

ダイワＪＰＸ日経400ファンド

運用報告書（全体版） 第８期

（決算日 2021年３月22日）
（作成対象期間 2020年３月24日～2021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／インデックス型		
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	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	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		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 騰 落 率	(ベンチマーク)	期 騰 落 率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
4 期末(2017年 3 月22日)	11,820	230	12.3	11,625	10.6	99.3	1.1	20,295
5 期末(2018年 3 月22日)	13,116	270	13.2	12,980	11.7	99.2	2.0	13,889
6 期末(2019年 3 月22日)	12,540	0	△ 4.4	12,226	△ 5.8	99.1	1.0	14,271
7 期末(2020年 3 月23日)	10,261	0	△18.2	9,814	△19.7	97.6	2.4	8,842
8 期末(2021年 3 月22日)	15,857	320	57.7	15,221	55.1	97.8	0.1	9,669

- (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) 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。

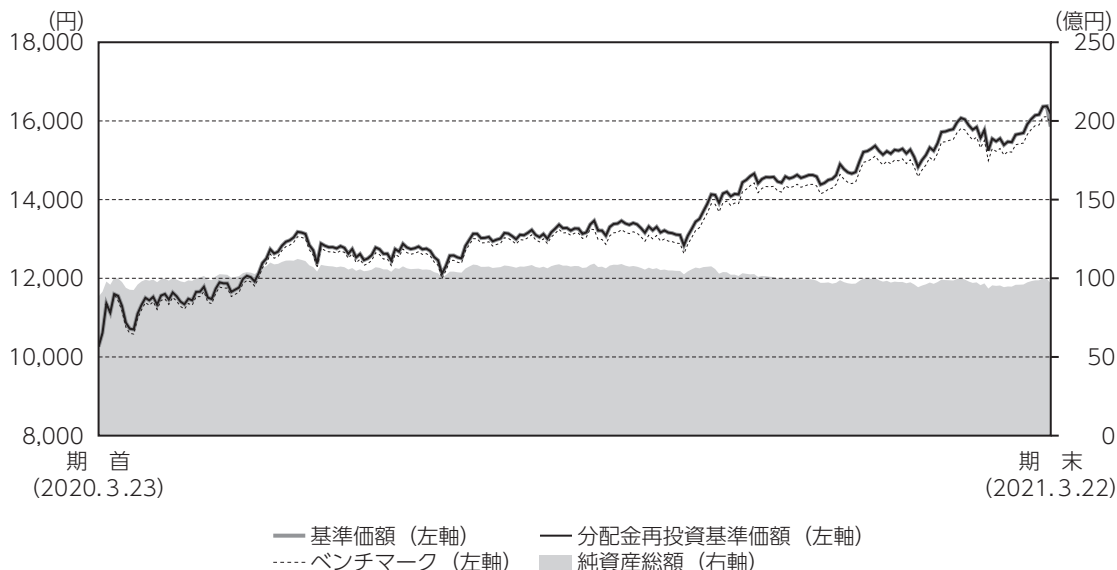
【注記】

- ・「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



(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：10,261円

期末：15,857円（分配金320円）

騰落率：57.7%（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。経済の回復への期待から世界的な株高となる中で、わが国の株式市場が上昇したことを受け、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。

ダイワ J P X日経400ファンド

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	J P X日経インデックス400		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
			(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2020年 3 月23日	円 10,261	% -	9,814	% -	% 97.6	% 2.4
3 月末	11,297	10.1	10,685	8.9	97.4	2.5
4 月末	11,785	14.9	11,156	13.7	97.4	2.2
5 月末	12,629	23.1	11,964	21.9	97.6	2.4
6 月末	12,618	23.0	11,940	21.7	98.8	0.9
7 月末	12,115	18.1	11,471	16.9	99.4	0.6
8 月末	13,106	27.7	12,417	26.5	99.6	0.2
9 月末	13,213	28.8	12,422	26.6	98.9	1.0
10月末	12,838	25.1	12,076	23.1	98.7	1.2
11月末	14,414	40.5	13,558	38.2	92.4	6.9
12月末	14,777	44.0	13,888	41.5	99.4	0.2
2021年 1 月末	14,830	44.5	13,946	42.1	99.5	0.2
2 月末	15,244	48.6	14,338	46.1	99.6	0.2
(期末) 2021年 3 月22日	16,177	57.7	15,221	55.1	97.8	0.1

(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

(2020.3.24～2021.3.22)

■国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、主要国の中央銀行による金融緩和策や、新規感染者数がピークアウトの傾向を見せた欧米で経済活動の再開が進展したこと、また国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感され、6月上旬まで株価は上昇基調で推移しました。6月中旬以降は、日米における感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、株価は横ばい圏で推移しました。10月に入ると欧州において感染拡大が再び目立ち始め、10月下旬になると複数の欧州主要国において行動制限措置の再施行および制限の強化が行われたことが嫌気され、株価は下落しました。しかし11月以降は、米国大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数の新型コロナウイルスのワクチンが承認されて接種が始まったこと、さらに2021年1月には、米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、米国の経済回復への期待が高まったことが好感されて株価は上昇しました。また2月後半に入ると、これまでの上昇による高値警戒感や米国における金利上昇などが懸念され、株価は上値の重い相場が続きました。

