

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 4 期 (決算日 2018年 3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4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

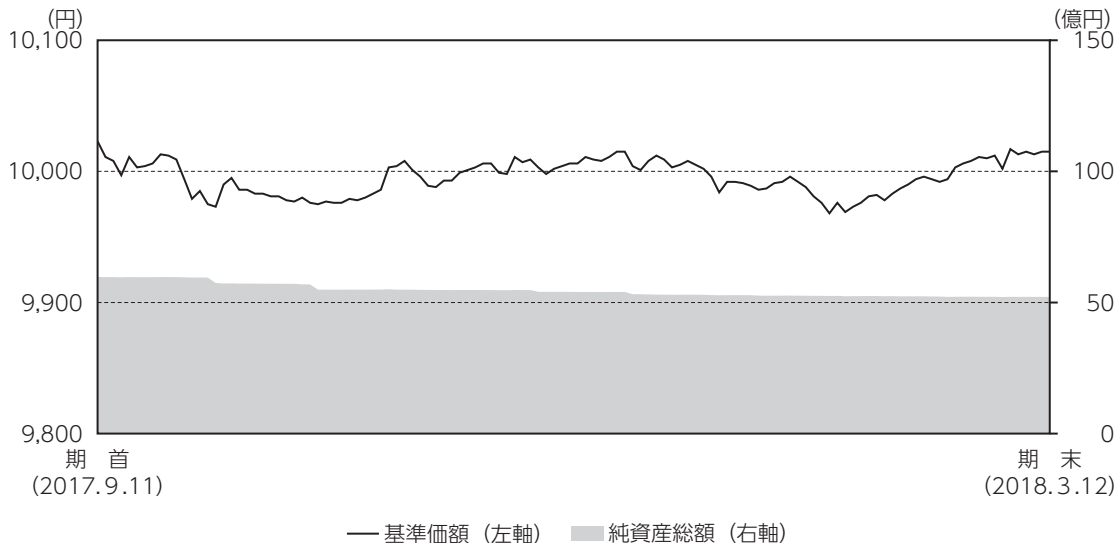
決 算 期	基 準 価 額			ダイワ・bond・インデックス (DBI) RMB S 指数		公 社 債 組入比率	債券先物 比率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 み 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
1 期末(2016年 9月12日)	円 10,013	円 20	% 0.3	9,873	% △1.3	% 97.8	% －	百万円 3,262
2 期末(2017年 3月10日)	9,941	10	△0.6	9,830	△0.4	97.1	－	6,421
3 期末(2017年 9月11日)	10,023	10	0.9	9,924	1.0	99.7	－	5,973
4 期末(2018年 3月12日)	10,005	10	△0.1	9,927	0.0	98.0	－	5,210

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) ダイワ・bond・インデックス (DBI) RMB S 指数 (参考指数) は、ダイワ・bond・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・bond・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

期首：10,023円

期末：10,005円 (分配金10円)

騰落率：△0.1% (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、債券価格の変動が限定的となったことから基準価額はおおむね横ばいとなりました。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		
(期首) 2017年 9 月11日	円 10,023	% －	9,924	% －	% 99.7	% －
9 月末	9,985	△0.4	9,892	△0.3	98.9	－
10月末	9,980	△0.4	9,896	△0.3	99.2	－
11月末	10,007	△0.2	9,919	△0.1	98.4	－
12月末	10,008	△0.1	9,918	△0.1	98.4	－
2018年 1 月末	9,976	△0.5	9,896	△0.3	98.4	－
2 月末	10,010	△0.1	9,924	0.0	98.3	－
(期末) 2018年 3 月12日	10,015	△0.1	9,927	0.0	98.0	－

(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

(2017.9.12～2018.3.12)

■国内債券市場

国内債券市場は、日銀の長短金利操作付き量的・質的金融緩和政策を背景に、長期金利はおおむね横ばいでの推移が続きました。

このような国債利回りの動きを受けて、住宅金融支援機構債（※）の利回りもおおむね横ばいでの推移が続きました。

※住宅金融支援機構債とは、住宅金融支援機構が発行するRMB S（住宅ローン担保証券）をいいます。

前期における「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。

ポートフォリオについて

(2017.9.12～2018.3.12)

