

DCダイワ日本債券インデックス

運用報告書(全体版) 第23期

(決算日 2025年12月1日)

(作成対象期間 2024年12月3日～2025年12月1日)

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあざ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います。

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(設定日:2003年1月27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 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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。 | |

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 |
|-------------------|-------------|--------|------------------------------|----------|----------|-----------|--------|
| | (分配額) | 税込み分配金 | 期中騰落率 | (ベンチマーク) | | | |
| 19期末(2021年11月30日) | 円 12,365 | 円 0 | % △ 0.2 | 532.469 | % 0.1 | % 99.0 | % — |
| 20期末(2022年11月30日) | 11,811 | 0 | △ 4.5 | 509.828 | △ 4.3 | 99.3 | — |
| 21期末(2023年11月30日) | 11,637 | 0 | △ 1.5 | 503.781 | △ 1.2 | 99.4 | — |
| 22期末(2024年12月2日) | 11,305 | 0 | △ 2.9 | 490.676 | △ 2.6 | 99.6 | — |
| 23期末(2025年12月1日) | 10,693 | 0 | △ 5.4 | 465.237 | △ 5.2 | 99.3 | — |

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 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。

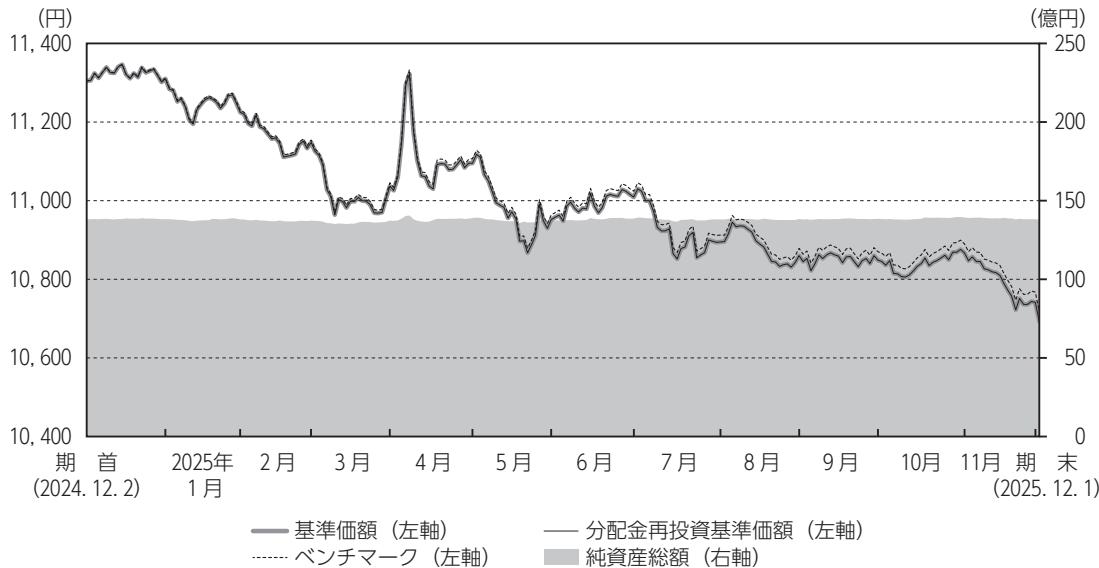
(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。

(注5) 債券先物比率は貢建比率-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：11,305円

期 末：10,693円（分配金 0円）

騰落率：△5.4%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

「日本債券インデックススマザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の公社債に投資した結果、金利が上昇（債券価格は下落）したことなどから、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。

DCダイワ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 (D B I) 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) 2024年12月 2日 | 円 11,305 | % — | % 490.676 | % 99.6 | % — |
| 12月末 | 11,310 | 0.0 | 490.969 | 0.1 | 99.4 |
| 2025年 1月末 | 11,225 | △ 0.7 | 487.408 | △ 0.7 | 99.4 |
| 2月末 | 11,148 | △ 1.4 | 484.139 | △ 1.3 | 99.3 |
| 3月末 | 11,037 | △ 2.4 | 479.407 | △ 2.3 | 99.4 |
| 4月末 | 11,095 | △ 1.9 | 482.074 | △ 1.8 | 99.3 |
| 5月末 | 10,952 | △ 3.1 | 475.855 | △ 3.0 | 99.1 |
| 6月末 | 11,009 | △ 2.6 | 478.485 | △ 2.5 | 99.4 |
| 7月末 | 10,895 | △ 3.6 | 473.634 | △ 3.5 | 99.2 |
| 8月末 | 10,860 | △ 3.9 | 472.163 | △ 3.8 | 98.8 |
| 9月末 | 10,849 | △ 4.0 | 471.810 | △ 3.8 | 99.4 |
| 10月末 | 10,867 | △ 3.9 | 472.676 | △ 3.7 | 99.0 |
| 11月末 | 10,741 | △ 5.0 | 467.336 | △ 4.8 | 99.2 |
| (期末) 2025年12月 1日 | 10,693 | △ 5.4 | 465.237 | △ 5.2 | 99.3 |

(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

(2024.12.3～2025.12.1)

■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

国内長期金利は、当造成期首より、米国金利の上昇に加えて円安の進行もあり、上昇基調で推移しました。特に、2025年1月の日銀金融政策決定会合で、政策金利が17年ぶりに0.5%へ引き上げられた上、日銀が利上げ継続の姿勢を示したこと、金利上昇ペースが加速しました。さらに3月には、ドイツが財政拡張へ転換したことで同国の長期金利が急騰した影響により、国内長期金利は1.6%に迫りました。ところが4月に入ると、米国の関税政策による景気減速懸念から株価急落とともにリスク回避の動きが強まり、1.1%付近まで急低下（債券価格は上昇）しました。しかし5月には、米中貿易交渉の進展を受けてリスク回避姿勢が和らいだことで急上昇し、再び1.6%に迫る局面も見られました。その後は、中東情勢の緊迫化や米国の関税政策による景気下押し懸念から、1.4%付近まで低下しました。7月には、参議院議員選挙を控えて与党の苦戦が見込まれる中で、日米関税合意による景気改善期待もあり、1.6%を上回りました。8月には、米国金利の低下に伴い一時的に国内金利も低下しましたが、その後は根強い財政悪化懸念等を背景に上昇に転じ、再び1.6%を上回りました。10月以降は、新政権発足に伴う政策期待も重なり、上昇基調が強まりました。こうした流れを受け、当造成期末には1.8%台まで上昇しました。

前造成期末における「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

(2024.12.3～2025.12.1)

■当ファンド

「日本債券インデックススマザーファンド」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応して、ポートフォリオのリバランスを適宜行いました。

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

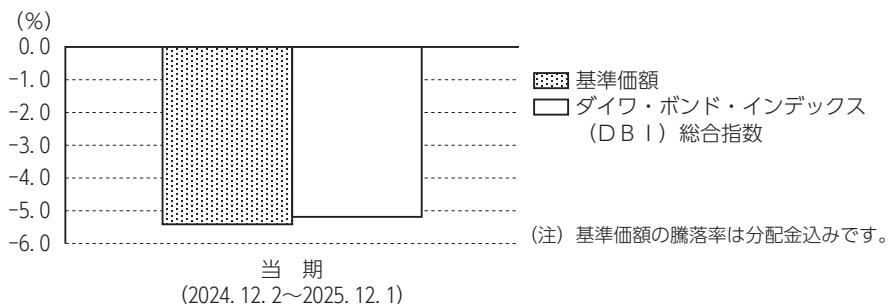
| 組入ファンド | ベンチマーク |
|--------------------|-------------------------|
| 日本債券インデックススマザーファンド | ダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数 |

ベンチマークとの差異について

当成期のベンチマークの騰落率は△5.2%、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.4%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異は△0.2%でした。差異の内訳は運用管理費用等の要因によるもので、当影響を除くと、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。



*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

分配金について

当成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、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 | |
|----------------------|------------|-------------|
| | 2024年12月3日 | ～2025年12月1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） | | 2,210 |

（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、ファンドの收益率とは異なります。

（注4）投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはございません。



今後の運用方針

■当ファンド

「日本債券インデックススマザーファンド」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 (2024.12.3~2025.12.1) | | 項目の概要 |
|---------|-----------------------------|---------|---|
| | 金額 | 比率 | |
| 信託報酬 | 30円 | 0.274% | 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11,005円です。 |
| (投信会社) | (11) | (0.099) | 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) | (14) | (0.132) | 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) | (5) | (0.044) | 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 |
| 合計 | 31 | 0.280 | |

