

# 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15期

（決算日 2023年9月11日）

（作成対象期間 2023年3月11日～2023年9月11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、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	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	
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。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数		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			
11期末(2021年9月10日)	円 10,027	円 10	% 0.9	532.807	% 0.8	% 97.2	% -	百万円 2,100
12期末(2022年3月10日)	9,923	10	△0.9	524.707	△1.5	95.7	-	2,029
13期末(2022年9月12日)	9,834	10	△0.8	515.486	△1.8	98.0	-	1,959
14期末(2023年3月10日)	9,728	10	△1.0	507.534	△1.5	92.6	-	1,846
15期末(2023年9月11日)	9,588	10	△1.3	502.840	△0.9	99.6	-	1,733

(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) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

(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。

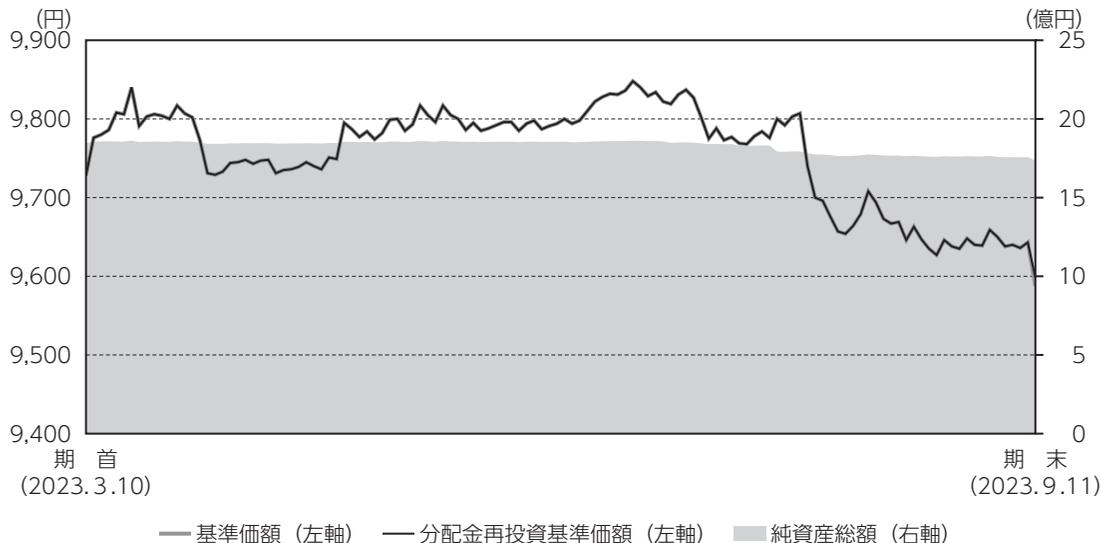
(注5) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）を除きます。

(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



(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：9,728円

期末：9,588円（分配金10円）

騰落率：△1.3%（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が発行する債券に投資した結果、債券価格の下落により、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。

ダイワ住宅金融支援機構債ファンド -Mr. フラット-

年 月 日	基 準 価 額		ダイワ・ボンド・インデックス ( D B I ) 総 合 指 数 (参考指数)		公 社 債 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2023年 3月10日	9,728	% -	507.534	% -	% 92.6	% -
3月末	9,802	0.8	514.584	1.4	92.9	-
4月末	9,795	0.7	515.907	1.6	92.3	-
5月末	9,792	0.7	515.440	1.6	97.0	-
6月末	9,822	1.0	516.779	1.8	96.5	-
7月末	9,700	△0.3	508.731	0.2	99.5	-
8月末	9,639	△0.9	505.088	△0.5	99.0	-
(期末) 2023年 9月11日	9,598	△1.3	502.840	△0.9	99.6	-

(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

(2023.3.11~2023.9.11)

### ■国内債券市況

国内債券市況は、金利は上昇（債券価格は下落）しました。

当作成期首より、欧米の金融システム不安を背景に長期金利は低下（債券価格は上昇）しましたが、その後は当局の迅速な対応が評価されたことなどから、長期金利は上昇に転じました。さらに、2023年7月に日銀が長短金利操作（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で、当作成期末にかけて長期金利は上昇しました。

