

ダイワＪＰＸ日経400ファンド (米ドル投資型)

運用報告書（全体版） 第７期

（決算日 2020年３月23日）
（作成対象期間 2019年３月23日～2020年３月23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、ＪＰＸ日経インデックス400の値動きをおおむね捉えるとともに、米ドルへの投資効果を享受することにより、信託財産の成長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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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/>

★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		
信託期間	約10年3カ月間（2014年1月6日～2024年3月22日）		
運用方針	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	ダイワＪＰＸ日経400マザー ファンドの受益証券	
	ダイワＪＰＸ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	
	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、配当等収益等を中心に分配します。ただし、配当等収益等が少額の場合には、分配を行なわないことがあります。		

最近 5 期の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			J P X 日経インデックス400		米ドル為替レート		株式組入率	株式先物率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 配 金	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率	(参考指数)	期 中 騰 落 率			
3 期末(2016年 3 月22日)	円 11,223	円 0	% △20.1		% △14.5	円 111.93	% △6.7	% 97.3	% 1.3	百万円 2,479
4 期末(2017年 3 月22日)	12,269	220	11.3	11,625	10.6	111.72	△0.2	98.9	1.1	2,283
5 期末(2018年 3 月22日)	13,004	280	8.3	12,980	11.7	105.63	△5.5	98.8	2.0	1,082
6 期末(2019年 3 月22日)	13,087	200	2.2	12,226	△ 5.8	110.74	4.8	100.4	1.0	880
7 期末(2020年 3 月23日)	10,924	0	△16.5	9,814	△19.7	110.82	0.1	93.9	2.3	548

- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (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として大和アセットマネジメントが計算したものです。
- (注 3) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。
- (注 4) 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 5) 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 6) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

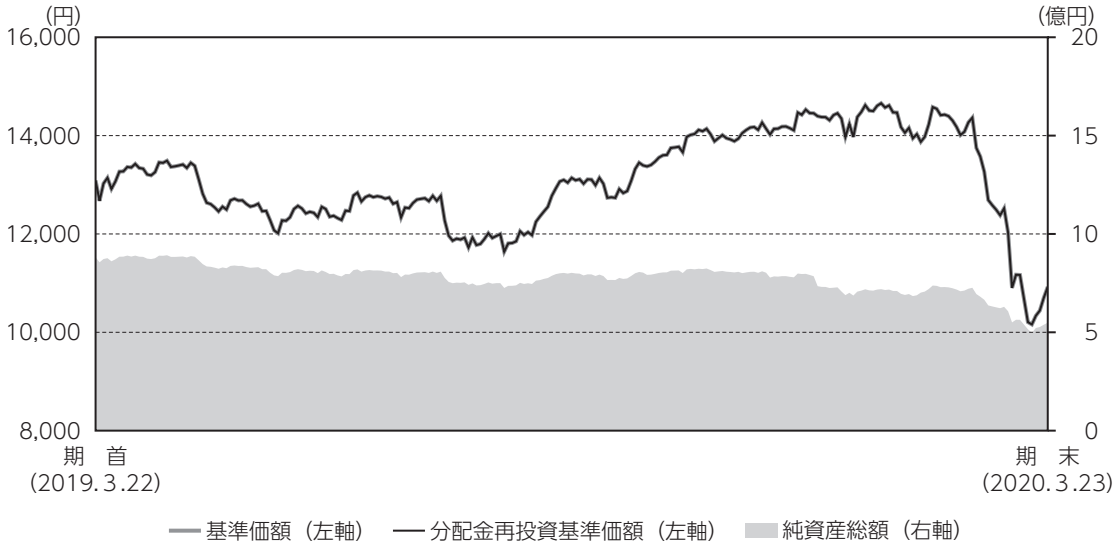
【注記】

- ・「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。



運用経過

基準価額等の推移について



* 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。

■ 基準価額・騰落率

期 首：13,087円

期 末：10,924円 (分配金0円)

騰落率：△16.5% (分配金込み)

■ 基準価額の主な変動要因

ダイワ J P X日経400マザーファンドの受益証券を通じて J P X日経インデックス400の値動きをおおむね捉えるとともに、円売り／米ドル買いの為替取引を行いました。

新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な経済活動の停滞や景気後退が懸念されてわが国の株式市場が下落したことが、基準価額のマイナス要因となりました。米ドルは円に対して横ばいとなりました。これらの結果、当ファンドの基準価額は下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ J P X日経400ファンド (米ドル投資型)

