

★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10年3カ月間（2014年1月6日～2024年3月22日）	
運用方針	投資成果をＪＰＸ日経インデックス400の動きに連動させること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ＪＰＸ日経400マザーファンドの受益証券
	ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。以下同じ。）
ベビーファンドの運用方法	①主として、マザーファンドの受益証券を通じて、わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）に投資し、投資成果をＪＰＸ日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ②マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。 ③株式以外の資産（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50％以下とします。	
マザーファンドの運用方法	①主として、わが国の金融商品取引所上場株式に投資し、投資成果をＪＰＸ日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ②株式の組入比率は、通常の状態 で高位に維持することを基本とします。 ③運用の効率化をはかるため、わが国の株価指数先物取引を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引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	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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等が少額の場合には、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。

ダイワＪＰＸ日経400ファンド

運用報告書（全体版）
第5期
(決算日 2018年3月22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、「ダイワＪＰＸ日経400ファンド」は、このたび、第5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			J P X日経インデックス400		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 配 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率			
1 期末(2014年 3月24日)	円 9,013	円 0	% △ 9.9	8,946	% △10.5	% 98.5	% 1.6	百万円 5,406
2 期末(2015年 3月23日)	12,401	120	38.9	12,295	37.4	98.0	1.9	17,813
3 期末(2016年 3月22日)	10,726	0	△13.5	10,509	△14.5	98.9	1.3	24,564
4 期末(2017年 3月22日)	11,820	230	12.3	11,625	10.6	99.3	1.1	20,295
5 期末(2018年 3月22日)	13,116	270	13.2	12,980	11.7	99.2	2.0	13,889

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
(注2) J P X日経インデックス400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として大和投資信託が計算したものです。
(注3) 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4) 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１）期末の基準価額は分配金込みです。

（注２）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ＪＰＸ日経インデックス400です。

■基準価額・騰落率

期 首：11,820円

期 末：13,116円（分配金270円）

騰落率：13.2%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ＪＰＸ日経インデックス400への連動をめざした運用を行なった結果、堅調な国内企業業績を背景に国内株式市況が上昇したことにより、基準価額も上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ J P X日経400ファンド

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率		(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2017年 3 月22日	円	%		%	%	%
	11,820	－	11,625	－	99.3	1.1
3 月末	11,784	△ 0.3	11,492	△ 1.1	97.5	2.5
4 月末	11,926	0.9	11,635	0.1	97.7	2.4
5 月末	12,176	3.0	11,878	2.2	98.1	1.9
6 月末	12,512	5.9	12,198	4.9	99.2	0.8
7 月末	12,537	6.1	12,229	5.2	99.4	0.5
8 月末	12,477	5.6	12,173	4.7	99.4	0.4
9 月末	12,975	9.8	12,566	8.1	97.9	2.0
10月末	13,705	15.9	13,283	14.3	97.7	2.4
11月末	13,916	17.7	13,492	16.1	98.1	1.7
12月末	14,099	19.3	13,660	17.5	98.4	1.4
2018年 1 月末	14,245	20.5	13,810	18.8	98.5	1.4
2 月末	13,688	15.8	13,269	14.1	98.1	1.7
(期末) 2018年 3 月22日	13,386	13.2	12,980	11.7	99.2	2.0

(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

(2017.3.23～2018.3.22)

■国内株式市況

国内株式市況は、期首より、トランプ米国大統領の政策に対する期待と不透明感が交錯し、一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、北朝鮮の地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感され、株価は上昇しました。6月以降は、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、株価は横ばい圏で推移しました。8月に入ると、再び北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国の物価統計の弱含みにより米国の2017年内の利上げ観測が後退したこと、対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。9月半ば以降は、米国の年内利上げ観測が再び高まり円安米ドル高となったことや北朝鮮問題への懸念が一服したこと、10月に行なわれた衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを受け、株価は上昇しました。11月半ばには急激な株価上昇への懸念から調整する場面が見られたものの、その後は、堅調な国内企業業績や、米国税制改革法案の議会審議の進展および同法の成立が好感され、株価は上昇しました。しかし2018年2月に入ると、米国長期金利が急上昇したことが懸念されて株価は下落しました。その後も、トランプ大統領の関税政策による中国との貿易戦争への懸念により相場は乱高下して推移し、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

ダイワ J P X 日経400マザーファンドを通じ、ベンチマーク（J P X 日経インデックス400）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。

■ダイワ J P X 日経400マザーファンド

ベンチマーク（J P X 日経インデックス400）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

(2017.3.23～2018.3.22)