■当ファンド

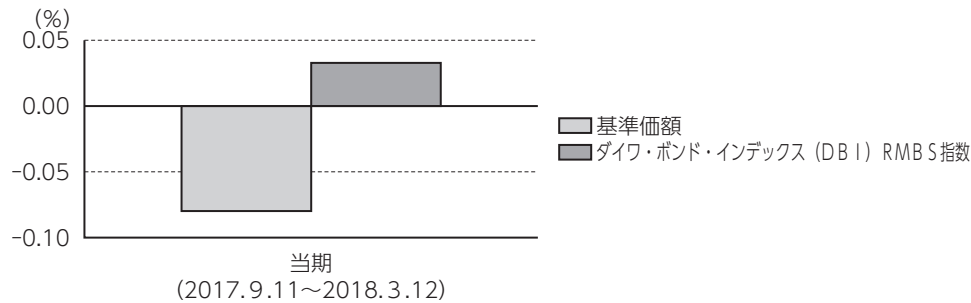
主として「住宅金融支援機構債マザーファンド」の受益証券を通じて、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないました。

■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。また、残存期間が長めの債券を中心としたポートフォリオとしました。

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10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
		2017年9月12日 ～2018年3月12日
当期分配金（税込み）	(円)	10
対基準価額比率	(%)	0.10
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)	55

- (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	12.89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	37.12
(d) 分配準備積立金	15.19
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	65.21
(f) 分配金	10.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	55.21

- (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 (2017.9.12～2018.3.12)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	10円	0.097%	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9,995円です。
(投 信 会 社)	(4)	(0.040)	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)	(0.040)	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 銀 行)	(2)	(0.016)	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
合 計	10	0.099	

(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

(2017年9月12日から2018年3月12日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
住宅金融支援機構債マザーファンド	5,538	5,587	1,096,282	1,105,148

(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

(2017年9月12日から2018年3月12日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	—	—	—	691	96	14.0
コール・ローン	9,631	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合95.0%

※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。

■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
住宅金融支援機構債マザーファンド	6,244,059	5,153,316	5,208,456

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年3月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
住宅金融支援機構債マザーファンド	5,208,456	99.7
コール・ローン等、その他	13,079	0.3
投資信託財産総額	5,221,535	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

2018年3月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,221,535,906円
コール・ローン等	13,079,139
住宅金融支援機構債マザーファンド(評価額)	5,208,456,767
(B) 負債	10,645,529
未払収益分配金	5,208,286
未払信託報酬	5,290,377
その他未払費用	146,866
(C) 純資産総額(A－B)	5,210,890,377
元本	5,208,286,679
次期繰越損益金	2,603,698
(D) 受益権総口数	5,208,286,679口
1万口当り基準価額(C/D)	10,005円

※期首における元本額は5,959,283,451円、当期中における追加設定元本額は9,049,731円、同解約元本額は760,046,503円です。

※当期末の計算口数当りの純資産額は10,005円です。

■損益の状況

当期 自2017年9月12日 至2018年3月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,478円
受取利息	48
支払利息	△ 1,526
(B) 有価証券売買損益	1,173,585
売買益	3,407,775
売買損	△ 2,234,190
(C) 信託報酬等	△ 5,437,243
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 4,265,136
(E) 前期繰越損益金	△18,239,177
(F) 追加信託差損益金	30,316,297
(配当等相当額)	(2,891,561)
(売買損益相当額)	(27,424,736)
(G) 合計(D + E + F)	7,811,984
(H) 収益分配金	△ 5,208,286
次期繰越損益金(G + H)	2,603,698
追加信託差損益金	30,316,297
(配当等相当額)	(2,891,561)
(売買損益相当額)	(27,424,736)
分配準備積立金	9,424,280
繰越損益金	△37,136,879

- (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「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	6,716,351円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	19,334,810
(d) 分配準備積立金	7,916,215
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	33,967,376
(f) 分配金	5,208,286
(g) 翌期繰越分配対象額(e − f)	28,759,090
(h) 受益権総口数	5,208,286,679口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ		
1 万 口 当 り 分 配 金		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、3月12日現在の基準価額（1万口当り10,005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4期（決算日 2018年3月12日）

（計算期間 2017年9月12日～2018年3月12日）

住宅金融支援機構債マザーファンドの第4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

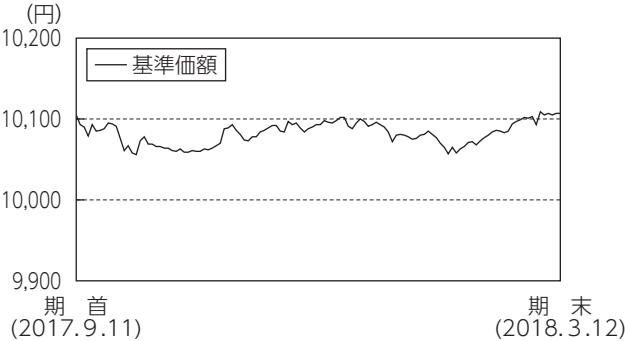
大和投資信託

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
	円	騰 落 率 %		騰 落 率 %	%	%
(期首)2017年 9月11日	10,105	—	9,924	—	94.4	—
9 月末	10,067	△0.4	9,892	△0.3	99.0	—
10 月末	10,064	△0.4	9,896	△0.3	99.2	—
11 月末	10,093	△0.1	9,919	△0.1	98.5	—
12 月末	10,096	△0.1	9,918	△0.1	98.5	—
2018年 1 月末	10,065	△0.4	9,896	△0.3	98.4	—
2 月末	10,101	△0.0	9,924	0.0	98.4	—
(期末)2018年 3月12日	10,107	0.0	9,927	0.0	98.1	—