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400		米ドル為替レート		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
		騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率		
(期首) 2019年 3 月22日	円	%		%	円	%	%	%
	13,087	－	12,226	－	110.74	－	100.4	1.0
3 月末	13,068	△ 0.1	12,048	△ 1.5	110.99	0.2	96.2	2.0
4 月末	13,385	2.3	12,230	0.0	111.85	1.0	97.6	1.5
5 月末	12,279	△ 6.2	11,440	△ 6.4	109.36	△1.2	97.1	2.2
6 月末	12,465	△ 4.8	11,748	△ 3.9	107.79	△2.7	96.8	2.0
7 月末	12,674	△ 3.2	11,831	△ 3.2	108.64	△1.9	98.2	1.0
8 月末	12,056	△ 7.9	11,467	△ 6.2	106.46	△3.9	96.8	1.8
9 月末	12,991	△ 0.7	12,068	△ 1.3	107.92	△2.5	97.7	1.1
10月末	13,773	5.2	12,673	3.7	108.88	△1.7	97.7	1.1
11月末	14,117	7.9	12,903	5.5	109.56	△1.1	97.5	1.2
12月末	14,347	9.6	13,067	6.9	109.56	△1.1	98.2	0.9
2020年 1 月末	14,030	7.2	12,825	4.9	109.06	△1.5	98.0	0.8
2 月末	12,690	△ 3.0	11,544	△ 5.6	109.43	△1.2	98.3	1.6
(期末) 2020年 3 月23日	10,924	△16.5	9,814	△19.7	110.82	0.1	93.9	2.3

(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

(2019.3.23～2020.3.23)

■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、世界的な景気減速懸念と米中通商協議の進展期待などが交錯し、横ばい圏で推移しました。2019年5月に入ると、米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は底堅く推移しました。その後8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が後退したことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染が拡大したことに続き、2月後半には中国以外における感染拡大が懸念されたことや米国株が大幅下落となったことが嫌気され、大きく下落しました。

■為替相場

米ドル円為替相場は、横ばいの動きとなりました。

米ドル円為替相場は、当作成期首より、米中通商交渉への懸念が高まったことなどから円高傾向となりました。2019年8月以降は、米中通商交渉や英国のEU（欧州連合）離脱交渉の進展期待が高まる中で円安傾向となりました。2020年2月半ば以降は、新型コロナウイルスの感染が拡大したことで一時的にリスク回避の円高となりましたが、世界的な経済活動の停滞や景気後退が懸念されると一転してドル需要が高まり、円安ドル高となり当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

J P X 日経インデックス400の値動きをおおむね捉えるとともに、円売り／米ドル買いの為替取引を行うことで米ドルへの投資効果の享受をめざし、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

(2019.3.23～2020.3.23)

■当ファンド

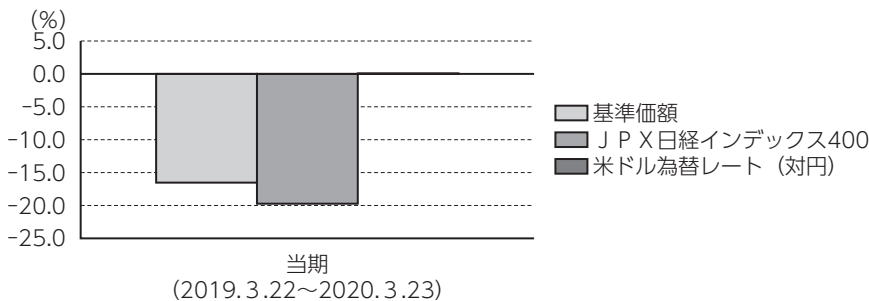
ダイワ J P X 日経400マザーファンドを通じて運用を行いました。
また、円売り／米ドル買いの為替取引を行いました。

■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

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を設けておりません。
以下のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案し、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（1万口当たり）

項 目		当 期
		2019年3月23日 ～2020年3月23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）	2,635

（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

J P X 日経インデックス400の値動きをおおむね捉えるとともに、円売り／米ドル買いの為替取引を行うことで米ドルへの投資効果の享受をめざし、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 (2019.3.23~2020.3.23)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	94円	0.715%	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13,100円です。
(投 信 会 社)	(46)	(0.350)	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)	(43)	(0.328)	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)	(0.038)	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	1	0.009	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)	(0)	(0.003)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	95	0.726	

(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。

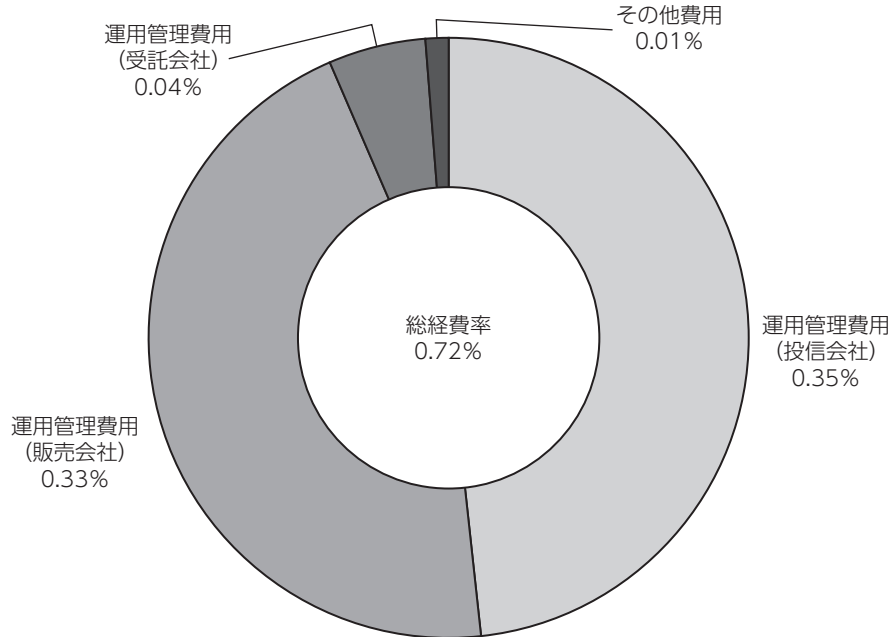
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.72%です。



