

★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4年8カ月間（2015年1月16日～2019年9月19日）	
運用方針	わが国の株式市場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ないます。	
主投資対象	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。） ロ. わが国の株価指数先物取引 ハ. ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券 ニ. ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券 ホ. わが国の債券等
ベビーファンドの運用方法	①主として、わが国の株式に投資し、日経平均株価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。 ②原則として、日経平均株価採用の全銘柄に等株数投資を行ないます。ただし、投資対象とする企業の財務状況を考慮したうえで、日経平均株価採用銘柄であっても投資を行なわない場合があります。また、日経平均株価採用銘柄の入れ替え等に際しては、流動性等を勘案して対応する場合があります。これらの場合、組入銘柄に等株数投資を行なわないことがあります。 ③運用の効率化をはかるため、ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券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、株式およびストックインデックス225・マザーファンドの受益証券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。 ④上記①～③にかかわらず、基準価額（1万口当たり。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、ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの受益証券および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。	
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
	ベビーファンドの株式組入上限比率	無制限
	ストックインデックス225・マザーファンドの株式組入上限比率	無制限
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの株式組入上限比率	純資産総額の10%以下
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。

ダイワ日本株式 インデックス・ファンド －シフト11 Ver3－

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2016年9月20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、「ダイワ日本株式インデックス・ファンド－シフト11 Ver3－」は、このたび、第2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			日 経 平 均 株 価 (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
	円	税込み 分配金 円	期 中 騰落率 %	円	期 中 騰落率 %				
1 期末 (2015年 9月24日)	11,065	0	10.7	17,571.83	2.7	—	—	34.4	3,739
2 期末 (2016年 9月20日)	11,061	0	△ 0.0	16,492.15	△ 6.1	—	—	—	1,652

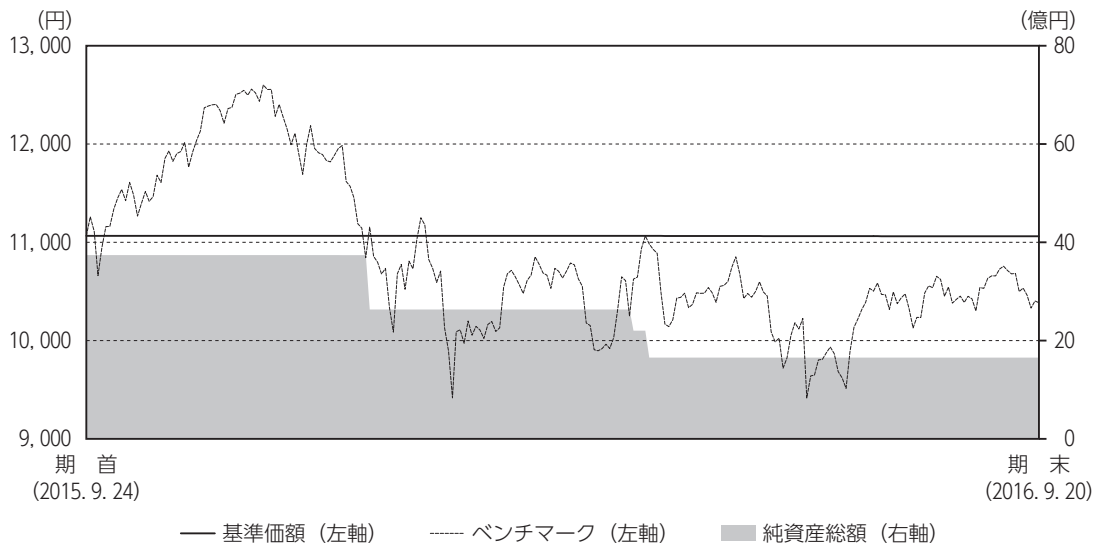
(注 1) 組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注 2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(注 3) 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。

*ベンチマークは日経平均株価です。

■基準価額・騰落率

期首：11,065円

期末：11,061円

騰落率：△0.0%

■基準価額の主な変動要因

安定運用に移行しているため、基準価額はほぼ横ばいで推移しました。

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率	公 社 債 組入比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)2015年9月24日	円	%	円	%	%	%	%
	11,065	—	17,571.83	—	—	—	34.4
9月末	11,065	0.0	17,388.15	△ 1.0	—	—	33.0
10月末	11,065	0.0	19,083.10	8.6	—	—	48.8
11月末	11,065	0.0	19,747.47	12.4	—	—	36.5
12月末	11,065	0.0	19,033.71	8.3	—	—	33.4
2016年1月末	11,065	0.0	17,518.30	△ 0.3	—	—	37.0
2月末	11,065	0.0	16,026.76	△ 8.8	—	—	29.1
3月末	11,065	0.0	16,758.67	△ 4.6	—	—	19.3
4月末	11,065	0.0	16,666.05	△ 5.2	—	—	16.8
5月末	11,064	△ 0.0	17,234.98	△ 1.9	—	—	7.2
6月末	11,063	△ 0.0	15,575.92	△ 11.4	—	—	7.2
7月末	11,062	△ 0.0	16,569.27	△ 5.7	—	—	13.2
8月末	11,062	△ 0.0	16,887.40	△ 3.9	—	—	31.8
(期末)2016年9月20日	11,061	△ 0.0	16,492.15	△ 6.1	—	—	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

