

★当ファンドの仕組みは次の通りでした。

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5年間（2014年3月19日～2019年3月22日）	
運用方針	J P X日経インデックス400の動きをとらえることにより信託財産の成長をめざして運用を行いません。	
主要投資対象	ベビーファンド	イ. 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。） ロ. わが国の株価指数先物取引 ハ. ダイワJ P X日経400マザーファンドの受益証券 ニ. J P X日経インデックス400に連動するE T F（上場投資信託証券） ホ. わが国の債券等
	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
ベビ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、J P X日経インデックス400の動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。 ②運用の効率化をはかるため、マザーファンドの受益証券、J P X日経インデックス400に連動するE T Fおよび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、マザーファンドの受益証券およびE T F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。 ③上記①および②にかかわらず、基準価額（1万円当り。既払分配金を加算しません。）が一度でも11,000円を超えた場合、わが国の債券等による安定運用に順次切り替えを行います。	
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いません。 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、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っていません。ファミリーファンド方式とは、受益者からの資金をまとめてベビーファンド（当ファンド）とし、その資金を主としてマザーファンドの受益証券に投資して、実質的な運用をマザーファンドで行なう仕組みです。

ダイワJ P X日経400ファンド キープ11

運用報告書（全体版） 繰上償還 （償還日 2018年4月18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J P X日経400ファンドキープ11」は、このたび、約款の規定により繰上償還となりました。

ここに、謹んで運用状況と償還の内容をお知らせいたします。

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			JPX日経インデックス400 (ベンチマーク)		株式組入比率	株式先物比率	公社債組入比率	純資産総額
	税込み 分配金	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率	期中 騰落率				
1 期末 (2015年 3月23日)	円 11,078	円 0	% 10.8	13,729	% 37.3	% -	% -	% 60.4	百万円 380
2 期末 (2016年 3月22日)	11,077	0	△ 0.0	11,735	△14.5	-	-	52.5	380
3 期末 (2017年 3月22日)	11,071	0	△ 0.1	12,981	10.6	-	-	27.1	110
4 期末 (2018年 3月22日)	11,064	0	△ 0.1	14,495	11.7	-	-	-	110
償 還 (2018年 4月18日)	11,063.20	-	△ 0.0	14,695	1.4	-	-	-	110

(注1) JPX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。

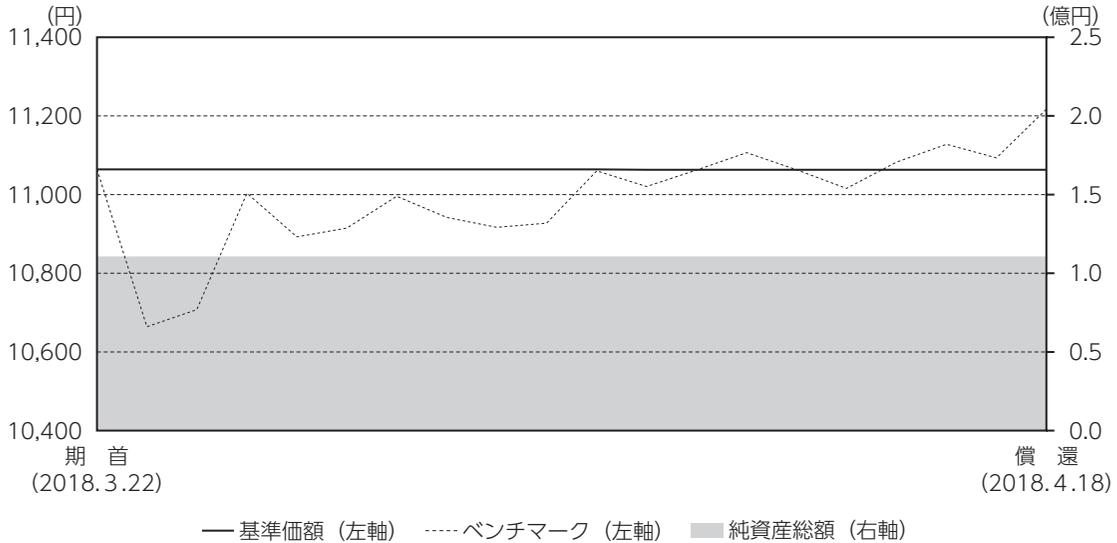
(注3) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

