

★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	
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	信託財産の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、ＪＰＸ日経インデックス400の値動きをおおむね捉えたとともに、為替取引を行ない、信託財産の成長をめざします。 ②原則として円売り／米ドル買いの為替取引を行なうことで、米ドルへの投資効果を享受することをめざします。この為替取引を行なうにあたっては、外国為替予約取引等を活用します。 ③マザーファンドの受益証券の組入比率は、通常の状態では高位に維持することを基本とします。	
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、通常の状態では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
(米ドル投資型)

運用報告書（全体版）
第3期
(決算日 2016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（米ドル投資型）」は、このたび、第3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/>

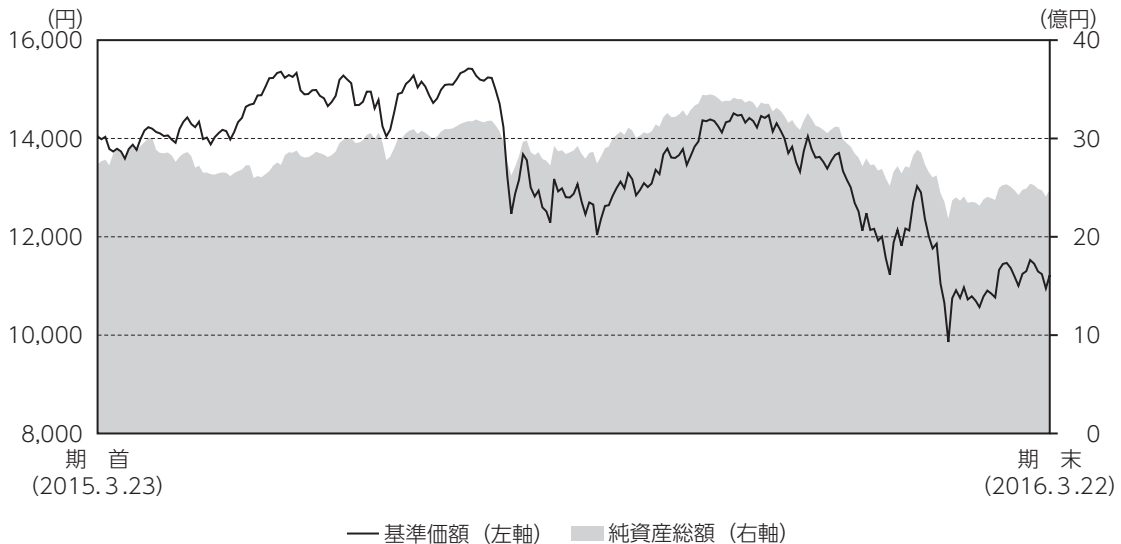
設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			J P X 日経インデックス400		米ドル為替レート		株式組入 比 率	株式先物 比 率	純 資 産 総 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
1 期末(2014年 3 月24日)	円 8,794	円 0	% △12.1	8,946	% △10.5	円 102.32	% △ 2.9	% 96.6	% 1.6	百万円 1,200
2 期末(2015年 3 月23日)	14,042	130	61.2	12,295	37.4	119.95	17.2	97.6	1.9	2,738
3 期末(2016年 3 月22日)	11,223	0	△20.1	10,509	△14.5	111.93	△ 6.7	97.3	1.3	2,479

(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) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。
(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



■基準価額・騰落率

期 首：14,042円
 期 末：11,223円
 騰落率：△20.1%

■基準価額の主な変動要因

ダイワＪＰＸ日経400マザーファンドの受益証券を通じて、ＪＰＸ日経インデックス400の値動きをおおむね捉えるとともに、円売り／米ドル買いの為替取引を行ないました。

ＪＰＸ日経インデックス400が下落したことや為替相場において円高が進んだことがマイナス要因となり、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 J P X日経400ファンド (米ドル投資型)

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400		米ドル為替レート		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2015年 3 月23日	円	%		%	円	%	%	%
	14,042	－	12,295	－	119.95	－	97.6	1.9
3 月末	13,735	△ 2.2	11,917	△ 3.1	120.17	0.2	95.4	2.9
4 月末	13,987	△ 0.4	12,256	△ 0.3	119.00	△0.8	96.6	4.3
5 月末	15,232	8.5	12,850	4.5	123.73	3.2	96.6	2.7
6 月末	14,681	4.6	12,506	1.7	122.45	2.1	97.2	2.3
7 月末	15,088	7.4	12,715	3.4	124.04	3.4	97.3	1.8
8 月末	13,558	△ 3.4	11,739	△ 4.5	121.18	1.0	97.7	2.0
9 月末	12,360	△12.0	10,732	△12.7	119.96	0.0	97.8	1.4
10月末	13,787	△ 1.8	11,898	△ 3.2	120.90	0.8	97.3	1.6
11月末	14,222	1.3	12,095	△ 1.6	122.82	2.4	98.2	1.0
12月末	13,707	△ 2.4	11,857	△ 3.6	120.61	0.6	96.8	2.1
2016年 1 月末	12,709	△ 9.5	10,977	△10.7	120.87	0.8	95.5	1.8
2 月末	10,847	△22.8	9,990	△18.7	113.62	△5.3	97.1	1.6
(期末) 2016年 3 月22日	11,223	△20.1	10,509	△14.5	111.93	△6.7	97.3	1.3