○国内短期債券市況

日銀が「マイナス金利付き量的・質的金融緩和」を導入したことを背景に、無担保コール翌日物金利は△0.06%程度まで低下、国庫短期証券（3カ月物）の利回りは△0.37%程度まで低下しました。

前期における「今後の運用方針」

○当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券を組み入れ、安定運用を継続して行なってまいります。

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないます。

ポートフォリオについて

○当ファンド

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券の組入比率を50～70%程度に維持して運用を行ないました。

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

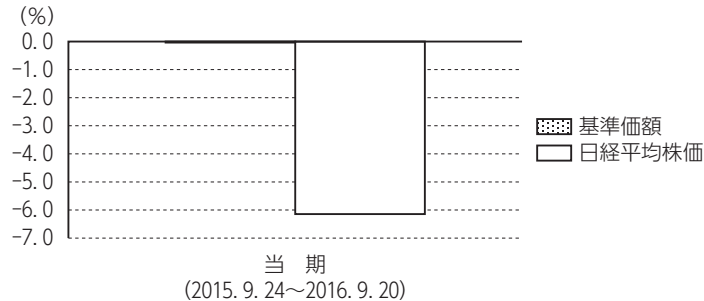
資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は△6.1%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。

- ・信託報酬等のコストが控除されたことがマイナス要因となりました。
- ・安定運用に移行しているため、株式市況の下落がかい離の要因となりました。

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、収益の分配は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9月25日 ～2016年9月20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)	1,061

(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

当ファンドの運用方針に基づき、「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券を組み入れ、安定運用を継続して行なってまいります。

○ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、安定的な運用を行ないます。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	(2015. 9. 25~2016. 9. 20)		
	金 額	比 率	
信託報酬	2円	0.022%	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)	(1)	(0.005)	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)	(2)	(0.015)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、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)	(0)	(0.002)	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
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
(監査費用)	(0)	(0.000)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	3	0.023	

(注1) 期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、項目の概要の簡便法により算出した結果です。なお、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れているマザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。

(注2) 金額欄は各項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 比率欄は1万口当りのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■売買および取引の状況
親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	—	—	1,267,465	1,270,000

(注) 単位未満は切捨て。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

期首保有額	期中設定額	期中解約額	期末保有額	取引の理由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	0	0	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満切捨て。

■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) ダイワ・マネーアセット・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9月25日から2016年9月20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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
公社債	43,269	4,750	11.0	—	—	—
コール・ローン	1,234,109	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合15.3%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 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、大和証券でず。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	2,395,687	1,128,222	1,130,140

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	1,130,140	68.4
コール・ローン等、その他	522,739	31.6
投資信託財産総額	1,652,880	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9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,652,880,037円
コール・ローン等	522,739,369
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	1,130,140,668
(B) 負債	4,732
その他未払費用	4,732
(C) 純資産総額（A－B）	1,652,875,305
元本	1,494,267,954
次期繰越損益金	158,607,351
(D) 受益権総口数	1,494,267,954口
1万口当り基準価額（C／D）	11,061円

* 期首における元本額は3,379,747,191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1,885,479,237円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は11,061円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月25日 至2016年9月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	162,609円
受取利息	296,617
支払利息	△ 134,008
(B) 有価証券売買損益	△ 95,394
売買益	128,742
売買損	△ 224,136
(C) 信託報酬等	△ 600,049
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 532,834
(E) 前期繰越損益金	150,548,341
(F) 追加信託差損益金	8,591,844
（配当等相当額）	（ 14,377）
（売買損益相当額）	（ 8,577,467）
(G) 合計（D＋E＋F）	158,607,351
次期繰越損益金（G）	158,607,351
追加信託差損益金	8,591,844
（配当等相当額）	（ 14,377）
（売買損益相当額）	（ 8,577,467）
分配準備積立金	150,548,341
繰越損益金	△ 532,834

（注1）信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しております。

（注2）追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

（注3）収益分配金の計算過程は「収益分配金の計算過程（総額）」の表をご参照ください。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	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	8,059,010
(d) 分配準備積立金	150,548,341
(e) 当期分配対象額（a＋b＋c＋d）	158,607,351
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	158,607,351
(h) 受益権総口数	1,494,267,954口

【注記】

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver3ー」について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