(注4) 公社債組入比率は新株予約権付社債券（転換社債券）および債券先物を除きます。



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

設定時：10,000円

償還時：11,063円20銭

騰落率：10.6%

■ 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、基準価額は上昇しました。また、基準価額が11,000円を超えた日（2014年7月1日）の翌営業日以降は、安定運用に切替えて運用を行ないました。

ダイワJPX日経400ファンド キープ11

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 率 比	公 社 債 組 入 比 率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首) 2018年3月22日	円 11,064	% -	14,495	% -	% -	% -	% -
3月末	11,064	0.0	14,405	△0.6	-	-	-
(償還) 2018年4月18日	11,063.20	△0.0	14,695	1.4	-	-	-

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2014.3.19~2018.4.18)

国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、ウクライナ情勢や消費税率引き上げが景気に与える悪影響への懸念から、上値の重い展開で始まりました。その後は、国内企業業績の改善や法人税率引き下げ方針の決定などが下支えし、2014年10月下旬には日銀による予想外の追加金融緩和の発表を受け、上昇基調となりました。2015年に入ってから、E C B（欧州中央銀行）による量的金融緩和の決定、国内景気の回復や企業業績の拡大などがプラス材料となり、上値を迫る展開が続きました。しかし8月以降は、中国を中心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などを嫌気し、下落基調となりました。2016年2月からは、日銀のマイナス金利導入の影響から銀行株が大幅に下落したことなどをきっかけに、上値の重い展開となりました。2016年後半以降は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて、同氏の政策に対する期待から市況は再び上昇基調に転じ、その後も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などを受けて底堅く推移しました。また、2017年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て、市況は一段高となりました。2018年に入ってから、高値警戒感や米国の長期金利上昇などを嫌気して一時的に調整局面を迎えたものの、市況は底堅く推移して償還を迎えました。

信託期間中の運用方針**当ファンド**

ファンドの運用方針に基づき、J P X日経インデックス400の動きに連動する投資成果をめざして運用を行ないます。

基準価額が一度でも11,000円を超えた場合、わが国の債券等による安定運用に順次切替えを行ないます。

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います。

信託期間中のポートフォリオについて

(2014.3.19~2018.4.18)

当ファンド

設定時より2014年4月中旬までは、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。4月下旬以降は、J P X日経インデックス400採用銘柄に直接投資を行ない、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。また、基準価額が11,000円を超えた日（2014年7月1日）の翌営業日以降は、当ファンドの運用方針に基づき、わが国の債券等による安定運用に切替え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

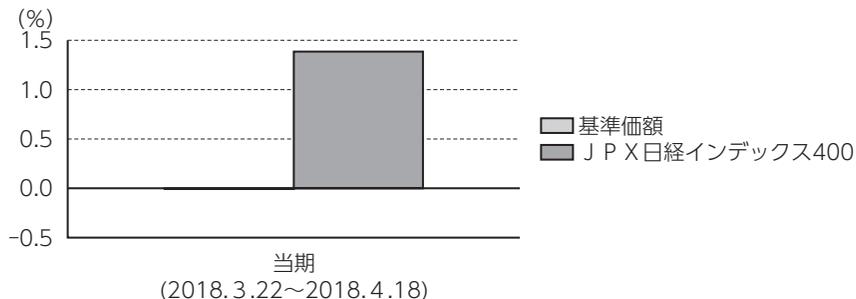
J P X日経インデックス400に連動する投資成果をめざして運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（J P X 日経インデックス400）の騰落率は1.4%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△0.0%となりました。

- ・安定運用を継続して行なったため、株式市況の上昇がかい離の要因となりました。
- ・短期金融資産の利回りがマイナスとなったことなどがマイナス要因となりました。