■当ファンド

ダイワ J P X 日経400マザーファンドを通じて運用を行ないました。

■ダイワ J P X 日経400マザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ないました。

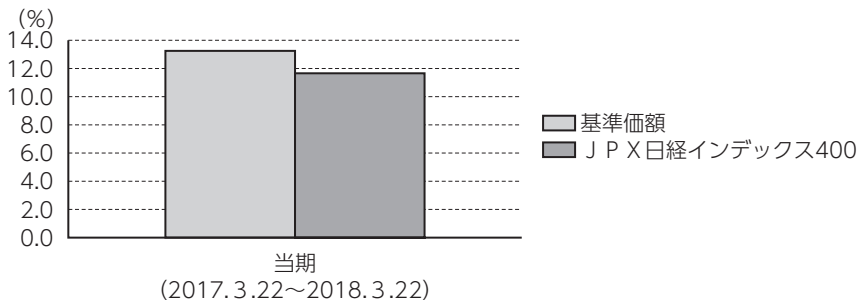
ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は11.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は13.2%となりました。

当ファンドで組み入れを行なっているマザーファンドで保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、ベンチマークとかい離しました。

その他、先物取引の影響、信託報酬等のコストがかい離の要因として挙げられます。

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

当期の1万口当り分配金（税込み）は270円といたしました。

収益分配金の決定根拠は下記の「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	
	2017年3月23日 ～2018年3月22日	
当期分配金（税込み）	（円）	270
対基準価額比率	（％）	2.02
当期の収益	（円）	270
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	3,116

（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。

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	273.82円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	736.37
(c) 収益調整金	1,977.51
(d) 分配準備積立金	398.67
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,386.38
(f) 分配金	270.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,116.38

（注）下線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

ダイワＪＰＸ日経400マザーファンドを通じ、ベンチマーク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。

■ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド

ベンチマーク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 (2017.3.23~2018.3.22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	92円	0.707%	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13,024円です。
(投 信 会 社)	(45)	(0.346)	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)	(42)	(0.324)	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)	(0.038)	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	0	0.002	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
(株 式)	(0)	(0.001)	
(先 物)	(0)	(0.001)	
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	93	0.716	

(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3月23日から2018年3月22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 J P X 日経400マザーファンド	1,860,805	2,587,217	8,185,057	11,065,780

(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

(2017年3月23日から2018年3月22日まで)

項 目	当 期
	ダイワ J P X 日経400マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	15,925,779千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	21,908,700千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.72

(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

(2017年3月23日から2018年3月22日まで)

決 算 期	当 期					
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	3,140	201	6.4	12,785	8	0.1
株式先物取引	4,605	—	—	4,554	—	—
コール・ローン	149,773	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合73.3%

※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

(2017年3月23日から2018年3月22日まで)

種 類	当 期		
	ダイワ J P X 日経400マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
株式	百万円 5	百万円 44	百万円 62

(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

(2017年3月23日から2018年3月22日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	374千円
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、当期中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	千円
ダイワ J P X 日経400マザーファンド	16,313,155	9,988,903 14,175,252

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年3月22日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ J P X 日経400マザーファンド	14,175,252	99.5
コール・ローン等、その他	72,395	0.5
投資信託財産総額	14,247,647	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22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	14,247,647,941円
コール・ローン等	72,395,457
ダイワ J P X 日経400マザーファン(評価額)	14,175,252,484
(B) 負債	357,960,579
未払収益分配金	285,918,394
未払解約金	22,510,810
未払信託報酬	49,155,892
その他未払費用	375,483
(C) 純資産総額(A - B)	13,889,687,362
元本	10,589,570,169
次期繰越損益金	3,300,117,193
(D) 受益権総口数	10,589,570,169口
1 万口当り基準価額(C / D)	13,116円

* 期首における元本額は17,170,966,753円、当期中における追加設定元本額は4,416,057,324円、同解約元本額は10,997,453,908円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,116円です。

■損益の状況

当期 自2017年3月23日 至2018年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 23,812円
受取利息	8,923
支払利息	△ 32,735
(B) 有価証券売買損益	1,247,901,752
売買益	2,130,293,546
売買損	△ 882,391,794
(C) 信託報酬等	△ 115,383,359
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,132,494,581
(E) 前期繰越損益金	359,440,309
(F) 追加信託差損益金	2,094,100,697
(配当等相当額)	(1,669,682,698)
(売買損益相当額)	(424,417,999)
(G) 合計(D + E + F)	3,586,035,587
(H) 収益分配金	△ 285,918,394
次期繰越損益金(G + H)	3,300,117,193
追加信託差損益金	2,094,100,697
(配当等相当額)	(1,669,682,698)
(売買損益相当額)	(424,417,999)
分配準備積立金	1,206,016,496

(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	289,969,769円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	779,790,543
(c) 収益調整金	2,094,100,697
(d) 分配準備積立金	422,174,578
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,586,035,587
(f) 分配金	285,918,394
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,300,117,193
(h) 受益権総口数	10,589,570,169口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	270円

●＜分配金再投資コース＞をご利用の方の税引き分配金は、3月22日現在の基準価額（1万口当り13,116円）に基づいて自動的に再投資いたしました。

分配金の課税上の取扱いについて

- ・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。
- ・普通分配金については、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による源泉徴収が行なわれ、申告不要制度が適用されます。なお、確定申告を行ない、申告分離課税または総合課税（配当控除の適用があります。）を選択することもできます。
- ・法人の受益者の場合、税率が異なります。
- ・税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。くわしくは、販売会社にお問い合わせください。
- ・課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」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。

