

日本物価連動国債ファンド

運用報告書（全体版） 第13期

（決算日 2020年3月10日）
（作成対象期間 2019年9月11日～2020年3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	約10年間（2013年9月5日～2023年9月8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 10%以下
	マザーファンドの 株式組入上限比率		
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 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
9 期末(2018年 3月12日)	円 10,155	円 20	% 1.9	10,241	% 2.4	% 98.3	% －	百万円 10,922
10期末(2018年 9月10日)	10,035	20	△1.0	10,154	△0.8	99.2	－	10,404
11期末(2019年 3月11日)	9,956	20	△0.6	10,115	△0.4	98.8	－	9,611
12期末(2019年 9月10日)	9,908	20	△0.3	10,118	0.0	99.0	－	8,931
13期末(2020年 3月10日)	9,806	20	△0.8	10,060	△0.6	99.7	－	7,867

(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。
「NOMURA物価連動国債インデックス」は、野村證券が公表している指数で、野村證券の知的財産です。わが国の物価連動国債市場全体のパフォーマンスを表す指標として、当該投資収益指数を当ファンドの参考指数として掲載しておりますが、野村證券は、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。

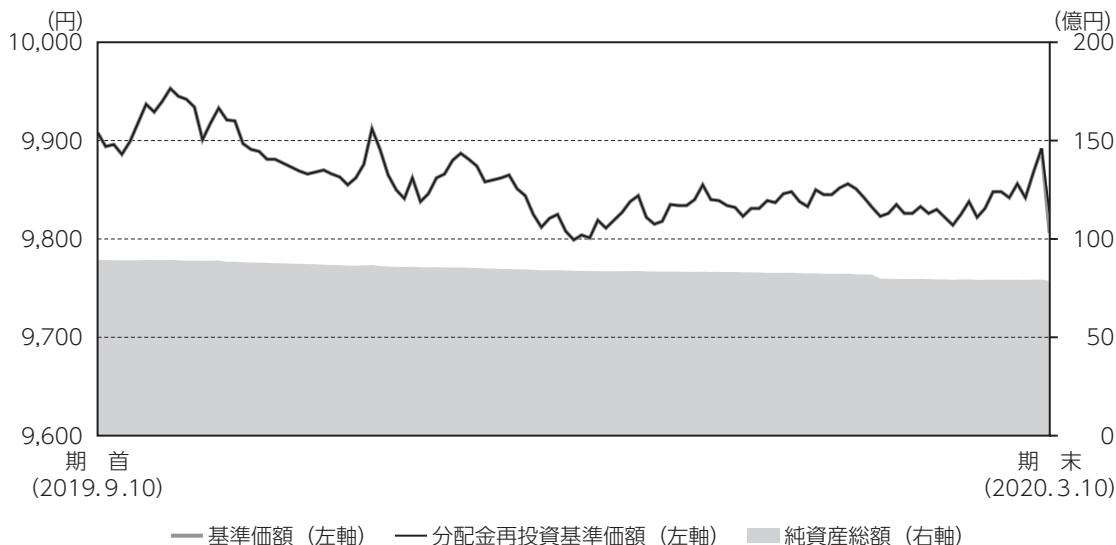
(注 5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(注 6) 債券先物比率は買建比率－売建比率です。



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：9,908円

期 末：9,806円（分配金20円）

騰落率：△0.8%（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、金利の上昇および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）の低下による物価連動国債価格の下落を主因として、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。

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		公 社 債 率 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2019年 9月10日	円	%		%	%	%
	9,908	－	10,118	－	99.0	－
9月末	9,934	0.3	10,141	0.2	99.5	－
10月末	9,876	△0.3	10,078	△0.4	99.2	－
11月末	9,844	△0.6	10,053	△0.6	99.7	－
12月末	9,840	△0.7	10,045	△0.7	98.8	－
2020年 1月末	9,856	△0.5	10,070	△0.5	98.8	－
2月末	9,848	△0.6	10,079	△0.4	98.9	－
(期末) 2020年 3月10日	9,826	△0.8	10,060	△0.6	99.7	－

