

ダイワ・インデックスセレクト J P X日経400

運用報告書（全体版） 第6期

（決算日 2019年3月22日）

（作成対象期間 2018年3月23日～2019年3月22日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、東京証券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おります。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型	
信託期間	約14年2カ月間（2014年1月31日～2028年3月22日）	
運用方針	投資成果をJ P X日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワJ P X日経400マザーファンドの受益証券
	ダイワJ P X日経400マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
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
	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。	

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）

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

<5605>

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			JPX日経インデックス400		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
2期末(2015年3月23日)	13,257	0	39.3	13,077	37.4	98.0	1.9	1,912
3期末(2016年3月22日)	11,497	0	△13.3	11,177	△14.5	98.9	1.3	3,155
4期末(2017年3月22日)	12,947	0	12.6	12,364	10.6	99.3	1.1	3,957
5期末(2018年3月22日)	14,703	0	13.6	13,806	11.7	97.2	2.0	4,428
6期末(2019年3月22日)	14,096	0	△ 4.1	13,003	△ 5.8	99.1	1.0	4,260

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

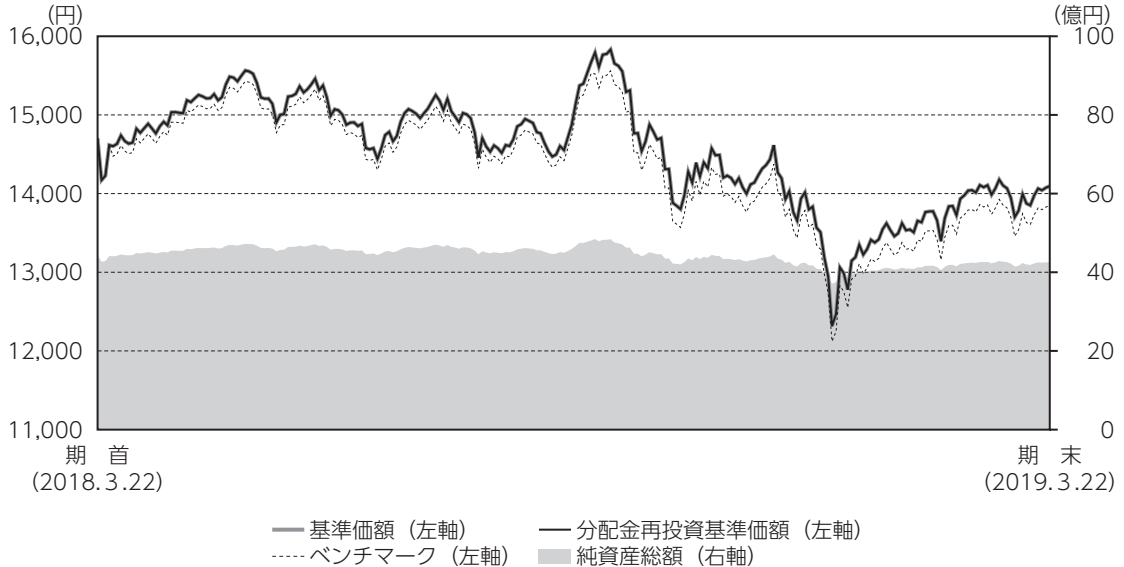
(注4) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(注5) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) ベンチマークは、期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- *分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- *分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- *ベンチマークはJ P X日経インデックス400です。

■基準価額・騰落率

期首：14,703円

期末：14,096円（分配金0円）

騰落率：△4.1%（分配金込み）

■基準価額の主な変動要因

ベンチマーク（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いました。

米中貿易摩擦への懸念などを嫌気してわが国の株式市場が下落したことにより、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・インデックスセレクト J P X日経400

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2018年 3月22日	円 14,703	% -	13,806	% -	% 97.2	% 2.0
3月末	14,740	0.3	13,721	△ 0.6	97.4	2.5
4月末	15,255	3.8	14,202	2.9	98.2	1.7
5月末	15,002	2.0	13,964	1.1	97.9	2.0
6月末	14,886	1.2	13,840	0.3	97.7	2.2
7月末	15,063	2.4	14,010	1.5	97.6	2.4
8月末	14,898	1.3	13,858	0.4	99.5	0.4
9月末	15,765	7.2	14,549	5.4	98.3	1.7
10月末	14,277	△ 2.9	13,182	△ 4.5	97.0	2.5
11月末	14,434	△ 1.8	13,329	△ 3.5	96.9	2.8
12月末	12,990	△11.7	11,979	△13.2	96.7	3.1
2019年 1月末	13,655	△ 7.1	12,593	△ 8.8	98.3	1.7
2月末	13,986	△ 4.9	12,899	△ 6.6	98.9	1.4
(期末) 2019年 3月22日	14,096	△ 4.1	13,003	△ 5.8	99.1	1.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2018.3.23~2019.3.22)