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

運用報告書 第5期（決算日 2018年3月22日）

（計算期間 2017年3月23日～2018年3月22日）

ダイワ J P X 日経400マザーファンドの第5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	投資成果を J P X 日経インデックス400の動きに連動させることをめざ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（上場予定を含みます。以下同じ。）
運 用 方 法	①主として、わが国の金融商品取引所上場株式に投資し、投資成果を J P X 日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 ②株式の組入比率は、通常の状態でも高位に維持することを基本とします。 ③運用の効率化をはかるため、わが国の株価指数先物取引を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引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	無制限

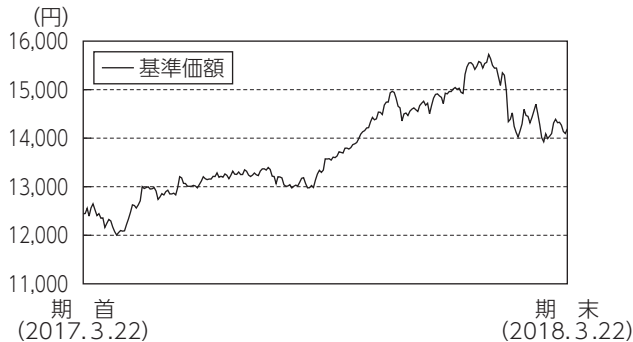
大和投資信託

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		J P X日経インデックス400		株 式 組 入 率	株 先 比 率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首)2017年 3月22日	12,441	—	11,625	—	99.3	1.1
3月末	12,406	△ 0.3	11,492	△ 1.1	97.5	2.5
4月末	12,562	1.0	11,635	0.1	97.7	2.4
5月末	12,833	3.2	11,878	2.2	98.1	1.9
6月末	13,195	6.1	12,198	4.9	99.2	0.8
7月末	13,230	6.3	12,229	5.2	99.4	0.5
8月末	13,174	5.9	12,173	4.7	99.4	0.4
9月末	13,708	10.2	12,566	8.1	97.9	2.0
10月末	14,488	16.5	13,283	14.3	97.7	2.4
11月末	14,720	18.3	13,492	16.1	98.1	1.7
12月末	14,922	19.9	13,660	17.5	98.4	1.4
2018年 1月末	15,087	21.3	13,810	18.8	98.5	1.4
2月末	14,505	16.6	13,269	14.1	98.1	1.7
(期末)2018年 3月22日	14,191	14.1	12,980	11.7	97.2	2.0

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) J P X日経インデックス400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として大和投資信託が計算したものです。

(注3) 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：12,441円 期末：14,191円 騰落率：14.1%

【基準価額の主な変動要因】

J P X日経インデックス400への連動をめざした運用を行なった結果、堅調な国内企業業績を背景に国内株式市況が上昇したことにより、基準価額も上昇しました。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

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、トランプ米国大統領の政策に対する期待と不透明感が交錯し、一進一退で推移しました。2017年4月に入ると、北朝鮮の地政学リスクの高まりが懸念され、株価は下落しました。しかし4月後半からは、地政学リスク悪化の一巡に加えて、フランス大統領選挙で中道派のマクロン氏が極右政党の候補者を抑えて当選したことが好感され、株価は上昇しました。6月以降

は、欧米の中央銀行の金融引き締めペースの見方が交錯し、株価は横ばい圏で推移しました。8月に入ると、再び北朝鮮に関わる地政学リスクが高まったことや、米国の物価統計の弱含みにより米国の2017年内の利上げ観測が後退したこと、対米ドルでの円高が進行したことなどが影響し、株価は軟調に推移しました。9月半ば以降は、米国の年内利上げ観測が再び高まり円安米ドル高となったことや北朝鮮問題への懸念が一服したこと、10月に行なわれた衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどをを受け、株価は上昇しました。11月半ばには急激な株価上昇への懸念から調整する場面が見られたものの、その後は、堅調な国内企業業績や、米国税制改革法案の議会審議の進展および同法の成立が好感され、株価は上昇しました。しかし2018年2月に入ると、米国長期金利が急上昇したことが懸念されて株価は下落しました。その後も、トランプ大統領の関税政策による中国との貿易戦争への懸念により相場は乱高下して推移し、期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

ベンチマーク（J P X日経インデックス400）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

ベンチマークに連動す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

ベンチマークの騰落率は11.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は14.1%となりました。

保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、ベンチマークとかい離しました。

売買を執行するにあたり、売買コスト等の負担がマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

ベンチマーク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	0円
(株式)	(0)
(先物)	(0)
有価証券取引税	—
その他費用	0
(その他)	(0)
合 計	0

(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は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2017年3月23日から2018年3月22日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株	千円	千株	千円
	1,498.2 (△1,795.96)	3,140,322 (-)	7,242.34	12,785,457

