

iFree 日本債券 インデックス

運用報告書（全体版） 第9期

（決算日 2024年12月2日）
（作成対象期間 2023年12月1日～2024年12月2日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、わが国の公社債等に投資し、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。

★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。	

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/>

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 物率	純資 産額
	(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			
5期末(2020年11月30日)	円 9,981	円 0	% △0.9	10,055	% △0.8	% 99.1	% -	百万円 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
9期末(2024年12月2日)	9,154	0	△2.8	9,283	△2.6	99.5	-	3,221

(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。

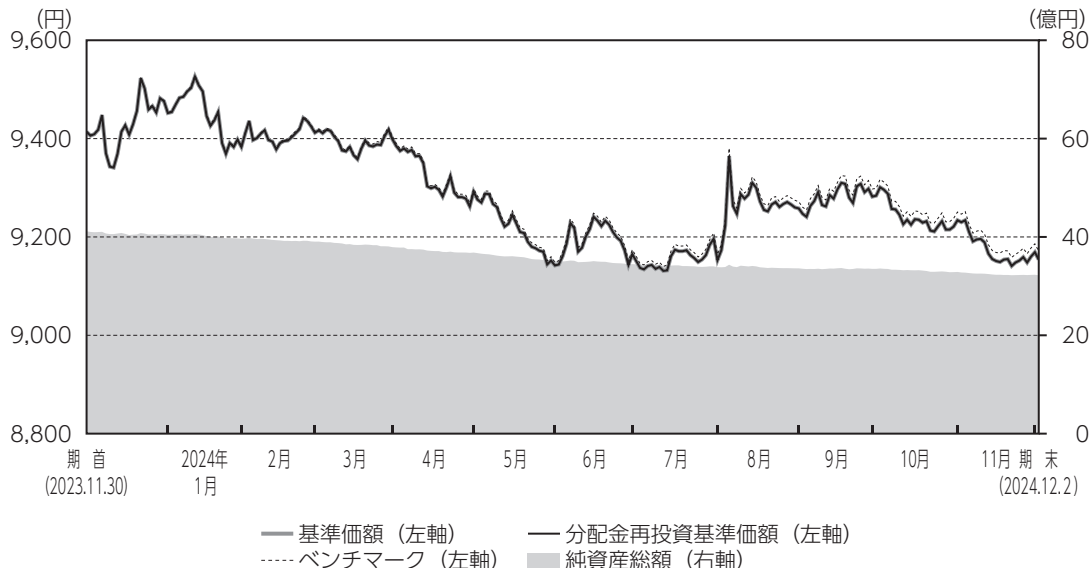
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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：9,414円

期末：9,154円（分配金0円）

騰落率：△2.8%（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 率 比
		騰 落 率		騰 落 率		
(期首) 2023年11月30日	円	%		%	%	%
	9,414	—	9,529	—	99.0	—
12月末	9,452	0.4	9,568	0.4	99.3	—
2024年 1 月末	9,383	△0.3	9,499	△0.3	99.4	—
2 月末	9,412	△0.0	9,529	0.0	99.3	—
3 月末	9,399	△0.2	9,519	△0.1	99.3	—
4 月末	9,292	△1.3	9,411	△1.2	99.5	—
5 月末	9,142	△2.9	9,260	△2.8	99.2	—
6 月末	9,165	△2.6	9,286	△2.6	99.4	—
7 月末	9,153	△2.8	9,276	△2.6	99.5	—
8 月末	9,258	△1.7	9,385	△1.5	99.5	—
9 月末	9,282	△1.4	9,411	△1.2	99.4	—
10月末	9,234	△1.9	9,363	△1.7	99.2	—
11月末	9,169	△2.6	9,298	△2.4	99.2	—
(期末) 2024年12月 2 日	9,154	△2.8	9,283	△2.6	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

(2023.12.1～2024.12.2)

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。

国内長期金利は、当作成期首より、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、低下（債券価格は上昇）基調で推移しました。2024年1月から5月にかけては、過度な利下げ織り込みが後退したことで米国金利が上昇したことや、日銀によるマイナス金利政策の解除などを受けて上昇しました。6月から7月にかけては、米国金利の低下が国内長期金利の低下要因となった一方、日銀による政策金利の引き上げが上昇要因となり、おおむね横ばいで推移しました。8月から9月にかけては、米国経済指標の軟化や日銀の利上げ姿勢を受けて景気減速懸念が台頭し、国内長期金利は低下しました。その後当作成期末にかけては、堅調な米国経済指標などを受けて米国金利が上昇し、国内長期金利も上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）」の受益証券を中心に組み入れ、ベンチマーク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

(2023.12.1～2024.12.2)

■当ファンド

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

■ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）

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

*マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

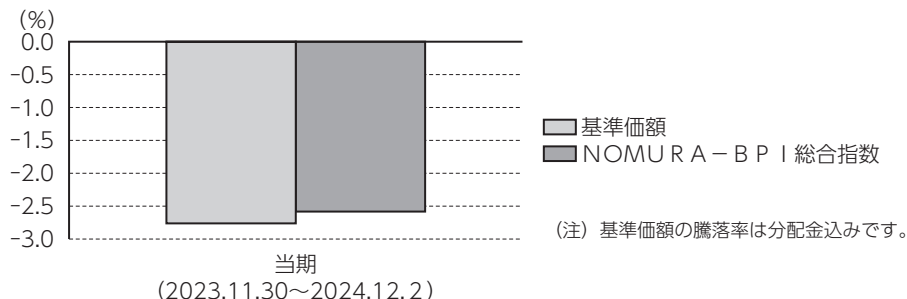
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	NOMURA-BPI総合指数

