

★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11カ月間（2015年10月5日～2020年9月18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。） 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
	ストックインデックス225・マザーファンド	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
	ダイワ・マネーアセット・マザーファンド	円建ての債券
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
ーシフト11 Ver5ー

運用報告書(全体版)
第2期

(決算日 2017年9月19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・ファンドーシフト11 Ver5ー」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		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	(ベンチマーク)	期 中 騰落率				
	円	円	%	円	%	%	%	%	百万円
1 期末 (2016年 9 月20日)	10, 975	0	9. 8	16, 492. 15	△ 7. 0	—	—	—	3, 571
2 期末 (2017年 9 月19日)	10, 967	0	△ 0. 1	20, 299. 38	23. 1	—	—	—	3, 569

(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。

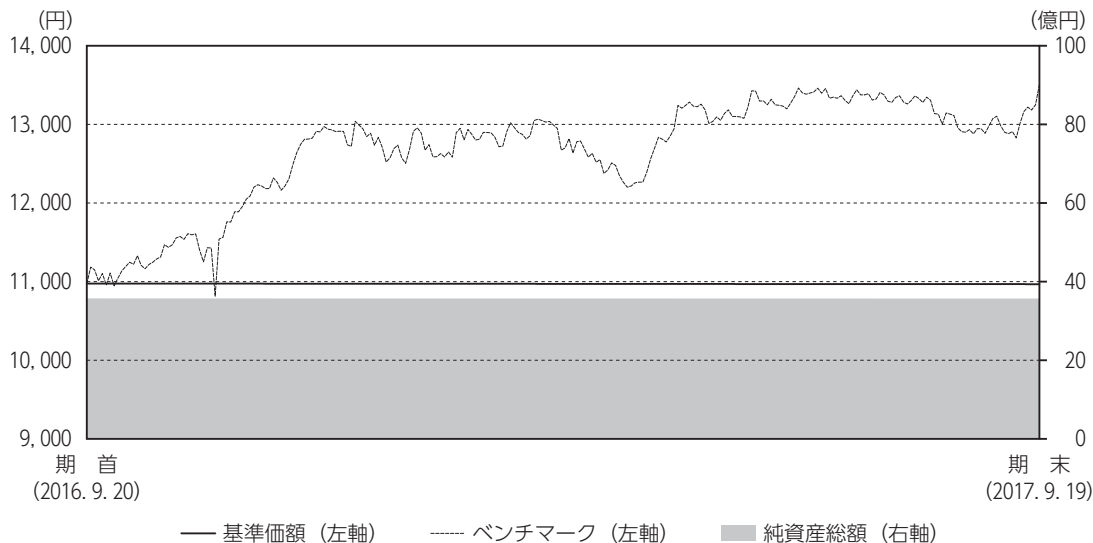
(注 2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(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：10,975円

期 末：10,967円

騰落率：△0.1%

基準価額の主な変動要因

安定運用を継続して行なった結果、基準価額はほぼ横ばいとなりました。

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			
	円	%	円	%	%	%	%
(期首) 2016年 9 月20日	10, 975	—	16, 492. 15	—	—	—	—
9 月末	10, 975	0. 0	16, 449. 84	△ 0. 3	—	—	15. 3
10月末	10, 974	△ 0. 0	17, 425. 02	5. 7	—	—	2. 0
11月末	10, 973	△ 0. 0	18, 308. 48	11. 0	—	—	15. 7
12月末	10, 973	△ 0. 0	19, 114. 37	15. 9	—	—	—
2017年 1 月末	10, 972	△ 0. 0	19, 041. 34	15. 5	—	—	18. 3
2 月末	10, 972	△ 0. 0	19, 118. 99	15. 9	—	—	14. 8
3 月末	10, 971	△ 0. 0	18, 909. 26	14. 7	—	—	—
4 月末	10, 970	△ 0. 0	19, 196. 74	16. 4	—	—	20. 7
5 月末	10, 969	△ 0. 1	19, 650. 57	19. 2	—	—	3. 0
6 月末	10, 969	△ 0. 1	20, 033. 43	21. 5	—	—	0. 3
7 月末	10, 968	△ 0. 1	19, 925. 18	20. 8	—	—	0. 0
8 月末	10, 968	△ 0. 1	19, 646. 24	19. 1	—	—	—
(期末) 2017年 9 月19日	10, 967	△ 0. 1	20, 299. 38	23. 1	—	—	—

