

ダイワ住宅金融支援機構債ファンド -Mr. フラット-

運用報告書（全体版） 第 1 期 (決算日 2016年 9月12日)

★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	約10年間（2016年 2月29日～2026年 3月10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	住宅金融支援機構債マザーファンドの受益証券
	住宅金融支援機構債マザーファンド	わが国の債券
マザーファンドの運用方法	①主として、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないます。 ②金利の方向性、利回り水準、格付けおよび流動性等を総合的に勘案し、ポートフォリオを構築します。 ③債券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80％程度以上に維持することを基本とします。	
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、経費控除後の配当等収益等を中心に分配することをめざします。ただし、基準価額の水準等によっては、売買益（評価益を含みます。）等を中心に分配する場合があります。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。	

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行ないます。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

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。

さて、「ダイワ住宅金融支援機構債ファンド -Mr. フラット-」は、このたび、第1期の決算を行ないました。

ここに、期中の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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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）

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

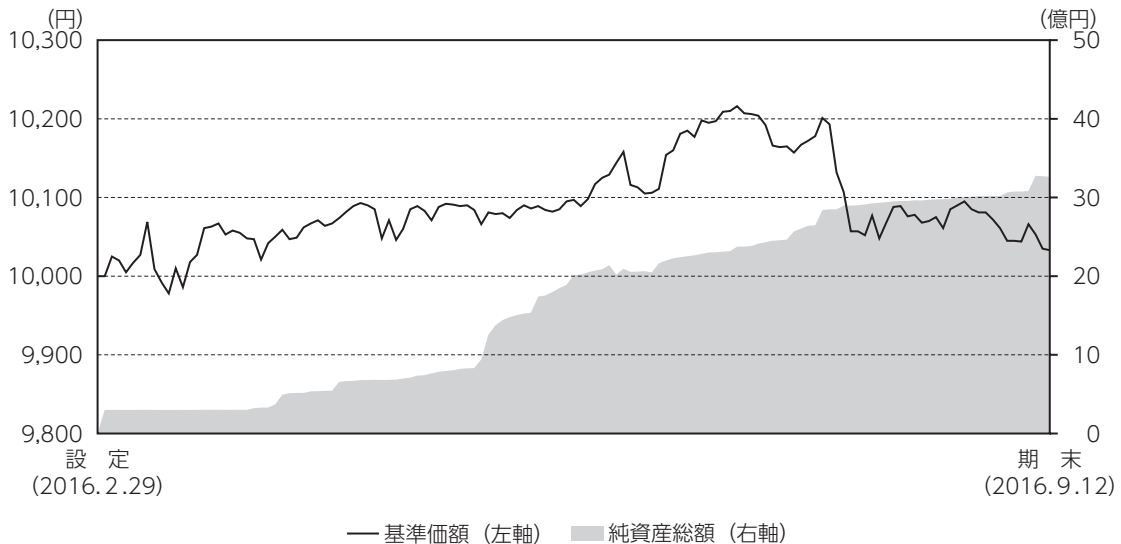
設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) RMB S 指数		公 社 債 組入比率	債券先物率 比	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			
1 期末(2016年 9月12日)	円 10,013	円 20	% 0.3	9,873	% △1.3	% 97.8	% －	百万円 3,262

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) RMB S 指数 (参考指数) は、ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) RMB S 指数の原データに基づき、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) RMB S 指数は、株式会社大和総研が公表している日本の住宅ローン証券化商品のパフォーマンス・インデックスです。
- (注 3) 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 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



（注）期末の基準価額は分配金込みです。

■基準価額・騰落率

設定時：10,000円

期 末：10,013円（分配金20円）

騰落率：0.3%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

主として「住宅金融支援機構債マザーファンド」の受益証券を通じて、住宅金融支援機構が発行する債券に投資した結果、債券の利息収入により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。

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス (D B I) R M B S 指 数		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(設定) 2016年 2月29日	円 10,000	% －	(2/26) 10,000	% －	% －	% －
2月末	10,000	0.0	10,002	0.0	98.8	－
3月末	10,021	0.2	9,992	△0.1	89.7	－
4月末	10,060	0.6	10,011	0.1	95.4	－
5月末	10,089	0.9	10,029	0.3	96.2	－
6月末	10,177	1.8	10,079	0.8	96.3	－
7月末	10,132	1.3	10,035	0.4	96.8	－
8月末	10,072	0.7	9,891	△1.1	96.9	－
(期末) 2016年 9月12日	10,033	0.3	9,873	△1.3	97.8	－

