

★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 3 カ月間（2013 年 7 月 4 日～2018 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
	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
	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した。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（限定追加型） ーシフト11ー

運用報告書(全体版) 満期償還

（償還日 2018 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（限定追加型）ーシフト11ー」は、このたび、満期償還となりました。

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			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 (2014年 9 月19日)	11, 057	0	10. 6	16, 321. 17	16. 1	—	—	40. 4	8, 686
2 期末 (2015年 9 月24日)	11, 056	0	△ 0. 0	17, 571. 83	7. 7	—	—	27. 9	6, 800
3 期末 (2016年 9 月20日)	11, 053	0	△ 0. 0	16, 492. 15	△ 6. 1	—	—	—	6, 304
4 期末 (2017年 9 月19日)	11, 046	0	△ 0. 1	20, 299. 38	23. 1	—	—	—	6, 185
償 還 (2018年 9 月19日)	11, 039. 64	—	△ 0. 1	23, 672. 52	16. 6	—	—	—	225

(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。

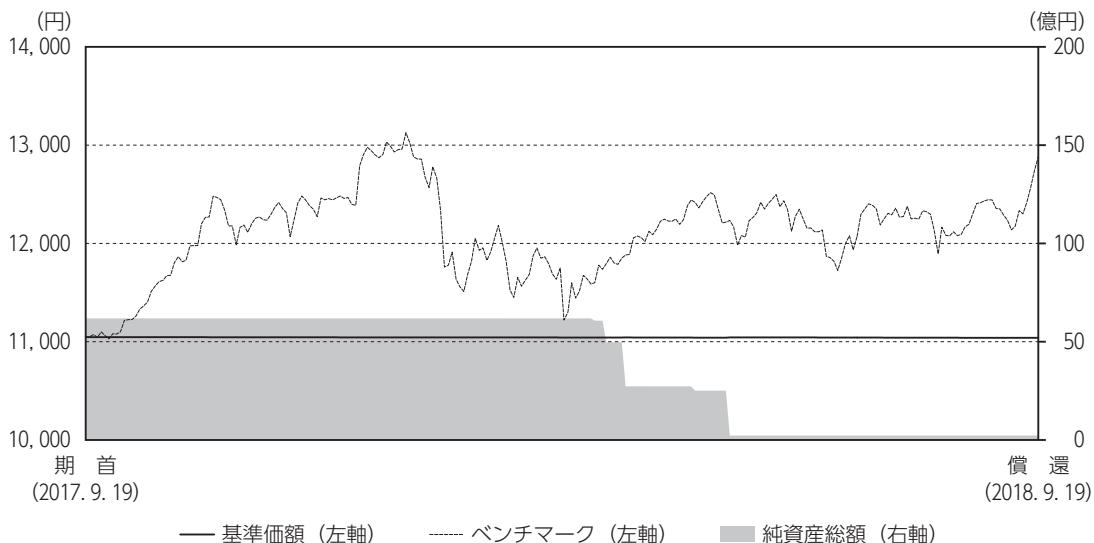
(注 2) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

(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

設定時：10,000円

償還時：11,039円64銭

騰落率：10.4%

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。また、安定運用に移行した後は、有価証券の値動きによる基準価額の変動はほぼなくなりました。

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－

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) 2017年 9 月19日	11, 046	—	20, 299. 38	—	—	—	—
9 月末	11, 046	0. 0	20, 356. 28	0. 3	—	—	—
10月末	11, 046	0. 0	22, 011. 61	8. 4	—	—	—
11月末	11, 045	△ 0. 0	22, 724. 96	11. 9	—	—	—
12月末	11, 044	△ 0. 0	22, 764. 94	12. 1	—	—	—
2018年 1 月末	11, 044	△ 0. 0	23, 098. 29	13. 8	—	—	—
2 月末	11, 043	△ 0. 0	22, 068. 24	8. 7	—	—	0. 3
3 月末	11, 042	△ 0. 0	21, 454. 30	5. 7	—	—	—
4 月末	11, 042	△ 0. 0	22, 467. 87	10. 7	—	—	—
5 月末	11, 043	△ 0. 0	22, 201. 82	9. 4	—	—	—
6 月末	11, 042	△ 0. 0	22, 304. 51	9. 9	—	—	—
7 月末	11, 041	△ 0. 0	22, 553. 72	11. 1	—	—	—
8 月末	11, 040	△ 0. 1	22, 865. 15	12. 6	—	—	—
(償還) 2018年 9 月19日	11, 039. 64	△ 0. 1	23, 672. 52	16. 6	—	—	—

