

# DCダイワ物価連動国債ファンド

## 運用報告書（全体版） 第18期

（決算日 2023年9月11日）

（作成対象期間 2022年9月13日～2023年9月11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、わが国の物価連動国債に投資し、安定した収益の確保および信託財産の着実な成長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

Daiva 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	
信託期間	無期限（設定日：2005年8月30日）	
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長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	ダイワ物価連動国債マザーファンドの受益証券
	ダイワ物価連動国債マザーファンド	わが国の物価連動国債を中心とする国債
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、分配対象額が少額の場合には、分配を行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物価連動 国債インデックス		公社債 組入比率	債券 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
14期末(2019年9月10日)	11,610	0	△0.9	11,785	△0.4	99.1	—	1,500
15期末(2020年9月10日)	11,229	0	△3.3	11,433	△3.0	99.6	—	1,417
16期末(2021年9月10日)	11,478	0	2.2	11,715	2.5	98.0	—	1,525
17期末(2022年9月12日)	12,034	0	4.8	12,271	4.7	96.8	—	1,826
18期末(2023年9月11日)	12,267	0	1.9	12,614	2.8	99.4	—	1,993

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) NOMURA物価連動国債インデックスは、NOMURA物価連動国債インデックスの原指数をもとに、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。

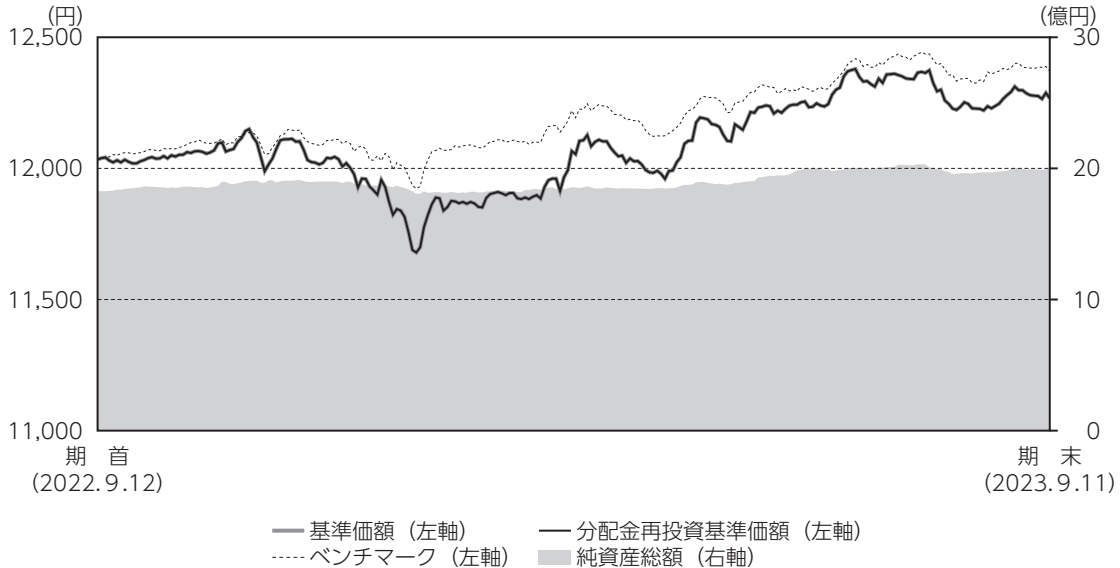
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

NOMURA物価連動国債インデックス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、当完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はありません。
- \* 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物価連動国債インデックスです。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：12,034円

期末：12,267円（分配金0円）

騰落率：1.9%（分配金込み）

#### ■ 基準価額の主な変動要因

主としてわが国の物価連動国債に投資した結果、市場が予想する将来の物価上昇率（同程度の残存年数の固定利付国債と物価連動国債の利回り差）の上昇による物価連動国債価格の上昇と、CPI（消費者物価指数）の上昇に伴う物価連動国債の元本の増加を主因として、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