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

(2020.3.24～2021.3.22)

■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。

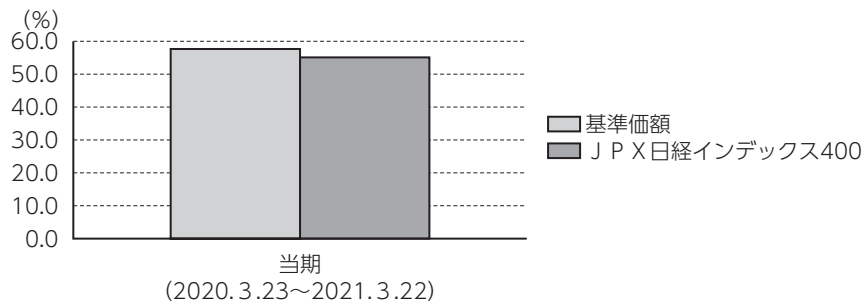
ベンチマークとの差異について

ベンチマークの騰落率は55.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は57.7%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、運用管理費用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

当作成期の1万口当り分配金（税込み）は下記「分配原資の内訳（1万口当り）」の「当期分配金（税込み）」欄をご参照ください。

収益分配金の決定根拠は下記「収益分配金の計算過程（1万口当り）」をご参照ください。

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	
	2020年3月24日 ～2021年3月22日	
当期分配金（税込み）（円）	320	
対基準価額比率（％）	1.98	
当期の収益（円）	320	
当期の収益以外（円）	—	
翌期繰越分配対象額（円）	5,857	

（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。

■収益分配金の計算過程（1万口当り）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	✓ 321.46円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,536.80
(c) 収益調整金	2,428.18
(d) 分配準備積立金	890.86
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,177.31
(f) 分配金	320.00
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	5,857.31

（注）✓を付した該当項目から分配金を計上しています。



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 (2020.3.24~2021.3.22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	97円	0.718%	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13,490円です。
(投 信 会 社)	(47)	(0.351)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(44)	(0.329)	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 会 社)	(5)	(0.038)	受託会社分は、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)	(0.000)	
(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	0.006	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)	(0.000)	信託事務の処理等に関するその他の費用
合 計	98	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。

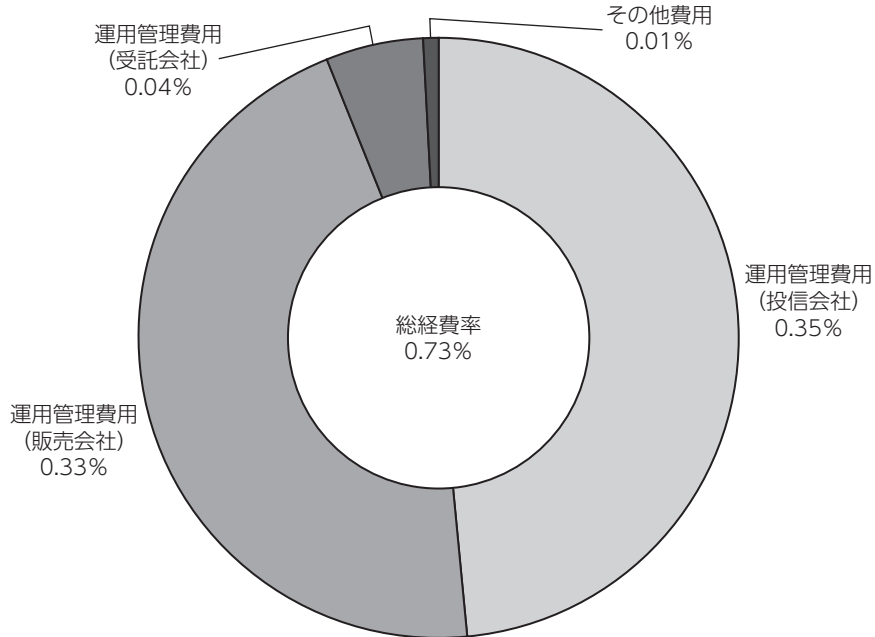
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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0.73%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

(2020年3月24日から2021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	200,042	275,110	2,536,104	3,917,460

(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

(2020年3月24日から2021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	6,577,994千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,608,455千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.42

(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

(2020年3月24日から2021年3月22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
株式	百万円 1,400	百万円 368	% 26.3	百万円 5,177	百万円 474	% 9.2
株式先物取引	3,144	—	—	3,539	—	—
コール・ローン	593,186	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合64.1%

※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

(2020年3月24日から2021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	当作成期末保有額
株式	百万円 0	百万円 8	百万円 33

(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

(2020年3月24日から2021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 12

(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 口 数	当 期 末 口 数	評 価 額 千円
	千口	千口	千円
ダイワ J P X 日経400マザーファンド	7,851,347	5,515,285	9,864,087

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021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	9,864,087	99.3
コール・ローン等、その他	70,748	0.7
投資信託財産総額	9,934,836	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