(注) 騰落率は期首比。

設定以来の投資環境について

(2013. 7. 4 ～ 2018. 9. 19)

国内株式市況

国内株式市況は、設定時より、2020年夏季五輪の東京開催が決定したことや米国経済が着実に回復していることなどを好感し、上昇基調で始まりました。2014年10月以降は、日銀の追加金融緩和やGPIF（年金積立金管理運用独立行政法人）の国内株式運用比率引き上げ決定、円安の大幅な進行などを受けて、急速に上昇しました。2015年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が広がったことや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背景に、軟調な推移となりました。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を受けて、底堅く推移しました。2017年10月には、衆議院議員選挙で連立与党が勝利したことなどを好感し、一段高となりました。2018年以降は、米国長期金利が上昇したことや世界的な貿易摩擦への懸念が高まったことなどを受け、上値の重い展開となりました。償還期末にかけては、米国株が上昇したことや円安が進んだことなどを好感し、上昇して償還を迎えました。

国内短期債券市況

国内短期金利は、設定時より、欧米の長期金利低下と良好な国債需給を背景に低下しました。2014年後半から2015年にかけて、日銀による量的・質的金融緩和と追加緩和観測が強まる局面では、国内短期金利は一時的にマイナス圏に低下しました。2016年1月に日銀がマイナス金利政策を導入し、9月には長短金利操作付き量的・質的金融緩和策を導入しました。このような日銀の金融政策を背景に、国内短期金利は恒常的にマイナス圏で推移しました。2017年以降は、主要先進国において金融政策の正常化観測が進む中、日本も緩和的な金融政策の運営方針を転換するのではないかとの思惑が浮上しました。国内短期金利はマイナス幅を縮小させつつも引き続きマイナス圏で推移し、おおむね横ばいの展開で償還を迎えました。

信託期間中の運用方針

■当ファンド

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。安定運用移行後は、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。

■ストックインデックス225・マザーファンド

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。

■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。

信託期間中のポートフォリオについて

(2013. 7. 4 ～ 2018. 9. 19)

■当ファンド

現物株式、日経平均先物および「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券の実質組入比率を100%程度に維持して運用を行ないました。

安定運用移行後は、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。

■ストックインデックス225・マザーファンド

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、実質株式組入比率を100%程度に維持しました。

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。

■ダイワ・マネーアセット・マザーファンド

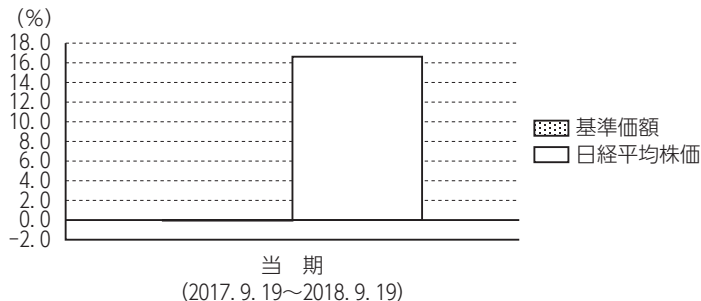
流動性と資産の安全性に配慮し、短期の国債およびコール・ローン等による運用を行ないました。

ベンチマークとの差異について

当期のベンチマーク（日経平均株価）の騰落率は16.6%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。

- ・安定運用に移行した後は、株式市況の上昇および下落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、見送らせていただきました。

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お願い申し上げます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2017. 9. 20～2018. 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11, 043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	1	0. 009	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)	(1)	(0. 008)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	1	0. 009	

(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

(2017年9月20日から2018年9月19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・マネー アセット・ マザーファンド	—	—	3,536,610	3,538,881

