

iFree 日本債券 インデックス

運用報告書（全体版） 第8期

（決算日 2023年11月30日）
（作成対象期間 2022年12月1日～2023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、わが国の公社債等に投資し、投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

大和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：2016年9月8日）	
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）の受益証券
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
組入制限	ベビーファンドの マザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの 株式組入上限比率	純資産総額の 10%以下
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行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			NOMURA-BPI 総合指数		公社債 組入比率	債券先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
4期末(2019年12月2日)	円 10,074	円 0	% 2.2	10,138	% 2.4	% 99.1	% -	百万円 175
5期末(2020年11月30日)	9,981	0	△0.9	10,055	△0.8	99.1	-	263
6期末(2021年11月30日)	9,975	0	△0.1	10,068	0.1	98.8	-	4,386
7期末(2022年11月30日)	9,547	0	△4.3	9,644	△4.2	99.0	-	4,582
8期末(2023年11月30日)	9,414	0	△1.4	9,529	△1.2	99.0	-	4,114

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NOMURA-BPI総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(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。

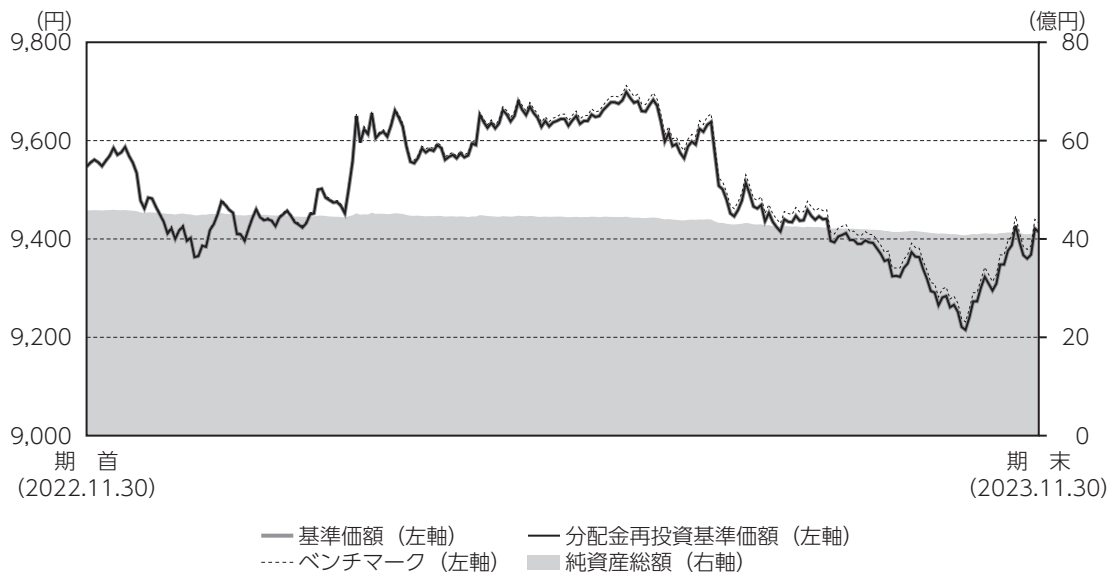
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

NOMURA-BPIの知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- *分配金再投資基準価額は、分配金(税込み)を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- *分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります(分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります)。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- *ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数です。

■基準価額・騰落率

期首：9,547円

期末：9,414円(分配金0円)

騰落率：△1.4%(分配金込み)

■基準価額の主な変動要因

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(BPI)」の受益証券を通じて、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)したことが主な要因となり、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。

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合指数 (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2022年11月30日	円 9,547	% -	9,644	% -	% 99.0	% -
12月末	9,421	△1.3	9,521	△1.3	99.3	-
2023年 1 月末	9,396	△1.6	9,496	△1.5	99.2	-
2 月末	9,500	△0.5	9,599	△0.5	99.0	-
3 月末	9,629	0.9	9,733	0.9	99.4	-
4 月末	9,652	1.1	9,756	1.2	99.4	-
5 月末	9,640	1.0	9,747	1.1	99.7	-
6 月末	9,660	1.2	9,773	1.3	99.2	-
7 月末	9,508	△0.4	9,621	△0.2	99.1	-
8 月末	9,438	△1.1	9,552	△1.0	99.2	-
9 月末	9,370	△1.9	9,483	△1.7	99.1	-
10月末	9,221	△3.4	9,332	△3.2	99.3	-
(期末) 2023年11月30日	9,414	△1.4	9,529	△1.2	99.0	-

(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

(2022.12.1～2023.11.30)

■国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇基調で推移しました。

国内長期金利は、当作成期首より2023年2月にかけて、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことにより上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。3月は欧米の金融不安の高まりを受けて金利は低下しましたが、4月から6月にかけては欧米の金融不安が落ち着いたことで上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。7月から8月にかけては、日銀が金融政策決定会合で長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を柔軟化することを決定したことなどから長期金利は上昇し、0.6%前後で推移しました。9月から10月にかけては、米国金利の上昇を受けて国内金利も上昇し、0.7%から1.0%前後で推移しました。当作成期末にかけては、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下基調で推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

ポートフォリオについて

(2022.12.1～2023.11.30)

