

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、分配を行なわないことがあります。 | |

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/>

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 総 |
|-----------------|--------|------------|-----------|----------------|-----------|------------|------------|-----------|
| | (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 |
| 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 |
| 7期末(2020年3月23日) | 11,566 | 0 | △17.9 | 10,438 | △19.7 | 97.6 | 2.4 | 2,993 |
| 8期末(2021年3月22日) | 18,287 | 0 | 58.1 | 16,189 | 55.1 | 95.9 | 0.1 | 4,135 |

(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。

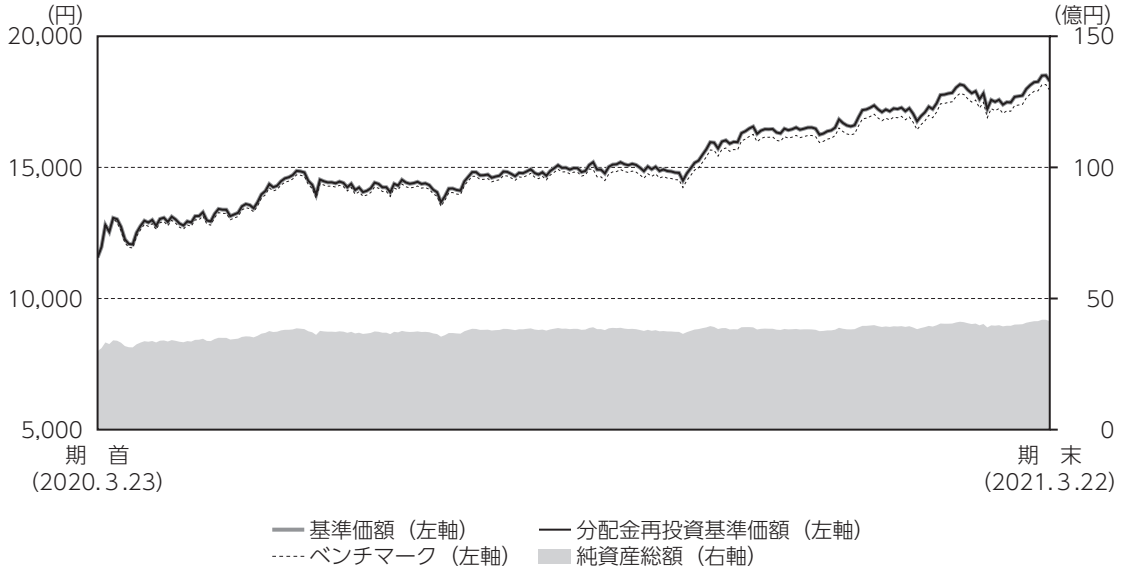
【注記】

- ・「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。



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：11,566円

期末：18,287円（分配金0円）

騰落率：58.1%（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。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・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) 2020年 3月23日 | 円 11,566 | % - | 10,438 | % - | % 97.6 | % 2.4 |
| 3 月末 | 12,735 | 10.1 | 11,364 | 8.9 | 97.4 | 2.5 |
| 4 月末 | 13,289 | 14.9 | 11,865 | 13.7 | 97.4 | 2.2 |
| 5 月末 | 14,243 | 23.1 | 12,725 | 21.9 | 97.6 | 2.4 |
| 6 月末 | 14,234 | 23.1 | 12,699 | 21.7 | 98.8 | 0.9 |
| 7 月末 | 13,670 | 18.2 | 12,200 | 16.9 | 99.4 | 0.6 |
| 8 月末 | 14,792 | 27.9 | 13,207 | 26.5 | 99.6 | 0.2 |
| 9 月末 | 14,916 | 29.0 | 13,212 | 26.6 | 98.9 | 1.0 |
| 10月末 | 14,496 | 25.3 | 12,844 | 23.1 | 98.7 | 1.2 |
| 11月末 | 16,279 | 40.7 | 14,421 | 38.2 | 92.4 | 6.9 |
| 12月末 | 16,693 | 44.3 | 14,771 | 41.5 | 99.4 | 0.2 |
| 2021年 1 月末 | 16,758 | 44.9 | 14,833 | 42.1 | 99.5 | 0.2 |
| 2 月末 | 17,228 | 49.0 | 15,250 | 46.1 | 99.6 | 0.2 |
| (期末) 2021年 3月22日 | 18,287 | 58.1 | 16,189 | 55.1 | 95.9 | 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、株価は上値の重い展開となりました。