2021年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	9,934,836,751円
コール・ローン等	40,688,806
ダイワ J P X 日経400マザーファンド(評価額)	9,864,087,945
未収入金	30,060,000
(B) 負債	265,624,290
未払収益分配金	195,124,363
未払解約金	34,433,900
未払信託報酬	35,792,893
その他未払費用	273,134
(C) 純資産総額(A - B)	9,669,212,461
元本	6,097,636,351
次期繰越損益金	3,571,576,110
(D) 受益権総口数	6,097,636,351口
1万口当り基準価額(C / D)	15,857円

* 期首における元本額は8,617,545,876円、当作成期間中における追加設定元本額は902,869,645円、同解約元本額は3,422,779,170円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は15,857円です。

■損益の状況

当期 自2020年3月24日 至2021年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 7,280円
受取利息	2,822
支払利息	△ 10,102
(B) 有価証券売買損益	3,463,972,516
売買益	4,495,345,141
売買損	△1,031,372,625
(C) 信託報酬等	△ 74,179,907
(D) 当期損益金(A + B + C)	3,389,785,329
(E) 前期繰越損益金	△1,103,701,897
(F) 追加信託差損益金	1,480,617,041
(配当等相当額)	(1,381,748,951)
(売買損益相当額)	(98,868,090)
(G) 合計(D + E + F)	3,766,700,473
(H) 収益分配金	△ 195,124,363
次期繰越損益金(G + H)	3,571,576,110
追加信託差損益金	1,480,617,041
(配当等相当額)	(1,381,748,951)
(売買損益相当額)	(98,868,090)
分配準備積立金	2,090,959,069

(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	196,017,723円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	1,546,850,254
(c) 収益調整金	1,480,617,041
(d) 分配準備積立金	543,215,455
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,766,700,473
(f) 分配金	195,124,363
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,571,576,110
(h) 受益権総口数	6,097,636,351口

収 益 分 配 金 の お 知 ら せ	
1 万 口 当 り 分 配 金	320円

●<分配金再投資コース>をご利用の方の税引き分配金は、決算日現在の基準価額に基づいて自動的に再投資いたしました。

- ・分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」があります。
 - ・分配落ち後の基準価額が個別元本と同額または個別元本を上回る場合には、分配金の全額が普通分配金となります。
 - ・分配落ち後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）、残りの額が普通分配金です。
 - ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時における個々の受益者の個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の個々の受益者の個別元本となります。

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

運用報告書 第8期（決算日 2021年3月22日）

（作成対象期間 2020年3月24日～2021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。

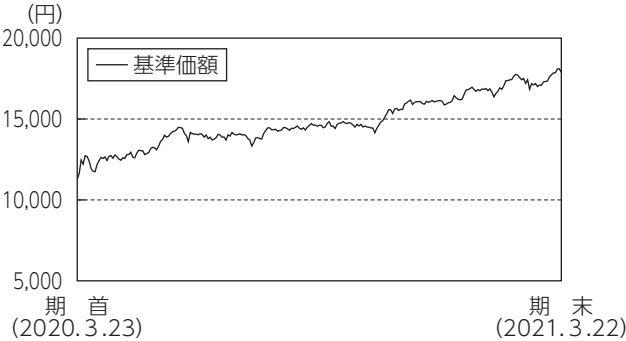
運 用 方 針	投資成果を J P X 日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株 式 組 入 制 限	無制限

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		株 式 入 率	株 先 比	式 物 率
	円	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率			
(期首)2020年 3月23日	11,262	% -	9,814	% -	97.6	% 2.4	
3月末	12,401	10.1	10,685	8.9	97.4	2.5	
4月末	12,945	14.9	11,156	13.7	97.4	2.2	
5月末	13,880	23.2	11,964	21.9	97.6	2.4	
6月末	13,876	23.2	11,940	21.7	98.8	0.9	
7月末	13,331	18.4	11,471	16.9	99.4	0.6	
8月末	14,431	28.1	12,417	26.5	99.6	0.2	
9月末	14,557	29.3	12,422	26.6	98.9	1.0	
10月末	14,153	25.7	12,076	23.1	98.7	1.2	
11月末	15,900	41.2	13,558	38.2	92.4	6.9	
12月末	16,310	44.8	13,888	41.5	99.4	0.2	
2021年 1月末	16,379	45.4	13,946	42.1	99.5	0.2	
2月末	16,845	49.6	14,338	46.1	99.6	0.2	
(期末)2021年 3月22日	17,885	58.8	15,221	55.1	95.9	0.1	

(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：11,262円 期末：17,885円 騰落率：58.8%

【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。経済の回復への期待から世界的な株高となる中で、わが国の株式市場が上昇したことを受け、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

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、主要国の中央銀行による金融緩和策や、新規感染者数がピークアウトの傾向を見せた欧米で経済