■当ファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

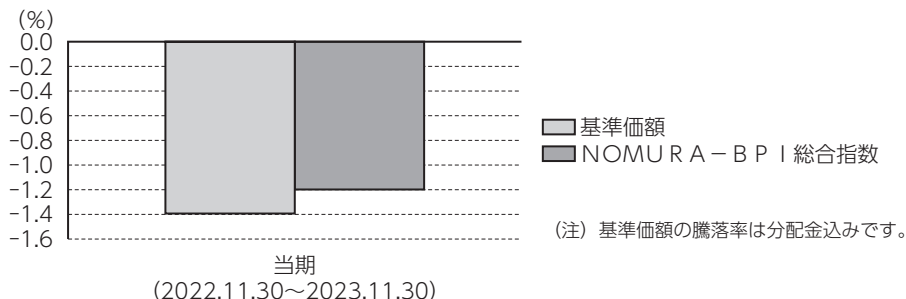
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	NOMURA-BPI総合指数

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 $\Delta 1.2\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 1.4\%$ 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 $\Delta 0.2\%$ でした。差異の内訳は、運用管理費用要因によるベンチマークとの差異が $\Delta 0.1\%$ 程度となっており、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはNOMURA-BPI総合指数です。

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（1万口当たり）

項 目	当 期	
	2022年12月1日 ～2023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）	52

（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。

（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ありません。



今後の運用方針

■当ファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド（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、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.12.1~2023.11.30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	13円	0.132%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,498円です。
(投 信 会 社)	(5)	(0.049)	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)	(7)	(0.071)	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)	(1)	(0.011)	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	13	0.137	

(注1) 当作成期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

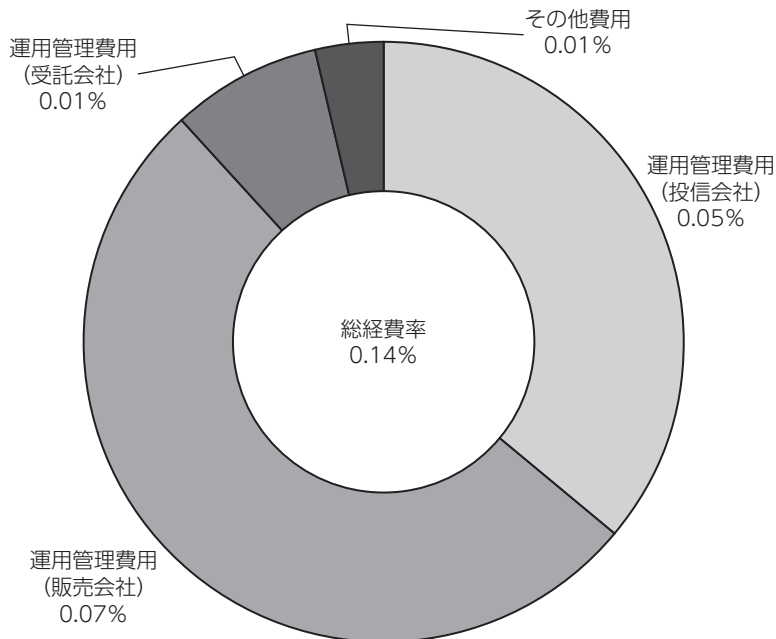
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

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

参考情報

■ 総経費率

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



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

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

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■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

(2022年12月1日から2023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
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I)	69,976	86,500	404,844	498,897

(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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 20,551	百万円 1,218	5.9	百万円 8,839	百万円 300	% 3.4
コール・ローン	65,912	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合9.2%

*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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
公社債		百万円 1,800

(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	評 価 額	口 数	評 価 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド(B P I)	3,696,009	3,361,141	4,110,340	4,110,340

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I)	4,110,340	99.6
コール・ローン等、その他	15,265	0.4
投資信託財産総額	4,125,605	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

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,125,605,978円
コール・ローン等	7,076,162
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド(B P I)(評価額)	4,110,340,413
未収入金	8,189,403
(B) 負債	11,163,596
未払解約金	8,223,220
未払信託報酬	2,822,855
その他未払費用	117,521
(C) 純資産総額(A - B)	4,114,442,382
元本	4,370,530,545
次期繰越損益金	△ 256,088,163
(D) 受益権総口数	4,370,530,545口
1万口当り基準価額(C / D)	9,414円

*期首における元本額は4,799,409,040円、当作成期間中における追加設定元本額は153,251,309円、同解約元本額は582,129,804円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,414円です。

*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は256,088,163円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,989円
受取利息	127
支払利息	△ 2,116
(B) 有価証券売買損益	△ 51,610,741
売買益	5,886,403
売買損	△ 57,497,144
(C) 信託報酬等	△ 6,021,027
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 57,633,757
(E) 前期繰越損益金	△ 173,502,207
(F) 追加信託差損益金	△ 24,952,199
(配当等相当額)	(21,506,127)
(売買損益相当額)	(△ 46,458,326)
(G) 合計(D + E + F)	△ 256,088,163
次期繰越損益金(G)	△ 256,088,163
追加信託差損益金	△ 24,952,199
(配当等相当額)	(21,506,127)
(売買損益相当額)	(△ 46,458,326)
分配準備積立金	1,520,059
繰越損益金	△ 232,656,023

(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	21,506,127
(d) 分配準備積立金	1,520,059
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	23,026,186
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	23,026,186
(h) 受益権総口数	4,370,530,545口

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）

運用報告書 第19期（決算日 2023年11月30日）

（作成対象期間 2022年12月1日～2023年11月30日）

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（B P I）の運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