(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) 先物取引の種類別取引状況

(2017年3月23日から2018年3月22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	百万円	百万円	百万円	百万円
	株式先物取引 4,605	4,554	-	-

(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

(2017年3月23日から2018年3月22日まで)

当					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
ソニー		81	354,257	4,373	三菱UFJフィナンシャルG		374.7	266,300	710
KDDI		35.7	104,342	2,922	三井住友フィナンシャルG		58.2	246,543	4,236
日本たばこ産業		24.9	91,043	3,656	日本電信電話		34.8	184,481	5,301
関西電力		54.6	82,207	1,505	みずほフィナンシャルG		919.7	183,736	199
トヨタ自動車		11.1	72,948	6,571	トヨタ自動車		27.6	177,489	6,430
本田技研		16.5	56,233	3,408	本田技研		53.9	176,467	3,273
サントリー食品インター		10.4	53,962	5,188	ソフトバンクグループ		18.6	170,761	9,180
日本電信電話		10	52,415	5,241	KDDI		55.8	168,436	3,018
キーエンス		0.8	50,617	63,272	ファナック		7	163,557	23,365
三井化学		59.9	41,485	692	武田薬品		27.2	161,860	5,950

(注1) 金額は受渡し代金。
(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.0%)				住友化学	123	82	50,348	ゴム製品 (1.1%)			
日本水産	23.3	13.3	7,155	日産化学	9.2	6.5	28,112	横浜ゴム	10.1	6.1	14,932
鉱業 (0.4%)				東ソー	48	16	33,824	東洋ゴム	8.9	6.3	11,377
国際石油開発帝石	94.5	57.7	76,769	デンカ	35	4.1	15,518	ブリヂストン	56.6	35	160,335
建設業 (3.2%)				信越化学	30.1	18.5	207,107	住友ゴム	15.7	10.4	20,103
安藤・間	12.9	9.2	7,341	エア・ウォーター	13.8	9.1	18,436	ガラス・土石製品 (0.9%)			
東急建設	6.4	4.6	5,377	太陽日酸	12.9	8.5	13,515	旭硝子	83	10.8	46,602
コムシスホールディングス	7	4.2	11,831	日本パーカライジング	8.6	5.7	10,299	住友大阪セメント	31	21	9,681
大成建設	91	11.8	62,894	三菱瓦斯化学	15.6	9.1	23,041	太平洋セメント	101	6.7	25,594
大林組	53.8	35.6	41,794	三井化学	—	10.1	33,633	ＴＯＴＯ	12.3	8.1	45,198
清水建設	55	36.3	34,267	J S R	16.9	11.1	26,695	日本碍子	21.2	12.9	24,110
長谷工コーポレーション	20.9	13.8	22,452	三菱ケミカルHLDGS	112.4	74.3	76,008	日本特殊陶業	14.5	9.1	23,487
鹿島建設	79	52	51,844	ダイセル	22.6	15	18,315	鉄鋼 (1.0%)			
三井住友建設	68.8	8.6	5,461	積水化学	38.1	23	42,458	新日鐵住金	75.6	46.8	110,424
前田建設	—	8.5	10,293	日本ゼオン	14	9.3	14,442	神戸製鋼所	29	—	—
戸田建設	—	14	10,990	アイカ工業	5.4	3.1	11,888	J F Eホールディングス	45.8	28.3	61,977
熊谷組	28	1.9	6,308	宇部興産	85	5.6	17,332	東京製鐵	—	5.6	4,704
大東建託	6.6	4.3	76,991	日立化成	9.3	5.5	13,216	日立金属	17.1	11.3	14,577
N I P P O	4	2.7	6,453	ダイキョーニシカフ	—	2.2	3,759	非鉄金属 (0.9%)			
