

DCダイワ物価連動国債ファンド

運用報告書（全体版） 第13期 （決算日 2018年9月10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	無期限	
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	ベビーファンド	ダイワ物価連動国債マザーファンドの受益証券
	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
マザーファンドの運用方法	①主としてわが国の物価連動国債を中心とする国債に投資し、わが国の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ないます。 ②わが国の物価連動国債を中心とする国債への投資にあたっては、以下の観点からポートフォリオを構築します。 イ. 物価・金利分析、金融・財政政策分析、ファンダメンタルズ分析、利回り曲線の分析、個別銘柄の割高・割安分析等に基づいて物価連動国債を中心とするポートフォリオを構築します。 ロ. 組み入れは原則として高位を保ちます。 ③運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。	
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、配当等収益等を中心に分配します。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。	

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、「DCダイワ物価連動国債ファンド」は、このたび、第13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/>

最近5期の運用実績

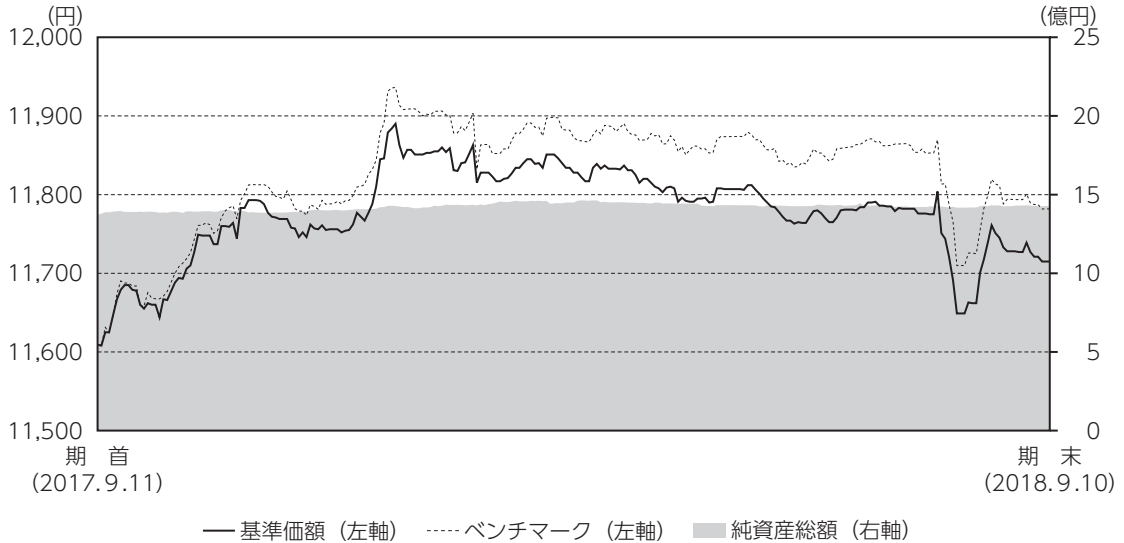
決 算 期	基 準 価 額			NOMU R A物価連動 国債インデックス		公 社 債 組入比率	債 券 先物比率	純 資 産 総 額
		税 込 配 分 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率			
9 期末(2014年 9月10日)	円	円	%		%	%	%	百万円
	12,288	0	7.4	12,415	6.6	99.2	－	1,309
10期末(2015年 9月10日)	12,056	0	△1.9	12,158	△2.1	100.2	－	1,477
11期末(2016年 9月12日)	11,625	0	△3.6	11,706	△3.7	99.0	－	1,317
12期末(2017年 9月11日)	11,609	0	△0.1	11,654	△0.4	99.2	－	1,372
13期末(2018年 9月10日)	11,715	0	0.9	11,827	1.5	99.0	－	1,428

- (注 1) NOMU R A物価連動国債インデックスは、NOMU R A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として大和投資信託が計算したものです。
- 「NOMU R A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ベンチマーク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 2) 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 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