<補足情報>

当ファンド（ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver3ー）が投資対象としている「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の決算日（2015年12月9日）と、当ファンドの決算日が異なっておりますので、当ファンドの決算日（2016年9月20日）現在におけるダイワ・マネーアセット・マザーファンドの組入資産の内容等を10ページに併せて掲載いたしました。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの主要な売買銘柄

公 社 債

(2015年9月25日から2016年9月20日まで)

買 付			売 付		
銘 柄		金 額	銘 柄		金 額
		千円			千円
591 国庫短期証券	2016/5/30	4,500,177			
613 国庫短期証券	2016/9/12	3,790,054			
601 国庫短期証券	2016/7/19	3,150,065			
611 国庫短期証券	2016/9/5	3,010,051			
586 国庫短期証券	2016/5/12	2,000,342			
607 国庫短期証券	2016/8/15	1,980,036			
609 国庫短期証券	2016/8/22	1,940,045			
610 国庫短期証券	2016/8/29	1,920,037			
596 国庫短期証券	2016/6/20	1,780,031			
557 国庫短期証券	2015/12/14	1,500,000			

(注1) 金額は受渡し代金（経過利子分は含まれておりません）。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

2016年9月20日現在における該当事項はありません。

ストックインデックス 225・マザーファンド

運用報告書 第15期（決算日 2016年9月20日）

（計算期間 2015年9月25日～2016年9月20日）

ストックインデックス 225・マザーファンドの第15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	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルと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のうち日経平均株価に採用された銘柄
運用方法	投資成果を日経平均株価の動きにできるだけ連動させるため、次のポートフォリオ管理を行ないます。 イ. 上記投資対象銘柄のうちの200銘柄以上に、原則として、等株数投資を行ないます。 ロ. 株式の組入比率は、高位を保ちます。
株式組入制限	無制限

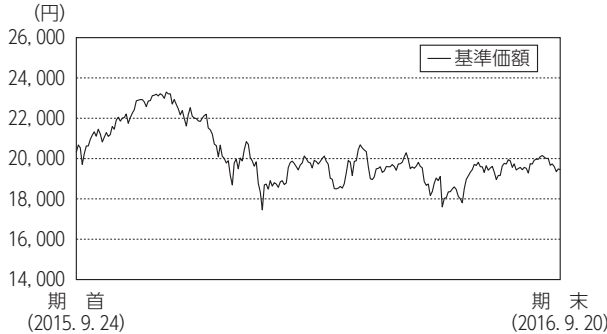
大和投資信託

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



《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：20,324円 期末：19,454円 騰落率：△4.3%

【基準価額の主な変動要因】

日経平均株価への連動をめざした運用を行なった結果、世界経済の先行き懸念や円高進行から日経平均株価が下落したことを受けて、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、世界経済の先行き不透明感や円高の進行などで軟調に始まりましたが、2015年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ECB（欧州中央銀行）が追加金融緩和を示唆したこと、中国が追加金融緩和を実施したことなどで上昇しました。12月以降は、ECBの追加金融緩和策への失望や原油価格の下落、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月末には日銀がマイナス金利を導入し一時的に株価は上昇しましたが、その後は、米国経済および中国経済への懸念や欧州金融機関の信用不安などで下落しました。2月後半からは、米国の製造業関連指標の回復や中国およびECBの金融緩和などにより株価は反発しましたが、3月後半以降は、日米金融政策や米国為替政策への思惑から為替相場が不安定になり、株価も乱高下しました。6月には、英国の国民投票でEU（欧州連合）離脱支持が多数だったことを受けて株価は下落しましたが、7月下旬には、国内の財政・金融政策への期待や円高傾向の一服などから戻り基調となりました。8月以降は売り買いが交錯し、上値の重い展開で期末を迎えました。

◆前期における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価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

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、日経平均株価採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行ない、日経平均株価の動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当期につきましては、日経平均株価採用銘柄すべてを組み入れて運用を行いました。

また、日経平均株価採用銘柄の入れ替え時には、その都度、組入銘柄の入れ替えを行ない、運動性の維持に努めました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は△6.1%となりました。一方、当ファンドの騰落率は△4.3%となりました。

- ・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。
- ・資金の流出に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担が、マイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、日経平均株価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。