(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、期首より、E C B（欧州中央銀行）による量的金融緩和や国内景気の回復、企業業績の拡大、良好な株式需給関係、円安の進行などをを受けて上昇しました。しかし2015年6月からは、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念や中国株の急落が上値の抑制要因となりました。さらに8月以降は、中国をはじめとした世界経済の先行き不透明感の広がりや円高の進行に加え、ドイツ大手自動車会社の排ガス不正問題やスイス大手資源商社の経営不安観測などが重なり、株価は下落しました。10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやE C Bが追加金融緩和を示唆したこと、中国で追加金融緩和が実施されたこと、国内企業の良い決算が発表されたことなどをを受けて株価は上昇しました。12月以降は、E C Bの追加金融緩和が予想を下回る内容だったことや原油安、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しました。2016年1月末に日銀によるマイナス金利が導入されると株式市況は一時的に好感し上昇基調となりましたが、その後は米国および中国の経済への懸念やさらなる円高、原油安などで投資家のリスク回避姿勢が一段と強まり、株価下落が加速しました。

○為替相場

為替相場は、期首より、米国と日本との金利差が拡大するとの観測から、米ドルが対円で上昇しました。しかし2015年7月以降は、原油価格の下落や人民元の切下げおよび新興国経済の減速懸念の高まりを背景に、リスク回避の動きから円高となりました。その後、9月と10月のF O M C（米国連邦公開市場委員会）では米国の利上げが見送られましたが、方向感に欠ける動きとなりました。10月以降は、堅調な米国の雇用統計を背景に年内の米国の利上げを織り込む展開となり、米ドルが対円で上昇しました。12月には米国の利上げが実施されましたが、原油価格の下落、E C Bの追加金融緩和内容の失望、中国株安や人民元下落などがリスク回避傾向を強め、円高が進行しました。2016年1月末に日銀が予想外のマイナス金利を導入すると円は当初は下落しましたが、一時的な動きにとどまり、米国の景気鈍化や欧州の一部の金融機関に対する懸念から株式市場が調整するなどリスク回避傾向が強まって、円高が進行しました。2月中旬からは原油価格が底打ちの様相となり、米国も利上げ観測の鈍化から米ドル円は横ばい推移となりました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

ダイワＪＰＸ日経400マザーファンドの受益証券を通じて、ＪＰＸ日経インデックス400の値動きをおおむね捉えるとともに、円売り／米ドル買いの為替取引を行なうことで米ドルへの投資効果の享受をめざし、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

ＪＰＸ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

○当ファンド

ダイワＪＰＸ日経400マザーファンドを通じて運用を行ないました。また、円売り／米ドル買いの為替取引を行ないました。

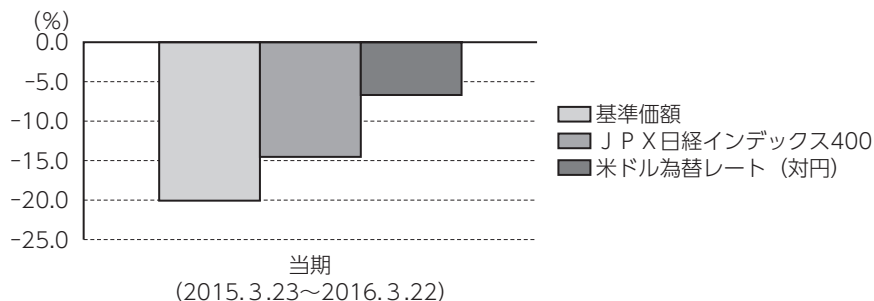
○ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド

ＪＰＸ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。

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（１万口当たり）

項 目		当 期
		2015年3月24日 ～2016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)	2,339

（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

ＪＰＸ日経インデックス400の値動きをおおむね捉えるとともに、円売り／米ドル買いの為替取引を行なうことで米ドルへの投資効果の享受をめざし、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

ＪＰＸ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。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当期		項 目 の 概 要
	(2015.3.24～2016.3.22)		
	金 額	比 率	
信託報酬	96円	0.705%	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13,560円です。
（投信会社）	(47)	(0.345)	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）	(44)	(0.323)	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	3	0.020	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）	(1)	(0.008)	
（先物）	(2)	(0.012)	
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)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	99	0.731	

(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

(2015年3月24日から2016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	1,813,507	2,250,797	1,757,368	2,120,798

(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

(2015年3月24日から2016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	23,316,215千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	26,537,198千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.87

(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

(2015年3月24日から2016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 17,125	百万円 2,028	% 11.8	百万円 6,190	百万円 841	% 13.6
株式	4,678	—	—	4,698	—	—
株式先物取引	127,459	—	—	—	—	—
コール・ローン	—	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合10.6%

※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

(2015年3月24日から2016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 68	百万円 23	百万円 129