(注1) 騰落率は期首比。
(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】
期首：10,105円 期末：10,107円 騰落率：0.0%

【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、債券価格の変動が限定的となったことから基準価額はおおむね横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内債券市況

国内債券市場は、日銀の長短金利操作付き量的・質的金融緩和政策を背景に、長期金利はおおむね横ばいでの推移が続きました。このような国債利回りの動きを受けて、住宅金融支援機構債 (※) の利回りもおおむね横ばいでの推移が続きました。
※住宅金融支援機構債とは、住宅金融支援機構が発行する RMB S (住宅ローン担保証券) をいいます。

◆前期における「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。

◆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。また、残存期間が長めの債券を中心としたポートフォリオとしました。

◆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	—
合 計	—

(注) 費用の項目および算出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。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2017年9月12日から2018年3月12日まで)

		買 付 額	売 付 額
国		千円	千円
内	特殊債券	—	691,388 (143,826)

(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) ()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

(2017年9月12日から2018年3月12日まで)

当			期		
買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
			98 住宅機構RMBS 0.9%	2050/7/10	177,239
			122 住宅機構RMBS 0.44%	2052/7/10	98,818
			118 住宅機構RMBS 0.47%	2052/3/10	97,956
			117 住宅機構RMBS 0.46%	2052/2/10	96,740
			95 住宅機構RMBS 0.81%	2050/4/10	87,692
			97 住宅機構RMBS 0.83%	2050/6/10	86,311
			39 住宅機構RMBS 1.52%	2045/8/10	46,629

(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)

区 分	当			期 末			
	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
特殊債券 (除く金融債券)	千円 5,294,052	千円 5,337,525	% 98.1	% —	% 98.1	% —	% —

(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)

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)	99 住宅機構RMBS	0.8800	83,787	86,719	2050/08/10
	100 住宅機構RMBS	0.8400	331,476	342,248	2050/09/10
	103 住宅機構RMBS	0.8600	172,864	178,827	2050/12/10
	105 住宅機構RMBS	0.7900	177,472	182,760	2051/02/10
	106 住宅機構RMBS	0.5400	357,184	361,755	2051/03/10
	107 住宅機構RMBS	0.4800	906,780	914,487	2051/04/10
	108 住宅機構RMBS	0.3400	1,093,692	1,092,926	2051/05/10
	109 住宅機構RMBS	0.3600	92,438	92,548	2051/06/10
	112 住宅機構RMBS	0.3300	188,284	188,265	2051/09/10
	113 住宅機構RMBS	0.3700	1,509,552	1,514,080	2051/10/10
	115 住宅機構RMBS	0.4100	284,670	286,207	2051/12/10
	117 住宅機構RMBS	0.4600	95,853	96,696	2052/02/10
合計	銘柄数 金 額	12銘柄 -----	5,294,052	5,337,525	-----

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年3月12日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 5,337,525	% 98.1
コール・ローン等、その他	105,469	1.9
投資信託財産総額	5,442,994	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

2018年3月12日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	5,442,994,706円
コール・ローン等	105,334,725
公社債(評価額)	5,337,525,455
未収利息	134,526
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A－B)	5,442,994,706
元本	5,385,306,059
次期繰越損益金	57,688,647
(D) 受益権総口数	5,385,306,059口
1万口当り基準価額(C／D)	10,107円

* 期首における元本額は6,489,635,634円、当期中における追加設定元本額は192,434,644円、同解約元本額は1,296,764,219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、住宅金融支援機構債ファンド(FOFs用)(適格機関投資家専用)990,554円、ダイワ住宅金融支援機構債ファンド－Mr.フラット－5,153,316,283円、ダイワ円債セレクト 超長期国債&住宅金融支援機構債コース230,999,222円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,107円です。

■損益の状況

当期 自2017年9月12日 至2018年3月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	13,313,532円
受取利息	13,336,802
支払利息	△ 23,270
(B) 有価証券売買損益	△14,850,378
売買損	△14,850,378
(C) 当期損益金(A＋B)	△ 1,536,846
(D) 前期繰越損益金	68,307,934
(E) 解約差損益金	△10,461,867
(F) 追加信託差損益金	1,379,426
(G) 合計(C＋D＋E＋F)	57,688,647
次期繰越損益金(G)	57,688,647

(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。