

# ダイワつみたて インデックス日本債券

## 運用報告書（全体版） 第5期

（決算日 2022年11月30日）  
（作成対象期間 2021年12月1日～2022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：2018年8月16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。	

設定以来の運用実績

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			
1 期末(2018年11月30日)	円 10,024	円 0	% 0.2	10,029	% 0.3	% 98.5	% -	百万円 4
2 期末(2019年12月 2 日)	10,240	0	2.2	10,268	2.4	99.1	-	179
3 期末(2020年11月30日)	10,145	0	△0.9	10,183	△0.8	99.1	-	526
4 期末(2021年11月30日)	10,139	0	△0.1	10,197	0.1	98.8	-	975
5 期末(2022年11月30日)	9,704	0	△4.3	9,768	△4.2	99.0	-	1,553

(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。

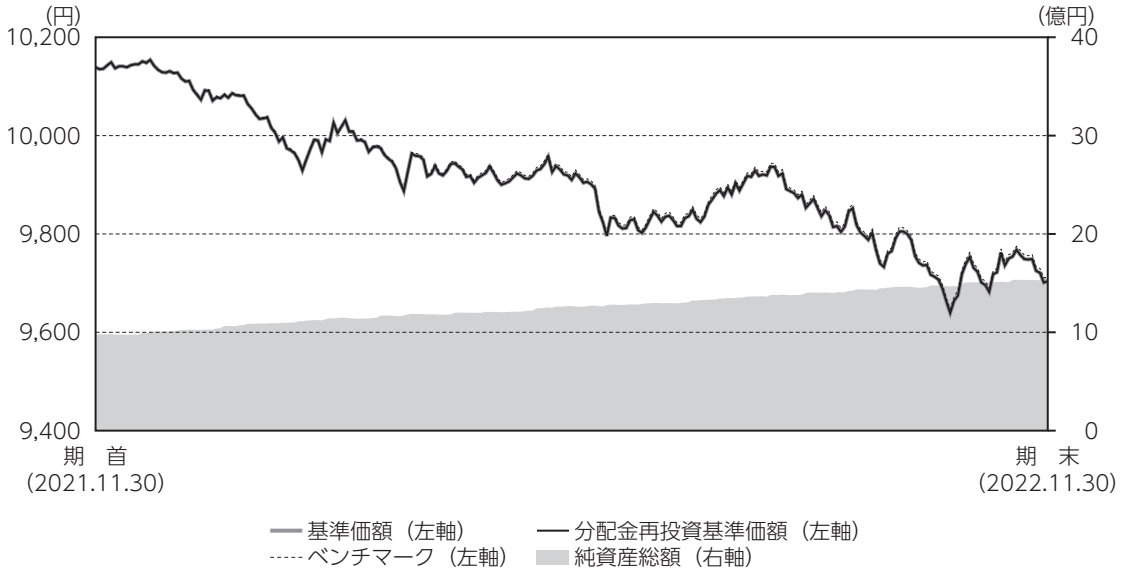
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

NOMURA-BPI の知的財産権およびその他一切の権利は野村証券株式会社に帰属します。なお、野村証券株式会社は、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：10,139円

期末：9,704円（分配金0円）

騰落率：△4.3%（分配金込み）

#### ■ 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。

ダイワつみたてインデックス日本債券

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA-BPI総合指数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 率 比
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2021年11月30日	円	%		%	%	%
	10,139	—	10,197	—	98.8	—
12月末	10,116	△0.2	10,176	△0.2	99.3	—
2022年 1 月末	10,043	△0.9	10,103	△0.9	99.0	—
2 月末	9,992	△1.4	10,052	△1.4	99.4	—
3 月末	9,963	△1.7	10,023	△1.7	99.4	—
4 月末	9,937	△2.0	9,999	△1.9	99.4	—
5 月末	9,921	△2.2	9,984	△2.1	99.0	—
6 月末	9,829	△3.1	9,893	△3.0	99.3	—
7 月末	9,894	△2.4	9,958	△2.3	99.4	—
8 月末	9,871	△2.6	9,935	△2.6	99.0	—
9 月末	9,765	△3.7	9,828	△3.6	99.4	—
10月末	9,753	△3.8	9,818	△3.7	99.0	—
(期末) 2022年11月30日	9,704	△4.3	9,768	△4.2	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

(2021.12.1～2022.11.30)

## ■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、日銀の長短金利操作の下、当作成期首より2021年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国での金融引き締め加速観測を受け、長期金利は2月に0.2%台まで上昇しました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレ要因となったため、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。その後4月から当作成期末にかけては、世界で予想以上にインフレが進んだため各国の金利が上昇し、日本の金利にも上昇圧力がかけられましたが、日銀が長期金利を0.25%までにとどめる方針を強く示したこともあり、0.2%から0.25%程度のレンジで推移しました。

## ■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

(2021.12.1～2022.11.30)

