

ダイワ・インデックスセレクト J P X日経400

★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2カ月間（2014年1月31日～2028年3月22日）	
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	ベビーファンド	ダイワJ P X日経400マザーファンドの受益証券
	ダイワJ P X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	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。	
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。

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・インデックスセレクト J P X日経400」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 (ベンチマーク)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比	純 資 産 額
	税 込 分 配 金	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率	期 中 騰 落 率				
1 期 末 (2014年 3月 24日)	円 9,515	円 0	% △ 4.9	9,514	% △ 4.9	% 98.5	% 1.6	百万円 236
2 期 末 (2015年 3月 23日)	13,257	0	39.3	13,077	37.4	98.0	1.9	1,912
3 期 末 (2016年 3月 22日)	11,497	0	△13.3	11,177	△14.5	98.9	1.3	3,155

(注1) 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2) 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



(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 J P X 日経インデックス400 です。

■ 基準価額・騰落率

期首：13,257円

期末：11,497円

騰落率：△13.3%

■ 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、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。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・インデックスセレクト J P X日経400

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	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2015年 3月23日	円 13,257	% -	13,077	% -	% 98.0	% 1.9
3 月末	12,945	△ 2.4	12,675	△ 3.1	97.1	2.9
4 月末	13,309	0.4	13,035	△ 0.3	97.4	4.3
5 月末	13,955	5.3	13,667	4.5	97.6	2.7
6 月末	13,589	2.5	13,301	1.7	97.8	2.3
7 月末	13,808	4.2	13,523	3.4	98.2	1.8
8 月末	12,744	△ 3.9	12,486	△ 4.5	98.7	2.0
9 月末	11,739	△11.5	11,414	△12.7	98.9	1.4
10月末	13,011	△ 1.9	12,655	△ 3.2	98.4	1.6
11月末	13,223	△ 0.3	12,864	△ 1.6	99.3	1.1
12月末	12,974	△ 2.1	12,611	△ 3.6	97.9	2.1
2016年 1 月末	12,014	△ 9.4	11,676	△10.7	98.2	1.8
2 月末	10,932	△17.5	10,625	△18.7	98.6	1.6
(期末) 2016年 3月22日	11,497	△13.3	11,177	△14.5	98.9	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」

○当ファンド

ダイワJ P X日経400マザーファンドを通じ、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。

○ダイワJ P X日経400マザーファンド

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

○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

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。

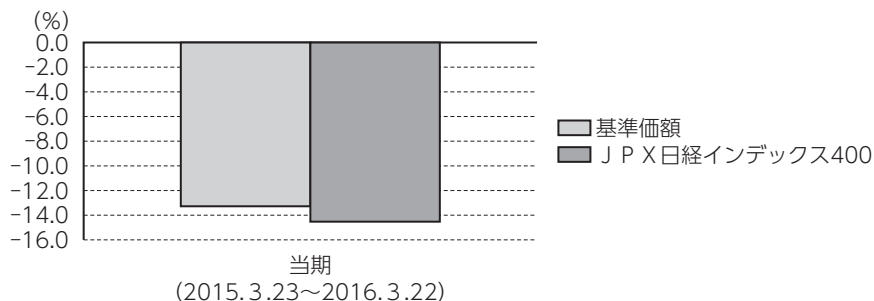
ベンチマークとの差異について

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△13.3%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

当期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配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	
	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）	2,128

(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、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。

○ダイワJ P X日経400マザーファンド

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。

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	55円	0.431%	信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率 期中の平均基準価額は12,800円です。
(投信会社)	(27)	(0.210)	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)	(0.188)	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)	(0.032)	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	0.021	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)	(0.009)	
(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	0.005	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(監査費用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	58	0.457	

(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まず。

(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	1,380,672	1,665,655	26,629	33,807

(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					
	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
区 分	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	17,125	2,028	11.8	6,190	841	13.6
株式先物取引	4,678	-	-	4,698	-	-
コール・ローン	127,459	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合9.7%

※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)	548千円
うち利害関係人への支払額 (B)	30千円
(B) / (A)	5.5%

(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	千口	千円
ダイワJ P X日経400マザーファンド	1,514,146	2,868,188	3,155,007