(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います。

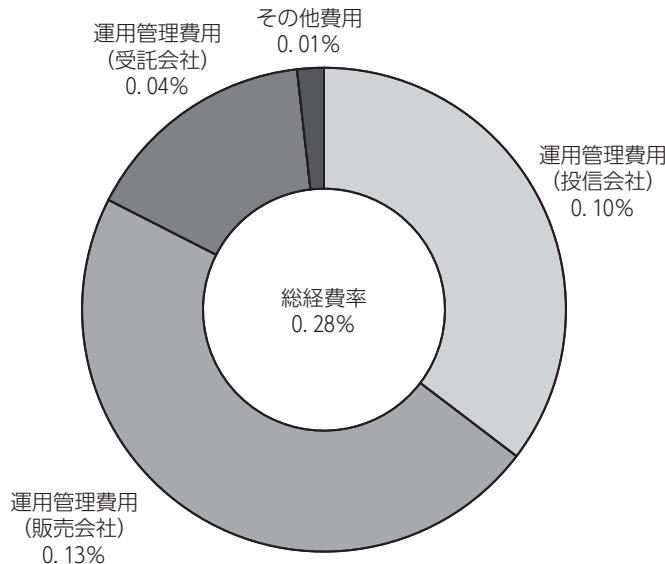
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入しています。

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

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口当たり）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.28%です。



(注1) 1万口当た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

(2024年12月3日から2025年12月1日まで)

| | 設 定 | | 解 約 | |
|---------------------------|-----------------|-----------------|---------------|-----------------|
| | 口 数 | 金 額 | 口 数 | 金 額 |
| 日本債券 インデックス マザーファンド | 千口 1,442,159 | 千円 1,837,953 | 千口 886,407 | 千円 1,132,476 |

(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成期中の利害関係人との取引状況

当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成期中の利害関係人との取引状況

(2024年12月3日から2025年12月1日まで)

| 決 算 期 | 当 期 | | | | | | | |
|---------|---------------|--------------|----------------------------|-----|---------------|----------------------------|----------|--|
| | 区分 | 買付額等 A | う ち 利 売 関係人との 取引状況 B | B/A | 売付額等 C | う ち 利 売 関係人との 取引状況 D | | |
| 公社債 | 百万円 60,662 | 百万円 7,740 | % 12.8 | | 百万円 33,315 | 百万円 1,974 | % 5.9 | |
| コール・ローン | 159,984 | — | — | — | | — | — | |

(注) 平均保有割合10.3%

※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

(2024年12月3日から2025年12月1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 | | 500 |

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 当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、当成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

■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 |
| 日本債券インデックス マザーファンド | 千口 10,539,428 | 千口 11,095,179 | 千円 13,773,555 |

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2025年12月1日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------|------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 日本債券インデックス マザーファンド | 千円 13,773,555 | % 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 53,916 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 13,827,472 | 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

2025年12月1日現在

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------------|-----------------|--|
| (A)資産 | 13,827,472,087円 | |
| コール・ローン等 | 53,381,442 | |
| 日本債券インデックス マザーファンド (評価額) | 13,773,555,642 | |
| 未収入金 | 535,003 | |
| (B)負債 | 26,505,907 | |
| 未払解約金 | 7,155,458 | |
| 未払信託報酬 | 18,971,124 | |
| その他未払費用 | 379,325 | |
| (C)純資産額 (A - B) | 13,800,966,180 | |
| 元本 | 12,906,518,702 | |
| 次期繰越損益金 | 894,447,478 | |
| (D)受益権総口数 | 12,906,518,702口 | |
| 1万口当たり基準価額 (C / D) | 10,693円 | |

*期首における元本額は12,227,206,438円、当成期間中における追加設定元本額は2,501,395,062円、同解約元本額は1,822,082,798円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10,693円です。

■損益の状況

当期 自 2024年12月3日 至 2025年12月1日

| 項目 | 当期 |
|----------------------|------------------|
| (A)配当等収益 | 201,088円 |
| 受取利息 | 201,088 |
| (B)有価証券売買損益 | △ 675,744,499 |
| 売買益 | 47,881,117 |
| 売買損 | △ 723,625,616 |
| (C)信託報酬等 | △ 38,592,160 |
| (D)当期損益金 (A + B + C) | △ 714,135,571 |
| (E)前期繰越損益金 | △ 777,275,021 |
| (F)追加信託差損益金 | 2,385,858,070 |
| (配当等相当額) | (2,739,209,345) |
| (売買損益相当額) | (△ 353,351,275) |
| (G)合計 (D + E + F) | 894,447,478 |
| 次期繰越損益金 (G) | 894,447,478 |
| 追加信託差損益金 | 2,385,858,070 |
| (配当等相当額) | (2,739,209,345) |
| (売買損益相当額) | (△ 353,351,275) |
| 分配準備積立金 | 113,515,301 |
| 繰越損益金 | △ 1,604,925,893 |

(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 | 2,739,209,345 |
| (d) 分配準備積立金 | 113,515,301 |
| (e) 当期分配対象額 (a + b + c + d) | 2,852,724,646 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額 (e - f) | 2,852,724,646 |
| (h) 受益権総口数 | 12,906,518,702□ |

《お知らせ》

■運用報告書にかかる信託約款の条文変更について

2025年4月1日付の投資信託及び投資法人に関する法律の改正により、運用報告書にかかる規定が変更されたため、運用報告書にかかる信託約款の条文を以下のとおり変更しました。（下線部を変更）

<変更前>

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

①委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<変更後>

(運用状況にかかる情報の提供)

①委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める事項にかかる情報を電磁的方法により提供します。

②前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求がであった場合には、当該方法により行なうものとします。

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書 第26期 (決算日 2025年12月1日)

(作成対象期間 2024年12月3日～2025年12月1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（D B I）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 |

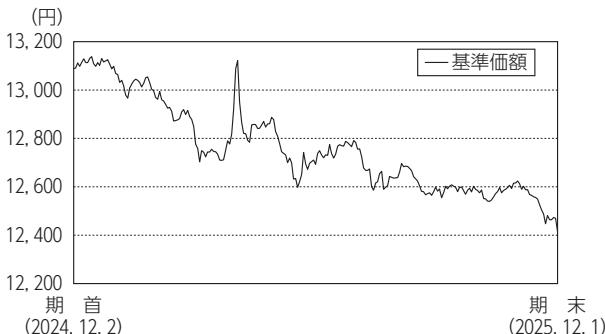
大和アセットマネジメント

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：13,089円 期末：12,414円 勝落率：△5.2%

【基準価額の主な変動要因】

わが国の公社債に投資した結果、金利が上昇（債券価格は下落）したことなどから、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

○国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

国内長期金利は、当成期首より、米国金利の上昇に加えて円安の進行もあり、上昇基調で推移しました。特に、2025年1月の日銀金融政策決定会合で、政策金利が17年ぶりに0.5%へ引き上げられた上、日銀が利上げ继续の姿勢を示したこと、金利上昇ペースが加速しました。さらに3月には、ドイツが財政拡張へ転換したこと、同国の長期金利が急騰した影響により、国内長期金利は1.6%に迫りました。ところが4月に入ると、米国の関税政策による景気減速懸念から株価急落とともにリスク回避の動きが強まり、1.1%付近まで急低下（債券価格は上昇）しました。しかし5月には、米中貿易交渉の進展を受けてリスク回避姿勢が和らいだことで急上昇し、再び1.6%に迫る局面も見られました。その後は、中東情勢の緊迫化や米国の関税政策による景気下押し懸念から、1.4%付近まで低下しました。7月には、参議院議員選挙を控えて与党の苦戦が見込まれる中で、日米関税合意による景気改善期待もあり、1.6%を上回りました。8月には、米国金利の低下に伴い一時に国内金利も低下しましたが、その後は根強い財政悪化懸念等を背景に上昇に転じ、再び1.6%を上回りました。10月以降は、新政権発足に伴う政策期待も重なり、上昇基調が強まりました。こうした流れを受け、当成期末には1.8%台まで上昇しました。

◆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ー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。当成期を通じて、公社債組入比率を高位に保つとともに、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出や毎月末に行われるベンチマークのユー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

当成期のベンチマークの騰落率は△5.2%、当ファンドの基準価額の騰落率は△5.2%となり、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。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。

*ベンチマークはダイワ・ボンド・インデックス（DBI）総合指数です。

| 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 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) 2024年12月2日 | 13,089 | — | 490.676 | — | 99.8 |
| 12月末 | 13,098 | 0.1 | 490.969 | 0.1 | 99.6 |
| 2025年1月末 | 13,003 | △ 0.7 | 487.408 | △ 0.7 | 99.6 |
| 2月末 | 12,916 | △ 1.3 | 484.139 | △ 1.3 | 99.5 |
| 3月末 | 12,790 | △ 2.3 | 479.407 | △ 2.3 | 99.6 |
| 4月末 | 12,861 | △ 1.7 | 482.074 | △ 1.8 | 99.5 |
| 5月末 | 12,697 | △ 3.0 | 475.855 | △ 3.0 | 99.3 |
| 6月末 | 12,766 | △ 2.5 | 478.485 | △ 2.5 | 99.6 |
| 7月末 | 12,637 | △ 3.5 | 473.634 | △ 3.5 | 99.4 |
| 8月末 | 12,599 | △ 3.7 | 472.163 | △ 3.8 | 99.0 |
| 9月末 | 12,590 | △ 3.8 | 471.810 | △ 3.8 | 99.6 |
| 10月末 | 12,613 | △ 3.6 | 472.676 | △ 3.7 | 99.2 |
| 11月末 | 12,470 | △ 4.7 | 467.336 | △ 4.8 | 99.4 |
| (期末) 2025年12月1日 | 12,414 | △ 5.2 | 465.237 | △ 5.2 | 99.5 |