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 $\Delta 2.6\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 2.8\%$ 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	
	2023年12月1日 ～2024年12月2日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	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) 円未満は切捨てしており、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 (2023.12.1~2024.12.2)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	14円	0.152%	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9,292円です。
(投 信 会 社)	(6)	(0.060)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(7)	(0.079)	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)	(0.013)	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	15	0.157	

(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。

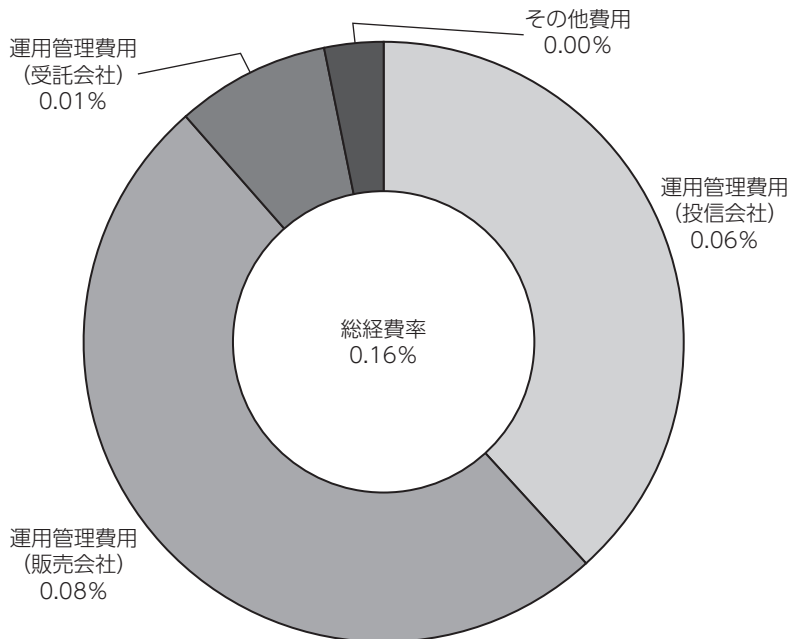
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.16%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

(2023年12月1日から2024年12月2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)	51,943	62,735	711,058	859,528

(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

(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

決 算 期	当 期						
	買付額等 A		うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C		うち利害 関係人との 取引状況D
公社債	百万円 71,229	百万円 2,593	3.6	百万円 20,979	百万円 301	% 1.4	
コール・ローン	131,555	-	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合4.2%

*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つて発行される有価証券

(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (B P I)		
公社債		百万円 3,700

(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)	3,361,141	2,702,026	3,217,843	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年12月2日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ日本債券インデックス マザーファンド (B P I)	3,217,843	99.7
コール・ローン等、その他	11,280	0.3
投資信託財産総額	3,229,124	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

2024年12月2日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,229,124,058円
コール・ローン等	6,216,764
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)	3,217,843,423
未収入金	5,063,871
(B) 負債	8,090,455
未払解約金	5,089,896
未払信託報酬	2,907,019
その他未払費用	93,540
(C) 純資産総額(A - B)	3,221,033,603
元本	3,518,894,333
次期繰越損益金	△ 297,860,730
(D) 受益権総口数	3,518,894,333口
1万口当り基準価額(C/D)	9,154円

*期首における元本額は4,370,530,545円、当作成期間中における追加設定元本額は142,115,480円、同解約元本額は993,751,692円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,154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297,860,730円です。

■損益の状況

当期 自2023年12月1日 至2024年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	6,167円
受取利息	6,256
支払利息	△ 89
(B) 有価証券売買損益	△ 84,400,741
売買益	10,766,271
売買損	△ 95,167,012
(C) 信託報酬等	△ 5,659,485
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 90,054,059
(E) 前期繰越損益金	△179,287,321
(F) 追加信託差損益金	△ 28,519,350
(配当等相当額)	(17,360,233)
(売買損益相当額)	(△ 45,879,583)
(G) 合計(D + E + F)	△297,860,730
次期繰越損益金(G)	△297,860,730
追加信託差損益金	△ 28,519,350
(配当等相当額)	(17,360,233)
(売買損益相当額)	(△ 45,879,583)
分配準備積立金	1,179,080
繰越損益金	△270,520,460

(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	17,360,233
(d) 分配準備積立金	1,179,080
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	18,539,313
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	18,539,313
(h) 受益権総口数	3,518,894,333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20期（決算日 2024年12月2日）

（作成対象期間 2023年12月1日～2024年12月2日）

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

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

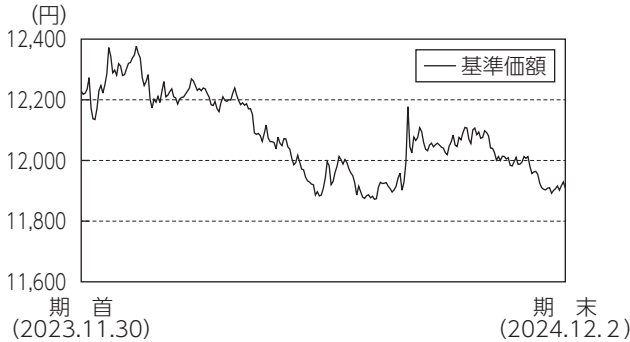
運用方針	投資成果をNOMURA - B P I 総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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 (ベンチマーク)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	%	円	%		
(期首)2023年11月30日	12,229	-	12,260	-	99.1	-
12月末	12,280	0.4	12,310	0.4	99.4	-
2024年 1 月 末	12,191	△0.3	12,222	△0.3	99.5	-
2 月 末	12,231	0.0	12,260	0.0	99.4	-
3 月 末	12,215	△0.1	12,247	△0.1	99.4	-
4 月 末	12,077	△1.2	12,108	△1.2	99.6	-
5 月 末	11,883	△2.8	11,914	△2.8	99.3	-
6 月 末	11,915	△2.6	11,947	△2.6	99.5	-
7 月 末	11,902	△2.7	11,935	△2.6	99.7	-
8 月 末	12,041	△1.5	12,074	△1.5	99.6	-
9 月 末	12,073	△1.3	12,108	△1.2	99.5	-
10 月 末	12,013	△1.8	12,047	△1.7	99.3	-
11 月 末	11,929	△2.5	11,963	△2.4	99.3	-
(期末)2024年12月2日	11,909	△2.6	11,943	△2.6	99.6	-