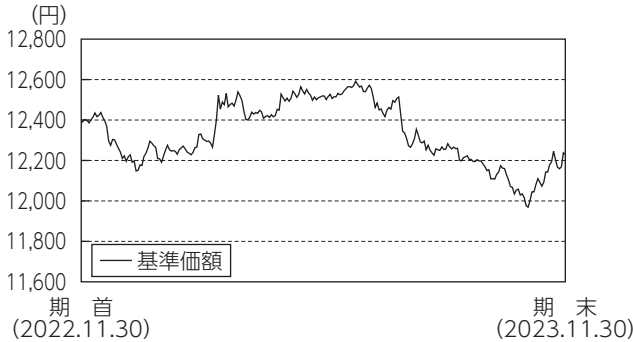
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株式組入制限	純資産総額の10%以下

大和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



年月日	基準価額		NOMURA-BPI 総合指数		公社債 組入比率	債券 先物比率
	円	騰落率	騰落率	騰落率		
(期首)2022年11月30日	12,385	-	12,408	-	99.1	-
12月末	12,223	△1.3	12,250	△1.3	99.4	-
2023年1月末	12,191	△1.6	12,217	△1.5	99.3	-
2月末	12,328	△0.5	12,350	△0.5	99.1	-
3月末	12,497	0.9	12,522	0.9	99.4	-
4月末	12,528	1.2	12,551	1.2	99.5	-
5月末	12,514	1.0	12,540	1.1	99.8	-
6月末	12,541	1.3	12,574	1.3	99.3	-
7月末	12,345	△0.3	12,378	△0.2	99.2	-
8月末	12,256	△1.0	12,289	△1.0	99.3	-
9月末	12,169	△1.7	12,201	△1.7	99.2	-
10月末	11,977	△3.3	12,007	△3.2	99.4	-
(期末)2023年11月30日	12,229	△1.3	12,260	△1.2	99.1	-

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) NOMURA-BPI総合指数は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
- (注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券(転換社債券)を除きます。
- (注5) 債券先物比率は買建比率-売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：12,385円 期末：12,229円 騰落率：△1.3%

【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)したことが主な要因となり、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

○国内債券市況

国内債券市場では、長期金利は上昇基調で推移しました。

国内長期金利は、当作成期首より2023年2月にかけて、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことにより上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。3月は欧米の金融不安の高まりを受け

て金利は低下しましたが、4月から6月にかけては欧米の金融不安が落ち着いたことで上昇し、0.4%から0.5%前後で推移しました。7月から8月にかけては、日銀が金融政策決定会合で長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)の運用を柔軟化することを決定したことなどから長期金利は上昇し、0.6%前後で推移しました。9月から10月にかけては、米国金利の上昇を受けて国内金利も上昇し、0.7%から1.0%前後で推移しました。当作成期末にかけては、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、金利は低下基調で推移しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド(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パース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

◆ポートフォリオについて

当ファンドの基準価額の騰落率が、ベンチマークの騰落率に連動することをめざしたポートフォリオ構築を行いました。当作成期を通じて、公社債組入比率を99%前後の高位に保つと同時に、ポートフォリオの満期構成やデュレーション、金利や信用スプレッド(国債以外の債券における国債との利回り格差)の変動に対する感応度などをベンチマークに適切に近づけることにより、高い連動性を維持しました。また、ファンドへの資金流入や毎月末に行われるベンチマークのユニパ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△1.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△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は△0.1%程度で、ベンチマークにおおむね連動した運用結果となりました。金利や信用スプレッド(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NOMURA-BPI総合指数です。

《今後の運用方針》

ベンチマークとの高い連動性を維持するように運用を行ってまいります。残存年限別構成や債券種別構成、金利や信用スプレッド(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パース変更に対しては、売買コストなどに十分配慮しつつ、きめ細かなポートフォリオのリバランスを行います。なお、当ファンドは現在、ベンチマークに含まれるすべての債券種別を組入対象としておりますが、流動性の問題などを勘案し、相対的に格付けの低い銘柄等への投資は見送ることもあります。

■1万口当りの費用の明細

項目	当期
売買委託手数料	-円
有価証券取引税	-
その他費用	-
合計	-

(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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	15,804,275	8,375,812 (-)
	地方債証券	1,641,256	(-)
内	特殊債券	608,675	100,523 (3,336)
	社債券	2,497,020	363,218 (-)

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子は含まれておりません）。

(注2) ()内は償還による減少分、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

(2022年12月1日から2023年11月30日まで)

		当期			
		買付		売付	
		金額	銘柄	金額	銘柄
		千円		千円	
369	10年国債 0.5% 2032/12/20	653,004	139 5年国債 0.1% 2024/3/20	640,972	
156	5年国債 0.2% 2027/12/20	602,022	141 5年国債 0.1% 2024/9/20	621,066	
370	10年国債 0.5% 2033/3/20	549,825	138 5年国債 0.1% 2023/12/20	561,080	
371	10年国債 0.4% 2033/6/20	469,550	140 5年国債 0.1% 2024/6/20	471,066	
149	5年国債 0.005% 2026/9/20	429,643	351 10年国債 0.1% 2028/6/20	469,877	
158	5年国債 0.1% 2028/3/20	429,374	439 2年国債 0.005% 2024/8/1	390,454	
446	2年国債 0.005% 2025/3/1	400,415	334 10年国債 0.6% 2024/6/20	322,403	
347	10年国債 0.1% 2027/6/20	399,144	149 5年国債 0.005% 2026/9/20	259,657	
154	5年国債 0.1% 2027/9/20	379,693	433 2年国債 0.005% 2024/2/1	250,142	
145	5年国債 0.1% 2025/9/20	361,092	145 20年国債 1.7% 2033/6/20	224,370	