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。

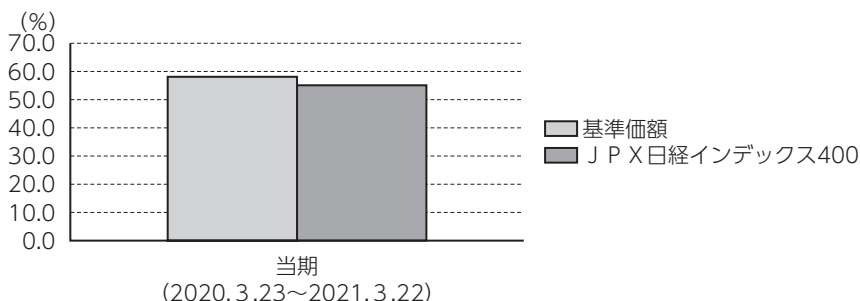
ベンチマークとの差異について

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58.1%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、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 | |
|------------|---------------------------|-------|
| | 2020年3月24日 ～2021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） | 8,286 |

(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 (2020.3.24~2021.3.22) | | 項 目 の 概 要 |
|---------------|------------------------------|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| 信 託 報 酬 | 67円 | 0.439% | 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15,231円です。 |
| (投 信 会 社) | (33) | (0.214) | 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) | (29) | (0.192) | 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) | (0.033) | 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 | 68 | 0.446 | |

(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。

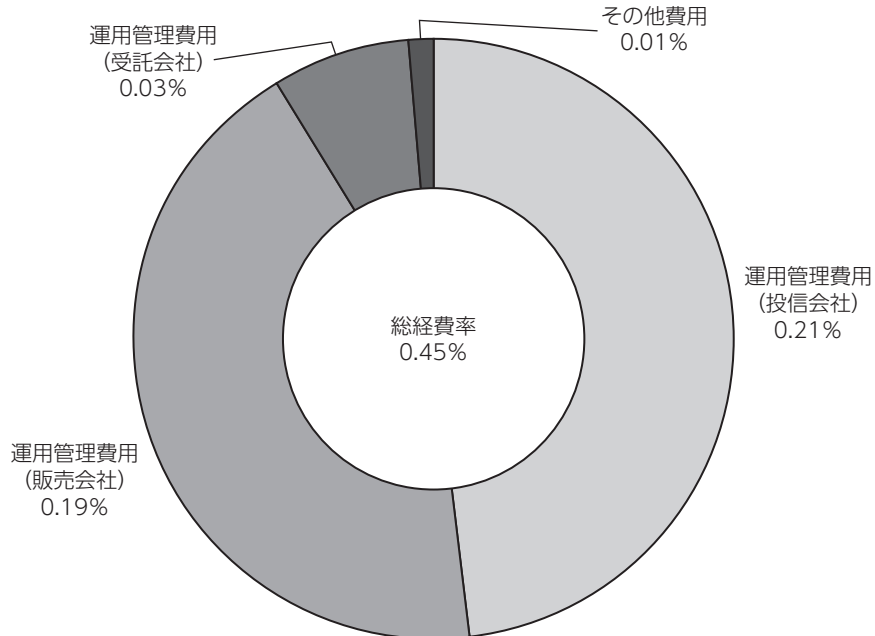
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.45%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 | 114,251 | 158,740 | 460,301 | 705,800 |

(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 | | | | | |
|---------|--------------|----------------|-----------|--------------|----------------|----------|
| | 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 |
| 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23.3%

*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

(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 | 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 | 2,658,079 | 2,312,029 | 4,135,064 |

(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 | 4,135,064 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 15,898 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 4,150,963 100.0 |

(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 | 4,150,963,659円 |
| コール・ローン等 | 9,218,732 |
| ダイワJ P X日経400マザーファンド(評価額) | 4,135,064,927 |
| 未収入金 | 6,680,000 |
| (B) 負債 | 15,798,683 |
| 未払解約金 | 7,250,637 |
| 未払信託報酬 | 8,442,600 |
| その他未払費用 | 105,446 |
| (C) 純資産総額(A - B) | 4,135,164,976 |
| 元本 | 2,261,285,323 |
| 次期繰越損益金 | 1,873,879,653 |
| (D) 受益権総口数 | 2,261,285,323口 |
| 1万口当り基準価額(C / D) | 18,287円 |

*期首における元本額は2,588,179,422円、当作成期間中における追加設定元本額は280,379,228円、同解約元本額は607,273,327円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は18,287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 | △ 1,796円 |
| 受取利息 | 374 |
| 支払利息 | △ 2,170 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,450,462,299 |
| 売買益 | 1,672,187,828 |
| 売買損 | △ 221,725,529 |
| (C) 信託報酬等 | △ 16,684,126 |
| (D) 当期損益金(A + B + C) | 1,433,776,377 |
| (E) 前期繰越損益金 | △ 271,094,870 |
| (F) 追加信託差損益金 | 711,198,146 |
| (配当等相当額) | (528,910,048) |
| (売買損益相当額) | (182,288,098) |
| (G) 合計(D + E + F) | 1,873,879,653 |
| 次期繰越損益金(G) | 1,873,879,653 |
| 追加信託差損益金 | 711,198,146 |
| (配当等相当額) | (528,910,048) |
| (売買損益相当額) | (182,288,098) |
| 分配準備積立金 | 1,162,683,303 |
| 繰越損益金 | △ 1,796 |