### ■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。

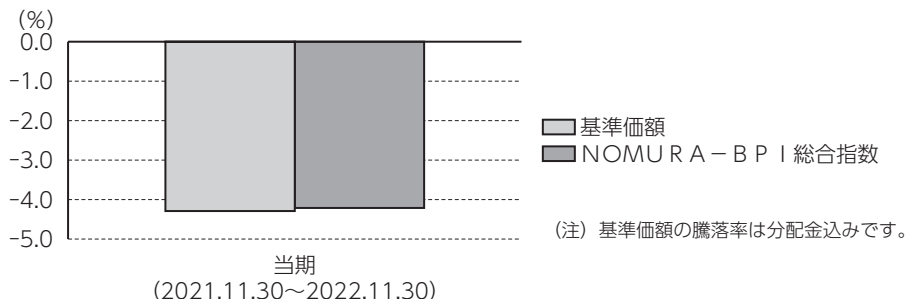
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（BPI）	NOMURA-BPI総合指数

## 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 $\Delta 4.2\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 4.3\%$ となりました。

当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の差異は $\Delta 0.1\%$ 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	
	2021年12月1日 ～2022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）	44

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



## 今後の運用方針

### ■当ファンド

「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 (2021.12.1~2022.11.30)		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9,909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)	(6)	(0.060)	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	14	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。

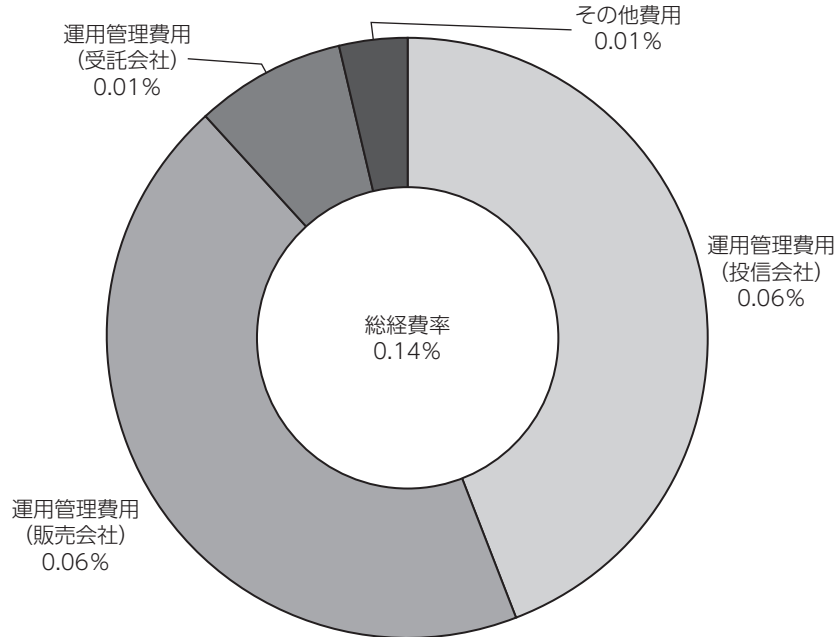
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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。

## ダイワつみたてインデックス日本債券

### ■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

(2021年12月1日から2022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)	563,401	711,882	64,019	80,988

(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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C		
公社債	百万円 12,207	百万円 -	% -	百万円 4,545	百万円 100	% 2.2
コール・ローン	49,173	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合3.3%

※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つて発行される有価証券

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

種 類	当 期	
	買	付 額
		百万円
公社債		100

(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	口 数	口 数	口 数
	千口	千口	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)	753,843	1,253,226	1,552,120	

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2022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)	1,552,120	99.8
コール・ローン等、その他	3,199	0.2
投資信託財産総額	1,555,320	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

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,555,320,562円
コール・ローン等	3,199,997
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)	1,552,120,565
(B) 負債	1,652,679
未払解約金	690,975
未払信託報酬	923,313
その他未払費用	38,391
(C) 純資産総額(A - B)	1,553,667,883
元本	1,600,998,676
次期繰越損益金	△ 47,330,793
(D) 受益権総口数	1,600,998,676口
1万口当り基準価額(C / D)	9,704円

\* 期首における元本額は961,756,532円、当作成期間中における追加設定元本額は849,189,813円、同解約元本額は209,947,669円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,704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47,330,793円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 578円
受取利息	8
支払利息	△ 586
(B) 有価証券売買損益	△49,136,783
売買益	3,653,475
売買損	△52,790,258
(C) 信託報酬等	△ 1,728,089
(D) 当期損益金(A + B + C)	△50,865,450
(E) 前期繰越損益金	△ 2,770,742
(F) 追加信託差損益金	6,305,399
(配当等相当額)	( 7,138,147)
(売買損益相当額)	(△ 832,748)
(G) 合計(D + E + F)	△47,330,793
次期繰越損益金(G)	△47,330,793
追加信託差損益金	6,305,399
(配当等相当額)	( 7,138,147)
(売買損益相当額)	(△ 832,748)
分配準備積立金	7,465
繰越損益金	△53,643,657