## DCダイワ物価連動国債ファンド

年 月 日	基 準 価 額		NOMURA物価連動国債インデックス		公 社 債 組 入 比 率	債 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2022年 9月12日	円 12,034	% -	12,271	% -	% 96.8	% -
9月末	12,032	△0.0	12,301	0.3	97.0	-
10月末	12,099	0.5	12,350	0.6	96.2	-
11月末	12,103	0.6	12,385	0.9	95.0	-
12月末	11,929	△0.9	12,294	0.2	96.8	-
2023年 1月末	11,867	△1.4	12,319	0.4	97.0	-
2月末	11,892	△1.2	12,337	0.5	97.9	-
3月末	12,046	0.1	12,444	1.4	97.4	-
4月末	12,175	1.2	12,479	1.7	99.0	-
5月末	12,209	1.5	12,550	2.3	98.4	-
6月末	12,349	2.6	12,657	3.2	98.4	-
7月末	12,294	2.2	12,639	3.0	98.5	-
8月末	12,298	2.2	12,630	2.9	98.9	-
(期末) 2023年 9月11日	12,267	1.9	12,614	2.8	99.4	-

(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

(2022.9.13~2023.9.11)

### ■国内物価連動国債市況

物価連動国債の価格は上昇しました。

当作成期首より、世界的なインフレ懸念などが金利上昇要因となりましたが、日銀が大規模な金融緩和の継続姿勢を強く示したこともあり、長期金利はおおむね横ばいでの推移が続きました。2022年12月に日銀が長期金利の変動許容幅を拡大し、2023年7月に長短金利操作（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で、当作成期末にかけて長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

一方、円安などを受けて、市場が予想する将来の物価上昇率およびCPI（消費者物価指数）が上昇したことから、物価連動国債市況は上昇しました。

## 前作成期末における「今後の運用方針」

### ■当ファンド

主として「ダイワ物価連動国債マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債市場全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行います。

### ■ダイワ物価連動国債マザーファンド

主としてわが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債市場全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行います。金利・物価見通しや個別銘柄の割高・割安分析などに基づいてポートフォリオを構築します。

## ポートフォリオについて

(2022.9.13~2023.9.11)

### ■当ファンド

主として「ダイワ物価連動国債マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債市場全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行いました。

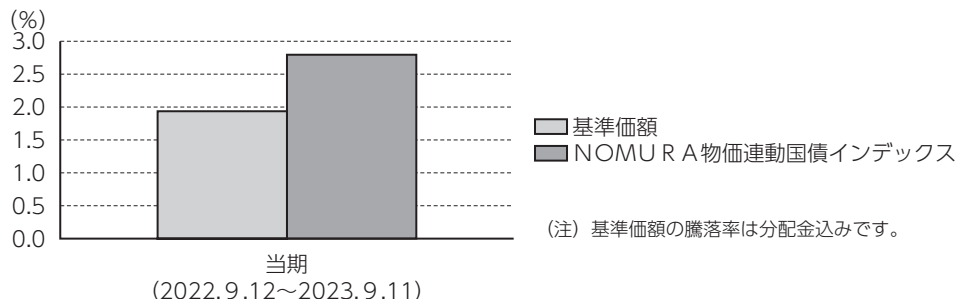
### ■ダイワ物価連動国債マザーファンド

主としてわが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債市場全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行いました。

## 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2.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は1.9%となりました。デフレーションの長期化がマイナス要因となり、ベンチマークを下回る運用成績となりました。

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NOMUR A物価連動国債インデックスです。

## 分配金について

当作成期は、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、収益分配は見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### ■分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2022年9月13日 ～2023年9月11日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,284

(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却等損益」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

主として「ダイワ物価連動国債マザーファンド」の受益証券を通じて、わが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債市場全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行います。

### ■ダイワ物価連動国債マザーファンド

主としてわが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債市場全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行います。金利・物価見通しや個別銘柄の割高・割安分析などに基づいてポートフォリオを構築します。

## 1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.9.13~2023.9.11)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	53円	0.439%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は12,093円です。
(投 信 会 社)	(20)	(0.164)	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)	(28)	(0.230)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(5)	(0.044)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	－	－	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
有 価 証 券 取 引 税	－	－	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	54	0.444	