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

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

区分	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBPI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	46,261,000	45,033,250	84.7	-	54.8	19.7	10.2		
地方債証券	3,034,160	3,067,174	5.8	-	3.5	1.1	1.1		
特殊債券 (除く金融債券)	1,189,084	1,216,626	2.3	-	1.5	0.4	0.4		
普通社債券	3,400,000	3,365,723	6.3	-	1.8	4.3	0.2		
合計	53,884,244	52,682,775	99.1	-	61.7	25.5	11.9		

(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			末		
	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日				
		%	千円	千円					
国債証券	142 5年国債	0.1000	320,000	320,419	2024/12/20				
	337 10年国債	0.3000	550,000	551,881	2024/12/20				
	444 2年国債	0.0050	170,000	170,073	2025/01/01				
	445 2年国債	0.0050	110,000	110,044	2025/02/01				
	446 2年国債	0.0050	400,000	400,148	2025/03/01				
	143 5年国債	0.1000	900,000	901,458	2025/03/20				
	338 10年国債	0.4000	80,000	80,441	2025/03/20				
	75 20年国債	2.1000	14,000	14,386	2025/03/20				
	76 20年国債	1.9000	25,000	25,625	2025/03/20				
	447 2年国債	0.0050	90,000	90,029	2025/04/01				
	448 2年国債	0.0050	70,000	70,014	2025/05/01				
	449 2年国債	0.0050	300,000	300,021	2025/06/01				
	144 5年国債	0.1000	650,000	651,105	2025/06/20				
	339 10年国債	0.4000	165,000	166,047	2025/06/20				
	78 20年国債	1.9000	17,000	17,503	2025/06/20				
	79 20年国債	2.0000	14,000	14,436	2025/06/20				
	451 2年国債	0.0050	20,000	20,003	2025/08/01				
	452 2年国債	0.0050	110,000	110,000	2025/09/01				
	145 5年国債	0.1000	1,070,000	1,071,829	2025/09/20				
	340 10年国債	0.4000	190,000	191,352	2025/09/20				
	81 20年国債	2.0000	65,000	67,337	2025/09/20				
	82 20年国債	2.1000	28,000	29,057	2025/09/20				
	453 2年国債	0.0050	60,000	59,977	2025/10/01				
	146 5年国債	0.1000	540,000	540,826	2025/12/20				
341 10年国債	0.3000	15,000	15,084	2025/12/20					
147 5年国債	0.0050	800,000	799,352	2026/03/20					
342 10年国債	0.1000	140,000	140,191	2026/03/20					
85 20年国債	2.1000	31,000	32,466	2026/03/20					
86 20年国債	2.3000	6,000	6,311	2026/03/20					
87 20年国債	2.2000	35,000	36,736	2026/03/20					
148 5年国債	0.0050	500,000	499,360	2026/06/20					
343 10年国債	0.1000	300,000	300,342	2026/06/20					
88 20年国債	2.3000	33,000	34,886	2026/06/20					
89 20年国債	2.2000	15,000	15,819	2026/06/20					

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）

区 分	当 期 銘 柄	年利率	期 末		償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
149	5年国債	0.0050	620,000	618,958	2026/09/20
344	10年国債	0.1000	90,000	90,087	2026/09/20
150	5年国債	0.0050	500,000	498,780	2026/12/20
345	10年国債	0.1000	410,000	410,184	2026/12/20
92	20年国債	2.1000	60,000	63,690	2026/12/20
151	5年国債	0.0050	450,000	448,519	2027/03/20
152	5年国債	0.1000	150,000	149,974	2027/03/20
346	10年国債	0.1000	250,000	249,957	2027/03/20
93	20年国債	2.0000	18,000	19,124	2027/03/20
94	20年国債	2.1000	45,000	47,958	2027/03/20
1	フィリピン共和国	0.7600	100,000	98,830	2027/04/22
153	5年国債	0.0050	270,000	268,852	2027/06/20
347	10年国債	0.1000	690,000	689,385	2027/06/20
95	20年国債	2.3000	30,000	32,312	2027/06/20
96	20年国債	2.1000	63,000	67,410	2027/06/20
154	5年国債	0.1000	520,000	519,110	2027/09/20
348	10年国債	0.1000	430,000	429,264	2027/09/20
97	20年国債	2.2000	25,000	26,948	2027/09/20
98	20年国債	2.1000	64,000	68,744	2027/09/20
155	5年国債	0.3000	90,000	90,470	2027/12/20
156	5年国債	0.2000	600,000	600,720	2027/12/20
349	10年国債	0.1000	430,000	428,787	2027/12/20
99	20年国債	2.1000	53,000	57,127	2027/12/20
157	5年国債	0.2000	60,000	60,012	2028/03/20
158	5年国債	0.1000	430,000	428,258	2028/03/20
350	10年国債	0.1000	400,000	398,380	2028/03/20
100	20年国債	2.2000	35,000	37,999	2028/03/20
101	20年国債	2.4000	18,000	19,696	2028/03/20
159	5年国債	0.1000	200,000	198,918	2028/06/20
161	5年国債	0.3000	100,000	100,360	2028/06/20
351	10年国債	0.1000	170,000	169,080	2028/06/20
102	20年国債	2.4000	10,000	10,987	2028/06/20
103	20年国債	2.3000	21,000	22,978	2028/06/20
104	20年国債	2.1000	64,000	69,452	2028/06/20
162	5年国債	0.3000	180,000	180,426	2028/09/20
352	10年国債	0.1000	320,000	317,721	2028/09/20
105	20年国債	2.1000	38,000	41,355	2028/09/20
106	20年国債	2.2000	16,000	17,488	2028/09/20
353	10年国債	0.1000	520,000	515,720	2028/12/20
107	20年国債	2.1000	40,000	43,680	2028/12/20
108	20年国債	1.9000	68,000	73,578	2028/12/20
354	10年国債	0.1000	280,000	277,368	2029/03/20
109	20年国債	1.9000	60,000	65,108	2029/03/20
110	20年国債	2.1000	27,000	29,580	2029/03/20
355	10年国債	0.1000	290,000	286,911	2029/06/20
111	20年国債	2.2000	35,000	38,672	2029/06/20
112	20年国債	2.1000	40,000	43,978	2029/06/20
356	10年国債	0.1000	440,000	434,728	2029/09/20
113	20年国債	2.1000	70,000	77,207	2029/09/20
357	10年国債	0.1000	420,000	414,267	2029/12/20
114	20年国債	2.1000	45,000	49,770	2029/12/20
115	20年国債	2.2000	42,000	46,701	2029/12/20
2	30年国債	2.4000	9,000	10,135	2030/02/20
358	10年国債	0.1000	480,000	472,454	2030/03/20
116	20年国債	2.2000	27,000	30,106	2030/03/20