(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	7,138,147
(d) 分配準備積立金	7,465
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	7,145,612
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	7,145,612
(h) 受益権総口数	1,600,998,676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18期（決算日 2022年11月30日）

（作成対象期間 2021年12月1日～2022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。

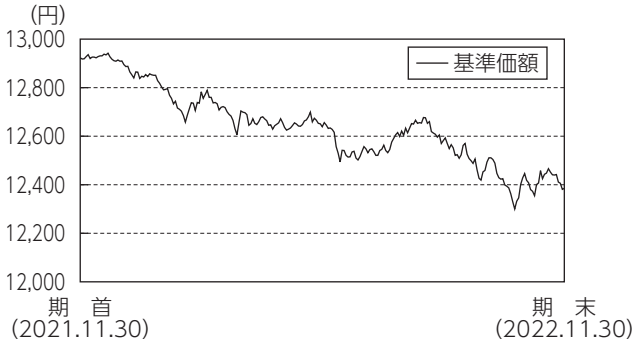
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	内外の公社債等（各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。）
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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



引き締め加速観測を受け、長期金利は2月に0.2%台まで上昇しました。その後、ロシアによるウクライナ侵攻などで一時0.1%台半ばまで低下しましたが、ロシアに対する経済制裁が追加的なインフレーション要因となったため、3月下旬には0.2%台半ばまで上昇しました。その後4月から当作成期末にかけては、世界で予想以上にインフレが進んだため各国の金利が上昇し、日本の金利にも上昇圧力がかかりましたが、日銀が長期金利を0.25%までにとどめる方針を強く示したこともあり、0.2%から0.25%程度のレンジで推移しました。

◆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

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。

◆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△4.2%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.2%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。

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	%	騰落率	%		
(期首)2021年11月30日	12,923	-	12,954	-	98.9	-
12月末	12,895	△0.2	12,927	△0.2	99.4	-
2022年1月末	12,803	△0.9	12,834	△0.9	99.1	-
2月末	12,739	△1.4	12,769	△1.4	99.5	-
3月末	12,704	△1.7	12,733	△1.7	99.5	-
4月末	12,672	△1.9	12,702	△1.9	99.5	-
5月末	12,653	△2.1	12,683	△2.1	99.1	-
6月末	12,537	△3.0	12,567	△3.0	99.4	-
7月末	12,621	△2.3	12,650	△2.3	99.5	-
8月末	12,593	△2.6	12,620	△2.6	99.1	-
9月末	12,459	△3.6	12,484	△3.6	99.5	-
10月末	12,446	△3.7	12,473	△3.7	99.1	-
(期末)2022年11月30日	12,385	△4.2	12,408	△4.2	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：12,923円 期末：12,385円 騰落率：△4.2%

【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、日銀の長短金利操作の下、当作成期首より2021年中はゼロ%をやや上回る狭いレンジで推移しました。2022年に入ると、世界的なインフレ圧力の高まりや各国での金融

■ 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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

国	内	買 付 額		売 付 額	
		千円	千円	千円	千円
	国債証券	12,107,241	( )	4,243,337	( )
	地方債証券	－	( )	201,504	( )
	特殊債券	－	( )	100,637	( )
	社債券	100,000	( )	－	( )

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利分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

(2021年12月1日から2022年11月30日まで)

当 期		買 付 額		売 付 額	
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
151	5年国債 0.005% 2027/3/20	449,928	137	5年国債 0.1% 2023/9/20	591,416
439	2年国債 0.005% 2024/8/1	390,705	135	5年国債 0.1% 2023/3/20	420,726
366	10年国債 0.2% 2032/3/20	388,931	136	5年国債 0.1% 2023/6/20	380,733
149	5年国債 0.005% 2026/9/20	381,767	419	2年国債 0.1% 2022/12/1	350,801
153	5年国債 0.005% 2027/6/20	370,170	430	2年国債 0.005% 2023/11/1	250,272
367	10年国債 0.2% 2032/6/20	359,729	422	2年国債 0.1% 2023/3/1	240,405
365	10年国債 0.1% 2031/12/20	332,219	428	2年国債 0.005% 2023/9/1	240,333
364	10年国債 0.1% 2031/9/20	265,603	329	10年国債 0.8% 2023/6/20	201,860
150	5年国債 0.005% 2026/12/20	260,069	429	2年国債 0.005% 2023/10/1	180,223
430	2年国債 0.005% 2023/11/1	250,647	134	5年国債 0.1% 2022/12/20	170,397

(注1) 金額は受渡し代金 (経過利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)