以下のグラフは、当期における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

信託期間中の収益分配につきましては、安定運用に移行したため、分配は行ないませんでした。

受益者のみなさまにおかれましては、当ファンドをご愛顧いただき厚く御礼申し上げます。今後とも証券投資信託の運用につきましては、受益者のみなさまのご期待に沿えますよう万全を期して努力する所存でございますので、一層のご愛顧を賜りますようよろしくお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.3.23~2018.4.18)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	一円	—%	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11,064円です。
(投 信 会 社)	(一)	(一)	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)	(一)	(一)	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)	(一)	(一)	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	—	—	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
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	0	0.001	その他費用＝期中のその他費用／期中の平均受益権口数
(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	0	0.001	

(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。

(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

当期中における売買および取引はありません。

■主要な売買銘柄

当期中における売買銘柄はありません。

■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。

■組入資産明細表

最終期末における有価証券等の組み入れはありません。

■投資信託財産の構成

2018年4月18日現在

項 目	償 還 時	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	110,710	100.0
投資信託財産総額	110,710	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4月18日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	110,710,596円
コール・ローン等	110,710,596
(B) 負債	1,135
未払利息	167
その他未払費用	968
(C) 純資産総額(A - B)	110,709,461
元本	100,070,004
償還差損益金	10,639,457
(D) 受益権総口数	100,070,004口
1万口当り償還価額(C / D)	11,063円20銭

* 期首における元本額は100,070,004円、当期中における追加設定元本額は0円、同解約元本額は0円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は11,063円20銭です。

■損益の状況

当期 自2018年3月23日 至2018年4月18日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 5,322円
支払利息	△ 5,322
(B) 信託報酬等	△ 1,335
(C) 当期損益金(A + B)	△ 6,657
(D) 前期繰越損益金	9,264,928
(E) 追加信託差損益金	1,381,186
(配当等相当額)	(663)
(売買損益相当額)	(1,380,523)
(F) 合計(C + D + E)	10,639,457
償還差損益金(F)	10,639,457

(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。

投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2014年3月19日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年4月18日		資産総額	110,710,596円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減 又は追加信託	負債総額	1,135円
				純資産総額	110,709,461円
受益権口数	50,000,000口	100,070,004口	50,070,004口	受益権口数	100,070,004口
元本額	50,000,000円	100,070,004円	50,070,004円	1単位当り償還金	11,063円20銭

毎計算期末の状況

計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1単位当り分配金	
				金額	分配率
	円	円	円	円	%
第1期	343,873,308	380,958,069	11,078	0	0.00
第2期	343,873,308	380,901,896	11,077	0	0.00
第3期	100,070,004	110,783,852	11,071	0	0.00
第4期	100,070,004	110,716,118	11,064	0	0.00

(注) 1単位は受益権1万口。

償 還 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 償 還 金	11,063円20銭

償還金の課税上の取扱いについて

- ・償還時の差益（償還価額から取得費用（申込手数料（税込み）を含む）を控除した利益）については、譲渡所得とみなされ、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率により、申告分離課税が適用されます。
- ・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。