(注) 騰落率は期首比。

投資環境について

(2016. 9. 21 ~ 2017. 9. 19)

■国内短期債券市況

日銀による「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を背景に、国庫短期証券（3 カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利はマイナス圏で推移しました。

前期における「今後の運用方針」

■当ファンド

「ダイワ・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います。

■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。

ポートフォリオについて

(2016. 9. 21 ~ 2017. 9. 19)

■当ファンド

「ダイワ・マネーアセット・マザーファンド」の受益証券を組み入れ、安定運用を継続して行ないました。

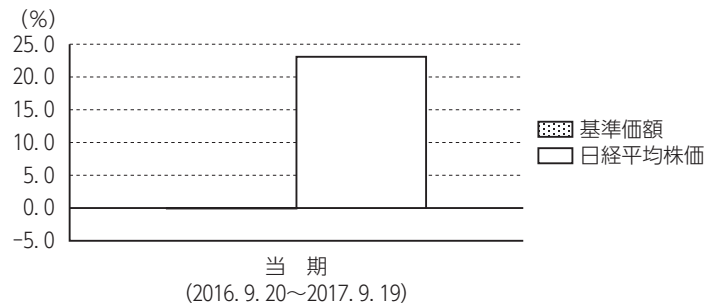
■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による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23.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.1%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。
- 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

安定運用に移行しているため、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	
	2016年9月21日 ～2017年9月19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)	982

- (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、短期の国債やコール・ローン等による運用を行なう方針です。

上記の運用方針により、マイナス利回りの短期の国債やコール・ローン等にも投資する場合があります。今後も低金利環境が継続した場合には、ファンド全体の損益がマイナスとなり、基準価額が下落する可能性があります。投資家のみなさまにおかれましては、ご注意くださいようお願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2016. 9. 21～2017. 9. 19)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	—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10,971円です。
(投 信 会 社)	(—)	(—)	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)	(—)	(—)	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)	(—)	(—)	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	0.002	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)	(0.002)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	0	0.002	

(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

当期中における売買および取引はありません。

■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

(2016年9月21日から2017年9月19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	44,951	11,310	25.2	—	—	—
コール・ローン	2,500,299	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合18.3%

※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、大和証券です。

■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	
0	—	—	0	当初設定時における取得

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■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・マネーアセット・マザーファンド	2,095,808	2,095,808	2,097,904

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2017年9月19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	2,097,904	58.8
コール・ローン等、その他	1,471,696	41.2
投資信託財産総額	3,569,601	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

2017年9月19日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	3,569,601,100円
コール・ローン等	1,471,696,908
ダイワ・マネーアセット・マザーファンド（評価額）	2,097,904,192
(B) 負債	9,516
その他未払費用	9,516
(C) 純資産総額（A－B）	3,569,591,584
元本	3,254,771,483
次期繰越損益金	314,820,101
(D) 受益権総口数	3,254,771,483口
1万口当り基準価額（C／D）	10,967円

* 期首における元本額は3,254,771,483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。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,967円です。

■損益の状況

当期 自2016年 9月21日 至2017年 9月19日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 876, 770円
支払利息	△ 876, 770
(B) 有価証券売買損益	△ 1, 467, 066
売買損	△ 1, 467, 066
(C) 信託報酬等	△ 48, 821
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 2, 392, 657
(E) 前期繰越損益金	319, 813, 455
(F) 追加信託差損益金	△ 2, 600, 697
(配当等相当額)	(5, 570)
(売買損益相当額)	(△ 2, 606, 267)
(G) 合計 (D + E + F)	314, 820, 101
次期繰越損益金 (G)	314, 820, 101
追加信託差損益金	△ 2, 600, 697
(配当等相当額)	(5, 570)
(売買損益相当額)	(△ 2, 606, 267)
分配準備積立金	319, 878, 176
繰越損益金	△ 2, 457, 378