区 分	当 期 銘 柄	年利率	期 末		償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
117	20年国債	2.1000	77,000	85,382	2030/03/20
3	30年国債	2.3000	4,000	4,493	2030/05/20
359	10年国債	0.1000	240,000	235,704	2030/06/20
118	20年国債	2.0000	13,000	14,364	2030/06/20
119	20年国債	1.8000	23,000	25,111	2030/06/20
120	20年国債	1.6000	98,000	105,742	2030/06/20
360	10年国債	0.1000	500,000	489,740	2030/09/20
4	30年国債	2.9000	8,000	9,359	2030/11/20
361	10年国債	0.1000	510,000	498,137	2030/12/20
123	20年国債	2.1000	42,000	46,848	2030/12/20
124	20年国債	2.0000	100,000	110,859	2030/12/20
362	10年国債	0.1000	550,000	535,826	2031/03/20
125	20年国債	2.2000	25,000	28,121	2031/03/20
126	20年国債	2.0000	21,000	23,316	2031/03/20
127	20年国債	1.9000	110,000	121,356	2031/03/20
5	30年国債	2.2000	8,000	9,011	2031/05/20
363	10年国債	0.1000	460,000	446,936	2031/06/20
128	20年国債	1.9000	32,000	35,349	2031/06/20
129	20年国債	1.8000	95,000	104,251	2031/06/20
364	10年国債	0.1000	430,000	416,455	2031/09/20
130	20年国債	1.8000	110,000	120,829	2031/09/20
131	20年国債	1.7000	150,000	163,639	2031/09/20
6	30年国債	2.4000	9,000	10,318	2031/11/20
365	10年国債	0.1000	410,000	396,076	2031/12/20
132	20年国債	1.7000	25,000	27,300	2031/12/20
133	20年国債	1.8000	150,000	164,965	2031/12/20
366	10年国債	0.2000	600,000	583,098	2032/03/20
134	20年国債	1.8000	15,000	16,520	2032/03/20
135	20年国債	1.7000	20,000	21,868	2032/03/20
136	20年国債	1.6000	180,000	195,386	2032/03/20
7	30年国債	2.3000	12,000	13,720	2032/05/20
367	10年国債	0.2000	330,000	319,911	2032/06/20
137	20年国債	1.7000	18,000	19,698	2032/06/20
139	20年国債	1.6000	250,000	271,547	2032/06/20
368	10年国債	0.2000	400,000	386,620	2032/09/20
140	20年国債	1.7000	100,000	109,517	2032/09/20
369	10年国債	0.5000	500,000	495,065	2032/12/20
141	20年国債	1.7000	140,000	153,419	2032/12/20
142	20年国債	1.8000	210,000	231,934	2032/12/20
370	10年国債	0.5000	550,000	543,477	2033/03/20
10	30年国債	1.1000	25,000	26,055	2033/03/20
143	20年国債	1.6000	100,000	108,711	2033/03/20
144	20年国債	1.5000	50,000	53,915	2033/03/20
371	10年国債	0.4000	480,000	468,993	2033/06/20
11	30年国債	1.7000	9,000	9,876	2033/06/20
145	20年国債	1.7000	40,000	43,895	2033/06/20
372	10年国債	0.8000	70,000	70,836	2033/09/20
12	30年国債	2.1000	11,000	12,487	2033/09/20
146	20年国債	1.7000	160,000	175,561	2033/09/20
13	30年国債	2.0000	11,000	12,389	2033/12/20
147	20年国債	1.6000	240,000	261,019	2033/12/20
14	30年国債	2.4000	22,000	25,666	2034/03/20
148	20年国債	1.5000	290,000	312,434	2034/03/20
15	30年国債	2.5000	21,000	24,750	2034/06/20
149	20年国債	1.5000	310,000	333,873	2034/06/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