(注1) 1万口当りの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

■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

(2019年3月23日から2020年3月23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	205,856	277,028	389,876	535,594

(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

(2019年3月23日から2020年3月23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	6,633,983千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	18,099,619千円
(c) 売買高比率 (a)／(b)	0.36

(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

(2019年3月23日から2020年3月23日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	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	%
株式	1,288	－	－	5,345	194	3.6
株式先物取引	2,433	－	－	2,282	－	－
コール・ローン	730,564	－	－	－	－	－

(注) 平均保有割合4.2%

※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

(2019年3月23日から2020年3月23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
株式	百万円 1	百万円 9	百万円 30

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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

(2019年3月23日から2020年3月23日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	14千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(B)／(A)	2.7%

(注) 売買委託手数料総額は、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。

※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、当作成期中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	653,234	469,214	528,429

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年3月23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	528,429	95.3
コール・ローン等、その他	25,773	4.7
投資信託財産総額	554,203	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

2020年3月23日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,096,267,171円
コール・ローン等	6,699,227
ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド(評価額)	528,429,239
未収入金	561,138,705
(B) 負債	547,419,343
未払金	542,433,278
未払解約金	2,348,080
未払信託報酬	2,617,838
その他未払費用	20,147
(C) 純資産総額(A－B)	548,847,828
元本	502,442,408
次期繰越損益金	46,405,420
(D) 受益権総口数	502,442,408口
1万口当り基準価額(C／D)	10,924円

* 期首における元本額は673,166,006円、当作成期間中における追加設定元本額は45,010,362円、同解約元本額は215,733,960円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,924円です。

■損益の状況

当期 自2019年3月23日 至2020年3月23日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 4,314円
受取利息	1,009
支払利息	△ 5,323
(B) 有価証券売買損益	△ 99,434,434
売買益	115,538,002
売買損	△214,972,436
(C) 信託報酬等	△ 5,603,497
(D) 当期損益金(A + B + C)	△105,042,245
(E) 前期繰越損益金	23,252,645
(F) 追加信託差損益金	128,195,020
(配当等相当額)	(88,151,756)
(売買損益相当額)	(40,043,264)
(G) 合計(D + E + F)	46,405,420
次期繰越損益金(G)	46,405,420
追加信託差損益金	128,195,020
(配当等相当額)	(88,151,756)
(売買損益相当額)	(40,043,264)
分配準備積立金	44,244,437
繰越損益金	△126,034,037

(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	11,942,694円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	88,151,756
(d) 分配準備積立金	32,301,743
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	132,396,193
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e－f)	132,396,193
(h) 受益権総口数	502,442,408口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド

運用報告書 第7期（決算日 2020年3月23日）

（作成対象期間 2019年3月23日～2020年3月23日）

ダイワＪＰＸ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。

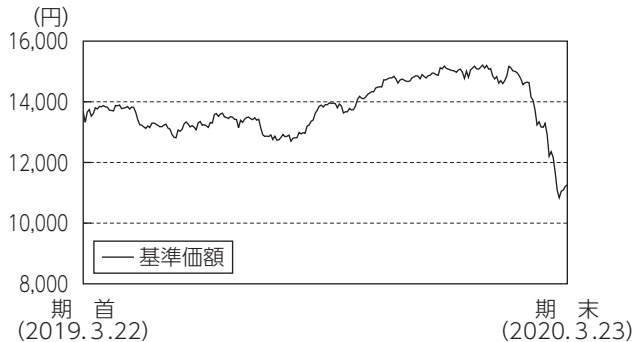
運 用 方 針	投資成果をＪＰＸ日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株 式 組 入 制 限	無制限

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
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 組 比	式 入 率	株 先 比	式 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	%	%	%	%
(期首)2019年 3月22日	13,664	—	12,226	—	99.1	1.0		
3月末	13,608	△ 0.4	12,048	△ 1.5	97.7	2.0		
4月末	13,815	1.1	12,230	0.0	98.2	1.6		
5月末	12,929	△ 5.4	11,440	△ 6.4	97.9	2.2		
6月末	13,300	△ 2.7	11,748	△ 3.9	97.9	2.0		
7月末	13,395	△ 2.0	11,831	△ 3.2	98.9	1.0		
8月末	12,989	△ 4.9	11,467	△ 6.2	98.2	1.8		
9月末	13,801	1.0	12,068	△ 1.3	98.8	1.1		
10月末	14,495	6.1	12,673	3.7	98.7	1.1		
11月末	14,759	8.0	12,903	5.5	98.6	1.2		
12月末	14,972	9.6	13,067	6.9	99.1	0.9		
2020年 1月末	14,698	7.6	12,825	4.9	99.1	0.8		
2月末	13,238	△ 3.1	11,544	△ 5.6	98.6	1.6		
(期末)2020年 3月23日	11,262	△17.6	9,814	△19.7	97.6	2.4		

(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として大和アセットマネジメント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：13,664円 期末：11,262円 騰落率：△17.6%