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

* ベンチマークはNOMURA物価連動国債インデックスです。

■ 基準価額・騰落率

期 首：11,609円

期 末：11,715円

騰落率：0.9%

■ 基準価額の主な変動要因

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）の上昇による物価連動国債価格の上昇を主因として、基準価額は上昇しました。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 組 入 比 率	債 先 物 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2017年 9 月11日	円	%		%	%	%
	11,609	—	11,654	—	99.2	—
9 月末	11,662	0.5	11,720	0.6	99.0	—
10月末	11,759	1.3	11,829	1.5	99.2	—
11月末	11,746	1.2	11,819	1.4	99.3	—
12月末	11,879	2.3	11,978	2.8	99.2	—
2018年 1 月末	11,840	2.0	11,933	2.4	99.4	—
2 月末	11,839	2.0	11,932	2.4	99.1	—
3 月末	11,833	1.9	11,926	2.3	99.3	—
4 月末	11,791	1.6	11,908	2.2	99.4	—
5 月末	11,784	1.5	11,905	2.2	99.4	—
6 月末	11,780	1.5	11,909	2.2	99.3	—
7 月末	11,804	1.7	11,916	2.2	99.5	—
8 月末	11,739	1.1	11,847	1.7	99.1	—
(期末) 2018年 9 月10日	11,715	0.9	11,827	1.5	99.0	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2017.9.12～2018.9.10)

■国内物価連動国債市況

国内債券市場では、日銀が金融緩和継続のための枠組み強化を決定しましたが、同時に長期金利の変動幅拡大を容認する方針を示したことから、長期金利は上昇しました。また、原油価格の上昇を受けて、市場が予想する将来の物価上昇率は上昇しました。

前期における「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、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ないます。

■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ないます。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

(2017.9.12～2018.9.10)

■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、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ないました。

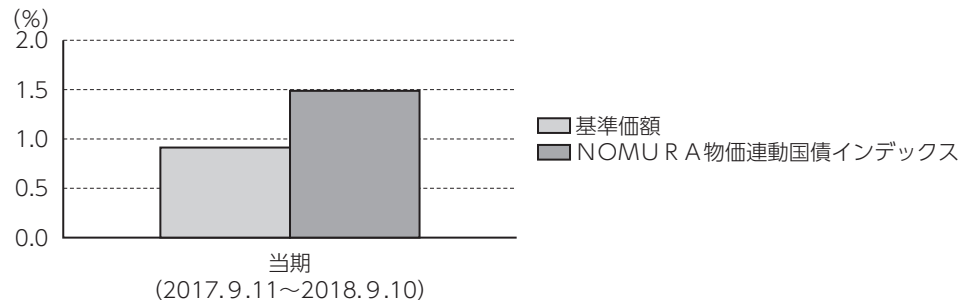
■ダイワ物価連動国債マザーファンド

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ないました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（NOMUR A物価連動国債インデックス）の騰落率は1.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は0.9%となりました。金利・物価見通しに基づくデュレーション戦略と信託報酬がマイナス要因となり、ベンチマークを下回る運用成績となりました。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配は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（1万口当たり）

項 目		当 期
		2017年9月12日 ～2018年9月10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)	—
翌期繰越分配対象額	(円)	1,982

- (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。



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、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ないます。

■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ないます。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 (2017.9.12~2018.9.10)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	51円	0.431%	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11,777円です。
(投 信 会 社)	(19)	(0.162)	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)	(27)	(0.226)	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)	(5)	(0.043)	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	1	0.005	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)	(1)	(0.005)	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	51	0.436	

(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9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	234,868	286,720	204,990	250,396

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

当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	1,143,272	1,173,150	1,427,606

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9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	1,427,606	99.7
コール・ローン等、その他	4,297	0.3
投資信託財産総額	1,431,903	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9月10日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,431,903,391円
コール・ローン等	4,297,124
ダイワ物価連動国債マザーファンド(評価額)	1,427,606,267
(B) 負債	3,634,379
未払解約金	506,042
未払信託報酬	3,089,586
その他未払費用	38,751
(C) 純資産総額(A－B)	1,428,269,012
元本	1,219,159,563
次期繰越損益金	209,109,449
(D) 受益権総口数	1,219,159,563口
1万口当り基準価額(C／D)	11,715円

* 期首における元本額は1,182,414,746円、当期中における追加設定元本額は373,013,415円、同解約元本額は336,268,598円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,715円です。