(注) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

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。

親投資信託残高

種 類	期 首
	口 数
	千口
ダイワ・マネーアセット・ マザーファンド	3,536,610

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2018年9月19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	225,350	100.0
投資信託財産総額	225,350	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9月19日現在

項 目	償 還 時
(A) 資産	225,350,507円
コール・ローン等	225,350,507
(B) 負債	3,787
未払利息	555
その他未払費用	3,232
(C) 純資産総額 (A - B)	225,346,720
元本	204,125,102
償還差損益金	21,221,618
(D) 受益権総口数	204,125,102口
1万口当り償還価額 (C / D)	11,039円64銭

* 期首における元本額は5,599,634,268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5,395,509,166円です。

* 償還時の計算口数当りの純資産額は11,039円64銭です。

■損益の状況

当期 自 2017年9月20日 至 2018年9月19日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 52,657円
受取利息	893,183
支払利息	△ 945,840
(B) 有価証券売買損益	122,473
売買益	605,331
売買損	△ 482,858
(C) 信託報酬等	△ 203,644
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 133,828
(E) 前期繰越損益金	22,890,436
(F) 追加信託差損益金	△ 1,534,990
(配当等相当額)	(112,982)
(売買損益相当額)	(△ 1,647,972)
(G) 合計 (D + E + F)	21,221,618
償還差損益金 (G)	21,221,618

(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	2013年 7 月 4 日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2018年 9 月19日		資 産 総 額	225, 350, 507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	3, 787円
				純 資 産 総 額	225, 346, 720円
受 益 権 口 数	2, 447, 388, 710口	204, 125, 102口	△2, 243, 263, 608口	受 益 権 口 数	204, 125, 102口
元 本 額	2, 447, 388, 710円	204, 125, 102円	△2, 243, 263, 608円	1 単位当り償還金	11, 039円64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	7, 856, 304, 438	8, 686, 611, 487	11, 057	0	0. 00
第 2 期	6, 151, 128, 172	6, 800, 991, 433	11, 056	0	0. 00
第 3 期	5, 704, 171, 170	6, 304, 967, 129	11, 053	0	0. 00
第 4 期	5, 599, 634, 268	6, 185, 276, 168	11, 046	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, 039円64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。

【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（限定追加型）－シフト11－」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。

ストックインデックス 225・マザーファンド

運用報告書 第17期（決算日 2018年 9 月19日）

（計算期間 2017年 9 月20日～2018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17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

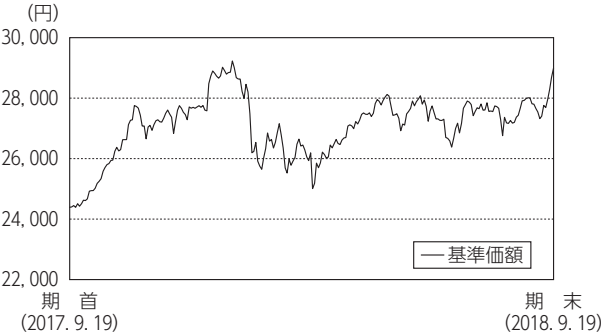
大和投資信託

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		株 式 組 入 比 率	先 物 比 率
	円	騰落率 (%)	円 (ベンチマーク)	騰落率 (%)		
(期首) 2017年 9月19日	24,389	—	20,299.38	—	97.2	1.8
9月末	24,613	0.9	20,356.28	0.3	97.2	2.8
10月末	26,626	9.2	22,011.61	8.4	98.1	1.9
11月末	27,495	12.7	22,724.96	11.9	97.6	2.4
12月末	27,580	13.1	22,764.94	12.1	97.7	2.3
2018年 1月末	27,989	14.8	23,098.29	13.8	98.0	1.9
2月末	26,765	9.7	22,068.24	8.7	97.8	2.2
3月末	26,214	7.5	21,454.30	5.7	98.0	2.1
4月末	27,462	12.6	22,467.87	10.7	98.0	2.0
5月末	27,143	11.3	22,201.82	9.4	97.6	2.5
6月末	27,303	11.9	22,304.51	9.9	98.6	1.4
7月末	27,609	13.2	22,553.72	11.1	98.5	1.5
8月末	28,005	14.8	22,865.15	12.6	98.8	1.2
(期末) 2018年 9月19日	28,999	18.9	23,672.52	16.6	97.9	1.1