- (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：12,229円 期末：11,909円 騰落率：△2.6%

【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、長期金利は上昇しました。

国内長期金利は、当作成期首より、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、低下（債券価格は上昇）基調で推移しま

した。2024年1月から5月にかけては、過度な利下げ織り込みが後退したことで米国金利が上昇したことや、日銀によるマイナス金利政策の解除などを受けて上昇しました。6月から7月にかけては、米国金利の低下が国内長期金利の低下要因となった一方、日銀による政策金利の引き上げが上昇要因となり、おおむね横ばいで推移しました。8月から9月にかけては、米国経済指標の軟化や日銀の利上げ姿勢を受けて景気減速懸念が台頭し、国内長期金利は低下しました。その後当作成期末にかけては、堅調な米国経済指標などを受けて米国金利が上昇し、国内長期金利も上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

ベンチマークとの高い運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、高い運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△2.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率も△2.6%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△0.0%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運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

(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国	国債証券	61,233,230	19,877,981 (－)
	地方債証券	2,641,518	701,648 (－)
内	特殊債券	3,459,119	200,335 (64,246)
	社債券	3,895,578	199,994 (－)

(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

(2023年12月1日から2024年12月2日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘柄	金額	銘柄	金額
千円		千円	
452 2年国債 0.005% 2025/9/1	2,016,584	452 2年国債 0.005% 2025/9/1	2,124,773
455 2年国債 0.005% 2025/12/1	2,015,132	455 2年国債 0.005% 2025/12/1	2,011,032
154 5年国債 0.1% 2027/9/20	1,851,109	356 10年国債 0.1% 2029/9/20	1,239,523
149 5年国債 0.005% 2026/9/20	1,752,552	145 5年国債 0.1% 2025/9/20	1,068,513
374 10年国債 0.8% 2034/3/20	1,687,862	143 5年国債 0.1% 2025/3/20	900,440
153 5年国債 0.005% 2027/6/20	1,538,382	173 20年国債 0.4% 2040/6/20	826,520
163 5年国債 0.4% 2028/9/20	1,473,159	144 5年国債 0.1% 2025/6/20	798,712
158 5年国債 0.1% 2028/3/20	1,387,965	357 10年国債 0.1% 2029/12/20	688,107
356 10年国債 0.1% 2029/9/20	1,298,446	347 10年国債 0.1% 2027/6/20	685,556
164 5年国債 0.2% 2028/12/20	1,190,739	149 20年国債 1.5% 2034/6/20	638,490

(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			末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	89,749,000	83,683,008	83.4	－	54.4	19.9	9.1
地方債証券	4,934,160	4,921,559	4.9	－	3.0	1.6	0.3
特殊債券 (除く金融債券)	4,401,393	4,331,613	4.3	－	2.7	1.4	0.2
普通社債券	7,100,000	6,976,991	7.0	－	2.2	4.1	0.6
合計	106,184,553	99,913,173	99.6	－	62.3	27.0	10.2

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

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

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

区分	当			末		
	銘柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円		
国債証券	456 2年国債	0.1000	500,000	497,825	2026/01/01	
	457 2年国債	0.1000	160,000	159,220	2026/02/01	
	458 2年国債	0.2000	780,000	776,770	2026/03/01	
	147 5年国債	0.0050	800,000	794,496	2026/03/20	
	342 10年国債	0.1000	700,000	696,038	2026/03/20	
	85 20年国債	2.1000	31,000	31,622	2026/03/20	
	86 20年国債	2.3000	6,000	6,135	2026/03/20	
	87 20年国債	2.2000	35,000	35,748	2026/03/20	
	459 2年国債	0.2000	40,000	39,815	2026/04/01	
	460 2年国債	0.3000	250,000	249,072	2026/05/01	
	461 2年国債	0.4000	300,000	299,220	2026/06/01	
	148 5年国債	0.0050	1,500,000	1,486,785	2026/06/20	
	343 10年国債	0.1000	300,000	297,792	2026/06/20	
	88 20年国債	2.3000	33,000	33,871	2026/06/20	
	89 20年国債	2.2000	15,000	15,373	2026/06/20	
	462 2年国債	0.4000	50,000	49,855	2026/07/01	
	463 2年国債	0.4000	250,000	249,197	2026/08/01	
	464 2年国債	0.4000	200,000	199,308	2026/09/01	
	149 5年国債	0.0050	2,300,000	2,275,666	2026/09/20	
	344 10年国債	0.1000	90,000	89,199	2026/09/20	
	465 2年国債	0.4000	100,000	99,629	2026/10/01	
	466 2年国債	0.5000	800,000	798,336	2026/11/01	
	150 5年国債	0.0050	1,450,000	1,432,556	2026/12/20	
	345 10年国債	0.1000	410,000	405,854	2026/12/20	
	92 20年国債	2.1000	60,000	61,831	2026/12/20	
	151 5年国債	0.0050	300,000	295,926	2027/03/20	
	152 5年国債	0.1000	130,000	128,514	2027/03/20	
	346 10年国債	0.1000	20,000	19,771	2027/03/20	
	93 20年国債	2.0000	18,000	18,572	2027/03/20	
	94 20年国債	2.1000	45,000	46,531	2027/03/20	
	1 フィリピン共和国	0.7600	100,000	98,538	2027/04/22	
	153 5年国債	0.0050	1,600,000	1,575,536	2027/06/20	
347 10年国債	0.1000	500,000	493,545	2027/06/20		