活動の再開が進展したこと、また国内でも5月下旬に緊急事態宣言が全面解除されたことなどが好感され、6月上旬まで株価は上昇基調で推移しました。6月中旬以降は、日米における感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、株価は横ばい圏で推移しました。10月に入ると欧州において感染拡大が再び目立ち始め、10月下旬になると複数の欧州主要国において行動制限措置の再施行および制限の強化が行われたことが嫌気され、株価は下落しました。しかし11月以降は、米大統領選挙において民主党のバイデン氏が事前予想通りの当選確実となって選挙に対する不確実性が後退したことや、欧米において複数の新型コロナウイルスのワクチンが承認されて接種が始まったこと、さらに2021年1月には、米国ジョージア州における上院決選投票で民主党候補が勝利し、大統領府および上下両院共に民主党が制したことで大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、米国の経済回復への期待が高まったことが好感されて株価は上昇しました。また2月後半に入ると、これまでの上昇による高値警戒感や米国における金利上昇などが懸念され、株価は上値の重い相場が続きました。

◆ 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55.1%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は58.8%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) (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	0

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております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

(2020年3月24日から2021年3月22日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株	千円	千株	千円
	649.6 (△1,031.85)	1,400,643 (-)	1,836.75	5,177,350

(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

(2020年3月24日から2021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 株式先物取引	百万円 3,144	百万円 3,539	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

(2020年3月24日から2021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
三菱UFJフィナンシャルG		128	58,877	459	NTTドコモ		69.1	264,430	3,826
日本電信電話		22.4	56,318	2,514	ソニー		16.4	159,150	9,704
キーエンス		0.6	31,304	52,173	任天堂		2.7	158,558	58,725
武田薬品		8.3	30,601	3,686	キーエンス		2.8	148,413	53,004
信越化学		1.8	29,938	16,632	ソフトバンクグループ		14.5	109,089	7,523
KDDI		9.1	28,632	3,146	日本電信電話		33	86,509	2,621
ホシザキ		2.7	28,117	10,413	リクルートホールディングス		18	82,613	4,589
伊藤園		2.7	21,752	8,056	トヨタ自動車		10.4	78,693	7,566
三浦工業		3.7	20,331	5,494	第一三共		19.8	71,542	3,613
中国電力		12.2	16,490	1,351	東京エレクトロン		1.8	62,343	34,635

