

D－I's 日経225 インデックス

★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／株式／インデックス型	
信託期間	約14年9カ月間（2013年12月9日～2028年9月19日）	
運用方針	投資成果を日経平均株価（日経225）の動きに連動させることをめざして運用を行います。	
主 要 投 資 対 象	ベビーファンド	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
マザーファンドの運用方法	投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行いません。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行います。 ロ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。	
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	無制限
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、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から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、配当等収益が少額の場合には、分配を行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いません。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。

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2015年9月24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、「D－I's 日経225インデックス」は、このたび、第2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/>

設定以来の運用実績

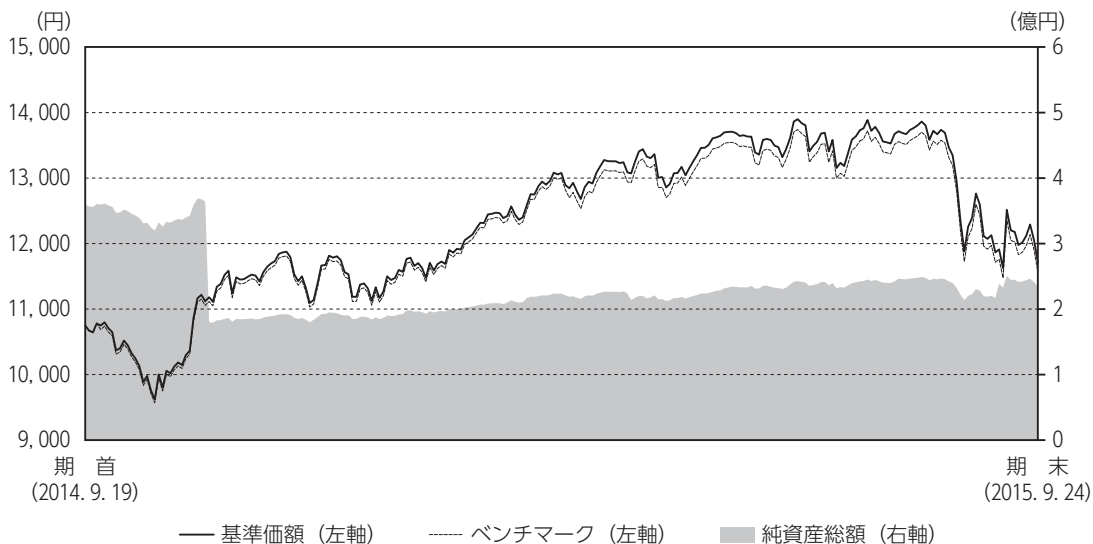
決 算 期	基 準 価 額			日経平均株価		株 式 組入比率	株 式 先物比率	純資産 総 額
		税込み 分配金	期 中 騰落率	(ベンチマーク)	期 中 騰落率			
	円	円	%	円	%	%	%	百万円
1 期末 (2014年 9 月19日)	10,747	0	7.5	16,321.17	6.7	98.2	1.8	359
2 期末 (2015年 9 月24日)	11,712	0	9.0	17,571.83	7.7	98.4	1.6	234

(注 1) 株式および株式先物の組入比率は、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 2) 株式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。

