

ダイワＪＰＸ日経400ファンド

運用報告書（全体版） 第６期

（決算日 2019年３月22日）
（作成対象期間 2018年３月23日～2019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。

当ファンドは、東京証券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ないました。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。

★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。）	
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。		

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）

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

最近 5 期の運用実績

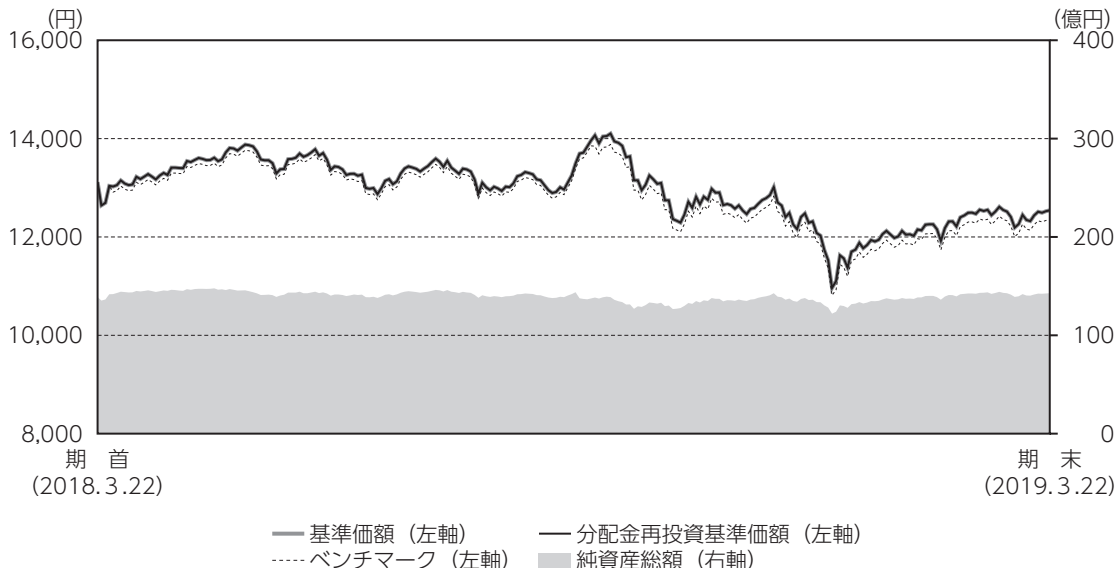
決 算 期	基 準 価 額			J P X 日経インデックス400		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 配 金	期 中 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 中 騰 落 率			
2 期末(2015年 3 月23日)	円 12,401	円 120	% 38.9	12,295	% 37.4	% 98.0	% 1.9	百万円 17,813
3 期末(2016年 3 月22日)	10,726	0	△13.5	10,509	△14.5	98.9	1.3	24,564
4 期末(2017年 3 月22日)	11,820	230	12.3	11,625	10.6	99.3	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
6 期末(2019年 3 月22日)	12,540	0	△ 4.4	12,226	△ 5.8	99.1	1.0	14,271

(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) 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) 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 5) 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。

- * 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す。
- * 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。
- * ベンチマークは J P X 日経インデックス400です。

■基準価額・騰落率

期 首：13,116円

期 末：12,540円（分配金0円）

騰落率：△4.4%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（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いました。

米中貿易摩擦への懸念などを嫌気してわが国の株式市場が下落したことにより、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ J P X日経400ファンド

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	J P X日経インデックス400		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
			(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2018年 3 月22日	円 13,116	% -	12,980	% -	% 99.2	% 2.0
3 月末	13,149	0.3	12,900	△ 0.6	97.4	2.5
4 月末	13,605	3.7	13,353	2.9	98.2	1.7
5 月末	13,375	2.0	13,129	1.1	97.9	2.0
6 月末	13,269	1.2	13,013	0.3	97.7	2.2
7 月末	13,424	2.3	13,172	1.5	97.6	2.4
8 月末	13,274	1.2	13,030	0.4	99.5	0.4
9 月末	14,043	7.1	13,679	5.4	98.3	1.7
10月末	12,714	△ 3.1	12,394	△ 4.5	97.0	2.5
11月末	12,851	△ 2.0	12,532	△ 3.5	96.9	2.8
12月末	11,564	△11.8	11,263	△13.2	96.7	3.1
2019年 1 月末	12,152	△ 7.3	11,840	△ 8.8	98.3	1.7
2 月末	12,444	△ 5.1	12,127	△ 6.6	98.9	1.4
(期末) 2019年 3 月22日	12,540	△ 4.4	12,226	△ 5.8	99.1	1.0

(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

(2018.3.23～2019.3.22)