(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%)				パルプ・紙 (0.2%)				第一三共	26.3	61.7	199,291
日本水産	12.5	9.6	5,452	王子ホールディングス	37.6	33.4	24,782	大塚ホールディングス	17.5	15.8	74,023
マルハニチロ	1.8	1.6	4,396	化学 (7.7%)				ペプチドリーム	4.6	—	—
鉱業 (0.2%)				クラレ	14.2	11.7	15,642	石油・石炭製品 (0.6%)			
国際石油開発帝石	50	37.9	30,585	旭化成	59.6	49.2	66,223	出光興産	10.3	8.4	24,637
建設業 (2.4%)				昭和電工	6.4	5.6	18,004	ENEOSホールディングス	138.2	114	58,698
安藤・間	7.4	6.6	5,953	住友化学	66.1	58.4	34,105	コスモエネルギーHDGS	2.7	2.4	6,528
東急建設	3.7	3	1,911	日産化学	5	4.1	24,518	ゴム製品 (0.7%)			
コムシスホールディングス	4.4	3.6	12,114	東ソー	13.9	11.5	25,277	横浜ゴム	5.3	4.4	8,311
東建コーポレーション	—	0.3	3,330	トクヤマ	2.6	2.2	6,369	TOYO TIRE	—	4	7,856
大成建設	9.6	7.4	32,375	デンカ	3.3	2.7	12,096	ブリヂストン	26.5	20.2	89,001
大林組	28.8	23.8	25,156	信越化学	15.4	13.7	250,367	住友ゴム	8.3	6.8	8,309
清水建設	29.2	22.3	20,805	エア・ウォーター	8.4	7.6	15,868	ガラス・土石製品 (0.8%)			
長谷工コーポレーション	11.1	7.8	12,760	日本酸素HLDGS	8.6	6.1	12,852	AGC	9.1	7	30,485
鹿島建設	22.6	17.4	27,927	三菱瓦斯化学	8.4	7.4	20,816	太平洋セメント	5.8	4.5	13,500
西松建設	2.2	1.7	5,108	三井化学	8.2	6.4	23,488	東海カーボン	9.6	7.4	12,950
三井住友建設	7	5.7	3,066	JSR	8.4	7.4	25,530	OTOO	6.6	5.4	36,234
前田建設	7.2	6	6,000	三菱ケミカルHLDGS	60.1	49.6	43,633	日本硝子	11.2	8.3	17,405
戸田建設	12	9.9	8,573	KHネオケム	—	1.2	3,561	日本特殊陶業	7.1	5.8	11,431
熊谷組	1.3	1.1	3,591	ダイセル	12.3	10	8,900	ニチアス	2.5	1.9	5,568
大東建託	3.5	2.6	31,122	積水化学	19.3	15.7	33,927	鉄鋼 (0.6%)			
NIPPO	2.4	2	6,060	アイカ工業	2.7	2.1	8,568	日本製鉄	40.6	35.8	69,147
五洋建設	11.4	10.1	9,079	宇部興産	4.5	3.7	9,416	JFEホールディングス	24.5	21.7	30,748
住友林業	7.3	5.6	13,412	日立化成	4.2	—	—	日立金属	9.8	—	—
大和ハウス	28.5	21.9	75,248	ダイキョーニシカフ	1.9	—	—	非鉄金属 (0.7%)			
積水ハウス	31.5	25.8	59,933	日油	3.4	2.8	16,128	日本軽金属HD	23	—	—
協和エグシオ	4.4	3.6	10,666	花王	22	18.1	130,482	住友鉱山	11.6	9.6	46,492
九電工	2	1.7	6,970	日本ペイントHOLD	7.4	6.1	52,948	DOWAホールディングス	2.3	—	—
食料品 (3.4%)				関西ペイント	10.1	8.3	24,061	古河電工	2.8	2.3	6,992
森永製菓	2.2	1.8	7,479	DIC	3.8	3.1	9,238	住友電工	34	26.2	45,142
江崎グリコ	2.7	—	—	資生堂	18.2	15.1	116,783	アサヒHD	—	1.4	6,237
寿スピリッツ	—	0.7	5,376	ライオン	11.9	9.9	22,314	金属製品 (0.3%)			
カルビー	4.2	3.5	10,416	ファンケル	—	2.8	10,808	SUMCO	10.9	9.6	25,200
森永乳業	—	1.4	7,798	コーセー	1.7	1.4	23,702	三和ホールディングス	8.7	7.1	10,493
ヤクルト	6.3	5.2	30,160	ポーラ・オルビスHD	3.9	3.2	8,643	リンナイ	1.8	1.5	18,330
明治ホールディングス	6.1	5	36,100	小林製菓	2.6	2.1	21,945	東プレ	1.7	—	—
日本ハム	3.5	2.9	14,239	日東電工	6.3	4.9	45,864	機械 (5.8%)			
アサヒグループホールディン	19.3	16.6	78,501	ニフコ	3.4	2.8	11,466	日本製鋼所	—	2.3	6,012
キリンHD	39.1	32.3	70,397	ユニ・チャーム	17.7	16.1	73,834	三浦工業	—	3.2	18,848
サントリー食品インター	6.2	5.1	21,139	医薬品 (6.4%)				アマダ	11.5	11	14,300
伊藤園	—	2.3	16,008	協和キリン	9.2	7.6	24,320	FUJII	—	3	8,127
キッコーマン	6.6	5.5	35,695	武田薬品	58.7	53.2	229,079	オーエスジー	4.2	3.7	7,659
味の素	20.4	18.1	42,372	アステラス製薬	80.8	65.7	117,438	DMG森精機	5.7	4.7	8,854
キューピー	5.1	4.2	10,689	大日本住友製薬	6.8	5.6	11,373	デスコ	1.2	1	33,800
カゴメ	—	3.1	11,051	塩野義製薬	11.7	9.5	56,050	ナブテスコ	5.4	4.4	22,088
アリアケジャパン	0.8	0.7	4,725	日本新薬	2.4	2.1	16,905	三井海洋開発	1	—	—
ニチレイ	4.4	3.6	10,328	中外製薬	9.6	23.7	105,607	SMC	2.9	2.2	138,666
東洋水産	4.7	3.9	18,408	科研製薬	1.6	1.3	5,999	小松製作所	41.6	34.3	116,311
日清食品HD	3.9	3	24,780	エーザイ	11	8.4	63,025	住友重機械	5.3	4.3	13,566
日本たばこ産業	53.2	40.8	86,577	ロート製薬	—	3.6	11,160	日立建機	3.7	3.5	12,145
繊維製品 (0.4%)				小野薬品	21.1	17.4	51,112	ハーモニック・ドライブ・シス	1.9	—	—
帝人	7.3	7	13,951	久光製薬	2.4	2.2	16,346	クボタ	48.7	39.8	98,266
東レ	65.1	53.7	39,748	参天製薬	17.1	13.2	20,658	ダイキン工業	11.7	9.7	215,534
ゴルドウイン	1.6	1.2	8,736	沢井製薬	1.9	1.7	9,214	ダイフク	4.7	4.2	43,344

