

ダイワ・ノーロード 日経225ファンド

運用報告書(全体版) 第6期

(決算日 2021年9月21日)

(作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21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、わが国の株式に投資し、投資成果を日経平均株価（日経225）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9年9カ月間（2015年12月9日～2025年9月19日）		
運用方針	投資成果を日経平均株価（日経225）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	ストックインデックス225・マザーファンドの受益証券	
	ストックインデックス225・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄	
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、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。		

最近5期の運用実績

決算期	基準価額			日経平均株価		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(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			
2 期末 (2017年 9月19日)	円 10,647	円 0	% 24.7	円 20,299.38	% 23.1	% 97.2	% 1.8	百万円 379
3 期末 (2018年 9月19日)	12,590	0	18.2	23,672.52	16.6	97.8	1.1	728
4 期末 (2019年 9月19日)	11,914	0	△ 5.4	22,044.45	△ 6.9	98.3	0.9	864
5 期末 (2020年 9月23日)	12,831	0	7.7	23,346.49	5.9	98.3	0.6	824
6 期末 (2021年 9月21日)	16,578	0	29.2	29,839.71	27.8	97.8	1.5	1,192

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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。

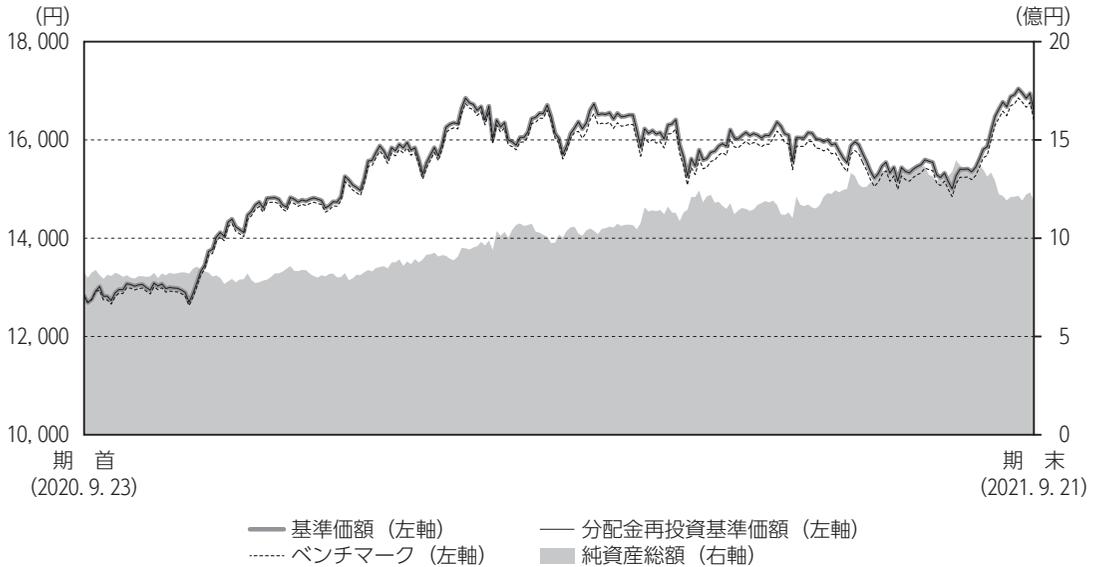
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



(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。
- * ベンチマークは日経平均株価です。

■ 基準価額・騰落率

期首：12,831円

期末：16,578円（分配金0円）

騰落率：29.2%（分配金込み）

■ 基準価額の変動要因

ベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ノーロード 日経225ファンド

年 月 日	基 準 価 額		日 経 平 均 株 価		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
	円	%	円	%	%	%
(期首)2020年9月23日	12,831	—	23,346.49	—	98.3	0.6
9月末	12,819	△ 0.1	23,185.12	△ 0.7	98.0	2.0
10月末	12,700	△ 1.0	22,977.13	△ 1.6	98.0	1.9
11月末	14,618	13.9	26,433.62	13.2	98.5	1.4
12月末	15,189	18.4	27,444.17	17.6	98.7	1.3
2021年1月末	15,302	19.3	27,663.39	18.5	97.9	2.1
2月末	16,026	24.9	28,966.01	24.1	99.0	1.0
3月末	16,227	26.5	29,178.80	25.0	96.8	3.2
4月末	16,020	24.9	28,812.63	23.4	97.4	2.5
5月末	16,045	25.0	28,860.08	23.6	98.2	1.8
6月末	16,009	24.8	28,791.53	23.3	98.3	1.7
7月末	15,163	18.2	27,283.59	16.9	98.2	1.8
8月末	15,610	21.7	28,089.54	20.3	98.4	1.6
(期末)2021年9月21日	16,578	29.2	29,839.71	27.8	97.8	1.5

(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. 9. 24 ~ 2021. 9. 21)

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、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年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当選確実となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた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、大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方に不透明感が増したこと、また世界的にインフレ懸念が台頭して米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことなどから、上値の重い展開となりました。9月に入ると、菅首相が自民党総裁選挙への不出馬を表明したことを受けて、来たる衆議院選挙での自民党大敗リスクが後退したことや新たな経済対策による景気回復期待などを背景に上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れて運用を行ってまいります。

ストックインデックス225・マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ポートフォリオについて

(2020. 9. 24 ~ 2021. 9. 21)