国債利回りの上昇を受けて、住宅金融支援機構が発行する債券の利回りも上昇しました。

## 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「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います。金利の方向性、利回り水準、格付けや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

(2023.3.11~2023.9.11)

### ■当ファンド

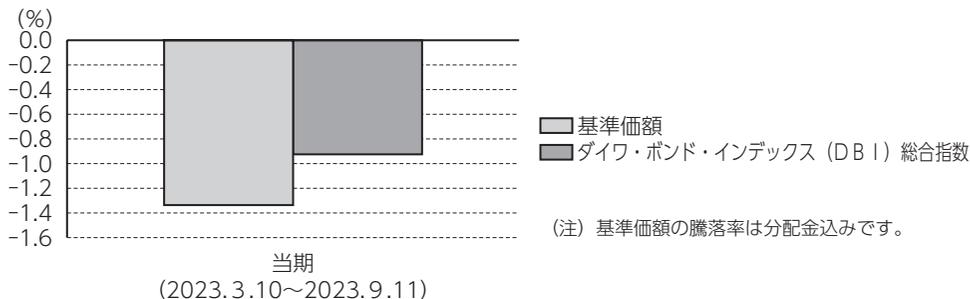
主として「住宅金融支援機構債マザーファンド」の受益証券を通じて、住宅金融支援機構が発行する債券に投資し、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行いました。

### ■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いました。金利の方向性、利回り水準、格付けや流動性等を総合的に勘案し、ポートフォリオを構築しました。

## 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	
	2023年3月11日 ~2023年9月11日	
<b>当期分配金(税込み) (円)</b>		<b>10</b>
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)		160

(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、「翌期繰越分配対象額」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。

### ■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	✓	13.51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		7.05
(d) 分配準備積立金		149.59
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)		170.17
(f) 分配金		10.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)		160.17

(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「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います。金利の方向性、利回り水準、格付けや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 (2023.3.11~2023.9.11)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	10円	0.100%	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9,756円です。
(投 信 会 社)	(4)	(0.042)	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)	(4)	(0.042)	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)	(2)	(0.017)	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	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
合 計	10	0.103	

(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。

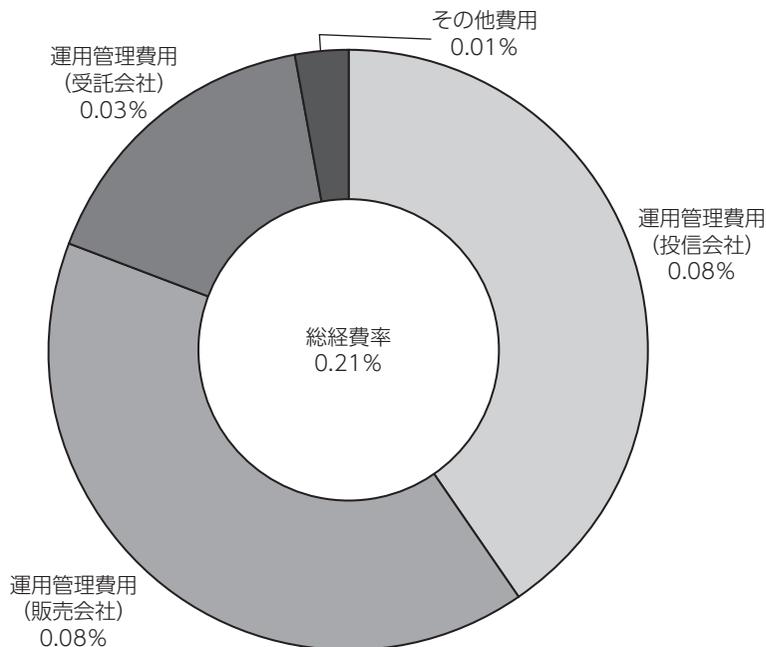
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.21%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

(2023年3月11日から2023年9月11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	1,847	1,860	79,117	79,810

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成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当作成期中の利害関係人との取引状況

(2023年3月11日から2023年9月11日まで)

決 算 期	当 期					
	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
公社債	百万円 200	百万円 -	-	百万円 101	百万円 101	% 100.0
コール・ローン	10,551	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合96.1%