前田道路	6	4	8,980	日本化薬	11	7.2	9,576	日本軽金属HD	—	30.6	8,659
五洋建設	—	14.1	10,546	日油	13	4.3	13,029	三菱マテリアル	10.5	6.9	22,839
住友林業	12.4	7.6	12,973	花王	42.6	26	194,116	住友鉱山	43	13.4	60,782
大和ハウス	53	35	141,540	日本ペイントHOLD	12.9	8.6	33,626	DOWAホールディングス	18	2.6	10,413
積水ハウス	56.5	38.6	71,834	関西ペイント	17.6	11.6	29,266	住友電工	63.2	39.1	64,417
協和エクシオ	7	4.3	11,545	D I C	6.6	4.4	15,862	金属製品 (0.2%)			
九電工	3.5	2.3	11,155	富士フイルムHLDGS	33.3	—	—	三和ホールディングス	16.6	10	13,760
日揮	16.7	—	—	資生堂	31.8	19.7	125,390	三協立山	2.2	—	—
食料品 (4.3%)				ライオン	—	14.7	29,841	リンナイ	2.9	1.9	18,772
江崎グリコ	4.5	3	16,320	コーセー	2.7	1.8	36,396	日本発条	15.8	10.4	11,512
カルビー	7.3	4.8	17,232	シーズ・ホールディングス	2.2	1.4	7,112	機械 (5.8%)			
ヤクルト	9.6	6.4	50,944	小林製薬	4.7	3	21,420	アマダホールディングス	—	16.2	21,448
明治ホールディングス	10.6	7	54,950	日東電工	12.1	8	64,800	オーエスジー	7.6	4.8	11,673
日本ハム	12	9	19,629	ニフコ	2.9	1.9	14,212	DMG森精機	9.9	5.8	11,513
アサヒグループホールディン	33.7	22.3	124,790	ユニ・チャーム	34	22.4	66,841	ディスコ	2	1.4	34,034
キリンHD	77.3	51.1	147,781	医薬品 (5.7%)				ニューフレアテクノロジー	0.4	0.2	1,426
サントリー食品インター	—	8.1	40,662	協和発酵キリン	20.1	13.3	30,018	ナブテスコ	8.7	5.8	25,143
伊藤園	5.3	—	—	武田薬品	62.9	39	218,751	SMC	5	3.3	149,358
キッコーマン	13	8.3	35,233	アステラス製薬	171.4	108.8	176,473	小松製作所	77.3	51.1	189,376
味の素	37	24.4	46,079	大日本住友製薬	—	7.8	13,455	住友重機械	49	6.1	24,674
キュービー	9.1	5.9	17,009	塩野義製薬	21.3	15.1	82,355	日立建機	7.5	4.9	21,045
ニチレイ	8.8	5.1	13,928	田辺三菱製薬	19.5	12.9	28,509	ハーモック・ドライブ・シス	—	1.6	9,648
東洋水産	8.8	5.8	24,041	中外製薬	16.7	11	62,040	クボタ	80.2	56.8	102,893
日清食品HD	7	4.6	33,028	科研製薬	3.1	1.9	11,609	荏原製作所	7.6	4.3	16,834
日本たばこ産業	75.6	65.7	186,325	エーザイ	20.6	12.7	86,817	ダイキン工業	21.9	14.4	172,656
繊維製品 (0.5%)				小野薬品	38.1	25	83,175	椿本チエイン	10	6	5,256
帝人	—	9.1	18,500	久光製薬	4.7	3.1	25,451	ダイフク	8	5.4	35,532
東レ	122	80.4	81,485	参天製薬	30.3	20	34,580	タダノ	8.4	5.1	8,103
パルプ・紙 (0.2%)				ツムラ	5.6	3.8	14,307	平和	5	3.3	7,306
王子ホールディングス	66	47	32,101	沢井製薬	2.8	2.1	10,059	竹内製作所	2.9	1.8	4,159
大王製紙	6.7	4.4	6,529	第一三共	49.4	30.3	113,109	T P R	1.8	1.2	3,435
化学 (7.5%)				キョーリン製薬HD	4.1	—	—	ホシザキ	4.7	3.3	31,779
クラレ	28.2	18.7	33,136	大塚ホールディングス	36.1	22	116,666	日本精工	32.9	21.7	31,486
旭化成	105	69.1	96,636	大正製薬HD	3.6	—	—	ジェイテクト	17.1	11.3	17,707