区 分	当 期			末			
	額面金額	評 価 額	組入比率	残存期間別組入比率			
				うち8B格以下組入比率	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	千円 38,553,000	千円 38,457,616	% 91.0	% －	% 58.9	% 20.6	% 11.5
地方債証券	1,400,000	1,441,583	3.4	－	1.3	2.1	－
特殊債券 (除く金融債券)	700,000	722,617	1.7	－	0.5	1.0	0.2
普通社債券	1,300,000	1,287,679	3.0	－	0.9	1.9	0.2
合 計	41,953,000	41,909,497	99.1	－	61.6	25.6	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手しています。

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

区 分	当 期			末		
	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	431	2年国債	0.0050	150,000	150,127	2023/12/01
	138	5年国債	0.1000	560,000	561,086	2023/12/20
	332	10年国債	0.6000	65,000	65,464	2023/12/20
	65	20年国債	1.9000	42,000	42,875	2023/12/20
	66	20年国債	1.8000	30,000	30,593	2023/12/20
	433	2年国債	0.0050	250,000	250,217	2024/02/01
	434	2年国債	0.0050	170,000	170,147	2024/03/01
	139	5年国債	0.1000	640,000	641,324	2024/03/20
	333	10年国債	0.6000	83,000	83,711	2024/03/20
	67	20年国債	1.9000	19,000	19,483	2024/03/20
	68	20年国債	2.2000	25,000	25,734	2024/03/20
	69	20年国債	2.1000	12,000	12,336	2024/03/20
	435	2年国債	0.0050	30,000	30,027	2024/04/01
	436	2年国債	0.0050	200,000	200,198	2024/05/01
	437	2年国債	0.0050	150,000	150,123	2024/06/01
	140	5年国債	0.1000	470,000	471,057	2024/06/20
	334	10年国債	0.6000	320,000	323,200	2024/06/20
	70	20年国債	2.4000	18,000	18,682	2024/06/20
	71	20年国債	2.2000	17,000	17,592	2024/06/20
	438	2年国債	0.0050	20,000	20,015	2024/07/01
	439	2年国債	0.0050	390,000	390,292	2024/08/01
	440	2年国債	0.0050	200,000	200,140	2024/09/01
	141	5年国債	0.1000	620,000	621,506	2024/09/20
	335	10年国債	0.5000	210,000	212,026	2024/09/20
	72	20年国債	2.1000	53,000	55,041	2024/09/20
	441	2年国債	0.0050	80,000	80,065	2024/10/01
	142	5年国債	0.1000	320,000	320,819	2024/11/20
	337	10年国債	0.3000	300,000	302,001	2024/12/20
	143	5年国債	0.1000	580,000	581,531	2025/03/20
	338	10年国債	0.4000	80,000	80,763	2025/03/20
	75	20年国債	2.1000	14,000	14,680	2025/03/20
	76	20年国債	1.9000	25,000	26,100	2025/03/20
	144	5年国債	0.1000	530,000	531,552	2025/06/20
	339	10年国債	0.4000	135,000	136,428	2025/06/20
78	20年国債	1.9000	17,000	17,830	2025/06/20	
79	20年国債	2.0000	14,000	14,719	2025/06/20	
145	5年国債	0.1000	710,000	712,186	2025/09/20	
340	10年国債	0.4000	190,000	192,183	2025/09/20	
81	20年国債	2.0000	65,000	68,662	2025/09/20	
82	20年国債	2.1000	28,000	29,656	2025/09/20	
146	5年国債	0.1000	360,000	361,152	2025/12/20	
341	10年国債	0.3000	15,000	15,139	2025/12/20	
147	5年国債	0.0050	580,000	580,000	2026/03/20	
342	10年国債	0.1000	140,000	140,438	2026/03/20	

ダイワ日本債券インデックスマザーファンド (BPI)