【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。

新型コロナウイルスの感染拡大による世界的な経済活動の停滞や景気後退が懸念されてわが国の株式市場が下落したことがマイナス要因となり、基準価額は下落しました。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、世界的な景気減速懸念と米中

通商協議の進展期待などが交錯し、横ばい圏で推移しました。2019年5月に入ると、米国が中国製品への関税率の引き上げや対象範囲の拡大方針を発表したこと、また中国の通信機器大手メーカーに対する取引制限措置を実施したことなどにより不透明感が高まり、株価は下落しました。下落一巡後は、世界景気の動向などに不透明感がある中で、6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことや米国の利下げ期待が支えとなり、株価は底堅く推移しました。その後8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が後退したことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染が拡大したことに続き、2月後半には中国以外における感染拡大が懸念されたことや米国株が大幅下落となったことが嫌気され、大きく下落しました。

◆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△19.7%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△17.6%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)	0 (0)
合 計	0

(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

(2019年3月23日から2020年3月23日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 709.4 (208.15)	千円 1,288,504 (-)	千株 2,460.25	千円 5,345,479

(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

(2019年3月23日から2020年3月23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 2,433	百万円 2,282	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

(2019年3月23日から2020年3月23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
NTTドコモ		千株 13.6	千円 39,391	円 2,896	ソフトバンクグループ		千株 30.8	千円 151,334	円 4,913
三菱UFJフィナンシャルG		69.9	34,403	492	武田薬品		39.2	148,584	3,790
ペプチドリーム		5.6	30,799	5,499	キーエンス		2.2	127,883	58,129
ルネサスエレクトロニクス		42.1	27,211	646	ソニー		17.9	114,262	6,383
Zホールディングス		77.8	25,698	330	KDDI		30.9	91,394	2,957
三井住友フィナンシャルG		7.6	25,251	3,322	日産自動車		130.4	85,039	652
日本新薬		2.9	25,061	8,642	日本電信電話		16	81,836	5,114
ニコン		19.3	24,930	1,291	任天堂		1.8	72,961	40,534
日本マクドナルドHLDG		4.7	23,144	4,924	本田技研		23.4	71,103	3,038
任天堂		0.6	22,585	37,643	NTTドコモ		24.5	66,709	2,722