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

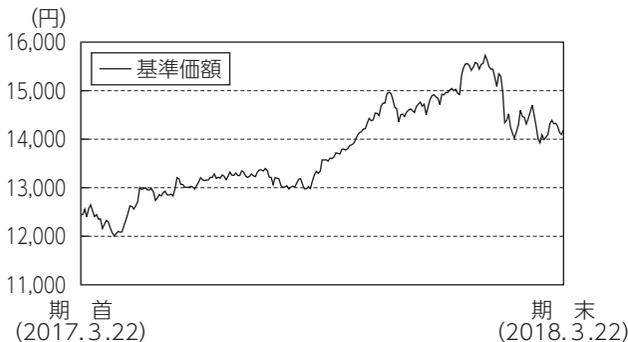
大和投資信託

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 (ベンチマーク)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 比 率
	円	%	円	%		
(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競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 (株式)	0円 (0)
(先物)	(0)
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	0 (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
	千株	千円	千株	千円
国内	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			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	
水産・農林業 (0.0%)																				
日本水産	23.3	13.3	7,155				住友化学	123	82	50,348										
鉱業 (0.4%)							日産化学	9.2	6.5	28,112										
国際石油開発帝石	94.5	57.7	76,769				東ソー	48	16	33,824										
建設業 (3.2%)							デンカ	35	4.1	15,518										
安藤・間	12.9	9.2	7,341				信越化学	30.1	18.5	207,107										
東急建設	6.4	4.6	5,377				エア・ウォーター	13.8	9.1	18,436										
コムシスホールディングス	7	4.2	11,831				大陽日酸	12.9	8.5	13,515										
大成建設	91	11.8	62,894				日本パーカライジング	8.6	5.7	10,299										
大林組	53.8	35.6	41,794				三菱瓦斯化学	15.6	9.1	23,041										
清水建設	55	36.3	34,267				三井化学	-	10.1	33,633										
長谷工コーポレーション	20.9	13.8	22,452				J S R	16.9	11.1	26,695										
鹿島建設	79	52	51,844				三菱ケミカルHLDGS	112.4	74.3	76,008										
三井住友建設	68.8	8.6	5,461				ダイセル	22.6	15	18,315										
前田建設	-	8.5	10,293				積水化学	38.1	23	42,458										
戸田建設	-	14	10,990				日本ゼオン	14	9.3	14,442										
熊谷組	28	1.9	6,308				アイカ工業	5.4	3.1	11,888										
大東建託	6.6	4.3	76,991				宇部興産	85	5.6	17,332										
N I P P O	4	2.7	6,453				日立化成	9.3	5.5	13,216										
前田道路	6	4	8,980				ダイキョーニシカワ	-	2.2	3,759										
五洋建設	-	14.1	10,546				日本化薬	11	7.2	9,576										
住友林業	12.4	7.6	12,973				日油	13	4.3	13,029										
大和ハウス	53	35	141,540				花王	42.6	26	194,116										
積水ハウス	56.5	38.6	71,834				日本ペイントHOLD	12.9	8.6	33,626										
協和エグシオ	7	4.3	11,545				関西ペイント	17.6	11.6	29,266										
九電工	3.5	2.3	11,155				D I C	6.6	4.4	15,862										
日揮	16.7	-	-				富士フイルムHLDGS	33.3	-	-										
食料品 (4.3%)							資生堂	31.8	19.7	125,390										
江崎グリコ	4.5	3	16,320				ライオン	-	14.7	29,841										
カルビー	7.3	4.8	17,232				コーセー	2.7	1.8	36,396										
ヤクルト	9.6	6.4	50,944				シーズ・ホールディングス	2.2	1.4	7,112										
明治ホールディングス	10.6	7	54,950				小林製菓	4.7	3	21,420										
日本ハム	12	9	19,629				日東電工	12.1	8	64,800										
