★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／内外／資産複合		
信託期間	無期限（設定日：2008年２月28日）		
運用方針	信託財産の着実な成長と安定した収益の確保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	下記の各マザーファンドの受益証券	
	トピックス・インデックス・マザーファンド	東京証券取引所第一部上場株式（上場予定を含みます。）	
	外国株式インデックスマザーファンド	外国の株式（預託証書を含みます。）	
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	わが国の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券	
	ダイワ・グローバルREITインデックス・マザーファンド	海外の金融商品取引所上場（上場予定を含みます。）および店頭登録（登録予定を含みます。）の不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券	
	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。）	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	わが国の公社債等（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。）	
	外国債券インデックスマザーファンド	外国の公社債	
組入制限	株式組入上限比率		
	トピックス・インデックス・マザーファンド	無制限	
	外国株式インデックスマザーファンド		
	ダイワ日本債券インデックスマザーファンド（ＢＰＩ）	純資産総額の10%以下	
	ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド		
	外国債券インデックスマザーファンド	純資産総額の30%以下	
	投資信託証券組入上限比率		
	ダイワＪ－ＲＥＩＴマザーファンド	無制限	
	ダイワ・グローバルＲＥＩＴインデックス・マザーファンド		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益とし、原則として、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、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。		

DCダイワ・ターゲットイヤー2020

運用報告書（全体版）
第14期

（決算日　2021年12月20日）

（作成対象期間　2020年12月19日～2021年12月20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、内外の株式、債券、リート（ＲＥＩＴ）および短期金融資産に投資し、中長期的に安定した信託財産の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/

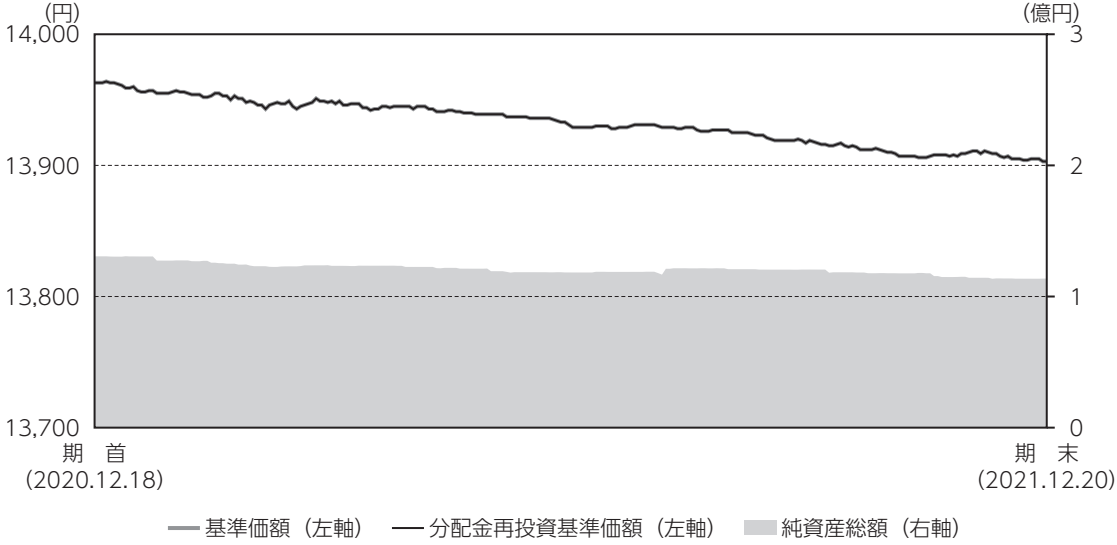
最近５期の運用実績

決算期	基準価額			株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	債券先物比率	投資信託受益証券組入比率	投資信託証券組入比率	不動産投信指数先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込み分配金	期中騰落率								
	円	円	%	%	%	%	%	%	%	%	百万円
10期末(2017年12月18日)	13,290	0	4.5	19.5	0.2	69.2	－	0.0	10.1	0.1	159
11期末(2018年12月18日)	13,049	0	△1.8	16.8	0.2	72.0	－	0.0	10.0	0.1	143
12期末(2019年12月18日)	13,829	0	6.0	16.7	0.3	72.0	－	－	9.7	0.2	135
13期末(2020年12月18日)	13,963	0	1.0	－	－	5.1	－	－	－	－	130
14期末(2021年12月20日)	13,903	0	△0.4	－	－	98.4	－	－	－	－	113