■国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、下落しました。2018年4月以降は、米国の保護主義的な政策への警戒感が強まる一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったこと、また通商問題でも一部で妥協点を探る動きなどがあり、株価は横ばい圏で推移しました。9月半ばからは、米中貿易摩擦でいったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、株価は上昇しました。10月は米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月は株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中貿易摩擦の緩和に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中貿易摩擦の緩和期待が再び高まり、株価は反発しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

ダイワ J P X 日経400マザーファンドを通じ、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■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ってまいります。

ポートフォリオについて

(2018.3.23～2019.3.22)

■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。

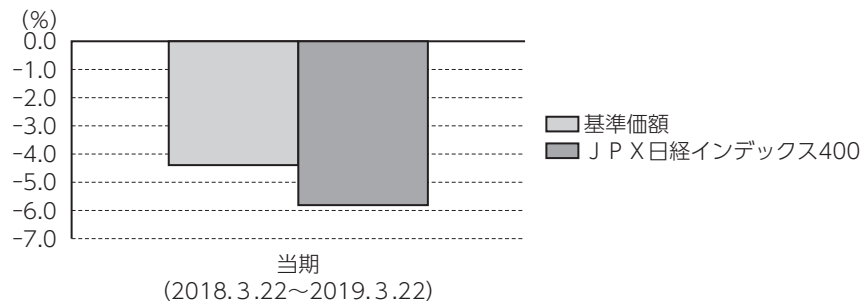
ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△5.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.4%となりました。

当ファンドで組み入れを行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

当作成期は、経費控除後の配当等収益が少額であったことから、収益分配を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	
	2018年3月23日 ～2019年3月22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）	2,910

- (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

ダイワ J P X 日経400マザーファンドを通じ、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ J P X 日経400マザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.3.23～2019.3.22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	92円	0.707%	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12,942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、法定書面等の作成等の対価
(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＝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
(株 式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
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	2	0.014	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)	(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)	(1)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	94	0.723	

- (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。

■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

(2018年3月23日から2019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	2,751,815	3,822,750	2,296,459	3,356,965

(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

(2018年3月23日から2019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	8,597,054千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	19,482,227千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.44

(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

(2018年3月23日から2019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	5,061	376	7.4	3,535	281	8.0
株式先物取引	2,744	—	—	2,923	—	—
コール・ローン	547,061	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合70.5%

※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

(2018年3月23日から2019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 9	百万円 11	百万円 49

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2018年3月23日から2019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
株式	百万円 3

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 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の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、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
ダイワ J P X 日経400マザーファンド	9,988,903	10,444,259	14,271,036

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019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	14,271,036	99.6
コール・ローン等、その他	62,739	0.4
投資信託財産総額	14,333,775	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

2019年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	14,333,775,322円
コール・ローン等	52,790,890
ダイワ J P X 日経400マザーファンド(評価額)	14,271,036,167
未収入金	9,948,265
(B) 負債	62,383,158
未払解約金	15,128,599
未払信託報酬	46,890,644
その他未払費用	363,915
(C) 純資産総額(A - B)	14,271,392,164
元本	11,381,046,111
次期繰越損益金	2,890,346,053
(D) 受益権総口数	11,381,046,111口
1 万口当り基準価額(C / D)	12,540円

* 期首における元本額は10,589,570,169円、当作成期間中における追加設定元本額は4,704,570,517円、同解約元本額は3,913,094,575円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,540円です。

■損益の状況

当期 自2018年3月23日 至2019年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 16,387円
受取利息	2,299
支払利息	△ 18,686
(B) 有価証券売買損益	△ 451,101,486
売買益	168,101,461
売買損	△ 619,202,947
(C) 信託報酬等	△ 99,344,387
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 550,462,260
(E) 前期繰越損益金	832,000,338
(F) 追加信託差損益金	2,608,807,975
(配当等相当額)	(2,269,910,485)
(売買損益相当額)	(338,897,490)
(G) 合計(D + E + F)	2,890,346,053
次期繰越損益金(G)	2,890,346,053
追加信託差損益金	2,608,807,975
(配当等相当額)	(2,269,910,485)
(売買損益相当額)	(338,897,490)
分配準備積立金	1,042,922,561
繰越損益金	△ 761,384,483

(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	210,922,223円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	2,269,910,485
(d) 分配準備積立金	832,000,338
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,312,833,046
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,312,833,046
(h) 受益権総口数	11,381,046,111口

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

【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。

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

運用報告書 第6期（決算日 2019年3月22日）

（作成対象期間 2018年3月23日～2019年3月22日）

ダイワ J P X 日経400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	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。）
株 式 組 入 制 限	無制限