アサヒグループホールディングス	33.7	22.3	124,790				ニフコ	2.9	1.9	14,212										
キリンHD	77.3	51.1	147,781				ユニ・チャーム	34	22.4	66,841										
サントリー食品インター	-	8.1	40,662				医薬品 (5.7%)													
伊藤園	5.3	-	-				協和発酵キリン	20.1	13.3	30,018										
キッコーマン	13	8.3	35,233				武田薬品	62.9	39	218,751										
味の素	37	24.4	46,079				アステラス製薬	171.4	108.8	176,473										
キューピー	9.1	5.9	17,009				大日本住友製薬	-	7.8	13,455										
ニチレイ	8.8	5.1	13,928				塩野義製薬	21.3	15.1	82,355										
東洋水産	8.8	5.8	24,041				田辺三菱製薬	19.5	12.9	28,509										
日清食品HD	7	4.6	33,028				中外製薬	16.7	11	62,040										
日本たばこ産業	75.6	65.7	186,325				科研製薬	3.1	1.9	11,609										
繊維製品 (0.5%)							エーザイ	20.6	12.7	86,817										
帯人	-	9.1	18,500				小野薬品	38.1	25	83,175										
東レ	122	80.4	81,485				久光製薬	4.7	3.1	25,451										
パルプ・紙 (0.2%)							参天製薬	30.3	20	34,580										
王子ホールディングス	66	47	32,101				ツムラ	5.6	3.8	14,307										
大王製紙	6.7	4.4	6,529				沢井製薬	2.8	2.1	10,059										
化学 (7.5%)							第一三共	49.4	30.3	113,109										
クラレ	28.2	18.7	33,136				キョーリン製薬HD	4.1	-	-										
旭化成	105	69.1	96,636				大塚ホールディングス	36.1	22	116,666										
							大正製薬HD	3.6	-	-										
ゴム製品 (1.1%)																				
横浜ゴム	10.1	6.1	14,932																	
東洋ゴム	8.9	6.3	11,377																	
ブリヂストン	56.6	35	160,335																	
住友ゴム	15.7	10.4	20,103																	
ガラス・土石製品 (0.9%)																				
旭硝子	83	10.8	46,602																	
住友大阪セメント	31	21	9,681																	
太平洋セメント	101	6.7	25,594																	
T O T O	12.3	8.1	45,198																	
日本硝子	21.2	12.9	24,110																	
日本特殊陶業	14.5	9.1	23,487																	
鉄鋼 (1.0%)																				
新日鐵住金	75.6	46.8	110,424																	
神戸製鋼所	29	-	-																	
J F E ホールディングス	45.8	28.3	61,977																	
東京製鐵	-	5.6	4,704																	
日立金属	17.1	11.3	14,577																	
非鉄金属 (0.9%)																				
日本軽金属HD	-	30.6	8,659																	
三菱マテリアル	10.5	6.9	22,839																	
住友鉱山	43	13.4	60,782																	
DOWAホールディングス	18	2.6	10,413																	
住友電工	63.2	39.1	64,417																	
金属製品 (0.2%)																				
三和ホールディングス	16.6	10	13,760																	
三協立山	2.2	-	-																	
リンナイ	2.9	1.9	18,772																	
日本発条	15.8	10.4	11,512																	
機械 (5.8%)																				
アマダホールディングス	-	16.2	21,448																	
オーエスジー	7.6	4.8	11,673																	
DMG森精機	9.9	5.8	11,513		</															

