

# 中期国債ファンド

---

---

## 運用報告書（全体版）

（2015年11月30日～2016年5月30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。

さて、「中期国債ファンド」の上記期間中に行なわれました決算について、運用状況と分配金などをまとめてご報告いたします。

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。

### ★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	無期限
運用方針	主として債券への投資により、安定した収益の確保を目的として、安定運用を行ないます。
主要投資対象	本邦通貨表示の公社債券
分配方針	毎日決算を行ない、運用収益（純資産総額の元本超過額）の全額を収益分配金に充当いたします。分配金は、税金を差引いたうえで、毎月最終営業日にまとめて全額自動的に再投資します。

## 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）

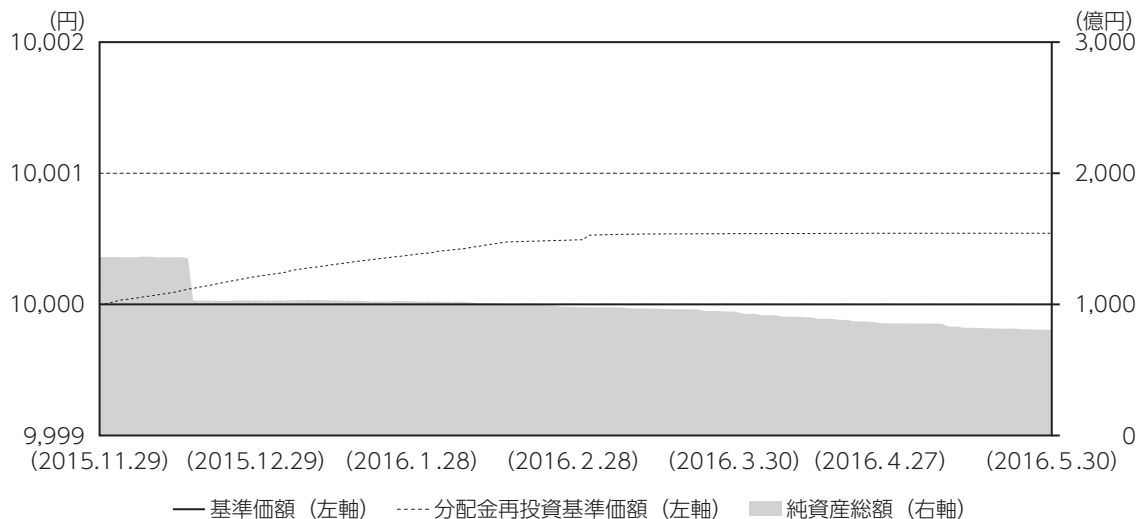
TEL 0120-106212

（営業日の9：00～17：00）

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

## 《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あり、お客さまの損益の状況を示すものではありません。

\* 実際には、分配金は税金を差引いたうえで再投資されます。

#### ■基準価額・騰落率

2015年11月30日：10,000円

2016年5月30日：10,000円（既払分配金0円54銭3厘）

騰落率：0.00%（分配金再投資ベース）

#### ■基準価額の主な変動要因

基準価額は10,000円で安定して推移しました。

## 投資環境について

### ○国内短期金融市況

日銀がマイナス金利付き量的・質的金融緩和を導入したことを背景に、短期金利は低下しました。

無担保コール翌日物金利は、2016年2月前半までプラスで推移しましたが、2月後半以降は0%附近からマイナスで推移しました。短期国債（3カ月物）の利回りは、1月まで小幅なマイナスで推移しましたが、2月以降はマイナス幅を拡大して推移しました。

## 前期末における「今後の運用方針」

短期の公社債や短期金融資産を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして運用を行ないます。

## ポートフォリオについて

元本の安全性を最優先に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、決算時の元本の安全性に配慮した運用を行なっているため、ベンチマークおよび参考指数はありません。

## 分配金について

当期間中の収益分配金の合計は1万口当たり0円54銭3厘（税込み）となりました。

### ■各期間における分配率の状況

期 間	年 利 回 り (税込み)
2015年12月	0.025%
2016年 1 月	0.020%
2 月	0.013%
3 月	0.005%
4 月	0.000%
5 月	0.000%

(注1) 年利回りは前月最終営業日～当月最終営業日の前日までの分配金合計額に基づいて算出。

(注2) 表中の数値は過去の実績であり、将来を保証するものではありません。

## 《今後の運用方針》

引き続き、元本の安全性を最優先に運用を行ないます。

■収益分配金のお知らせ

(2015年11月30日～2016年5月30日)