* ベンチマークは日経平均株価です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,747円

期末：11,712円

騰落率：9.0%

■ 基準価額の主な変動要因

日経平均株価への連動をめざした運用を行なった結果、日経平均株価の動きを反映して、基準価額は値上がりしました。

D－I’s 日経225インデックス

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%	円	%	%	%
(期首) 2014年 9 月19日	10,747	—	16,321.17	—	98.2	1.8
9 月末	10,708	△ 0.4	16,173.52	△ 0.9	98.1	1.8
10月末	10,866	1.1	16,413.76	0.6	97.6	2.3
11月末	11,560	7.6	17,459.85	7.0	98.0	2.0
12月末	11,562	7.6	17,450.77	6.9	98.2	1.8
2015年 1 月末	11,703	8.9	17,674.39	8.3	98.5	1.5
2 月末	12,453	15.9	18,797.94	15.2	98.4	1.5
3 月末	12,792	19.0	19,206.99	17.7	97.6	2.4
4 月末	13,006	21.0	19,520.01	19.6	97.4	4.2
5 月末	13,703	27.5	20,563.15	26.0	96.5	2.7
6 月末	13,490	25.5	20,235.73	24.0	98.5	1.5
7 月末	13,715	27.6	20,585.24	26.1	98.3	1.7
8 月末	12,596	17.2	18,890.48	15.7	98.4	1.6
(期末) 2015年 9 月24日	11,712	9.0	17,571.83	7.7	98.4	1.6

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首から2014年10月中旬にかけて、世界経済の不透明感の強まりやエボラ出血熱の感染拡大懸念、2大臣辞任による国内政治不安などにより下落しました。10月下旬以降は、日銀の追加金融緩和やGPIF（年金積立金管理運用独立行政法人）の国内株式運用比率引上げ決定、円安の大幅な進行などを受けて、株価は急速に上昇しました。12月から2015年1月前半にかけては、原油価格急落によるロシア経済不安やギリシャ情勢の混迷によるユーロ安などが警戒され株価も一時下落しましたが、1月後半以降は、ECB（欧州中央銀行）による量的金融緩和の決定や国内景気の持ち直し、良好な株式需給関係、さらなる円安の進行などを受けて、株価は大きく上昇しました。6月からは、ギリシャ支援協議の難航によりギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念が一時高まったことや、中国株式市況の急落を受け中国経済への不安が高まったこと、さらには世界経済減速懸念も台頭したことから日本株式市況も弱含みになり、8月中旬以降は急落しました。その後は一進一退の推移で期末を迎えました。

前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行なっております。

ポートフォリオについて

○当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組入れて運用を行ないました。

○ストックインデックス225・マザーファンド

株式の組入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、日経平均株価採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行ない、日経平均株価の動きに連動するよ

うに、ポートフォリオを構築し運用しております。当期につきましては、日経平均株価採用銘柄すべてを組入れて運用を行ないました。

また、日経平均株価採用銘柄の入替え時には、その都度、組入銘柄の入替えを行ない、連動性の維持に努めました。

ベンチマークとの差異について

- ・ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は7.7%となりました。一方、当ファンドの騰落率は9.0%となりました。

ほぼ100%組入れているマザーファンドに組入銘柄の配当金が計上されたのに対し、ベンチマークである日経平均株価には配当金の影響が考慮されていないことが、プラスのかい離要因となりました。

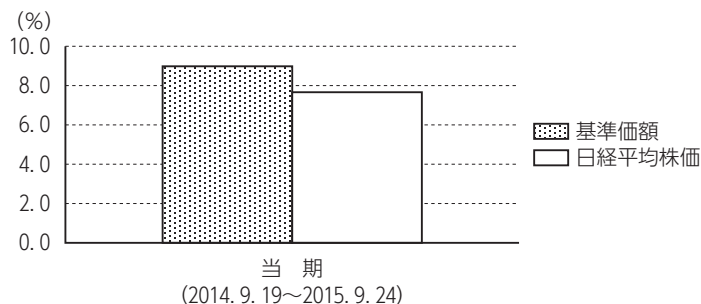
また、ファンドから信託報酬等コストが控除されたことがマイナス要因となりました。

- ・トラッキング・エラーは、過去1年（2014年9月～2015年8月）で0.81%と低位で安定しております。

※トラッキング・エラーとは、ファンドの基準価額の騰落率からベンチマーク（日経平均株価）の騰落率を差し引いた超過騰落率の振れの度合いを示すもので、この値が低いほど、ファンドのベンチマークに対する連動率が高いと考えることができます。