(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 | 822,225,706 |
| (c) 収益調整金 | 711,198,146 |
| (d) 分配準備積立金 | 340,457,597 |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 1,873,881,449 |
| (f) 分配金 | 0 |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f) | 1,873,881,449 |
| (h) 受益権総口数 | 2,261,285,323口 |

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。

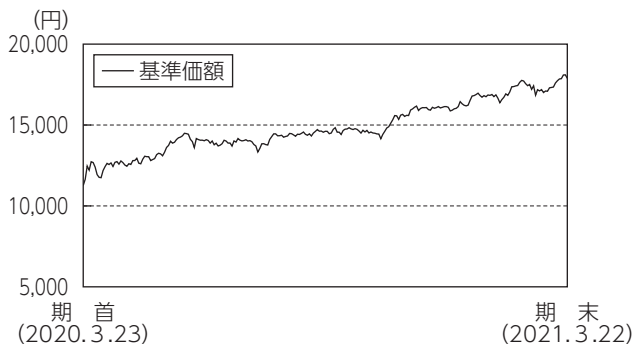
| | |
|--------|---|
| 運用方針 | 投資成果を J P X日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。 |
| 主要投資対象 | わが国の金融商品取引所上場株式 (上場予定を含みます。) |
| 株式組入制限 | 無制限 |

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 (ベンチマーク) | | 株 式 先 比 | 式 入 率 | 株 先 比 | 式 物 率 |
|----------------|--------|------|-------------------------------|------|---------|-------|-------|-------|
| | 円 | % | ベンチマーク | % | | | | |
| (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

活動の再開が進化したこと、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」

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、ベンチマークと乖離しました。

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 |
| | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| 国内 | 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 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| 株式先物取引 | 3,144 | 3,539 | - | - |

(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 | 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 (0.1%) | | | | 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%) | | | |
| 長谷江コーポレーション | 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 | J S R | 8.4 | 7.4 | 25,530 | TOTO | 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 | ダイキョーニシカワ | 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 | DI C | 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グス | 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 | F U J I | - | 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 | ナプテスコ | 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 | S M C | 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・システムズ | 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 |
| ゴールドウイン | 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 |

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 |
| | 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%) | | | | コロブラ | 3 | — | — |
| 日本電産 | 11.1 | 18.2 | 242,060 | テルモ | 26 | 23.2 | 89,784 | ティーガイア | 0.8 | 0.8 | 1,632 |
| 日新電機 | 2.2 | — | — | 島津製作所 | 11 | 9.8 | 38,318 | ガハ・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 |
| サイコーエプソン | 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 |
| アルバック | 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 | パンダイナムコ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 | 日本オラルク | 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 | カブコム | 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 |
| 浜松ホトニクス | 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 | メディカル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 | 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DHYLDGS | 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%) | | | | | | | S O M P O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 | | | | | |
| エーピーシー・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%) | | | | | | メイテック | 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 | 7,650.4 | 5,431.4 | 15,902,546 | | | | |
| 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 | | | | 銘柄数<比率> | 399銘柄 | 399銘柄 | <95.9%> | | | | | |
| ZOZO | 6.2 | 4.4 | 14,498 | | | | 東京センチュリー | 1.8 | 1.7 | 12,342 | | | | | | | | | | | | |
| 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 | | | | | | | | | | | | |
| クリエイトSDH | 1.5 | 1.1 | 4,081 | | | | アコム | - | 15 | 8,115 | | | | | | | | | | | | |
| すかいらーくHD | 10.1 | 8.4 | 14,624 | | | | オリコ | 24.5 | 20.2 | 3,353 | | | | | | | | | | | | |
| コスモス薬品 | 0.4 | 0.8 | 13,864 | | | | オリックス | 56.7 | 45.4 | 88,757 | | | | | | | | | | | | |
| ツルパ&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 | | | | プラススコポリューション | 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 | | | | | | | | | | | | |
| ケースホールディングス | 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 | | | | ジェイエイシールイトメント | 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%) | | | | | | | UTグループ | 1.4 | 1 | 3,665 | | | | | | | | | | | | |
| めびきフィナンシャルG | 47.1 | 38.8 | 11,135 | | | | エス・エム・エス | 2.7 | 2.5 | 8,200 | | | | | | | | | | | | |
| コンコルディア・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 | | | | | | | | | | | | |

(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 | 19 | - |

(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 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】

- ・「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。