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	年 率	末			償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	評 価 額	
銘 柄		%	千円	千円	千円	
95	20年国債	2.3000	30,000	31,278	2027/06/20	
96	20年国債	2.1000	63,000	65,368	2027/06/20	
154	5年国債	0.1000	2,180,000	2,148,520	2027/09/20	
348	10年国債	0.1000	430,000	423,790	2027/09/20	
97	20年国債	2.2000	25,000	26,093	2027/09/20	
98	20年国債	2.1000	64,000	66,622	2027/09/20	
155	5年国債	0.3000	90,000	89,098	2027/12/20	
156	5年国債	0.2000	850,000	838,941	2027/12/20	
349	10年国債	0.1000	430,000	423,124	2027/12/20	
99	20年国債	2.1000	53,000	55,345	2027/12/20	
157	5年国債	0.2000	60,000	59,129	2028/03/20	
158	5年国債	0.1000	1,730,000	1,699,309	2028/03/20	
350	10年国債	0.1000	400,000	392,904	2028/03/20	
100	20年国債	2.2000	35,000	36,772	2028/03/20	
101	20年国債	2.4000	18,000	19,027	2028/03/20	
159	5年国債	0.1000	200,000	196,086	2028/06/20	
161	5年国債	0.3000	400,000	394,940	2028/06/20	
351	10年国債	0.1000	500,000	490,215	2028/06/20	
102	20年国債	2.4000	10,000	10,608	2028/06/20	
103	20年国債	2.3000	21,000	22,204	2028/06/20	
104	20年国債	2.1000	64,000	67,226	2028/06/20	
162	5年国債	0.3000	280,000	276,060	2028/09/20	
163	5年国債	0.4000	1,470,000	1,454,756	2028/09/20	
352	10年国債	0.1000	250,000	244,632	2028/09/20	
105	20年国債	2.1000	38,000	40,026	2028/09/20	
106	20年国債	2.2000	16,000	16,912	2028/09/20	
164	5年国債	0.2000	1,200,000	1,176,612	2028/12/20	
166	5年国債	0.4000	320,000	316,281	2028/12/20	
353	10年国債	0.1000	520,000	507,821	2028/12/20	
107	20年国債	2.1000	40,000	42,245	2028/12/20	
108	20年国債	1.9000	68,000	71,281	2028/12/20	
168	5年国債	0.6000	450,000	447,934	2029/03/20	
169	5年国債	0.5000	500,000	495,625	2029/03/20	
109	20年国債	1.9000	60,000	63,013	2029/03/20	
110	20年国債	2.1000	27,000	28,587	2029/03/20	
170	5年国債	0.6000	750,000	745,710	2029/06/20	
171	5年国債	0.4000	650,000	640,562	2029/06/20	
172	5年国債	0.5000	300,000	296,964	2029/06/20	
355	10年国債	0.1000	100,000	97,207	2029/06/20	
111	20年国債	2.2000	35,000	37,296	2029/06/20	
173	5年国債	0.6000	150,000	148,992	2029/09/20	
356	10年国債	0.1000	500,000	485,060	2029/09/20	
113	20年国債	2.1000	170,000	180,835	2029/09/20	
357	10年国債	0.1000	700,000	677,873	2029/12/20	
114	20年国債	2.1000	45,000	48,024	2029/12/20	
115	20年国債	2.2000	42,000	45,037	2029/12/20	
2	30年国債	2.4000	9,000	9,762	2030/02/20	
358	10年国債	0.1000	1,040,000	1,005,326	2030/03/20	
116	20年国債	2.2000	27,000	29,037	2030/03/20	
117	20年国債	2.1000	77,000	82,417	2030/03/20	
3	30年国債	2.3000	4,000	4,332	2030/05/20	
359	10年国債	0.1000	1,000,000	964,880	2030/06/20	
118	20年国債	2.0000	13,000	13,883	2030/06/20	