具体的には過去1年の毎月の超過騰落率を二乗し、その平均値の平方根を年率換算して算出します。

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少額であったため、収益の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（1万口当り）

項 目		当 期
		2014年9月20日 ～2015年9月24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)	1,711

（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

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価に連動する投資成果をめざして「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を高位に組入れて運用を行なってまいります。

○ストックインデックス225・マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2014. 9. 20～2015. 9. 24)		
	金 額	比 率	
信託報酬	54円	0. 438%	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12, 337円です。
(投信会社)	(26)	(0. 208)	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)	(24)	(0. 197)	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)	(4)	(0. 033)	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	2	0. 017	売買委託手数料＝期中の売買委託手数料／期中の平均受益権総口数 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
(株式)	(0)	(0. 000)	
(先物)	(2)	(0. 017)	
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. 006	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
(その他)	(0)	(0. 001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	57	0. 461	

(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

(2014年9月20日から2015年9月24日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ストックインデックス225・マザーファンド	33,737	72,860	111,777	217,680

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2014年9月20日から2015年9月24日まで)

項 目	当 期
	ストックインデックス225・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	114,106,757千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	128,950,541千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.88

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況

(1) ベビーファンドにおける期中の利害関係人との取引状況

当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期中の利害関係人との取引状況

(2014年9月20日から2015年9月24日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	51,008	1,736	3.4	63,098	17,295	27.4
株式先物取引	47,431	—	—	48,069	—	—
コール・ローン	677,156	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.2%

※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) 利害関係人の発行する有価証券等

(2014年9月20日から2015年9月24日まで)

種 類	当 期		
	ストックインデックス225・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	96	131	229

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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

(2014年9月20日から2015年9月24日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	42千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B) / (A)	0.1%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

※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、当期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社です。

■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
ストックインデックス225・マザーファンド	193,515	115,475	234,691

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年9月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	234,691	99.8
コール・ローン等、その他	571	0.2
投資信託財産総額	235,263	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

2015年9月24日現在	
項 目	当 期 末
(A) 資産	235, 263, 202円
コール・ローン等	546, 229
ストックインデックス225・	
マザーファンド（評価額）	234, 691, 973
未収入金	25, 000
(B) 負債	523, 520
未払信託報酬	517, 149
その他未払費用	6, 371
(C) 純資産総額（A－B）	234, 739, 682
元本	200, 428, 112
次期繰越増益金	34, 311, 570
(D) 受益権総口数	200, 428, 112口
1万口当り基準価額（C／D）	11, 712円

* 期首における元本額は334, 388, 174円、当期中における追加設定元本額は63, 039, 369円、同解約元本額は196, 999, 431円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は11, 712円です。

■損益の状況

項 目	当 期
(A) 配当等収益	26円
受取利息	26
(B) 有価証券売買損益	9, 877, 655
売買益	20, 065, 237
売買損	△ 10, 187, 582
(C) 信託報酬等	△ 1, 034, 080
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	8, 843, 601
(E) 前期繰越増益金	16, 405, 736
(F) 追加信託差損益金	9, 062, 233
（配当等相当額）	（ 7, 014, 877）
（売買損益相当額）	（ 2, 047, 356）
(G) 合計（D＋E＋F）	34, 311, 570
次期繰越増益金（G）	34, 311, 570
追加信託差損益金	9, 062, 233
（配当等相当額）	（ 7, 014, 877）
（売買損益相当額）	（ 2, 047, 356）
分派準備積立金	25, 249, 337

（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）」の表を参照。

■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	26円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	8, 843, 575
(c) 収益調整金	9, 062, 233
(d) 分派準備積立金	16, 405, 736
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	34, 311, 570
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	34, 311, 570
(h) 受益権総口数	200, 428, 112口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

《お知らせ》

●運用報告書（全体版）の電子交付について

2014年12月1日施行の法改正により、運用報告書は「交付運用報告書」と「運用報告書（全体版）」（本書）の2種類になりましたが、「運用報告書（全体版）」については、交付に代えて電子交付する旨を信託約款に決めました。