- (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	5, 570
(d) 分配準備積立金	319, 878, 176
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	319, 883, 746
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	319, 883, 746
(h) 受益権総口数	3, 254, 771, 483□

【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 Ver5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 Ver5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（2016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（2017年9月19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

(2016年9月21日から2017年9月19日まで)

買 付			売 付		
銘 柄		金 額	銘 柄		金 額
		千円			千円
645 国庫短期証券	2017/2/20	4,280,100			
669 国庫短期証券	2017/6/12	3,020,099			
657 国庫短期証券	2017/4/17	2,860,055			
659 国庫短期証券	2017/4/24	2,650,077			
652 国庫短期証券	2017/3/27	2,530,020			
629 国庫短期証券	2016/11/28	2,440,076			
642 国庫短期証券	2017/2/6	2,410,036			
644 国庫短期証券	2017/5/12	2,070,088			
651 国庫短期証券	2017/3/21	1,970,049			
632 国庫短期証券	2016/12/12	1,890,066			

(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

2017年9月19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16期（決算日 2017年 9月19日）

（計算期間 2016年 9月21日～2017年 9月19日）

ストックインデックス 225・マザーファンドの第16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

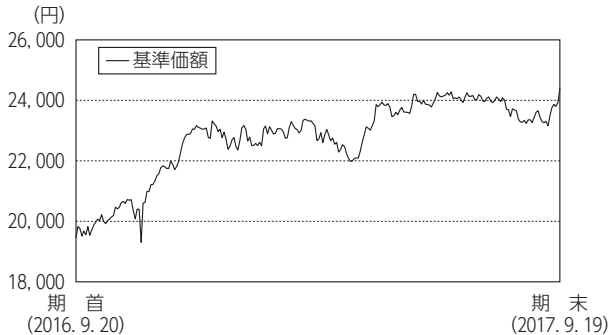
大和投資信託

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



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 物 率
	円	%	円	%	%	%
(期首) 2016年 9月20日	19,454	—	16,492.15	—	98.6	1.4
9月末	19,536	0.4	16,449.84	△ 0.3	98.3	1.7
10月末	20,696	6.4	17,425.02	5.7	98.0	2.0
11月末	21,750	11.8	18,308.48	11.0	98.2	1.8
12月末	22,742	16.9	19,114.37	15.9	98.8	1.2
2017年 1月末	22,654	16.4	19,041.34	15.5	98.5	1.5
2月末	22,764	17.0	19,118.99	15.9	98.3	1.6
3月末	22,665	16.5	18,909.26	14.7	98.0	2.0
4月末	23,015	18.3	19,196.74	16.4	97.5	2.5
5月末	23,569	21.2	19,650.57	19.2	97.9	2.1
6月末	24,055	23.7	20,033.43	21.5	98.2	1.8
7月末	23,925	23.0	19,925.18	20.8	98.8	1.2
8月末	23,605	21.3	19,646.24	19.1	98.4	1.7
(期末) 2017年 9月19日	24,389	25.4	20,299.38	23.1	97.2	1.8

(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。

《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：19,454円 期末：24,389円 騰落率：25.4%

【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、日経平均株価の動きを反映して、基準価額は上昇しました。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、日米の金融政策や米国大統領選挙に関する見方が交錯し、一進一退で推移しました。2016年11月は、米国大統領選挙でのトランプ氏勝利を受けて一時的に投資家のリスク回避姿勢が強まり株価は下落しましたが、その後はトランプ氏の景気刺激政策への期待から、上昇基調となりました。12月半ば以降は、株価の急上昇に対する警戒感に加えてトランプ氏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て、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、米国物価統計の弱含みにより米国の年内利上げ観測が後退したこと、また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。期末にかけては、北朝鮮の地政学リスクがやや後退したことや、衆議院解散観測を受けての安倍政権に対する期待の高まりから上昇しました。