区 分	当 期	年 率	末			償還年月日
			額 面 金 額	評 価 額	評 価 額	
銘 柄		%	千円	千円	千円	
119	20年国債	1.8000	23,000	24,311	2030/06/20	
120	20年国債	1.6000	98,000	102,543	2030/06/20	
360	10年国債	0.1000	1,040,000	1,001,603	2030/09/20	
4	30年国債	2.9000	8,000	8,999	2030/11/20	
361	10年国債	0.1000	1,020,000	980,791	2030/12/20	
123	20年国債	2.1000	42,000	45,344	2030/12/20	
124	20年国債	2.0000	100,000	107,385	2030/12/20	
362	10年国債	0.1000	1,430,000	1,372,485	2031/03/20	
125	20年国債	2.2000	25,000	27,219	2031/03/20	
126	20年国債	2.0000	21,000	22,604	2031/03/20	
127	20年国債	1.9000	110,000	117,742	2031/03/20	
5	30年国債	2.2000	8,000	8,722	2031/05/20	
363	10年国債	0.1000	830,000	794,600	2031/06/20	
128	20年国債	1.9000	32,000	34,306	2031/06/20	
129	20年国債	1.8000	95,000	101,254	2031/06/20	
364	10年国債	0.1000	850,000	811,639	2031/09/20	
130	20年国債	1.8000	110,000	117,393	2031/09/20	
131	20年国債	1.7000	150,000	159,112	2031/09/20	
6	30年国債	2.4000	9,000	9,979	2031/11/20	
365	10年国債	0.1000	880,000	838,068	2031/12/20	
132	20年国債	1.7000	25,000	26,545	2031/12/20	
133	20年国債	1.8000	150,000	160,272	2031/12/20	
366	10年国債	0.2000	1,150,000	1,099,791	2032/03/20	
134	20年国債	1.8000	15,000	16,039	2032/03/20	
135	20年国債	1.7000	20,000	21,247	2032/03/20	
136	20年国債	1.6000	180,000	189,921	2032/03/20	
7	30年国債	2.3000	12,000	13,271	2032/05/20	
367	10年国債	0.2000	1,100,000	1,048,553	2032/06/20	
137	20年国債	1.7000	18,000	19,125	2032/06/20	
139	20年国債	1.6000	250,000	263,855	2032/06/20	
368	10年国債	0.2000	1,000,000	950,380	2032/09/20	
140	20年国債	1.7000	100,000	106,332	2032/09/20	
369	10年国債	0.5000	1,130,000	1,096,902	2032/12/20	
141	20年国債	1.7000	140,000	148,905	2032/12/20	
142	20年国債	1.8000	210,000	225,023	2032/12/20	
370	10年国債	0.5000	1,120,000	1,084,171	2033/03/20	
10	30年国債	1.1000	25,000	25,395	2033/03/20	
143	20年国債	1.6000	100,000	105,564	2033/03/20	
144	20年国債	1.5000	50,000	52,396	2033/03/20	
371	10年国債	0.4000	1,060,000	1,014,314	2033/06/20	
11	30年国債	1.7000	9,000	9,571	2033/06/20	
145	20年国債	1.7000	40,000	42,538	2033/06/20	
372	10年国債	0.8000	950,000	938,049	2033/09/20	
12	30年国債	2.1000	11,000	12,066	2033/09/20	
146	20年国債	1.7000	160,000	170,086	2033/09/20	
373	10年国債	0.6000	1,160,000	1,122,427	2033/12/20	
13	30年国債	2.0000	11,000	11,972	2033/12/20	
147	20年国債	1.6000	350,000	368,949	2033/12/20	
374	10年国債	0.8000	1,370,000	1,344,983	2034/03/20	
14	30年国債	2.4000	22,000	24,713	2034/03/20	
148	20年国債	1.5000	290,000	302,713	2034/03/20	
375	10年国債	1.1000	600,000	603,384	2034/06/20	
15	30年国債	2.5000	21,000	23,786	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	年 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
銘 柄	%	千 円	千 円		
149	20年国債	1.5000	110,000	114,642	2034/06/20
376	10年国債	0.9000	130,000	127,982	2034/09/20
16	30年国債	2.5000	26,000	29,453	2034/09/20
150	20年国債	1.4000	350,000	360,720	2034/09/20
17	30年国債	2.4000	17,000	19,102	2034/12/20
151	20年国債	1.2000	240,000	242,390	2034/12/20
18	30年国債	2.3000	20,000	22,291	2035/03/20
152	20年国債	1.2000	500,000	503,920	2035/03/20
19	30年国債	2.3000	15,000	16,716	2035/06/20
153	20年国債	1.3000	470,000	477,299	2035/06/20
20	30年国債	2.5000	16,000	18,152	2035/09/20
154	20年国債	1.2000	380,000	381,273	2035/09/20
21	30年国債	2.3000	16,000	17,838	2035/12/20
155	20年国債	1.0000	530,000	519,659	2035/12/20
22	30年国債	2.5000	17,000	19,303	2036/03/20
156	20年国債	0.4000	480,000	438,969	2036/03/20
23	30年国債	2.5000	16,000	18,164	2036/06/20
157	20年国債	0.2000	510,000	453,226	2036/06/20
24	30年国債	2.5000	15,000	17,032	2036/09/20
158	20年国債	0.5000	680,000	623,396	2036/09/20
25	30年国債	2.3000	17,000	18,918	2036/12/20
159	20年国債	0.6000	530,000	489,571	2036/12/20
26	30年国債	2.4000	32,000	35,959	2037/03/20
160	20年国債	0.7000	780,000	726,538	2037/03/20
161	20年国債	0.6000	350,000	320,631	2037/06/20
27	30年国債	2.5000	32,000	36,312	2037/09/20
162	20年国債	0.6000	540,000	492,577	2037/09/20
163	20年国債	0.6000	350,000	317,709	2037/12/20
28	30年国債	2.5000	34,000	38,536	2038/03/20
164	20年国債	0.5000	660,000	588,475	2038/03/20
165	20年国債	0.5000	550,000	487,806	2038/06/20
29	30年国債	2.4000	43,000	48,138	2038/09/20
166	20年国債	0.7000	620,000	562,656	2038/09/20
167	20年国債	0.5000	300,000	263,358	2038/12/20
30	30年国債	2.3000	56,000	61,818	2039/03/20
168	20年国債	0.4000	640,000	550,656	2039/03/20
169	20年国債	0.3000	400,000	337,052	2039/06/20
31	30年国債	2.2000	76,000	82,742	2039/09/20
170	20年国債	0.3000	530,000	444,108	2039/09/20
171	20年国債	0.3000	400,000	333,100	2039/12/20
32	30年国債	2.3000	115,000	126,365	2040/03/20
172	20年国債	0.4000	510,000	429,267	2040/03/20
173	20年国債	0.4000	400,000	334,824	2040/06/20
33	30年国債	2.0000	95,000	100,169	2040/09/20
174	20年国債	0.4000	750,000	624,307	2040/09/20
175	20年国債	0.5000	370,000	311,469	2040/12/20
34	30年国債	2.2000	110,000	118,682	2041/03/20
176	20年国債	0.5000	595,000	498,175	2041/03/20
177	20年国債	0.4000	380,000	310,988	2041/06/20
35	30年国債	2.0000	120,000	125,606	2041/09/20
178	20年国債	0.5000	660,000	546,513	2041/09/20
179	20年国債	0.5000	510,000	420,224	2041/12/20
36	30年国債	2.0000	138,000	143,917	2042/03/20