年月日	基準価額		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式組入率	株式先比率
	円	%	円	%		
(期首)2015年9月24日	20,324	—	17,571.83	—	98.4	1.6
9月末	20,240	△ 0.4	17,388.15	△ 1.0	97.7	2.3
10月末	22,211	9.3	19,083.10	8.6	98.1	1.9
11月末	22,989	13.1	19,747.47	12.4	98.3	1.7
12月末	22,196	9.2	19,033.71	8.3	98.0	2.0
2016年1月末	20,441	0.6	17,518.30	△ 0.3	98.2	1.8
2月末	18,716	△ 7.9	16,026.76	△ 8.8	98.2	1.8
3月末	19,720	△ 3.0	16,758.67	△ 4.6	97.6	2.4
4月末	19,613	△ 3.5	16,666.05	△ 5.2	98.2	1.8
5月末	20,290	△ 0.2	17,234.98	△ 1.9	98.0	2.0
6月末	18,360	△ 9.7	15,575.92	△ 11.4	98.6	1.4
7月末	19,534	△ 3.9	16,569.27	△ 5.7	98.4	1.6
8月末	19,922	△ 2.0	16,887.40	△ 3.9	98.8	1.2
(期末)2016年9月20日	19,454	△ 4.3	16,492.15	△ 6.1	98.6	1.4

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

ストックインデックス225・マザーファンド

■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)	2円 (0) (2)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	2

(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を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9月25日から2016年9月20日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 23,133.6 (△1,508.092)	千円 49,619,436 (—)	千株 10,776.008	千円 22,053,765

(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9月25日から2016年9月20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 43,459	百万円 43,434	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9月25日から2016年9月20日まで)

買 柄	当 期			売 柄	当 期		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
ファーストリテイリング	千株 106	千円 3,979,738	円 37,544	ファーストリテイリング	千株 48	千円 1,840,444	円 38,342
ユニ・ファミリーマートHD	309.5	2,428,896	7,847	ソフトバンクグループ	144	922,080	6,403
ファナック	106	1,922,373	18,135	ファナック	48	909,361	18,945
KDDI	636	1,870,986	2,941	KDDI	288	892,842	3,100
ソフトバンクグループ	318	1,760,824	5,537	京セラ	96	516,324	5,378
京セラ	212	1,091,417	5,148	ダイキン工業	48	430,141	8,961
アステラス製薬	530	851,538	1,606	アステラス製薬	240	396,842	1,653
ダイキン工業	106	835,362	7,880	東京エレクトロン	48	396,667	8,263
セコム	106	833,015	7,858	テルモ	96	395,509	4,119
テルモ	212	800,932	3,777	セコム	48	389,593	8,116

(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	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株	株数
水産・農林業 (0.2%)															
日本水産	294	352	155,936		信越化学	294	352	2,474,560		古河機金	294	352	55,264		
マルハニチロ	29.4	35.2	87,225		三井化学	294	352	164,032		古河電工	294	352	90,816		
鉱業 (0.1%)					三菱ケミカル HLDGS	147	176	106,761		住友電工	294	352	506,704		
国際石油開発帝石	117.6	140.8	116,399		宇部興産	294	352	67,232		フジクラ	294	352	196,416		
建設業 (2.8%)					日本化薬	294	352	373,824		金属製品 (0.4%)					
コムシホールディングス	294	352	647,328		花王	294	352	1,992,320		SUMCO	29.4	35.2	28,969		
大成建設	294	352	267,520		富士フィルム HLDGS	294	352	1,341,824		東洋製罐グループHD	294	352	647,680		
大林組	294	352	347,072		資生堂	294	352	949,520		機械 (5.2%)					
清水建設	294	352	313,280		日東電工	294	352	2,330,944		日本製鋼所	294	352	164,032		
長谷工コーポレーション	—	70.4	65,964		医薬品 (7.7%)					オークマ	294	352	266,112		
鹿島建設	294	352	245,696		協和発酵キリン	294	352	555,104		アマダホールディングス	294	352	375,936		
大和ハウス	294	352	936,144		武田薬品	294	352	1,634,688		小松製作所	294	352	805,552		
積水ハウス	294	352	588,720		アステラス製薬	1,470	1,760	2,762,320		住友重機械	294	352	177,408		
日揮	294	352	594,528		大日本住友製薬	294	352	630,432		日立建機	294	352	696,608		
千代田化工建	294	352	280,896		塩野義製薬	294	352	1,763,520		クボタ	294	352	516,032		
食料品 (5.4%)					中外製薬	294	352	1,226,720		荏原製作所	294	352	195,008		
日清製粉G本社	294	352	532,224		エーザイ	294	352	2,244,704		ダイキン工業	294	352	3,297,536		
明治ホールディングス	29.4	70.4	673,024		第一三共	294	352	850,608		日本精工	294	352	368,896		
日本ハム	294	352	853,600		石油・石炭製品 (0.3%)					NTN	294	352	125,664		
サッポロホールディングス	294	70.4	193,036		昭和シエル石油	294	352	312,224		ジェイテクト	294	352	521,312		
アサヒグループホールディング	294	352	1,252,064		JXホールディングス	294	352	138,300		日立造船	58.8	70.4	36,185		
キリンHD	294	352	573,584		ゴム製品 (1.0%)					三菱重工業	294	352	152,908		
宝ホールディングス	294	352	328,064		横浜ゴム	147	176	287,408		IHI	294	352	99,616		
キッコーマン	294	352	1,126,400		ブリヂストン	294	352	1,277,056		電気機器 (16.9%)					
味の素	294	352	782,848		ガラス・土製品 (1.5%)					日清紡ホールディングス	—	352	359,744		
ニチレイ	294	352	373,472		日東紡績	294	—	—		コニカミノルタ	294	352	304,832		
日本たばこ産業	294	352	1,396,032		旭硝子	294	352	227,392		ミネベア	294	352	333,344		
繊維製品 (0.4%)					日本板硝子	294	352	28,864		日立	294	352	166,636		
東洋紡	294	352	57,728		日本電気硝子	441	528	273,504		東芝	294	352	111,232		
ユニチカ	294	352	19,712		住友大阪セメント	294	352	162,624		三菱電機	294	352	441,232		
日清紡ホールディングス	294	—	—		太平洋セメント	294	352	102,784		富士電機	294	352	160,512		
帝人	294	352	138,688		東海カーボン	294	352	97,856		安川電機	294	352	525,536		
東レ	294	352	338,870		TOYO	294	176	667,920		明電舎	294	352	115,808		
パルプ・紙 (0.3%)					日本碍子	294	352	743,776		ジーエス・ユアサコーポ	294	352	145,728		
王子ホールディングス	294	352	142,208		鉄鋼 (0.2%)					日本電気	294	352	90,464		
日本製紙	29.4	35.2	65,296		新日鐵住金	294	35.2	69,168		富士通	294	352	188,742		
北越紀州製紙	294	352	219,296		神戸製鋼所	294	352	31,680		沖電気	294	352	48,576		
化学 (8.3%)					JFEホールディングス	29.4	35.2	50,793		パナソニック	294	352	358,336		
クラレ	294	352	500,896		日新製鋼	29.4	35.2	46,076		シャープ	294	—	—		
旭化成	294	352	281,388		大平洋金属	294	352	100,320		ソニー	294	352	1,168,640		
昭和電工	294	35.2	44,105		非鉄金属 (1.3%)					TDK	294	352	2,537,920		
住友化学	294	352	161,216		日本軽金属HD	294	352	76,032		ミツミ電機	294	352	203,104		
日産化学	294	352	1,089,440		三井金属	294	352	72,864		アルプス電気	294	352	867,680		
日本曹達	294	352	148,544		東邦亜鉛	294	352	110,176		パイオニア	294	352	78,144		
東ソー	294	352	216,480		三菱マテリアル	294	352	99,968		横河電機	294	352	465,696		
トクヤマ	294	352	121,792		住友鉱山	294	352	457,600		アドバンテスト	588	704	946,880		
デンカ	294	352	158,752		DOWAホールディングス	294	352	241,824		カシオ	294	352	495,264		