(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			銘柄	期首			銘柄	期首		
	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	76.6	59.6	39,812	ベプチドリーム	—	4.6	17,940
日本水産	14.9	12.5	5,750	昭和電工	7.2	6.4	12,672	石油・石炭製品 (0.6%)			
マルハニチロ	2.2	1.8	3,846	住友化学	84.8	66.1	18,640	出光興産	8.5	10.3	24,864
鉱業 (0.2%)				日産化学	6.6	5	15,025	J X T Gホールディングス	184.9	138.2	46,449
国際石油開発帝石	59.9	50	25,850	東ソー	16.6	13.9	14,831	コスモエネルギーHLDGS	3.2	2.7	3,766
建設業 (2.6%)				トクヤマ	—	2.6	4,625	ゴム製品 (0.7%)			
安藤・間	9.5	7.4	4,528	デンカ	4.2	3.3	6,705	横浜ゴム	6.4	5.3	6,519
東急建設	4.4	3.7	1,872	信越化学	19	15.4	137,937	ブリヂストン	33.8	26.5	81,752
コムシスホールディングス	4.8	4.4	10,181	エア・ウォーター	8.8	8.4	10,642	住友ゴム	9.9	8.3	7,685
大成建設	12.3	9.6	27,398	太陽日酸	8.9	8.6	11,962	ガラス・土石製品 (0.7%)			
大林組	36.9	28.8	22,838	日本パーカライジング	5.9	—	—	A G C	10.9	9.1	21,339
清水建設	37.7	29.2	21,900	三菱瓦斯化学	11.1	8.4	9,340	太平洋セメント	6.9	5.8	9,981
長谷工コーポレーション	15.4	11.1	12,287	三井化学	9.8	8.2	16,482	東海カーボン	—	9.6	7,996
鹿島建設	28.9	22.6	22,080	J S R	10.8	8.4	12,986	T O T O	8.5	6.6	20,856
西松建設	2.7	2.2	4,496	三菱ケミカルHLDGS	72	60.1	36,108	日本碍子	13.4	11.2	13,921
三井住友建設	8.9	7	3,129	ダイセル	16.7	12.3	8,892	日本特殊陶業	9.3	7.1	9,563
前田建設	8.8	7.2	5,126	積水化学	23.5	19.3	24,993	ニチアス	3	2.5	4,717
戸田建設	14.3	12	7,080	日本セオン	9.7	—	—	鉄鋼 (0.5%)			
熊谷組	1.8	1.3	2,910	アイカ工業	3.2	2.7	7,929	日本製鉄	48.7	40.6	36,893
大東建託	4.4	3.5	35,367	宇部興産	5.4	4.5	6,966	J F Eホールディングス	29.4	24.5	17,493
N I P P O	3.3	2.4	5,179	日立化成	5	4.2	18,291	東京製鐵	5.8	—	—
前田道路	3.9	—	—	ダイキョーニシカフ	2.3	1.9	891	日立金属	11.7	9.8	10,025
五洋建設	14.6	11.4	5,380	日油	4.2	3.4	11,067	非鉄金属 (0.6%)			
住友林業	8.7	7.3	8,730	花王	26.7	22	172,392	日本軽金属HD	29.6	23	3,519
大和ハウス	34.1	28.5	67,445	日本ペイントHOLD	8.9	7.4	39,590	三菱マテリアル	7.2	—	—
積水ハウス	37.7	31.5	53,644	関西ペイント	12.1	10.1	20,149	住友鉱山	14.9	11.6	23,437
協和エクシオ	4.6	4.4	10,102	D I C	4.9	3.8	7,527	DOWAホールディングス	2.5	2.3	5,692
九電工	2.4	2	5,356	資生堂	21.8	18.2	103,139	古河電工	3.1	2.8	4,922
食料品 (4.2%)				ライオン	15.3	11.9	25,870	住友電工	40.7	34	35,496
森永製菓	2.8	2.2	8,745	コーセー	1.9	1.7	20,910	金属製品 (0.3%)			
江崎グリコ	3.3	2.7	11,947	シーズ・ホールディングス	0.3	—	—	S U M C O	12	10.9	12,175
カルビー	5	4.2	10,802	ポーラ・オルビスHD	4.7	3.9	7,597	三和ホールディングス	11.2	8.7	6,037
ヤクルト	8.2	6.3	36,918	小林製菓	3.1	2.6	25,974	リンナイ	1.9	1.8	12,600
明治ホールディングス	7.8	6.1	42,761	日東電工	8.3	6.3	26,806	東プレ	2	1.7	1,868
日本ハム	4.8	3.5	11,025	ニフコ	4.4	3.4	6,687	日本発条	10.8	—	—
アサヒグループホールディン	23.1	19.3	62,937	ユニ・チャーム	23.3	17.7	63,631	機械 (4.7%)			
キリンHD	49.9	39.1	83,165	医薬品 (7.3%)				アマダホールディングス	16.8	11.5	9,223
サントリー食品インター	7.4	6.2	25,017	協和キリン	13.8	9.2	19,218	オーエスジー	5.4	4.2	5,342
キッコーマン	7.3	6.6	26,400	武田薬品	96	58.7	176,804	DMG森精機	6.9	5.7	4,873
味の素	24.4	20.4	35,169	アステラス製薬	101.4	80.8	117,160	ダイスコ	1.5	1.2	22,248
キューピー	6.1	5.1	10,592	大日本住友製薬	8.1	6.8	8,228	ナブテスコ	6	5.4	12,133
アリアケジャパン	—	0.8	4,784	塩野義製薬	14.4	11.7	55,539	三井海洋開発	1.2	1	1,099
ニチレイ	5.7	4.4	11,268	田辺三菱製薬	11.5	—	—	S M C	3.2	2.9	116,116
東洋水産	5.7	4.7	22,701	日本新薬	—	2.4	17,568	小松製作所	49.8	41.6	66,248
日清食品HD	4.7	3.9	33,033	中外製薬	11.5	9.6	116,304	住友重機械	6.3	5.3	9,577
日本たばこ産業	63.7	53.2	101,346	科研製薬	2	1.6	7,256	日立建機	4.4	3.7	7,044
繊維製品 (0.4%)				エーザイ	13.2	11	73,535	ハモニック・ドライブ・シス	2	1.9	7,894
帝人	8.8	7.3	11,964	小野薬品	26	21.1	43,740	クボタ	58.9	48.7	59,584
東レ	83.5	65.1	27,114	久光製薬	3.2	2.4	11,268	荏原製作所	4.9	—	—
ゴールドウイン	—	1.6	10,304	参天製薬	20.8	17.1	29,736	ダイキン工業	15	11.7	146,835
パルプ・紙 (0.2%)				ツムラ	3.4	—	—	椿本チエイン	1.4	—	—
王子ホールディングス	48.5	37.6	19,740	沢井製薬	2.3	1.9	10,032	ダイフク	6.1	4.7	27,730
化学 (7.4%)				第一三共	31.5	26.3	176,525	タダノ	5.3	—	—
クラレ	18.2	14.2	14,185	大塚ホールディングス	20.9	17.5	60,182	平和	3.1	—	—