区 分	当 期	年 率	末		
			額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
銘 柄	%	千 円	千 円		
180	20年国債	0.8000	650,000	561,684	2042/03/20
181	20年国債	0.9000	380,000	332,621	2042/06/20
37	30年国債	1.9000	165,000	169,045	2042/09/20
182	20年国債	1.1000	550,000	496,430	2042/09/20
183	20年国債	1.4000	410,000	387,659	2042/12/20
38	30年国債	1.8000	250,000	251,382	2043/03/20
184	20年国債	1.1000	420,000	376,429	2043/03/20
39	30年国債	1.9000	105,000	106,980	2043/06/20
185	20年国債	1.1000	530,000	473,152	2043/06/20
40	30年国債	1.8000	80,000	80,000	2043/09/20
186	20年国債	1.5000	530,000	504,830	2043/09/20
41	30年国債	1.7000	80,000	78,586	2043/12/20
187	20年国債	1.3000	400,000	367,204	2043/12/20
42	30年国債	1.7000	200,000	195,872	2044/03/20
188	20年国債	1.6000	400,000	385,232	2044/03/20
43	30年国債	1.7000	335,000	327,315	2044/06/20
189	20年国債	1.9000	300,000	302,805	2044/06/20
44	30年国債	1.7000	155,000	150,864	2044/09/20
190	20年国債	1.8000	340,000	336,559	2044/09/20
45	30年国債	1.5000	200,000	187,568	2044/12/20
46	30年国債	1.5000	190,000	177,697	2045/03/20
47	30年国債	1.6000	355,000	337,019	2045/06/20
48	30年国債	1.4000	210,000	191,633	2045/09/20
49	30年国債	1.4000	340,000	309,325	2045/12/20
50	30年国債	0.8000	270,000	216,599	2046/03/20
51	30年国債	0.3000	350,000	248,794	2046/06/20
52	30年国債	0.5000	300,000	222,567	2046/09/20
53	30年国債	0.6000	230,000	173,817	2046/12/20
54	30年国債	0.8000	290,000	228,418	2047/03/20
55	30年国債	0.8000	390,000	305,639	2047/06/20
56	30年国債	0.8000	160,000	124,852	2047/09/20
57	30年国債	0.8000	235,000	182,590	2047/12/20
1	40年国債	2.4000	30,000	32,059	2048/03/20
58	30年国債	0.8000	390,000	301,497	2048/03/20
59	30年国債	0.7000	240,000	180,247	2048/06/20
60	30年国債	0.9000	250,000	196,322	2048/09/20
61	30年国債	0.7000	260,000	193,492	2048/12/20
2	40年国債	2.2000	48,000	49,287	2049/03/20
62	30年国債	0.5000	290,000	203,878	2049/03/20
63	30年国債	0.4000	240,000	163,209	2049/06/20
64	30年国債	0.4000	250,000	168,987	2049/09/20
65	30年国債	0.4000	275,000	184,629	2049/12/20
3	40年国債	2.2000	19,000	19,345	2050/03/20
66	30年国債	0.4000	350,000	233,397	2050/03/20
67	30年国債	0.6000	290,000	203,466	2050/06/20
68	30年国債	0.6000	300,000	209,292	2050/09/20
69	30年国債	0.7000	261,000	186,301	2050/12/20
4	40年国債	2.2000	54,000	54,498	2051/03/20
70	30年国債	0.7000	391,000	277,359	2051/03/20
71	30年国債	0.7000	280,000	197,531	2051/06/20
72	30年国債	0.7000	250,000	175,535	2051/09/20
73	30年国債	0.7000	340,000	237,602	2051/12/20
5	40年国債	2.0000	61,000	58,619	2052/03/20

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

区 分	銘 柄	当 期		末	
		年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	74 30年国債	1.0000	365,000	276,173	2052/03/20
	75 30年国債	1.3000	360,000	293,601	2052/06/20
	76 30年国債	1.4000	240,000	200,148	2052/09/20
	77 30年国債	1.6000	245,000	213,936	2052/12/20
	6 40年国債	1.9000	268,000	250,054	2053/03/20
	78 30年国債	1.4000	180,000	149,164	2053/03/20
	79 30年国債	1.2000	270,000	211,882	2053/06/20
	80 30年国債	1.8000	260,000	236,251	2053/09/20
	81 30年国債	1.6000	300,000	259,365	2053/12/20
	7 40年国債	1.7000	190,000	167,988	2054/03/20
	82 30年国債	1.8000	350,000	316,876	2054/03/20
	83 30年国債	2.2000	140,000	138,511	2054/06/20
	84 30年国債	2.1000	100,000	96,720	2054/09/20
	8 40年国債	1.4000	40,000	32,470	2055/03/20
	9 40年国債	0.4000	40,000	23,251	2056/03/20
	10 40年国債	0.9000	290,000	198,067	2057/03/20
	11 40年国債	0.8000	85,000	55,231	2058/03/20
	12 40年国債	0.5000	99,000	56,214	2059/03/20
	13 40年国債	0.5000	252,000	139,572	2060/03/20
	14 40年国債	0.7000	273,000	160,278	2061/03/20
	15 40年国債	1.0000	650,000	419,705	2062/03/20
	16 40年国債	1.3000	1,030,000	727,025	2063/03/20
	17 40年国債	2.2000	715,000	654,954	2064/03/20
種別	銘柄数		268銘柄		
小計	金額		89,749,000	83,683,008	
地方債証券	27-15 北海道公債	0.2200	100,000	99,475	2026/02/26
	28-1 静岡県公債	0.0800	100,000	99,269	2026/03/19
	222 神奈川公債	0.0600	100,000	99,045	2026/06/19
	168 共同発行地方	0.2100	100,000	98,848	2027/03/25
	170 共同発行地方	0.1800	200,000	197,348	2027/05/25
	29-6 千葉公債	0.2450	100,000	98,443	2028/01/25
	30-3 新潟公債	0.1460	134,160	130,464	2029/02/28
	6-1 愛知県5年	0.4770	300,000	295,675	2029/04/12
	6-1 京都府5年	0.4820	200,000	197,148	2029/04/16
	6-1 大阪市5年	0.5800	200,000	197,913	2029/05/22
	6 札幌市20年	2.2400	100,000	106,319	2029/06/20
	8 静岡県20年	2.2430	100,000	106,516	2029/08/17
	797 東京都公債	0.0400	100,000	96,331	2029/09/20
	1 埼玉県15年	0.9410	100,000	100,525	2029/10/19
	11 名古屋市20年	2.1300	100,000	106,388	2029/12/14
	2-1 千葉市公債	0.1310	100,000	96,238	2030/04/24
	9 埼玉県20年	2.1500	100,000	106,945	2030/05/24
	206 共同発行地方	0.1310	200,000	192,357	2030/05/24
	457 大阪府公債	0.1000	100,000	95,930	2030/06/28
	11兵庫県公債20年	1.8400	100,000	105,459	2030/08/16
	2-2 横浜市公債	0.1350	100,000	95,987	2030/08/19
	2-1 静岡市公債	0.1400	100,000	95,819	2030/11/18
	3-5 北海道公債	0.1400	100,000	95,281	2031/06/30
	3-1 茨城県公債	0.1400	100,000	95,341	2031/06/30
	10 京都市20年	1.8030	100,000	106,110	2031/11/21
	3-3 堺市公債	0.1250	100,000	94,701	2031/12/22
	4-3 長崎県公債	0.3640	100,000	95,840	2032/06/18
	24-3 神戸市20年	1.6350	100,000	105,085	2032/08/13