※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) 当作成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比率

当作成期中における売買委託手数料総額に対する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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

■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	1,840,266	1,762,997	1,745,896

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年9月11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	1,745,896	99.7
コール・ローン等、その他	5,449	0.3
投資信託財産総額	1,751,346	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9月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,751,346,419円
コール・ローン等	5,449,901
住宅金融支援機構債マザーファンド(評価額)	1,745,896,518
(B) 負債	17,892,669
未払収益分配金	1,807,850
未払解約金	14,203,845
未払信託報酬	1,830,231
その他未払費用	50,743
(C) 純資産総額(A - B)	1,733,453,750
元本	1,807,850,452
次期繰越損益金	△ 74,396,702
(D) 受益権総口数	1,807,850,452口
1万口当り基準価額(C/D)	9,588円

\*期首における元本額は1,897,636,710円、当作成期間中における追加設定元本額は2,817,844円、同解約元本額は92,604,102円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は9,588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74,396,702円です。

■損益の状況

当期 自2023年3月11日 至2023年9月11日

項 目	当	期
(A) 配当等収益	△	774円
受取利息		26
支払利息	△	800
(B) 有価証券売買損益	△	21,610,338
売買益		698,908
売買損	△	22,309,246
(C) 信託報酬等	△	1,880,974
(D) 当期損益金(A + B + C)	△	23,492,086
(E) 前期繰越損益金	△	59,416,965
(F) 追加信託差損益金		10,320,199
(配当等相当額)	(	1,276,237)
(売買損益相当額)	(	9,043,962)
(G) 合計(D + E + F)	△	72,588,852
(H) 収益分配金	△	1,807,850
次期繰越損益金(G + H)	△	74,396,702
追加信託差損益金		10,320,199
(配当等相当額)	(	1,276,237)
(売買損益相当額)	(	9,043,962)
分配準備積立金		27,680,289
繰越損益金	△	112,397,190

- (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	2,443,619円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	1,276,237
(d) 分配準備積立金	27,044,520
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	30,764,376
(f) 分配金	1,807,850
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	28,956,526
(h) 受益権総口数	1,807,850,452口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ

1 万 口 当 り 分 配 金 ( 税 込 み )

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、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。

# 住宅金融支援機構債マザーファンド

運用報告書 第15期 (決算日 2023年9月11日)

(作成対象期間 2023年3月11日～2023年9月11日)

住宅金融支援機構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。

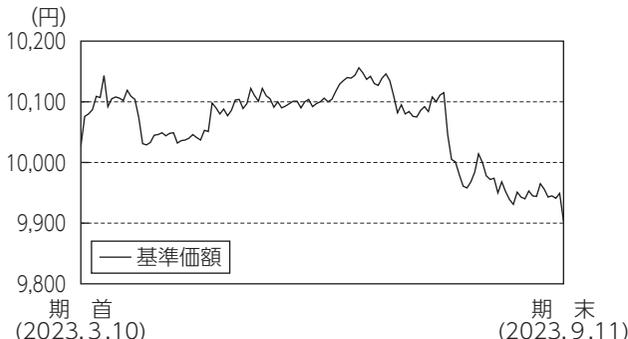
運用方針	安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の債券
株式組入制限	純資産総額の10%以下

## 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		ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数 (参考指数)		公社債組入比率	債券先物比率
	円	騰落率		騰落率	%	%
(期首)2023年3月10日	10,027	-	507.534	-	92.7	-
3月末	10,104	0.8	514.584	1.4	93.0	-
4月末	10,098	0.7	515.907	1.6	92.4	-
5月末	10,097	0.7	515,440	1.6	97.1	-
6月末	10,130	1.0	516.779	1.8	96.6	-
7月末	10,005	△0.2	508.731	0.2	99.6	-
8月末	9,944	△0.8	505.088	△0.5	99.1	-
(期末)2023年9月11日	9,903	△1.2	502.840	△0.9	98.8	-

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) ダイワ・ボンド・インデックス (DBI) 総合指数は、株式会社大和総研が公表している日本における債券市場のパフォーマンス・インデックスです。