区 分	当 期	末			
		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額
		%	千 円	千 円	
16	30年国債	2.5000	26,000	30,684	2034/09/20
150	20年国債	1.4000	280,000	298,485	2034/09/20
17	30年国債	2.4000	17,000	19,903	2034/12/20
151	20年国債	1.2000	280,000	292,261	2034/12/20
18	30年国債	2.3000	20,000	23,228	2035/03/20
152	20年国債	1.2000	285,000	297,118	2035/03/20
19	30年国債	2.3000	15,000	17,434	2035/06/20
153	20年国債	1.3000	275,000	289,385	2035/06/20
20	30年国債	2.5000	16,000	18,974	2035/09/20
154	20年国債	1.2000	305,000	317,129	2035/09/20
21	30年国債	2.3000	16,000	18,617	2035/12/20
155	20年国債	1.0000	250,000	253,820	2035/12/20
22	30年国債	2.5000	17,000	20,179	2036/03/20
156	20年国債	0.4000	220,000	207,473	2036/03/20
23	30年国債	2.5000	16,000	19,004	2036/06/20
157	20年国債	0.2000	310,000	283,925	2036/06/20
24	30年国債	2.5000	15,000	17,836	2036/09/20
158	20年国債	0.5000	285,000	270,205	2036/09/20
25	30年国債	2.3000	17,000	19,802	2036/12/20
159	20年国債	0.6000	300,000	286,974	2036/12/20
26	30年国債	2.4000	32,000	37,678	2037/03/20
160	20年国債	0.7000	280,000	270,457	2037/03/20
161	20年国債	0.6000	220,000	208,997	2037/06/20
27	30年国債	2.5000	32,000	38,098	2037/09/20
162	20年国債	0.6000	270,000	255,506	2037/09/20
163	20年国債	0.6000	230,000	216,793	2037/12/20
28	30年国債	2.5000	34,000	40,481	2038/03/20
164	20年国債	0.5000	300,000	277,758	2038/03/20
165	20年国債	0.5000	220,000	202,807	2038/06/20
29	30年国債	2.4000	43,000	50,631	2038/09/20
166	20年国債	0.7000	320,000	302,547	2038/09/20
167	20年国債	0.5000	260,000	237,705	2038/12/20
30	30年国債	2.3000	56,000	65,055	2039/03/20
168	20年国債	0.4000	250,000	224,002	2039/03/20
169	20年国債	0.3000	230,000	201,813	2039/06/20
31	30年国債	2.2000	76,000	87,078	2039/09/20
170	20年国債	0.3000	255,000	222,589	2039/09/20
171	20年国債	0.3000	150,000	130,251	2039/12/20
32	30年国債	2.3000	45,000	52,138	2040/03/20
172	20年国債	0.4000	275,000	241,711	2040/03/20
173	20年国債	0.4000	200,000	174,888	2040/06/20
33	30年国債	2.0000	95,000	105,552	2040/09/20
174	20年国債	0.4000	340,000	295,759	2040/09/20
175	20年国債	0.5000	195,000	171,785	2040/12/20
34	30年国債	2.2000	110,000	125,397	2041/03/20
176	20年国債	0.5000	245,000	214,889	2041/03/20
177	20年国債	0.4000	180,000	154,312	2041/06/20
35	30年国債	2.0000	120,000	132,814	2041/09/20
178	20年国債	0.5000	335,000	291,202	2041/09/20
179	20年国債	0.5000	210,000	181,717	2041/12/20
36	30年国債	2.0000	138,000	152,392	2042/03/20
180	20年国債	0.8000	250,000	227,650	2042/03/20
181	20年国債	0.9000	220,000	203,350	2042/06/20
37	30年国債	1.9000	165,000	179,280	2042/09/20
182	20年国債	1.1000	230,000	219,564	2042/09/20

