

# 日本物価連動国債ファンド

## 運用報告書（全体版） 第22期

（決算日 2024年9月10日）

（作成対象期間 2024年3月12日～2024年9月10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と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

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		
信託期間	2013年9月5日～2050年9月9日		
運用方針	安定した収益の確保と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	イ、ダイワ物価連動国債マザーファンドの受益証券 ロ、わが国の物価連動国債	
	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	
	ベビーファンドの実質株式組入上限比率	純資産総額の	
	マザーファンドの株式組入上限比率	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、経費控除後の配当等収益等の中から分配することをめざします。ただし、基準価額の水準等を勘案し、売買益等も含めて分配を行なうことがあります。なお、分配対象額が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

## 最近5期の運用実績

決算期	基準価額			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	(参考指数)	期中 騰落率			
18期末(2022年9月12日)	円 10,156	円 20	% 1.4	10,535	% 1.6	% 96.9	% -	百万円 6,948
19期末(2023年3月10日)	10,092	10	△0.5	10,643	1.0	98.2	-	8,103
20期末(2023年9月11日)	10,338	10	2.5	10,829	1.7	99.4	-	7,196
21期末(2024年3月11日)	10,436	10	1.0	10,897	0.6	97.0	-	7,221
22期末(2024年9月10日)	10,583	10	1.5	11,030	1.2	94.9	-	8,872

(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。

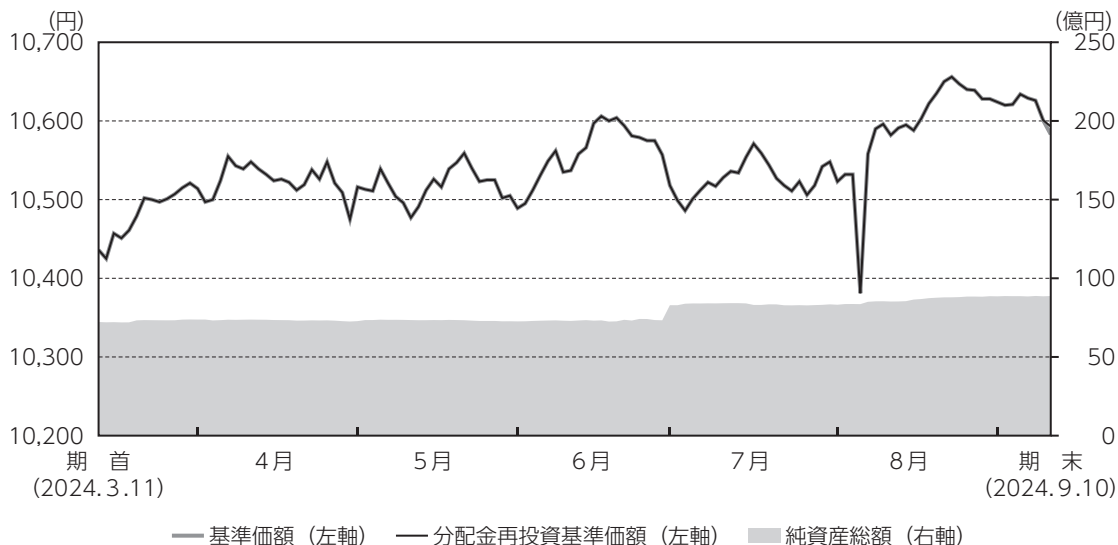
(注6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。

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。

#### ■ 基準価額・騰落率

期首：10,436円

期末：10,583円（分配金10円）

騰落率：1.5%（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。

日本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 (参考指数)		公 社 債 組 入 比 率	債 先 物 比 券 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首) 2024年 3月11日	円 10,436	% -	10,897	% -	% 97.0	% -
3月末	10,514	0.7	10,968	0.6	96.9	-
4月末	10,516	0.8	10,963	0.6	97.5	-
5月末	10,489	0.5	10,946	0.4	98.5	-
6月末	10,518	0.8	10,975	0.7	97.9	-
7月末	10,523	0.8	10,973	0.7	97.7	-
8月末	10,624	1.8	11,058	1.5	95.5	-
(期末) 2024年 9月10日	10,593	1.5	11,030	1.2	94.9	-

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

## 投資環境について

(2024.3.12~2024.9.10)

### ■国内物価連動国債市況

国内物価連動国債の価格は上昇しました。

国内債券市場では、当作成期首より、日銀のマイナス金利政策解除と長短金利操作の撤廃、追加金融引き締め観測の高まりを背景に、金利は上昇（債券価格は下落）しました。2024年7月に日銀は追加利上げを決定しましたが、当作成期末にかけては、米国金利の低下（債券価格は上昇）や金融市場の不安定化を受けて、国内金利は低下しました。

