

★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（預託証券を含みます。）
	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16期

（決算日 2023年12月18日）

（作成対象期間 2022年12月20日～2023年12月18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、2020年の決算日以降は、わが国の短期債券および短期金融資産に投資し、リスクを抑えた運用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	投資証券 組入比率	不動産 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
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
15期末(2022年12月19日)	13,838	0	△0.5	—	—	98.5	—	—	—	—	98
16期末(2023年12月18日)	13,793	0	△0.3	—	—	98.7	—	—	—	—	93

(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。

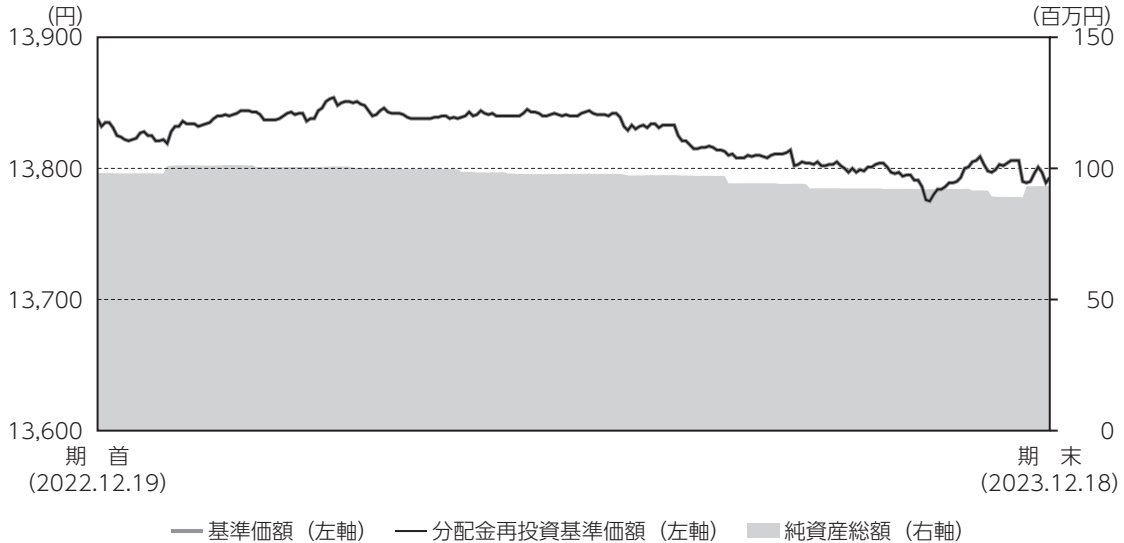
(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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



(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：13,838円

期末：13,793円（分配金0円）

騰落率：△0.3%（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 率	債 先 物 比	券 率
		騰 落 率				
(期首) 2022年12月19日	円	13,838	%	%		%
12月末		13,822	△0.1	98.5		—
2023年 1 月末		13,834	△0.0	98.7		—
2 月末		13,838	0.0	98.7		—
3 月末		13,848	0.1	98.4		—
4 月末		13,840	0.0	98.7		—
5 月末		13,840	0.0	98.5		—
6 月末		13,840	0.0	98.5		—
7 月末		13,841	0.0	99.1		—
8 月末		13,821	△0.1	98.9		—
9 月末		13,808	△0.2	98.6		—
10月末		13,800	△0.3	99.2		—
11月末		13,776	△0.4	99.1		—
(期末) 2023年12月18日		13,802	△0.3	98.8		—
		13,793	△0.3	98.7		—

(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

(2022.12.20~2023.12.18)

■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2023年1月にかけて、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことにより短期金利にも上昇圧力がかかり、上昇基調で推移しました。その後は欧米の金融不安の高まりを受けて短期金利は低下（債券価格は上昇）しましたが、4月には欧米の金融不安が落ち着いたことで上昇しました。7月から8月にかけては、日銀が金融政策決定会合で長短金利操作（イールドカーブ・コントロール）の運用を柔軟化することを決定したことなどから、短期金利は上昇しました。9月から10月にかけては、米国金利の上昇を受けて国内短期金利も上昇しました。当作成期末にかけては、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、国内短期金利は低下基調で推移しました。