(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：24,389円 期末：28,999円 騰落率：18.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（日経平均株価）への連動をめざした運用を行なった結果、ベンチマークの動きを反映して、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、米国の2017年内の利上げ観測が高まり円安米ドル高となったことや、北朝鮮に関わる地政学リスクが後退したこと、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、上昇しました。その後も、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月に米国の長期金利が急上昇したこと、また3月に米国が新たな関税を課す方針を示し貿易摩擦激化への懸念が高まったことにより、株価は下落しました。4月以降は、米国の保護主義的な政策への警戒感が強まる一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったことや、通商問題でも一部で妥協を探る動きなどがあり、株価は横ばい圏で推移しました。9月中旬に米中貿易摩擦への懸念が和らぐと、上昇して期末を迎えました。

◆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、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います。

◆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、日経平均株価に採用されている全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16.6%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は18.9%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。
- ・資金の流入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等が、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、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 (株式) (先物・オプション)	0円 (0) (0)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	1

(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

(2017年 9 月20日から2018年 9 月19日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 9, 299. 6 (△ 7, 336. 8)	千円 30, 367, 771 (—)	千株 8, 566. 9	千円 27, 206, 861

(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

(2017年 9 月20日から2018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 42, 950	百万円 44, 114	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

(2017年 9 月20日から2018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
ファーストリテイリング	48	2, 167, 229	45, 150	ファーストリテイリング	46	1, 900, 611	41, 317
リクルートホールディングス	864	2, 163, 470	2, 504	ソフトバンクグループ	138	1, 327, 666	9, 620
ソフトバンクグループ	144	1, 248, 434	8, 669	ファナック	46	1, 106, 318	24, 050
ファナック	48	1, 219, 059	25, 397	東京エレクトロン	46	857, 742	18, 646
東京エレクトロン	48	941, 421	19, 612	KDD I	276	831, 705	3, 013
KDD I	288	808, 922	2, 808	京セラ	92	653, 865	7, 107
京セラ	96	604, 820	6, 300	ダイキン工業	46	580, 818	12, 626
ダイキン工業	48	601, 392	12, 529	信越化学	46	488, 696	10, 623
テルモ	96	544, 624	5, 673	テルモ	92	478, 152	5, 197
信越化学	48	524, 609	10, 929	日東電工	46	432, 894	9, 410