(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

(2015年3月24日から2016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 14

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 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

(2015年3月24日から2016年3月22日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	586千円
うち利害関係人への支払額 (B)	33千円
(B)÷(A)	5.7%

(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	千円
ダイワ J P X 日経400マザーファンド	2,161,232	2,217,371 2,439,108

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016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	2,439,108 96.5
コール・ローン等、その他	87,643 3.5
投資信託財産総額	2,526,752 100.0

(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

2016年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,956,581,568円
コール・ローン等	52,267,388
ダイワ J P X 日経400マザーファンド(評価額)	2,439,108,398
未収入金	2,465,205,782
(B) 負債	2,477,228,204
未払金	2,466,954,344
未払解約金	46,725
未払信託報酬	10,149,329
その他未払費用	77,806
(C) 純資産総額(A－B)	2,479,353,364
元本	2,209,229,598
次期繰越損益金	270,123,766
(D) 受益権総口数	2,209,229,598口
1万口当り基準価額(C／D)	11,223円

* 期首における元本額は1,950,131,568円、当期中における追加設定元本額は1,524,149,380円、同解約元本額は1,265,051,350円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,223円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月24日 至2016年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	28,352円
受取利息	28,352
(B) 有価証券売買損益	△590,332,321
売買益	392,911,619
売買損	△983,243,940
(C) 信託報酬等	△ 20,613,749
(D) 当期損益金(A + B + C)	△610,917,718
(E) 前期繰越損益金	226,919,479
(F) 追加信託差損益金	654,122,005
(配当等相当額)	(256,793,169)
(売買損益相当額)	(397,328,836)
(G) 合計(D + E + F)	270,123,766
次期繰越損益金(G)	270,123,766
追加信託差損益金	654,122,005
(配当等相当額)	(256,793,169)
(売買損益相当額)	(397,328,836)
分配準備積立金	260,043,898
繰越損益金	△644,042,137

(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	33,124,419円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	256,793,169
(d) 分配準備積立金	226,919,479
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	516,837,067
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e－f)	516,837,067
(h) 受益権総口数	2,209,229,598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。

《訂正のお知らせ》

作成対象期間の末日が2015年3月23日の交付運用報告書および運用報告書（全体版）につきまして、「1万口当りの費用の明細」の表の「項目の概要」における次の記載にて下線部が不要でした。お詫び申し上げますとともに、下線部を除いてお読み替えくださいますようお願い申し上げます。

「期中の平均基準価額（月末値の平均値）」は10,781円です。」

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

運用報告書 第3期（決算日 2016年3月22日）

（計算期間 2015年3月24日～2016年3月22日）

ダイワ J P X 日経400マザーファンドの第3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。）を主要投資対象とします。
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 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

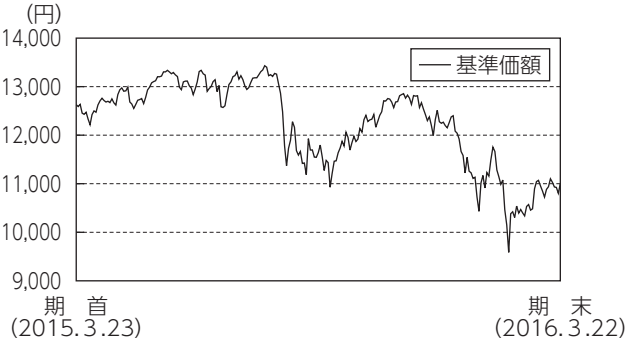
大和投資信託

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 比	式 率	株 先 比	式 物 率
	円	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率				
(期首)2015年 3月23日	12,628	—	12,295	—	98.0	1.9		
3月末	12,332	△ 2.3	11,917	△ 3.1	97.1	2.9		
4月末	12,684	0.4	12,256	△ 0.3	97.4	4.3		
5月末	13,304	5.4	12,850	4.5	97.6	2.7		
6月末	12,960	2.6	12,506	1.7	97.8	2.3		
7月末	13,174	4.3	12,715	3.4	98.2	1.8		
8月末	12,163	△ 3.7	11,739	△ 4.5	98.7	2.0		
9月末	11,208	△11.2	10,732	△12.7	98.9	1.4		
10月末	12,427	△ 1.6	11,898	△ 3.2	98.4	1.6		
11月末	12,634	0.0	12,095	△ 1.6	99.3	1.1		
12月末	12,400	△ 1.8	11,857	△ 3.6	97.9	2.1		
2016年 1月末	11,487	△ 9.0	10,977	△10.7	98.2	1.8		
2月末	10,456	△17.2	9,990	△18.7	98.7	1.6		
(期末)2016年 3月22日	11,000	△12.9	10,509	△14.5	98.9	1.3		

(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：12,628円 期末：11,000円 騰落率：△12.9%