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
不二越	16	—	—	川崎重工業	125	8.2	28,905	京阪ホールディングス	48	6	19,680
THK	11.3	6.6	30,789	名村造船所	4.8	—	—	名古屋鉄道	78	10.5	28,308
イーグル工業	1.7	1.3	2,405	日産自動車	188.9	124.8	139,276	日本通運	62	3.9	28,041
マキタ	10.4	13.8	72,588	いすゞ自動車	46.4	30.7	49,887	ヤマトホールディングス	28.6	17.6	46,235
三菱重工業	268	17.7	72,021	トヨタ自動車	64	47.5	325,185	山九	21	2.6	13,702
IHI	123	—	—	日野自動車	22.9	15.1	20,792	日立物流	—	2.2	6,446
電気機器 (16.8%)				日信工業	3.6	2.2	3,951	海運業 (-)			
コニカミノルタ	37.5	24.8	23,262	NOK	7.7	5.7	12,032	日本郵船	135	—	—
ブラザー工業	20.7	12.9	32,379	カルソニックカンセイ	11	—	—	空運業 (0.8%)			
ミネベアミツミ	25.8	19.7	46,570	アイシン精機	14.7	8.7	49,590	日本航空	28.9	18.6	80,296
日立	385	254	201,498	マツダ	50.7	33.2	47,509	ANAホールディングス	297	19.6	80,850
三菱電機	170.8	105.9	184,318	本田技研	128.7	91.3	334,523	情報・通信業 (7.0%)			
富士電機	48	32	23,808	スズキ	31.7	21	119,574	新日鉄住金 S O L	—	1.6	4,840
安川電機	18.6	12.3	60,700	S U B A R U	49.7	32.9	119,065	グリー	9.6	—	—
日本電産	20.8	12.7	209,296	ヤマハ発動機	22.6	14.9	48,425	ネクソン	17.3	11.6	42,282
オムロン	17	11.3	72,772	豊田合成	5.2	3.8	9,199	コロブラ	4.4	3.4	3,107
日本電気	220	13.7	43,566	シマノ	6.5	4.3	66,048	ティーガイア	1.6	1	2,830
富士通	154	109	68,811	ティ・エス テック	3.7	2.5	10,575	ガンホー・オンライン・エンター	33.1	28.2	10,208
沖電気	6.9	—	—	精密機器 (1.7%)				野村総合研究所	11.8	6.6	32,604
ルネサスエレクトロニクス	8.3	5.5	6,187	テルモ	24.6	16.2	90,720	オービック	5.4	3.3	29,700
セイコーエプソン	23.8	15.8	30,573	島津製作所	20.6	12.6	37,585	ヤフー	113.3	74.9	38,124
アルバック	—	2.4	15,072	ニコン	27.9	—	—	トレンドマイクロ	8.4	5.1	31,722
エレコム	1.4	0.9	2,271	トプコン	8.1	—	—	日本オラクル	2.5	1.7	14,790
パナソニック	183	120.9	198,880	オリンパス	25.6	15.8	64,464	伊藤忠テクノソリューション	3.6	2.4	10,740
富士通ゼネラル	5	3.2	6,320	H O Y A	33	21.6	120,117	大塚商会	4.3	3.1	32,643
日立国際電気	4.2	—	—	朝日インテック	3.8	5.1	19,992	U S E N	7.4	—	—
ソニー	—	61.8	323,770	セイコーHD	11	1.6	4,150	日本テレビ H L D S	14.4	9.5	17,945
T D K	9	5.5	54,340	その他製品 (0.7%)				日本電信電話	71.6	46.8	234,327
アルプス電気	14.8	9.1	24,406	バンダイナムコ H L D G S	17.7	10.9	38,368	K D D I	106.3	86.2	235,153
クラリオン	—	6	1,890	パイロットコーポレーション	2.8	1.8	10,764	光通信	1.9	1.3	20,371
ヒロセ電機	2.6	1.7	26,197	アシックス	15.9	10.5	20,716	N T T ドコモ	118.1	76.9	213,935
日本航空電子	5	3	4,812	ヤマハ	10.8	7.1	33,831	GMOインターネット	5.8	3.8	8,607
横河電機	17.4	10.6	23,012	ビジョン	9.7	6.4	28,352	東宝	10.3	6.8	23,324
日本光電工業	6.7	4.4	13,244	電気・ガス業 (1.5%)				N T T データ	9.8	32.3	36,176
堀場製作所	3.2	2.1	16,674	中部電力	52.8	32.4	47,628	スクウェア・エニックス・HD	—	4.8	23,856
アドバンテスト	—	5.9	13,711	関西電力	—	43.2	56,462	S C S K	4.3	2.4	10,848
キーエンス	7.3	5.2	338,832	東北電力	40	24.8	34,943	コナミホールディングス	—	4.2	23,226
シスメックス	12.4	8.2	78,720	電源開発	12.7	8.4	22,948	ソフトバンクグループ	45.4	30.8	261,892
O B A R A G R O U P	—	0.6	4,002	東京瓦斯	172	22.6	61,957	卸売業 (4.9%)			
スタンレー電気	11.4	8.1	31,873	大阪瓦斯	155	20.5	42,670	双日	93.4	61.7	21,101
カシオ	12.9	8.5	13,889	東邦瓦斯	40	5.2	16,718	アルフレッサホールディングス	18.7	11.6	27,422
ファナック	16.2	10.1	271,336	陸運業 (4.7%)				神戸物産	—	0.7	3,153
エンプラス	0.7	—	—	東武鉄道	86	11.3	36,216	シップヘルスケアHD	3	2.2	8,382
浜松ホトニクス	12.5	7.7	32,109	相鉄ホールディングス	34	4.5	12,775	第一興商	3.4	2.1	11,949
京セラ	26.3	17.4	105,339	東京急行	87	28.8	48,528	メディカルHD	15.8	10.4	22,869
村田製作所	16.8	11.1	162,226	小田急電鉄	25.7	15.7	33,692	伊藤忠	115.8	76.5	158,010
小糸製作所	9.6	6.3	46,620	京王電鉄	45	5.9	26,845	丸紅	155.6	85.7	67,223
ミツバ	2.9	1.9	2,622	京成電鉄	12	7.4	24,013	豊田通商	17.6	11.6	42,746
S C R E E N ホールディングス	3.3	2	20,580	東日本旅客鉄道	31	19	185,782	兼松	34	4.4	6,116
キャノン	86.2	57	224,865	西日本旅客鉄道	15.4	9.6	70,531	三井物産	142.9	88.6	162,979
リコー	48.2	31.8	35,806	東海旅客鉄道	13.3	9.5	187,150	日立ハイテクノロジーズ	5.5	3.6	18,252
東京エレクトロン	10.7	7.1	151,549	西武ホールディングス	—	13.5	25,258	住友商事	99.5	65.8	117,453
輸送用機器 (8.2%)				西日本鉄道	26	3.9	10,705	三菱商事	118.6	73.2	212,499
トヨタ紡織	—	3.1	6,717	近鉄グループ H L D G S	161	10	41,600	阪和興業	16	1.9	8,730
豊田自動織機	14.6	8.6	54,610	阪急阪神 H L D G S	20.2	13.4	52,528	岩谷産業	18	2.3	9,177
デンソー	39.5	23.5	139,519	南海電鉄	45	6.3	16,802	東邦ホールディングス	5.1	3.1	7,737