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	1.5	1.3	4,095	輸送用機器 (5.8%)				南海電鉄	—	4.5	12,411
T P R	1.2	—	—	トヨタ紡織	2.7	2.2	4,067	京阪ホールディングス	5.2	4.3	21,973
ホシザキ	—	2.4	23,952	豊田自動織機	7.4	6.1	60,756	名古屋鉄道	9.5	7.9	22,048
日本精工	17.3	15.6	18,127	デンソー	20.2	16.7	122,745	日本通運	3.1	2.5	21,275
ジェイテクト	8.8	—	—	川崎重工業	7.1	—	—	ヤマトホールディングス	15.2	10.1	30,350
T H K	5.3	4.7	17,437	いすゞ自動車	26.6	22	24,904	山九	2.4	1.8	9,270
マキタ	12	9.9	47,866	トヨタ自動車	35.2	26.1	218,248	日立物流	1.6	1.6	5,944
三菱重工業	15.4	11.9	42,756	日野自動車	11.5	9.5	9,709	九州旅客鉄道	—	5.6	16,038
I H I	6.6	5.1	11,969	アイシン精機	7.6	5.5	22,220	空運業 (0.6%)			
電気機器 (17.6%)				マツダ	27	23.8	21,610	日本航空	15.7	17.5	48,037
コニカミノルタ	20.1	—	—	本田技研	72.3	59.7	199,696	ANAホールディングス	15.9	19.4	54,426
ブラザー工業	11.2	9.3	23,240	スズキ	18.2	15	70,200	情報・通信業 (8.0%)			
ミネベアミツミ	17	13.1	36,680	S U B A R U	28.5	21.7	47,967	システナ	—	2.7	5,867
日立	44.1	36.4	196,851	ヤマハ発動機	12	10.7	28,815	日鉄ソリューションズ	1.4	1.1	3,949
三菱電機	91.8	75.8	131,854	豊田合成	3	2.4	7,168	T I S	3	7.4	18,884
富士電機	5.5	4.6	21,735	シマノ	3.4	2.8	71,274	コーエーテックモHD	—	1.5	10,320
安川電機	9.9	8.2	43,706	テイ・エス・テック	2.1	1.8	6,219	ネクソン	25.7	18.8	65,706
東芝テック	1.2	0.8	3,376	精密機器 (2.9%)				コロプラ	3	—	—
日本電産	11.1	18.2	242,060	テルモ	26	23.2	89,784	ティアーガイア	0.8	0.8	1,632
日新電機	2.2	—	—	島津製作所	11	9.8	38,318	ガハホ・オンライン・エンター	2.2	1.8	4,060
オムロン	8.2	6.3	56,448	ブイ・テクノロジー	0.4	0.4	2,244	GMOペイメントゲートウェイ	1.5	1.6	22,896
MC J	—	2.4	2,440	東京精密	1.7	1.3	6,747	アカツキ	0.3	0.3	1,435
日本電気	11.1	9.6	64,992	ニコン	14.9	11.6	11,785	野村総合研究所	12.8	13.6	46,308
富士通	8.9	6.8	110,398	オリンパス	50.8	41.9	98,821	インフォコム	—	0.7	2,016
ルネサスエレクトロニクス	43.9	32.6	38,076	HOYA	18.3	15	191,100	オービック	3.1	2.3	45,241
セイコーエプソン	11.4	9.4	17,061	朝日インテック	10.4	8	24,720	ジャストシステム	—	1.1	6,677
アルパック	1.7	1.4	6,223	その他製品 (1.9%)				Zホールディングス	123.8	102.2	57,886
エレコム	1	0.9	4,653	バンダイナムコHLDGS	9.5	6.3	50,059	トレンドマイクロ	4	4	22,240
パナソニック	104.9	80.8	112,716	パイロットコーポレーション	1.5	1.3	4,777	日本オラクル	1.8	1.5	16,320
シャープ	—	8.8	16,385	タカラトミー	4.1	—	—	伊藤忠テクノソリューションズ	4.1	3.4	12,104
アンリツ	—	4.6	11,247	ヤマハ	5.5	4.5	27,405	大塚商会	4.9	4	20,200
富士通ゼネラル	2.5	—	—	ビジョン	5.5	4.9	20,139	東映アニメーション	—	0.3	3,324
ソニー	39.3	24.8	284,208	任天堂	5.6	3.1	195,238	デジタルガレージ	1.6	1.2	5,136
T D K	4.4	3.7	56,425	電気・ガス業 (1.3%)				日本ユニシス	2.8	2.6	9,100
アルプスアルパイン	8.1	6.2	9,275	中部電力	28.1	23.2	33,616	日本テレビHLD S	7.5	—	—
ヒロセ電機	1.4	—	—	関西電力	34.8	28.7	35,544	日本電信電話	91.7	81.1	239,001
横河電機	8.4	7.6	16,051	中国電力	—	10.9	15,281	K D D I	67.2	59.6	207,944
アズビル	5.8	5.1	24,811	東北電力	22.9	17.8	19,419	光通信	0.9	0.9	19,917
日本光電工業	3.8	3.1	9,873	九州電力	18.9	16.7	18,553	N T T コモ	66.6	—	—
堀場製作所	1.8	1.5	10,740	北海道電力	—	7.1	3,727	東宝	5.3	4.4	18,942
アドバンテスト	6.8	5.6	50,792	電源開発	7.3	6	11,688	N T T データ	24	19.8	33,957
キーエンス	6.6	4.4	220,528	東京瓦斯	17.7	14.6	36,456	スクウェア・エニックス・HD	3.8	3.2	20,928
シスメックス	6.6	5.9	67,909	大阪瓦斯	17.8	13.7	29,948	カブコン	4.2	3.2	22,304
O B A R A G R O U P	0.5	0.4	1,610	陸運業 (4.1%)				S C S K	2.1	1.7	11,203
レーザーテック	4	3.3	42,933	東武鉄道	9.7	7.9	24,845	コナミホールディングス	3.3	2.7	18,198
スタンレー電気	6.5	5.3	17,940	相鉄ホールディングス	3.9	3.5	9,278	ソフトバンクグループ	43.3	30.8	303,811
カシオ	8.1	6.1	12,462	東急	23.2	19.1	29,318	卸売業 (5.1%)			
ファナック	8.7	6.7	173,329	小田急電鉄	13.7	12.1	38,417	双日	50	41.2	13,472
浜松トニックス	6.6	5.4	35,910	京王電鉄	4.8	4.2	32,172	アルフレッサホールディングス	10.1	7.7	16,940
京セラ	12.9	11.6	85,979	京成電鉄	6.4	5.7	21,118	神戸物産	3.1	5.2	15,464
太陽誘電	4.1	3.4	18,700	東日本旅客鉄道	16.2	13.3	112,278	ダイワボウHD	0.8	0.7	6,713
村田製作所	27	22.3	201,815	西日本旅客鉄道	8.2	6.8	45,791	T O K A I ホールディングス	4.8	3.6	3,484
小糸製作所	5.5	4.5	35,100	東海旅客鉄道	7.6	6.3	113,179	シップヘルスケアHD	1.4	1.3	8,346
S C R E E N ホールディングス	1.6	1.3	11,713	西武ホールディングス	12.3	9.1	11,975	コメダホールディングス	2	1.6	3,422
キャノン	49.4	37.7	89,895	近鉄グループHLDGS	8.7	7.2	32,904	第一興商	1.8	1.5	6,705
東京エレクトロン	6.1	4.4	182,600	阪急阪神HLDGS	11.6	9.6	36,288	メディアバルHD	9.8	7.5	17,212