(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。

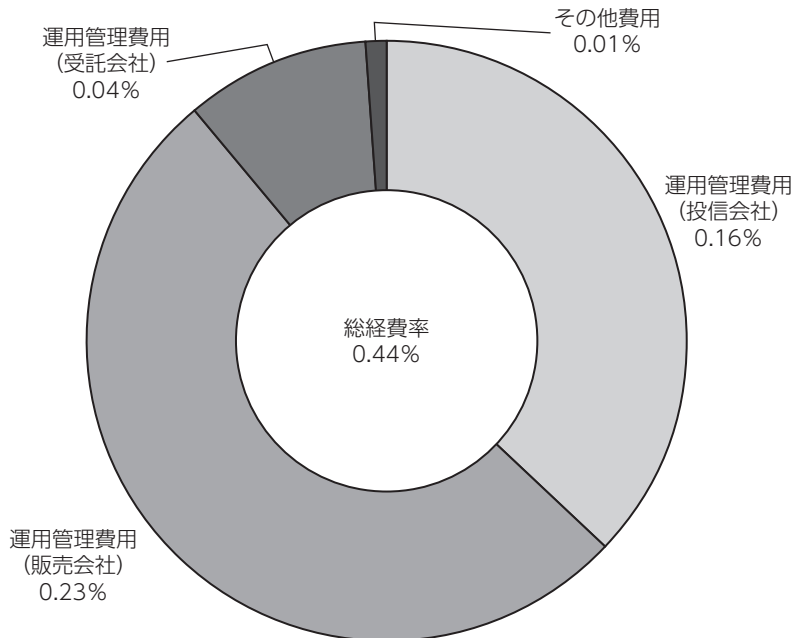
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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0.44%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。

## DCダイワ物価連動国債ファンド

### ■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9月13日から2023年9月11日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ物価連動国債マザーファンド	404,876	519,773	310,357	396,679

(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9月13日から2023年9月11日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
公社債	百万円 1,312	百万円 108	% 8.3	百万円 899	百万円 -	% -
コール・ローン	56,388	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合19.5%

※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) 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総額に対する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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

### ■組入資産明細表

#### 親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円	千口	千口	千円
ダイワ物価連動国債マザーファンド	1,430,447	1,524,965	1,987,487			

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2023年9月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワ物価連動国債マザーファンド	千円 1,987,487	% 99.5
コール・ローン等、その他	10,522	0.5
投資信託財産総額	1,998,009	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9月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,998,009,888円
コール・ローン等	10,522,639
ダイワ物価連動国債マザーファンド(評価額)	1,987,487,249
(B) 負債	4,605,230
未払解約金	298,740
未払信託報酬	4,253,137
その他未払費用	53,353
(C) 純資産総額(A - B)	1,993,404,658
元本	1,625,075,267
次期繰越損益金	368,329,391
(D) 受益権総口数	1,625,075,267口
1万口当り基準価額(C/D)	12,267円

\*期首における元本額は1,517,428,630円、当作成期間中における追加設定元本額は633,729,164円、同解約元本額は526,082,527円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は12,267円です。

## ■損益の状況

当期 自2022年9月13日 至2023年9月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,640円
受取利息	546
支払利息	△ 4,186
(B) 有価証券売買損益	42,608,852
売買益	48,224,621
売買損	△ 5,615,769
(C) 信託報酬等	△ 8,434,129
(D) 当期損益金(A + B + C)	34,171,083
(E) 前期繰越損益金	37,957,852
(F) 追加信託差損益金	296,200,456
(配当等相当額)	( 299,164,397)
(売買損益相当額)	(△ 2,963,941)
(G) 合計(D + E + F)	368,329,391
次期繰越損益金(G)	368,329,391
追加信託差損益金	296,200,456
(配当等相当額)	( 299,164,397)
(売買損益相当額)	(△ 2,963,941)
分配準備積立金	72,132,575
繰越損益金	△ 3,640

(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	34,173,748
(c) 収益調整金	299,164,397
(d) 分配準備積立金	37,958,827
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	371,296,972
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	371,296,972
(h) 受益権総口数	1,625,075,267口