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
サンリオ	4.9	2.9	5,568	八十二銀行	40.7	—	—	エヌ・ティ・ティ都市開発 サービス業 (2.8%)	9.8	6.5	8,580
日鉄住金物産	1.4	0.8	4,608	ほくほくフィナンシャルG	10.5	6.9	10,260		4.5	2.6	10,361
ミスミグループ本社	17.8	12.1	35,816	広島銀行	47	15.4	12,366		4.8	3.5	26,005
小売業 (4.6%)				中国銀行	14.9	9.6	12,105		12.9	9.3	28,039
ローソン	5	2.6	18,408	セブン銀行	59.3	39.2	13,406		3.7	—	—
エービーシー・マート	2.9	1.9	12,958	みずほフィナンシャルG	2,136.7	1,362.4	263,351		6.1	4	20,520
ゲオホールディングス	2.6	—	—	山口フィナンシャルG	20	13	17,004		11.9	7.6	14,166
アダストリア	—	1.6	3,785	北洋銀行	25.8	—	—		2.2	1.4	4,480
セリア	1.9	2.5	12,425	証券、商品先物取引業 (1.2%)					14.5	10.6	49,608
ビックカメラ	—	6.1	10,223	F P G	5.6	3.6	4,899		7.5	5.5	10,609
MonotaRO	5.6	3.7	13,597	SBIホールディングス	17.9	11.8	30,609	ディーパ	23.2	14.1	21,023
J.フロントリテイリング	20	12.4	22,729	ジャフコ	2.6	1.5	7,635	博報堂DYHLDGS	2.4	—	—
マツモトキヨシHLDGS	3	4.3	18,812	大和証券G本社	148	89	62,317	ぐるなび	18.6	—	—
スタートトゥデイ	14.4	10.2	27,795	野村ホールディングス	323.2	179.6	112,232	電通	18.1	12	127,500
ウエルシアHD	4.2	2.8	12,712	岡三証券グループ	14	—	—	オリエンタルランド	6.5	4.3	9,924
クリエイトSDH	2.3	1.5	4,033	東海東京HD	18.1	11.6	9,036	リゾートトラスト	20.3	12.4	27,007
コスモス薬品	0.8	0.5	10,765	松井証券	9	5.1	5,115	サイバーエージェント	85.5	51.9	47,332
セブン&アイ・HLDGS	66.1	43.7	195,776	カブドットコム証券	11.8	6.7	2,579	楽天	0.8	5.5	16,527
ツルハホールディングス	3.2	2.3	34,224	保険業 (2.9%)				リログループ	2.7	—	—
クスリのアオキHLDGS	1.3	0.8	5,824	SOMPOホールディングス	33	20.5	85,546	エイチ・アイ・エス	2.3	1.5	5,452
ノジマ	2.5	1.8	4,568	MS & AD	47.2	27.3	91,919	カナモト	17.4	10.7	84,080
良品計画	2.1	1.4	52,570	SONY F H	15.1	8.6	16,830	セコム	—	1.2	7,308
ドンキホーテホールディング	10.2	6.8	40,800	第一生命HLDGS	95.3	59.1	119,470	イオンデモ	1.9	1.2	4,710
VTホールディングス	7.1	—	—	東京海上HD	64	39.3	197,443	合計	株数、金額	16,326.6	8,786.5
ユナイテッドアローズ	2.1	1.3	5,401	T & Dホールディングス	57.6	32.3	55,572	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>
スギホールディングス	3.5	2.3	13,455	その他金融業 (1.5%)				(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。			
ユニー・ファミリーマートHD	4.8	3.3	28,380	全国保証	4.5	2.9	13,934	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。			
日本瓦斯	2.9	1.9	8,616	芙蓉総合リース	1.8	1.2	8,652	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。			
しまむら	1.8	1.2	16,104	興銀リース	3	2	6,340	(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)			
高島屋	27	16	16,144	東京センチュリー	3.2	2.1	13,776				
イオン	65	40.1	73,443	イオンフィナンシャルサービス	10.1	7.4	18,085				
イズミ	3.1	1.9	13,110	オリコ	34.2	22.6	3,842				
ヤオコー	1.8	1.2	7,128	日立キャピタル	3.7	2.9	7,844				
ケーズホールディングス	7.3	4.4	13,266	オリックス	111.9	69.6	133,214				
アインホールディングス	2.1	1.4	10,836	三菱UFJリース	40.1	26.5	17,039				
ニトリホールディングス	6.8	4.1	77,469	日本取引所グループ	49.1	30.7	58,483				
パローホールディングス	3.4	2.4	6,787	不動産業 (2.8%)							
ファーストリテイリング	2.6	1.7	71,944	いちご	15	14.9	6,734				
サンドラッグ	3	4.4	21,692	ヒューリック	33	21.8	25,418				
銀行業 (6.2%)				野村不動産HLDGS	10.5	6.9	17,788				
めざきフィナンシャルG	—	54.2	22,601	プレサンスコーポレーション	2.5	1.4	2,237				
東京TYフィナンシャルG	2.3	1.4	3,511	オープンハウス	—	1.7	11,271				
九州フィナンシャルG	34.6	22.8	12,334	東急不動産HD	38.2	25.3	19,734				
コンコルディア・フィナンシャル	103.5	63.5	38,100	飯田GHD	13.2	8.7	17,765				
新生銀行	150	9	14,760	パーク24	8	5.8	16,733				
あおぞら銀行	100	6.2	26,722	三井不動産	84	52.1	131,370				
三菱UFJフィナンシャルG	685.7	342.3	243,409	三菱地所	118	77.7	138,966				
りそなホールディングス	184.9	114.6	66,662	東京建物	18.3	11.4	18,240				
三井住友トラストHD	33	20.5	90,364	住友不動産	38	25	96,825				
三井住友フィナンシャルG	113.1	60.4	273,732	大京	29	—	—				
千葉銀行	61	37	32,005	レオパレス21	20	12.5	10,325				
群馬銀行	35.1	21.2	13,038	スターツコーポレーション	2.1	1.4	3,955				
ひくおかフィナンシャルG	64	—	—	住友不動産販売	1.4	—	—				
静岡銀行	43	28	28,840	タカラレーベン	6.9	—	—				
スルガ銀行	16.2	10.7	16,060	イオンモール	10.2	6.7	15,289				