区 分	銘 柄	当 期		末	
		年利率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日
		%	千円	千円	
	24-1 広島県20年	1.7000	100,000	105,581	2032/09/14
	28 東京都20年	1.5900	100,000	104,709	2033/03/18
	5-3 愛知県公債	0.6810	100,000	97,206	2033/05/31
	244 共同発行地方	0.5900	100,000	96,301	2033/07/25
	25-1 広島県20年	1.7500	100,000	105,823	2033/09/13
	262 神奈川公債	1.0800	300,000	299,201	2034/03/17
	6-2 大阪府公債	0.9950	200,000	197,516	2034/05/22
	17 北九州市20年	1.5290	100,000	103,465	2034/06/20
	255 共同発行地方	1.0810	300,000	298,269	2034/06/23
	26-5 京都府20年	1.4550	100,000	102,675	2034/08/10
種別	銘柄数		38銘柄		
小計	金額		4,934,160	4,921,559	
特殊債券 (除く金融債券)	127 都市再生	0.0750	100,000	98,778	2026/09/18
	80 住宅支援機構	1.5890	100,000	101,476	2026/09/18
	95 日本政策金融	0.3140	300,000	296,854	2027/03/11
	321 政保道路機構	0.1550	100,000	98,476	2027/08/31
	F163地方公団団体	1.0500	100,000	100,748	2028/04/28
	3 地方公団15年	1.1760	100,000	101,238	2029/01/26
	4 国際協力銀行CO	0.6390	100,000	98,982	2029/03/19
	184 日本政策投資	0.4920	200,000	196,639	2029/04/12
	79 政保道路機構	2.1000	100,000	105,593	2029/04/27
	F168地方公団団体	1.4250	200,000	204,698	2029/05/28
	81 政保道路機構	2.1000	100,000	105,702	2029/05/31
	47日本政策投資CO	1.0270	100,000	100,588	2029/09/20
	97 政保道路機構	2.1000	100,000	106,383	2029/12/28
	397 政保道路機構	0.0700	100,000	96,321	2029/12/28
	129 地方公団団体	0.0950	100,000	95,823	2030/02/28
	F231地方公団団体	1.1760	100,000	101,355	2030/04/30
	143 政保道路機構	1.8000	200,000	212,125	2031/08/29
	23 地方公団20	1.6800	100,000	104,811	2032/07/28
	174 日本政策投資	0.6490	100,000	96,171	2033/07/14
	478 政保道路機構	1.0900	300,000	298,854	2034/06/30
	33 沖縄振興開発	1.0680	100,000	98,109	2034/10/20
	235 政保道路機構	1.2240	100,000	100,377	2034/12/28
	F568地方公団団体	0.3260	300,000	269,879	2035/07/30
	47 住宅機構RMBS	1.9200	170,088	173,966	2046/04/10
	92 住宅機構RMBS	0.7400	78,984	76,693	2050/01/10
	100 住宅機構RMBS	0.8400	48,649	47,208	2050/09/10
	120 住宅機構RMBS	0.4000	903,672	843,758	2052/05/10
種別	銘柄数		27銘柄		
小計	金額		4,401,393	4,331,613	
普通社債券	11 ヒューリック	0.3200	100,000	99,227	2026/04/13
	36 芙蓉総合リース	0.2700	100,000	99,116	2026/06/05
	20 成田国際空港	0.1050	100,000	98,853	2026/08/21
	32大和ハウス工業	0.3100	100,000	99,105	2026/09/07
	17 パナソニック	0.4700	100,000	99,185	2026/09/18
	7 三井住友海上	0.1900	100,000	98,735	2026/11/13
	6 楽天カード	0.6200	100,000	97,125	2026/12/17
	39 芙蓉総合リース	0.3500	200,000	197,513	2027/02/26
	57 三井化学	0.3500	200,000	197,768	2027/03/01
	58 日産フィナンシャル	0.7000	200,000	195,629	2027/03/19
	80 三菱地所	2.3050	100,000	103,231	2027/03/19
	102 トヨタファイナンス	0.4140	100,000	98,945	2027/04/09