また、賃金の上昇などを背景に、市場が予想する将来の物価上昇率は上昇しました。

## 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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長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

(2024.3.12~2024.9.10)

### ■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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

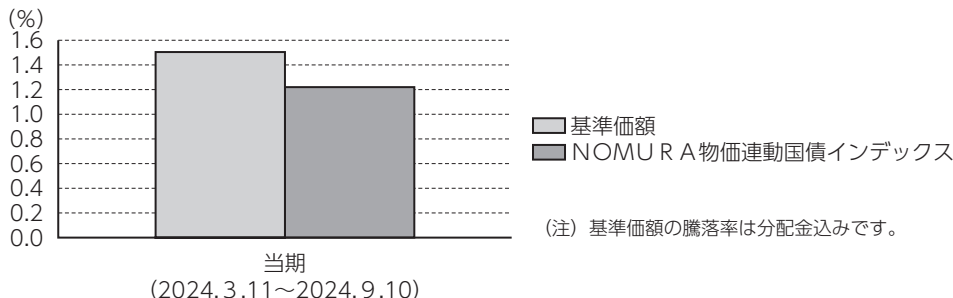
### ■ダイワ物価連動国債マザーファンド

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。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



## 分配金について

当作成期の1万口当り分配金(税込み)は下記「分配原資の内訳(1万口当り)」の「当期分配金(税込み)」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程(1万口当り)」をご参照ください。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

### 分配原資の内訳(1万口当り)

項目	当期	
	2024年3月12日 ～2024年9月10日	
<b>当期分配金(税込み)</b>	<b>(円)</b>	<b>10</b>
対基準価額比率	(%)	0.09
当期の収益	(円)	10
当期の収益以外	(円)	-
翌期繰越分配対象額	(円)	582

(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。

### 収益分配金の計算過程(1万口当り)

項目	当	期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓	2.58円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	✓	120.25
(c) 収益調整金		316.05
(d) 分配準備積立金		153.77
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		592.67
(f) 分配金		10.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		582.67

(注) ✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



## 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、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長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 (2024.3.12~2024.9.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	21円	0.200%	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10,543円です。
(投 信 会 社)	(8)	(0.073)	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)	(12)	(0.110)	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)	(2)	(0.017)	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	0	0.003	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)	(0)	(0.003)	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	21	0.203	

(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。

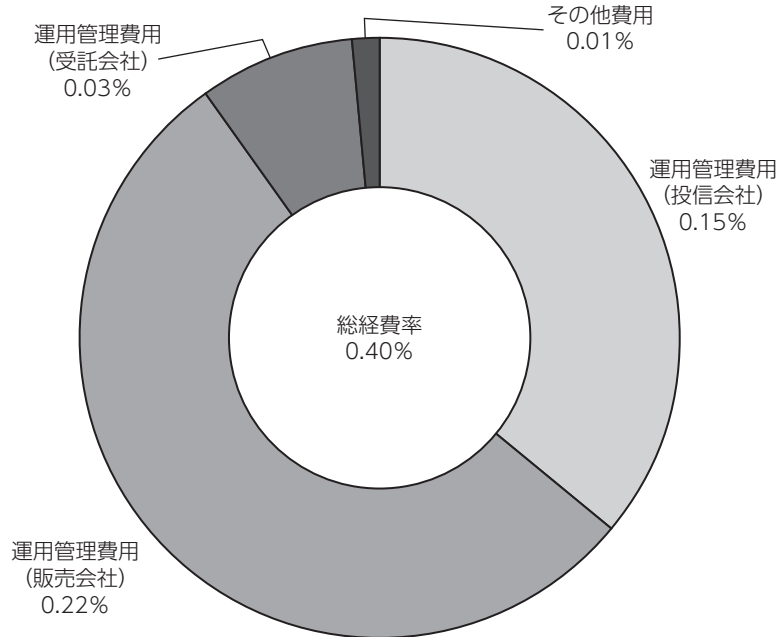
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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0.40%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。

## 日本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

(2024年3月12日から2024年9月10日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 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	1,736,485	2,314,314	598,829	799,428