（注１）基準価額の騰落率は分配金込み。
（注２）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３）先物比率は買建比率－売建比率です。
（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）当ファンドは、ファンドの運用方針に対して適切な比較指数がないため、ベンチマークおよび参考指数を記載しておりません。

運用経過

基準価額等の推移について



＊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。

■基準価額・騰落率

期　首：13,963円
期　末：13,903円（分配金0円）
騰落率：△0.4%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

国内短期債券に投資した結果、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。

ＤＣダイワ・ターゲットイヤー2020

年　　月　　日	基準価額		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率		
	円	%	%	%
（期首）2020年12月18日	13,963	－	5.1	－
12月末	13,959	△0.0	95.1	－
2021年１月末	13,954	△0.1	98.0	－
２月末	13,946	△0.1	96.7	－
３月末	13,947	△0.1	96.3	－
４月末	13,941	△0.2	99.1	－
５月末	13,937	△0.2	98.0	－
６月末	13,930	△0.2	97.8	－
７月末	13,929	△0.2	98.4	－
８月末	13,923	△0.3	97.7	－
９月末	13,915	△0.3	98.3	－
10月末	13,907	△0.4	98.3	－
11月末	13,909	△0.4	98.2	－
（期末）2021年12月20日	13,903	△0.4	98.4	－

（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 (2020.12.19～2021.12.20)

■国内短期債券市況

国内短期債券市場では、短期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

国内短期金利は、当作成期首より、日銀が金融政策を変更するとの思惑から上昇する場面もありましたが、政策の大枠に変更がなかったこともあり、低下しました。その後はマイナス圏でレンジ内の推移が続き、2021年９月以降は、商品市況の上昇などによる世界的なインフレ懸念を受けた先進各国の金利の上昇に連動して、国内短期金利も上昇しました。当作成期末にかけては、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券および短期金融資産への投資を通じて、リスクを抑えた運用を行ってまいります。

■ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

今後も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います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、ファンドの資金流出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、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

ポートフォリオについて (2020.12.19～2021.12.20)

■当ファンド

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券および短期金融資産への投資を通じて、リスクを抑えた運用を行いました。

■ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

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、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの残存年限構成やデュレーションなどをベンチマークに近づけることにより、連動性を維持しました。

＊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
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期指数

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および参考指数を設けておりません。

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（１万口当り）

項目			当期 2020年12月19日 ～2021年12月20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）	―
翌期繰越分配可能額		（円）	5,514

（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。

※なお、投資信託約款上の分配対象額は、上記分配可能額のうち経費控除後の配当等収益です。

今後の運用方針

■当ファンド

「ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド」の受益証券および短期金融資産への投資を通じて、リスクを抑えた運用を行ってまいります。

■ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

今後も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います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、ファンドの資金流出入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変化に対しては、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を見送ることもあります。