(注 1) 金額は受渡し代金。

(注 2) 金額の単位未満は切捨て。

ストックインデックス225・マザーファンド

■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
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
水産・農林業 (0.2%)				三菱ケミカル HLDGS	125	126	127,323	フジクラ	250	252	152,208
日本水産	250	252	161,532	宇部興産	250	25.2	71,895	金属製品 (0.4%)			
マルハニチロ	25	25.2	102,438	日本化薬	250	252	331,884	SUMCO	25	25.2	42,184
鉱業 (0.1%)				花王	250	252	2,281,860	東洋製罐グループHD	250	252	584,388
国際石油開発帝石	100	100.8	138,448	富士フイルム HLDGS	250	252	1,287,468	機械 (5.2%)			
建設業 (2.5%)				資生堂	250	252	1,997,856	日本製鋼所	50	50.4	140,666
コムシスホールディングス	250	252	817,740	日東電工	250	252	2,146,032	オークマ	250	50.4	312,480
大成建設	250	50.4	252,504	医薬品 (8.5%)				アマダホールディングス	250	252	294,084
大林組	250	252	274,176	協和発酵キリン	250	252	528,444	小松製作所	250	252	827,064
清水建設	250	252	252,252	武田薬品	250	252	1,180,872	住友重機械	250	50.4	196,560
長谷工コーポレーション	50	50.4	75,297	アステラス製薬	1,250	1,260	2,528,190	日立建機	250	252	888,300
鹿島建設	250	252	202,356	大日本住友製薬	250	252	611,604	クボタ	250	252	465,696
大和ハウス	250	252	831,852	塩野義製薬	250	252	1,818,432	荏原製作所	50	50.4	196,560
積水ハウス	250	252	436,716	中外製薬	250	252	1,758,960	ダイキン工業	250	252	3,932,460
日揮	250	252	605,556	エーザイ	250	252	2,657,340	日本精工	250	252	319,536
千代田化工建	250	252	213,948	第一三共	250	252	1,154,160	N T N	250	252	115,920
食品業 (4.5%)				大塚ホールディングス	250	252	1,364,076	ジェイテクト	250	252	411,012
日清製粉G本社	250	252	583,128	石油・石炭製品 (0.5%)				日立造船	50	50.4	23,234
明治ホールディングス	50	50.4	375,480	昭和シエル石油	250	252	611,604	三菱重工業	250	25.2	104,907
日本ハム	250	126	510,300	JXTG ホールディングス	250	252	210,420	I H I	250	25.2	111,762
サッポロホールディングス	50	50.4	117,784	ゴム製品 (0.9%)				電気機器 (17.6%)			
アサヒグループホールディングス	250	252	1,241,352	横浜ゴム	125	126	300,384	日清紡ホールディングス	250	252	332,136
キリンHD	250	252	732,564	ブリヂストン	250	252	1,069,740	コニカミノルタ	250	252	298,368
宝ホールディングス	250	252	383,544	ガラス・土製品 (1.5%)				ミネベアミツミ	250	252	540,036
キッコーマン	250	252	1,670,760	A G C	50	50.4	238,392	日立	250	252	188,294
味の素	250	252	481,950	日本板硝子	25	25.2	30,567	三菱電機	250	252	384,678
ニチレイ	125	126	363,384	日本電気硝子	75	75.6	261,954	富士電機	250	252	233,352
日本たばこ産業	250	252	753,480	住友大阪セメント	250	252	122,724	安川電機	250	252	882,000
繊維製品 (0.2%)				太平洋セメント	250	25.2	86,688	明電舎	250	—	—
東洋紡	250	25.2	47,527	東海カーボン	250	252	520,128	ジーエス・ユアサ コーポ	250	252	140,364
ユニチカ	250	25.2	17,791	T O T O	125	126	616,770	日本電気	250	25.2	77,112
帝人	50	50.4	111,535	日本碍子	250	252	455,112	富士通	250	252	205,279
東レ	250	252	218,383	鉄鋼 (0.2%)				沖電気	25	25.2	36,288
パルプ・紙 (0.2%)				新日鐵住金	25	25.2	58,224	セイコーエプソン	500	504	984,816
王子ホールディングス	250	252	205,632	神戸製鋼所	25	25.2	24,091	パナソニック	250	252	339,570
日本製紙	25	25.2	51,206	J F Eホールディングス	25	25.2	62,924	ソニー	250	252	1,683,864
北越コーポレーション	250	—	—	日新製鋼	25	25.2	40,622	T D K	250	252	3,071,880
化学 (8.8%)				大平洋金属	250	25.2	94,626	アルプス電気	250	252	784,980
クラレ	250	252	413,784	非鉄金属 (1.1%)				パイオニア	250	252	26,964
旭化成	250	252	425,880	日本軽金属HD	250	252	62,244	横河電機	250	252	591,948
昭和電工	25	25.2	136,080	三井金属	250	25.2	77,616	アドバンテス	500	504	1,212,624
住友化学	250	252	162,540	東邦亜鉛	250	25.2	102,060	カシオ	250	252	468,720
日産化学	250	252	1,512,000	三菱マテリアル	25	25.2	81,774	ファナック	250	252	5,586,840
東ソー	250	126	216,972	住友鉱山	250	126	477,036	京セラ	500	504	3,335,976
トクヤマ	250	50.4	154,980	DOWA ホールディングス	250	50.4	175,392	太陽誘電	250	252	708,372
デンカ	250	50.4	192,024	古河機金	250	25.2	41,202	SCREEN ホールディングス	50	50.4	368,424
信越化学	250	252	2,477,916	古河電工	25	25.2	94,248	キヤノン	375	378	1,343,034
三井化学	250	50.4	143,035	住友電工	250	252	453,348	リコー	250	252	300,132