国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、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、下落しました。2018年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、また通商問題でも一部で妥協点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月半ばからは、米中貿易摩擦でいったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、株価は上昇しました。10月には、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月は株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中貿易摩擦の緩和に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中貿易摩擦の緩和期待が再び高まり、株価は反発しました。

前作成期末における「今後の運用方針」**当ファンド**

ダイワJ P X日経400マザーファンドを通じ、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ダイワJ P X日経400マザーファンド

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ってまいります。

ポートフォリオについて

(2018.3.23~2019.3.22)

当ファンド

ダイワJ P X日経400マザーファンドを通じて運用を行いました。

ダイワJ P X日経400マザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

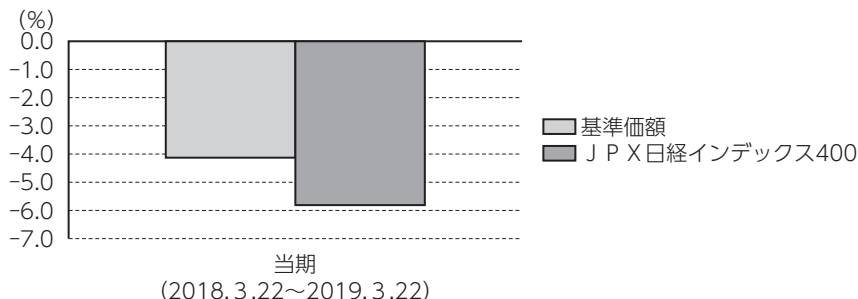
ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は△5.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△4.1%となりました。

当ファンドで組み入れを行っているマザーファンドで保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、ベンチマークとかい離しました。

その他、先物取引の影響、信託報酬等のコストがかい離の要因として挙げられます。

以下のグラフは当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、経費控除後の配当等収益が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

■分配原資の内訳（1万口当り）

項目	当 期	
	2018年3月23日 ～2019年3月22日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（%）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	4,095

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売買等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金（税込み）に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。



今後の運用方針

■当ファンド

ダイワ J P X日経400マザーファンドを通じ、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

■ダイワ J P X日経400マザーファンド

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2018.3.23~2019.3.22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	63円	0.432%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は14,527円です。
(投 信 会 社)	(31)	(0.211)	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、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(27)	(0.189)	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)	(5)	(0.032)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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
(株 式)	(0)	(0.001)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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	2	0.014	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.005)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
(そ の 他)	(1)	(0.009)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	65	0.448	

(注1) 当作成期中の費用(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) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

■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

(2018年3月23日から2019年3月22日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワJ P X日経400マザーファンド	244,595	343,337	247,193	350,786

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2018年3月23日から2019年3月22日まで)

項 目	当 期
	ダイワJ P X日経400マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	8,597,054千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	19,482,227千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.44

(注1) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2018年3月23日から2019年3月22日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等			売付額等		
区 分	A	うち利害関係人との取引状況B	B/A	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	%
株式	5,061	376	7.4	3,535	281	8.0
株式先物取引	2,744	-	-	2,923	-	-
コール・ローン	547,061	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合22.3%

※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) 利害関係人の発行する有価証券等

(2018年3月23日から2019年3月22日まで)

種 類	当 期		
	ダイワJ P X日経400マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	9	11	49

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となつて発行される有価証券

(2018年3月23日から2019年3月22日まで)

種 類	当 期
	ダイワJ P X日経400マザーファンド
	買 付 額
株式	百万円 3

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(5) 当作成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

当作成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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券、大和証券グループ本社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワJ P X日経400マザーファンド	3,120,482	3,117,883	4,260,276

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年3月22日現在

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワJ P X日経400マザーファンド	4,260,276	99.6
コール・ローン等、その他	15,924	0.4
投資信託財産総額	4,276,201	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

2019年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,276,201,547円
コール・ローン等	14,380,450
ダイワJPX日経400マザーファンド(評価額)	4,260,276,573
未収入金	1,544,524
(B) 負債	15,818,672
未払解約金	6,754,215
未払信託報酬	8,950,548
その他未払費用	113,909
(C) 純資産総額(A - B)	4,260,382,875
元本	3,022,487,866
次期繰越損益金	1,237,895,009
(D) 受益権総口数	3,022,487,866口
1万口当り基準価額(C / D)	14,096円

* 期首における元本額は3,011,803,742円、当作成期間中における追加設定元本額は487,291,380円、同解約元本額は476,607,256円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は14,096円です。