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

(2022.12.20~2023.12.18)

■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、確定拠出型年金向けファンドであることを考慮し、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	
	2022年12月20日 ～2023年12月18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。

(注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配可能額」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。

※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、ファンドの資金流入出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。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.12.20~2023.12.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	33円	0.241%	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13,824円です。
(投 信 会 社)	(14)	(0.104)	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)	(14)	(0.104)	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
合 計	34	0.249	

(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。

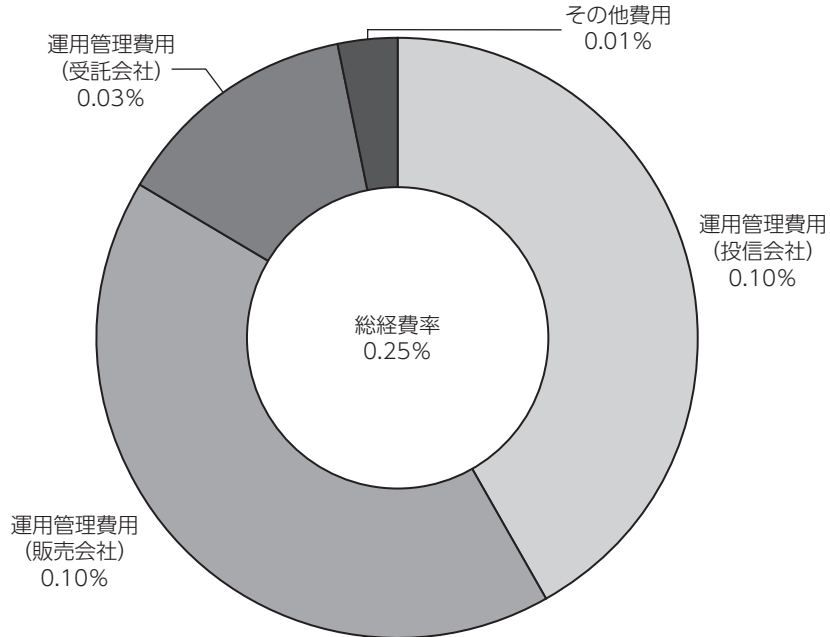
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2022年12月20日から2023年12月18日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千□	千円	千□	千円
ダイワ短期日本債券 インデックスマザーファンド	7,710	8,035	12,362	12,894

(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		
	□ 数	□ 数	評 価 額	□ 数	□ 数	評 価 額
	千□	千□	千円	千□	千□	千円
ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド	93,976	89,325	93,086			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年12月18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	93,086	99.7
コール・ローン等、その他	300	0.3
投資信託財産総額	93,386	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

2023年12月18日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	93,386,951円
コール・ローン等	300,842
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)	93,086,109
(B) 負債	117,240
未払信託報酬	113,471
その他未払費用	3,769
(C) 純資産総額(A - B)	93,269,711
元本	67,621,761
次期繰越損益金	25,647,950
(D) 受益権総口数	67,621,761口
1万口当り基準価額(C / D)	13,793円

* 期首における元本額は70,965,911円、当作成期間中における追加設定元本額は6,011,631円、同解約元本額は9,355,781円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,793円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月20日 至2023年12月18日

項 目	当 期
(A) 有価証券売買損益	△ 44,746円
売買益	8,618
売買損	△ 53,364
(B) 信託報酬等	△ 241,327
(C) 当期損益金(A + B)	△ 286,073
(D) 前期繰越損益金	10,669,007
(E) 追加信託差損益金	15,265,016
(配当等相当額)	(25,892,928)
(売買損益相当額)	(△10,627,912)
(F) 合計(C + D + E)	25,647,950
次期繰越損益金(F)	25,647,950
追加信託差損益金	15,265,016
(配当等相当額)	(25,892,928)
(売買損益相当額)	(△10,627,912)
分配準備積立金	11,398,950
繰越損益金	△ 1,016,016