●書面決議手続きの改正について

重大な約款変更や繰上償還の際に行なう書面決議について、2014年12月1日施行の法改正により以下の点が変更されたことに伴い、信託約款の該当箇所の変更を行ないました。

・書面決議の可決要件が、「受益者の半数以上の賛成かつ受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」から「受益者の保有する議決権の3分の2以上の賛成を得ること」に変更されました。

・投資信託の併合を行なう際、すべての場合で書面決議が必要とされてきましたが、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものであるときは、当該併合に関する書面決議が不要となりました。

・書面決議に反対した受益者による受益権買取請求の規定について、一部解約請求に応じる投資信託（当ファンドは該当します。）には適用されなくなりました。

【注記】

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「D－I's 日経225インデックス」について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

ストックインデックス 225・マザーファンド

運用報告書 第14期（決算日 2015年 9月24日）

（計算期間 2014年 9月20日～2015年 9月24日）

ストックインデックス 225・マザーファンドの第14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	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
運用方法	投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 ロ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。
株式組入制限	無制限

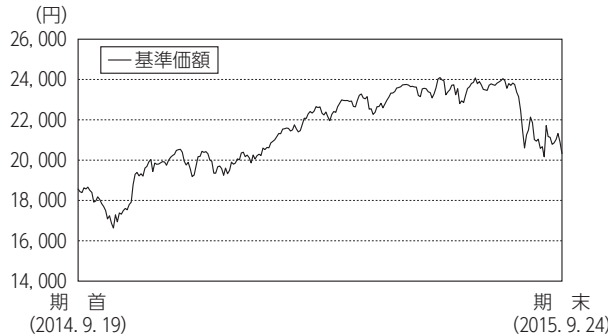
大和投資信託

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		日経平均株価		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	円	騰落率	(ベンチマーク) 円	騰落率		
(期首) 2014年 9月19日	18,567	—	16,321.17	—	98.2	1.8
9月末	18,503	△ 0.3	16,173.52	△ 0.9	98.2	1.8
10月末	18,782	1.2	16,413.76	0.6	97.7	2.3
11月末	19,989	7.7	17,459.85	7.0	98.0	2.0
12月末	20,000	7.7	17,450.77	6.9	98.2	1.8
2015年 1月末	20,251	9.1	17,674.39	8.3	98.5	1.5
2月末	21,556	16.1	18,797.94	15.2	98.5	1.5
3月末	22,151	19.3	19,206.99	17.7	97.6	2.4
4月末	22,530	21.3	19,520.01	19.6	97.4	4.2
5月末	23,747	27.9	20,563.15	26.0	96.6	2.7
6月末	23,386	26.0	20,235.73	24.0	98.5	1.5
7月末	23,785	28.1	20,585.24	26.1	98.3	1.7
8月末	21,853	17.7	18,890.48	15.7	98.4	1.6
(期末) 2015年 9月24日	20,324	9.5	17,571.83	7.7	98.4	1.6

(注 1) 騰落率は期首比。
(注 2) 株式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：18,567円 期末：20,324円 騰落率：9.5%

【基準価額の主な変動要因】

日経平均株価への連動をめざした運用を行なった結果、日経平均株価の動きを反映して、基準価額は値上がりしました。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首から2014年10月中旬にかけて、世界経済の不透明感の強まりやエボラ出血熱の感染拡大懸念、2大臣辞任による国内政治不安などにより下落しました。10月下旬以降は、日銀の追加金融緩和やGPIF（年金積立金管理運用独立行政法人）の国内株式運用比率引上げ決定、円安の大幅な進行などを受けて、株価は急速に上昇しました。12月から2015年1月前半にかけては、原油価格急落によるロシア経済不安やギリシャ情勢の混迷によるユーロ安などが警戒され株価も一時下落しましたが、1月後半以降は、ECB（欧州中央銀行）による量的金融緩和の決定や国内景気の持ち直し、良好な株式需給関係、さらなる円安の進行などを受けて、株価は大きく上昇しました。6月からは、ギリシャ支援協議の難航によりギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念が一時高まったことや、中国株式市況の急落を受け中国経済への不安が高まったこと、さらには世界経済減速懸念も台頭したことから日本株式市況も弱含みになり、8月中旬以降は急落しました。その後は一進一退の推移で期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