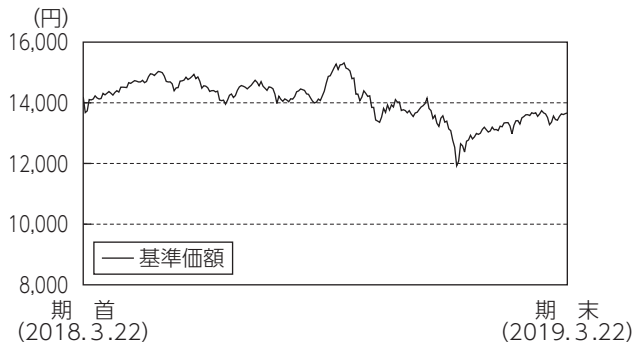
大和投資信託

Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<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		J P X日経インデックス400 (ベンチマーク)		株 式 組 入 率	株 式 先 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率
(期首)2018年 3月22日	円 14,191	% -	12,980	% -	97.2	% 2.0
3月末	14,228	0.3	12,900	△ 0.6	97.4	2.5
4月末	14,730	3.8	13,353	2.9	98.2	1.7
5月末	14,491	2.1	13,129	1.1	97.9	2.0
6月末	14,384	1.4	13,013	0.3	97.7	2.2
7月末	14,561	2.6	13,172	1.5	97.6	2.4
8月末	14,407	1.5	13,030	0.4	99.5	0.4
9月末	15,250	7.5	13,679	5.4	98.3	1.7
10月末	13,816	△ 2.6	12,394	△ 4.5	97.0	2.5
11月末	13,973	△ 1.5	12,532	△ 3.5	96.9	2.8
12月末	12,580	△11.4	11,263	△13.2	96.7	3.1
2019年 1月末	13,229	△ 6.8	11,840	△ 8.8	98.3	1.7
2月末	13,554	△ 4.5	12,127	△ 6.6	98.9	1.4
(期末)2019年 3月22日	13,664	△ 3.7	12,226	△ 5.8	99.1	1.0

(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) 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) 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：14,191円 期末：13,664円 騰落率：△3.7%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（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いました。

米中貿易摩擦への懸念などを嫌気してわが国の株式市場が下落したことにより、基準価額も下落しました。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

○国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、下落しました。2018年4月以降は、米国の保護主義的な政策への警戒感が強まる

一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったこと、また通商問題でも一部で妥協点を探る動きなどがあり、株価は横ばい圏で推移しました。9月半ばからは、米中貿易摩擦でいったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、株価は上昇しました。10月は米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月は株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中貿易摩擦の緩和に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長が発言などが嫌気され下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中貿易摩擦の緩和期待が再び高まり、株価は反発しました。

◆前作成期末における「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△5.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.7%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、ベンチマークと乖離しました。

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)	0円 (0)
(先物・オプション)	(0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	1 (1)
合 計	1

(注1) 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) 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

(2018年3月23日から2019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
	2,242.7 (△300.915)	5,061,715 (-)	1,535.185	3,535,339

(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

(2018年3月23日から2019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	2,744	2,923	-	-

(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

(2018年3月23日から2019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
任天堂		7.4	292,015	39,461	ソニー		15.8	99,758	6,313
リクルートホールディングス		86.1	288,583	3,351	トヨタ自動車		14.2	98,344	6,925
武田薬品		62.3	281,185	4,513	ソフトバンクグループ		6.3	60,903	9,667
J X T Gホールディングス		198.1	156,603	790	キーエンス		0.9	56,766	63,074
三菱UFJフィナンシャルG		203.8	136,546	670	本田技研		15.1	49,742	3,294
ソフトバンクグループ		12.2	115,561	9,472	三井住友フィナンシャルG		10.4	46,715	4,491
日本電信電話		21.4	104,663	4,890	アステラス製薬		24.5	44,455	1,814
三井住友フィナンシャルG		18.5	80,171	4,333	日本電信電話		8.2	41,392	5,047
電通		13.8	71,656	5,192	日本たばこ産業		12.9	39,218	3,040
ソニー		10.1	57,716	5,714	リコー		33.4	38,591	1,155