【基準価額の主な変動要因】

J P X日経インデックス400への運動をめざした運用を行なった結果、J P X日経インデックス400の動きを反映して、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、期首より、E C B（欧州中央銀行）による量的金融緩和や国内景気の回復、企業業績の拡大、良好な株式需給関係、円安の進行などを受けて上昇しました。しかし2015年6月からは、ギリシャのデフォルト（債務不履行）懸念や中国株の急落が上値の抑制要因となりました。さらに8月以降は、中国をはじめとした世界経済の先行き不透明感の広がりや円高の進行に加え、ドイツ大手自動車会社の排ガス不正問題やスイス大手資源商社の経営不安観測などが重なり、株価は下落しました。10月に入ると、世界経済に対する過度な不安感が後退したことやE C Bが追加金融緩和を示唆したこと、中国で追加金融緩和が実施されたこと、国内企業の良好な決算が発表されたことなどを受けて株価は上昇しました。12月以降は、E C Bの追加金融緩和が予想を下回る内容だったことや原油安、中国・人民元安と中国株安、円高などにより株価は下落しま

した。2016年1月末に日銀によるマイナス金利が導入されると株式市況は一時的に好感し上昇基調となりましたが、その後は米国および中国の経済への懸念やさらなる円高、原油安などで投資家のリスク回避姿勢が一段と強まり、株価下落が加速しました。

◆前期における「今後の運用方針」

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

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いました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（J P X日経インデックス400）の騰落率は△14.5%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△12.9%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》

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。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	3円 (1)
(先物)	(2)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	3

(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

(2015年3月24日から2016年3月22日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 11,607.8 (△ 492.4)	千円 17,125,894 (—)	千株 4,453.5	千円 6,190,321

(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、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

(2015年3月24日から2016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 4,678	百万円 4,698	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

(2015年3月24日から2016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
ソフトバンクグループ		49.4	324,703	6,572	東芝		349	135,441	388
日本たばこ産業		74	319,214	4,313	KDD I		42.7	127,995	2,997
本田技研		75.5	282,151	3,737	トヨタ自動車		14.8	116,133	7,846
KDD I		85.9	253,394	2,949	三菱UFJフィナンシャルG		135.3	111,414	823
日本電信電話		51.3	252,423	4,920	日本電信電話		17.2	98,511	5,727
三井住友フィナンシャルG		53.2	250,672	4,711	キャノン		22.6	92,009	4,071
MS & AD		65.8	248,463	3,776	J Xホールディングス		193.3	91,504	473
武田薬品		41.1	238,715	5,808	ファナック		3.2	77,255	24,142
みずほフィナンシャルG		930.5	217,560	233	パナソニック		49.5	74,686	1,508
トヨタ自動車		29.3	217,258	7,414	日本たばこ産業		17.1	73,990	4,326

(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				銘柄				銘柄			
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	
鉱業 (0.4%)				バルブ・紙 (0.2%)				医薬品 (7.2%)			
国際石油開発帝石	79.8	117.4	109,686	王子ホールディングス	58	85	40,460	エフピコ	1.7	—	—
建設業 (3.2%)				大王製紙	—	9.2	9,016	ニフコ	3.2	4	21,920
安藤・岡	10.1	14.9	8,761	化学 (6.6%)				ユニ・チャーム	28.7	42.2	104,845
コムシスホールディングス	6.7	9.6	17,366	クラレ	24.1	32.9	45,073	協和発酵キリン	17	24.9	44,097
ミサワホーム	1.8	2.6	2,093	旭化成	88	130	94,341	武田薬品	53	82.9	447,162
大成建設	79	116	88,740	昭和電工	94	—	—	アステラス製薬	161.2	233.2	360,294
大林組	—	66.8	75,016	住友化学	—	153	79,407	塩野義製薬	22.1	30.4	165,649
清水建設	—	68	65,960	日産化学	9.3	12.5	36,525	田辺三菱製薬	16.5	24.3	47,846
長谷工コーポレーション	18.9	26	28,444	東ソー	35	56	27,440	中外製薬	14.1	20.7	70,173
鹿島建設	67	104	75,608	東亜合成	18	—	—	科研製薬	5	3.6	23,220
三井住友建設	—	85.4	8,625	デンカ	29	43	20,081	エーザイ	18.7	25.6	176,998
大東建託	5.8	8.3	135,124	信越化学	25.4	37.4	224,774	ロート製薬	6.4	10.2	21,379
NIPPO	4	5	9,225	エア・ウォーター	13	17	28,492	小野薬品	6.4	9.5	214,082
住友林業	11.2	15.3	19,859	大陽日酸	18	16	17,456	久光製薬	4	6.5	32,695
大和ハウス	44.3	65.8	212,599	日本バーカライジング	3.3	10.6	10,854	持田製薬	1	1.4	11,284
積水ハウス	47	74.5	147,957	日本触媒	11	—	—	参天製薬	5.2	38.3	63,807
協和エクシオ	6.4	8.7	11,257	J S R	14	19.5	32,818	ツムラ	4.5	6.6	18,024
日揮	15	22	41,734	三菱ケミカルHLDGS	88.5	139.5	85,443	沢井製薬	2.2	3.5	25,445
東芝プラントシステム	2.5	—	—	日本合成化学	3	5	3,530	第一三共	47.6	70	182,595
千代田化工建	11	16	15,152	ダイセル	19.9	29.3	42,690	キョーリン製薬HD	3.8	5.6	12,090
食料品 (5.0%)				積水化学	33	47.3	64,895	大塚ホールディングス	28.1	44.8	182,336
日清製粉G本社	16.6	—	—	日本ゼオン	12	18	13,302	大正製薬HD	3.4	5	45,250
カルビー	5.6	8.3	37,765	アイカ工業	4.3	6.3	14,735	石油・石炭製品 (0.1%)			
ヤクルト	8.1	11.9	63,070	宇部興産	71	111	23,088	昭和シェル石油	12.7	20.9	20,565
明治ホールディングス	4.5	13.2	117,876	日立化成	7	10.3	20,981	東燃ゼネラル石油	21	—	—
日本ハム	11	16	40,320	日本化薬	9	14	15,554	出光興産	6.7	—	—
アサヒグループホールディン	30.4	41.8	142,161	日油	—	16	12,848	JXホールディングス	157.1	—	—
キリンHD	64.8	90.3	142,132	花王	38.1	56	332,360	ゴム製品 (1.2%)			
伊藤園	4.5	6.6	23,496	日本ペイントHOLD	12.3	16.1	41,216	横浜ゴム	16	12.6	22,957
キッコーマン	12	15	56,250	関西ペイント	17	23.6	42,739	東洋ゴム	6.4	9.4	16,365
味の素	35	48	130,104	D I C	57	82	21,484	ブリヂストン	44.4	70.3	290,198
キューピー	7.7	11.3	28,984	東洋インキSCホールディン	14	—	—	住友ゴム	11	19.5	33,091
ニチレイ	16	24	21,576	富士フイルムHLDGS	32.4	47.7	214,888	ガラス・土石製品 (0.8%)			
東洋水産	7.9	11	44,770	資生堂	25.2	39.5	98,592	旭硝子	70	110	68,090
日清食品HD	6.4	9.4	51,512	コーセー	—	3.4	36,040	日本電気硝子	27	—	—
日本たばこ産業	72.6	129.5	594,664	シース・ホールディングス	1	2.6	6,076	太平洋セメント	88	130	36,530
繊維製品 (0.5%)				小林製薬	2.3	3.2	31,040	TOTO	21	15.3	54,468
東レ	110	151	143,510	日東電工	10.9	16.1	111,605	日本硝子	—	26	53,768