■損益の状況

当期 自2018年3月23日 至2019年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,235円
受取利息	238
支払利息	△ 3,473
(B) 有価証券売買損益	△ 150,244,877
売買益	30,522,049
売買損	△ 180,766,926
(C) 信託報酬等	△ 19,321,631
(D) 当期損益金(A + B + C)	△ 169,569,743
(E) 前期繰越損益金	578,258,718
(F) 追加信託差損益金	829,206,034
(配当等相当額)	(583,755,684)
(売買損益相当額)	(245,450,350)
(G) 合計(D + E + F)	1,237,895,009
次期繰越損益金(G)	1,237,895,009
追加信託差損益金	829,206,034
(配当等相当額)	(583,755,684)
(売買損益相当額)	(245,450,350)
分配準備積立金	578,262,610
繰越損益金	△ 169,573,635

(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下記「収益分配金の計算過程(総額)」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	659,639,526
(d) 分配準備積立金	578,262,610
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	1,237,902,136
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	1,237,902,136
(h) 受益権総口数	3,022,487,866口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

【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。

ダイワ J P X日経400マザーファンド

運用報告書 第6期 (決算日 2019年3月22日)

(作成対象期間 2018年3月23日～2019年3月22日)

ダイワ J P X日経400マザーファンドの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。

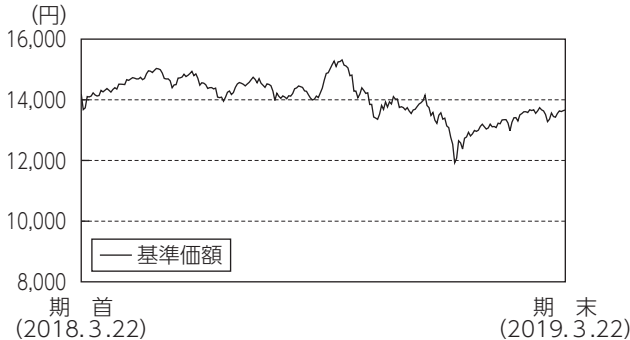
運用方針	投資成果を J P X日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式 (上場予定を含みます。)
株式組入制限	無制限

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

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



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 先 比 率	式 物 率 率
	円	%	騰 落 率	%			
(期首)2018年 3月22日	14,191	-	12,980	-	97.2	2.0	
3月末	14,228	0.3	12,900	△ 0.6	97.4	2.5	
4月末	14,730	3.8	13,353	2.9	98.2	1.7	
5月末	14,491	2.1	13,129	1.1	97.9	2.0	
6月末	14,384	1.4	13,013	0.3	97.7	2.2	
7月末	14,561	2.6	13,172	1.5	97.6	2.4	
8月末	14,407	1.5	13,030	0.4	99.5	0.4	
9月末	15,250	7.5	13,679	5.4	98.3	1.7	
10月末	13,816	△ 2.6	12,394	△ 4.5	97.0	2.5	
11月末	13,973	△ 1.5	12,532	△ 3.5	96.9	2.8	
12月末	12,580	△11.4	11,263	△13.2	96.7	3.1	
2019年 1月末	13,229	△ 6.8	11,840	△ 8.8	98.3	1.7	
2月末	13,554	△ 4.5	12,127	△ 6.6	98.9	1.4	
(期末)2019年 3月22日	13,664	△ 3.7	12,226	△ 5.8	99.1	1.0	

- (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) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注4) 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：14,191円 期末：13,664円 騰落率：△3.7%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマーク（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いました。

米中貿易摩擦への懸念などを嫌気してわが国の株式市場が下落したことにより、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、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、下落しました。2018年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、また通商問題でも一部で妥協点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月半ばからは、米中貿易摩擦でいったん悪材料は出尽くしたとの見方が広がったことや為替市場で円安が進行したことなどが評価され、株価は上昇しました。10月は米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。11月は株価急落からの自律反発や米中首脳会談において米中貿易摩擦の緩和に何らかの進展が見られるとの期待により株価が上昇したものの、12月に入ると中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長が発言などが嫌気され下落しました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中貿易摩擦の緩和期待が再び高まり、株価は反発しました。

◆前作成期末における「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△5.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△3.7%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・オプション)	(0)
有価証券取引税	-
その他費用 (その他)	1 (1)
合 計	1

- (注1) 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) 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

(2018年3月23日から2019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	2,242.7 (△300.915)	5,061,715 (-)	1,535.185	3,535,339

(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

(2018年3月23日から2019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	2,744	2,923	-	-

(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

(2018年3月23日から2019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
任天堂		7.4	292,015	39,461	ソニー		15.8	99,758	6,313
リクルートホールディングス		86.1	288,583	3,351	トヨタ自動車		14.2	98,344	6,925
武田薬品		62.3	281,185	4,513	ソフトバンクグループ		6.3	60,903	9,667
J X T Gホールディングス		198.1	156,603	790	キーエンス		0.9	56,766	63,074
三菱UFJフィナンシャルG		203.8	136,546	670	本田技研		15.1	49,742	3,294
ソフトバンクグループ		12.2	115,561	9,472	三井住友フィナンシャルG		10.4	46,715	4,491
日本電信電話		21.4	104,663	4,890	アステラス製薬		24.5	44,455	1,814
三井住友フィナンシャルG		18.5	80,171	4,333	日本電信電話		8.2	41,392	5,047
電通		13.8	71,656	5,192	日本たばこ産業		12.9	39,218	3,040
ソニー		10.1	57,716	5,714	リコー		33.4	38,591	1,155