(注1) 勝落率は期首比。

(注2) 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3) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。
(注4) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

《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出や毎月末に行われるベンチマークのユー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 | 一円 |
| 有価証券取引税 | 一 |
| その他費用 | 一 |
| 合計 | 一 |

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております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

(2024年12月3日から2025年12月1日まで)

| | 買付額 | 売付額 |
|-----|-------------------|--------------------|
| 国 | 千円 58,477,385 | 千円 (31,427,252) |
| | 地方債証券 400,000 | 千円 (299,135) |
| 内 | 千円 698,334 | 千円 (299,017) |
| | 特殊債券 1,087,194 | 千円 (1,289,946) |
| 社債券 | | |

(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

(2024年12月3日から2025年12月1日まで)

| 買付 | 当期 | | 付 |
|---------------------------|-----------|----|-----------|
| | 銘柄 | 金額 | |
| | | 千円 | 千円 |
| 377 10年国債 1.2% 2034/12/20 | 1,939,502 | | 1,585,829 |
| 181 5年国債 1.3% 2030/9/20 | 1,801,176 | | 1,468,182 |
| 178 5年国債 1% 2030/3/20 | 1,534,349 | | 1,420,661 |
| 366 10年国債 0.2% 2032/3/20 | 1,354,828 | | 1,097,223 |
| 174 5年国債 0.7% 2029/9/20 | 1,325,948 | | 943,008 |
| 378 10年国債 1.4% 2035/3/20 | 1,320,441 | | 932,520 |
| 161 5年国債 0.3% 2028/6/20 | 1,150,125 | | 897,264 |
| 18 40年国債 3.1% 2065/3/20 | 1,144,074 | | 864,449 |
| 176 5年国債 1% 2029/12/20 | 1,119,087 | | 848,435 |
| 379 10年国債 1.5% 2035/6/20 | 1,115,924 | | 775,780 |

(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 | 当期 | | | | 末 | | |
|--------------|----|-------------------|-------------------|-----------|-----------|-----------|-----------|
| | 区分 | 額面金額 | 評価額 | 組入比率 | うちB格以下組入率 | 残存期間別組入比率 | |
| | | | | | | 5年以上 | 2年以上 |
| 国債証券 | | 千円 145,771,000 | 千円 129,053,673 | % 86.7 | % — | % 54.3 | % 23.5 |
| 地方債証券 | | 6,600,000 | 6,394,791 | 4.3 | — | 2.0 | 1.9 |
| 特殊債券(除く金融債券) | | 4,400,000 | 4,165,523 | 2.8 | — | 1.7 | 0.8 |
| 普通社債券 | | 8,800,000 | 8,442,648 | 5.7 | — | 1.7 | 3.3 |
| 合計 | | 165,571,000 | 148,056,636 | 99.5 | — | 59.7 | 29.5 |
| | | | | | | | 10.3 |

(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 | 銘柄 | 年利率 | 当期 | | | 償還年月日 |
|------|-----------|-------------|---------------|---------------|------------|-------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | 末 | |
| 国債証券 | 469 2年国債 | % 0.7000 | 千円 700,000 | 千円 698,901 | 2027/02/01 | |
| | 470 2年国債 | 0.8000 | 800,000 | 799,456 | 2027/03/01 | |
| | 151 5年国債 | 0.0050 | 850,000 | 840,684 | 2027/03/20 | |
| | 152 5年国債 | 0.1000 | 600,000 | 594,150 | 2027/03/20 | |
| | 346 10年国債 | 0.1000 | 780,000 | 772,395 | 2027/03/20 | |
| | 93 20年国債 | 2.0000 | 100,000 | 101,467 | 2027/03/20 | |
| | 94 20年国債 | 2.1000 | 130,000 | 132,073 | 2027/03/20 | |
| | 471 2年国債 | 0.9000 | 250,000 | 250,080 | 2027/04/01 | |
| | 472 2年国債 | 0.7000 | 490,000 | 488,667 | 2027/05/01 | |
| | 473 2年国債 | 0.8000 | 800,000 | 798,640 | 2027/06/01 | |
| | 153 5年国債 | 0.0050 | 1,000,000 | 986,030 | 2027/06/20 | |
| | 347 10年国債 | 0.1000 | 900,000 | 888,732 | 2027/06/20 | |
| | 95 20年国債 | 2.3000 | 50,000 | 51,060 | 2027/06/20 | |
| | 96 20年国債 | 2.1000 | 55,000 | 55,998 | 2027/06/20 | |
| | 474 2年国債 | 0.7000 | 330,000 | 328,818 | 2027/07/01 | |
| | 475 2年国債 | 0.9000 | 500,000 | 499,590 | 2027/08/01 | |
| | 476 2年国債 | 0.9000 | 900,000 | 898,911 | 2027/09/01 | |
| | 154 5年国債 | 0.1000 | 1,570,000 | 1,545,696 | 2027/09/20 | |
| | 348 10年国債 | 0.1000 | 900,000 | 886,068 | 2027/09/20 | |
| | 97 20年国債 | 2.2000 | 40,000 | 40,874 | 2027/09/20 | |
| | 98 20年国債 | 2.1000 | 320,000 | 326,425 | 2027/09/20 | |
| | 477 2年国債 | 1.0000 | 550,000 | 550,143 | 2027/10/01 | |
| | 478 2年国債 | 1.0000 | 700,000 | 700,000 | 2027/11/01 | |
| | 155 5年国債 | 0.3000 | 730,000 | 719,663 | 2027/12/20 | |
| | 156 5年国債 | 0.2000 | 1,380,000 | 1,357,685 | 2027/12/20 | |
| | 349 10年国債 | 0.1000 | 1,250,000 | 1,227,275 | 2027/12/20 | |
| | 99 20年国債 | 2.1000 | 100,000 | 102,229 | 2027/12/20 | |
| | 157 5年国債 | 0.2000 | 200,000 | 196,254 | 2028/03/20 | |
| | 158 5年国債 | 0.1000 | 1,650,000 | 1,615,399 | 2028/03/20 | |
| | 350 10年国債 | 0.1000 | 800,000 | 783,224 | 2028/03/20 | |
| | 100 20年国債 | 2.2000 | 155,000 | 159,119 | 2028/03/20 | |
| | 101 20年国債 | 2.4000 | 350,000 | 360,874 | 2028/03/20 | |
| | 27 メキシコ国債 | 1.0500 | 100,000 | 97,561 | 2028/04/20 | |