区 分	当 期	末			
		銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額
		%	千 円	千 円	
183	20年国債	1.4000	190,000	190,285	2042/12/20
38	30年国債	1.8000	250,000	266,610	2043/03/20
184	20年国債	1.1000	170,000	161,270	2043/03/20
39	30年国債	1.9000	105,000	113,580	2043/06/20
185	20年国債	1.1000	180,000	170,143	2043/06/20
40	30年国債	1.8000	80,000	85,027	2043/09/20
186	20年国債	1.5000	50,000	50,540	2043/09/20
41	30年国債	1.7000	80,000	83,560	2043/12/20
42	30年国債	1.7000	100,000	104,329	2044/03/20
43	30年国債	1.7000	105,000	109,415	2044/06/20
44	30年国債	1.7000	155,000	161,449	2044/09/20
45	30年国債	1.5000	125,000	125,501	2044/12/20
46	30年国債	1.5000	170,000	170,411	2045/03/20
47	30年国債	1.6000	125,000	127,450	2045/06/20
48	30年国債	1.4000	145,000	142,266	2045/09/20
49	30年国債	1.4000	120,000	117,524	2045/12/20
50	30年国債	0.8000	170,000	146,922	2046/03/20
51	30年国債	0.3000	155,000	118,850	2046/06/20
52	30年国債	0.5000	150,000	120,223	2046/09/20
53	30年国債	0.6000	130,000	106,316	2046/12/20
54	30年国債	0.8000	140,000	119,569	2047/03/20
55	30年国債	0.8000	140,000	119,210	2047/06/20
56	30年国債	0.8000	160,000	135,827	2047/09/20
57	30年国債	0.8000	135,000	114,257	2047/12/20
1	40年国債	2.4000	30,000	34,963	2048/03/20
58	30年国債	0.8000	210,000	177,193	2048/03/20
59	30年国債	0.7000	110,000	90,242	2048/06/20
60	30年国債	0.9000	150,000	128,727	2048/09/20
61	30年国債	0.7000	110,000	89,571	2048/12/20
2	40年国債	2.2000	48,000	53,865	2049/03/20
62	30年国債	0.5000	135,000	103,950	2049/03/20
63	30年国債	0.4000	140,000	104,417	2049/06/20
64	30年国債	0.4000	120,000	89,142	2049/09/20
65	30年国債	0.4000	125,000	92,567	2049/12/20
3	40年国債	2.2000	19,000	21,287	2050/03/20
66	30年国債	0.4000	175,000	128,966	2050/03/20
67	30年国債	0.6000	140,000	108,743	2050/06/20
68	30年国債	0.6000	140,000	108,448	2050/09/20
69	30年国債	0.7000	161,000	127,848	2050/12/20
4	40年国債	2.2000	54,000	60,500	2051/03/20
70	30年国債	0.7000	166,000	131,491	2051/03/20
71	30年国債	0.7000	130,000	102,716	2051/06/20
72	30年国債	0.7000	203,000	159,992	2051/09/20
73	30年国債	0.7000	120,000	94,339	2051/12/20
5	40年国債	2.0000	61,000	65,625	2052/03/20
74	30年国債	1.0000	155,000	131,874	2052/03/20
75	30年国債	1.3000	160,000	146,710	2052/06/20
76	30年国債	1.4000	120,000	112,603	2052/09/20
77	30年国債	1.6000	195,000	191,766	2052/12/20
6	40年国債	1.9000	68,000	71,498	2053/03/20
78	30年国債	1.4000	150,000	140,374	2053/03/20
79	30年国債	1.2000	160,000	142,304	2053/06/20
80	30年国債	1.8000	70,000	71,953	2053/09/20
7	40年国債	1.7000	41,000	41,123	2054/03/20
8	40年国債	1.4000	40,000	37,168	2055/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

		当 期			未	
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
	9 40年国債	0.4000	40,000	27,122	2056/03/20	
	10 40年国債	0.9000	240,000	191,049	2057/03/20	
	11 40年国債	0.8000	85,000	64,909	2058/03/20	
	12 40年国債	0.5000	99,000	67,093	2059/03/20	
	13 40年国債	0.5000	252,000	168,774	2060/03/20	
	14 40年国債	0.7000	273,000	195,099	2061/03/20	
	15 40年国債	1.0000	250,000	196,635	2062/03/20	
	16 40年国債	1.3000	300,000	258,339	2063/03/20	
種別	銘柄数					
小計	金額		46,261,000	45,033,250		
地方債証券	3 兵庫県公債12年	0.5600	100,000	100,635	2025/04/16	
	32 東京都5年	0.0200	100,000	99,879	2025/06/20	
	151 共同発行地方	0.4660	100,000	100,649	2025/10/24	
	401 大阪府公債	0.4770	100,000	100,650	2025/10/29	
	22-1 福岡県15年	1.6700	100,000	103,036	2025/11/21	
	22-1 滋賀県公債	0.4760	100,000	100,679	2025/11/27	
	751 東京都公債	0.3700	100,000	100,480	2025/12/19	
	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	100,134	2026/02/26	
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,821	2026/03/19	
	222 神奈川県公債	0.0600	100,000	99,722	2026/06/19	
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	99,976	2027/03/25	
	29-6 千葉県公債	0.2450	100,000	99,798	2028/01/25	
	30-3 新潟県公債	0.1460	134,160	132,422	2029/02/28	
	6 札幌市20年	2.2400	100,000	109,966	2029/06/20	
	797 東京都公債	0.0400	100,000	97,735	2029/09/20	
	1 埼玉県15年	0.9410	100,000	102,882	2029/10/19	
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	109,949	2029/12/14	
	2-1 千葉市公債	0.1310	100,000	97,658	2030/04/24	
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	110,407	2030/05/24	
	457 大阪府公債	0.1000	100,000	97,165	2030/06/28	
	11兵庫県公債20年	1.8400	100,000	108,474	2030/08/16	
	2-2 横浜市公債	0.1350	100,000	97,351	2030/08/19	
	2-1 静岡市公債	0.1400	100,000	97,099	2030/11/18	
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	96,225	2031/06/30	
	3-1 茨城県公債	0.1400	100,000	96,336	2031/06/30	
	10 京都市20年	1.8030	100,000	108,783	2031/11/21	
	3-3 堺市公債	0.1250	100,000	95,715	2031/12/22	
	4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	97,085	2032/06/18	
	24-1 広島県20年	1.7000	100,000	108,333	2032/09/14	
	244 共同発行地方	0.5900	100,000	98,116	2033/07/25	
種別	銘柄数					
小計	金額		3,034,160	3,067,174		
特殊債券 (除く金融債券)	241 政保道路機構	0.4500	100,000	100,526	2025/03/31	
	261 政保道路機構	0.3810	100,000	100,549	2025/11/28	
	127 都市再生	0.0750	100,000	99,579	2026/09/18	
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	103,814	2026/09/18	
	3 地方公共団15年	1.1760	100,000	103,679	2029/01/26	
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	109,294	2029/05/31	
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,072	2029/09/20	
	129 地方公共団体	0.0950	100,000	97,323	2030/02/28	
	F231地方公共団体	1.1760	100,000	103,928	2030/04/30	
	174 日本政策投資	0.6490	100,000	98,210	2033/07/14	
	47 住宅機構RMBS	1.9200	189,084	196,647	2046/04/10	
種別	銘柄数					
小計	金額		1,189,084	1,216,626		