(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	25,892,928
(d) 分配準備積立金	11,398,950
(e) 当期分配可能額(a + b + c + d)	37,291,878
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配可能額(e - f)	37,291,878
(h) 受益権総口数	67,621,761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17期 (決算日 2023年12月18日)

(作成対象期間 2022年12月20日～2023年12月18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。

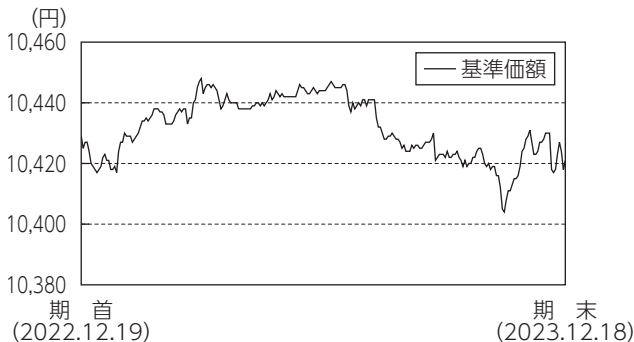
運用方針	投資成果をNOMURA-BPI総合短期指数の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の公社債等 (各種の債権や資産を担保・裏付けとして発行された証券を含みます。)
株式組入制限	純資産総額の10%以下

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 (ベンチマーク)		公 社 債 組入比率	債券先物 比 率
	円	%	円	%		
(期首)2022年12月19日	10,429	-	10,500	-	98.7	-
12月末	10,418	△0.1	10,488	△0.1	98.9	-
2023年 1 月末	10,429	0.0	10,500	△0.0	98.9	-
2 月末	10,434	0.0	10,504	0.0	98.6	-
3 月末	10,444	0.1	10,516	0.2	98.9	-
4 月末	10,440	0.1	10,513	0.1	98.7	-
5 月末	10,442	0.1	10,515	0.1	98.7	-
6 月末	10,445	0.2	10,519	0.2	99.3	-
7 月末	10,432	0.0	10,505	0.0	99.1	-
8 月末	10,425	△0.0	10,500	△0.0	98.8	-
9 月末	10,421	△0.1	10,496	△0.0	99.4	-
10 月末	10,405	△0.2	10,481	△0.2	99.2	-
11 月末	10,427	△0.0	10,502	0.0	99.0	-
(期末)2023年12月18日	10,421	△0.1	10,497	△0.0	98.9	-

(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。
 (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：10,429円 期末：10,421円 騰落率：△0.1%

【基準価額の主な変動要因】

短期金利が上昇したことが主なマイナス要因となり、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2023年1月にかけて、日銀が長期金利の変動許容幅を拡大したことにより短期金利にも上昇圧力

がかかり、上昇基調で推移しました。その後は欧米の金融不安の高まりを受けて短期金利は低下(債券価格は上昇)しましたが、4月には欧米の金融不安が落ち着いたことで上昇しました。7月から8月にかけては、日銀が金融政策決定会合で長短金利操作(イールドカーブ・コントロール)の運用を柔軟化することを決定したことなどから、短期金利は上昇しました。9月から10月にかけては、米国金利の上昇を受けて国内短期金利も上昇しました。当作成期末にかけては、米国で利上げサイクルの終了が意識されたことにより、国内短期金利は低下基調で推移しました。

◆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

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△0.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.1%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	-
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。

ダイワ短期日本債券インデックスマザーファンド

■売買および取引の状況

公 社 債

(2022年12月20日から2023年12月18日まで)