(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

(2019.9.11～2020.3.10)

■国内物価連動国債市況

当作成期を通して、物価連動国債の価格は下落しました。

当作成期首より、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待を背景に金利は上昇しました。また、日銀の追加金融緩和観測が後退したことも、金利上昇要因となりました。2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、世界的に景気減速懸念が高まったことや市場のリスク回避姿勢が強まったことから、金利は低下しました。

原油価格の下落や円高などをを受けて、市場が予想する将来の物価上昇率は大幅に低下しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

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

(2019.9.11～2020.3.10)

■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。

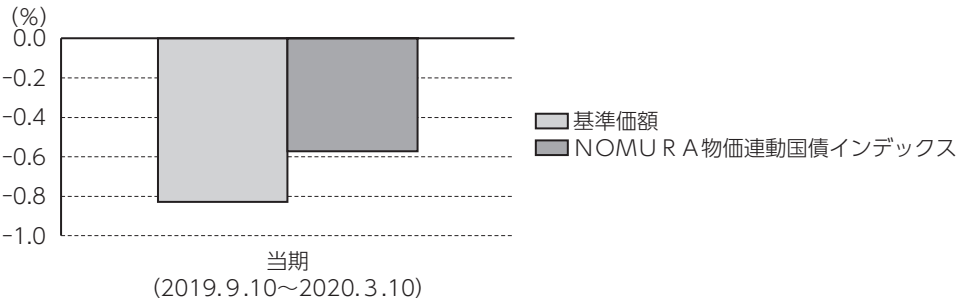
■ダイワ物価連動国債マザーファンド

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。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。



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	
	2019年9月11日 ～2020年3月10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）	—	
当期の収益以外（円）	20	
翌期繰越分配対象額（円）	244	

（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	0.00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	✓ 264.92
(d) 分配準備積立金	0.00
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	264.92
(f) 分配金	20.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	244.92

（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

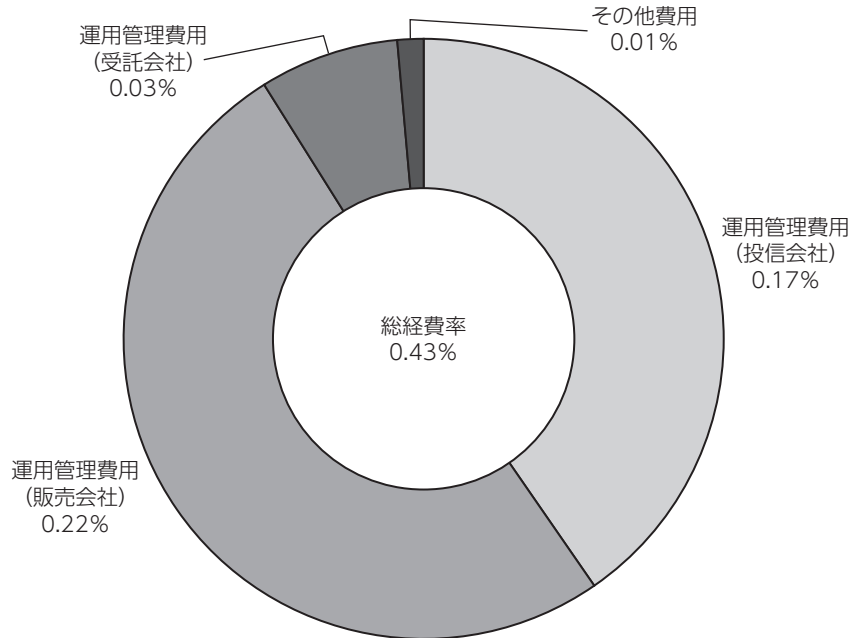
項 目	当期 (2019.9.11～2020.3.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	21円	0.213%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は9,857円です。
(投 信 会 社)	(9)	(0.087)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(11)	(0.109)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(2)	(0.016)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社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＝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
(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	21	0.215	

- (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0.43%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

(2019年9月11日から2020年3月10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	29,915	36,233	866,562	1,045,273

(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	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ物価連動国債マザーファンド	7,367,092	6,530,445	7,860,697