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	評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	評価額
日本特殊陶業	千株 12.2	千株 17.9	千円 37,822	富士通	千株 130	千株 192	千円 81,273	オリンパス	千株 -	千株 -	千円 -
ニチアス	6	-	-	沖電気	47	86	13,932	HOYA	32.2	46.3	130,684
鉄鋼 (1.2%)				セイコーエプソン	9.2	29.6	57,512	セイコーHD	-	13	5,837
新日鐵住金	598	93.9	206,767	ワコム	10.6	15.7	8,258	その他製品 (0.6%)			
神戸製鋼所	-	382	40,492	パナソニック	164.7	227.2	231,062	パナダイナムコHLDGS	14.9	20.6	50,779
JFEホールディングス	36.1	56.9	87,796	アンリツ	8.5	11.9	8,270	パイロットコーポレーション	-	3.5	14,787
大同特殊鋼	24	-	-	富士通ゼネラル	4	6	10,242	アシックス	13.4	18.5	39,275
日立金属	14	23.8	28,607	日立国際電気	-	4.5	5,872	ヤマハ	-	14.6	51,465
非鉄金属 (0.9%)				TDK	8.2	12	82,320	ビジョン	2.6	11.3	31,097
三井金属	38	53	10,494	アルプス電気	-	16.9	35,709	電気・ガス業 (0.9%)			
三菱マテリアル	88	130	44,980	ヒロセ電機	2.2	3.2	41,248	電源開発	9.8	17	58,310
住友鉱山	39	57	71,193	日本航空電子	-	6	7,704	東京瓦斯	164	222	113,886
DOWAホールディングス	17	27	19,008	横河電機	13.5	19.9	22,765	大阪瓦斯	140	206	86,787
住友電工	53.3	83.3	114,162	日本光電工業	2.9	8.3	24,825	陸運業 (5.8%)			
アサヒHD	2.1	3.1	4,882	堀場製作所	2.5	3.7	15,577	東武鉄道	72	106	59,678
金属製品 (0.3%)				キーエンス	3.1	4.5	271,035	相鉄ホールディングス	31	45	30,735
三和ホールディングス	-	21.1	16,795	シスメックス	10.5	15.4	109,032	東京急行	73	116	107,300
三協立山	-	2.7	3,996	スタンレー電気	9.7	14.3	35,521	小田急電鉄	43	64	78,336
LIXILグループ	21	-	-	カシオ	13.5	19.9	45,053	京王電鉄	38	56	54,768
リンナイ	2.6	3.9	39,273	ファナック	14.1	20.3	360,223	京成電鉄	20	30	45,780
ジーテクト	1.3	-	-	エンプラス	-	1	4,265	東日本旅客鉄道	24.8	36.4	371,098
日本発条	12.3	19.6	21,383	浜松ホトニクス	5.6	15.5	49,057	西日本旅客鉄道	13	19.1	132,458
機械 (4.8%)				京セラ	22.2	32.6	166,260	東海旅客鉄道	12.1	17.8	357,424
日本製鋼所	20	-	-	村田製作所	14.2	20.9	300,855	西日本鉄道	23	34	25,670
オーエスジー	6.4	9.5	19,845	小糸製作所	8.1	11.9	59,738	近鉄グループHLDGS	136	200	91,800
ディスコ	1.6	2.7	26,352	ミツバ	2.5	3.4	5,865	阪急阪神HLDGS	91	133	92,701
ニューフレアテクノロジー	0.2	0.4	2,088	キャノン	78.4	107.1	359,427	南海電鉄	-	60	36,840
ナブテスコ	8.6	10.8	26,740	リコー	40.6	64.4	74,768	京阪電鉄	40	59	46,669
SMC	4.2	6.2	167,493	東京エレクトロン	-	16.3	117,376	名古屋鉄道	66	97	50,634
小松製作所	70.1	102	197,982	輸送用機器 (8.5%)				日本通運	54	77	39,809
住友重機械	39	61	29,829	トヨタ紡織	4.7	7	12,453	ヤマトホールディングス	23.8	36.8	86,075
日立建機	6.3	9.3	17,112	鬼怒川ゴム	3	-	-	山九	16	26	13,156
クボタ	68	99.9	154,145	ユニプレス	2.6	4.1	8,126	日立物流	2.8	-	-
荏原製作所	29	46	22,954	豊田自動織機	12.3	18.1	90,319	海運業 (0.1%)			
ダイキン工業	19.7	29	242,585	デンソー	33.4	49.1	219,427	日本郵船	-	178	40,584
栗田工業	8	-	-	東海理化電機	-	5.8	12,110	空運業 (0.4%)			
椿本チエイン	7	12	8,928	三井造船	52	77	13,552	ANAホールディングス	266	369	120,736
タダノ	7	10	10,640	川崎重工業	98	155	50,995	倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
平和	2.9	6.2	15,121	名村造船所	2.6	6	5,196	上組	16	-	-
SANKYO	4.1	-	-	日産自動車	189.7	279.1	301,986	近鉄エクスプレス	1.2	3.6	5,698
ユニバーサルエンターテインメント	1.3	2	3,776	いすゞ自動車	42.7	57.6	67,420	情報・通信業 (8.5%)			
セガサミーホールディングス	14.5	21.4	27,841	トヨタ自動車	43.7	58.2	354,903	グリー	8.1	11.9	6,997
TPR	1.5	2.4	7,008	日野自動車	19.3	28.4	35,954	ネクソン	-	18.8	35,362
ホシザキ電機	3.9	5.8	55,216	三菱自動車工業	49.5	79	66,360	ティーガイア	1.3	2	2,850
日本精工	28	40.8	42,636	NOK	6.5	9.6	18,739	ガホー・オンライン・エンター	33.8	45.7	13,664
ジェイテクト	14.4	21.2	31,545	KYB	15	-	-	インターネットアジアティ	2.2	-	-
不二越	13	18	7,434	大同メタル工業	1.9	-	-	野村総合研究所	7.6	13.8	55,752
THK	9	13.2	26,782	カルソニックカンセイ	10	15	11,760	フジ・メディア・HD	13.9	20.4	26,866
イーグル工業	-	2.5	3,847	アイシン精機	12.4	20	86,900	オービック	4.6	6.8	39,848
マキタ	8.8	13	91,910	マツダ	40.3	63	107,257	ヤフー	95.6	140.7	67,676
三菱重工業	227	354	153,813	ダイハツ	16.1	23.7	37,659	トレンドマイクロ	7.1	9.5	41,372
IHI	97	153	35,343	本田技研	75.8	133.6	413,625	日本オラクル	2.1	3.1	19,065
電気機器 (12.2%)				スズキ	28.3	41.6	124,009	伊藤忠テクノソリューション	1.5	4.4	9,838
コニカミノルタ	32.2	49.7	50,544	富士重工業	46	62.8	248,248	大塚商会	3.6	5.3	30,104
ブラザー工業	17.5	25.7	34,463	ヤマハ発動機	20.6	28.1	51,366	USEN	7.8	9	2,934
ミネベア	20	32	29,312	エクセディ	1.8	2.7	6,596	エイベックス・グループHD	2.6	3.6	5,104
日立	325	507	271,143	豊田合成	4.4	7.2	15,552	日本テレビHLDGS	12.2	17.9	33,634
東芝	285	-	-	日本精機	-	5	10,350	日本電信電話	42.2	117.9	586,198
三菱電機	135	212	251,962	エフ・シー・シー	2	-	-	KDDI	45.2	179.2	558,745
富士電機	38	60	23,880	シマノ	5.8	8	147,200	光通信	1.2	2.4	20,472
安川電機	15.9	24.7	31,739	ディ・エス・テック	2.9	4.6	11,987	NTTドコモ	109.9	151.4	395,683
日本電産	14.4	23.9	194,498	精密機器 (1.8%)				GMOインターネット	4.5	7.3	10,322
オムロン	14.6	22.5	76,387	デルモ	20.7	30.5	125,202	東宝	9.5	14	41,734
ジーエス・ユアサコーポ	26	-	-	ニコン	25.2	37.1	66,705	NTTデータ	8.2	12.1	67,034
日本電気	-	273	78,078	トプコン	-	6.7	9,909	SCSK	3.2	4.7	19,857