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
東京エレクトロン	250	252	4,125,240	千円	トレンドマイクロ	250	252	1,794,240	千円	不動産業 (1.6%)				
輸送用機器 (5.8%)					スカパー JSATHD	25	25.2	13,910		東急不動産HD	250	252	198,576	
デンソー	250	252	1,438,164		日本電信電話	50	50.4	259,761		三井不動産	250	252	664,398	
三井 E&SHD	250	25.2	51,030		KDDI	1,500	1,512	4,672,080		三菱地所	250	252	486,360	
川崎重工業	250	25.2	79,758		NTTドコモ	25	25.2	76,834		東京建物	125	126	171,486	
日産自動車	250	252	273,798		東宝	25	25.2	89,334		住友不動産	250	252	1,005,732	
いすゞ自動車	125	126	220,752		NTTデータ	1,250	1,260	1,964,340		サービス業 (4.5%)				
トヨタ自動車	250	252	1,768,788		コナミホールディングス	250	252	1,078,560		ディー・エヌ・エー	75	75.6	145,076	
日野自動車	250	252	311,472		ソフトバンクグループ	750	756	8,251,740		電通	250	252	1,307,880	
三菱自動車工業	25	25.2	19,807		卸売業 (2.3%)					楽天	250	252	211,831	
マツダ	50	50.4	66,654		双日	25	25.2	10,155		リクルートホールディングス	—	756	2,770,740	
本田技研	500	504	1,705,032		伊藤忠	250	252	527,310		日本郵政	—	252	338,436	
スズキ	250	252	1,789,452		丸紅	250	252	251,344		東京ドーム	125	126	126,882	
SUBARU	250	252	823,788		豊田通商	250	252	1,030,680		セコム	250	252	2,341,836	
ヤマハ発動機	250	252	737,604		三井物産	250	252	495,306						
精密機器 (3.2%)					住友商事	250	252	472,878		株数・金額	50,187.5	43,583.4	160,769,568	
テルモ	500	504	3,291,120		三菱商事	250	252	875,196		銘柄数<比率>	225銘柄	225銘柄	<97.9%>	
ニコン	250	252	539,784		小売業 (12.7%)									
オリンパス	250	252	1,127,700		J. フロントリテイリング	125	126	208,404		(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。				
シチズン時計	250	252	187,236		三越伊勢丹HD	250	252	340,452		(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。				
その他製品 (1.3%)					セブン & アイ・HLDGS	250	252	1,285,200		(注3) 評価額の単位未満は切捨て。				
凸版印刷	250	252	229,572		ユニ・ファミリーマートHD	250	252	2,787,120		(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)				
大日本印刷	250	126	334,530		高島屋	250	126	234,360						
ヤマハ	250	252	1,469,160		丸井グループ	250	252	677,880						
電気・ガス業 (0.2%)					イオン	250	252	671,202						
東京電力HD	25	25.2	13,482		ファーストリテイリング	250	252	14,169,960						
中部電力	25	25.2	43,054		銀行業 (0.8%)									
関西電力	25	25.2	41,139		コンソルティア・フィナンシャル	250	252	137,844						
東京瓦斯	250	50.4	139,658		新生銀行	250	25.2	44,528						
大阪瓦斯	250	50.4	109,922		あおぞら銀行	250	25.2	101,052						
陸運業 (2.3%)					三菱UFJフィナンシャルG	250	252	177,080						
東武鉄道	250	50.4	171,612		リそなホールディングス	25	25.2	15,732						
東京急行	125	126	258,930		三井住友トラストHD	25	25.2	115,340						
小田急電鉄	125	126	340,956		三井住友フィナンシャルG	25	25.2	114,357						
京王電鉄	250	50.4	315,000		千葉銀行	250	252	186,732						
京成電鉄	125	126	495,180		ふくおかフィナンシャルG	250	252	158,760						
東日本旅客鉄道	25	25.2	268,884		静岡銀行	250	252	243,936						
西日本旅客鉄道	25	25.2	196,887		みずほフィナンシャルG	250	252	49,971						
東海旅客鉄道	25	25.2	586,404		証券・商品先物取引業 (0.4%)									
日本通運	250	25.2	187,236		大和証券G本社	250	252	174,384						
ヤマトホールディングス	250	252	849,996		野村ホールディングス	250	252	136,508						
海運業 (0.1%)					松井証券	250	252	301,392						
日本郵船	250	25.2	53,298		保険業 (1.0%)									
商船三井	250	25.2	79,632		SOMPOホールディングス	62.5	63	298,998						
川崎汽船	250	25.2	56,624		MS & AD	75	75.6	276,620						
空運業 (0.1%)					SONY FH	50	50.4	120,859						
ANAホールディングス	250	25.2	99,414		第一生命HLDGS	25	25.2	57,997						
倉庫・運輸関連業 (0.2%)					東京海上HD	125	126	686,322						
三菱倉庫	250	126	353,682		T&Dホールディングス	50	50.4	90,064						
情報・通信業 (11.3%)					その他金融業 (0.3%)									
ヤフー	100	100.8	41,126		クレディセゾン	250	252	453,852						