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円
竹内製作所	1.8	1.5	1,801	デンソー	24.2	20.2	63,468	名古屋鉄道	11.1	9.5	29,450
T P R	1.5	1.2	1,375	川崎重工業	8.6	7.1	10,295	日本通運	4.1	3.1	14,957
ホシザキ	3.2	—	—	日産自動車	129.7	—	—	ヤマトホールディングス	18.3	15.2	21,188
日本精工	22.6	17.3	11,002	いすゞ自動車	34.8	26.6	16,880	山九	2.9	2.4	8,820
ジェイテクト	10.5	8.8	5,720	トヨタ自動車	40.5	35.2	217,254	日立物流	2.3	1.6	3,300
T H K	6.9	5.3	10,504	日野自動車	13.7	11.5	5,968	空運業 (0.6%)			
マキタ	13.4	12	33,492	NOK	5.9	—	—	日本航空	19.1	15.7	30,638
三菱重工業	18.4	15.4	41,241	アイシン精機	9.1	7.6	17,829	ANAホールディングス	19	15.9	43,756
I H I	—	6.6	7,847	マツダ	34.5	27	15,687	情報・通信業 (8.8%)			
電気機器 (15.1%)				本田技研	91.3	72.3	160,289	日鉄ソリューションズ	1.6	1.4	3,570
コニカミノルタ	24	20.1	8,442	スズキ	20.1	18.2	45,500	T I S	3.6	3	13,020
ブラザー工業	14.3	11.2	16,352	S U B A R U	34.1	28.5	54,834	ネクソン	27.5	25.7	39,603
ミネベアミツミ	20.4	17	23,545	ヤマハ発動機	15.5	12	14,148	コロプラ	3.1	3	2,232
日立	49.5	44.1	116,181	豊田合成	3.6	3	5,061	ティーガイア	1.1	0.8	1,523
三菱電機	109.9	91.8	108,094	シマノ	4.4	3.4	51,612	ガホー・オンライン・エンター	26	2.2	3,297
富士電機	7.1	5.5	11,137	テイ・エス テック	2.6	2.1	5,090	GMOベメントゲートウェイ	—	1.5	11,100
安川電機	12.7	9.9	25,146	精密機器 (3.0%)				アカツキ	—	0.3	1,011
東芝テック	—	1.2	3,744	テルモ	15.6	26	81,380	野村総合研究所	6.9	12.8	27,904
日本電産	13.2	11.1	114,108	島津製作所	14.1	11	28,677	オービック	3.7	3.1	40,145
日新電機	—	2.2	1,751	プイ・テクノロジー	—	0.4	1,244	Zホールディングス	70.3	123.8	36,149
オムロン	11.7	8.2	40,631	東京精密	—	1.7	4,321	トレンドマイクロ	5.7	4	17,580
日本電気	14.2	11.1	39,127	ニコン	—	14.9	13,871	日本オラクル	2.2	1.8	14,670
富士通	10.6	8.9	75,071	オリンパス	16.4	50.8	67,056	伊藤忠テクノソリューションズ	4.9	4.1	10,766
ルネサスエレクトロニクス	11.4	43.9	14,969	H O Y A	22.1	18.3	155,550	大塚商会	5.8	4.9	20,188
セイコーエプソン	13.6	11.4	12,175	朝日インテック	6.2	10.4	28,662	デジタルガレージ	—	1.6	4,222
アルパック	2.2	1.7	3,981	その他製品 (2.4%)				日本ユニシス	3.4	2.8	6,759
エレコム	1	1	3,525	バンダイナムコH L D G S	11.4	9.5	46,711	日本テレビH L D S	9.9	7.5	9,037
パナソニック	125.6	104.9	75,590	パイロットコーポレーション	1.9	1.5	4,567	日本電信電話	60	91.7	229,250
富士通ゼネラル	3.4	2.5	4,300	タカラトミー	—	4.1	3,091	K D D I	95.1	67.2	196,123
ソニー	56.1	39.3	230,533	アシックス	10.9	—	—	光通信	1.3	0.9	14,850
T D K	5.8	4.4	32,340	ヤマハ	6.5	5.5	20,625	N T T ドコモ	77.5	66.6	214,052
アルプスアルパイン	10.1	8.1	7,290	ビジョン	6.6	5.5	20,350	GMOインターネット	3.9	—	—
ヒロセ電機	1.6	1.4	15,316	任天堂	6.8	5.6	211,736	東宝	7.1	5.3	18,311
横河電機	11	8.4	9,088	電気・ガス業 (1.6%)				N T T データ	28.7	24	22,512
アズビル	—	5.8	15,723	中部電力	33.6	28.1	39,368	スクウェア・エニックス・HD	5	3.8	16,188
日本光電工業	4.8	3.8	12,236	関西電力	44.9	34.8	35,652	カブコン	4.6	4.2	12,146
堀場製作所	2.2	1.8	8,469	東北電力	25.7	22.9	22,213	S C S K	2.8	2.1	8,389
アドバンテスト	7.5	6.8	25,500	九州電力	22.7	18.9	16,272	コナミホールディングス	4.4	3.3	9,216
キーエンス	5.1	6.6	214,962	電源開発	8.7	7.3	14,935	ソフトバンクグループ	36.7	43.3	137,997
シスメックス	8.6	6.6	44,998	東京瓦斯	21.6	17.7	41,072	卸売業 (5.3%)			
O B A R A G R O U P	0.6	0.5	1,150	大阪瓦斯	21.3	17.8	33,179	双日	59.8	50	11,700
レーザーテック	—	4	18,120	東邦瓦斯	5.4	—	—	アルフレッサホールディングス	12	10.1	18,735
スタンレー電気	7.8	6.5	12,610	陸運業 (5.5%)				神戸物産	1.6	3.1	12,260
カシオ	9.7	8.1	10,967	東武鉄道	11.6	9.7	36,084	ダイワボウHD	—	0.8	3,704
ファナック	10.4	8.7	114,535	相鉄ホールディングス	5	3.9	11,060	T O K A I ホールディングス	—	4.8	4,387
浜松ホトニクス	7.9	6.6	27,192	東急	29.9	23.2	38,744	シップヘルスケアHD	2.3	1.4	5,313
京セラ	16.8	12.9	74,058	小田急電鉄	17.6	13.7	33,017	コメダホールディングス	—	2	3,344
太陽誘電	—	4.1	10,241	京王電鉄	6.1	4.8	29,712	第一興商	2.1	1.8	5,247
村田製作所	11.5	27	131,625	京成電鉄	8.2	6.4	19,456	メディアバルHD	11.7	9.8	18,208
小糸製作所	6.6	5.5	16,967	東日本旅客鉄道	19.5	16.2	134,103	日本ライフライン	—	2.7	3,067
S C R E E N ホールディングス	1.9	1.6	5,336	西日本旅客鉄道	9.9	8.2	58,564	伊藤忠	75.7	63.3	132,961
キャノン	59.2	49.4	110,112	東海旅客鉄道	9.8	7.6	137,180	丸紅	106.8	94.2	50,717
東京エレクトロン	7.3	6.1	104,371	西武ホールディングス	14	12.3	15,104	豊田通商	12.1	10.1	22,361
輸送用機器 (5.6%)				近鉄グループH L D G S	10.4	8.7	46,110	兼松	4.3	3.4	3,576
トヨタ紡織	3.8	2.7	3,102	阪急阪神H L D G S	13.9	11.6	42,630	三井物産	89.2	79.5	116,745
豊田自動織機	8.9	7.4	33,818	京阪ホールディングス	6.2	5.2	24,570	日立ハイテク	3.3	3.1	24,428