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年3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	7,860,697	99.3
コール・ローン等、その他	58,365	0.7
投資信託財産総額	7,919,063	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

2020年3月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	7,919,063,246円
コール・ローン等	42,221,061
ダイワ物価連動国債マザーファンド(評価額)	7,860,697,410
未収入金	16,144,775
(B) 負債	51,248,016
未払収益分配金	16,046,328
未払解約金	17,018,038
未払信託報酬	17,953,089
その他未払費用	230,561
(C) 純資産総額(A－B)	7,867,815,230
元本	8,023,164,368
次期繰越損益金	△ 155,349,138
(D) 受益権総口数	8,023,164,368口
1万口当り基準価額(C／D)	9,806円

* 期首における元本額は9,013,719,284円、当作成期間中における追加設定元本額は93,120,223円、同解約元本額は1,083,675,139円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,806円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は155,349,138円です。

■損益の状況

当期 自2019年9月11日 至2020年3月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 2,950円
受取利息	217
支払利息	△ 3,167
(B) 有価証券売買損益	△ 47,456,085
売買益	4,844,683
売買損	△ 52,300,768
(C) 信託報酬等	△ 18,183,659
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 65,642,694
(E) 前期繰越損益金	△351,860,105
(F) 追加信託差損益金	278,199,989
(配当等相当額)	(173,409,247)
(売買損益相当額)	(104,790,742)
(G) 合計(D + E + F)	△139,302,810
(H) 収益分配金	△ 16,046,328
次期繰越損益金(G + H)	△155,349,138
追加信託差損益金	262,153,661
(配当等相当額)	(157,362,919)
(売買損益相当額)	(104,790,742)
繰越損益金	△417,502,799

(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	212,557,295
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	212,557,295
(f) 分配金	16,046,328
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	196,510,967
(h) 受益権総口数	8,023,164,368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、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》
■商号変更について
大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

ダイワ物価連動国債マザーファンド

運用報告書 第15期（決算日 2020年3月10日）

（作成対象期間 2019年3月12日～2020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。

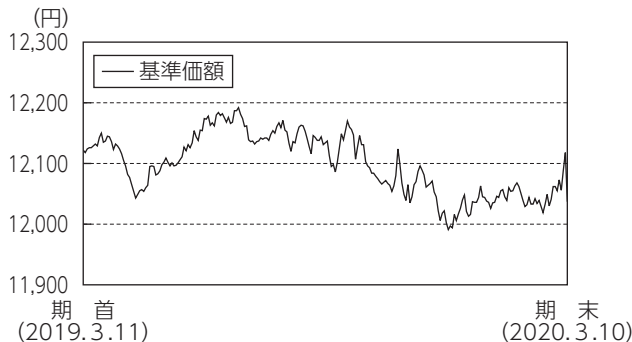
運 用 方 針	安定した収益の確保および信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の物価連動国債を中心とする国債
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

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 (参考指数)		公 社 債 組入比率	債券先物 比 率
	円	騰 落 率	円	騰 落 率		
(期首)2019年3月11日	12,122	—	11,462	—	98.9	—
3月末	12,144	0.2	11,477	0.1	99.7	—
4月末	12,095	△0.2	11,447	△0.1	99.2	—
5月末	12,131	0.1	11,486	0.2	99.0	—
6月末	12,176	0.4	11,529	0.6	99.5	—
7月末	12,154	0.3	11,505	0.4	99.5	—
8月末	12,143	0.2	11,501	0.3	98.5	—
9月末	12,147	0.2	11,492	0.3	99.6	—
10月末	12,080	△0.3	11,420	△0.4	99.3	—
11月末	12,045	△0.6	11,392	△0.6	99.8	—
12月末	12,044	△0.6	11,382	△0.7	98.7	—
2020年1月末	12,068	△0.4	11,411	△0.5	98.9	—
2月末	12,062	△0.5	11,422	△0.4	98.9	—
(期末)2020年3月10日	12,037	△0.7	11,400	△0.5	99.8	—

