス6,961,101,317円、ダイワライフスタイル25459,018,956円、ダイワライフスタイル50504,172,138円、ダイワライフスタイル75136,416,156円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,185円です。

■損益の状況

当期 自 2019年12月3日 至 2020年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	692,403,223円
受取利息	692,615,699
支払利息	△ 212,476
(B) 有価証券売買損益	△ 1,455,887,100
売買益	24,146,430
売買損	△ 1,480,033,530
(C) その他費用	△ 2,730
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 763,486,607
(E) 前期繰越損益金	24,817,836,094
(F) 解約差損益金	△ 8,973,370,224
(G) 追加信託差損益金	11,545,997,159
(H) 合計 (D + E + F + G)	26,626,976,422
次期繰越損益金 (H)	26,626,976,422

(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。