期 間	1万口 (元本1万円) 当り分配金				
	税 込 み	所 得 税	地 方 税	源 泉 税 合 計	お 手 取 り 額
2015年12月	0円21銭2厘	0円03銭2厘	0円01銭	0円04銭2厘	0円17銭
2016年 1 月	0円16銭6厘	0円02銭5厘	0円00銭8厘	0円03銭3厘	0円13銭3厘
2 月	0円11銭3厘	0円01銭7厘	0円00銭5厘	0円02銭2厘	0円09銭1厘
3 月	0円04銭9厘	0円00銭7厘	0円00銭2厘	0円00銭9厘	0円04銭
4 月	0円00銭3厘	0円00銭	0円00銭	0円00銭	0円00銭3厘
5 月	0円00銭	0円00銭	0円00銭	0円00銭	0円00銭

- (注1) 分配金は各月における前月最終営業日～当月最終営業日の前日までの累計です。  
 (注2) 所得税には復興特別所得税が含まれます。  
 (注3) 上記期間中のお手取り分配金は、各月の最終営業日にみなさまの口座に繰入れて再投資いたしました。  
 (注4) 上記期間内に取得の場合には、取得日から各期間の末日までの分配金合計から、源泉税額を差引いた額が再投資額となります。

■資産・負債・元本および基準価額の状況

(2016年5月30日現在)

資				産			負 債	純資産総額	元 本	1万口当り 基準価額
公 社 債		そ の 他 有 価 証 券		コ ー ル ・ ロ ー ン 等 そ の 他 資 産		合 計				
金 額	比 率	金 額	比 率	金 額	比 率	金 額	金 額	金 額	金 額	円
百万円	%	百万円	%	百万円	%	百万円	百万円	百万円	百万円	円
-	-	-	-	80,609	100.0	80,609	0	80,609	80,609	10,000

- (注1) 比率は投資信託財産総額 (80,609百万円) に対する割合。  
 (注2) 公社債およびその他有価証券には現先取引により取得したものを含まれます。  
 (注3) 2016年5月30日現在における次期繰越金は3千円です。  
 (注4) 単位未満は切捨て。  
 ※2015年11月29日現在の元本額は136,189百万円、当作成期間中における追加設定元本額は6,556百万円、同解約元本額は62,136百万円です。  
 ※2016年5月30日現在の1口当り純資産額は1.0000円です。

■売買および損益の状況

(2015年11月30日～2016年5月30日)

組 入 有 価 証 券 の 売 買 状 況				先 物 取 引 状 況				損 益 の 状 況		
買 付		売 付		買 建		売 建		運 用 損 益	信 託 報 酬 等	収 益 分 配 金
公 社 債	そ の 他 有 価 証 券	公 社 債	そ の 他 有 価 証 券	新 規 買 付 額	決 済 額	新 規 売 付 額	決 済 額			
百万円 54,449	百万円 482,371	百万円 3,101	百万円 460,939	億 円 -	億 円 -	億 円 -	億 円 -	千 円 8,401	千 円 2,477	千 円 5,920
[18,590]	[ 59,994]	[ - ]	[ 59,994]	[ - ]	[ - ]	[ - ]	[ - ]			

- (注1) 公社債の買付、売付は受渡代金。(経過利子分は含まれておりません。)( )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2) 組入有価証券の売買状況には、現先取引に係る金額を含めて表示しております。  
 (注3) 組入有価証券の売買状況および先物取引状況の[ ]内は、当作成期間中における利害関係人との取引金額。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項に規定される法人等をいいます。なお、当ファンドに係る当作成期間中の利害関係人は、大和証券、東京証券です。  
 (注4) 単位未満は切捨て。  
 (注5) 2016年5月30日現在における先物取引の取引残高(評価額)はありません。

■組入資産明細表

2016年5月30日現在における該当事項はありません。

《お知らせ》

●信託財産留保額の撤廃について

換金の際、購入日から起算して換金申込受付日の翌営業日の前日までの日数が30日未満の場合、1万口につき10円の信託財産留保額を換金代金から差し引くことになっていましたが、繰上償還に向けて受益者の利便性を向上させるため、2016年4月1日以降、この信託財産留保額を撤廃する約款変更を行ないました。