◆ポートフォリオについて

株式の組入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、日経平均株価採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行ない、日経平均株価の動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当期につきましては、日経平均株価採用銘柄すべてを組入れて運用を行ないました。

また、日経平均株価採用銘柄の入替え時には、その都度、組入銘柄の入替えを行ない、流動性の維持に努めました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は7.7%となりました。一方、当ファンドの騰落率は9.5%となりました。

- ・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。
- ・資金の流入に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担が、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価に連動する投資成果をめざして運用を行なってまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	4円 (0)
(先物)	(4)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	4

- (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、簡便法により算出した結果です。費用の項目および算出方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) 各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

(1) 株 式

(2014年 9 月20日から2015年 9 月24日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 (23,682.8 668.7)	千円 (51,008,735 —)	千株 29,045.8	千円 63,098,022

- (注 1) 金額は受渡し代金。
- (注 2) ()内は株式分割、合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。
- (注 3) 金額の単位未満は切捨て。

(2)先物取引の種別取引状況

(2014年 9 月20日から2015年 9 月24日まで)

種 類 別		買 建		売 建	
		新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国内	株式先物取引	百万円 47,431	百万円 48,069	百万円 —	百万円 —

- (注 1) 金額は受渡し代金。
- (注 2) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

株 式

(2014年 9 月20日から2015年 9 月24日まで)

当 期				期			
買 付				売 付			
銘 柄	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
ファーストリテイリング	112	5,154,823	46,025	ファーストリテイリング	138	6,107,044	44,253
ファナック	112	2,369,699	21,158	ソフトバンクグループ	414	3,166,259	7,647
ソフトバンクグループ	336	2,362,437	7,031	ファナック	138	3,016,606	21,859
KDDI	488	1,808,220	3,705	KDDI	388	2,155,999	5,556
京セラ	224	1,269,658	5,668	京セラ	276	1,580,611	5,726
アステラス製薬	560	968,076	1,728	アステラス製薬	690	1,247,522	1,808
ダイキン工業	112	839,382	7,494	東京エレクトロン	138	1,078,992	7,818
日東電工	112	834,848	7,454	ダイキン工業	138	1,054,070	7,638
TDK	112	834,109	7,447	本田技研	276	1,048,734	3,799
本田技研	224	827,577	3,694	信越化学	138	1,047,222	7,588