日本債券インデックスマザーファンド

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|----|-------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | | 当 | 末 | |
| | | % | 額面金額 | 評価額 | |
| | | | 千円 | 千円 | |
| | 161 5年国債 | 0.3000 | 1,550,000 | 1,520,767 | 2028/06/20 |
| | 351 10年国債 | 0.1000 | 600,000 | 585,636 | 2028/06/20 |
| | 11 フィリピン共和国 | 0.9900 | 100,000 | 98,055 | 2028/08/15 |
| | 162 5年国債 | 0.3000 | 400,000 | 391,360 | 2028/09/20 |
| | 163 5年国債 | 0.4000 | 1,600,000 | 1,569,776 | 2028/09/20 |
| | 352 10年国債 | 0.1000 | 20,000 | 19,456 | 2028/09/20 |
| | 164 5年国債 | 0.2000 | 270,000 | 262,518 | 2028/12/20 |
| | 165 5年国債 | 0.3000 | 450,000 | 438,858 | 2028/12/20 |
| | 166 5年国債 | 0.4000 | 1,350,000 | 1,320,556 | 2028/12/20 |
| | 1 CT5年国債 | 0.3000 | 300,000 | 292,530 | 2028/12/20 |
| | 353 10年国債 | 0.1000 | 750,000 | 726,900 | 2028/12/20 |
| | 108 20年国債 | 1.9000 | 300,000 | 306,897 | 2028/12/20 |
| | 167 5年国債 | 0.4000 | 150,000 | 146,263 | 2029/03/20 |
| | 168 5年国債 | 0.6000 | 400,000 | 392,636 | 2029/03/20 |
| | 169 5年国債 | 0.5000 | 900,000 | 880,578 | 2029/03/20 |
| | 354 10年国債 | 0.1000 | 800,000 | 772,344 | 2029/03/20 |
| | 109 20年国債 | 1.9000 | 55,000 | 56,291 | 2029/03/20 |
| | 110 20年国債 | 2.1000 | 260,000 | 267,800 | 2029/03/20 |
| | 170 5年国債 | 0.6000 | 300,000 | 293,673 | 2029/06/20 |
| | 171 5年国債 | 0.4000 | 400,000 | 388,776 | 2029/06/20 |
| | 172 5年国債 | 0.5000 | 500,000 | 487,670 | 2029/06/20 |
| | 2 CT5年国債 | 0.5000 | 900,000 | 877,806 | 2029/06/20 |
| | 355 10年国債 | 0.1000 | 320,000 | 307,705 | 2029/06/20 |
| | 111 20年国債 | 2.2000 | 400,000 | 413,680 | 2029/06/20 |
| | 112 20年国債 | 2.1000 | 250,000 | 257,700 | 2029/06/20 |
| | 173 5年国債 | 0.6000 | 360,000 | 351,316 | 2029/09/20 |
| | 174 5年国債 | 0.7000 | 1,230,000 | 1,204,797 | 2029/09/20 |
| | 356 10年国債 | 0.1000 | 700,000 | 670,187 | 2029/09/20 |
| | 1 30年国債 | 2.8000 | 16,000 | 16,914 | 2029/09/20 |
| | 113 20年国債 | 2.1000 | 360,000 | 371,300 | 2029/09/20 |
| | 175 5年国債 | 0.9000 | 500,000 | 492,305 | 2029/12/20 |
| | 176 5年国債 | 1.0000 | 570,000 | 563,524 | 2029/12/20 |
| | 177 5年国債 | 1.1000 | 650,000 | 645,118 | 2029/12/20 |
| | 357 10年国債 | 0.1000 | 620,000 | 591,033 | 2029/12/20 |
| | 114 20年国債 | 2.1000 | 70,000 | 72,237 | 2029/12/20 |
| | 115 20年国債 | 2.2000 | 180,000 | 186,445 | 2029/12/20 |
| | 2 30年国債 | 2.4000 | 184,000 | 192,210 | 2030/02/20 |
| | 178 5年国債 | 1.0000 | 1,435,000 | 1,415,742 | 2030/03/20 |
| | 358 10年国債 | 0.1000 | 1,100,000 | 1,043,955 | 2030/03/20 |
| | 116 20年国債 | 2.2000 | 200,000 | 207,280 | 2030/03/20 |
| | 117 20年国債 | 2.1000 | 200,000 | 206,466 | 2030/03/20 |
| | 3 30年国債 | 2.3000 | 30,000 | 31,239 | 2030/05/20 |
| | 179 5年国債 | 1.0000 | 940,000 | 925,505 | 2030/06/20 |
| | 180 5年国債 | 1.1000 | 350,000 | 346,174 | 2030/06/20 |
| | 3 CT5年国債 | 1.0000 | 350,000 | 344,603 | 2030/06/20 |
| | 359 10年国債 | 0.1000 | 1,100,000 | 1,039,522 | 2030/06/20 |
| | 118 20年国債 | 2.0000 | 95,000 | 97,708 | 2030/06/20 |
| | 119 20年国債 | 1.8000 | 93,000 | 94,833 | 2030/06/20 |
| | 120 20年国債 | 1.6000 | 317,000 | 320,461 | 2030/06/20 |
| | 181 5年国債 | 1.3000 | 1,700,000 | 1,693,863 | 2030/09/20 |
| | 360 10年国債 | 0.1000 | 1,850,000 | 1,740,646 | 2030/09/20 |
| | 121 20年国債 | 1.9000 | 200,000 | 204,866 | 2030/09/20 |
| | 122 20年国債 | 1.8000 | 200,000 | 203,918 | 2030/09/20 |
| | 4 30年国債 | 2.9000 | 36,000 | 38,615 | 2030/11/20 |

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|----|-----------|--------|-----------|---|-----------|
| | | | 当 | 末 | |
| | | | | % | |
| | | | | | 千円 |
| | 361 10年国債 | 0.1000 | 1,200,000 | | 1,125,096 |
| | 123 20年国債 | 2.1000 | 200,000 | | 206,942 |
| | 124 20年国債 | 2.0000 | 300,000 | | 308,997 |
| | 362 10年国債 | 0.1000 | 1,300,000 | | 1,213,082 |
| | 125 20年国債 | 2.2000 | 130,000 | | 135,193 |
| | 126 20年国債 | 2.0000 | 110,000 | | 113,281 |
| | 127 20年国債 | 1.9000 | 350,000 | | 358,627 |
| | 5 30年国債 | 2.2000 | 28,000 | | 29,129 |
| | 363 10年国債 | 0.1000 | 1,490,000 | | 1,383,867 |
| | 128 20年国債 | 1.9000 | 250,000 | | 256,105 |
| | 129 20年国債 | 1.8000 | 200,000 | | 203,802 |
| | 364 10年国債 | 0.1000 | 1,600,000 | | 1,478,496 |
| | 130 20年国債 | 1.8000 | 140,000 | | 142,545 |
| | 131 20年国債 | 1.7000 | 150,000 | | 151,884 |
| | 6 30年国債 | 2.4000 | 24,000 | | 25,245 |
| | 365 10年国債 | 0.1000 | 1,900,000 | | 1,746,651 |
| | 132 20年国債 | 1.7000 | 100,000 | | 101,137 |
| | 366 10年国債 | 0.2000 | 1,300,000 | | 1,196,923 |
| | 134 20年国債 | 1.8000 | 30,000 | | 30,491 |
| | 135 20年国債 | 1.7000 | 92,000 | | 92,951 |
| | 136 20年国債 | 1.6000 | 550,000 | | 552,365 |
| | 7 30年国債 | 2.3000 | 55,000 | | 57,558 |
| | 367 10年国債 | 0.2000 | 1,300,000 | | 1,191,060 |
| | 138 20年国債 | 1.5000 | 300,000 | | 299,019 |
| | 139 20年国債 | 1.6000 | 370,000 | | 371,098 |
| | 368 10年国債 | 0.2000 | 1,250,000 | | 1,139,525 |
| | 140 20年国債 | 1.7000 | 570,000 | | 574,548 |
| | 8 30年国債 | 1.8000 | 27,000 | | 27,364 |
| | 369 10年国債 | 0.5000 | 1,580,000 | | 1,464,328 |
| | 9 30年国債 | 1.4000 | 43,000 | | 42,414 |
| | 141 20年国債 | 1.7000 | 400,000 | | 402,532 |
| | 142 20年国債 | 1.8000 | 240,000 | | 243,117 |
| | 370 10年国債 | 0.5000 | 1,800,000 | | 1,660,860 |
| | 10 30年国債 | 1.1000 | 45,000 | | 43,374 |
| | 143 20年国債 | 1.6000 | 210,000 | | 209,588 |
| | 144 20年国債 | 1.5000 | 140,000 | | 138,768 |
| | 371 10年国債 | 0.4000 | 1,420,000 | | 1,294,344 |
| | 11 30年国債 | 1.7000 | 40,000 | | 40,134 |
| | 145 20年国債 | 1.7000 | 340,000 | | 341,139 |
| | 372 10年国債 | 0.8000 | 1,350,000 | | 1,263,708 |
| | 12 30年国債 | 2.1000 | 60,000 | | 61,844 |
| | 146 20年国債 | 1.7000 | 20,000 | | 20,034 |
| | 1 CT10年国債 | 0.7000 | 400,000 | | 369,584 |
| | 373 10年国債 | 0.6000 | 1,000,000 | | 917,240 |
| | 13 30年国債 | 2.0000 | 75,000 | | 76,674 |
| | 147 20年国債 | 1.6000 | 600,000 | | 595,326 |
| | 2 CT10年国債 | 1.0000 | 800,000 | | 754,344 |
| | 374 10年国債 | 0.8000 | 740,000 | | 687,075 |
| | 14 30年国債 | 2.4000 | 82,000 | | 86,235 |
| | 148 20年国債 | 1.5000 | 350,000 | | 343,784 |
| | 375 10年国債 | 1.1000 | 1,250,000 | | 1,185,612 |
| | 15 30年国債 | 2.5000 | 50,000 | | 52,945 |
| | 149 20年国債 | 1.5000 | 432,000 | | 423,338 |
| | 376 10年国債 | 0.9000 | 1,010,000 | | 938,441 |