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
	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SOLO	-	1.6	4,840
安川電機	18.6	12.3	60,700	SUBARU	49.7	32.9	119,065	グリーン	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	ガッホ・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	HOYA	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	USEN	7.4	-	-
ソニー	-	61.8	323,770	セイコーHD	11	1.6	4,150	日本テレビHLD S	14.4	9.5	17,945
TDK	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	パナダイナムHLDGS	17.7	10.9	38,368	KDDI	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	NTT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	ピジヨン	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%)				NTT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
OBARA GROUP	-	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
SCREEN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HLDGS	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HLDGS	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	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	
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	9.8	6.5	8,580	サービス業 (2.8%)								
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	ミクシィ	4.5	2.6	10,361	日本M&Aセンター	4.8	3.5	26,005	パーソルホールディングス	12.9	9.3	28,039	
ミスミグループ本社	17.8	12.1	35,816	広島銀行	47	15.4	12,366	クックパッド	3.7	-	-	クックパッド	3.7	-	-	総合警備保障	6.1	4	20,520	
小売業 (4.6%)				中国銀行	14.9	9.6	12,105	カカココム	11.9	7.6	14,166	ディップ	2.2	1.4	4,480	エムスリー	14.5	10.6	49,608	
ローソン	5	2.6	18,408	セブン銀行	59.3	39.2	13,406	ディー・エヌ・エー	7.5	5.5	10,609	エムスリー	14.5	10.6	49,608	ディー・エヌ・エー	7.5	5.5	10,609	
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	博報堂DYHLDGS	23.2	14.1	21,023	ディー・エヌ・エー	7.5	5.5	10,609	博報堂DYHLDGS	23.2	14.1	21,023	
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	ぐるなび	2.4	-	-	電通	18.6	-	-	オリエンタルランド	18.1	12	127,500	
アダストリア	-	1.6	3,785	北洋銀行	25.8	-	-	電通	18.6	-	-	オリエンタルランド	18.1	12	127,500	リゾートトラスト	6.5	4.3	9,924	
セリア	1.9	2.5	12,425	証券・商品先物取引業 (1.2%)				ユー・エス・エス	20.3	12.4	27,007	リゾートトラスト	6.5	4.3	9,924	ユー・エス・エス	20.3	12.4	27,007	
ビックカメラ	-	6.1	10,223	F P G	5.6	3.6	4,899	サイバーエージェント	8.8	6.6	35,178	ユー・エス・エス	20.3	12.4	27,007	サイバーエージェント	8.8	6.6	35,178	
MonotaRO	5.6	3.7	13,597	SBIホールディングス	17.9	11.8	30,609	楽天	85.5	51.9	47,332	楽天	85.5	51.9	47,332	サイバーエージェント	8.8	6.6	35,178	
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	リログループ	0.8	5.5	16,527	リログループ	0.8	5.5	16,527	楽天	85.5	51.9	47,332	
マツモトキヨシHLDGS	3	4.3	18,812	大和証券G本社	148	89	62,317	エイチ・アイ・エス	2.7	-	-	エイチ・アイ・エス	2.7	-	-	リログループ	0.8	5.5	16,527	
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	カナモト	2.3	1.5	5,452	カナモト	2.3	1.5	5,452	エイチ・アイ・エス	2.7	-	-	
ウエルシアHD	4.2	2.8	12,712	岡三証券グループ	14	-	-	セコム	17.4	10.7	84,080	セコム	17.4	10.7	84,080	カナモト	2.3	1.5	5,452	
クリエイトSDH	2.3	1.5	4,033	東海東京HD	18.1	11.6	9,036	メイテック	-	1.2	7,308	メイテック	-	1.2	7,308	セコム	17.4	10.7	84,080	
コスモス薬品	0.8	0.5	10,765	松井証券	9	5.1	5,115	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	メイテック	-	1.2	7,308	
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	合計	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710
ツルハホールディングス	3.2	2.3	34,224	保険業 (2.9%)				株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
クワリのアオキHLDGS	1.3	0.8	5,824	SOMPOホールディングス	33	20.5	85,546	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
ノジマ	2.5	1.8	4,568	MS & AD	47.2	27.3	91,919	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
良品計画	2.1	1.4	52,570	SONY FH	15.1	8.6	16,830	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
スギホールディングス	3.5	2.3	13,455	その他金融業 (1.5%)				株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
日本瓦斯	2.9	1.9	8,616	芙蓉総合リース	1.8	1.2	8,652	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
しまむら	1.8	1.2	16,104	興銀リース	3	2	6,340	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
高島屋	27	16	16,144	東京センチュリー	3.2	2.1	13,776	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
イズミ	3.1	1.9	13,110	オリコ	34.2	22.6	3,842	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
ヤオコー	1.8	1.2	7,128	日立キャピタル	3.7	2.9	7,844	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
ケースホールディングス	7.3	4.4	13,266	オリックス	111.9	69.6	133,214	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
パロールホールディングス	3.4	2.4	6,787	不動産業 (2.8%)				株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
サンドラッグ	3	4.4	21,692	ヒューリック	33	21.8	25,418	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
銀行業 (6.2%)				野村不動産HLDGS	10.5	6.9	17,788	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
めがきフィナンシャルG	-	54.2	22,601	プラスانسコーポレーション	2.5	1.4	2,237	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
新生銀行	150	9	14,760	パーク24	8	5.8	16,733	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
あおぞら銀行	100	6.2	26,722	三井不動産	84	52.1	131,370	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
三井住友トラストHD	33	20.5	90,364	住友不動産	38	25	96,825	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
三井住友フィナンシャルG	113.1	60.4	273,732	大京	29	-	-	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
千葉銀行	61	37	32,005	レオパレス21	20	12.5	10,325	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
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	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
ひくおかフィナンシャルG	64	-	-	住友不動産販売	1.4	-	-	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
静岡銀行	43	28	28,840	タカラレーベン	6.9	-	-	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>	イオンディライト	1.9	1.2	4,710	
スルガ銀行	16.2	10.7	16,060	イオンモール	10.2	6.7	15,289	株数、金額	16,326.6	8,786.5	19,375,952	銘柄数<比率>	400銘柄	399銘柄	<97.2%>					

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

■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】

- ・「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。