(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%)				旭化成	69.1	76.6	91,307	石油・石炭製品 (0.7%)			
日本水産	13.3	14.9	11,994	昭和電工	—	7.2	27,576	出光興産	—	8.5	35,657
マルハニチロ	—	2.2	8,910	住友化学	82	84.8	45,792	J X T Gホールディングス	—	184.9	102,619
鉱業 (0.3%)				日産化学	6.5	6.6	33,792	コスモエネルギーHDGS	—	3.2	8,640
国際石油開発帝石	57.7	59.9	64,452	東ソー	16	16.6	29,116	ゴム製品 (0.9%)			
建設業 (3.0%)				デンカ	4.1	4.2	13,524	横浜ゴム	6.1	6.4	13,241
安藤・岡	9.2	9.5	7,400	信越化学	18.5	19	175,921	TOYO TIRE	6.3	—	—
東急建設	4.6	4.4	3,828	エア・ウォーター	9.1	8.8	14,502	ブリヂストン	35	33.8	145,880
コムシスホールディングス	4.2	4.8	14,184	大陽日酸	8.5	8.9	14,774	住友ゴム	10.4	9.9	13,513
大成建設	11.8	12.3	64,575	日本パーカライジング	5.7	5.9	8,501	ガラス・土石製品 (0.8%)			
大林組	35.6	36.9	41,586	三菱瓦斯化学	9.1	11.1	18,414	AGC	10.8	10.9	43,000
清水建設	36.3	37.7	37,021	三井化学	10.1	9.8	27,342	住友大阪セメント	21	—	—
長谷工コーポレーション	13.8	15.4	22,360	J S R	11.1	10.8	19,062	太平洋セメント	6.7	6.9	25,944
鹿島建設	52	28.9	48,176	三菱ケミカルHDGS	74.3	72	59,407	TOTO	8.1	8.5	38,760
西松建設	—	2.7	6,947	ダイセル	15	16.7	19,923	日本碍子	12.9	13.4	22,820
三井住友建設	8.6	8.9	6,897	積水化学	23	23.5	42,441	日本特殊陶業	9.1	9.3	20,171
前田建設	8.5	8.8	10,199	日本セオン	9.3	9.7	10,999	ニチアス	—	3	6,522
戸田建設	14	14.3	10,224	アイカ工業	3.1	3.2	11,696	鉄鋼 (0.9%)			
熊谷組	1.9	1.8	6,264	宇部興産	5.6	5.4	12,787	新日鐵住金	46.8	48.7	97,473
大東建託	4.3	4.4	69,190	日立化成	5.5	5	12,525	J F Eホールディングス	28.3	29.4	57,432
N I P P O	2.7	3.3	6,933	ダイキョーニシカワ	2.2	2.3	2,546	東京製鐵	5.6	5.8	5,440
前田道路	4	3.9	8,416	日本化薬	7.2	—	—	日立金属	11.3	11.7	15,619
五洋建設	14.1	14.6	7,708	日油	4.3	4.2	16,023	非鉄金属 (0.8%)			
住友林業	7.6	8.7	13,076	花王	26	26.7	232,076	日本軽金属HD	30.6	29.6	7,429
大和ハウス	35	34.1	120,100	日本ペイントHOLD	8.6	8.9	38,937	三菱マテリアル	6.9	7.2	21,470
積水ハウス	38.6	37.7	68,991	関西ペイント	11.6	12.1	26,015	住友鉱山	13.4	14.9	49,736
協和エクシオ	4.3	4.6	13,662	D I C	4.4	4.9	16,390	DOWAホールディングス	2.6	2.5	9,262
九電工	2.3	2.4	8,424	資生堂	19.7	21.8	174,443	古河電工	—	3.1	9,024
食料品 (4.2%)				ライオン	14.7	15.3	36,062	住友電工	39.1	40.7	61,945
森永製菓	—	2.8	13,874	コーセー	1.8	1.9	37,183	金属製品 (0.3%)			
江崎グリコ	3	3.3	19,173	シーズ・ホールディングス	1.4	0.3	1,764	SUMCO	—	12	15,444
カルビー	4.8	5	15,050	ポーラ・オルビスHD	—	4.7	16,732	三和ホールディングス	10	11.2	14,504
ヤクルト	6.4	8.2	63,304	小林製菓	3	3.1	28,613	リンナイ	1.9	1.9	14,801
明治ホールディングス	7	7.8	69,810	日東電工	8	8.3	49,260	東プレ	—	2	4,326
日本ハム	9	4.8	19,272	ニフコ	1.9	4.4	12,452	日本発条	10.4	10.8	10,692
アサヒグループホールディン	22.3	23.1	112,058	ユニ・チャーム	22.4	23.3	85,068	機械 (4.9%)			
キリンHD	51.1	49.9	130,962	医薬品 (6.8%)				アマダホールディングス	16.2	16.8	18,580
サントリー食品インター	8.1	7.4	37,370	協和発酵キリン	13.3	13.8	32,029	オーエスジー	4.8	5.4	11,194
キッコーマン	8.3	7.3	39,785	武田薬品	39	96	453,024	DMG森精機	5.8	6.9	9,742
味の素	24.4	24.4	43,358	アステラス製薬	108.8	101.4	171,873	ディスコ	1.4	1.5	23,100
キューピー	5.9	6.1	16,183	大日本住友製薬	7.8	8.1	22,380	ニューフレアテクノロジー	0.2	—	—
ニチレイ	5.1	5.7	15,355	塩野義製薬	15.1	14.4	96,249	ナプテスコ	5.8	6	19,380
東洋水産	5.8	5.7	23,455	田辺三菱製薬	12.9	11.5	17,698	三井海洋開発	—	1.2	4,098
日清食品HD	4.6	4.7	35,673	中外製薬	11	11.5	86,365	SMC	3.3	3.2	131,072
日本たばこ産業	65.7	63.7	175,334	科研製薬	1.9	2	10,560	小松製作所	51.1	49.8	132,717
繊維製品 (0.4%)				エーザイ	12.7	13.2	99,858	住友重機械	6.1	6.3	23,121
帝人	9.1	8.8	16,711	小野薬品	25	26	57,577	日立建機	4.9	4.4	13,332
東レ	80.4	83.5	61,856	久光製薬	3.1	3.2	15,920	ハーモニック・ドライブ・シス	1.6	2	7,950
パルプ・紙 (0.2%)				参天製薬	20	20.8	33,779	クボタ	56.8	58.9	94,799
王子ホールディングス	47	48.5	34,580	ツムラ	3.8	3.4	11,271	荏原製作所	4.3	4.9	14,994
大王製紙	4.4	—	—	沢井製薬	2.1	2.3	14,904	ダイキン工業	14.4	15	190,500
化学 (7.5%)				第一三共	30.3	31.5	137,560	椿本チエイン	6	1.4	5,670
クラレ	18.7	18.2	26,335	大塚ホールディングス	22	20.9	92,900	ダイフク	5.4	6.1	35,868