銘柄	期首			銘柄	期首			銘柄	期首		
	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
住友商事	64	57.1	68,434	静岡銀行	27.3	—	—	エムスリー	22.1	19.3	53,711
三菱商事	76	63.5	144,716	広島銀行	16	—	—	アウトソーシング	—	5	1,915
阪和興業	1.9	—	—	セブン銀行	36.6	30.3	8,635	ディー・エヌ・エー	5.7	4.3	4,983
岩谷産業	2.4	2	7,170	みずほフィナンシャルG	1,473.5	1,230.8	150,157	博報堂DYHLDGS	14.6	12.2	11,919
東邦ホールディングス	3.2	—	—	証券・商品先物取引業 (0.9%)				電通グループ	12.8	9	18,810
PAL TAC	2	1.4	7,000	F P G	3.4	2.8	1,408	オリエンタルランド	12.4	9.3	131,595
日鉄物産	0.8	0.6	1,989	SBIホールディングス	12.9	10.1	14,392	リゾートトラスト	4.4	4	4,076
ミスミグループ本社	13.6	11.3	22,215	大和証券G本社	87	72.7	30,243	ユー・エス・エス	12.8	9.8	14,308
小売業 (4.8%)				野村ホールディングス	190.8	159.4	65,242	サイバーエージェント	6.5	5	17,050
ローソン	2.7	2.3	12,903	東海東京HD	12.9	—	—	楽天	49	40.9	29,775
エーピーシー・マート	1.7	1.4	7,224	松井証券	5.3	5.2	4,170	エン・ジャパン	1.5	1.6	2,918
アダストリア	1.5	—	—	保険業 (2.8%)				テクノプロ・ホールディング	2.1	1.8	8,379
日本マクドナルドHLDG	—	3.8	18,791	SOMPOホールディングス	19.1	17	48,501	リクルートホールディングス	75.3	62.9	162,911
セリア	2.8	2.2	6,754	MS & AD	28.4	23.7	66,774	リログループ	5.7	4.8	9,192
ビックカメラ	5.8	5.4	4,395	S O N Y F H	8.9	7.4	11,677	カナモト	1.6	1.4	2,627
MonotaRO	6.8	6.4	18,860	第一生命HLDGS	61.4	51.3	59,636	セコム	11.1	9.3	72,233
J. フロントリテイリング	13.9	10.8	8,931	東京海上HD	39.3	32.4	150,562	メイテック	1.3	1.1	4,339
マツモトキヨシHLDGS	4.5	3.7	13,893	T & Dホールディングス	33.5	27.1	20,975	イオンデニライ	1.3	—	—
ZOZO	11.7	6.2	8,022	その他金融業 (1.2%)				合 計	株数、金額	9,193.1	7,650.4
ウエルシアHD	2.9	2.7	19,305	全国保証	3.1	2.6	7,748	銘柄数<比率>	398銘柄	399銘柄	<97.6%>
クリエイトSDH	1.6	1.5	4,000	芙蓉総合リース	1.2	0.9	4,590	(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。			
すかいらーくHD	10.1	10.1	17,765	東京センチュリー	2.2	1.8	6,201	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。			
コスモス薬品	0.5	0.4	9,088	イオンフィナンシャルサービス	6.9	5.5	5,863	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。			
セブン&アイ・HLDGS	45.4	35.4	114,412	オリコ	29.3	24.5	2,670				
ツルハホールディングス	2.4	2	25,900	日立キャピタル	2.6	—	—				
クスリのアオキHLDGS	1.1	0.8	6,768	オリックス	72.3	56.7	68,465				
ノジマ	1.9	1.6	2,801	三菱UFJリース	24.5	23	11,316				
良品計画	1.5	1.2	12,132	日本取引所グループ	29.3	26	49,166				
パナソニックHD	6.5	19.9	35,143	不動産業 (2.3%)							
ゼンショーホールディングス	5.1	4.3	8,741	いちご	13.8	11.5	2,438				
ワークマン	—	0.9	5,139	ビューリック	22.6	18.9	17,803				
ユナイテッドアローズ	1.2	0.9	1,416	野村不動産HLDGS	7.2	5.5	8,888				
スズキホールディングス	2.4	1.8	9,504	プレザンスコーポレーション	1.7	1.5	1,359				
ファミリーマート	12	7.2	11,448	オープンハウス	1.8	2.6	4,854				
日本瓦斯	1.8	—	—	東急不動産HD	29.2	24.6	10,897				
しまむら	1.3	1.1	7,656	飯田GHD	9	7.6	10,229				
丸井グループ	9.2	8.3	15,280	パーク24	6.3	4.9	7,815				
イオン	41.7	34.8	74,245	三井不動産	57.5	44.7	72,503				
イズミ	2.2	1.8	4,230	三菱地所	76	63.5	86,296				
ヤオコー	1.2	1	6,110	東京建物	11.8	9.7	9,185				
ケーズホールディングス	11.3	8.7	9,813	住友不動産	24.4	20.4	47,674				
アインホールディングス	1.5	1.1	6,666	レオパレス21	13.4	—	—				
ニトリホールディングス	4.7	3.9	53,040	スターツコーポレーション	1.5	1.2	2,144				
ファーストリテイリング	1.4	1.2	48,900	イオンモール	5.4	4.5	5,971				
サンドラッグ	4.1	3.4	10,200	日本空港ビルデング	—	2.9	11,397				
銀行業 (5.0%)				サービス業 (4.8%)							
めざきフィナンシャルG	56.3	47.1	9,985	ミグシィ	2.9	2.2	3,170				
九州フィナンシャルG	23.7	—	—	ジェイエイシークラウドメント	—	0.6	582				
コンソディア・フィナンシャル	69.1	53.3	16,949	日本M&Aセンター	7.8	6.6	16,678				
新生銀行	8	6.6	8,500	UTグループ	—	1.4	1,317				
あおぞら銀行	6.1	5.4	10,675	エス・エム・エス	—	2.7	5,154				
三菱UFJフィナンシャルG	499.6	456.9	181,572	パーソルホールディングス	10.5	8.8	7,770				
りそなホールディングス	119	99.4	31,072	総合警備保障	4.2	3.5	16,922				
三井住友トラストHD	21.3	17.1	49,709	カカフコム	7.9	6.6	13,398				
三井住友フィナンシャルG	68.5	60.7	159,853	ディップ	1.7	1.2	1,942				
千葉銀行	38.4	31.2	14,788	ベネフィット・ワン	—	3.2	4,118				