(注) 単位未満は切捨て。

### ■主要な売買銘柄

当作成期中における売買銘柄はありません。

### ■利害関係人との取引状況等

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

### ■組入資産明細表

#### 親投資信託残高

種 類	期 首			当 期 末		
	□ 数	金 額	評 価 額	□ 数	金 額	評 価 額
	千口	千円	千円	千口	千円	千円
ダイワ物価連動国債マザーファンド	5,459,192	6,596,848	8,846,374			

(注) 単位未満は切捨て。

### ■投資信託財産の構成

2024年9月10日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ物価連動国債マザーファンド	8,846,374	99.4
コール・ローン等、その他	53,321	0.6
投資信託財産総額	8,899,695	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9月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	8,899,695,582円
コール・ローン等	53,321,107
ダイワ物価連動国債マザーファンド(評価額)	8,846,374,475
(B) 負債	26,774,075
未払収益分配金	8,384,386
未払解約金	2,592,635
未払信託報酬	15,581,782
その他未払費用	215,272
(C) 純資産総額(A - B)	8,872,921,507
元本	8,384,386,558
次期繰越損益金	488,534,949
(D) 受益権総口数	8,384,386,558口
1万口当り基準価額(C/D)	10,583円

\* 期首における元本額は6,919,766,153円、当作成期間中における追加設定元本額は2,487,679,897円、同解約元本額は1,023,059,492円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,583円です。

## ■損益の状況

当期 自2024年3月12日 至2024年9月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	21,592円
受取利息	21,636
支払利息	△ 44
(B) 有価証券売買損益	118,766,112
売買益	127,605,810
売買損	△ 8,839,698
(C) 信託報酬等	△ 15,797,054
(D) 当期損益金(A + B + C)	102,990,650
(E) 前期繰越損益金	128,931,926
(F) 追加信託差損益金	264,996,759
(配当等相当額)	( 151,610,390)
(売買損益相当額)	( 113,386,369)
(G) 合計(D + E + F)	496,919,335
(H) 収益分配金	△ 8,384,386
次期繰越損益金(G + H)	488,534,949
追加信託差損益金	264,996,759
(配当等相当額)	( 151,610,390)
(売買損益相当額)	( 113,386,369)
分配準備積立金	223,538,190

(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	2,165,823円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	100,824,827
(c) 収益調整金	264,996,759
(d) 分配準備積立金	128,931,926
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	496,919,335
(f) 分配金	8,384,386
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	488,534,949
(h) 受益権総口数	8,384,386,558口

## 収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 ( 税 込 み )

10円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
- ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

## 《お知らせ》

## ■信託報酬率の引き下げについて

2024年6月5日付で、信託報酬を年率0.59%以内から年率0.54%以内に引き下げました。

# 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（日本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（2024年3月11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（2024年9月10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

(2024年3月12日から2024年9月10日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
28 物価連動国債 0.005% 2033/3/10		千円 1,193,236	26 物価連動国債 0.005% 2031/3/10		千円 115,117
29 物価連動国債 0.005% 2034/3/10		318,271			

(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、2024年9月10日現在におけるダイワ物価連動国債マザーファンド（8,376,641千円）の内容です。

### (1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2024年9月10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 9,400,000	千円 10,690,337	% 95.2	% -	% 40.3	% 54.9	% -

(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）

2024年9月10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 2,285,742	2028/03/10
	24 物価連動国債		0.1000	3,400,000	3,882,927	2029/03/10
	26 物価連動国債		0.0050	1,800,000	2,093,165	2031/03/10
	27 物価連動国債		0.0050	800,000	914,144	2032/03/10
	28 物価連動国債		0.0050	1,100,000	1,197,187	2033/03/10
	29 物価連動国債		0.0050	300,000	317,169	2034/03/10
合 計	銘 柄 数	6銘柄		9,400,000	10,690,337	
	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19期 (決算日 2024年3月11日)

(作成対象期間 2023年3月11日～2024年3月11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。