区 分	当 期			未 期		
	銘柄	年利 率	額 面 金 額	評 価 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千 円	千 円		
85	20年国債	2.1000	31,000	33,141	2026/03/20	
86	20年国債	2.3000	6,000	6,454	2026/03/20	
87	20年国債	2.2000	35,000	37,533	2026/03/20	
148	5年国債	0.0050	500,000	499,820	2026/06/20	
343	10年国債	0.1000	270,000	270,812	2026/06/20	
88	20年国債	2.3000	33,000	35,675	2026/06/20	
89	20年国債	2.2000	15,000	16,163	2026/06/20	
149	5年国債	0.0050	450,000	449,572	2026/09/20	
344	10年国債	0.1000	90,000	90,238	2026/09/20	
150	5年国債	0.0050	260,000	259,526	2026/12/20	
345	10年国債	0.1000	410,000	410,828	2026/12/20	
92	20年国債	2.1000	60,000	64,973	2026/12/20	
151	5年国債	0.0050	450,000	448,744	2027/03/20	
346	10年国債	0.1000	250,000	250,320	2027/03/20	
93	20年国債	2.0000	18,000	19,488	2027/03/20	
94	20年国債	2.1000	45,000	48,915	2027/03/20	
1	フィリピン共和国	0.7600	100,000	98,662	2027/04/22	
153	5年国債	0.0050	370,000	368,571	2027/06/20	
347	10年国債	0.1000	400,000	400,180	2027/06/20	
95	20年国債	2.3000	30,000	33,012	2027/06/20	
96	20年国債	2.1000	63,000	68,754	2027/06/20	
154	5年国債	0.1000	140,000	139,932	2027/09/20	
348	10年国債	0.1000	430,000	429,793	2027/09/20	
97	20年国債	2.2000	25,000	27,502	2027/09/20	
98	20年国債	2.1000	64,000	70,101	2027/09/20	
349	10年国債	0.1000	380,000	379,521	2027/12/20	
99	20年国債	2.1000	53,000	58,269	2027/12/20	
350	10年国債	0.1000	480,000	479,241	2028/03/20	
100	20年国債	2.2000	35,000	38,822	2028/03/20	
101	20年国債	2.4000	18,000	20,155	2028/03/20	
351	10年国債	0.1000	440,000	439,027	2028/06/20	
102	20年国債	2.4000	10,000	11,247	2028/06/20	
103	20年国債	2.3000	21,000	23,504	2028/06/20	
104	20年国債	2.1000	64,000	70,928	2028/06/20	
352	10年国債	0.1000	500,000	498,705	2028/09/20	
105	20年国債	2.1000	38,000	42,286	2028/09/20	
106	20年国債	2.2000	16,000	17,897	2028/09/20	
353	10年国債	0.1000	440,000	438,548	2028/12/20	
107	20年国債	2.1000	40,000	44,678	2028/12/20	
108	20年国債	1.9000	68,000	75,136	2028/12/20	
354	10年国債	0.1000	410,000	408,335	2029/03/20	
109	20年国債	1.9000	60,000	66,530	2029/03/20	
110	20年国債	2.1000	27,000	30,275	2029/03/20	
355	10年国債	0.1000	350,000	348,187	2029/06/20	
111	20年国債	2.2000	35,000	39,602	2029/06/20	
112	20年国債	2.1000	40,000	45,001	2029/06/20	
356	10年国債	0.1000	390,000	387,511	2029/09/20	
113	20年国債	2.1000	70,000	79,032	2029/09/20	
357	10年国債	0.1000	360,000	357,123	2029/12/20	
114	20年国債	2.1000	45,000	50,945	2029/12/20	
115	20年国債	2.2000	42,000	47,840	2029/12/20	
2	30年国債	2.4000	9,000	10,402	2030/02/20	
358	10年国債	0.1000	480,000	475,516	2030/03/20	
116	20年国債	2.2000	27,000	30,851	2030/03/20	
117	20年国債	2.1000	77,000	87,429	2030/03/20	
3	30年国債	2.3000	4,000	4,609	2030/05/20	
359	10年国債	0.1000	390,000	385,663	2030/06/20	
118	20年国債	2.0000	13,000	14,707	2030/06/20	
119	20年国債	1.8000	23,000	25,679	2030/06/20	
120	20年国債	1.6000	98,000	107,963	2030/06/20	
360	10年国債	0.1000	460,000	454,194	2030/09/20	
4	30年国債	2.9000	8,000	9,656	2030/11/20	
361	10年国債	0.1000	460,000	453,656	2030/12/20	
123	20年国債	2.1000	42,000	48,094	2030/12/20	
124	20年国債	2.0000	100,000	113,723	2030/12/20	
362	10年国債	0.1000	450,000	443,250	2031/03/20	
125	20年国債	2.2000	25,000	28,928	2031/03/20	
126	20年国債	2.0000	21,000	23,958	2031/03/20	