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は設定比。

投資環境について

○国内債券市場

国内長期金利は、設定時より、日銀の追加金融緩和観測や世界的なリスク回避の動きから低下傾向が続きました。しかし、2016年7月末の日銀の金融緩和の強化が市場の期待を下回る内容であったことから金利は上昇に転じ、長期金利はファンド設定時と比べて小幅に上昇しました。

住宅金融支援機構が発行する債券は、国債の値動きに連れる展開となりました。

ポートフォリオについて

○当ファンド

主として「住宅金融支援機構債マザーファンド」の受益証券を通じて、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないました。

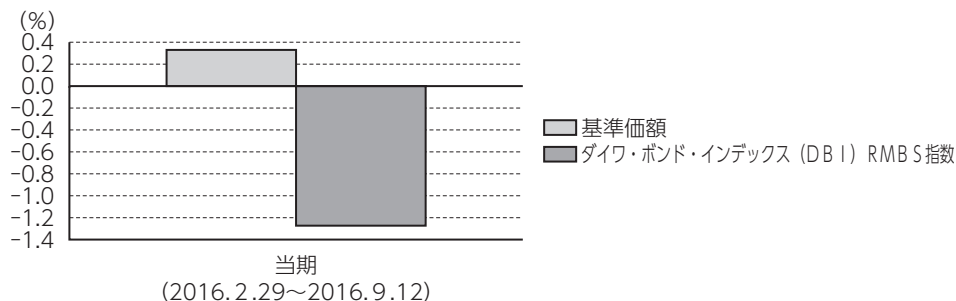
○住宅金融支援機構債マザーファンド

主として、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないました。

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

当期の1万口当り分配金（税込み）は20円といたしました。
収益分配金の決定根拠は下記の「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
		2016年2月29日 ～2016年9月12日
当期分配金（税込み）	(円)	20
対基準価額比率	(%)	0.20
当期の収益	(円)	9
当期の収益以外	(円)	11
翌期繰越分配対象額	(円)	12

- (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。

■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	9.47円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0.00
(c) 収益調整金	23.20
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	32.68
(f) 分配金	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	12.68

(注) 下線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「住宅金融支援機構債マザーファンド」の受益証券を通じて、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないます。

○住宅金融支援機構債マザーファンド

主として、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないます。金利の方向性、利回り水準、格付けおよび流動性等を総合的に勘案し、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		項 目 の 概 要
	(2016.2.29～2016.9.12)		
	金 額	比 率	
信託報酬	11円	0.104%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は10,090円です。
(投信会社)	(4)	(0.044)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、目 論見書・運用報告書の作成等の対価
(販売会社)	(4)	(0.044)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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
(受託銀行)	(2)	(0.017)	受託銀行分は、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＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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＝期中の有価証券取引税／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＝期中のその他費用／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
(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	11	0.107	

(注1) 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。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている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。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■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

(2016年2月29日から2016年9月12日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
住宅金融支援機構債 マザーファンド	3,417,608	3,454,300	173,218	175,642

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当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期中の利害関係人との取引状況

(2016年2月29日から2016年9月12日まで)

決 算 期		期				
区 分	買付額等	うち利害 関係人との 取引状況	B/A	売付額等	うち利害 関係人との 取引状況	D/C
	A			C		
公社債	百万円 3,278	百万円 1,702	% 51.9	百万円 —	百万円 —	% —
コール・ローン	16,145	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合100.0%

※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) 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い比率

当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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■**投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況**

設定時保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
300	－	300	－	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

親投資信託殘高

種 類	当 期 末	
	□ 数	評 価 額
住宅金融支援機構債マザーファンド	千口 3,244,390	千円 3,261,585

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
住宅金融支援機構債マザーファンド	千円 3,261,585	% 99.6
コール・ローン等、その他	12,464	0.4
投資信託財産総額	3,274,050	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

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,274,050,215円
コール・ローン等	12,464,618
住宅金融支援機構債マザーファンド(評価額)	3,261,585,597
(B) 負債	11,309,637
未払収益分配金	6,517,214
未払解約金	3,019,800
未払信託報酬	1,724,803
その他未払費用	47,820
(C) 純資産総額(A－B)	3,262,740,578
元本	3,258,607,241
次期繰越損益金	4,133,337
(D) 受益権総口数	3,258,607,241口
1万口当り基準価額(C/D)	10,013円