(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：10,027円 期末：9,903円 騰落率：△1.2%

## 【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、債券価格の下落により、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

## ○国内債券市況

国内債券市況は、金利は上昇 (債券価格は下落) しました。

当作成期首より、欧米の金融システム不安を背景に長期金利は低下 (債券価格は上昇) しましたが、その後は当局の迅速な対応が評価されたことなどから、長期金利は上昇に転じました。さらに、2023年7月に日銀が長短金利操作 (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で、当作成期末にかけて長期金利は上昇しました。

国債利回りの上昇を受けて、住宅金融支援機構が発行する債券の利回りも上昇しました。

## ◆前作成期末における「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います。金利の方向性、利回り水準、格付けや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いました。金利の方向性、利回り水準、格付けや流動性等を総合的に勘案し、ポートフォリオを構築しました。

## ◆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。

## 《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います。金利の方向性、利回り水準、格付けや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。

## ■売買および取引の状況

## 公社債

(2023年3月11日から2023年9月11日まで)

		買付額	売付額
		千円	千円
国	特殊債券	200,000	101,832 (63,772)

(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。

# 住宅金融支援機構債マザーファンド

## ■主要な売買銘柄

### 公社債

(2023年3月11日から2023年9月11日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘柄	柄金額	銘柄	柄金額
193 住宅機構RMBS 0.96% 2058/6/10	100,000 千円	193 住宅機構RMBS 0.96% 2058/6/10	101,832 千円
194 住宅機構RMBS 0.94% 2058/7/10	100,000		

(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		
	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				
区分	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)	1,858,501	1,791,328	98.8	—	98.8	—	—	—	—

(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力しています。

### (2) 国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

区分	当		期		末	
	銘柄	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	54,352	54,047	2050/08/10	
	100 住宅機構RMBS	0.8400	158,592	157,354	2050/09/10	
	103 住宅機構RMBS	0.8600	114,090	113,086	2050/12/10	
	107 住宅機構RMBS	0.4800	615,520	593,299	2051/04/10	
	108 住宅機構RMBS	0.3400	632,150	604,082	2051/05/10	
	172 住宅機構RMBS	0.3100	91,127	84,365	2056/09/10	
	177 住宅機構RMBS	0.4000	93,159	86,805	2057/02/10	
	194 住宅機構RMBS	0.9400	99,511	98,287	2058/07/10	
合計	銘柄数	8銘柄		1,858,501	1,791,328	
	金額					

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2023年9月11日現在

項目	当期		末	
	評価額	比率	評価額	比率
	千円	%	千円	%
公社債	1,791,328	98.8		
コール・ローン等、その他	20,843	1.2		
投資信託財産総額	1,812,172	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9月11日現在

項目	当	期	末
(A) 資産	1,812,172,173円		
コール・ローン等	20,817,373		
公社債(評価額)	1,791,328,824		
未収利息	25,976		
(B) 負債	—		
(C) 純資産総額(A-B)	1,812,172,173		
元本	1,829,915,641		
次期繰越損益金	△ 17,743,468		
(D) 受益権総口数	1,829,915,641口		
1万口当り基準価額(C/D)	9,903円		

\*期首における元本額は1,919,342,683円、当作成期間中における追加設定元本額は1,847,919円、同解約元本額は91,274,961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:

住宅金融支援機構債マザーファンド(FOF s用)(適格機関投資家専用) 66,918,046円  
 ダイワ住宅金融支援機構債マザーファンド-Mr. フラットー 1,762,997,595円

\*当期末の計算口数当りの純資産額は9,903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17,743,468円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年3月11日 至2023年9月11日

項目	当	期
(A) 配当等収益	4,636,698円	
受取利息	4,660,498	
支払利息	△ 23,800	
(B) 有価証券売買損益	△26,728,339	
売買益	3,107,747	
売買損	△29,836,086	
(C) 当期損益金(A+B)	△22,091,641	
(D) 前期繰越損益金	5,159,987	
(E) 解約差損益金	△ 824,363	
(F) 追加信託差損益金	12,549	
(G) 合計(C+D+E+F)	△17,743,468	
次期繰越損益金(G)	△17,743,468	

(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。