区 分	当 期			未 期		
	銘柄	年利 率	額 面 金 額	評 価 額	評 価 額	償 還 年 月 日
		%	千 円	千 円		
127	20年国債	1.9000	110,000	124,603	2031/03/20	
5	30年国債	2.2000	8,000	9,281	2031/05/20	
363	10年国債	0.1000	380,000	373,973	2031/06/20	
128	20年国債	1.9000	32,000	36,359	2031/06/20	
129	20年国債	1.8000	95,000	107,147	2031/06/20	
364	10年国債	0.1000	380,000	373,638	2031/09/20	
130	20年国債	1.8000	28,000	31,669	2031/09/20	
131	20年国債	1.7000	150,000	168,370	2031/09/20	
6	30年国債	2.4000	9,000	10,678	2031/11/20	
365	10年国債	0.1000	335,000	329,673	2031/12/20	
132	20年国債	1.7000	25,000	28,146	2031/12/20	
133	20年国債	1.8000	150,000	170,203	2031/12/20	
366	10年国債	0.2000	390,000	390,534	2032/03/20	
134	20年国債	1.8000	15,000	17,066	2032/03/20	
135	20年国債	1.7000	20,000	22,573	2032/03/20	
136	20年国債	1.6000	180,000	201,531	2032/03/20	
7	30年国債	2.3000	12,000	14,222	2032/05/20	
367	10年国債	0.2000	360,000	358,822	2032/06/20	
137	20年国債	1.7000	18,000	20,339	2032/06/20	
139	20年国債	1.6000	250,000	280,175	2032/06/20	
368	10年国債	0.2000	130,000	129,377	2032/09/20	
140	20年国債	1.7000	100,000	113,062	2032/09/20	
141	20年国債	1.7000	48,000	54,292	2032/12/20	
142	20年国債	1.8000	185,000	211,048	2032/12/20	
10	30年国債	1.1000	25,000	26,797	2033/03/20	
143	20年国債	1.6000	100,000	112,202	2033/03/20	
144	20年国債	1.5000	130,000	144,573	2033/03/20	
11	30年国債	1.7000	9,000	10,189	2033/06/20	
145	20年国債	1.7000	210,000	237,755	2033/06/20	
12	30年国債	2.1000	11,000	12,916	2033/09/20	
146	20年国債	1.7000	200,000	226,454	2033/09/20	
13	30年国債	2.0000	11,000	12,808	2033/12/20	
147	20年国債	1.6000	220,000	246,765	2033/12/20	
14	30年国債	2.4000	22,000	26,598	2034/03/20	
148	20年国債	1.5000	195,000	216,547	2034/03/20	
15	30年国債	2.5000	21,000	25,656	2034/06/20	
149	20年国債	1.5000	215,000	238,607	2034/06/20	
16	30年国債	2.5000	26,000	31,813	2034/09/20	
150	20年国債	1.4000	225,000	247,016	2034/09/20	
17	30年国債	2.4000	17,000	20,624	2034/12/20	
151	20年国債	1.2000	260,000	279,099	2034/12/20	
18	30年国債	2.3000	20,000	24,059	2035/03/20	
152	20年国債	1.2000	200,000	214,480	2035/03/20	
19	30年国債	2.3000	15,000	18,060	2035/06/20	
153	20年国債	1.3000	275,000	297,987	2035/06/20	
20	30年国債	2.5000	16,000	19,672	2035/09/20	
154	20年国債	1.2000	205,000	219,362	2035/09/20	
21	30年国債	2.3000	16,000	19,292	2035/12/20	
155	20年国債	1.0000	220,000	229,539	2035/12/20	
22	30年国債	2.5000	17,000	20,939	2036/03/20	
156	20年国債	0.4000	200,000	193,052	2036/03/20	
23	30年国債	2.5000	16,000	19,735	2036/06/20	
157	20年国債	0.2000	210,000	196,637	2036/06/20	
24	30年国債	2.5000	15,000	18,503	2036/09/20	
158	20年国債	0.5000	225,000	218,646	2036/09/20	
25	30年国債	2.3000	17,000	20,532	2036/12/20	
159	20年国債	0.6000	220,000	215,941	2036/12/20	
26	30年国債	2.4000	32,000	39,096	2037/03/20	
160	20年国債	0.7000	190,000	188,407	2037/03/20	
161	20年国債	0.6000	200,000	194,912	2037/06/20	
27	30年国債	2.5000	32,000	39,540	2037/09/20	
162	20年国債	0.6000	210,000	203,899	2037/09/20	
163	20年国債	0.6000	160,000	154,764	2037/12/20	
28	30年国債	2.5000	34,000	42,021	2038/03/20	
164	20年国債	0.5000	260,000	246,844	2038/03/20	
165	20年国債	0.5000	155,000	146,541	2038/06/20	
29	30年国債	2.4000	43,000	52,504	2038/09/20	
166	20年国債	0.7000	215,000	208,760	2038/09/20	