- (注 1) 金額は受渡し代金。
- (注 2) 金額の単位未満は切捨て。

ストックインデックス225・マザーファンド

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首	当期末		銘柄	期首	当期末		銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.1%)				三井化学	320	294	116,424	住友電工	320	294	461,286
日本水産	320	294	104,370	三菱ケミカル HLDGS	160	147	94,770	フジクラ	320	294	155,820
マルハニチロ	32	29.4	49,245	宇部興産	320	294	61,152	金属製品 (0.5%)			
鉱業 (0.1%)				日本化薬	320	294	378,672	SUMCO	32	29.4	32,428
国際石油開発帝石	128	117.6	127,537	花王	320	294	1,499,400	東洋製罐グループ HD	320	294	565,656
建設業 (2.7%)				富士フイルム HLDGS	320	294	1,362,102	機械 (4.4%)			
コムシスホールディングス	320	294	403,368	資生堂	320	294	748,083	日本製鋼所	320	294	112,014
大成建設	320	294	219,618	日東電工	320	294	2,137,968	オークマ	320	294	225,204
大林組	320	294	286,650	医薬品 (7.7%)				アマダホールディングス	320	294	273,714
清水建設	320	294	302,820	協和発酵キリン	320	294	508,032	小松製作所	320	294	541,107
鹿島建設	320	294	183,456	武田薬品	320	294	1,600,830	住友重機械	320	294	151,410
大和ハウス	320	294	844,956	アステラス製薬	1,600	1,470	2,318,925	日立建機	320	294	487,452
積水ハウス	320	294	533,316	大日本住友製薬	320	294	369,852	クボタ	320	294	501,417
日揮	320	294	476,721	塩野義製薬	320	294	1,312,710	荏原製作所	320	294	133,476
千代田化工建	320	294	245,490	中外製薬	320	294	1,127,490	ダイキン工業	320	294	2,036,832
食料品 (5.1%)				エーザイ	320	294	2,211,468	日本精工	320	294	351,330
日清製粉G本社	320	294	474,810	第一三共	320	294	624,897	N T N	320	294	157,878
明治ホールディングス	32	29.4	505,386	石油・石炭製品 (0.3%)				ジェイテクト	320	294	484,218
日本ハム	320	294	711,480	昭和シエル石油	320	294	281,064	日立造船	64	58.8	36,514
サッポロホールディングス	320	294	132,006	JX ホールディングス	320	294	133,476	三菱重工業	320	294	158,554
アサヒグループホールディン	320	294	1,103,970	ゴム製品 (1.2%)				I H I	320	294	95,844
キリンHD	320	294	465,255	横浜ゴム	320	147	311,199	電気機器 (16.8%)			
宝ホールディングス	320	294	206,388	ブリヂストン	320	294	1,220,394	コニカミノルタ	320	294	383,376
キッコーマン	320	294	968,730	ガラス・土石製品 (1.6%)				ミネベア	320	294	397,194
味の素	320	294	712,950	日東紡績	320	294	106,134	日立	320	294	182,721
ニチレイ	320	294	202,566	旭硝子	320	294	212,562	東芝	320	294	90,640
日本たばこ産業	320	294	1,173,648	日本板硝子	320	294	30,576	三菱電機	320	294	322,959
繊維製品 (0.7%)				日本電気硝子	480	441	261,954	富士電機	320	294	132,006
東洋紡	320	294	47,628	住友大阪セメント	320	294	132,300	安川電機	320	294	368,088
ユニチカ	320	294	17,640	太平洋セメント	320	294	106,134	明電舎	320	294	107,898
日清紡ホールディングス	320	294	409,542	東海カーボン	320	294	82,320	ジーエス・ユアサ コーポ	320	294	130,830
帝人	320	294	107,898	T O T O	320	294	494,802	日本電気	320	294	110,250
東レ	320	294	306,495	日本碍子	320	294	702,366	富士通	320	294	165,933
パルプ・紙 (0.3%)				鉄鋼 (0.2%)				沖電気	320	294	55,860
王子ホールディングス	320	294	160,818	新日鐵住金	320	294	67,355	パナソニック	320	294	367,500
日本製紙	32	29.4	57,036	神戸製鋼所	320	294	43,806	シャープ	320	294	45,570
北越紀州製紙	320	294	199,038	J F Eホールディングス	32	29.4	49,230	ソニー	320	294	890,820
化学 (7.9%)				日新製鋼	32	29.4	33,310	T D K	320	294	2,096,220
クラレ	320	294	424,536	大平洋金属	320	294	86,730	ミツミ電機	320	294	192,864
旭化成	320	294	259,161	非鉄金属 (1.3%)				アルプス電気	320	294	1,043,700
昭和電工	320	294	39,396	日本軽金属HD	320	294	52,038	パイオニア	320	294	83,496
住友化学	320	294	181,104	三井金属	320	294	67,914	横河電機	320	294	380,142
日産化学	320	294	773,808	東邦亜鉛	320	294	87,318	アドバンテス	640	588	524,496
日本曹達	320	294	200,214	三菱マテリアル	320	294	112,308	カシオ	320	294	665,616
東ソー	320	294	168,756	住友鉱山	320	294	418,656	ファナック	320	294	5,772,690
トクヤマ	320	294	56,742	DOWA ホールディングス	320	294	274,008	京セラ	640	588	3,279,864
電気化学	320	294	138,180	古河機金	320	294	70,266	太陽誘電	320	294	445,116
信越化学	320	294	1,799,280	古河電工	320	294	56,742	SCREEN ホールディングス	320	294	174,930

銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末		銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
キヤノン	480	441	1,552,320		情報・通信業 (10.8%)					T&D ホールディングス				
リコー	320	294	365,148		ヤフー	128	117.6	53,272		その他金融業 (0.5%)				
東京エレクトロン	320	294	1,745,478		トレンドマイクロ	320	294	1,224,510		クレディセゾン				
輸送用機器 (7.1%)					スカパー JSATHD	32	29.4	15,640		不動産業 (2.5%)				
デンソー	320	294	1,570,842		日本電信電話	32	58.8	254,545		東急不動産HD	320	294	229,908	
三井造船	320	294	54,096		KDDI	640	1,764	4,806,018		三井不動産	320	294	916,986	
川崎重工業	320	294	128,184		NTTドコモ	32	29.4	63,312		三菱地所	320	294	703,248	
日産自動車	320	294	326,781		東宝	32	29.4	77,527		平和不動産	64	58.8	73,735	
いすゞ自動車	320	147	182,280		NTTデータ	320	294	1,752,240		東京建物	320	147	204,918	
トヨタ自動車	320	294	2,087,400		コナミ	320	294	746,172		住友不動産	320	294	1,116,318	
日野自動車	320	294	379,554		ソフトバンクグループ	960	882	5,180,868		サービス業 (3.1%)				
三菱自動車工業	32	29.4	27,400		卸売業 (2.1%)					電通	320	294	1,805,160	
マツダ	64	58.8	107,956		双日	32	29.4	6,791		東京ドーム	320	294	149,646	
本田技研	640	588	2,167,956		伊藤忠	320	294	395,724		セコム	320	294	2,139,438	
スズキ	320	294	1,087,506		丸紅	320	294	186,572						
富士重工業	320	294	1,247,442		豊田通商	320	294	766,164						
精密機器 (2.8%)					三井物産	320	294	442,470						
テルモ	640	588	1,866,900		住友商事	320	294	363,090						
ニコン	320	294	423,066		三菱商事	320	294	610,638						
オリンパス	320	294	1,206,870		小売業 (13.0%)									
シチズンホールディングス	320	294	232,260		J. フロントリテイリング	160	147	268,569						
その他製品 (1.1%)					三越伊勢丹HD	320	294	522,144						
凸版印刷	320	294	279,888		セブン&アイ・HLDS	320	294	1,554,672						
大日本印刷	320	294	337,659		高島屋	320	294	272,538						
ヤマハ	320	294	767,928		丸井グループ	320	294	409,248						
電気・ガス業 (0.3%)					イオン	320	294	519,351						
東京電力	32	29.4	23,255		ユニーグループ・HD	320	294	212,856						
中部電力	32	29.4	51,156		ファーストリテイリング	320	294	13,318,200						
関西電力	32	29.4	37,573		銀行業 (1.3%)									
東京瓦斯	320	294	168,991		新生銀行	320	294	70,854						
大阪瓦斯	320	294	132,417		あおぞら銀行	320	294	127,596						
陸運業 (2.5%)					三菱UFJフィナンシャルG	320	294	212,650						
東武鉄道	320	294	150,234		りそなホールディングス	32	29.4	17,684						
東京急行	320	294	255,780		三井住友トラストHD	320	294	127,360						
小田急電鉄	320	294	316,638		三井住友フィナンシャルG	32	29.4	133,975						
京王電鉄	320	294	246,078		千葉銀行	320	294	241,374						
京成電鉄	320	294	366,618		横浜銀行	320	294	201,213						
東日本旅客鉄道	32	29.4	299,145		ふくおかフィナンシャルG	320	294	157,584						
西日本旅客鉄道	32	29.4	216,531		静岡銀行	320	294	346,626						
東海旅客鉄道	32	29.4	551,397		みずほフィナンシャルG	320	294	67,090						
日本通運	320	294	170,814		証券・商品先物取引業 (0.6%)									
ヤマトホールディングス	320	294	678,258		大和証券G本社	320	294	229,937						
海運業 (0.2%)					野村ホールディングス	320	294	208,651						
日本郵船	320	294	86,142		松井証券	320	294	304,878						
商船三井	320	294	91,728		保険業 (1.1%)									
川崎汽船	320	294	80,850		損保ジャパン興亜HD	80	73.5	258,205						
空運業 (0.1%)					MS&AD	96	88.2	286,209						
ANAホールディングス	320	294	100,459		SONY F H	64	58.8	118,776						
倉庫・運輸関連業 (0.3%)					第一生命	32	29.4	55,051						
三菱倉庫	320	294	420,714		東京海上HD	160	147	634,746						