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

区分	銘柄	当期		期末	
		年利率	額面金額	評価額	償還年月日
		%	千円	千円	
60	ソフトバンクグループ	1.7990	100,000	99,703	2027/04/23
30	阪神高速道路	0.3390	200,000	197,722	2027/05/31
42	リコーリース	0.3900	100,000	98,622	2027/06/01
4	香港上海銀行	0.8080	100,000	99,398	2027/06/25
9	ソフトバンク	0.4800	100,000	97,763	2027/12/03
16	クボタ	0.4790	100,000	98,528	2028/04/20
16	JERA	0.6400	100,000	98,617	2028/04/25
1	SOMPOHD	0.4790	100,000	98,507	2028/04/27
11	サントリーホールディング	0.3890	100,000	98,227	2028/05/25
29	東急不動産HD	0.4500	100,000	97,749	2028/06/01
50	大阪瓦斯	0.3900	100,000	98,256	2028/06/02
82	三井不動産	0.3600	100,000	97,776	2028/06/06
22	積水ハウス	0.3600	100,000	97,964	2028/06/07
26	リソナホールデン	0.4150	100,000	98,164	2028/06/07
81	ホンダファイナンス	0.3890	100,000	98,084	2028/06/20
101	中日本高速道	0.4390	200,000	196,954	2028/08/17
33	首都高速道路	0.5230	300,000	295,766	2028/12/20
3	伊藤園	0.5730	100,000	98,205	2029/02/22
40	ソニーG	0.6270	100,000	98,572	2029/03/07
46	光通信	1.2720	100,000	98,516	2029/03/14
103	トヨタファイナンス	0.6170	200,000	196,904	2029/04/11
55	西日本鉄道	0.6670	200,000	196,705	2029/04/11
111	東日本高速道	0.6070	300,000	296,171	2029/04/25
4	オリックス銀行	0.7710	100,000	98,944	2029/04/25
32	住友電工	0.4640	100,000	97,499	2029/07/13
489	九州電力	0.4400	100,000	96,757	2030/05/24
65	東京瓦斯	0.2250	100,000	95,603	2030/09/10
18	セブンアンドアイ	1.0400	100,000	97,644	2030/11/01
35	東レ	0.9730	100,000	98,972	2030/11/22
20	三菱倉庫	0.7590	100,000	97,821	2031/03/14
88	西日本高速道	0.8580	300,000	297,754	2031/05/23
33	NTTファイナンス	1.1120	200,000	199,963	2031/06/20
34	KDDI	1.0580	100,000	99,606	2031/07/11
16	武田薬品	0.4000	100,000	94,631	2031/10/14
5	NTTファイナンス	0.4890	100,000	94,563	2032/09/17
143	三菱地所	0.9000	100,000	96,885	2033/05/02
448	中国電力	0.9200	100,000	96,348	2033/05/25
31	トヨタ自動車	0.7350	100,000	96,244	2033/06/01
214	オリックス	0.8500	100,000	95,489	2033/06/13
87	電源開発	1.1060	100,000	97,212	2034/02/20
566	中部電力	1.0710	200,000	194,283	2034/04/25
563	東北電力	1.1610	200,000	194,294	2034/04/25
38	NTTファイナンス	1.3980	100,000	99,153	2034/09/20
種別小計	銘柄数	55銘柄			
	金額		7,100,000	6,976,991	
合計	銘柄数	388銘柄			
	金額		106,184,553	99,913,173	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年12月2日現在

項目	当期	
	評価額	比率
公社債	千円 99,913,173	% 97.0
コール・ローン等、その他	3,076,520	3.0
投資信託財産総額	102,989,694	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

2024年12月2日現在

項目	当期	期末
(A) 資産	102,989,694,632円	
コール・ローン等	366,340,834	
公社債(評価額)	99,913,173,697	
未収入金	2,523,086,400	
未収利息	178,439,637	
前払費用	8,654,064	
(B) 負債	2,651,060,971	
未払金	2,645,198,400	
未払解約金	5,862,571	
(C) 純資産総額(A-B)	100,338,633,661	
元本	84,257,790,348	
次期繰越損益金	16,080,843,313	
(D) 受益権総口数	84,257,790,348口	
1万口当り基準価額(C/D)	11,909円	

* 期首における元本額は43,455,436,599円、当作成期間中における追加設定元本額は42,569,058,150円、同解約元本額は1,766,704,401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)	4,223,830,047円
日本債券インデックスファンドVA (適格機関投資家専用)	31,224,761,665円
iFree 日本債券インデックス	2,702,026,554円
iFree 8資産バランス	8,598,446,809円
ダイワ・ライフ・バランス30	13,373,316,634円
ダイワ・ライフ・バランス50	11,374,296,557円
ダイワ・ライフ・バランス70	4,568,705,243円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	2,289,608,057円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,872,795,069円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	905,400,010円
ダイワつみたてインデックス日本債券	2,738,688,879円
ダイワつみたてインデックスバランス30	57,073,919円
ダイワつみたてインデックスバランス50	31,138,748円
ダイワつみたてインデックスバランス70	54,718,175円
ダイワ世界バランスファンド40VA	194,032,014円
ダイワ世界バランスファンド60VA	48,951,968円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,909円です。

■損益の状況

当期 自2023年12月1日 至2024年12月2日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	534,273,622円
受取利息	534,289,536
支払利息	△ 15,914
(B) 有価証券売買損益	△ 2,954,842,715
売買益	36,209,356
売買損	△ 2,991,052,071
(C) 当期損益金(A + B)	△ 2,420,569,093
(D) 前期繰越損益金	9,687,344,898
(E) 解約差損益金	△ 366,782,953
(F) 追加信託差損益金	9,180,850,461
(G) 合計(C + D + E + F)	16,080,843,313
次期繰越損益金(G)	16,080,843,313

(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。