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
コナミホールディングス	千株 5.4	千株 —	千円 —
ソフトバンクグループ	38.3	78.7	443,238
卸売業 (4.6%)			
双日	89.3	123.6	29,911
アルフレックスホールディングス	15.8	24.7	54,562
シッパヘルスケアHD	2.4	4	12,120
三菱食品	1.5	—	—
第一興商	3.2	4.6	21,574
メディパルHD	13.3	19.6	35,515
伊藤忠	111.7	154	222,376
丸紅	116.7	193.1	119,200
豊田通商	14.9	21.9	58,035
兼松	27	42	7,014
三井物産	113.1	177.5	251,872
日立ハイテクノロジーズ	4.6	6.8	21,284
山善	5.1	—	—
住友商事	78.7	123.5	149,496
三菱商事	102.2	147.3	301,965
岩谷産業	15	23	14,904
東邦ホールディングス	4.6	6.3	15,075
サンリオ	3.7	6	14,022
日鉄住金物産	12	17	6,528
ミスミグループ本社	5	22	36,102
小売業 (4.8%)			
ローソン	5.1	7.4	70,004
エービーシー・マート	1.9	2.5	17,625
ゲオホールディングス	2.5	3.7	7,322
日本マクドナルドHLDG	5.6	—	—
パル	0.8	—	—
セリア	1.6	2.1	15,057
MonotaRO	2.6	6.9	22,011
J. フロントリテイリング	16.9	24.8	34,918
マツモトキヨシHLDGS	3	4	23,000
スタートトゥデイ	4.2	6	26,460
三越伊勢丹HD	26.5	39	52,416
ウエルシアHD	1.6	2.3	14,674
コスモス薬品	0.7	1	18,950
セブン&アイ・HLDGS	55.8	82.1	390,631
ツルハホールディングス	2.8	4.5	49,365
良品計画	1.6	2.3	51,612
ドンキホーテホールディング	4.3	12.7	50,990
VTホールディングス	5.5	8.8	5,799
ユナイテッドアローズ	1.7	2.8	13,356
スギホールディングス	2.4	3.5	20,930
ファミリーマート	4.5	6	34,560
日本瓦斯	—	3	7,569
AOKIホールディングス	3.1	4.5	6,282
コメリ	2.3	—	—
しまむら	1.5	2.3	29,923
高島屋	19	29	26,622
イオン	53.3	80.8	129,522
ユニーグループ・HD	12.8	—	—
イズミ	3	3.9	18,915
ヤオコー	—	2.2	10,582
ケーズホールディングス	3.1	4.1	15,785
アインホールディングス	1.6	2.4	13,752
ヤマダ電機	52.7	—	—
ニトリホールディングス	5.8	8.5	80,240
王将フードサービス	1	—	—
アークス	3.1	—	—
パローホールディングス	2.9	4.2	12,066
ファーストリテイリング	2.7	3.9	139,074
サンドラッグ	2.8	4.1	33,866
銀行業 (6.3%)			
新生銀行	127	170	25,670