		当 期			未	
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
		%	千円	千円		
普通社債券	497 関西電力	1.0020	100,000	101,187	2025/06/20	
	14 セブリアンドアイ	0.1900	100,000	99,761	2025/12/19	
	11 ヒューリック	0.3200	100,000	99,874	2026/04/13	
	36 芙蓉総合リース	0.2700	100,000	99,632	2026/06/05	
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	99,525	2026/08/21	
	32大和ハウス工業	0.3100	100,000	99,975	2026/09/07	
	17 パナソニック	0.4700	100,000	100,049	2026/09/18	
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	99,610	2026/11/13	
	6 楽天カード	0.6200	100,000	89,980	2026/12/17	
	80 三菱地所	2.3050	100,000	106,323	2027/03/19	
	42 リコーリース	0.3900	100,000	99,460	2027/06/01	
	9 ソフトバンク	0.4800	100,000	98,287	2027/12/03	
	16 クボタ	0.4790	100,000	99,785	2028/04/20	
	16 JERA	0.6400	100,000	99,812	2028/04/25	
	1 SOMPOHD	0.4790	100,000	100,021	2028/04/27	
	11サントリーホールディング	0.3890	100,000	99,413	2028/05/25	
	29 東急不動産HD	0.4500	100,000	99,285	2028/06/01	
	50 大阪瓦斯	0.3900	100,000	99,314	2028/06/02	
	82 三井不動産	0.3600	100,000	99,294	2028/06/06	
	22 積水ハウス	0.3600	100,000	99,385	2028/06/07	
	26 リゾネホールディング	0.4150	100,000	99,576	2028/06/07	
	81 ホンダファイナンス	0.3890	100,000	99,434	2028/06/20	
	101 中日本高速道	0.4390	200,000	199,566	2028/08/17	
	32 住友電工	0.4640	100,000	99,137	2029/07/13	
	489 九州電力	0.4400	100,000	97,192	2030/05/24	
	65 東京瓦斯	0.2250	100,000	96,250	2030/09/10	
	18 セブリアンドアイ	1.0400	100,000	100,833	2030/11/01	
	35 東レ	0.9730	100,000	99,902	2030/11/22	
	5 NTTファイナンス	0.4890	100,000	95,639	2032/09/17	
	143 三菱地所	0.9000	100,000	98,829	2033/05/02	
	448 中国電力	0.9200	100,000	96,688	2033/05/25	
	31 トヨタ自動車	0.7350	100,000	97,542	2033/06/01	
	214 オリックス	0.8500	100,000	95,150	2033/06/13	
種別	銘柄数					
小計	金額		3,400,000	3,365,723		
合計	銘柄数					
小計	金額		53,884,244	52,682,775		

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)

■投資信託財産の構成

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	52,682,775	98.6
コール・ローン等、その他	765,322	1.4
投資信託財産総額	53,448,097	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

2023年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	53,448,097,700円
コール・ローン等	568,530,714
公社債(評価額)	52,682,775,133
未収入金	100,484,000
未収利息	92,305,414
前払費用	4,002,439
(B) 負債	305,316,203
未払金	297,126,800
未払解約金	8,189,403
(C) 純資産総額(A - B)	53,142,781,497
元本	43,455,436,599
次期繰越損益金	9,687,344,898
(D) 受益権総口数	43,455,436,599口
1万口当り基準価額(C/D)	12,229円

* 期首における元本額は34,135,552,866円、当作成期間中における追加設定元本額は10,094,084,082円、同解約元本額は774,200,349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：

日本債券インデックスファンド (FOFs用) (適格機関投資家専用)	2,738,982,458円
iFree 日本債券インデックス	3,361,141,887円
iFree 8資産バランス	6,400,564,081円
ダイワ・ライフ・バランス30	11,825,100,390円
ダイワ・ライフ・バランス50	9,124,633,659円
ダイワ・ライフ・バランス70	3,495,533,334円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	1,935,570,741円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,530,659,908円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	611,361,968円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,117,596,780円
ダイワつみたてインデックスバランス30	47,452,814円
ダイワつみたてインデックスバランス50	21,682,780円
ダイワつみたてインデックスバランス70	18,604,243円
ダイワ世界バランスファンド40VA	184,289,943円
ダイワ世界バランスファンド60VA	42,261,613円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,229円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月1日 至2023年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	291,775,248円
受取利息	291,882,286
支払利息	△ 107,038
(B) 有価証券売買損益	△ 935,059,647
売買益	31,781,335
売買損	△ 966,840,982
(C) 当期損益金(A + B)	△ 643,284,399
(D) 前期繰越損益金	8,141,435,887
(E) 解約差損益金	△ 179,515,833
(F) 追加信託差損益金	2,368,709,243
(G) 合計(C + D + E + F)	9,687,344,898
次期繰越損益金(G)	9,687,344,898

(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。

NOMURA-BPIの知的財産権およびその他一切の権利は野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社に帰属します。なお、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社は、同指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当ファンドの設定の可否、運用成果等並びに当ファンド及び同指数に関連して行われる当社のサービス提供等の行為に関して一切責任を負いません。