ストックインデックス 225・マザーファンド

■投資信託財産の構成

2018年 9月19日現在		
項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	160,769,568	96.6
コール・ローン等、その他	5,681,961	3.4
投資信託財産総額	166,451,530	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 9月19日現在		
項 目	当 期 末	
(A) 資産	167,241,390,410円	
コール・ローン等	1,698,693,137	
株式（評価額）	160,769,568,960	
未収入金	3,877,834,313	
未収配当金	105,434,000	
差入委託証拠金	789,860,000	
(B) 負債	2,956,147,788	
未払解約金	2,089,819,500	
差入委託証拠金代用有価証券	866,300,000	
その他未払費用	28,288	
(C) 純資産総額（A－B）	164,285,242,622	
元本	56,651,695,845	
次期繰越損益金	107,633,546,777	
(D) 受益権総口数	56,651,695,845口	
1万口当り基準価額（C／D）	28,999円	

＊期首における元本額は56,891,999,288円、当期中における追加設定元本額は14,141,470,208円、同解約元本額は14,381,773,651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 27,895,175,418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 A729,679,107円、大和 ストック インデックス 225 ファンド9,955,023,672円、D－I's 日経 225 インデックス 124,378,246円、iFree 日経 225 インデックス833,850,889円、DＣ・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）5,332,826,806円、ダイワ・ノーロード 日経 225 ファンド251,076,604円、ダイワファンドラップ 日経 225 インデックス2,399,270,132円、ダイワ日経 225 インデックス（ダイワ S M A 専用）9,740,271円、ダイワ・インデックスセレクト 日経 225 9,120,674,700円です。

＊当期末の計算口数当りの純資産額は28,999円です。

■損益の状況

当期 自 2017年 9月20日 至 2018年 9月19日		
項 目	当 期	
(A) 配当等収益	2,657,009,415円	
受取配当金	2,657,812,812	
受取利息	1,123	
その他収益金	398,728	
支払利息	△ 1,203,248	
(B) 有価証券売買損益	22,714,236,311	
売買益	28,423,577,616	
売買損	△ 5,709,341,305	
(C) 先物取引等損益	547,105,405	
取引益	902,243,165	
取引損	△ 355,137,760	
(D) その他費用	△ 817,994	
(E) 当期損益金（A＋B＋C＋D）	25,917,533,137	
(F) 前期繰越損益金	81,864,245,513	
(G) 解約差損益金	△ 23,893,274,665	
(H) 追加信託差損益金	23,745,042,792	
(I) 合計（E＋F＋G＋H）	107,633,546,777	
次期繰越損益金（I）	107,633,546,777	