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
日本ライフライン	2.7	2.4	3,652	三井住友トラストHD	17.1	14.1	58,444	エムスリー	19.3	12.8	94,310
伊藤忠	63.3	52.2	186,510	三井住友フィナンシャルG	60.7	53	228,006	アウトソーシング	5	4.1	7,486
丸紅	94.2	73.6	70,052	千葉銀行	31.2	24.9	19,870	ディー・エヌ・エー	4.3	—	—
豊田通商	10.1	7.5	35,662	ふくおかフィナンシャルG	—	6.7	15,992	博報堂DYHLDGS	12.2	10.1	19,392
兼松	3.4	3	4,728	セブン銀行	30.3	25	6,800	電通グループ	9	8.1	31,914
三井物産	79.5	60.6	144,500	みずほフィナンシャルG	1,230.8	101.6	172,872	オリエンタルランド	9.3	7.7	130,630
日立ハイテク	3.1	—	—	証券・商品先物取引業 (0.9%)				リゾートトラスト	4	—	—
住友商事	57.1	47.1	76,937	F P G	2.8	2.3	1,683	ユー・エス・エス	9.8	8.1	17,026
三菱商事	63.5	45.5	149,103	S B Iホールディングス	10.1	9.2	30,268	サイバーエージェント	5	—	—
岩谷産業	2	1.8	11,898	大和証券G本社	72.7	56	33,348	楽天	40.9	33.8	50,024
P A L T A C	1.4	1.2	6,936	野村ホールディングス	159.4	114.1	79,972	エン・ジャパン	1.6	1.3	4,134
日鉄物産	0.6	0.5	2,180	松井証券	5.2	—	—	テクノロ・ホールディング	1.8	1.4	12,362
ミスミグループ本社	11.3	9.4	30,973	保険業 (2.3%)				アイ・アールジャパンHD	—	0.3	3,903
小売業 (4.7%)				SOMPOホールディングス	17	13.2	58,198	リクルートホールディングス	62.9	47.9	245,727
ローソン	2.3	1.9	10,203	M S & A D	23.7	18.2	62,553	ペイカレントコンサルティング	—	0.5	12,300
エービーシー・マート	1.4	1.2	7,920	S O N Y F H	7.4	—	—	リロググループ	4.8	4	9,012
日本マクドナルドHLDG	3.8	3.1	15,903	第一生命HLDGS	51.3	39.5	78,723	エイチ・アイ・エス	—	1.1	2,644
セリア	2.2	1.8	6,759	東京海上HD	32.4	24.8	132,903	カナモト	1.4	1.3	3,770
ビックカメラ	5.4	4.4	5,750	T & Dホールディングス	27.1	22.3	32,937	セコム	9.3	7.1	66,576
MonotaRO	6.4	5.3	31,694	その他金融業 (1.3%)				メイテツク	1.1	0.9	5,562
J. フロントリテイリング	10.8	8.9	10,519	全国保証	2.6	1.9	9,956	合 計	株数・金額	千株	千円
マツモトキヨシHLDGS	3.7	3.1	15,934	芙蓉総合リース	0.9	0.8	6,520	株数、金額	7,650.4	5,431.4	15,902,546
Z O Z O	6.2	4.4	14,498	東京センチュリー	1.8	1.7	12,342	銘柄数<比率>	399銘柄	399銘柄	<95.9%>
ウエルシアHD	2.7	3.9	14,839	イオンフィナンシャルサービス	5.5	4.6	7,291	(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。			
クリエイトSDH	1.5	1.1	4,081	アコム	—	15	8,115	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。			
すかいらーくHD	10.1	8.4	14,624	オリコ	24.5	20.2	3,353	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。			
コスモス薬品	0.4	0.8	13,864	オリックス	56.7	45.4	88,757				
セパン&アイ・HLDGS	35.4	29.2	130,319	三菱UFJリース	23	16.9	11,711				
ツルハホールディングス	2	1.6	23,120	日本取引所グループ	26	20.2	51,166				
クスリのアオキHLDGS	0.8	0.7	5,971	不動産業 (2.4%)							
スノーグローバルHLDGS	—	4.1	19,823	いちご	11.5	8.3	2,813				
ノジマ	1.6	1.3	4,069	ヒューリック	18.9	15.9	20,717				
良品計画	12	9.9	27,254	野村不動産HLDGS	5.5	4.5	12,181				
パナソニックHD	19.9	14.9	37,667	プレサンスコーポレーション	1.5	—	—				
ゼンショーホールディングス	4.3	4	12,200	オープンハウス	2.6	2.4	11,628				
ワークマン	0.9	1	8,050	東急不動産HD	24.6	20.3	13,783				
ユナイテッドアローズ	0.9	—	—	飯田GHD	7.6	6.2	17,229				
スギホールディングス	1.8	1.5	13,005	パーク24	4.9	4	8,828				
ファミリーマート	7.2	—	—	三井不動産	44.7	34.1	89,819				
しまむら	1.1	—	—	三菱地所	63.5	49.1	95,794				
丸井グループ	8.3	6.3	14,452	東京建物	9.7	7.4	12,742				
イオン	34.8	28.7	93,590	住友不動産	20.4	16.8	67,099				
イズミ	1.8	1.5	6,937	スターツコーポレーション	1.2	0.9	2,835				
ヤオコー	1	0.8	5,552	イオンモール	4.5	3.7	7,063				
ケーズホールディングス	8.7	6.6	10,302	日本空港ビルデング	2.9	2.5	13,225				
アインホールディングス	1.1	1	7,160	サービス業 (5.2%)							
ニトリホールディングス	3.9	3	63,465	ミクシィ	2.2	1.8	5,349				
ファーストリテイリング	1.2	1	86,890	ジェイエイシリアルメント	0.6	—	—				
サンドラッグ	3.4	2.8	11,606	日本M&Aセンター	6.6	5.9	36,167				
銀行業 (5.7%)				U T グループ	1.4	1	3,665				
めぶきフィナンシャルG	47.1	38.8	11,135	エス・エム・エス	2.7	2.5	8,200				
コンコディア・フィナンシャル	53.3	45.5	22,295	パーソルホールディングス	8.8	7.2	15,573				
新生銀行	6.6	6.1	11,699	総合警備保障	3.5	2.9	15,312				
あおぞら銀行	5.4	4.5	12,069	カカフコム	6.6	5.4	17,280				
三菱UFJフィナンシャルG	456.9	479.1	313,283	ディップ	1.2	1.1	3,421				
りそなホールディングス	99.4	81.3	40,154	ベネフィット・ワン	3.2	2.6	7,644				