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		未		償還年月日
	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額	
		%	千円	千円	
167	20年国債	0.5000	160,000	150,075	2038/12/20
30	30年国債	2.3000	56,000	67,527	2039/03/20
168	20年国債	0.4000	250,000	229,782	2039/03/20
169	20年国債	0.3000	155,000	139,492	2039/06/20
31	30年国債	2.2000	76,000	90,354	2039/09/20
170	20年国債	0.3000	175,000	156,700	2039/09/20
171	20年国債	0.3000	140,000	124,814	2039/12/20
32	30年国債	2.3000	45,000	54,186	2040/03/20
172	20年国債	0.4000	215,000	194,256	2040/03/20
173	20年国債	0.4000	200,000	180,066	2040/06/20
33	30年国債	2.0000	95,000	109,854	2040/09/20
174	20年国債	0.4000	230,000	206,337	2040/09/20
175	20年国債	0.5000	165,000	150,201	2040/12/20
34	30年国債	2.2000	110,000	130,821	2041/03/20
176	20年国債	0.5000	150,000	136,083	2041/03/20
177	20年国債	0.4000	180,000	159,724	2041/06/20
35	30年国債	2.0000	120,000	138,771	2041/09/20
178	20年国債	0.5000	190,000	171,304	2041/09/20
179	20年国債	0.5000	190,000	170,832	2041/12/20
36	30年国債	2.0000	138,000	159,548	2042/03/20
180	20年国債	0.8000	160,000	151,753	2042/03/20
181	20年国債	0.9000	160,000	154,353	2042/06/20
37	30年国債	1.9000	165,000	187,684	2042/09/20
182	20年国債	1.1000	60,000	59,757	2042/09/20
38	30年国債	1.8000	95,000	106,210	2043/03/20
39	30年国債	1.9000	105,000	119,179	2043/06/20
40	30年国債	1.8000	80,000	89,252	2043/09/20
41	30年国債	1.7000	80,000	87,680	2043/12/20
42	30年国債	1.7000	85,000	93,077	2044/03/20
43	30年国債	1.7000	95,000	103,933	2044/06/20
44	30年国債	1.7000	85,000	92,905	2044/09/20
45	30年国債	1.5000	105,000	110,589	2044/12/20
46	30年国債	1.5000	115,000	120,961	2045/03/20
47	30年国債	1.6000	105,000	112,354	2045/06/20
48	30年国債	1.4000	110,000	113,228	2045/09/20
49	30年国債	1.4000	120,000	123,331	2045/12/20
50	30年国債	0.8000	110,000	99,629	2046/03/20
51	30年国債	0.3000	155,000	124,251	2046/06/20
52	30年国債	0.5000	120,000	100,628	2046/09/20
53	30年国債	0.6000	95,000	81,251	2046/12/20
54	30年国債	0.8000	118,000	105,449	2047/03/20
55	30年国債	0.8000	96,000	85,475	2047/06/20
56	30年国債	0.8000	100,000	88,708	2047/09/20
57	30年国債	0.8000	105,000	92,799	2047/12/20
1	40年国債	2.4000	30,000	36,666	2048/03/20
58	30年国債	0.8000	150,000	132,075	2048/03/20
59	30年国債	0.7000	97,000	83,049	2048/06/20
60	30年国債	0.9000	100,000	89,504	2048/09/20
61	30年国債	0.7000	95,000	80,612	2048/12/20
2	40年国債	2.2000	48,000	56,355	2049/03/20
62	30年国債	0.5000	110,000	88,173	2049/03/20
63	30年国債	0.4000	110,000	85,401	2049/06/20
64	30年国債	0.4000	90,000	69,609	2049/09/20
65	30年国債	0.4000	86,000	66,641	2049/12/20
3	40年国債	2.2000	19,000	22,400	2050/03/20
66	30年国債	0.4000	115,000	88,949	2050/03/20
67	30年国債	0.6000	140,000	113,121	2050/06/20
68	30年国債	0.6000	106,000	85,355	2050/09/20
69	30年国債	0.7000	106,000	87,528	2050/12/20
4	40年国債	2.2000	54,000	63,139	2051/03/20
70	30年国債	0.7000	166,000	136,498	2051/03/20
71	30年国債	0.7000	66,000	54,093	2051/06/20
72	30年国債	0.7000	203,000	165,995	2051/09/20
73	30年国債	0.7000	120,000	97,996	2051/12/20
5	40年国債	2.0000	61,000	68,461	2052/03/20
74	30年国債	1.0000	155,000	137,269	2052/03/20
75	30年国債	1.3000	160,000	153,134	2052/06/20
76	30年国債	1.4000	80,000	78,191	2052/09/20