## ダイワ物価連動国債マザーファンド

### <補足情報>

当ファンド（DCダイワ物価連動国債ファンド）が投資対象としている「ダイワ物価連動国債マザーファンド」の決算日（2023年3月10日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2023年9月11日）現在におけるダイワ物価連動国債マザーファンドの組入資産の内容等を掲載いたしました。

### ■ダイワ物価連動国債マザーファンドの主要な売買銘柄 公 社 債

(2022年9月13日から2023年9月11日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
26 物価連動国債 0.005% 2031/3/10		千円 657,396	26 物価連動国債 0.005% 2031/3/10		千円 899,237
24 物価連動国債 0.1% 2029/3/10		435,794			
27 物価連動国債 0.005% 2032/3/10		219,139			

(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

下記は、2023年9月11日現在におけるダイワ物価連動国債マザーファンド（7,030,567千円）の内容です。

#### (1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2023年9月11日現在						
	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		
					5 年 以 上	2 年 以 上	2 年 未 満
国債証券	千円 8,200,000	千円 9,134,770	% 99.7	% -	% 75.3	% 24.4	% -

(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）

2023年9月11日現在							
区 分	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日	
国債証券	23 物価連動国債		% 0.1000	千円 2,000,000	千円 2,233,039	2028/03/10	
	24 物価連動国債		0.1000	3,400,000	3,771,754	2029/03/10	
	26 物価連動国債		0.0050	1,900,000	2,136,186	2031/03/10	
	27 物価連動国債		0.0050	900,000	993,790	2032/03/10	
合 計	銘 柄 数	4銘柄		8,200,000	9,134,770		
	金 額						

(注) 単位未満は切捨て。

# ダイワ物価連動国債マザーファンド

## 運用報告書 第18期 (決算日 2023年3月10日)

(作成対象期間 2022年3月11日～2023年3月10日)

ダイワ物価連動国債マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

### ★当ファンドの仕組みは次の通りです。

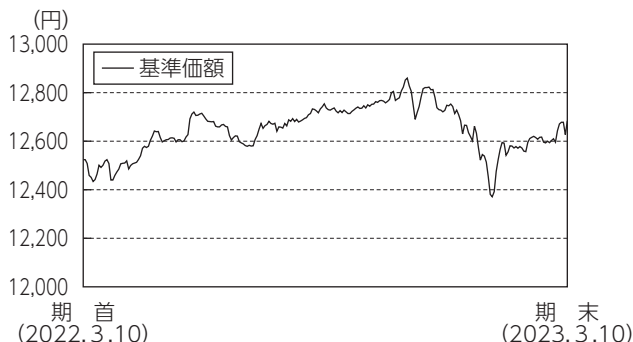
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の物価連動国債を中心とする国債
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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物価連動 国債インデックス		公 社 債 組入比率	債券先物 比
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首)2022年3月10日	12,524	-	11,744	-	98.5	-
3月末	12,440	△0.7	11,725	△0.2	99.0	-
4月末	12,604	0.6	11,864	1.0	98.5	-
5月末	12,627	0.8	11,894	1.3	99.1	-
6月末	12,605	0.6	11,854	0.9	98.6	-
7月末	12,673	1.2	11,892	1.3	98.1	-
8月末	12,731	1.7	11,935	1.6	96.8	-
9月末	12,729	1.6	11,968	1.9	97.3	-
10月末	12,805	2.2	12,015	2.3	96.4	-
11月末	12,813	2.3	12,049	2.6	95.2	-
12月末	12,633	0.9	11,960	1.8	97.1	-
2023年1月末	12,572	0.4	11,985	2.0	97.2	-
2月末	12,603	0.6	12,002	2.2	98.2	-
(期末)2023年3月10日	12,684	1.3	12,061	2.7	98.5	-

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) NOMURA物価連動国債インデックスは、NOMURA物価連動国債インデックスの原指数をもとに、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：12,524円 期末：12,684円 騰落率：1.3%

【基準価額の主な変動要因】

主としてわが国の物価連動国債に投資した結果、消費者物価指数の上昇に伴う物価連動国債の元本の増加を主因として、基準価額は上昇しました。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