■有価証券の貸付及び借入の状況

項 目	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	株 324,600 (131,900)	株 — (—)

(注1) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。
 (注2) 当ファンドに係る当期中の利害関係人のうち、大和証券へ131,900株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2018年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 19,375,952	% 92.6
コール・ローン等、その他	1,552,181	7.4
投資信託財産総額	20,928,133	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22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	21,070,963,280円
コール・ローン等	1,515,809,506
株式(評価額)	19,375,952,240
未収入金	2,724,340
未収配当金	30,525,850
未収利息	57,202
その他未収収益	514,142
差入委託証拠金	145,380,000
(B) 負債	1,145,656,352
未払金	644,320
未払解約金	3,522,775
差入委託証拠金代用有価証券	142,830,000
受入担保金	998,650,169
その他未払費用	9,088
(C) 純資産総額(A－B)	19,925,306,928
元本	14,040,935,890
次期繰越損益金	5,884,371,038
(D) 受益権総口数	14,040,935,890口
1万口当り基準価額(C／D)	14,191円

＊期首における元本額は21,366,221,858円、当期中における追加設定元本額は2,855,238,037円、同解約元本額は10,180,524,005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、ダイワ J P X 日経400ファンド（米ドル投資型）774,721,079円、iFree J P X 日経400インデックス107,500,559円、ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド49,329,084円、ダイワ J P X 日経400ファンド9,988,903,167円、ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 3,120,482,001円です。
 ＊当期末の計算口数当りの純資産額は14,191円です。

■損益の状況

当期 自2017年3月23日 至2018年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	502,302,554円
受取配当金	496,564,408
受取利息	385,519
その他収益金	5,711,583
支払利息	△ 358,956
(B) 有価証券売買損益	2,624,847,130
売買益	3,238,166,929
売買損	△ 613,319,799
(C) 先物取引等損益	39,823,381
取引益	77,682,942
取引損	△ 37,859,561
(D) その他費用	△ 225,250
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	3,166,747,815
(F) 前期繰越損益金	5,215,864,878
(G) 解約差損益金	△3,580,424,441
(H) 追加信託差損益金	1,082,182,786
(I) 合計(E + F + G + H)	5,884,371,038
次期繰越損益金(I)	5,884,371,038

(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。

【注記】

- ・「ＪＰＸ日経インデックス400」は、株式会社日本取引所グループおよび株式会社東京証券取引所（以下、総称して「ＪＰＸグループ」といいます。）と株式会社日本経済新聞社（以下、「日経」といいます。）とによって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、ＪＰＸグループと日経は、「ＪＰＸ日経インデックス400」自体および「ＪＰＸ日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。
- ・「ＪＰＸ日経インデックス400」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべてＪＰＸグループと日経に帰属しています。
- ・ＪＰＸグループと日経は、「ＪＰＸ日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延又は中断に関して、責任を負いません。
- ・ＪＰＸグループと日経は、「ＪＰＸ日経インデックス400」の計算方法など、その内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。