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
あおぞら銀行	千株 90	千株 124	千円 49,352
三菱UFJフィナンシャルG	457	601.6	332,684
りそなホールディングス	156.1	229.6	94,204
三井住友トラストHD	295	410	140,179
三井住友フィナンシャルG	63.1	102.7	370,644
西日本シティ銀行	47	64	13,376
千葉銀行	51	76	42,484
横浜銀行	92	132	70,554
常陽銀行	48	71	29,394
群馬銀行	32	44	22,484
群おかフィナンシャルG	54	85	33,065
静岡銀行	39	57	48,678
十六銀行	22	33	11,451
スルガ銀行	14.1	18.6	37,200
八十二銀行	32	47	24,628
ほくほくフィナンシャルG	91	134	22,244
広島銀行	39	58	25,172
中国銀行	12.8	18.5	22,477
伊予銀行	19	28	21,700
セブン銀行	45	73.5	34,471
みずほフィナンシャルG	1,375.2	2,017.7	361,370
山口フィナンシャルG	18	24	25,440
北洋銀行	20.1	29.6	8,939
京葉銀行	15	22	9,658
証券、商品先物取引業 (1.4%)			
SBIホールディングス	—	23.6	27,682
ジャフコ	—	3.3	11,665
大和証券G本社	125	184	129,664
野村ホールディングス	272.7	377.6	196,767
岡三証券グループ	11	17	10,761
東海東京HD	15.3	22.5	14,737
日本証券	6.8	10	10,200
カブドットコム証券	—	17.4	6,577
保険業 (3.0%)			
損保ジャパン興亜HD	—	43.6	138,255
MS & AD	—	58.7	178,154
SONY F H	12.8	18.8	29,403
第一生命	85.5	125.7	172,460
東京海上HD	54.9	79.5	309,811
T & Dホールディングス	48.6	71.5	76,076
その他金融業 (1.6%)			
クレディセゾン	10.9	14.9	30,530
芙蓉総合リース	1.4	2.2	10,516
興銀リース	2.5	3.7	7,607
東京センチュリーリース	3.1	4.6	18,768
Jトラスト	4	—	—
アイフル	22.3	—	—
リコーリース	1	—	—
イオンフィナンシャルサービス	8.8	12.9	34,971
アコム	26.8	39.4	21,630
日立キャピタル	2.6	4.6	11,573
オリックス	94.4	139	225,805
三菱UFJリース	33.8	49.8	25,398
日本取引所グループ	19.6	57.6	103,680
不動産業 (3.5%)			
ヒューリック	22.5	40.9	42,781
野村不動産HLDGS	8	13	27,625
プラサンスコーポレーション	—	0.7	2,926
東急不動産HD	35	47.5	36,195
飯田GHHD	8.7	18.2	40,222
パーク24	6.7	9.9	29,304
三井不動産	71	104	290,212
三菱地所	99	146	318,937
東京建物	—	21.4	30,409
住友不動産	32	47	153,784