(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6期（決算日 2017年12月11日）

（計算期間 2016年12月10日～2017年12月11日）

ダイワ・マネーアセット・マザーファンドの第6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

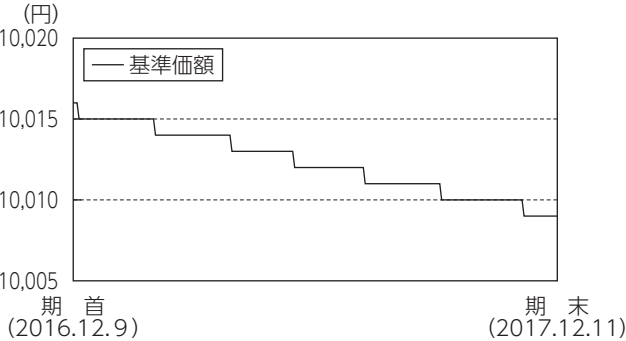
大和投資信託

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 率
	騰 落 率	組 入 比 率	
(期首)2016年12月 9 日	円 10,016	% -	% 28.2
12月末	10,015	△0.0	-
2017年 1 月末	10,015	△0.0	31.1
2 月末	10,014	△0.0	25.3
3 月末	10,014	△0.0	-
4 月末	10,013	△0.0	35.3
5 月末	10,012	△0.0	5.1
6 月末	10,012	△0.0	0.6
7 月末	10,011	△0.0	0.1
8 月末	10,011	△0.0	-
9 月末	10,010	△0.1	-
10月末	10,010	△0.1	-
11月末	10,009	△0.1	-
(期末)2017年12月11日	10,009	△0.1	-

(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なっており、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：10,016円 期末：10,009円 騰落率：△0.1%

【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「長短金利操作付き量的・質的金融緩和」を維持しました。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」

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

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は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

公 社 債

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

		買 付 額	売 付 額
国 内	国債証券	千円 33,310,870	千円 - (36,270,000)

(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

(2016年12月10日から2017年12月11日まで)

当		期	
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		
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		
660 国庫短期証券 2017/5/1	1,450,027		
638 国庫短期証券 2017/1/16	1,270,010		

(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

当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

2017年12月11日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
コール・ローン等、その他	17,415,714	100.0
投資信託財産総額	17,415,714	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12月11日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	17,415,714,754円
コール・ローン等	17,415,714,754
(B) 負債	－
(C) 純資産総額(A－B)	17,415,714,754
元本	17,399,953,390
次期繰越損益金	15,761,364
(D) 受益権総口数	17,399,953,390口
1万口当り基準価額(C／D)	10,009円

* 期首における元本額は10,476,400,958円、当期中における追加設定元本額は9,625,428,641円、同解約元本額は2,701,876,209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DBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジあり) 6,592,748円、ダイワDBモメンタム戦略ファンド(為替ヘッジなし) 10,288,683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・レアル債α(毎月分配型) ユースーパー・ハインカムーα50コース49,911円、ダイワ・ブラジル・レアル債α(毎月分配型) ユースーパー・ハインカムー 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32,460,107円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 3－858,588,190円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 6－3,325,620,751円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 7－828,595,357円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト11 Ver 4－3,326,673,327円、ダイワ日本株式インデックス・ファンドーシフト12 Ver 2－549,443,563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、ダイワ円債セレクト マネーコース808,108,471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／NB・米国債券戦略ファンド 為替ヘッジあり(毎月分配型) 1,235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) 1,598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) 1,544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) 1,984円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型)ーシフト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)ーシフト12－679,321,043円、ダイワ日本株式インデックス・ファンド(限定追加型)ーシフト13－1,287,713,056円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,009円です。

■損益の状況

当期 自2016年12月10日 至2017年12月11日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 8,299,426円
受取利息	△ 922,829
支払利息	△ 7,376,597
(B) 有価証券売買損益	△ 2,491
売買損	△ 2,491
(C) その他費用	△ 174,287
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 8,476,204
(E) 前期繰越損益金	16,325,703
(F) 解約差損益金	△ 3,147,995
(G) 追加信託差損益金	11,059,860
(H) 合計(D + E + F + G)	15,761,364
次期繰越損益金(H)	15,761,364

(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。