◆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おります。

◆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、期中に東芝の組み入れを見送り、東芝が日経平均株価採用銘柄より除外された2017年8月からは、すべての銘柄を組み入れて運用を行ないました。

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、連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23.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は25.4%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おります。

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)	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を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1)株 式

(2016年 9月21日から2017年 9月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 3,950.7 (△3,287.208)	千円 10,431,718 ()	千株 23,815.192	千円 58,750,439

- (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)先物取引の種別取引状況

(2016年 9月21日から2017年 9月19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 41,135	百万円 41,561	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

(2016年 9月21日から2017年 9月19日まで)

当 期				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
大塚ホールディングス	304	1,566,467	5,152	ファーストリテイリング	116	4,514,726	38,920
セイコーエプソン	512	1,498,606	2,926	ソフトバンクグループ	348	2,798,374	8,041
楽天	366	480,247	1,312	ファナック	116	2,446,606	21,091
ファーストリテイリング	14	468,201	33,442	KDDI	696	2,092,719	3,006
ソフトバンクグループ	42	342,411	8,152	東京エレクトロン	116	1,451,911	12,516
ファナック	14	300,506	21,464	京セラ	232	1,402,729	6,046
KDDI	84	249,664	2,972	ダイキン工業	116	1,259,896	10,861
東京エレクトロン	14	181,383	12,955	信越化学	116	1,078,234	9,295
京セラ	28	173,759	6,205	日東電工	116	1,018,089	8,776
ダイキン工業	14	151,488	10,820	テルモ	232	980,424	4,225