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
大京	千株 21	千株 36	千円 6,660
レオパレス21	14.6	23.1	15,477
スターツコーポレーション	—	3	7,560
住友不動産販売	1	1.4	3,196
タカラレーベン	5.9	8.6	5,865
イオンモール	8.6	12.7	21,463
エヌ・ティ・ティ都市開発	8.3	12.2	13,566
サービス業 (3.5%)			
ミクシィ	—	4.2	17,367
日本M & Aセンター	—	3.2	19,776
アコーディア・ゴルフ	5.3	—	—
テンパホールディングス	2.8	14.6	22,922
クックパッド	—	4.6	9,880
総合警備保障	—	6.9	41,607
カカココム	9.3	15.1	33,084
エムスリー	12.2	18	49,338
ディー・エヌ・エー	7	9.3	18,200
博報堂DYHLDGS	19.6	28.8	36,057
電通	15.7	23.1	128,436
みらかホールディングス	3.7	5.3	25,201
オリエンタルランド	3.8	22.5	181,035
リゾートトラスト	5.2	8.7	22,037
りらいあコミュニケーション	2.6	—	—
ユー・エス・エス	17.1	25.1	45,832
サイバーエージェント	3.4	5.1	25,602
楽天	61.3	97.2	103,080
リロ・ホールディング	0.6	1	14,630
エイチ・アイ・エス	2.3	3.4	11,101
カナモト	—	2.9	7,861
セコム	13.7	21.6	184,032
ペネッセホールディングス	5.2	7	24,395
イオンディライト	1.4	2	7,400
合 計			
株数、金額	14,406.7	21,068.6	29,815.181
銘柄数<比率>	399銘柄	400銘柄	<98.9%>

(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	期末
買 建 額	売 建 額	
国内	百万円 393	百万円 —
TOPIX	—	—

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 29,815,181	% 98.4
コール・ローン等、その他	481,733	1.6
投資信託財産総額	30,296,915	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

2016年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	30,438,121,833円
コール・ローン等	422,911,140
株式(評価額)	29,815,181,910
未収入金	11,075,683
未収配当金	47,747,100
差入委託証拠金	141,206,000
(B) 負債	279,237,158
未払金	101,030,776
未払解約金	35,376,382
差入委託証拠金代用有価証券	142,830,000
(C) 純資産総額(A－B)	30,158,884,675
元本	27,417,450,149
次期繰越損益金	2,741,434,526
(D) 受益権総口数	27,417,450,149口
1万口当り基準価額(C／D)	11,000円

＊期首における元本額は18,516,946,625円、当期中における追加設定元本額は15,850,654,754円、同解約元本額は6,950,151,230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）2,217,371,271円、ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド925,646円、ダイワ J P X 日経400ファンド22,330,964,350円、ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 2,868,188,882円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,000円です。

■損益の状況

当期 自2015年3月24日 至2016年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	492,628,917円
受取配当金	492,054,269
受取利息	316,759
その他収益金	257,889
(B) 有価証券売買損益	△4,030,677,932
売買益	1,089,986,997
売買損	△5,120,664,929
(C) 先物取引等損益	△ 28,691,946
取引益	134,508,445
取引損	△ 163,200,391
(D) 当期損益金(A + B + C)	△3,566,740,961
(E) 前期繰越損益金	4,866,479,753
(F) 解約差損益金	△1,808,913,027
(G) 追加信託差損益金	3,250,608,761
(H) 合計(D + E + F + G)	2,741,434,526
次期繰越損益金(H)	2,741,434,526

(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。