■損益の状況

当期 自2017年9月12日 至2018年9月10日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,693円
受取利息	191
支払利息	△ 1,884
(B) 有価証券売買損益	13,421,968
売買益	18,670,518
売買損	△ 5,248,550
(C) 信託報酬等	△ 6,206,643
(D) 当期損益金(A + B + C)	7,213,632
(E) 前期繰越損益金	△ 19,420,361
(F) 追加信託差損益金	221,316,178
(配当等相当額)	(194,886,955)
(売買損益相当額)	(26,429,223)
(G) 合計(D + E + F)	209,109,449
次期繰越損益金(G)	209,109,449
追加信託差損益金	221,316,178
(配当等相当額)	(194,886,955)
(売買損益相当額)	(26,429,223)
分配準備積立金	20,413,580
繰越損益金	△ 32,620,309

(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	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	221,316,178
(d) 分配準備積立金	20,413,580
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	241,729,758
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e－f)	241,729,758
(h) 受益権総口数	1,219,159,563口

<補足情報>

当ファンド（ＤＣダイワ物価連動国債ファンド）が投資対象としている「ダイワ物価連動国債マザーファンド」の決算日（2018年３月12日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2018年９月10日）現在におけるダイワ物価連動国債マザーファンドの組入資産の内容等を９ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ物価連動国債マザーファンドの主要な売買銘柄
公 社 債

(2017年9月12日から2018年9月10日まで)

買		付	売		付
銘	柄	金 額	銘	柄	金 額
22 物価連動国債 0.1% 2027/3/10		千円 1,064,925	17 物価連動国債 0.1% 2023/9/10		千円 539,778
23 物価連動国債 0.1% 2028/3/10		531,279			

(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

下記は、2018年9月10日現在におけるダイワ物価連動国債マザーファンド（9,739,846千口）の内容です。

(1) 国内（邦貨建）公社債（種類別）

区 分	2018年9月10日現在						
	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
国債証券	千円 11,000,000	千円 11,739,006	% 99.0	% －	% 99.0	% －	% －

(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）

2018年9月10日現在						
区 分	銘	柄	年 利 率	額 面 金 額	評 価 額	償 還 年 月 日
国債証券	17 物価連動国債		% 0.1000	千円 2,500,000	千円 2,693,570	2023/09/10
	18 物価連動国債		0.1000	4,800,000	5,151,820	2024/03/10
	19 物価連動国債		0.1000	1,200,000	1,256,169	2024/09/10
	20 物価連動国債		0.1000	500,000	525,705	2025/03/10
	21 物価連動国債		0.1000	300,000	315,892	2026/03/10
	22 物価連動国債		0.1000	1,200,000	1,270,287	2027/03/10
	23 物価連動国債		0.1000	500,000	525,561	2028/03/10
合 計	銘 柄 数	7銘柄		11,000,000	11,739,006	
	金 額					

(注) 単位未満は切捨て。

ダイワ物価連動国債マザーファンド

運用報告書 第13期（決算日 2018年3月12日）

（計算期間 2017年3月11日～2018年3月12日）

ダイワ物価連動国債マザーファンドの第13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
運 用 方 法	①主としてわが国の物価連動国債を中心とする国債に投資し、わが国の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ないます。 ②わが国の物価連動国債を中心とする国債への投資にあたっては、以下の観点からポートフォリオを構築します。 イ．物価・金利分析、金融・財政政策分析、ファンダメンタルズ分析、利回り曲線の分析、個別銘柄の割高・割安分析等に基づいて物価連動国債を中心とするポートフォリオを構築します。 ロ．組み入れは原則として高位を保ちます。 ③運用の効率化を図るため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額ならびに債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。
株 式 組 入 制 限	純資産総額の10%以下