ストックインデックス225・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	千株	千円		株数	株数	千株	千円		株数	株数	千株	千円
ファンック	294	352	5,954	080	川崎汽船	294	352	90	112	松井証券	294	352	322	080
京セラ	588	704	3,510	144	空運業 (0.1%)					保険業 (1.0%)				
太陽誘電	294	352	362	560	ANAホールディングス	294	352	99	968	損保ジャパン興亜HD	73.5	88	278	080
SCREENホールディングス	294	352	441	408	倉庫・運輸関連業 (0.4%)					M S & A D	88.2	105.6	307	243
キャノン	441	528	1,532	256	三菱倉庫	294	352	536	096	S O N Y F H	58.8	70.4	104	403
リコー	294	352	325	248	情報・通信業 (12.2%)					第一生命	29.4	35.2	50	635
東京エレクトロン	294	352	3,229	248	ヤフー	117.6	140.8	57	587	東京海上HD	147	176	685	872
輸送用機器 (6.7%)					トレンドマイクロ	294	352	1,244	320	T&Dホールディングス	58.8	70.4	86	028
デンソー	294	352	1,456	224	スカパー JSATHD	29.4	35.2	16	684	その他金融業 (0.4%)				
三井造船	294	352	49	632	日本電信電話	58.8	70.4	324	825	フレディセゾン	294	352	608	960
川崎重工業	294	352	109	120	K D D I	1,764	2,112	6,477	504	不動産業 (1.8%)				
日産自動車	294	352	355	168	N T T ドコモ	29.4	35.2	90	076	東急不動産HD	294	352	190	784
いすゞ自動車	147	176	215	424	東宝	29.4	35.2	116	864	三井不動産	294	352	730	928
トヨタ自動車	294	352	2,095	104	N T T データ	294	352	1,833	920	三菱地所	294	352	659	296
日野自動車	294	352	383	680	コナミホールディングス	294	352	1,346	400	平和不動産	58.8	—	—	—
三菱自動車工業	29.4	35.2	16	192	ソフトバンクグループ	882	1,056	6,839	712	東京建物	147	176	213	664
マツダ	58.8	70.4	111	302	卸売業 (2.0%)					住友不動産	294	352	917	136
本田技研	588	704	2,084	544	双日	29.4	35.2	8	905	サービス業 (3.4%)				
スズキ	294	352	1,180	960	伊藤忠	294	352	435	776	ディー・エヌ・エー	—	105.6	403	392
富士重工業	294	352	1,342	880	丸紅	294	352	179	168	電通	294	352	1,869	120
ヤマハ発動機	—	352	691	328	豊田通商	294	352	835	296	東京ドーム	294	176	172	480
精密機器 (3.1%)					三井物産	294	352	472	912	セコム	294	352	2,673	792
テルモ	588	704	2,759	680	住友商事	294	352	392	128					
ニコン	294	352	525	888	三菱商事	294	352	747	648	合計	株数、金額	62,489.7	73,339.2	150,982.568
オリンパス	294	352	1,265	440	小売業 (11.5%)					銘柄数<比率>	>225銘柄	225銘柄	<98.6%>	
シチズンホールディングス	294	352	188	672	J. フロントリテイリング	147	176	224	576	銘柄数<比率>	>225銘柄	225銘柄	<98.6%>	
その他製品 (1.2%)					三越伊勢丹HD	294	352	362	560	(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。				
凸版印刷	294	352	327	008	セブン&アイ・HLDGS	294	352	1,600	192	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。				
大日本印刷	294	352	359	744	ユニ・ファミリーマートHD	—	352	2,386	560	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
ヤマハ	294	352	1,121	120	高島屋	294	352	288	288					
電気・ガス業 (0.3%)					丸井グループ	294	352	496	672					
東京電力HD	29.4	35.2	14	748	イオン	294	352	524	480					
中部電力	29.4	35.2	52	923	ユニーグループ・HD	294	—	—	—					
関西電力	29.4	35.2	32	426	ファーストリテイリング	294	352	11,443	520					
東京瓦斯	294	352	165	756	銀行業 (1.0%)									
大阪瓦斯	294	352	150	409	コンソルディア・フィナンシャル	—	352	170	966					
陸運業 (2.5%)					新生銀行	294	352	53	856					
東武鉄道	294	352	180	576	あおぞら銀行	294	352	124	960					
東京急行	294	352	274	912	三菱UFJフィナンシャルG	294	352	181	420					
小田急電鉄	294	352	397	408	りそなホールディングス	29.4	35.2	15	276					
京王電鉄	294	352	312	224	三井住友トラストHD	294	352	120	560					
京成電鉄	294	352	450	912	三井住友フィナンシャルG	29.4	35.2	120	982					
東日本旅客鉄道	29.4	35.2	315	884	千葉銀行	294	352	207	328					
西日本旅客鉄道	29.4	35.2	219	225	横浜銀行	294	—	—	—					
東海旅客鉄道	29.4	35.2	614	768	ふくおかフィナンシャルG	294	352	146	784					
日本通運	294	352	177	408	静岡銀行	294	352	291	104					
ヤマトホールディングス	294	352	856	240	みずほフィナンシャルG	294	352	61	318					
海運業 (0.2%)					証券、商品先物取引業 (0.5%)									
日本郵船	294	352	65	472	大和証券G本社	294	352	202	153					
商船三井	294	352	82	016	野村ホールディングス	294	352	162	342					