(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	期末	銘柄	期首	当期	期末	銘柄	期首	当期	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 (0.1%)				旭化成	69.1	76.6	91,307	石油・石炭製品 (0.7%)			
日本水産	13.3	14.9	11,994	昭和電工	-	7.2	27,576	出光興産	-	8.5	35,657
マルハニチロ	-	2.2	8,910	住友化学	82	84.8	45,792	JXTGホールディングス	-	184.9	102,619
鉱業 (0.3%)				日産化学	6.5	6.6	33,792	コスモエネルギーHDGS	-	3.2	8,640
国際石油開発帝石	57.7	59.9	64,452	東ソー	16	16.6	29,116	ゴム製品 (0.9%)			
建設業 (3.0%)				デンカ	4.1	4.2	13,524	横浜ゴム	6.1	6.4	13,241
安藤・間	9.2	9.5	7,400	信越化学	18.5	19	175,921	TOYO TIRE	6.3	-	-
東急建設	4.6	4.4	3,828	エア・ウォーター	9.1	8.8	14,502	ブリヂストン	35	33.8	145,880
コムシスホールディングス	4.2	4.8	14,184	大陽日酸	8.5	8.9	14,774	住友ゴム	10.4	9.9	13,513
大成建設	11.8	12.3	64,575	日本パーカライジング	5.7	5.9	8,501	ガラス・土石製品 (0.8%)			
大林組	35.6	36.9	41,586	三菱瓦斯化学	9.1	11.1	18,414	AGC	10.8	10.9	43,000
清水建設	36.3	37.7	37,021	三井化学	10.1	9.8	27,342	住友大阪セメント	21	-	-
長谷工コーポレーション	13.8	15.4	22,360	J S R	11.1	10.8	19,062	太平洋セメント	6.7	6.9	25,944
鹿島建設	52	28.9	48,176	三菱ケミカルHDGS	74.3	72	59,407	TOTO	8.1	8.5	38,760
西松建設	-	2.7	6,947	ダイセル	15	16.7	19,923	日本碍子	12.9	13.4	22,820
三井住友建設	8.6	8.9	6,897	積水化学	23	23.5	42,441	日本特殊陶業	9.1	9.3	20,171
前田建設	8.5	8.8	10,199	日本セオン	9.3	9.7	10,999	ニチアス	-	3	6,522
戸田建設	14	14.3	10,224	アイカ工業	3.1	3.2	11,696	鉄鋼 (0.9%)			
熊谷組	1.9	1.8	6,264	宇部興産	5.6	5.4	12,787	新日鐵住金	46.8	48.7	97,473
大東建託	4.3	4.4	69,190	日立化成	5.5	5	12,525	JFEホールディングス	28.3	29.4	57,432
NIPPO	2.7	3.3	6,933	ダイキョーニシカワ	2.2	2.3	2,546	東京製鐵	5.6	5.8	5,440
前田道路	4	3.9	8,416	日本化薬	7.2	-	-	日立金属	11.3	11.7	15,619
五洋建設	14.1	14.6	7,708	日油	4.3	4.2	16,023	非鉄金属 (0.8%)			
住友林業	7.6	8.7	13,076	花王	26	26.7	232,076	日本軽金属HD	30.6	29.6	7,429
大和ハウス	35	34.1	120,100	日本ペイントHOLD	8.6	8.9	38,937	三菱マテリアル	6.9	7.2	21,470
積水ハウス	38.6	37.7	68,991	関西ペイント	11.6	12.1	26,015	住友鉱山	13.4	14.9	49,736
協和エクスシオ	4.3	4.6	13,662	D I C	4.4	4.9	16,390	DOWAホールディングス	2.6	2.5	9,262
九電工	2.3	2.4	8,424	資生堂	19.7	21.8	174,443	古河電工	-	3.1	9,024
食料品 (4.2%)				ライオン	14.7	15.3	36,062	住友電工	39.1	40.7	61,945
森永製菓	-	2.8	13,874	コーセー	1.8	1.9	37,183	金属製品 (0.3%)			
江崎グリコ	3	3.3	19,173	シーズ・ホールディングス	1.4	0.3	1,764	SUMCO	-	12	15,444
カルビー	4.8	5	15,050	ポーラ・オルビスHD	-	4.7	16,732	三和ホールディングス	10	11.2	14,504
ヤクルト	6.4	8.2	63,304	小林製菓	3	3.1	28,613	リンナイ	1.9	1.9	14,801
明治ホールディングス	7	7.8	69,810	日東電工	8	8.3	49,260	東プレ	-	2	4,326
日本ハム	9	4.8	19,272	ニフコ	1.9	4.4	12,452	日本発条	10.4	10.8	10,692
アサヒグループホールディングス	22.3	23.1	112,058	ユニ・チャーム	22.4	23.3	85,068	機械 (4.9%)			
キリンHD	51.1	49.9	130,962	医薬品 (6.8%)				アマダホールディングス	16.2	16.8	18,580
サントリー食品インター	8.1	7.4	37,370	協和発酵キリン	13.3	13.8	32,029	オーエスジー	4.8	5.4	11,194
キッコーマン	8.3	7.3	39,785	武田薬品	39	96	453,024	DMG森精機	5.8	6.9	9,742
味の素	24.4	24.4	43,358	アステラス製薬	108.8	101.4	171,873	ディスコ	1.4	1.5	23,100
キユーピー	5.9	6.1	16,183	大日本住友製薬	7.8	8.1	22,380	ニューフレアテクノロジー	0.2	-	-
ニチレイ	5.1	5.7	15,355	塩野義製薬	15.1	14.4	96,249	ナプテスコ	5.8	6	19,380
東洋水産	5.8	5.7	23,455	田辺三菱製薬	12.9	11.5	17,698	三井海洋開発	-	1.2	4,098
日清食品HD	4.6	4.7	35,673	中外製薬	11	11.5	86,365	SMC	3.3	3.2	131,072
日本たばこ産業	65.7	63.7	175,334	科研製薬	1.9	2	10,560	小松製作所	51.1	49.8	132,717
繊維製品 (0.4%)				エーザイ	12.7	13.2	99,858	住友重機械	6.1	6.3	23,121
帝人	9.1	8.8	16,711	小野薬品	25	26	57,577	日立建機	4.9	4.4	13,332
東レ	80.4	83.5	61,856	久光製薬	3.1	3.2	15,920	ホームック・ドライブ・シス	1.6	2	7,950
パルプ・紙 (0.2%)				参天製薬	20	20.8	33,779	クボタ	56.8	58.9	94,799
王子ホールディングス	47	48.5	34,580	ツムラ	3.8	3.4	11,271	荏原製作所	4.3	4.9	14,994
大王製紙	4.4	-	-	沢井製薬	2.1	2.3	14,904	ダイキン工業	14.4	15	190,500
化学 (7.5%)				第一三共	30.3	31.5	137,560	椿本チエイン	6	1.4	5,670
クラレ	18.7	18.2	26,335	大塚ホールディングス	22	20.9	92,900	ダイフク	5.4	6.1	35,868