１万口当りの費用の明細

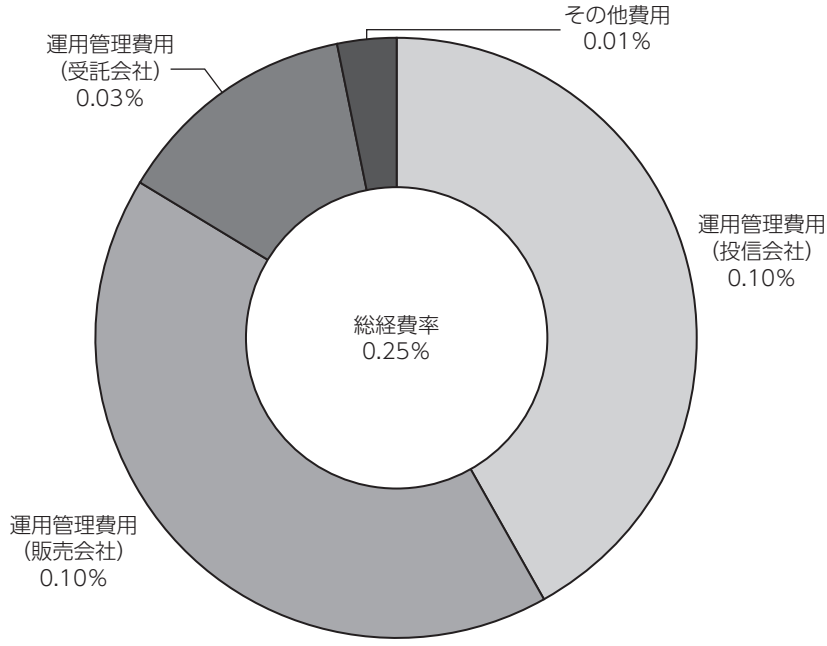
項　　目	当期 (2020.12.19～2021.12.20)		項　目　の　概　要
	金　額	比　率	
信　託　報　酬	34円	0.243%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 **当作成期中の平均基準価額は13,932円です。**
（投　信　会　社）	(15)	(0.105)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
（販　売　会　社）	(15)	(0.105)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
（受　託　会　社）	(5)	(0.033)	受託会社分は、運用財産の管理、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	0.008	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)	(0.008)	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
（そ　　の　　他）	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合　　計	35	0.251	

（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0.25％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

（2020年12月19日から2021年12月20日まで）

	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	128,130	134,156	26,101	27,307

（注）単位未満は切捨て。

■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	
	口数	口数	評価額
	千口	千口	千円
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	6,513	108,542	113,448

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	113,448	99.7
コール・ローン等、その他	372	0.3
投資信託財産総額	113,821	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

2021年12月20日現在

項目	当期末
(A) 資産	**113,821,000円**
コール・ローン等	372,736
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド(評価額)	113,448,264
(B) 負債	**149,794**
未払信託報酬	144,959
その他未払費用	4,835
(C) 純資産総額(A－B)	**113,671,206**
元本	81,760,592
次期繰越損益金	31,910,614
(D) 受益権総口数	**81,760,592口**
1万口当り基準価額(C／D)	**13,903円**

＊期首における元本額は93,557,729円、当作成期間中における追加設定元本額は8,360,525円、同解約元本額は20,157,662円です。
＊当期末の計算口数当りの純資産額は13,903円です。

■損益の状況

当期　自2020年12月19日　至2021年12月20日

項目	当期
(A) 有価証券売買損益	**△ 165,182円**
売買益	22,555
売買損	△ 187,737
(B) 信託報酬等	**△ 304,339**
(C) 当期損益金(A＋B)	**△ 469,521**
(D) 前期繰越損益金	**15,811,730**
(E) 追加信託差損益金	**16,568,405**
(配当等相当額)	(29,277,352)
(売買損益相当額)	(△12,708,947)
(F) 合計(C＋D＋E)	**31,910,614**
次期繰越損益金(F)	**31,910,614**
追加信託差損益金	16,568,405
(配当等相当額)	(29,277,352)
(売買損益相当額)	(△12,708,947)
分配準備積立金	15,811,740
繰越損益金	△ 469,531

（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	29,277,352
(d) 分配準備積立金	15,811,740
(e) 当期分配可能額(a＋b＋c＋d)	45,089,092
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e－f)	45,089,092
(h) 受益権総口数	81,760,592口