日本債券インデックスマザーファンド

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|----|-----------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | | 当 | 末 | |
| | | % | 額面金額 | 評価額 | |
| | | | 千円 | 千円 | |
| | 16 30年国債 | 2.5000 | 250,000 | 264,700 | 2034/09/20 |
| | 150 20年国債 | 1.4000 | 770,000 | 746,599 | 2034/09/20 |
| | 377 10年国債 | 1.2000 | 1,350,000 | 1,282,972 | 2034/12/20 |
| | 17 30年国債 | 2.4000 | 130,000 | 136,493 | 2034/12/20 |
| | 151 20年国債 | 1.2000 | 550,000 | 522,692 | 2034/12/20 |
| | 378 10年国債 | 1.4000 | 1,300,000 | 1,253,096 | 2035/03/20 |
| | 18 30年国債 | 2.3000 | 80,000 | 83,251 | 2035/03/20 |
| | 152 20年国債 | 1.2000 | 850,000 | 804,899 | 2035/03/20 |
| | 379 10年国債 | 1.5000 | 1,075,000 | 1,043,190 | 2035/06/20 |
| | 19 30年国債 | 2.3000 | 500,000 | 520,155 | 2035/06/20 |
| | 153 20年国債 | 1.3000 | 300,000 | 285,912 | 2035/06/20 |
| | 3 CT10年国債 | 1.6000 | 400,000 | 390,892 | 2035/09/20 |
| | 380 10年国債 | 1.7000 | 950,000 | 936,234 | 2035/09/20 |
| | 154 20年国債 | 1.2000 | 180,000 | 169,380 | 2035/09/20 |
| | 21 30年国債 | 2.3000 | 60,000 | 62,261 | 2035/12/20 |
| | 155 20年国債 | 1.0000 | 860,000 | 790,684 | 2035/12/20 |
| | 22 30年国債 | 2.5000 | 170,000 | 179,322 | 2036/03/20 |
| | 156 20年国債 | 0.4000 | 660,000 | 567,171 | 2036/03/20 |
| | 157 20年国債 | 0.2000 | 800,000 | 667,880 | 2036/06/20 |
| | 24 30年国債 | 2.5000 | 92,000 | 96,729 | 2036/09/20 |
| | 158 20年国債 | 0.5000 | 650,000 | 557,459 | 2036/09/20 |
| | 25 30年国債 | 2.3000 | 150,000 | 154,351 | 2036/12/20 |
| | 159 20年国債 | 0.6000 | 630,000 | 542,814 | 2036/12/20 |
| | 26 30年国債 | 2.4000 | 300,000 | 310,911 | 2037/03/20 |
| | 160 20年国債 | 0.7000 | 650,000 | 562,802 | 2037/03/20 |
| | 161 20年国債 | 0.6000 | 660,000 | 561,204 | 2037/06/20 |
| | 27 30年国債 | 2.5000 | 150,000 | 156,339 | 2037/09/20 |
| | 162 20年国債 | 0.6000 | 800,000 | 675,656 | 2037/09/20 |
| | 163 20年国債 | 0.6000 | 600,000 | 503,286 | 2037/12/20 |
| | 28 30年国債 | 2.5000 | 300,000 | 311,118 | 2038/03/20 |
| | 164 20年国債 | 0.5000 | 840,000 | 690,765 | 2038/03/20 |
| | 165 20年国債 | 0.5000 | 570,000 | 465,108 | 2038/06/20 |
| | 29 30年国債 | 2.4000 | 200,000 | 204,096 | 2038/09/20 |
| | 166 20年国債 | 0.7000 | 850,000 | 707,115 | 2038/09/20 |
| | 167 20年国債 | 0.5000 | 600,000 | 482,160 | 2038/12/20 |
| | 30 30年国債 | 2.3000 | 220,000 | 220,673 | 2039/03/20 |
| | 168 20年国債 | 0.4000 | 820,000 | 644,618 | 2039/03/20 |
| | 169 20年国債 | 0.3000 | 620,000 | 476,414 | 2039/06/20 |
| | 31 30年国債 | 2.2000 | 300,000 | 295,617 | 2039/09/20 |
| | 170 20年国債 | 0.3000 | 750,000 | 571,612 | 2039/09/20 |
| | 171 20年国債 | 0.3000 | 570,000 | 430,657 | 2039/12/20 |
| | 32 30年国債 | 2.3000 | 385,000 | 381,508 | 2040/03/20 |
| | 172 20年国債 | 0.4000 | 500,000 | 380,595 | 2040/03/20 |
| | 173 20年国債 | 0.4000 | 780,000 | 588,915 | 2040/06/20 |
| | 33 30年国債 | 2.0000 | 350,000 | 331,632 | 2040/09/20 |
| | 174 20年国債 | 0.4000 | 950,000 | 711,417 | 2040/09/20 |
| | 175 20年国債 | 0.5000 | 700,000 | 528,696 | 2040/12/20 |
| | 34 30年国債 | 2.2000 | 270,000 | 260,604 | 2041/03/20 |
| | 176 20年国債 | 0.5000 | 800,000 | 599,416 | 2041/03/20 |
| | 177 20年国債 | 0.4000 | 700,000 | 511,371 | 2041/06/20 |
| | 35 30年国債 | 2.0000 | 320,000 | 298,496 | 2041/09/20 |
| | 178 20年国債 | 0.5000 | 800,000 | 589,720 | 2041/09/20 |
| | 179 20年国債 | 0.5000 | 630,000 | 460,870 | 2041/12/20 |
| | 36 30年国債 | 2.0000 | 350,000 | 323,921 | 2042/03/20 |

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|----|-----------|--------|---------|---------|------------|
| | | | 当 | 末 | |
| | | | | % | |
| | | | | 千円 | 千円 |
| | 180 20年国債 | 0.8000 | 840,000 | 643,364 | 2042/03/20 |
| | 181 20年国債 | 0.9000 | 620,000 | 479,731 | 2042/06/20 |
| | 37 30年国債 | 1.9000 | 350,000 | 316,358 | 2042/09/20 |
| | 182 20年国債 | 1.1000 | 850,000 | 676,396 | 2042/09/20 |
| | 183 20年国債 | 1.4000 | 570,000 | 474,074 | 2042/12/20 |
| | 38 30年国債 | 1.8000 | 260,000 | 229,567 | 2043/03/20 |
| | 184 20年国債 | 1.1000 | 690,000 | 542,560 | 2043/03/20 |
| | 39 30年国債 | 1.9000 | 270,000 | 241,123 | 2043/06/20 |
| | 185 20年国債 | 1.1000 | 730,000 | 570,217 | 2043/06/20 |
| | 40 30年国債 | 1.8000 | 240,000 | 209,743 | 2043/09/20 |
| | 186 20年国債 | 1.5000 | 700,000 | 582,211 | 2043/09/20 |
| | 41 30年国債 | 1.7000 | 250,000 | 214,075 | 2043/12/20 |
| | 187 20年国債 | 1.3000 | 550,000 | 439,488 | 2043/12/20 |
| | 42 30年国債 | 1.7000 | 320,000 | 272,307 | 2044/03/20 |
| | 188 20年国債 | 1.6000 | 550,000 | 460,130 | 2044/03/20 |
| | 43 30年国債 | 1.7000 | 300,000 | 253,824 | 2044/06/20 |
| | 189 20年国債 | 1.9000 | 560,000 | 489,798 | 2044/06/20 |
| | 44 30年国債 | 1.7000 | 300,000 | 252,513 | 2044/09/20 |
| | 190 20年国債 | 1.8000 | 500,000 | 428,130 | 2044/09/20 |
| | 45 30年国債 | 1.5000 | 300,000 | 242,655 | 2044/12/20 |
| | 191 20年国債 | 2.0000 | 530,000 | 467,449 | 2044/12/20 |
| | 46 30年国債 | 1.5000 | 300,000 | 241,317 | 2045/03/20 |
| | 192 20年国債 | 2.4000 | 415,000 | 389,083 | 2045/03/20 |
| | 47 30年国債 | 1.6000 | 450,000 | 366,723 | 2045/06/20 |
| | 193 20年国債 | 2.5000 | 400,000 | 379,564 | 2045/06/20 |
| | 48 30年国債 | 1.4000 | 470,000 | 367,013 | 2045/09/20 |
| | 194 20年国債 | 2.7000 | 400,000 | 390,428 | 2045/09/20 |
| | 49 30年国債 | 1.4000 | 310,000 | 240,671 | 2045/12/20 |
| | 50 30年国債 | 0.8000 | 450,000 | 306,184 | 2046/03/20 |
| | 51 30年国債 | 0.3000 | 500,000 | 299,285 | 2046/06/20 |
| | 52 30年国債 | 0.5000 | 430,000 | 268,259 | 2046/09/20 |
| | 53 30年国債 | 0.6000 | 400,000 | 253,564 | 2046/12/20 |
| | 54 30年国債 | 0.8000 | 450,000 | 297,040 | 2047/03/20 |
| | 55 30年国債 | 0.8000 | 400,000 | 262,024 | 2047/06/20 |
| | 56 30年国債 | 0.8000 | 430,000 | 279,525 | 2047/09/20 |
| | 57 30年国債 | 0.8000 | 400,000 | 258,044 | 2047/12/20 |
| | 1 40年国債 | 2.4000 | 100,000 | 89,824 | 2048/03/20 |
| | 58 30年国債 | 0.8000 | 650,000 | 416,143 | 2048/03/20 |
| | 59 30年国債 | 0.7000 | 380,000 | 235,235 | 2048/06/20 |
| | 60 30年国債 | 0.9000 | 350,000 | 226,282 | 2048/09/20 |
| | 61 30年国債 | 0.7000 | 380,000 | 231,416 | 2048/12/20 |
| | 2 40年国債 | 2.2000 | 110,000 | 93,754 | 2049/03/20 |
| | 62 30年国債 | 0.5000 | 450,000 | 257,125 | 2049/03/20 |
| | 63 30年国債 | 0.4000 | 430,000 | 236,409 | 2049/06/20 |
| | 64 30年国債 | 0.4000 | 420,000 | 228,673 | 2049/09/20 |
| | 65 30年国債 | 0.4000 | 420,000 | 226,606 | 2049/12/20 |
| | 3 40年国債 | 2.2000 | 195,000 | 163,429 | 2050/03/20 |
| | 66 30年国債 | 0.4000 | 350,000 | 187,029 | 2050/03/20 |
| | 67 30年国債 | 0.6000 | 420,000 | 235,964 | 2050/06/20 |
| | 68 30年国債 | 0.6000 | 470,000 | 261,132 | 2050/09/20 |
| | 69 30年国債 | 0.7000 | 460,000 | 260,603 | 2050/12/20 |
| | 4 40年国債 | 2.2000 | 180,000 | 147,220 | 2051/03/20 |
| | 70 30年国債 | 0.7000 | 550,000 | 308,594 | 2051/03/20 |
| | 71 30年国債 | 0.7000 | 450,000 | 250,191 | 2051/06/20 |