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
タダノ	5.1	5.3	5,506	豊田自動織機	8.6	8.9	51,442	京阪ホールディングス	6	6.2	27,993
平和	3.3	3.1	6,919	デンソー	23.5	24.2	109,384	名古屋鉄道	10.5	11.1	33,774
竹内製作所	1.8	1.8	3,529	川崎重工業	8.2	8.6	23,572	日本通運	3.9	4.1	25,502
T P R	1.2	1.5	3,343	日産自動車	124.8	129.7	124,161	ヤマトホールディングス	17.6	18.3	53,417
ホシザキ	3.3	3.2	21,984	いすゞ自動車	30.7	34.8	52,200	山九	2.6	2.9	15,660
日本精工	21.7	22.6	23,481	トヨタ自動車	47.5	40.5	273,496	日立物流	2.2	2.3	7,670
ジェイテクト	11.3	10.5	14,805	日野自動車	15.1	13.7	13,206	空運業 (0.8%)			
T H K	6.6	6.9	19,720	日信工業	2.2	—	—	日本航空	18.6	19.1	74,241
イーグル工業	1.3	—	—	N O K	5.7	5.9	10,484	ANAホールディングス	19.6	19	76,361
マキタ	13.8	13.4	49,312	アイシン精機	8.7	9.1	37,856	情報・通信業 (8.0%)			
三菱重工業	17.7	18.4	85,909	マツダ	33.2	34.5	43,625	新日鉄住金 S O L	1.6	1.6	4,758
電気機器 (14.2%)				本田技研	91.3	91.3	278,830	T I S	—	3.6	18,324
コニカミノルタ	24.8	24	26,376	スズキ	21	20.1	102,108	ネクソン	11.6	27.5	46,777
ブラザー工業	12.9	14.3	29,243	S U B A R U	32.9	34.1	93,297	コロプラ	3.4	3.1	2,145
ミネベアミツミ	19.7	20.4	34,108	ヤマハ発動機	14.9	15.5	33,774	ティーガイア	1	1.1	2,094
日立	254	49.5	179,833	豊田合成	3.8	3.6	8,654	カンホ・オンライン・エンター	28.2	26	10,400
三菱電機	105.9	109.9	159,574	シマノ	4.3	4.4	76,120	野村総合研究所	6.6	6.9	34,258
富士電機	32	7.1	23,856	ティ・エス テック	2.5	2.6	8,580	オービック	3.3	3.7	40,959
安川電機	12.3	12.7	45,085	精密機器 (2.2%)				ヤフー	74.9	70.3	19,262
日本電産	12.7	13.2	180,444	テルモ	16.2	15.6	108,576	トレンドマイクロ	5.1	5.7	29,298
オムロン	11.3	11.7	61,074	島津製作所	12.6	14.1	43,780	日本オラクル	1.7	2.2	18,722
日本電気	13.7	14.2	54,670	オリンパス	15.8	16.4	81,590	伊藤忠テクノソリューションズ	2.4	4.9	12,593
富士通	109	10.6	83,231	H O Y A	21.6	22.1	163,319	大塚商会	3.1	5.8	22,881
ルネサスエレクトロニクス	5.5	11.4	6,156	朝日インテック	5.1	6.2	32,054	日本ユニシス	—	3.4	9,652
セイコーエプソン	15.8	13.6	23,024	セイコーHD	1.6	—	—	日本テレビ H L D S	9.5	9.9	17,018
アルパック	2.4	2.2	7,040	その他製品 (1.8%)				日本電信電話	46.8	60	288,840
エレコム	0.9	1	3,360	バンダイナムコ H L D G S	10.9	11.4	58,824	K D D I	86.2	95.1	235,610