* 設定時における元本額は300,000,000円、当期中における追加設定元本額は3,276,587,487円、同解約元本額は317,980,246円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は10.013円です。

■損益の状況

当期 自2016年2月29日 至2016年9月12日

項	目	當	期
(A)	配當等收益	△	2,203,190
	受取利息		72
	支払利息	△	2,275
(B)	有価証券売買損益	△	18,908,674
	売買益		1,023,814
	売買損	△	19,932,488
(C)	信託報酬等	△	1,772,629
(D)	当期損益金(A + B + C)	△	20,683,506
(E)	追加信託差損益金 (配當等相当額)		31,334,057 (1,145,663)
	(売買損益相当額)		(30,188,394)
(F)	合計(D + E)		10,650,551
(G)	収益分配金	△	6,517,214
	次期繰越損益金(F + G)		4,133,337
	追加信託差損益金 (配當等相当額)		27,749,590 (1,145,663)
	(売買損益相当額)		(26,603,927)
	分配準備積立金		156,371
	繰越損益金	△	23,772,624

(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8ページの「収益分配金の計算過程(総額)」の表をご参照ください。

■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	3,089,118円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	7,561,433
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	10,650,551
(f) 分配金	6,517,214
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	4,133,337
(h) 受益権総口数	3,258,607,241口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	20円

●＜分配金再投資コース＞をご利用の方の税引き分配金は、9月12日現在の基準価額（1万口当り10,013円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・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。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用はありません。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

住宅金融支援機構債マザーファンド

運用報告書 第1期（決算日 2016年9月12日）

（計算期間 2016年2月29日～2016年9月12日）

住宅金融支援機構債マザーファンドの第1期にかかる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	わが国の債券
運用方法	①主として、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないます。 ②金利の方向性、利回り水準、格付けおよび流動性等を総合的に勘案し、ポートフォリオを構築します。 ③債券の組入比率は、通常の状態では信託財産の純資産総額の80%程度以上に維持することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

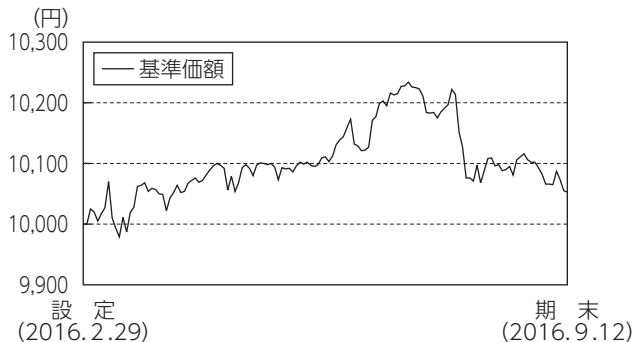
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<http://www.daiwa-am.co.jp/>

■当期中の基準価額と市況の推移



年 月 日	基 準 価 額		ダイウ・ボンド・インデックス (DBI) RMBS 指数 (参考指数)		公 社 債 組入比率	債券先物 比 率
	円	騰 落 率	(2/26)	騰 落 率		
(設定)2016年2月29日	10,000	—	10,000	—	—	—
2月末	10,000	0.0	10,002	0.0	98.9	—
3月末	10,022	0.2	9,992	△0.1	89.8	—
4月末	10,068	0.7	10,011	0.1	95.5	—
5月末	10,102	1.0	10,029	0.3	96.2	—
6月末	10,195	2.0	10,079	0.8	96.3	—
7月末	10,152	1.5	10,035	0.4	96.9	—
8月末	10,093	0.9	9,891	△1.1	97.0	—
(期末)2016年9月12日	10,053	0.5	9,873	△1.3	97.8	—

(注1) 騰落率は設定比。

(注2) ダイウ・ボンド・インデックス (DBI) RMBS 指数 (参考指数) は、ダイウ・ボンド・インデックス (DBI) RMBS 指数の原データに基づき、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和投資信託が計算したものです。ダイウ・ボンド・インデックス (DBI) RMBS 指数は、株式会社大和総研が公表している日本の住宅ローン証券化商品のパフォーマンス・インデックスです。

(注3) 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4) 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】

設定時：10,000円 期末：10,053円 騰落率：0.5%

【基準価額の主な変動要因】

主として住宅金融支援機構が発行する債券に投資した結果、債券の利息収入により基準価額は上昇しました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内長期金利は、設定日より、日銀の追加金融緩和観測や世界的なリスク回避の動きから低下傾向が続きました。しかし、2016年7月末の日銀の金融緩和の強化が市場の期待を下回る内容であったことから金利は上昇に転じ、長期金利はファンド設定時と比べて小幅に上昇しました。