- (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	千円		株数	株数	評価額	千円		株数	株数	評価額	千円
水産・農林業 (0.2%)					三井化学	352	250	173,750		住友電工	352	250	443,750	
日本水産	352	250	154,000		三菱ケミカル HLDGS	176	125	135,187		フジクラ	352	250	231,250	
マルハニチロ	35.2	25	82,875		宇部興産	352	250	83,250		金属製品 (0.4%)				
鉱業 (0.1%)					日本化薬	352	250	454,000		SUMCO	35.2	25	42,700	
国際石油開発帝石	140.8	100	111,150		花王	352	250	1,711,000		東洋製罐グループHD	352	250	477,250	
建設業 (2.9%)					富士フイルム HLDGS	352	250	1,095,750		機械 (5.3%)				
コムシスホールディングス	352	250	635,500		資生堂	352	250	1,147,500		日本製鋼所	352	50	130,750	
大成建設	352	250	293,000		日東電工	352	250	2,441,250		オークマ	352	250	281,500	
大林組	352	250	325,000		医薬品 (7.5%)					アマダホールディングス	352	250	310,500	
清水建設	352	250	299,750		協和発酵キリン	352	250	466,000		小松製作所	352	250	792,000	
長谷工コーポレーション	70.4	50	70,550		武田薬品	352	250	1,547,750		住友重機械	352	250	223,250	
鹿島建設	352	250	259,500		アステラス製薬	1,760	1,250	1,832,500		日立建機	352	250	808,750	
大和ハウス	352	250	962,250		大日本住友製薬	352	250	369,750		クボタ	352	250	503,500	
積水ハウス	352	250	466,375		塩野義製薬	352	250	1,489,750		荏原製作所	352	50	182,750	
日揮	352	250	433,000		中外製薬	352	250	1,165,000		ダイキン工業	352	250	2,828,750	
千代田化工建	352	250	153,000		エーザイ	352	250	1,467,250		日本精工	352	250	365,500	
食料品 (4.9%)					第一三共	352	250	652,500		N T N	352	250	117,500	
日清製粉G本社	352	250	489,750		大塚ホールディングス	—	250	1,094,500		ジェイテクト	352	250	382,750	
明治ホールディングス	70.4	50	437,000		石油・石炭製品 (0.3%)					日立造船	70.4	50	28,800	
日本ハム	352	250	786,250		昭和シエル石油	352	250	305,250		三菱重工業	352	250	109,175	
サッポロホールディングス	70.4	50	159,500		JXTGホールディングス	352	250	141,425		I H I	352	250	96,250	
アサヒグループホールディン	352	250	1,146,000		ゴム製品 (1.1%)					電気機器 (19.9%)				
キリンHD	352	250	632,750		横浜ゴム	176	125	280,625		日清紡ホールディングス	352	250	331,750	
宝ホールディングス	352	250	266,000		ブリヂストン	352	250	1,256,250		コニカミノルタ	352	250	232,500	
キッコーマン	352	250	878,750		ガラス・土製品 (1.6%)					ミネベアミツミ	352	250	474,750	
味の素	352	250	542,375		旭硝子	352	50	208,250		日立	352	250	198,275	
ニチレイ	352	125	361,250		日本板硝子	352	25	21,250		東芝	352	—	—	
日本たばこ産業	352	250	930,000		日本電気硝子	528	75	318,750		三菱電機	352	250	438,750	
繊維製品 (0.3%)					住友大阪セメント	352	250	125,000		富士電機	352	250	157,000	
東洋紡	352	250	49,750		太平洋セメント	352	250	109,750		安川電機	352	250	902,500	
ユニチカ	352	250	20,750		東海カーボン	352	250	225,000		明電舎	352	250	100,750	
帝人	352	50	114,550		T O T O	176	125	551,875		ジーエス・ユアサ コーポ	352	250	145,500	
東レ	352	250	271,375		日本碍子	352	250	531,000		日本電気	352	250	74,750	
パルプ・紙 (0.3%)					鉄鋼 (0.2%)					富士通	352	250	211,525	
王子ホールディングス	352	250	148,750		新日鐵住金	35.2	25	67,800		沖電気	352	25	37,600	
日本製紙	35.2	25	51,950		神戸製鋼所	352	25	33,575		セイコーエプソン	—	500	1,411,500	
北越紀州製紙	352	250	173,000		J F Eホールディングス	35.2	25	55,887		パナソニック	352	250	412,875	
化学 (9.3%)					日新製鋼	35.2	25	35,525		ソニー	352	250	1,073,500	
クラレ	352	250	532,000		大平洋金属	352	250	78,000		T D K	352	250	1,880,000	
旭化成	352	250	349,750		非鉄金属 (1.5%)					ミツミ電機	352	—	—	
昭和電工	35.2	25	84,125		日本軽金属HD	352	250	82,750		アルプス電気	352	250	758,750	
住友化学	352	250	176,750		三井金属	352	250	149,000		パイオニア	352	250	51,500	
日産化学	352	250	1,020,000		東邦亜鉛	352	250	122,500		横河電機	352	250	471,750	
日本曹達	352	—	—		三菱マテリアル	352	25	99,250		アドバンテス	704	500	1,058,500	
東ソー	352	250	324,000		住友鉱山	352	250	489,000		カシオ	352	250	394,250	
トクヤマ	352	250	129,750		DOWAホールディングス	352	250	205,750		ファナック	352	250	5,688,750	
デンカ	352	250	183,250		古河機金	352	250	48,750		京セラ	704	500	3,491,500	
信越化学	352	250	2,540,000		古河電工	352	25	157,250		太陽誘電	352	250	435,500	