日本債券インデックスマザーファンド

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|-------|----------|-------------|-------------|-------------|------------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | |
| | 72 30年国債 | 0.7000 | 450,000 | 248,364 | 2051/09/20 |
| | 73 30年国債 | 0.7000 | 450,000 | 246,262 | 2051/12/20 |
| | 5 40年国債 | 2.0000 | 160,000 | 123,171 | 2052/03/20 |
| | 74 30年国債 | 1.0000 | 550,000 | 327,618 | 2052/03/20 |
| | 75 30年国債 | 1.3000 | 450,000 | 290,200 | 2052/06/20 |
| | 76 30年国債 | 1.4000 | 410,000 | 270,542 | 2052/09/20 |
| | 77 30年国債 | 1.6000 | 430,000 | 297,852 | 2052/12/20 |
| | 6 40年国債 | 1.9000 | 250,000 | 185,982 | 2053/03/20 |
| | 78 30年国債 | 1.4000 | 500,000 | 327,585 | 2053/03/20 |
| | 79 30年国債 | 1.2000 | 410,000 | 253,072 | 2053/06/20 |
| | 80 30年国債 | 1.8000 | 420,000 | 303,160 | 2053/09/20 |
| | 81 30年国債 | 1.6000 | 475,000 | 324,520 | 2053/12/20 |
| | 7 40年国債 | 1.7000 | 290,000 | 203,765 | 2054/03/20 |
| | 82 30年国債 | 1.8000 | 460,000 | 330,054 | 2054/03/20 |
| | 83 30年国債 | 2.2000 | 450,000 | 355,054 | 2054/06/20 |
| | 84 30年国債 | 2.1000 | 400,000 | 307,760 | 2054/09/20 |
| | 85 30年国債 | 2.3000 | 400,000 | 321,820 | 2054/12/20 |
| | 8 40年国債 | 1.4000 | 340,000 | 217,093 | 2055/03/20 |
| | 86 30年国債 | 2.4000 | 400,000 | 328,980 | 2055/03/20 |
| | 87 30年国債 | 2.8000 | 325,000 | 291,317 | 2055/06/20 |
| | 88 30年国債 | 3.2000 | 575,000 | 558,802 | 2055/09/20 |
| | 9 40年国債 | 0.4000 | 220,000 | 98,736 | 2056/03/20 |
| | 10 40年国債 | 0.9000 | 130,000 | 69,635 | 2057/03/20 |
| | 11 40年国債 | 0.8000 | 320,000 | 162,316 | 2058/03/20 |
| | 12 40年国債 | 0.5000 | 380,000 | 166,443 | 2059/03/20 |
| | 13 40年国債 | 0.5000 | 420,000 | 179,982 | 2060/03/20 |
| | 14 40年国債 | 0.7000 | 430,000 | 196,587 | 2061/03/20 |
| | 15 40年国債 | 1.0000 | 410,000 | 205,410 | 2062/03/20 |
| | 16 40年国債 | 1.3000 | 850,000 | 464,440 | 2063/03/20 |
| | 17 40年国債 | 2.2000 | 840,000 | 603,086 | 2064/03/20 |
| | 18 40年国債 | 3.1000 | 1,050,000 | 944,569 | 2065/03/20 |
| 種別小計 | 銘柄数 | 280銘柄 | | | |
| | 金額 | | 145,771,000 | 129,053,673 | |
| 地方債証券 | | 28-2 新潟県公債 | 0.1800 | 100,000 | 99,111 |
| | | 168 共同発行地方 | 0.2100 | 100,000 | 99,017 |
| | | 170 共同発行地方 | 0.1800 | 200,000 | 197,588 |
| | | 420 大阪府公債 | 0.1700 | 200,000 | 197,546 |
| | | 29-1 福岡県公債 | 0.2000 | 100,000 | 98,731 |
| | | 29-5 広島県公債 | 0.2450 | 100,000 | 98,154 |
| | | 14 横浜市20年 | 2.3200 | 100,000 | 102,700 |
| | | 20-1 神戸市20年 | 2.3800 | 100,000 | 103,000 |
| | | 16 東京都20年 | 2.0100 | 100,000 | 102,303 |
| | | 26-2 京都府15年 | 1.0710 | 100,000 | 99,247 |
| | | 6-1 大阪市5年 | 0.5800 | 100,000 | 97,553 |
| | | 21-5 愛知県公債 | 2.2800 | 100,000 | 103,343 |
| | | 195 共同発行地方 | 0.0290 | 100,000 | 95,536 |
| | | 196 共同発行地方 | 0.0600 | 100,000 | 95,500 |
| | | 8 静岡県20年 | 2.2430 | 200,000 | 206,469 |
| | | 19 横浜市20年 | 2.2000 | 100,000 | 103,131 |
| | | 796 東京都公債 | 0.0400 | 100,000 | 95,144 |
| | | 26-5 札幌市15年 | 0.9610 | 100,000 | 98,560 |
| | | 1 北九州市15年 | 0.9360 | 100,000 | 98,375 |