(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	3,155,007	99.8
コール・ローン等、その他	7,430	0.2
投資信託財産総額	3,162,438	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	3,162,438,269円
コール・ローン等	7,430,499
ダイワJPX日経400マザーファンド(評価額)	3,155,007,770
(B) 負債	7,340,202
未払解約金	1,046,900
未払信託報酬	6,215,318
その他未払費用	77,984
(C) 純資産総額(A - B)	3,155,098,067
元本	2,744,177,307
次期繰越損益金	410,920,760
(D) 受益権総口数	2,744,177,307口
1万口当り基準価額(C / D)	11,497円

* 期首における元本額は1,442,391,737円、当期中における追加設定元本額は1,545,569,951円、同解約元本額は243,784,381円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,497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	2,461円
受取利息	2,461
(B) 有価証券売買損益	△383,221,644
売買益	10,228,524
売買損	△393,450,168
(C) 信託報酬等	△ 11,478,843
(D) 当期損益金(A + B + C)	△394,698,026
(E) 前期繰越損益金	269,740,582
(F) 追加信託差損益金	535,878,204
(配当等相当額)	(314,223,731)
(売買損益相当額)	(221,654,473)
(G) 合計(D + E + F)	410,920,760
次期繰越損益金(G)	410,920,760
追加信託差損益金	535,878,204
(配当等相当額)	(314,223,731)
(売買損益相当額)	(221,654,473)
分配準備積立金	269,740,582
繰越損益金	△394,698,026

(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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	314,223,731
(d) 分配準備積立金	269,740,582
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	583,964,313
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	583,964,313
(h) 受益権総口数	2,744,177,307口

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。

《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10,934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

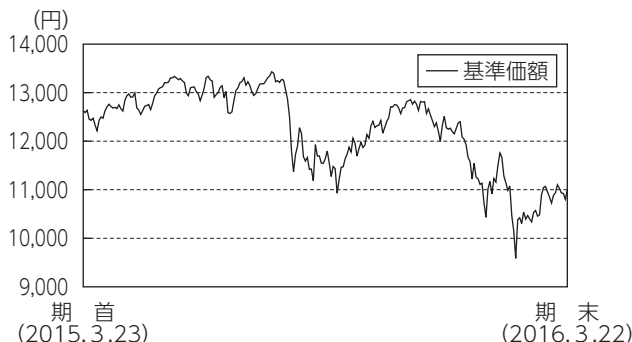
Daiwa Asset Management

東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

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

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

■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 先 物 比 率	株 式 先 物 比 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への連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まいります。

◆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》

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。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物)	3円 (1) (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

(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 株式先物取引	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	KDDI	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
KDDI	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	キヤノン	22.6	92,009	4,071
MS&AD	65.8	248,463	3,776	JX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	期首		期末		銘柄	期首		期末		銘柄	期首		期末	
	株数	株数	評価額	評価額		株数	株数	評価額	評価額		株数	株数	評価額	評価額
	千株	千株	千円	千円		千株	千株	千円	千円		千株	千株	千円	千円
鉱業 (0.4%)					バルブ・紙 (0.2%)									
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・間	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	
NIPPPO	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		JSR	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	—	—		日本セオン	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		昭和シエル石油	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グス	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		DI 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ホールディングス	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			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	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		千株	千株	千円		千株	千株	千円	
日本特殊陶業	12.2	17.9	37,822		富士通	130	192	81,273	オリンパス	-	-	-	29.6	130,684						
ニチアス	6	-	-		沖電気	47	86	13,932	HOYA	32.2	46.3	205,201		46.3	205,201					
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		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	-	38.2	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		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		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		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		14.6	51,465					
非鉄金属 (0.9%)					TDK	8.2	12	8,230	ビジョン	2.6	11.3	31,097		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		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		59	46,669					
SMC	4.2	6.2	167,493		東京エレクトロ	-	16.3	117,376	名古屋鉄道	66	97	50,634		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		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		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		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		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		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		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		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		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		2	2,850					
日本精工	28	40.8	42,636		NOK	6.5	9.6	18,739	ガンホー・オンライン・エンター	33.8	45.7	13,664		45.7	13,664					
ジェイテクト	14.4	21.2	31,545		KYB	15	-	-	インターネットインシアティブ	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		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		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		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		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		9.5	41,372					
IHI	97	153	35,343		本田技研	75.8	133.6	413,625	日本オラル	2.1	3.1	19,065		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ズ	1.5	4.4	9,838		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		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		9	2,934					
ミネベア	20	32	29,312		エクセディ	1.8	2.7	6,596	イベックス・グループHD	2.6	3.6	5,104		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		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		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		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		2.4	20,472					
安川電機	15.9	24.7	31,739		ティ・エス・テック	2.9	4.6	11,987	NTTドコモ	109.9	151.4	395,683		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		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		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		12.1	67,034					
日本電気	-	27.3	78,078		トプコン	-	6.7	9,909	SCKK	3.2	4.7	19,857		4.7	19,857					