パナソニック	120.9	125.6	120,337	パイロットコーポレーション	1.8	1.9	8,407	光通信	1.3	1.3	27,274
富士通ゼネラル	3.2	3.4	5,089	アシックス	10.5	10.9	15,554	N T T ドコモ	76.9	77.5	191,153
ソニー	61.8	56.1	264,174	ヤマハ	7.1	6.5	35,555	GMOインターネット	3.8	3.9	7,164
T D K	5.5	5.8	51,272	ビジヨン	6.4	6.6	30,558	東宝	6.8	7.1	30,423
アルプスアルパイン	9.1	10.1	23,331	任天堂	—	6.8	208,760	N T T データ	32.3	28.7	34,755
クラリオン	6	—	—	電気・ガス業 (1.9%)				スクウェア・エニックス・HD	4.8	5	19,850
ヒロセ電機	1.7	1.6	18,656	中部電力	32.4	33.6	59,791	カプコン	—	4.6	11,444
日本航空電子	3	—	—	関西電力	43.2	44.9	77,003	S C S K	2.4	2.8	13,790
横河電機	10.6	11	24,387	東北電力	24.8	25.7	37,650	コナミホールディングス	4.2	4.4	21,582
日本光電工業	4.4	4.8	16,968	九州電力	—	22.7	30,054	ソフトバンクグループ	30.8	36.7	413,609
堀場製作所	2.1	2.2	13,640	電源開発	8.4	8.7	24,116	卸売業 (5.1%)			
アドバンテスト	5.9	7.5	19,335	東京瓦斯	22.6	21.6	66,765	双日	61.7	59.8	24,219
キーエンス	5.2	5.1	356,745	大阪瓦斯	20.5	21.3	49,160	アルファホールディングス	11.6	12	38,040
シスメックス	8.2	8.6	60,131	東邦瓦斯	5.2	5.4	27,054	神戸物産	0.7	1.6	6,400
O B A R A G R O U P	0.6	0.6	2,232	陸運業 (5.4%)				シップヘルスケアHD	2.2	2.3	10,396
スタンレー電気	8.1	7.8	23,345	東武鉄道	11.3	11.6	37,584	第一興商	2.1	2.1	11,802
カシオ	8.5	9.7	14,113	相鉄ホールディングス	4.5	5	16,925	メディカルHD	10.4	11.7	30,712
ファナック	10.1	10.4	203,320	東京急行	28.8	29.9	57,916	伊藤忠	76.5	75.7	156,206
浜松ホトニクス	7.7	7.9	33,456	小田急電鉄	15.7	17.6	46,833	丸紅	85.7	106.8	86,070
京セラ	17.4	16.8	108,528	京王電鉄	5.9	6.1	43,127	豊田通商	11.6	12.1	45,435
村田製作所	11.1	11.5	190,152	京成電鉄	7.4	8.2	32,677	兼松	4.4	4.3	5,843
小糸製作所	6.3	6.6	41,184	東日本旅客鉄道	19	19.5	210,307	三井物産	88.6	89.2	161,184
ミツバ	1.9	—	—	西日本旅客鉄道	9.6	9.9	82,962	日立ハイテクノロジーズ	3.6	3.3	15,543
S C R E E Nホールディングス	2	1.9	8,977	東海旅客鉄道	9.5	9.8	247,107	住友商事	65.8	64	103,456
キャノン	57	59.2	189,736	西武ホールディングス	13.5	14	26,264	三菱商事	73.2	76	247,380
リコー	31.8	—	—	西日本鉄道	3.9	—	—	阪和興業	1.9	1.9	6,365
東京エレクトロン	7.1	7.3	120,559	近鉄グループ H L D G S	10	10.4	53,768	岩谷産業	2.3	2.4	8,856
輸送用機器 (6.8%)				阪急阪神 H L D G S	13.4	13.9	57,476	東邦ホールディングス	3.1	3.2	8,918
トヨタ紡織	3.1	3.8	6,608	南海電鉄	6.3	—	—	サンリオ	2.9	—	—