区 分	当 期		未		償還年月日	
	銘 柄	年利率	額面金額	評 価 額		
		%	千円	千円		
6	40年国債	1.9000	40,000	43,788	2053/03/20	
7	40年国債	1.7000	41,000	42,883	2054/03/20	
8	40年国債	1.4000	40,000	38,750	2055/03/20	
9	40年国債	0.4000	40,000	28,282	2056/03/20	
10	40年国債	0.9000	91,000	75,719	2057/03/20	
11	40年国債	0.8000	85,000	67,973	2058/03/20	
12	40年国債	0.5000	99,000	70,435	2059/03/20	
13	40年国債	0.5000	252,000	177,899	2060/03/20	
14	40年国債	0.7000	273,000	205,852	2061/03/20	
15	40年国債	1.0000	145,000	119,398	2062/03/20	
種別	銘柄数	-----	258銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	38,553,000	38,457,616	-----	
地方債証券	3	兵庫県公債12年	0.5600	100,000	101,020	2025/04/16
	401	大阪府公債	0.4770	100,000	100,988	2025/10/29
	22-1	福岡県15年	1.6700	100,000	104,612	2025/11/21
	27-1	滋賀県公債	0.4760	100,000	101,064	2025/11/27
	751	東京都公債	0.3700	100,000	100,760	2025/12/19
	27-15	北海道公債	0.2200	100,000	100,222	2026/02/26
	28-1	静岡県公債	0.0800	100,000	99,832	2026/03/19
	222	神奈川県公債	0.0600	100,000	99,710	2026/06/19
	168	共同発行地方	0.2100	100,000	100,051	2027/03/25
	29-6	千葉県公債	0.2450	100,000	99,989	2028/01/25
	11	名古屋市20年	2.1300	100,000	112,369	2029/12/14
	9	埼玉県20年	2.1500	100,000	112,943	2030/05/24
	11	兵庫県公債20年	1.8400	100,000	110,696	2030/08/16
	3-5	北海道公債	0.1400	100,000	97,322	2031/06/30
種別	銘柄数	-----	14銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	1,400,000	1,441,583	-----	
特殊債券 除く金融債券	65	地方公共団体	0.5350	100,000	100,669	2024/10/28
	241	政保道路機構	0.4500	100,000	100,900	2025/03/31
	261	政保道路機構	0.3810	100,000	100,932	2025/11/28
	127	都市再生	0.0750	100,000	99,315	2026/09/18
	80	住宅支援機構	1.5890	100,000	105,060	2026/09/18
	81	政保道路機構	2.1000	100,000	111,858	2029/05/31
	47	日本政策投資CO	1.0270	100,000	103,878	2029/09/20
種別	銘柄数	-----	7銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	700,000	722,617	-----	
普通社債券	32	東日本旅客鉄道	2.2600	100,000	102,781	2024/03/19
	25	西日本高速道	0.5240	100,000	100,650	2024/12/20
	497	関西電力	1.0020	100,000	101,709	2025/06/20
	14	セブアンドアイ	0.1900	100,000	99,661	2025/12/19
	20	成田国際空港	0.1050	100,000	99,368	2026/08/21
	17	パナソニック	0.4700	100,000	100,154	2026/09/18
	7	三井住友海上	0.1900	100,000	99,403	2026/11/13
	6	楽天カード	0.6200	100,000	95,907	2026/12/17
	80	三菱地所	2.3050	100,000	108,265	2027/03/19
	9	ソフトバンク	0.4800	100,000	98,340	2027/12/03
	65	東京瓦斯	0.2250	100,000	97,144	2030/09/10
	18	楽天グループ	1.0500	100,000	86,407	2031/12/02
	5	NTTファイナンス	0.4890	100,000	97,885	2032/09/17
種別	銘柄数	-----	13銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	1,300,000	1,287,679	-----	
合計	銘柄数	-----	292銘柄	-----	-----	
小計	金額	-----	41,953,000	41,909,497	-----	

(注) 単位未満は切捨て。



■投資信託財産の構成

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	41,909,497	98.8
コール・ローン等、その他	506,960	1.2
投資信託財産総額	42,416,457	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

2022年11月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	42,416,457,467円
コール・ローン等	430,711,043
公社債(評価額)	41,909,497,020
未収利息	73,960,289
前払費用	2,289,115
(B) 負債	139,468,714
未払金	135,408,450
未払解約金	4,060,264
(C) 純資産総額(A - B)	42,276,988,753
元本	34,135,552,866
次期繰越損益金	8,141,435,887
(D) 受益権総口数	34,135,552,866口
1万口当り基準価額(C/D)	12,385円

\* 期首における元本額は28,295,749,520円、当作成期間中における追加設定元本額は6,672,798,337円、同解約元本額は832,994,991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)	1,509,919,138円
iFree 日本債券インデックス	3,696,009,628円
iFree 8資産バランス	4,700,707,358円
ダイワ・ライフ・バランス30	9,972,029,435円
ダイワ・ライフ・バランス50	6,944,671,544円
ダイワ・ライフ・バランス70	2,311,095,059円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/安定コース)	1,633,964,980円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/6分散コース)	1,282,581,388円
DCダイワ・ワールドアセット (六つの羽/成長コース)	492,975,132円
ダイワつみたてインデックス日本債券	1,253,226,133円
ダイワつみたてインデックスバランス30	36,466,976円
ダイワつみたてインデックスバランス50	15,711,858円
ダイワつみたてインデックスバランス70	13,313,259円
ダイワ世界バランスファンド40VA	216,676,466円
ダイワ世界バランスファンド60VA	56,204,512円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,385円です。

■損益の状況

当期 自2021年12月1日 至2022年11月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	241,757,056円
受取利息	241,810,807
支払利息	△ 53,751
(B) 有価証券売買損益	△1,906,903,190
売買益	2,392,200
売買損	△1,909,295,390
(C) 当期損益金(A + B)	△1,665,146,134
(D) 前期繰越損益金	8,272,126,456
(E) 解約差損益金	△ 219,663,037
(F) 追加信託差損益金	1,754,118,602
(G) 合計(C + D + E + F)	8,141,435,887
次期繰越損益金(G)	8,141,435,887

(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證券株式会社に帰属します。なお、野村證券株式会社は、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。