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

運用報告書　第15期（決算日　2021年12月20日）

（作成対象期間　2020年12月19日～2021年12月20日）

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

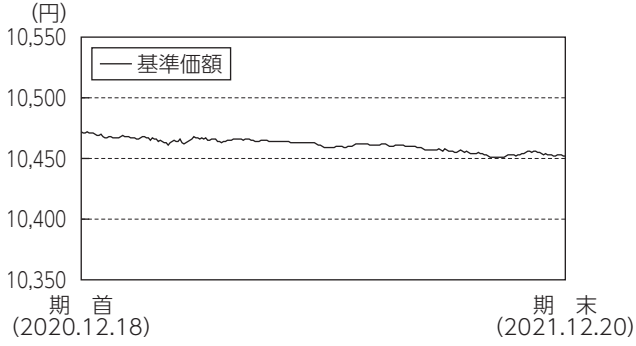
★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ総合短期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	わが国の公社債等（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総合短期指数		公社債組入比率	債券先物比率
		騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
	円	%		%	%	%
(期首)2020年12月18日	10,472	−	10,533	−	97.2	−
12月末	10,469	△0.0	10,530	△0.0	95.3	−
2021年1月末	10,467	△0.0	10,529	△0.0	98.2	−
2月末	10,463	△0.1	10,526	△0.1	96.9	−
3月末	10,466	△0.1	10,530	△0.0	96.5	−
4月末	10,464	△0.1	10,529	△0.0	99.3	−
5月末	10,463	△0.1	10,528	△0.0	98.2	−
6月末	10,460	△0.1	10,525	△0.1	98.0	−
7月末	10,461	△0.1	10,527	△0.1	98.6	−
8月末	10,459	△0.1	10,526	△0.1	97.9	−
9月末	10,455	△0.2	10,522	△0.1	98.5	−
10月末	10,451	△0.2	10,520	△0.1	98.5	−
11月末	10,455	△0.2	10,523	△0.1	98.4	−
(期末)2021年12月20日	10,452	△0.2	10,521	△0.1	98.6	−

(注1) 騰落率は期首比。
(注2) NOMURA−BPI総合短期指数は、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。NOMURA−BPIは、野村證券株式会社が算出する、日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表すために開発された投資収益指数で、そのうち残存期間1−3年の部分の投資収益を表したものが総合短期指数です。
NOMURA−BPIは、野村證券株式会社が公表している指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し、一切責任を負うものではありません。
(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：10,472円　期末：10,452円　騰落率：△0.2%

【基準価額の主な変動要因】

短期金利の利回りがマイナスで推移したことから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期債券市況

国内短期債券市場では、短期金利は上昇（債券価格は下落）しました。

国内短期金利は、当作成期首より、日銀が金融政策を変更するとの思惑から上昇する場面もありましたが、政策の大枠に変更がなかったこともあり、低下しました。その後はマイナス圏でレンジ内の推移が続き、2021年9月以降は、商品市況の上昇などによる世界的なインフレ懸念を受けた先進各国の金利の上昇に連動して、国内短期金利も上昇しました。足元では、新型コロナウイルスの新たな変異株への懸念が高まったことなどから、金利は低下しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

今後も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います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、ファンドの資金流出入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変化に対しては、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を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、公社債組入比率を高位に保つと同時に、ポートフォリオの残存年限構成やデュレーションなどをベンチマークに近づけることにより、連動性を維持しました。

◆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△0.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.2%となりました。

当ファンドとベンチマークとの騰落率の差は△0.1%程度となり、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。

＊ベンチマークはNOMURA−BPI総合短期指数です。

《今後の運用方針》

今後も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います。残存年限別構成やデュレーションなどを管理するとともに、ファンドの資金流出入や毎月末に行われるベンチマークのユニバース変化に対しては、売買コストに配慮しつつ、ポートフォリオのリバランスを行います。なお、ベンチマークに含まれる債券のうち、格付けの低い銘柄については、信用リスク管理や流動性確保の観点から投資を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	0
(その他)	(0)
合計	0