		買 付 額	売 付 額
		千円	千円
国	国債証券	396,435	301,145 (-)

(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

(2022年12月20日から2023年12月18日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄	銘	柄
金額		金額	
千円		千円	
148 5年国債 0.005% 2026/6/20	59,092	142 5年国債 0.1% 2024/12/20	84,117
142 5年国債 0.1% 2024/12/20	55,114	335 10年国債 0.5% 2024/9/20	62,372
149 5年国債 0.005% 2026/9/20	52,874	433 2年国債 0.005% 2024/2/1	57,000
145 5年国債 0.1% 2025/9/20	45,085	334 10年国債 0.6% 2024/6/20	54,415
342 10年国債 0.1% 2026/3/20	43,126	333 10年国債 0.6% 2024/3/20	35,236
150 5年国債 0.005% 2026/12/20	39,902	144 5年国債 0.1% 2025/6/20	3,005
146 5年国債 0.1% 2025/12/20	33,051	148 5年国債 0.005% 2026/6/20	2,994
143 5年国債 0.1% 2025/3/20	31,063	143 5年国債 0.1% 2025/3/20	2,003
144 5年国債 0.1% 2025/6/20	17,032		
335 10年国債 0.5% 2024/9/20	9,073		

(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)

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		
	千円	千円	%	%	5年以上	2年以上	2年未満
国債証券	452,000	451,939	98.9	-	-	53.1	45.8

(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。
 (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)

区 分	銘 柄	年 利 率	当 期		償 還 年 月 日
			額 面 金 額	評 価 額	
		%	千円	千円	
国債証券	143 5年国債	0.1000	38,000	38,047	2025/03/20
	144 5年国債	0.1000	126,000	126,132	2025/06/20
	145 5年国債	0.1000	45,000	45,043	2025/09/20
	146 5年国債	0.1000	42,000	42,037	2025/12/20
	147 5年国債	0.0050	9,000	8,987	2026/03/20
	342 10年国債	0.1000	43,000	43,033	2026/03/20
	148 5年国債	0.0050	56,000	55,902	2026/06/20
	149 5年国債	0.0050	53,000	52,875	2026/09/20
	150 5年国債	0.0050	40,000	39,880	2026/12/20
	合 計	銘柄数 金 額	9銘柄	452,000	451,939

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年12月18日現在

項 目	当 期		末
	評 価 額	比 率	
		千円	%
公社債	451,939	98.9	
コール・ローン等、その他	5,238	1.1	
投資信託財産総額	457,178	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

2023年12月18日現在

項 目	当 期	末
(A) 資産	457,178,475円	
コール・ローン等	5,124,512	
公社債(評価額)	451,939,790	
未収利息	101,590	
前払費用	12,583	
(B) 負債	1,000	
未払解約金	1,000	
(C) 純資産総額(A-B)	457,177,475	
元本	438,719,306	
次期繰越損益金	18,458,169	
(D) 受益権総口数	438,719,306口	
1万円当り基準価額(C/D)	10,421円	

* 期首における元本額は347,622,118円、当作成期間中における追加設定元本額は126,667,022円、同解約元本額は35,569,834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:

D Cダイワ・ターゲットイヤー2050	65,190,584円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2060	985,533円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2020	89,325,506円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2030	201,611,475円
D Cダイワ・ターゲットイヤー2040	81,606,208円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,421円です。

■損益の状況

当期 自2022年12月20日 至2023年12月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	651,184円
受取利息	652,589
支払利息	△ 1,405
(B) 有価証券売買損益	△ 1,079,980
売買益	23,760
売買損	△ 1,103,740
(C) 当期損益金(A + B)	△ 428,796
(D) 前期繰越損益金	14,915,653
(E) 解約差損益金	△ 1,530,866
(F) 追加信託差損益金	5,502,178
(G) 合計(C + D + E + F)	18,458,169
次期繰越損益金(G)	18,458,169

(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-BPI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。