○国内物価連動国債市況

物価連動国債の価格は上昇しました。

当作成期首より、世界的なインフレ懸念などが金利上昇要因となりましたが、日銀が大規模な金融緩和の継続姿勢を強く示したこと

もあり、長期金利はおおむね横ばいでの推移が続きました。2022年12月後半以降は、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことを受けて、長期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

また、円安などを受けて、市場が予想する将来の物価上昇率および消費者物価指数は上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

主としてわが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行います。金利・物価見通しや個別銘柄の割高・割安分析などに基づいてポートフォリオを構築します。

◆ポートフォリオについて

主として、わが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当作成期の当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率は、「当作成期中の基準価額と市況等の推移」をご参照ください。

参考指数は国内の物価連動国債市場の動向を表す代表的な指数として掲載しております。

《今後の運用方針》

主としてわが国の物価連動国債に投資し、物価連動国債全体のパフォーマンスを上回る投資成果をめざして運用を行います。金利・物価見通しや個別銘柄の割高・割安分析などに基づいてポートフォリオを構築します。

■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3月11日から2023年3月10日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	国債証券	2,722,154	656,040 ( )

- (注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。
- (注2) ( )内は償還による減少分、上段の数字には含まれておりません。
- (注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公社債

(2022年3月11日から2023年3月10日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘柄	金額	銘柄	金額
26 物価連動国債 0.005% 2031/3/10	千円 1,309,577	25 物価連動国債 0.2% 2030/3/10	千円 547,772
27 物価連動国債 0.005% 2032/3/10	976,783	21 物価連動国債 0.1% 2026/3/10	108,267
24 物価連動国債 0.1% 2029/3/10	435,794		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。  
(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内(邦貨建) 公社債(種類別)

作成期	当		期				
	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	組入比率	
区分	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	9,000,000	9,767,564	98.5	-	98.5	-	-

(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)

区分	銘柄	年利率	当		期	
			額面金額	評価額	償還年月日	
		%	千円	千円		
国債証券	23 物価連動国債	0.1000	2,000,000	2,185,090	2028/03/10	
	24 物価連動国債	0.1000	3,400,000	3,703,295	2029/03/10	
	26 物価連動国債	0.0050	2,700,000	2,925,414	2031/03/10	
	27 物価連動国債	0.0050	900,000	953,764	2032/03/10	
合計	銘柄数 金額	4銘柄	9,000,000	9,767,564		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年3月10日現在

項目	当		期	
	評価額	比率	評価額	比率
	千円	%	千円	%
公社債	9,767,564	98.4		
コール・ローン等、その他	159,157	1.6		
投資信託財産総額	9,926,722	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3月10日現在

項目	当	期	末
(A) 資産	9,926,722,419円		
コール・ローン等	159,157,778		
公社債(評価額)	9,767,564,641		
(B) 負債	10,100,853		
未払解約金	10,100,853		
(C) 純資産総額(A-B)	9,916,621,566		
元本	7,817,955,184		
次期繰越損益金	2,098,666,382		
(D) 受益権総口数	7,817,955,184口		
1万口当り基準価額(C/D)	12,684円		

\*期首における元本額は6,177,914,689円、当作成期間中における追加設定元本額は2,748,227,223円、同解約元本額は1,108,186,728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:  
日本物価連動国債ファンド 6,369,923,817円  
DCダイワ物価連動国債ファンド 1,448,031,367円  
\*当期末の計算口数当りの純資産額は12,684円です。

■損益の状況

当期 自2022年3月11日 至2023年3月10日

項目	当	期
(A) 配当等収益	5,607,751円	
受取利息	5,711,556	
支払利息	△ 103,805	
(B) 有価証券売買損益	83,732,413	
売買益	117,084,356	
売買損	△ 33,351,943	
(C) 当期損益金(A+B)	89,340,164	
(D) 前期繰越損益金	1,559,027,930	
(E) 解約差損益金	△ 290,770,090	
(F) 追加信託差損益金	741,068,378	
(G) 合計(C+D+E+F)	2,098,666,382	
次期繰越損益金(G)	2,098,666,382	

(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物価連動国債インデックス」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。