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
		千株	千株			千円			千株	千株		千円			千株	千株		千円		
タダノ	5.1	5.3	5,506				豊田自動織機	8.6	8.9	51,442			京阪ホールディングス	6	6.2	27,993				
平和	3.3	3.1	6,919				デンソー	23.5	24.2	109,384			名古屋鉄道	10.5	11.1	33,744				
竹内製作所	1.8	1.8	3,529				川崎重工業	8.2	8.6	23,572			日本通運	3.9	4.1	25,502				
T P R	1.2	1.5	3,343				日産自動車	124.8	129.7	124,161			ヤマトホールディングス	17.6	18.3	53,417				
ホシザキ	3.3	3.2	21,984				いすゞ自動車	30.7	34.8	52,200			山九	2.6	2.9	15,660				
日本精工	21.7	22.6	23,481				トヨタ自動車	47.5	40.5	273,496			日立物流	2.2	2.3	7,670				
ジェイテクト	11.3	10.5	14,805				日野自動車	15.1	13.7	13,206			空運業 (0.8%)							
THK	6.6	6.9	19,720				日信工業	2.2	-	-			日本航空	18.6	19.1	74,241				
イーグル工業	1.3	-	-				NOK	5.7	5.9	10,484			ANAホールディングス	19.6	19	76,361				
マキタ	13.8	13.4	49,312				アイシン精機	8.7	9.1	37,856			情報・通信業 (8.0%)							
三菱重工業	17.7	18.4	85,909				マツダ	33.2	34.5	43,625			新日鉄住金SOLO	1.6	1.6	4,758				
電気機器 (14.2%)							本田技研	91.3	91.3	278,830			T I S	-	3.6	18,324				
コニカミノルタ	24.8	24	26,376				スズキ	21	20.1	102,108			ネクソン	11.6	27.5	46,777				
ブラザー工業	12.9	14.3	29,243				S U B A R U	32.9	34.1	93,297			コロプラ	3.4	3.1	2,145				
ミネベアミツミ	19.7	20.4	34,108				ヤマハ発動機	14.9	15.5	33,774			ティーガイア	1	1.1	2,094				
日立	254	49.5	179,833				豊田合成	3.8	3.6	8,654			カホー・オンライン・エンター	28.2	26	10,400				
三菱電機	105.9	109.9	159,574				シマノ	4.3	4.4	76,120			野村総合研究所	6.6	6.9	34,258				
富士電機	32	7.1	23,856				ティ・エス テック	2.5	2.6	8,580			オービック	3.3	3.7	40,959				
安川電機	12.3	12.7	45,085				精密機器 (2.2%)						ヤフー	74.9	70.3	19,262				
日本電産	12.7	13.2	180,444				テルモ	16.2	15.6	108,576			トレンドマイクロ	5.1	5.7	29,298				
オムロン	11.3	11.7	61,074				島津製作所	12.6	14.1	43,780			日本オラクル	1.7	2.2	18,722				
日本電気	13.7	14.2	54,670				オリンパス	15.8	16.4	81,590			伊藤忠テクノソリューション	2.4	4.9	12,593				
富士通	109	10.6	83,231				HOYA	21.6	22.1	163,319			大塚商会	3.1	5.8	22,881				
ルネサスエレクトロニクス	5.5	11.4	6,156				朝日インテック	5.1	6.2	32,054			日本ユニシス	-	3.4	9,652				
セイコーエプソン	15.8	13.6	23,024				セイコーHD	1.6	-	-			日本テレビHDLS	9.5	9.9	17,018				
アルバック	2.4	2.2	7,040				その他製品 (1.8%)						日本電信電話	46.8	60	288,840				
エレコム	0.9	1	3,360				バンダイナムコHDLS	10.9	11.4	58,824			KDDI	86.2	95.1	235,610				
パナソニック	120.9	125.6	120,337				パイロットコーポレーション	1.8	1.9	8,407			光通信	1.3	1.3	27,274				
富士通ゼネラル	3.2	3.4	5,089				アシックス	10.5	10.9	15,554			N T T ドコモ	76.9	77.5	191,153				
ソニー	61.8	56.1	264,174				ヤマハ	7.1	6.5	35,555			GMOインターネット	3.8	3.9	7,164				
TDK	5.5	5.8	51,272				ビジョン	6.4	6.6	30,558			東宝	6.8	7.1	30,423				
アルプスアルパイン	9.1	10.1	23,331				任天堂	-	6.8	208,760			N T T データ	32.3	28.7	34,755				
クラリオン	6	-	-				電気・ガス業 (1.9%)						スクウェア・エニックス・HD	4.8	5	19,850				
ヒロセ電機	1.7	1.6	18,656				中部電力	32.4	33.6	59,791			カプコン	-	4.6	11,444				
日本航空電子	3	-	-				関西電力	43.2	44.9	77,003			S C S K	2.4	2.8	13,790				
横河電機	10.6	11	24,387				東北電力	24.8	25.7	37,650			コナミホールディングス	4.2	4.4	21,582				
日本光電工業	4.4	4.8	16,968				九州電力	-	22.7	30,054			ソフトバンクグループ	30.8	36.7	413,609				
堀場製作所	2.1	2.2	13,640				電源開発	8.4	8.7	24,116			卸売業 (5.1%)							
アドバンテスト	5.9	7.5	19,335				東京瓦斯	22.6	21.6	66,765			双日	61.7	59.8	24,219				
キーエンス	5.2	5.1	356,745				大阪瓦斯	20.5	21.3	49,160			アルファホールディングス	11.6	12	38,040				
シスメックス	8.2	8.6	60,131				東邦瓦斯	5.2	5.4	27,054			神戸物産	0.7	1.6	6,400				
OBARA GROUP	0.6	0.6	2,232				陸運業 (5.4%)					シップヘルスケアHD	2.2	2.3	10,396					
スタンレー電気	8.1	7.8	23,345				東武鉄道	11.3	11.6	37,584			第一興商	2.1	2.1	11,802				
カシオ	8.5	9.7	14,113				相鉄ホールディングス	4.5	5	16,925			メディカルHD	10.4	11.7	30,712				
ファナック	10.1	10.4	203,320				東京急行	28.8	29.9	57,916			伊藤忠	76.5	75.7	156,206				
浜松ホトニクス	7.7	7.9	33,456				小田急電鉄	15.7	17.6	46,833			丸紅	85.7	106.8	86,070				
京セラ	17.4	16.8	108,528				京王電鉄	5.9	6.1	43,127			豊田通商	11.6	12.1	45,435				
村田製作所	11.1	11.5	190,152				京成電鉄	7.4	8.2	32,677			兼松	4.4	4.3	5,843				
小糸製作所	6.3	6.6	41,184				東日本旅客鉄道	19	19.5	210,307			三井物産	88.6	89.2	161,184				
ミツバ	1.9	-	-				西日本旅客鉄道	9.6	9.9	82,962			日立ハイテクノロジーズ	3.6	3.3	15,543				
SCREENホールディングス	2	1.9	8,977				東海旅客鉄道	9.5	9.8	247,107			住友商事	65.8	64	103,456				
キャノン	57	59.2	189,736				西武ホールディングス	13.5	14	26,264			三菱商事	73.2	76	247,380				
リコー	31.8	-	-				西日本鉄道	3.9	-	-			阪和興業	1.9	1.9	6,365				
東京エレクトロン	7.1	7.3	120,559				近鉄グループHDLS	10	10.4	53,768			岩谷産業	2.3	2.4	8,856				
輸送用機器 (6.8%)							阪急阪神HDLS	13.4	13.9	57,476			東邦ホールディングス	3.1	3.2	8,918				
トヨタ紡織	3.1	3.8	6,608				南海電鉄	6.3	-	-			サンリオ	2.9	-	-				

銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
PAL TAC	-	2	11,960			
日鉄住金物産	0.8	0.8	3,848			
ミスミグループ本社	12.1	13.6	36,570			
小売業 (4.4%)						
ローソン	2.6	2.7	16,794			
エービーシー・マート	1.9	1.7	11,220			
アダストリア	1.6	1.5	3,714			
セリア	2.5	2.8	10,542			
ビックカメラ	6.1	5.8	7,018			
MonotaRO	3.7	6.8	16,136			
J.フロントリテイリング	12.4	13.9	18,042			
マツモトキヨシHLDGS	4.3	4.5	16,762			
ZOZO	10.2	11.7	23,751			
ウエルシアHD	2.8	2.9	10,614			
クリエイトSDH	1.5	1.6	4,436			
すかいらーくHD	-	10.1	18,099			
コスモス薬品	0.5	0.5	9,475			
セブン&アイ・HLDGS	43.7	45.4	196,672			
ツルハホールディングス	2.3	2.4	21,912			
クスリのアオキHLDGS	0.8	1.1	8,844			
ノジマ	1.8	1.9	3,828			
良品計画	1.4	1.5	39,540			
パナソニックHD	6.8	6.5	45,500			
ゼンショーホールディングス	-	5.1	13,326			
ユニテッドアローズ	1.3	1.2	4,548			
スギホールディングス	2.3	2.4	11,760			
ユニ・ファミリーマートHD	3.3	12	36,180			
日本瓦斯	1.9	1.8	6,147			
しまむら	1.2	1.3	12,220			
高島屋	16	-	-			
丸井グループ	-	9.2	20,552			
イオン	40.1	41.7	96,681			
イズミ	1.9	2.2	11,132			
ヤオコー	1.2	1.2	6,876			
ケーズホールディングス	4.4	11.3	11,220			
アインホールディングス	1.4	1.5	12,300			
ニトリホールディングス	4.1	4.7	62,510			
パローホールディングス	2.4	-	-			
ファーストリテイリング	1.7	1.4	75,516			
サンドラッグ	4.4	4.1	13,263			
銀行業 (5.7%)						
めがきフィナンシャルG	54.2	56.3	16,664			
東京きらぼしFG	1.4	-	-			
九州フィナンシャルG	22.8	23.7	11,399			
コンコディア・フィナンシャル	63.5	69.1	30,127			
新生銀行	9	8	12,824			
あおぞら銀行	6.2	6.1	19,154			
三菱UFJフィナンシャルG	342.3	499.6	284,871			
りそなホールディングス	114.6	119	59,345			
三井住友トラストHD	20.5	21.3	88,352			
三井住友フィナンシャルG	60.4	68.5	275,027			
千葉銀行	37	38.4	23,846			
群馬銀行	21.2	-	-			
静岡銀行	28	27.3	23,805			
スルガ銀行	10.7	-	-			
ほくほくフィナンシャルG	6.9	-	-			

銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
広島銀行	15.4	16	9,328			
中国銀行	9.6	-	-			
セブン銀行	39.2	36.6	12,151			
みずほフィナンシャルG	1,362.4	1,473.5	258,599			
山口フィナンシャルG	13	-	-			
証券、商品先物取引業 (0.9%)						
FPG	3.6	3.4	3,267			
SBIホールディングス	11.8	12.9	31,643			
ジャフコ	1.5	-	-			
大和証券G本社	89	87	49,085			
野村ホールディングス	179.6	190.8	78,533			
東海東京HD	11.6	12.9	5,572			
松井証券	5.1	5.3	6,344			
カブドットコム証券	6.7	-	-			
保険業 (2.7%)						
SOMP Oホールディングス	20.5	19.1	77,546			
M&A D	27.3	28.4	96,105			
SONY F H	8.6	8.9	18,431			
第一生命HLDGS	59.1	61.4	98,485			
東京海上HD	39.3	39.3	213,988			
T&Dホールディングス	32.3	33.5	39,228			
その他金融業 (1.2%)						
全国保証	2.9	3.1	12,896			
芙蓉総合リース	1.2	1.2	6,960			
興銀リース	2	-	-			
東京センチュリー	2.1	2.2	10,659			
イオンフィナンシャルサービス	7.4	6.9	16,028			
オリコ	22.6	29.3	3,457			
日立キャピタル	2.9	2.6	7,046			
オリックス	69.6	72.3	117,089			
三菱UFJリース	26.5	24.5	14,063			
日本取引所グループ	30.7	29.3	58,424			
不動産業 (2.9%)						
いちご	14.9	13.8	5,299			
ビューリック	21.8	22.6	24,588			
野村不動産HLDGS	6.9	7.2	15,796			
プレサンスコーポレーション	1.4	1.7	2,383			
オープンハウス	1.7	1.8	7,236			
東急不動産HD	25.3	29.2	19,359			
飯田GHD	8.7	9	18,540			
パーク24	5.8	6.3	15,712			
三井不動産	52.1	57.5	162,063			
三菱地所	77.7	76	154,166			
東京建物	11.4	11.8	15,611			
住友不動産	25	24.4	114,240			
レオパレス21	12.5	13.4	3,242			
スターツコーポレーション	1.4	1.5	3,615			
イオンモール	6.7	5.4	9,779			
エヌ・ティ・ティ都市開発	6.5	-	-			
サービス業 (4.5%)						
ミクシィ	2.6	2.9	7,598			
日本M&Aセンター	3.5	7.8	24,336			
パーソルホールディングス	9.3	10.5	19,813			
総合警備保障	4	4.2	19,950			
カカクコム	7.6	7.9	15,879			
ディップ	1.4	1.7	3,162			

銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
エムスリー	10.6	22.1	41,083			
ディー・エヌ・エー	5.5	5.7	9,809			
博報堂DYHLDGS	14.1	14.6	26,090			
電通	-	12.8	60,544			
オリエンタルランド	12	12.4	153,636			
リゾートトラスト	4.3	4.4	6,740			
ユー・エス・エス	12.4	12.8	26,137			
サイバーエージェント	6.6	6.5	27,820			
楽天	51.9	49	50,960			
エン・ジャパン	-	1.5	4,822			
テクノプロ・ホールディング	-	2.1	13,923			
リクルートホールディングス	-	75.3	238,776			
リログループ	5.5	5.7	17,499			
カナモト	1.5	1.6	4,248			
セコム	10.7	11.1	105,683			
メイテック	1.2	1.3	6,526			
イオンディライト	1.2	1.3	5,323			
合計	株数、金額	8,786.5	9,193.1	19,903.552		
	銘柄数<比率>	399銘柄	398銘柄	<99.1%>		

(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
TOPIX	191	-

(注) 単位未満は切捨て。

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 916,600 (34,000)	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作成期中の利害関係人のうち、大和証券へ34,000株を貸付しています。

■投資信託財産の構成

2019年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 19,903,552	% 84.4
コール・ローン等、その他	3,672,058	15.6
投資信託財産総額	23,575,611	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

2019年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	23,718,441,650円
コール・ローン等	3,639,252,163
株式(評価額)	19,903,552,690
未収入金	53,520
未収配当金	20,077,900
未収利息	348,053
その他未収収益	12,327,324
差入委託証拠金	142,830,000
(B) 負債	3,630,392,564
未払解約金	17,223,473
差入委託証拠金代用有価証券	142,830,000
受入担保金	3,470,339,091
(C) 純資産総額(A - B)	20,088,049,086
元本	14,701,217,669
次期繰越損益金	5,386,831,417
(D) 受益権総口数	14,701,217,669口
1万口当り基準価額(C / D)	13,664円

* 期首における元本額は14,040,935,890円、当作成期間中における追加設定元本額は3,678,957,102円、同解約元本額は3,018,675,323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) 653,234,722円、iFree J P X 日経400インデックス422,788,910円、ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド63,050,638円、ダイワ J P X 日経400ファンド10,444,259,490円、ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 3,117,883,909円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,664円です。

■損益の状況

当期 自2018年3月23日 至2019年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	442,361,472円
受取配当金	391,421,554
受取利息	3,680,609
その他収益金	48,930,366
支払利息	△ 1,671,057
(B) 有価証券売買損益	△ 998,774,991
売買益	1,177,608,715
売買損	△2,176,383,706
(C) 先物取引等損益	△ 22,923,780
取引益	39,476,263
取引損	△ 62,400,043
(D) その他費用	△ 1,744,078
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△ 581,081,377
(F) 前期繰越損益金	5,884,371,038
(G) 解約差損益金	△1,358,595,919
(H) 追加信託差損益金	1,442,137,675
(I) 合計(E + F + G + H)	5,386,831,417
次期繰越損益金(I)	5,386,831,417

(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。