(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。

「NOMURA物価連動国債インデックス」は、野村證券が公表している指数で、野村證券の知的財産です。わが国の物価連動国債市場全体のパフォーマンスを表す指標として、当該投資収益指数を当ファンドの参考指数として掲載しておりますが、野村證券は、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：12,122円 期末：12,037円 騰落率：△0.7%

【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）の低下による物価連動国債価格の下落を主因として、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。

◆投資環境について

○国内物価連動国債市況

当作成期を通して物価連動国債の価格は下落しました。

当作成期首より、欧米の経済指標の下振れや米中貿易摩擦の激化などを背景に、世界的に景気減速懸念が高まったことから、長期金利は低下しました。また、日銀の追加金融緩和観測が高まったことも、金利低下要因となりました。2019年9月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待を背景に、長期金利は上昇しました。2020年1月以降は、新型コロナウイルスの感染拡大を受けて、市場のリスク回避姿勢が強まったことから、長期金利は低下しました。

原油価格の下落や円高などを受けて、市場が予想する将来の物価上昇率は大幅に低下しました。

◆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 (その他)	0 (0)
合 計	0

(注1) 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。

(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

(2019年3月12日から2020年3月10日まで)

国 内	買 付 額	売 付 額
	千円	千円
国債証券	2,917,091	4,467,584 (—)

(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) 単位未満は四捨五入。

■主要な売買銘柄
公 社 債

(2019年3月12日から2020年3月10日まで)

当			期		
買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
		千円			千円
23 物価連動国債 0.1% 2028/3/10	1,459,763		18 物価連動国債 0.1% 2024/3/10	2,339,065	
24 物価連動国債 0.1% 2029/3/10	1,039,866		17 物価連動国債 0.1% 2023/9/10	1,816,424	
21 物価連動国債 0.1% 2026/3/10	417,461		19 物価連動国債 0.1% 2024/9/10	312,095	

(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			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	
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	8,900,000	9,302,637	99.8	－	60.3	39.4	－

(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）

当			期			末
区 分	銘 柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償還年月日	
国債証券	18 物価連動国債	0.1000	2,600,000	2,749,323	2024/03/10	
	19 物価連動国債	0.1000	900,000	927,639	2024/09/10	
	20 物価連動国債	0.1000	500,000	518,409	2025/03/10	
	21 物価連動国債	0.1000	700,000	730,116	2026/03/10	
	22 物価連動国債	0.1000	1,200,000	1,264,496	2027/03/10	
	23 物価連動国債	0.1000	2,000,000	2,084,604	2028/03/10	
	24 物価連動国債	0.1000	1,000,000	1,028,047	2029/03/10	
	合計		8,900,000	9,302,637		
銘柄数	7銘柄					
金 額						

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年3月10日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
	千円	%	
公社債	9,302,637	99.6	
コール・ローン等、その他	38,883	0.4	
投資信託財産総額	9,341,521	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

2020年3月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,341,521,050円
コール・ローン等	38,883,907
公社債(評価額)	9,302,637,143
(B) 負債	16,144,775
未払解約金	16,144,775
(C) 純資産総額(A－B)	9,325,376,275
元本	7,747,385,143
次期繰越損益金	1,577,991,132
(D) 受益権総口数	7,747,385,143口
1万口当り基準価額(C／D)	12,037円

*期首における元本額は9,121,461,061円、当作成期間中における追加設定元本額は346,487,813円、同解約元本額は1,720,563,731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、日本物価連動国債ファンド6,530,445,635円、DCダイワ物価連動国債ファンド1,216,939,508円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は12,037円です。

■損益の状況

当期 自2019年3月12日 至2020年3月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	9,935,488円
受取利息	9,977,707
支払利息	△ 42,219
(B) 有価証券売買損益	△ 80,639,357
売買益	1,886,331
売買損	△ 82,525,688
(C) その他費用	△ 708
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 70,704,577
(E) 前期繰越損益金	1,935,348,855
(F) 解約差損益金	△ 359,878,701
(G) 追加信託差損益金	73,225,555
(H) 合計(D + E + F + G)	1,577,991,132
次期繰越損益金(H)	1,577,991,132

(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。