(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	
	買建額	売建額
国内	百万円	百万円
日経平均	2,170	—

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年9月20日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	150,982,568 千円	97.6 %
コール・ローン等、その他	3,715,707	2.4
投資信託財産総額	154,698,275	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9月20日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	155,558,837,911円
コール・ローン等	1,833,918,286
株式(評価額)	150,982,568,000
未収入金	1,706,470,625
未収配当金	120,841,000
差入委託証拠金	915,040,000
(B) 負債	2,407,962,940
未払金	54,677,940
未払解約金	1,486,985,000
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000
(C) 純資産総額 (A - B)	153,150,874,971
元本	78,725,801,897
次期繰越損益金	74,425,073,074
(D) 受益権総口数	78,725,801,897口
1万口当り基準価額 (C / D)	19,454円

* 期首における元本額は65,793,251,657円、当期中における追加設定元本額は27,704,388,858円、同解約元本額は14,771,838,618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、ストックインデックスファンド225 47,890,676,041円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225V A1,255,730,658円、大和ストックインデックス225ファンド16,540,987,869円、D-1's日経225インデックス109,267,543円、i F r e e日経225インデックス7,865,503円、D C・ダイワ・ストックインデックス225(確定拠出年金専用ファンド) 5,598,873,889円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11Ver6-121,798,935円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11Ver7-161,450,731円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト12Ver2-221,928,436円、ダイワ・ノーロード日経225ファンド217,691,365円、ダイワ・インデックスセレクト日経225 6,599,530,927円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は19,454円です。