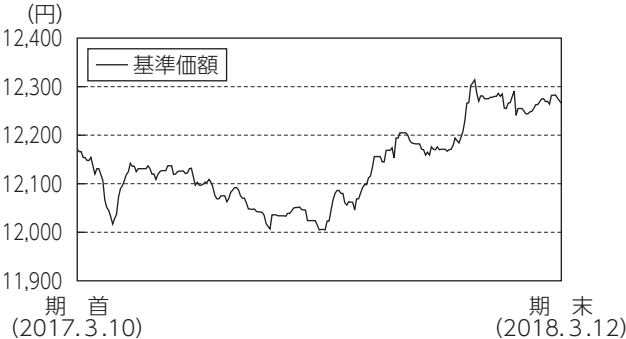
大和投資信託

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		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 %		騰 落 率 %		
(期首)2017年 3月10日	12,171	—	11,519	—	99.3	—
3月末	12,067	△0.9	11,419	△0.9	99.4	—
4月末	12,131	△0.3	11,477	△0.4	99.6	—
5月末	12,126	△0.4	11,474	△0.4	98.8	—
6月末	12,063	△0.9	11,410	△1.0	98.7	—
7月末	12,018	△1.3	11,354	△1.4	99.1	—
8月末	12,024	△1.2	11,359	△1.4	99.1	—
9月末	12,063	△0.9	11,403	△1.0	99.1	—
10月末	12,169	△0.0	11,508	△0.1	99.1	—
11月末	12,159	△0.1	11,499	△0.2	99.3	—
12月末	12,302	1.1	11,653	1.2	99.2	—
2018年 1月末	12,266	0.8	11,609	0.8	99.3	—
2月末	12,269	0.8	11,608	0.8	99.1	—
(期末)2018年 3月12日	12,266	0.8	11,605	0.7	99.2	—

(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として大和投資信託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) 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：12,171円 期末：12,266円 騰落率：0.8%

【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、長期金利の低下を主因に基準価額は上昇しました。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

国内長期金利は、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が、期首比では小幅に低下しました。

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）は、円高を受けて一時下落しましたが、原油価格等の資源価格の上昇を受けて上昇に転じたことから、期首比でおおむね横ばいの水準となりました。

◆前期における「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ないます。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。

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ないます。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	—
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 3月11日から2018年 3月12日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円	千円
		1,061,136	— (—)

(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

(2017年3月11日から2018年3月12日まで)

当		期	
買	付	売	付
銘	柄	銘	柄
金 額		金 額	
千円		千円	
22 物価連動国債 0.1% 2027/3/10		1,061,136	

(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		
					5年以上	2年以上	2年未満
	千円	千円	%	%	%	%	%
国債証券	10,800,000	11,634,130	99.2	—	99.2	—	—

(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		
国債証券	17 物価連動国債	0.1000	3,000,000	3,255,706	2023/09/10	
	18 物価連動国債	0.1000	4,800,000	5,191,444	2024/03/10	
	19 物価連動国債	0.1000	1,200,000	1,268,109	2024/09/10	
	20 物価連動国債	0.1000	500,000	529,682	2025/03/10	
	21 物価連動国債	0.1000	300,000	318,820	2026/03/10	
	22 物価連動国債	0.1000	1,000,000	1,070,368	2027/03/10	
合計	銘柄数 金 額	6銘柄	10,800,000	11,634,130		

(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	%
公社債	11,634,130	99.2
コール・ローン等、その他	88,659	0.8
投資信託財産総額	11,722,790	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	11,722,790,361円
コール・ローン等	88,598,724
公社債(評価額)	11,634,130,935
未収利息	60,702
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A－B)	11,722,790,361
元本	9,557,373,096
次期繰越損益金	2,165,417,265
(D) 受益権総口数	9,557,373,096口
1万口当り基準価額(C／D)	12,266円

*期首における元本額は8,682,599,276円、当中における追加設定元本額は1,225,515,964円、同解約元本額は350,742,144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8,375,830,839円、DCダイワ物価連動国債ファンド1,181,542,257円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は12,266円です。

■損益の状況

当期 自2017年3月11日 至2018年3月12日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	10,409,921円
受取利息	10,465,245
支払利息	△ 55,324
(B) 有価証券売買損益	78,321,388
売買益	78,480,655
売買損	△ 159,267
(C) その他費用	△ 188
(D) 当期損益金(A + B + C)	88,731,121
(E) 前期繰越損益金	1,885,255,365
(F) 解約差損益金	△ 74,692,367
(G) 追加信託差損益金	266,123,146
(H) 合計(D + E + F + G)	2,165,417,265
次期繰越損益金(H)	2,165,417,265

(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。