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	千株	株数	千円			株数	千株	株数	千円			株数	千株	株数	千円																		
SCREENホールディングス						352	50	380,000	倉庫・運輸関連業 (0.3%)						第一生命HLDGS						35.2	25	47,487												
キヤノン						528	375	1,438,875	三菱倉庫						352	250	349,000	東京海上HD						176	125	565,625									
リコー						352	250	275,000	情報・通信業 (11.8%)						T&Dホールディングス						70.4	50	78,375												
東京エレクトロン						352	250	4,307,500	ヤフー						140.8	100	50,600	その他金融業 (0.4%)						クレディセゾン						352	250	513,750			
輸送用機器 (6.7%)												トレンドマイクロ						352	250	1,402,500	不動産業 (1.7%)						東急不動産HD						352	250	164,250
デンソー						352	250	1,375,500	スカパーJSATHD						35.2	25	12,650	三井不動産						352	250	584,250									
三井造船						352	250	35,500	日本電信電話						70.4	50	256,750	三菱地所						352	250	475,000									
川崎重工業						352	250	91,750	KDDI						2,112	1,500	4,471,500	東京建物						176	125	172,875									
日産自動車						352	250	288,250	NTTドコモ						35.2	25	64,587	住友不動産						352	250	859,750									
いすゞ自動車						176	125	186,312	東宝						35.2	25	98,250	サービス業 (2.9%)						ディー・エヌ・エー						105.6	75	182,775			
トヨタ自動車						352	250	1,682,250	NTTデータ						352	1,250	1,500,000	電通						352	250	1,178,750									
日野自動車						352	250	340,000	コナミホールディングス						352	250	1,407,500	楽天						—	250	312,500									
三菱自動車工業						35.2	25	21,625	ソフトバンクグループ						1,056	750	6,678,000	東京ドーム						176	125	125,875									
マツダ						70.4	50	82,950	卸売業 (2.3%)						セコム						352	250	2,081,500												
本田技研						704	500	1,647,000	双日						35.2	25	7,675	合計						株数・金額		73,339.2	50,187.5	134,894,422							
スズキ						352	250	1,532,000	伊藤忠						352	250	458,250	銘柄数<比率>						225銘柄	225銘柄	<97.2%>									
SUBARU						352	250	995,000	丸紅						352	250	185,725	(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。																	
ヤマハ発動機						352	250	818,750	豊田通商						352	250	915,000	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。																	
精密機器 (2.9%)												三井物産						352	250	421,625	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。														
テルモ						704	500	2,262,500	住友商事						352	250	402,125	(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)																	
ニコン						352	250	472,500	三菱商事						352	250	655,125	銘柄別						当期末											
オリンパス						352	250	966,250	小売業 (9.1%)												買建額		売建額												
シチズン時計						352	250	194,750	J.フロントリテイリング						176	125	187,125	国内		百万円		百万円													
その他製品 (1.2%)												三越伊勢丹HD						352	250	287,500	日経平均		2,498		—										
凸版印刷						352	250	278,500	セブン&アイ・HLDGS						352	250	1,101,750	(注) 単位未満は切捨て。																	
大日本印刷						352	250	331,250	ユニー・ファミリーマートHD						352	250	1,432,500																		
ヤマハ						352	250	977,500	高島屋						352	250	260,750																		
電気・ガス業 (0.2%)												丸井グループ						352	250	406,750															
東京電力HD						35.2	25	11,450	イオン						352	250	409,625																		
中部電力						35.2	25	35,962	ファーストリテイリング						352	250	8,200,000																		
関西電力						35.2	25	38,512	銀行業 (1.0%)																										
東京瓦斯						352	250	143,625	コンソルディア・フィナンシャル						352	250	139,525																		
大阪瓦斯						352	250	107,125	新生銀行						352	250	43,750																		
陸運業 (2.2%)												あおぞら銀行						352	250	106,750															
東武鉄道						352	250	156,250	三菱UFJフィナンシャルG						352	250	177,225																		
東京急行						352	125	200,625	リソなホールディングス						35.2	25	13,822																		
小田急電鉄						352	125	267,625	三井住友トラストHD						352	25	99,375																		
京王電鉄						352	250	234,750	三井住友フィナンシャルG						35.2	25	107,200																		
京成電鉄						352	125	388,125	千葉銀行						352	250	190,250																		
東日本旅客鉄道						35.2	25	254,875	ふくおかフィナンシャルG						352	250	122,000																		
西日本旅客鉄道						35.2	25	196,925	静岡銀行						352	250	249,000																		
東海旅客鉄道						35.2	25	485,875	みずほフィナンシャルG						352	250	48,950																		
日本通運						352	250	185,250	証券・商品先物取引業 (0.4%)																										
ヤマトホールディングス						352	250	579,000	大和証券G本社						352	250	158,525																		
海運業 (0.2%)												野村ホールディングス						352	250	157,925															
日本郵船						352	250	58,000	松井証券						352	250	215,000																		
商船三井						352	250	87,750	保険業 (1.0%)																										
川崎汽船						352	250	73,250	SOMPOホールディングス						88	62.5	283,062																		
空運業 (0.1%)												MS&AD						105.6	75	273,750															
ANAホールディングス						352	250	104,925	SONYFH						70.4	50	89,100																		