■損益の状況

当期 自2015年9月25日 至2016年9月20日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,886,934,761円
受取配当金	2,795,832,536
受取利息	745,461
その他収益金	90,906,449
支払利息	549,685
(B) 有価証券売買損益	△ 8,179,590,699
売買益	9,210,763,785
売買損	17,390,354,484
(C) 先物取引等損益	16,773,226
取引益	917,419,699
取引損	△ 900,646,473
(D) その他費用	△ 32,022
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	△ 5,275,914,734
(F) 前期繰越損益金	67,926,219,578
(G) 解約差損益金	△ 15,963,007,117
(H) 追加信託差損益金	27,737,775,347
(I) 合計 (E + F + G + H)	74,425,073,074
次期繰越損益金 (I)	74,425,073,074

(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。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

運用報告書 第4期 (決算日 2015年12月9日)

(計算期間 2014年12月10日～2015年12月9日)

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第4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	安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。
主要投資対象	円建ての債券
運用方法	①円建ての債券を中心に投資し、安定した収益の確保をめざして安定運用を行ないます。 ②円建資産への投資にあたっては、残存期間が1年未満、取得時においてA-2格相当以上の債券およびコマーシャル・ペーパーに投資することを基本とします。
株式組入制限	純資産総額の10%以下

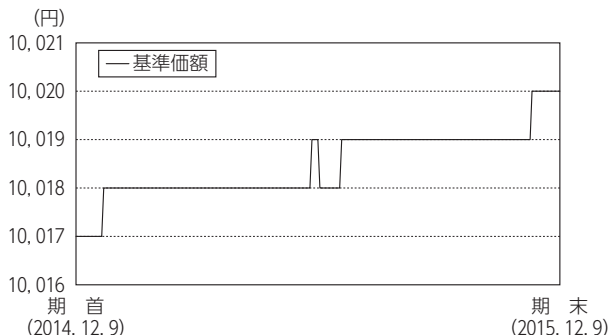
大和投資信託

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/>

■当期中の基準価額の推移



《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：10,017円 期末：10,020円 騰落率：0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境で利息収入が僅少であったことなどから、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

◆投資環境について

○国内短期金融市場

期を通じて、日銀は金融市場調節の操作目標をマネタリーベースとする量的・質的金融緩和政策を維持しました。このような日銀の金融政策を背景に、短期金融市場では低金利が続ぎ、無担保コール翌日物金利は0.07%台を中心に推移しました。国庫短期証券（3カ月物）の利回りは日銀の買い入れによる需給ひっ迫等を背景に、△0.11～0.02%程度で推移しました。

◆前期における「今後の運用方針」

資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

◆ポートフォリオについて

短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産による安定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および参考指数を設けておりません。

《今後の運用方針》

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等の短期金融資産への投資により、安定的な運用を行なっております。

年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組入比率
	円	騰 落 率 %	
(期首) 2014年12月9日	10,017	—	53.3
12月末	10,018	0.0	72.3
2015年1月末	10,018	0.0	80.5
2月末	10,018	0.0	70.3
3月末	10,018	0.0	59.6
4月末	10,018	0.0	70.6
5月末	10,018	0.0	73.2
6月末	10,019	0.0	69.3
7月末	10,019	0.0	59.4
8月末	10,019	0.0	65.5
9月末	10,019	0.0	51.5
10月末	10,019	0.0	76.0
11月末	10,020	0.0	56.8
(期末) 2015年12月9日	10,020	0.0	52.7

(注1) 騰落率は期首比。

(注2) 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。

(注3) 当ファンドは、安定的な収益の確保をめざして安定運用を行っており、ベンチマークおよび参考指数はありません。

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	—円
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	—

(注) 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。

ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

■売買および取引の状況

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

		買付額	売付額
国	国債証券	千円	千円
国内	国債証券	32,338,160	(32,240,000)

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) ()内は償還による減少分で、上段の数字には含まれておりません。

(注3) 単位未満は切捨て。

■主要な売買銘柄

公 社 債

(2014年12月10日から2015年12月9日まで)

当		期	
買付		売付	
銘柄	金額	銘柄	金額
	千円		千円
491 国庫短期証券 2015/5/14	1,999,998		
540 国庫短期証券 2015/9/24	1,699,999		
555 国庫短期証券 2015/12/7	1,500,000		
557 国庫短期証券 2015/12/14	1,500,000		
541 国庫短期証券 2015/9/28	1,499,998		
532 国庫短期証券 2015/8/17	1,499,995		
514 国庫短期証券 2015/5/25	1,499,968		
521 国庫短期証券 2015/6/29	1,499,925		
502 国庫短期証券 2015/3/30	1,199,993		
563 国庫短期証券 2016/1/18	1,150,000		