住宅金融支援機構が発行する債券は、国債の値動きに連れる展開となりました。

◆ポートフォリオについて

主として、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないました。

◆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。

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

《今後の運用方針》

主として、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、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ないます。金利の方向性、利回り水準、格付けおよび流動性等を総合的に勘案し、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 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出方法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 各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

(2016年2月29日から2016年9月12日まで)

	買 付 額	売 付 額
国 内	千円	千円
特殊債券	3,278,675	— (65,545)

(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

(2016年2月29日から2016年9月12日まで)

当 期			期 間		
買	付	金 額	売	付	金 額
銘 柄			銘 柄		
		千円			千円
107 住宅機構RMBS 0.48% 2051/4/10		909,034			
108 住宅機構RMBS 0.34% 2051/5/10		698,632			
100 住宅機構RMBS 0.84% 2050/9/10		402,853			
103 住宅機構RMBS 0.86% 2050/12/10		204,042			
106 住宅機構RMBS 0.54% 2051/3/10		202,171			
105 住宅機構RMBS 0.79% 2051/12/10		201,955			
99 住宅機構RMBS 0.88% 2050/8/10		101,684			
109 住宅機構RMBS 0.36% 2051/6/10		101,257			
97 住宅機構RMBS 0.83% 2050/6/10		99,006			
92 住宅機構RMBS 0.74% 2050/1/10		97,746			

(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。

住宅金融支援機構債マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

作成期 区分	当 期			末			
	額面金額	評価額	組入比率	うちBBB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
特殊債券 (除く金融債券)	3,139,923	3,191,257	97.8	—	97.8	—	—

(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。

(2) 国内（邦貨建）公社債（銘柄別）

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	
特殊債券 (除く金融債券)	39 住宅機構RMBS	1.5200	55,555	59,249	2045/08/10
	88 住宅機構RMBS	0.9300	83,774	86,990	2049/09/10
	92 住宅機構RMBS	0.7400	88,866	91,229	2050/01/10
	95 住宅機構RMBS	0.8100	93,144	96,310	2050/04/10
	97 住宅機構RMBS	0.8300	92,978	96,027	2050/06/10
	99 住宅機構RMBS	0.8800	94,871	98,400	2050/08/10
	100 住宅機構RMBS	0.8400	379,300	392,272	2050/09/10
	103 住宅機構RMBS	0.8600	193,088	200,135	2050/12/10
	105 住宅機構RMBS	0.7900	194,900	201,019	2051/02/10
	106 住宅機構RMBS	0.5400	195,556	197,902	2051/03/10
	107 住宅機構RMBS	0.4800	882,927	889,372	2051/04/10
	108 住宅機構RMBS	0.3400	686,077	683,607	2051/05/10
	109 住宅機構RMBS	0.3600	98,887	98,738	2051/06/10
合計	銘柄数 金 額	13銘柄 -----	3,139,923	3,191,257	-----

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月12日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
	千円	%	
公社債	3,191,257	92.3	
コール・ローン等、その他	267,843	7.7	
投資信託財産総額	3,459,101	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

2016年9月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,459,101,269円
コール・ローン等	267,748,085
公社債(評価額)	3,191,257,392
未収利息	91,574
前払費用	4,218
(B) 負債	197,454,251
未払金	197,454,251
(C) 純資産総額(A－B)	3,261,647,018
元本	3,244,390,329
次期繰越損益金	17,256,689
(D) 受益権総口数	3,244,390,329口
1万口当り基準価額(C／D)	10,053円

* 設定時における元本額は299,730,000円、当期中における追加設定元本額は3,117,878,889円、同解約元本額は173,218,560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は、ダイワ住宅金融支援機構債ファンドMR、フラットー3,244,390,329円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,053円です。

■損益の状況

当期 自2016年2月29日 至2016年9月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,863,950円
受取利息	4,899,796
支払利息	△ 35,846
(B) 有価証券売買損益	△21,873,206
売買益	782,625
売買損	△22,655,831
(C) その他費用	△ 1,745
(D) 当期損益金(A + B + C)	△17,011,001
(E) 解約差損益金	△ 2,424,062
(F) 追加信託差損益金	36,691,752
(G) 合計(D + E + F)	17,256,689
次期繰越損益金(G)	17,256,689

(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。