■投資信託財産の構成

2017年9月19日現在		
項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 134,894,422	% 96.9
コール・ローン等、その他	4,323,590	3.1
投資信託財産総額	139,218,012	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

2017年9月19日現在	
項 目	当 期 末
(A) 資産	140,008,002,801円
コール・ローン等	1,979,025,274
株式（評価額）	134,894,422,500
未収入金	2,254,062,027
未収配当金	90,503,000
差入委託証拠金	789,990,000
(B) 負債	1,251,758,000
未払解約金	385,458,000
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000
(C) 純資産総額（A－B）	138,756,244,801
元本	56,891,999,288
次期繰越損益金	81,864,245,513
(D) 受益権総口数	56,891,999,288口
1万口当り基準価額（C／D）	24,389円

* 期首における元本額は78,725,801,897円、当期中における追加設定元本額は9,750,934,005円、同解約元本額は31,584,736,614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 29,839,637,905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 A934,940,216円、大和ストックインデックス225ファンド10,398,001,066円、D－I's日経225インデックス102,430,549円、iFree日経225インデックス103,304,273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）5,031,285,400円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト12Ver2ー227,152,665円、ダイワ・ノーロード日経225ファンド155,766,009円、ダイワファンドラップ日経225インデックス1,669,599,472円、ダイワ日経225インデックス（ダイワS M A 専用）428,154円、ダイワ・インデックスセレクト日経225 8,429,453,579円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,389円です。

■損益の状況

当期 自2016年9月21日 至2017年9月19日	
項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,774,846,036円
受取配当金	2,775,725,064
その他収益金	436,564
支払利息	△ 1,315,592
(B) 有価証券売買損益	32,230,575,612
売買益	34,058,409,010
売買損	△ 1,827,833,398
(C) 先物取引等損益	753,493,940
取引益	917,437,479
取引損	△ 163,943,539
(D) その他費用	△ 224,792
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	35,758,690,796
(F) 前期繰越損益金	74,425,073,074
(G) 解約差損益金	△ 40,378,052,352
(H) 追加信託差損益金	12,058,533,995
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	81,864,245,513
次期繰越損益金（I）	81,864,245,513

(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5期（決算日 2016年12月9日）

（計算期間 2015年12月10日～2016年12月9日）

ダイワ・マネーアセット・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	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

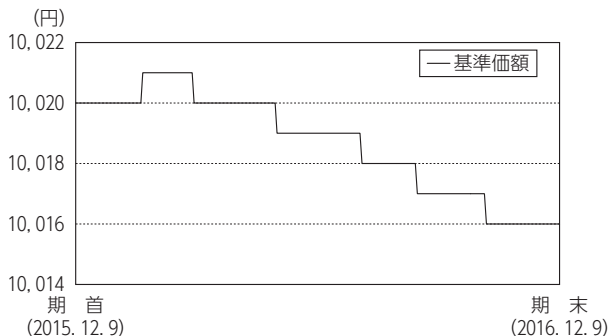
大和投資信託

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



年 月 日	基 準 価 額		公 社 債 組入比率
	円	騰 落 率 %	
(期首) 2015年12月 9 日	10,020	—	52.7
12月末	10,020	0.0	52.0
2016年 1月末	10,020	0.0	61.6
2月末	10,021	0.0	48.5
3月末	10,020	0.0	32.1
4月末	10,020	0.0	24.5
5月末	10,019	△ 0.0	10.5
6月末	10,019	△ 0.0	10.5
7月末	10,018	△ 0.0	19.3
8月末	10,017	△ 0.0	46.5
9月末	10,017	△ 0.0	26.1
10月末	10,016	△ 0.0	3.4
11月末	10,016	△ 0.0	26.7
(期末) 2016年12月 9 日	10,016	△ 0.0	28.2