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|--------------|--------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| | 1-1 山梨県公債 | 0.0500 | 100,000 | 94,989 | 2029/10/30 |
| | 11 名古屋市20年 | 2.1300 | 200,000 | 205,820 | 2029/12/14 |
| | 1-5 千葉市公債 | 0.0800 | 100,000 | 94,544 | 2030/02/25 |
| | 2-1 静岡県公債 | 0.1260 | 100,000 | 94,599 | 2030/03/19 |
| | 2-1 京都府公債 | 0.1350 | 200,000 | 189,060 | 2030/04/12 |
| | 9 埼玉県20年 | 2.1500 | 100,000 | 103,046 | 2030/05/24 |
| | 206 共同発行地方 | 0.1310 | 100,000 | 94,304 | 2030/05/24 |
| | 808 東京都公債 | 0.1100 | 100,000 | 93,626 | 2030/09/20 |
| | 2-4 札幌市公債 | 0.1200 | 100,000 | 93,679 | 2030/09/20 |
| | 2-7 埼玉県公債 | 0.1250 | 100,000 | 93,602 | 2030/10/16 |
| | 27-12 愛知県15年 | 0.7590 | 100,000 | 96,531 | 2030/10/21 |
| | 2-2 岡山県公債 | 0.1200 | 100,000 | 93,056 | 2031/01/29 |
| | 3-5 北海道公債 | 0.1400 | 100,000 | 92,423 | 2031/06/30 |
| | 23-4 福岡市20年 | 1.8900 | 100,000 | 101,688 | 2031/08/19 |
| | 7 大阪府20年 | 1.8400 | 200,000 | 202,717 | 2031/09/26 |
| | 37-2 宮城県公債 | 0.1350 | 100,000 | 91,756 | 2031/10/28 |
| | 10 京都市20年 | 1.8030 | 100,000 | 101,057 | 2031/11/21 |
| | 3-2 徳島県公債 | 0.1300 | 100,000 | 91,544 | 2031/11/26 |
| | 827 東京都公債 | 0.2940 | 100,000 | 91,951 | 2032/03/19 |
| | 12 埼玉県20年 | 1.7300 | 100,000 | 100,380 | 2032/05/24 |
| | 4-3 長崎県公債 | 0.3640 | 100,000 | 91,914 | 2032/06/18 |
| | 13 千葉県20年 | 1.7010 | 100,000 | 99,938 | 2032/10/15 |
| | 5-1 福岡県公債 | 0.6810 | 100,000 | 92,409 | 2033/05/30 |
| | 244 共同発行地方 | 0.5900 | 200,000 | 183,047 | 2033/07/25 |
| | 25-1 広島県20年 | 1.7500 | 100,000 | 99,623 | 2033/09/13 |
| | 19 兵庫県公債20年 | 1.5700 | 100,000 | 98,071 | 2033/12/09 |
| | 262 神奈川県公債 | 1.0800 | 100,000 | 94,046 | 2034/03/17 |
| | 16 千葉県20年 | 1.5550 | 100,000 | 97,636 | 2034/04/14 |
| | 26-4 愛知県20年 | 1.5420 | 100,000 | 97,442 | 2034/05/15 |
| | 6-2 大阪市公債 | 0.9950 | 100,000 | 93,172 | 2034/05/22 |
| | 17 北九州市20年 | 1.5290 | 100,000 | 97,242 | 2034/06/20 |
| | 255 共同発行地方 | 1.0810 | 100,000 | 93,722 | 2034/06/23 |
| | 27 神奈川県20年 | 1.3980 | 100,000 | 95,924 | 2034/09/20 |
| | 866 東京都公債 | 1.7140 | 200,000 | 195,727 | 2035/06/20 |
| | 270 共同発行地方 | 1.7610 | 200,000 | 196,027 | 2035/09/25 |
| | 31 神奈川県20年 | 1.0020 | 100,000 | 90,811 | 2035/12/20 |
| | 4 川崎市公債30年 | 2.1000 | 100,000 | 92,311 | 2041/09/20 |
| | 4 埼玉県30年 | 1.3270 | 100,000 | 74,326 | 2045/12/20 |
| 種別小計 | 銘柄数 | 57銘柄 | | | |
| | 金額 | | 6,600,000 | 6,394,791 | |
| 特殊債券（除く金融債券） | F124地方公共団体 | 1.4180 | 100,000 | 100,502 | 2027/06/04 |
| | 97政保地方公共団体 | 0.1300 | 100,000 | 98,703 | 2027/06/14 |
| | F143地方公共団体 | 1.3510 | 100,000 | 100,387 | 2027/08/25 |
| | 321 政保道路機構 | 0.1550 | 200,000 | 196,995 | 2027/08/31 |
| | 1 地方公共団15年 | 1.3340 | 100,000 | 100,305 | 2028/01/28 |
| | F192地方公共団体 | 1.1670 | 100,000 | 99,690 | 2028/10/24 |
| | F226地方公共団体 | 1.0960 | 100,000 | 99,223 | 2029/02/28 |
| | 4 国際協力銀行CO | 0.6390 | 100,000 | 97,710 | 2029/03/19 |
| | 86 政保道路機構 | 2.0000 | 100,000 | 102,469 | 2029/07/31 |
| | 47日本政策投資CO | 1.0270 | 100,000 | 98,539 | 2029/09/20 |
| | 97 政保道路機構 | 2.1000 | 100,000 | 102,896 | 2029/12/28 |
| | 129 地方公共団体 | 0.0950 | 200,000 | 188,607 | 2030/02/28 |

日本債券インデックスマザーファンド

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|-------|----------------|--------|-----------|-----------|------------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | |
| | 403 政保道路機構 | 0.0010 | 100,000 | 94,178 | 2030/03/29 |
| | F221地方公共団体 | 1.1980 | 200,000 | 197,368 | 2030/04/26 |
| | 69 政保政策投資 C | 0.0800 | 100,000 | 93,272 | 2030/12/16 |
| | 160 政保道路機構 | 1.8000 | 200,000 | 202,195 | 2032/03/19 |
| | 156鉄道建設・運輸 | 0.3500 | 200,000 | 182,162 | 2032/08/30 |
| | 123 住宅支援機構 | 1.8010 | 100,000 | 100,194 | 2032/09/17 |
| | 174 日本政策投資 | 0.6490 | 300,000 | 274,707 | 2033/07/14 |
| | 31 地方公共団体 | 1.7440 | 100,000 | 99,119 | 2033/09/28 |
| | 2 公営企業30年 | 2.3900 | 200,000 | 207,249 | 2033/12/20 |
| | 478 政保道路機構 | 1.0900 | 100,000 | 93,997 | 2034/06/30 |
| | 223 政保道路機構 | 1.4270 | 100,000 | 96,567 | 2034/07/31 |
| | 33 沖縄振興開発 | 1.0680 | 200,000 | 185,155 | 2034/10/20 |
| | 235 政保道路機構 | 1.2240 | 100,000 | 94,438 | 2034/12/28 |
| | F568地方公共団体 | 0.3260 | 200,000 | 170,128 | 2035/07/30 |
| | 86 政保政策投資 C | 1.7130 | 300,000 | 293,526 | 2035/09/18 |
| | 284 政保道路機構 | 0.1490 | 200,000 | 163,793 | 2036/07/31 |
| | 298 政保道路機構 | 0.5470 | 100,000 | 84,728 | 2036/12/26 |
| | 247 道路機構 | 0.3420 | 200,000 | 146,710 | 2040/03/19 |
| 種別小計 | 銘柄数 | 30銘柄 | | | |
| | 金額 | | 4,400,000 | 4,165,523 | |
| 普通社債券 | | | | | |
| | 22 イオン FS | 0.4400 | 200,000 | 198,030 | 2027/01/04 |
| | 509 関西電力 | 0.4700 | 100,000 | 98,933 | 2027/05/25 |
| | 30 阪神高速道路 | 0.3390 | 100,000 | 98,882 | 2027/05/31 |
| | 42 リコーリース | 0.3900 | 100,000 | 98,663 | 2027/06/01 |
| | 12 アサヒグループ HD | 0.3300 | 100,000 | 98,722 | 2027/06/11 |
| | 15 デンソー | 0.2450 | 100,000 | 98,603 | 2027/06/18 |
| | 4 香港上海銀行 | 0.8080 | 100,000 | 99,308 | 2027/06/25 |
| | 78 トヨタファイナンス | 0.2650 | 100,000 | 98,530 | 2027/07/23 |
| | 11 東京電力パワー | 0.7900 | 100,000 | 98,563 | 2028/01/25 |
| | 7 日本製鉄 | 0.5640 | 100,000 | 98,059 | 2028/03/17 |
| | 16 クボタ | 0.4790 | 100,000 | 97,936 | 2028/04/20 |
| | 16 JERA | 0.6400 | 100,000 | 98,116 | 2028/04/25 |
| | 1 SOMPOHD | 0.4790 | 100,000 | 97,768 | 2028/04/27 |
| | 111 住友不動産 | 0.5200 | 100,000 | 98,045 | 2028/04/28 |
| | 11サントリーホールディング | 0.3890 | 100,000 | 97,734 | 2028/05/25 |
| | 50 大阪瓦斯 | 0.3900 | 100,000 | 97,762 | 2028/06/02 |
| | 82 三井不動産 | 0.3600 | 100,000 | 97,573 | 2028/06/06 |
| | 22 積水ハウス | 0.3600 | 100,000 | 97,622 | 2028/06/07 |
| | 26 リそなホールディング | 0.4150 | 100,000 | 97,673 | 2028/06/07 |
| | 1 レゾナツク HD | 0.6950 | 100,000 | 97,712 | 2028/06/15 |
| | 31 豊田通商 | 0.3550 | 200,000 | 194,984 | 2028/06/15 |
| | 81 ホンダファイナンス | 0.3890 | 100,000 | 97,402 | 2028/06/20 |
| | 34 沖縄電力 | 0.3650 | 100,000 | 97,570 | 2028/06/23 |
| | 62 日本電気 | 0.3550 | 200,000 | 194,780 | 2028/07/11 |
| | 3 オリックス銀行 | 0.4100 | 200,000 | 195,002 | 2028/07/12 |
| | 68 名古屋鉄道 | 0.3750 | 200,000 | 194,978 | 2028/07/13 |
| | 20 ZHD | 0.4600 | 100,000 | 96,683 | 2028/07/28 |
| | 101 中日本高速道 | 0.4390 | 400,000 | 391,221 | 2028/08/17 |
| | 4 アステラス製薬 | 0.5190 | 300,000 | 293,083 | 2028/08/31 |
| | 8 ピーエヌピー・パリバ | 1.0100 | 100,000 | 98,251 | 2028/09/07 |
| | 27 リそなホールディング | 0.5190 | 200,000 | 195,265 | 2028/09/08 |
| | 15 ソフトバンク | 0.4100 | 100,000 | 96,358 | 2028/10/12 |