■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 662,900 (77,400)	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77,400株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2021年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 15,902,546	% 86.1
コール・ローン等、その他	2,561,647	13.9
投資信託財産総額	18,464,193	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

2021年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	18,658,908,742円
コール・ローン等	1,885,569,657
株式(評価額)	15,902,546,520
未収入金	651,379,364
未収配当金	18,944,625
未収利息	112,788
その他未収収益	5,640,788
差入委託証拠金	194,715,000
(B) 負債	2,079,104,439
未払金	2,211,000
未払解約金	42,805,775
差入委託証拠金代用有価証券	196,135,000
受入担保金	1,837,952,664
(C) 純資産総額(A－B)	16,579,804,303
元本	9,270,336,794
次期繰越損益金	7,309,467,509
(D) 受益権総口数	9,270,336,794口
1万口当り基準価額(C／D)	17,885円

* 期首における元本額は11,743,469,789円、当作成期間中における追加設定元本額は1,836,393,176円、同解約元本額は4,309,526,171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) 306,618,342円、iFree J P X 日経400インデックス855,846,102円、ダイワ J P X 日経400ファンド(適格機関投資家専用) 220,013,122円、ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド 60,544,231円、ダイワ J P X 日経400ファンド5,515,285,404円、ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 2,312,029,593円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は17,885円です。

■損益の状況

当期 自2020年3月24日 至2021年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	375,723,234円
受取配当金	349,741,307
受取利息	2,583,025
その他収益金	24,433,829
支払利息	△ 1,034,927
(B) 有価証券売買損益	6,774,425,604
売買益	6,854,387,717
売買損	△ 79,962,113
(C) 先物取引等損益	93,430,500
取引益	109,997,700
取引損	△ 16,567,200
(D) その他費用	△ 70,693
(E) 当期損益金(A + B + C + D)	7,243,508,645
(F) 前期繰越損益金	1,481,494,307
(G) 解約差損益金	△2,332,807,146
(H) 追加信託差損益金	917,271,703
(I) 合計(E + F + G + H)	7,309,467,509
次期繰越損益金(I)	7,309,467,509

(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。