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	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
コナミホールディングス	千株	千株	千円				あおぞら銀行	千株	千株	千円				大京	千株	千株	千円			
ソフトバンクグループ	5.4	—	—				三菱UFJフィナンシャルG	90	124	49,352				レオパレス21	21	36	6,660			
卸売業 (4.6%)	38.3	78.7	443,238				リそなホールディングス	457	601.6	332,684				スターツコーポレーション	14.6	23.1	15,477			
双日	89.3	123.6	29,911				三井住友トラストHD	156.1	229.6	94,204				住友不動産販売	—	3	7,560			
アルフレッサホールディングス	15.8	24.7	54,562				三井住友フィナンシャルG	295	410	140,179				イオンモール	1	1.4	3,196			
シッパルスケアHD	2.4	4	12,120				西日本シティ銀行	63.1	102.7	370,644				エヌ・ティ・ティ都市開発	5.9	8.6	5,865			
三菱食品	1.5	—	—				千葉銀行	47	64	13,376				サバービ業 (3.5%)	8.6	12.7	21,463			
第一興商	3.2	4.6	21,574				横浜銀行	51	76	42,484				ミクシィ	8.3	12.2	13,566			
メディアバルHD	13.3	19.6	35,515				横濱銀行	92	132	70,554				日本M&Aセンター	—	3.2	19,776			
伊藤忠	111.7	154	222,376				群馬銀行	48	71	29,394				アコディア・ゴルフ	—	—	—			
丸紅	116.7	193.1	119,200				群馬銀行	32	44	22,484				テンポホールディングス	5.3	—	—			
豊田通商	14.9	21.9	58,035				ふくおかフィナンシャルG	32	44	22,484				クックパッド	2.8	14.6	22,922			
兼松	27	42	7,014				静岡銀行	54	85	33,065				総合警備保障	—	4.6	9,880			
三井物産	113.1	177.5	251,872				十六銀行	39	57	48,678				カカココム	—	6.9	41,607			
日立ハイテクノロジーズ	4.6	6.8	21,284				スルガ銀行	22	33	11,451				エムスリー	9.3	15.1	33,084			
山善	5.1	—	—				八十二銀行	14.1	18.6	37,200				ティーツー・エヌ・イー	12.2	18	49,338			
住友商事	78.7	123.5	149,496				ほくほくフィナンシャルG	91	134	22,244				博報堂DHYHL DGS	7	9.3	18,200			
三菱商事	102.2	147.3	301,965				中国銀行	39	58	25,172				電通	19.6	28.8	36,057			
岩谷産業	15	23	14,904				伊予銀行	12.8	18.5	22,477				みらかホールディングス	15.7	23.1	128,436			
東邦ホールディングス	4.6	6.3	15,075				セブン銀行	19	28	21,700				オリエンタルランド	3.7	5.3	25,201			
サンリオ	3.7	6	14,022				みずほフィナンシャルG	45	73.5	34,471				リゾートトラスト	3.8	22.5	181,035			
日鉄住金物産	12	17	6,528				山口フィナンシャルG	1,375.2	2,017.7	361,370				りらいあコミュニケーション	5.2	8.7	22,037			
ミスミグループ本社	5	22	36,102				北洋銀行	18	24	25,440				ユー・エス・エス	2.6	—	—			
小売業 (4.8%)							京葉銀行	20.1	29.6	8,939				サイバーエージェント	17.1	25.1	45,832			
ローソン	5.1	7.4	70,004				証券、商品先物取引業 (1.4%)	15	22	9,658				楽天	3.4	5.1	25,602			
エービーシー・マート	1.9	2.5	17,625				SBIホールディングス	—	23.6	27,682				リロ・ホールディング	61.3	97.2	103,080			
ゲオホールディングス	2.5	3.7	7,322				ジャフコ	—	3.3	11,665				エイチ・アイ・エス	0.6	1	14,630			
日本マクドナルドHLDG	5.6	—	—				大和証券G本社	125	184	129,664				カナモト	2.3	3.4	11,101			
バル	0.8	—	—				野村ホールディングス	272.7	377.6	196,767				セコム	—	2.9	7,861			
セリア	1.6	2.1	15,057				岡三証券グループ	11	17	10,761				ペネッセホールディングス	13.7	21.6	184,032			