| 区分 | 銘柄 | 年利率 | 期 | | 償還年月日 |
|------|---------------|--------|-------------|-------------|------------|
| | | | 額面金額 | 評価額 | |
| | | % | 千円 | 千円 | |
| | 33 首都高速道路 | 0.5230 | 100,000 | 97,613 | 2028/12/20 |
| | 28 三井住友TB | 0.5440 | 300,000 | 291,362 | 2029/01/25 |
| | 41 東海旅客鉄道 | 2.1660 | 100,000 | 102,305 | 2029/01/29 |
| | 111 東日本高速道 | 0.6070 | 100,000 | 97,415 | 2029/04/25 |
| | 32 住友電工 | 0.4640 | 100,000 | 96,290 | 2029/07/13 |
| | 13 NTT ファイナンス | 1.0900 | 100,000 | 98,133 | 2029/09/20 |
| | 85 電源開発 | 0.8720 | 100,000 | 97,181 | 2029/10/31 |
| | 52 阪急阪神 HLDG | 0.2150 | 100,000 | 94,908 | 2029/11/21 |
| | 7 凸版印刷 | 1.1040 | 100,000 | 98,062 | 2029/12/12 |
| | 39 BPCE S. A. | 1.4580 | 100,000 | 98,013 | 2029/12/19 |
| | 65 東京瓦斯 | 0.2250 | 100,000 | 93,559 | 2030/09/10 |
| | 18 セブンアンドアイ | 1.0400 | 100,000 | 95,737 | 2030/11/01 |
| | 35 東レ | 0.9730 | 300,000 | 288,053 | 2030/11/22 |
| | 538 関西電力 | 0.3900 | 100,000 | 93,167 | 2031/01/24 |
| | 88 西日本高速道 | 0.8580 | 100,000 | 95,826 | 2031/05/23 |
| | 33 NTT ファイナンス | 1.1120 | 100,000 | 95,999 | 2031/06/20 |
| | 34 KDDI | 1.0580 | 100,000 | 96,225 | 2031/07/11 |
| | 18 楽天グループ | 1.0500 | 100,000 | 86,804 | 2031/12/02 |
| | 44 大阪瓦斯 | 0.3690 | 100,000 | 91,130 | 2032/06/02 |
| | 18 武田薬品 | 1.9350 | 100,000 | 98,235 | 2032/06/11 |
| | 34 ダイキン工業 | 1.6520 | 100,000 | 98,263 | 2032/09/10 |
| | 143 三菱地所 | 0.9000 | 100,000 | 92,457 | 2033/05/02 |
| | 448 中国電力 | 0.9200 | 100,000 | 91,509 | 2033/05/25 |
| | 31 トヨタ自動車 | 0.7350 | 100,000 | 91,835 | 2033/06/01 |
| | 2 AGC | 0.7900 | 100,000 | 91,623 | 2033/06/08 |
| | 63 住友商事 | 0.8400 | 100,000 | 91,240 | 2033/06/15 |
| | 67 阪急阪神 HLDG | 0.7740 | 100,000 | 91,400 | 2033/07/13 |
| | 560 東北電力 | 0.8700 | 200,000 | 181,640 | 2033/07/25 |
| | 87 電源開発 | 1.1060 | 100,000 | 91,642 | 2034/02/20 |
| | 41 ソニーG | 1.0010 | 100,000 | 92,170 | 2034/03/07 |
| | 393 北海道電力 | 1.4010 | 100,000 | 93,045 | 2034/06/23 |
| | 38 NTT ファイナンス | 1.3980 | 200,000 | 185,841 | 2034/09/20 |
| | 83 東京電力 PG | 2.6160 | 200,000 | 196,850 | 2035/05/28 |
| | 11 三井住友海上 | 2.0660 | 200,000 | 195,322 | 2035/07/25 |
| | 332 北海道電力 | 0.9070 | 100,000 | 85,598 | 2036/04/25 |
| | 23 森ビル | 0.9700 | 100,000 | 80,662 | 2038/05/17 |
| | 107 東日本旅客鉄 | 1.4150 | 100,000 | 75,690 | 2045/01/27 |
| 種別小計 | 銘柄数 | 69銘柄 | | | |
| | 金額 | | 8,800,000 | 8,442,648 | |
| 合計 | 銘柄数 | 436銘柄 | | | |
| | 金額 | | 165,571,000 | 148,056,636 | |

(注) 単位未満は切捨て。

日本債券インデックスマザーファンド

■投資信託財産の構成

2025年12月1日現在

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-------------|-------|
| | 評価額 | 比率 |
| 千円 | | % |
| 公社債 | 148,056,636 | 97.1 |
| コール・ローン等、その他 | 4,365,548 | 2.9 |
| 投資信託財産総額 | 152,422,184 | 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

2025年12月1日現在

| 項目 | 当期末 |
|--------------------------|-------------------------|
| (A) 資産 | 152,422,184,664円 |
| コール・ローン等 | 490,369,628 |
| 公社債（評価額） | 148,056,636,090 |
| 未収入金 | 3,454,022,850 |
| 未収利息 | 375,422,244 |
| 前払費用 | 45,733,852 |
| (B) 負債 | 3,628,909,797 |
| 未払金 | 3,554,588,450 |
| 未払解約金 | 74,321,347 |
| (C) 純資産総額 (A - B) | 148,793,274,867 |
| 元本 | 119,861,352,942 |
| 次期繰越損益金 | 28,931,921,925 |
| (D) 受益権総口数 | 119,861,352,942口 |
| 1万口当り基準価額 (C / D) | 12,414円 |

*期首における元本額は98,770,541,951円、当成期間中における追加設定元本額は37,393,871,500円、同解約元本額は16,303,060,511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：

| | |
|------------------------------|-----------------|
| ダイワ国内重視バランスファンド30VA（一般投資家私募） | 30,242,579円 |
| ダイワ国内重視バランスファンド50VA（一般投資家私募） | 155,708,319円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド30VA（一般投資家私募） | 39,160,107円 |
| ダイワ国際分散バランスファンド50VA（一般投資家私募） | 392,326,775円 |
| DCダイワ日本債券インデックス | 11,095,179,348円 |
| ダイワ国内債券インデックス（ラップ専用） | 33,952,815,122円 |
| ダイワ・バランスファンド35VA | 7,327,340,543円 |
| ダイワ・バランスファンド25VA（適格機関投資家専用） | 1,366,627,333円 |
| ダイワ国内バランスファンド25VA（適格機関投資家専用） | 151,056,182円 |
| ダイワ国内バランスファンド30VA（適格機関投資家専用） | 174,235,036円 |
| ダイワ・ノーロード 日本債券ファンド | 42,251,977円 |
| ダイワファンドラップ 日本債券インデックス | 36,790,421,534円 |
| ダイワ日本債券インデックス（ダイワSMA専用） | 15,422,746,793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 | 1,908,412,305円 |
| スタイル9（4資産分散・保守型） | 13,136,298円 |
| スタイル9（4資産分散・バランス型） | 26,558,840円 |
| スタイル9（4資産分散・積極型） | 3,191,316円 |
| スタイル9（6資産分散・保守型） | 5,607,534円 |
| スタイル9（6資産分散・バランス型） | 48,538,671円 |
| スタイル9（6資産分散・積極型） | 3,907,495円 |
| スタイル9（8資産分散・保守型） | 8,627,706円 |
| スタイル9（8資産分散・バランス型） | 45,386,483円 |
| スタイル9（8資産分散・積極型） | 5,566,516円 |

ダイワ国内債券インデックス（投資一任専用）

3,122,291,340円

ダイワ・インデックスセレクト 日本債券

587,929,227円

ダイワ投信俱楽部日本債券インデックス

5,709,571,896円

ダイワライフスタイル25

466,803,642円

ダイワライフスタイル50

745,008,857円

ダイワライフスタイル75

220,703,168円

*当期末の計算口数当りの純資産額は12,414円です。

■損益の状況

当期 自 2024年12月3日 至 2025年12月1日

| 項目 | 当期 |
|-------------------------------|-----------------------|
| (A) 配当等収益 | 1,178,528,057円 |
| 受取利息 | 1,178,528,057 |
| (B) 有価証券売買損益 | 8,263,874,870 |
| 売買益 | 51,273,650 |
| 売買損 | 8,315,148,520 |
| (C) 当期損益金 (A + B) | 7,085,346,813 |
| (D) 前期繰越損益金 | 30,514,387,947 |
| (E) 解約差損益金 | 4,668,063,334 |
| (F) 追加信託差損益金 | 10,170,944,125 |
| (G) 合計 (C + D + E + F) | 28,931,921,925 |
| 次期繰越損益金 (G) | 28,931,921,925 |

(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。

《お知らせ》

■運用報告書にかかる信託約款の条文変更について

2025年4月1日付の投資信託及び投資法人に関する法律の改正により、運用報告書にかかる規定が変更されたため、運用報告書にかかる信託約款の条文を以下のとおり変更しました。（下線部を変更）

＜変更前＞

（運用報告書）

委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める運用報告書を交付しません。

＜変更後＞

（運用状況にかかる情報）

委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条に定める事項にかかる情報を提供しません。