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
P A L T A C	—	2	11,960	千円	広島銀行	15.4	16	9,328	千円	エムスリー	10.6	22.1	41,083	千円
日鉄住金物産	0.8	0.8	3,848		中国銀行	9.6	—	—		ディー・エヌ・エー	5.5	5.7	9,809	
ミスミグループ本社	12.1	13.6	36,570		セブン銀行	39.2	36.6	12,151		博報堂D Y H L D G S	14.1	14.6	26,090	
小売業 (4.4%)					みずほフィナンシャルG	1,362.4	1,473.5	258,599		電通	—	12.8	60,544	
ローソン	2.6	2.7	16,794		山口フィナンシャルG	13	—	—		オリエンタルランド	12	12.4	153,636	
エービーシー・マート	1.9	1.7	11,220		証券、商品先物取引業 (0.9%)					リゾートトラスト	4.3	4.4	6,740	
アダストリア	1.6	1.5	3,714		F P G	3.6	3.4	3,267		ユー・エス・エス	12.4	12.8	26,137	
セリア	2.5	2.8	10,542		S B Iホールディングス	11.8	12.9	31,643		サイバーエージェント	6.6	6.5	27,820	
ビックカメラ	6.1	5.8	7,018		ジャフコ	1.5	—	—		楽天	51.9	49	50,960	
MonotaRO	3.7	6.8	16,136		大和証券G本社	89	87	49,085		エン・ジャパン	—	1.5	4,822	
J. フロントリテイリング	12.4	13.9	18,042		野村ホールディングス	179.6	190.8	78,533		テクノプロ・ホールディング	—	2.1	13,923	
マツモトキヨシH L D G S	4.3	4.5	16,762		東海東京H D	11.6	12.9	5,572		リクルートホールディングス	—	75.3	238,776	
Z O Z O	10.2	11.7	23,751		松井証券	5.1	5.3	6,344		リログループ	5.5	5.7	17,499	
ウエルシアH D	2.8	2.9	10,614		カブドットコム証券	6.7	—	—		カナモト	1.5	1.6	4,248	
クリエイトS D H	1.5	1.6	4,436		保険業 (2.7%)					セコム	10.7	11.1	105,683	
すかいらーくH D	—	10.1	18,099		S O M P Oホールディングス	20.5	19.1	77,546		メイテック	1.2	1.3	6,526	
コスモス薬品	0.5	0.5	9,475		M S & A D	27.3	28.4	96,105		イオンディライト	1.2	1.3	5,323	
セブン&アイ・H L D G S	43.7	45.4	196,672		S O N Y F H	8.6	8.9	18,431						
ツルハホールディングス	2.3	2.4	21,912		第一生命H L D G S	59.1	61.4	98,485		合 計	株 数、金 額	8,786.5	9,193.1	19,903,552
クスリのアオキH L D G S	0.8	1.1	8,844		東京海上H D	39.3	39.3	213,988		銘柄数<比率>	399銘柄	398銘柄	<99.1%>	
ノジマ	1.8	1.9	3,828		T & Dホールディングス	32.3	33.5	39,228						
良品計画	1.4	1.5	39,540		その他金融業 (1.2%)									
パナソニックH D	6.8	6.5	45,500		全国保証	2.9	3.1	12,896		(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。			
ゼンショーホールディングス	—	5.1	13,326		芙蓉総合リース	1.2	1.2	6,960		(注2)	合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。			
ユナイテッドアローズ	1.3	1.2	4,548		興銀リース	2	—	—		(注3)	評価額の単位未満は切捨て。			
スギホールディングス	2.3	2.4	11,760		東京センチュリー	2.1	2.2	10,659		(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)				
ユニ・ファミリーマートH D	3.3	12	36,180		イオンフィナンシャルサービス	7.4	6.9	16,028			銘柄 別	当 期	末	
日本瓦斯	1.9	1.8	6,147		オリコ	22.6	29.3	3,457			買 建 額	売 建 額		
しまむら	1.2	1.3	12,220		日立キャピタル	2.9	2.6	7,046		国内	百万円	百万円		
高島屋	16	—	—		オリックス	69.6	72.3	117,089		内	191	—		
丸井グループ	—	9.2	20,552		三菱U F J リース	26.5	24.5	14,063			(注) 単位未満は切捨て。			
イオン	40.1	41.7	96,681		日本取引所グループ	30.7	29.3	58,424						
イズミ	1.9	2.2	11,132		不動産業 (2.9%)									
ヤオコー	1.2	1.2	6,876		いちご	14.9	13.8	5,299						
ケーズホールディングス	4.4	11.3	11,220		ビューリック	21.8	22.6	24,588						
アインホールディングス	1.4	1.5	12,300		野村不動産H L D G S	6.9	7.2	15,796						
ニトリホールディングス	4.1	4.7	62,510		プレサンスコーポレーション	1.4	1.7	2,383						
パローホールディングス	2.4	—	—		オープンハウス	1.7	1.8	7,236						
ファーストリテイリング	1.7	1.4	75,516		東急不動産H D	25.3	29.2	19,359						
サンドラッグ	4.4	4.1	13,263		飯田G H D	8.7	9	18,540						
銀行業 (5.7%)					パーク24	5.8	6.3	15,712						
めがきフィナンシャルG	54.2	56.3	16,664		三井不動産	52.1	57.5	162,063						
東京きらぼしF G	1.4	—	—		三菱地所	77.7	76	154,166						
九州フィナンシャルG	22.8	23.7	11,399		東京建物	11.4	11.8	15,611						
コンコディア・フィナンシャル	63.5	69.1	30,127		住友不動産	25	24.4	114,240						
新生銀行	9	8	12,824		レオパレス21	12.5	13.4	3,242						
あおぞら銀行	6.2	6.1	19,154		スターツコーポレーション	1.4	1.5	3,615						
三菱UFJフィナンシャルG	342.3	499.6	284,871		イオンモール	6.7	5.4	9,779						
りそなホールディングス	114.6	119	59,345		エヌ・ティ・ティ都市開発	6.5	—	—						
三井住友トラストH D	20.5	21.3	88,352		サービス業 (4.5%)									
三井住友フィナンシャルG	60.4	68.5	275,027		ミクシィ	2.6	2.9	7,598						
千葉銀行	37	38.4	23,846		日本M & A センター	3.5	7.8	24,336						
群馬銀行	21.2	—	—		パーソルホールディングス	9.3	10.5	19,813						
静岡銀行	28	27.3	23,805		総合警備保障	4	4.2	19,950						
スルガ銀行	10.7	—	—		カカココム	7.6	7.9	15,879						
ほくほくフィナンシャルG	6.9	—	—		ディップ	1.4	1.7	3,162						