MonotaRO	2.6	6.9	22,011				東海東京HD	15.3	22.5	14,737				イオンディライト	5.2	7	24,395			
J. フロントリテイリング	16.9	24.8	34,918				松井証券	6.8	10	10,200				合計	1.4	2	7,400			
マツモトキヨシHLDGS	3	4	23,000				カブドットコム証券	—	17.4	6,577				株数、金額	14,406.7	21,068.6	29,815.181			
スタートトゥデイ	4.2	6	26,460				保険業 (3.0%)							銘柄数<比率>	399銘柄	400銘柄	<98.9%>			
三越伊勢丹HD	26.5	39	52,416				損保ジャパン興亜HD	—	43.6	138,255				(注1)						
ウエルシアHD	1.6	2.3	14,674				MS & AD	—	58.7	178,154				(注2)						
コスモス薬品	0.7	1	18,950				S O N Y F H	12.8	18.8	29,403				(注3)						
セブン&アイ・HLDGS	55.8	82.1	390,631				第一生命	85.5	125.7	172,460										
ツルハホールディングス	2.8	4.5	49,365				東京海上HD	54.9	79.5	309,811										
良品計画	1.6	2.3	51,612				T & Dホールディングス	48.6	71.5	76,076										
ドンキホーテホールディング	4.3	12.7	50,990				その他金融業 (1.6%)													
V Tホールディングス	5.5	8.8	5,799				クレディセゾン	10.9	14.9	30,530										
ユナイテッドアローズ	1.7	2.8	13,356				芙蓉総合リース	1.4	2.2	10,516										
スギホールディングス	2.4	3.5	20,930				興銀リース	1.5	3.7	7,607										
ファミリーマート	4.5	6	34,560				東京センチリーリース	3.1	4.6	18,768										
日本瓦斯	—	3	7,569				Jトラスト	4	—	—										
AOKIホールディングス	3.1	4.5	6,282				アイフル	22.3	—	—										
コメリ	2.3	—	—				リコーリース	1	—	—										
しまむら	1.5	2.3	29,923				イオンフィナンシャルサービス	8.8	12.9	34,971										
高島屋	19	29	26,622				アコム	26.8	39.4	21,630										
イオン	53.3	80.8	129,522				日立キャピタル	2.6	4.6	11,573										
ユニークグループ・HD	12.8	—	—				オリックス	94.4	139	225,805										
イズミ	3	3.9	18,915				三菱UFJリース	33.8	49.8	25,398										
ヤオコー	—	2.2	10,582				日本取引所グループ	19.6	57.6	103,680										
ケーズホールディングス	3.1	4.1	15,785				不動産業 (3.5%)													
アインホールディングス	1.6	2.4	13,752				ビューリック	22.5	40.9	42,781										
ヤマダ電機	52.7	—	—				野村不動産HLDGS	8	13	27,625										
ニトリホールディングス	5.8	8.5	80,240				プラススコポレーション	—	0.7	2,926										
王将フードサービス	1	—	—				東急不動産HD	35	47.5	36,195										
アークス	3.1	—	—				飯田GHHD	8.7	18.2	40,222										
パローホールディングス	2.9	4.2	12,066				パーク24	6.7	9.9	29,304										
ファーストリテイリング	2.7	3.9	139,074				三井不動産	71	104	290,212										
サンドラッグ	2.8	4.1	33,866				三菱地所	99	146	318,937										
銀行業 (6.3%)							東京建物	—	21.4	30,409										
新生銀行	127	170	25,670				住友不動産	32	47	153,784										

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

■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	%
株式	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】

- ・「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。