■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 821,400 (3,700)	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3,700株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2020年3月23日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 12,904,828	% 84.4
コール・ローン等、その他	2,391,919	15.6
投資信託財産総額	15,296,747	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

2020年3月23日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	15,438,724,590円
コール・ローン等	2,342,747,166
株式(評価額)	12,904,828,170
未収配当金	26,015,660
未収利息	142,304
その他未収収益	2,066,290
差入委託証拠金	162,925,000
(B) 負債	2,213,760,494
未払金	66,441,955
未払解約金	1,473,900
差入委託証拠金代用有価証券	142,830,000
受入担保金	2,003,014,639
(C) 純資産総額(A－B)	13,224,964,096
元本	11,743,469,789
次期繰越損益金	1,481,494,307
(D) 受益権総口数	11,743,469,789口
1万口当り基準価額(C／D)	11,262円

＊期首における元本額は14,701,217,669円、当作成期間中における追加設定元本額は1,576,780,556円、同解約元本額は4,534,528,436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) 469,214,384円、iFree J P X 日経400インデックス676,882,355円、ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド87,945,800円、ダイワ J P X 日経400ファンド7,851,347,546円、ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 2,658,079,704円です。
 ＊当期末の計算口数当りの純資産額は11,262円です。

■損益の状況

当期 自2019年3月23日 至2020年3月23日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	485,712,077円
受取配当金	460,232,080
受取利息	3,418,196
その他収益金	23,958,525
支払利息	△ 1,896,724
(B) 有価証券売買損益	△2,941,748,791
売買益	833,534,512
売買損	△3,775,283,303
(C) 先物取引等損益	△ 21,895,700
取引益	40,133,140
取引損	△ 62,028,840
(D) その他費用	△ 293,152
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	△2,478,225,566
(F) 前期繰越損益金	5,386,831,417
(G) 解約差損益金	△1,946,038,581
(H) 追加信託差損益金	518,927,037
(I) 合計(E + F + G + H)	1,481,494,307
次期繰越損益金(I)	1,481,494,307

(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】

- ・「ＪＰＸ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「ＪＰＸ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、ＪＰＸグループと日経は、「ＪＰＸ日経インデックス400」自体および「ＪＰＸ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。
- ・「ＪＰＸ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ＪＰＸグループと日経に帰属しています。
- ・ＪＰＸグループと日経は、「ＪＰＸ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。
- ・ＪＰＸグループと日経は、「ＪＰＸ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。