■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 916,600 (34,000)	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作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ34,000株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2019年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 19,903,552	% 84.4
コール・ローン等、その他	3,672,058	15.6
投資信託財産総額	23,575,611	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

2019年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	23,718,441,650円
コール・ローン等	3,639,252,163
株式(評価額)	19,903,552,690
未収入金	53,520
未収配当金	20,077,900
未収利息	348,053
その他未収収益	12,327,324
差入委託証拠金	142,830,000
(B) 負債	3,630,392,564
未払解約金	17,223,473
差入委託証拠金代用有価証券	142,830,000
受入担保金	3,470,339,091
(C) 純資産総額(A－B)	20,088,049,086
元本	14,701,217,669
次期繰越損益金	5,386,831,417
(D) 受益権総口数	14,701,217,669口
1万口当り基準価額(C／D)	13,664円

＊期首における元本額は14,040,935,890円、当作成期間中における追加設定元本額は3,678,957,102円、同解約元本額は3,018,675,323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) 653,234,722円、iFree J P X 日経400インデックス422,788,910円、ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド63,050,638円、ダイワ J P X 日経400ファンド10,444,259,490円、ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 3,117,883,909円です。
 ＊当期末の計算口数当りの純資産額は13,664円です。

■損益の状況

当期 自2018年3月23日 至2019年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	442,361,472円
受取配当金	391,421,554
受取利息	3,680,609
その他収益金	48,930,366
支払利息	△ 1,671,057
(B) 有価証券売買損益	△ 998,774,991
売買益	1,177,608,715
売買損	△2,176,383,706
(C) 先物取引等損益	△ 22,923,780
取引益	39,476,263
取引損	△ 62,400,043
(D) その他費用	△ 1,744,078
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	△ 581,081,377
(F) 前期繰越損益金	5,884,371,038
(G) 解約差損益金	△1,358,595,919
(H) 追加信託差損益金	1,442,137,675
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	5,386,831,417
次期繰越損益金(I)	5,386,831,417

(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】

- ・「J P X 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「J P X 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、J P X グループと日経は、「J P X 日経インデックス400」自体および「J P X 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。
- ・「J P X 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 J P X グループと日経に帰属しています。
- ・J P X グループと日経は、「J P X 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。
- ・J P X グループと日経は、「J P X 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。