(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

（2020年12月19日から2021年12月20日まで）

		買　付　額	売　付　額
		千円	千円
国内	国債証券	435,644	117,270 （　　－）

（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

（2020年12月19日から2021年12月20日まで）

当期			
買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
335 10年国債 0.5% 2024/9/20	53,987	134 5年国債 0.1% 2022/12/20	47,110
334 10年国債 0.6% 2024/6/20	53,153	416 2年国債 0.1% 2022/9/1	40,092
430 2年国債 0.005% 2023/11/1	47,121	413 2年国債 0.1% 2022/6/1	30,067
134 5年国債 0.1% 2022/12/20	40,594		
136 5年国債 0.1% 2023/6/20	40,235		
135 5年国債 0.1% 2023/3/20	40,216		
416 2年国債 0.1% 2022/9/1	40,174		
333 10年国債 0.6% 2024/3/20	35,754		
137 5年国債 0.1% 2023/9/20	35,231		
413 2年国債 0.1% 2022/6/1	30,103		

（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、新株予約権付社債券（転換社債券）を除く）

作成期	当期末						
区分	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
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	321,000	323,942	98.6	－	－	44.9	53.7

（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）

当期末					
区分	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	135 5年国債	0.1000	40,000	40,106	2023/03/20
	136 5年国債	0.1000	40,000	40,131	2023/06/20
	427 2年国債	0.0050	14,000	14,028	2023/08/01
	137 5年国債	0.1000	35,000	35,134	2023/09/20
	430 2年国債	0.0050	47,000	47,109	2023/11/01
	138 5年国債	0.1000	5,000	5,022	2023/12/20
	333 10年国債	0.6000	35,000	35,566	2024/03/20
	334 10年国債	0.6000	52,000	52,937	2024/06/20
	335 10年国債	0.5000	53,000	53,905	2024/09/20
合計 銘柄数	9銘柄				
合計 金額			321,000	323,942	

（注）単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年12月20日現在

項目	当期末	
	評価額	比率
	千円	%
公社債	323,942	98.6
コール・ローン等、その他	4,636	1.4
投資信託財産総額	328,579	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

2021年12月20日現在

項目	当期末
(A) 資産	**328,579,396円**
コール・ローン等	4,499,641
公社債(評価額)	323,942,760
未収利息	122,984
前払費用	14,011
(B) 負債	**－**
(C) 純資産総額(A－B)	**328,579,396**
元本	314,356,530
次期繰越損益金	14,222,866
(D) 受益権総口数	**314,356,530口**
1万口当り基準価額(C／D)	**10,452円**

＊期首における元本額は6,513,195円、当作成期間中における追加設定元本額は347,115,400円、同解約元本額は39,272,065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：

DCダイワ・ターゲットイヤー2050	26,486,360円
DCダイワ・ターゲットイヤー2020	108,542,159円
DCダイワ・ターゲットイヤー2030	135,752,811円
DCダイワ・ターゲットイヤー2040	43,575,200円

＊当期末の計算口数当りの純資産額は10,452円です。

■損益の状況

当期　自2020年12月19日　至2021年12月20日

項目	当期
(A) 配当等収益	**565,592円**
受取利息	567,025
支払利息	△ 1,433
(B) 有価証券売買損益	**△ 1,063,636**
売買損	△ 1,063,636
(C) その他費用	**△ 5**
(D) 当期損益金(A＋B＋C)	**△ 498,049**
(E) 前期繰越損益金	**307,250**
(F) 解約差損益金	**△ 1,813,935**
(G) 追加信託差損益金	**16,227,600**
(H) 合計(D＋E＋F＋G)	**14,222,866**
次期繰越損益金(H)	**14,222,866**

（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。