銘柄別	当期末		銘柄別	当期末	
	買建額	売建額		買建額	売建額
国内	百万円	百万円	国内	百万円	百万円
日経平均	2,128	—	日経平均	2,128	—

(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)

銘柄別	当期末	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	2,128	—

(注) 単位未満は切捨て。

ストックインデックス225・マザーファンド

■投資信託財産の構成

2015年9月24日現在		
項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	131,596,487	97.5
コール・ローン等、その他	3,316,715	2.5
投資信託財産総額	134,913,203	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

2015年9月24日現在		
項 目	当 期 末	
(A) 資産	135,754,518,376円	
コール・ローン等	3,237,827,476	
株式（評価額）	131,596,487,400	
未収配当金	78,888,500	
差入委託証拠金	841,315,000	
(B) 負債	2,035,047,141	
未払金	73,792,141	
未払解約金	1,094,955,000	
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000	
(C) 純資産総額（A－B）	133,719,471,235	
元本	65,793,251,657	
次期繰越損益金	67,926,219,578	
(D) 受益権総口数	65,793,251,657口	
1万口当り基準価額（C／D）	20,324円	

- * 期首における元本額は72,964,236,064円、当期中における追加設定元本額は32,049,626,144円、同解約元本額は39,220,610,551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、ストックインデックスファンド225 39,850,315,246円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225ⅤA 1,552,179,123円、大和ストックインデックス225ファンド 14,839,385,229円、D－I's 日経225インデックス115,475,287円、DC・ダイワ・ストックインデックス225（確定拠出年金専用ファンド）5,140,773,975円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト12Ver2ー 201,603,813円、ダイワ・インデックスセレクト 日経225 4,093,518,984円です。
- * 当期末の計算口数当りの純資産額は20,324円です。

■損益の状況

当期 自2014年9月20日 至2015年9月24日		
項 目	当 期	
(A) 配当等収益	2,114,434,937円	
受取配当金	2,112,670,804	
受取利息	1,432,578	
その他収益金	331,555	
(B) 有価証券売買損益	10,609,506,530	
売買益	18,255,338,033	
売買損	△ 7,645,831,503	
(C) 先物取引等損益	365,543,373	
取引益	1,025,981,671	
取引損	△ 660,438,298	
(D) その他費用	△ 1,625,676	
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	13,087,859,164	
(F) 前期繰越損益金	62,509,074,404	
(G) 解約差損益金	△ 42,209,327,846	
(H) 追加信託差損益金	34,538,613,856	
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	67,926,219,578	
次期繰越損益金（I）	67,926,219,578	

- (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。