(注1) 金額は受渡し代金(経過利子分は含まれておりません)。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1)国内(邦貨建)公社債(種類別)

作成期	当			期			末		
	額面金額	評価額	組入比率	うちBB格以下組入比率	残存期間別組入比率	5年以上	2年以上	2年未満	
	千円	千円	%	%	%	%	%	%	
国債証券	6,435,000	6,437,978	52.7	—	—	—	—	52.7	

(注1) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注2) 額面金額、評価額の単位未満は切捨て。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

区分	銘柄	当		期		末	
		年利率	額面金額	評価額	償還年月日		
		%	千円	千円			
国債証券	557 国庫短期証券	—	1,500,000	1,500,000	2015/12/14		
	336 2年国債	0.1000	185,000	185,022	2016/01/15		
	563 国庫短期証券	—	1,150,000	1,150,000	2016/01/18		
	566 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/01		
	567 国庫短期証券	—	1,000,000	999,999	2016/02/08		
	573 国庫短期証券	—	500,000	500,097	2016/03/07		
	100 5年国債	0.3000	1,100,000	1,102,860	2016/09/20		
合計	銘柄数	7銘柄					
	金額		6,435,000	6,437,978			

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
公社債	6,437,978	52.7
コール・ローン等、その他	5,772,311	47.3
投資信託財産総額	12,210,290	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

2015年12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	12, 210, 290, 310円
コール・ローン等	5, 771, 514, 330
公社債 (評価額)	6, 437, 978, 324
未収利息	668, 726
前払費用	128, 930
(B) 負債	—
(C) 純資産総額 (A - B)	12, 210, 290, 310
元本	12, 186, 116, 869
次期繰越損益金	24, 173, 441
(D) 受益権総口数	12, 186, 116, 869口
1万口当り基準価額 (C / D)	10, 020円

* 期首における元本額は11,884,993,463円、当期中における追加設定元本額は8,064,725,261円、同解約元本額は7,763,601,855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・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジあり4,998,495円、ダイワ・グローバル高利回りCBファンドⅡ 為替ヘッジなし2,499,247円、ダイワ・グローバル・ハイブリッド証券ファンドⅡ (為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジあり) 999円、ダイワ債券コア戦略ファンド (為替ヘッジなし) 999円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (毎月分配型) 219,583円、通貨選択型ダイワ米国株主還元株αクワトロプレミアム (年2回決算型) 24,953円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (毎月分配型) 848,389円、ダイワ米国株主還元株ツインαプレミアム (年2回決算型) 66,873円、ダイワ米国株主還元株ファンド36,730,213円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (年1回決算型) 4,995円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (年1回決算型) 4,995円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-04 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-07 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2014-10 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、世界ハイブリッド証券ファンド2015-01 (為替ヘッジあり/限定追加型) 999円、ダイワ・ブラジル・リアル債α (毎月分配型) -スーパー・ハイインカム- α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・リアル債α (毎月分配型) -スーパー・ハイインカム- α100コース49,911円、ダイワ・オーストラリア高配当株ファンド・マネー・ポートフォリオ26,536,157円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 3 -2,395,687,762円、ダイワ日本株式ベア・ファンド-ベアシフト11-71,870,634円、ダイワ日本株式ベア・ファンド-ベアシフト11 Ver 2 -29,945,799円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド-シフト11 Ver 5 -2,095,808,384円、ダイワ・スイス高配当株ツインα (毎月分配型) 2,996,106円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 為替ヘッジなしコース10,980,236円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 日本円コース1,696,946円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) ブラジル・リアル・コース7,487,022円、通貨選択型ダイワ世界インカム・ハンター (毎月分配型) 通貨セレクト・コース3,593,631円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり (毎月分配型) 29,988,005円、ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジなし (毎月分配型) 1,999,201円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 日本円コース (毎月分配型) 1,002,195円、通貨選択型 ダイワ/NB・米国債券戦略ファンド 通貨セレクトコース (毎月分配型) 3,011,774円、ダイワ新興国ハイインカム・プラス -インカムチェンジ (積立型) -7,515,709円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド (限定追加型) -シフト11-3,536,610,361円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド (限定追加型) -シフト12-2,626,169,333円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド (限定追加型) -シフト13-1,287,713,056円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,020円です。

■損益の状況

当期 自2014年12月10日 至2015年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	3, 173, 485円
受取利息	3, 173, 485
(B) 有価証券売買損益	△ 382, 400
売買益	1, 050
売買損	△ 383, 450
(C) 当期損益金 (A + B)	2, 791, 085
(D) 前期繰越損益金	20, 640, 762
(E) 解約差損益金	△ 14, 198, 145
(F) 追加信託差損益金	14, 939, 739
(G) 合計 (C + D + E + F)	24, 173, 441
次期繰越損益金 (G)	24, 173, 441

(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。