(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、安定した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。

《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：10,020円 期末：10,016円 騰落率：△0.0%

【基準価額の主な変動要因】

低金利環境が継続したことなどから、基準価額は下落しました。

◆投資環境について

○国内短期金融市況

期首より、日銀は量的・質的金融緩和を継続し、2016年1月にはマイナス金利付き量的・質的金融緩和の導入を、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和の導入を決定しました。このような日銀の金融政策を背景に、国庫短期証券（3カ月物）の利回りおよび無担保コール翌日物金利は低下しました。

◆前期における「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いました。

◆ポートフォリオについて

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・ローン等による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、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
売買委託手数料	—円
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を四捨五入してあります。

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

(2015年12月10日から2016年12月9日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 48,041,830	千円 — (51,515,000)

(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

(2015年12月10日から2016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
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		
629 国庫短期証券 2016/11/28	2,440,076		
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		
632 国庫短期証券 2016/12/12	1,890,066		

(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		
区 分	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	2,960,000	2,960,056	28.2	—	—	—	28.2

(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。
(注3) 評価額および格付情報については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(2)国内(邦貨建)公社債(銘柄別)

当		期		末	
区 分	銘 柄	年利率	額面金額	評価額	償還年月日
国債証券	632 国庫短期証券	— %	千円 1,890,000	千円 1,890,015	2016/12/12
	634 国庫短期証券	—	320,000	320,006	2016/12/19
	635 国庫短期証券	—	750,000	750,034	2016/12/26
合計	銘柄数	3銘柄			
	金 額		2,960,000	2,960,056	

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2016年12月9日現在

項 目	当	期	末
	評 価 額	比	率
	千円		%
公社債	2,960,056		27.4
コール・ローン等、その他	7,832,675		72.6
投資信託財産総額	10,792,732		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12月9日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,792,732,361円
コール・ローン等	7,832,629,033
公社債（評価額）	2,960,056,480
その他未収収益	46,848
(B) 負債	300,005,700
未払金	300,005,700
(C) 純資産総額（A－B）	10,492,726,661
元本	10,476,400,958
次期繰越損益金	16,325,703
(D) 受益権総口数	10,476,400,958口
1万口当り基準価額（C／D）	10,016円

* 期首における元本額は12,186,116,869円、当期中における追加設定元本額は1,736,323,360円、同解約元本額は3,446,039,271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・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／N B・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／N B・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・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－α50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α（毎月分配型）－スーパー・ハインカム－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39,455,979円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 3－1,078,302,562円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 7－1,257,987,220円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト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5,990,216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1,397,544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・レアル・コース3,994,008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1,597,623円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジあり40,885円、ダイワ世界インカム・ハンター（年2回決算型）為替ヘッジなし100,789円、ダイワ／N B・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／N B・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／N B・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／N B・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、ダイワ新興国ハインカム・プラス－インカムチェンジ（積立型）－1,527,685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12－1,088,870,549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10,016円です。

■損益の状況

当期 自2015年12月10日 至2016年12月9日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,082,398円
受取利息	1,776,408
その他収益金	46,848
支払利息	△ 2,905,654
(B) 有価証券売買損益	△ 3,128,171
売買益	40
売買損	△ 3,128,211
(C) その他費用	△ 111,607
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	△ 4,322,176
(E) 前期繰越損益金	24,173,441
(F) 解約差損益金	△ 6,316,919
(G) 追加信託差損益金	2,791,357
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	16,325,703
次期繰越損益金（H）	16,325,703

（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。