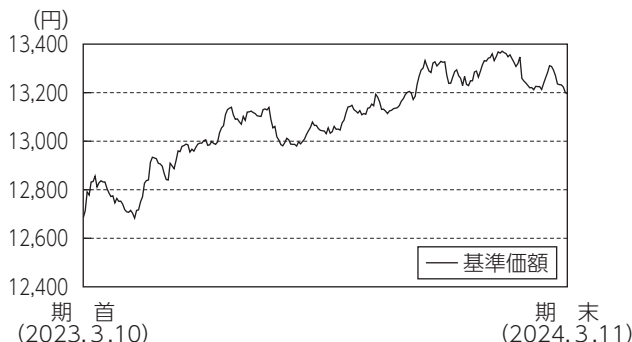
運用方針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の物価連動国債を中心とする国債
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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 (参考指数)		公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率 %	%	騰落率 %	%	%
(期首)2023年3月10日	12,684	-	12,061	-	98.5	-
3月末	12,772	0.7	12,107	0.4	97.6	-
4月末	12,913	1.8	12,140	0.7	99.3	-
5月末	12,955	2.1	12,210	1.2	98.7	-
6月末	13,108	3.3	12,314	2.1	98.7	-
7月末	13,055	2.9	12,296	1.9	98.8	-
8月末	13,065	3.0	12,287	1.9	99.1	-
9月末	13,124	3.5	12,353	2.4	99.1	-
10月末	13,138	3.6	12,373	2.6	98.6	-
11月末	13,310	4.9	12,515	3.8	99.5	-
12月末	13,264	4.6	12,474	3.4	98.3	-
2024年1月末	13,308	4.9	12,487	3.5	97.1	-
2月末	13,293	4.8	12,438	3.1	97.2	-
(期末)2024年3月11日	13,196	4.0	12,349	2.4	97.2	-

(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：12,684円 期末：13,196円 騰落率：4.0%

【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

国内物価連動国債の価格は上昇しました。

国内物価連動国債市況は、当作成期首より、欧米の金融システム不安を背景に金利は低下(債券価格は上昇)しましたが、その後は当局の迅速な対応が評価されたことなどから、金利は上昇(債券価格は下落)に転じました。2023年7月以降も、米国金利の上昇や日銀が長短金利操作の運用の柔軟化を決定したことを受けて国内金利は上昇基調となりましたが、その後は米国金利が低下したことから、国内金利も低下に転じました。当作成期末にかけては、日銀の金融政策正常化観測を背景に、金利は上昇しました。

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

(2023年3月11日から2024年3月11日まで)

国	買付額	売付額
国内	千円	千円
国債証券	-	1,011,543 (-)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) (-)内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公社債

(2023年3月11日から2024年3月11日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
		26 物価連動国債 0.005% 2031/3/10	899,237
		27 物価連動国債 0.005% 2032/3/10	112,306

(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			うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率		
	区分	額面金額	評価額	組入比率	5年以上	2年以上		2年未満		
		千円	千円	%	%	%	%	%	%	%
国債証券		8,100,000	9,132,895	97.2		32.6	64.6			-

(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)

区分	銘柄	当		期		償還年月日
		額面金額	評価額	額面金額	評価額	
国債証券	23 物価連動国債	0.1000	2,000,000	2,252,817	2028/03/10	
	24 物価連動国債	0.1000	3,400,000	3,817,921	2029/03/10	
	26 物価連動国債	0.0050	1,900,000	2,165,417	2031/03/10	
	27 物価連動国債	0.0050	800,000	896,739	2032/03/10	
合計	銘柄数	4銘柄				
	金額		8,100,000	9,132,895		

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2024年3月11日現在

項目	当		期	
	評価額	比率	評価額	比率
公社債	千円	%	千円	%
	9,132,895	97.2		
コール・ローン等、その他	266,887	2.8		
投資信託財産総額	9,399,782	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3月11日現在

項目	当	期	末
(A) 資産	9,399,782,511円		
コール・ローン等	266,870,764		
公社債(評価額)	9,132,895,468		
未収利息	16,279		
(B) 負債	4,047,294		
未払解約金	4,047,294		
(C) 純資産総額(A-B)	9,395,735,217		
元本	7,120,253,671		
次期繰越損益金	2,275,481,546		
(D) 受益権総口数	7,120,253,671口		
1万口当り基準価額(C/D)	13,196円		

\* 期首における元本額は7,817,955,184円、当作成期間中における追加設定元本額は1,265,707,968円、同解約元本額は1,963,409,481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 5,459,192,323円  
    DCダイワ物価連動国債ファンド 1,661,061,348円  
\* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,196円です。

■損益の状況

当期 自2023年3月11日 至2024年3月11日

項目	当	期
(A) 配当等収益	5,912,575円	
受取利息	5,943,655	
支払利息	△ 31,080	
(B) 有価証券売買損益	376,874,386	
売買益	376,874,386	
(C) 当期損益金(A+B)	382,786,961	
(D) 前期繰越損益金	2,098,666,382	
(E) 解約差損益金	△ 598,717,338	
(F) 追加信託差損益金	392,745,541	
(G) 合計(C+D+E+F)	2,275,481,546	
次期繰越損益金(G)	2,275,481,546	

(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。