当ファンド

「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券をほぼ100%組み入れて運用を行いました。

■ストックインデックス225・マザーファンド

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、当作成期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、ベンチマーク採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行い、ベンチマークの動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当作成期につきましては、原則として、ベンチマークに採用されている全銘柄を組み入れて運用を行いました。

また、ベンチマーク採用銘柄の入替え時には、その都度、組入銘柄の入替えを行い、連動性の維持に努めました。

* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

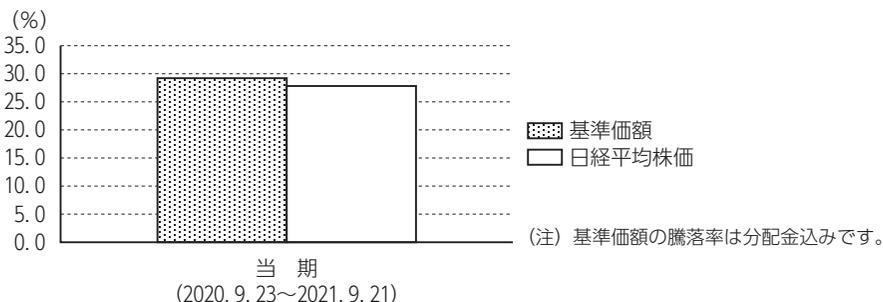
組入ファンド	ベンチマーク
ストックインデックス225・マザーファンド	日経平均株価

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は27.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.2%となりました。

ほぼ100%組み入れているマザーファンドに組入銘柄の配当金が計上されたのに対し、ベンチマークである日経平均株価には配当金の影響が考慮されていないことが、プラスの乖離要因となりました。また、ファンドから運用管理費用が控除されたことがマイナス要因となりました。

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。



* ベンチマークは日経平均株価です。

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、収益の分配は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9月24日 ～2021年9月21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）	6,578

- （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

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして「ストックインデックス225・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れて運用を行ってまいります。

ストックインデックス225・マザーファンド

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2020. 9. 24～2021. 9. 21)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	84円	0.547%	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15,392円です。
(投 信 会 社)	(40)	(0.263)	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)	(39)	(0.252)	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	0.001	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)	(0.006)	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	85	0.554	

(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。

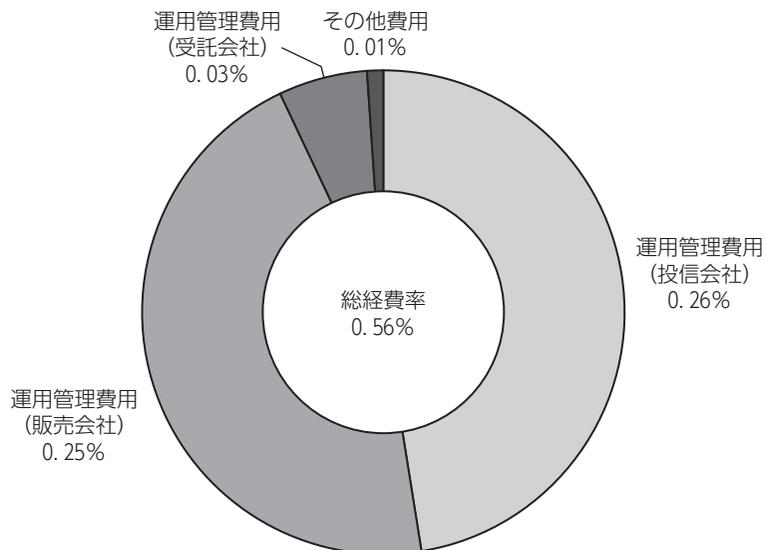
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.56%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9月24日から2021年9月21日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数 千口	金 額 千円	□ 数 千口	金 額 千円
ストックインデックス225・マザーファンド	537,746	1,942,449	506,444	1,826,319

(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9月24日から2021年9月21日まで)

項 目	当 期
	ストックインデックス225・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	56,422,158千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	175,483,133千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.32

(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9月24日から2021年9月21日まで)

決 算 期	当 期					
	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 22,448	百万円 6,253	% 27.9	百万円 33,973	百万円 11,695	% 34.4
株式先物取引	70,102	6,255	8.9	69,189	4,099	5.9
コール・ローン	2,142,077	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合0.6%

※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9月24日から2021年9月21日まで)

種 類	当 期		
	ストックインデックス225・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 15	百万円 21	百万円 156

(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って発行される有価証券

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

種 類	当 期
	ストックインデックス225・マザーファンド
	買 付 額
株式	百万円 294

(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

(2020年9月24日から2021年9月21日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	15千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	7.1%

(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	
	□ 数	□ 数	評 価 額
ストックインデックス225・マザーファンド	千口 275,864	千口 307,165	千円 1,192,571

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ストックインデックス225・マザーファンド	1,192,571	98.4
コール・ローン等、その他	19,636	1.6
投資信託財産総額	1,212,207	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9月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,212,207,802円
コール・ローン等	5,636,801
ストックインデックス225・マザーファンド(評価額)	1,192,571,001
未収入金	14,000,000
(B) 負債	19,430,943
未払解約金	16,096,758
未払信託報酬	3,301,255
その他未払費用	32,930
(C) 純資産総額 (A - B)	1,192,776,859
元本	719,492,693
次期繰越損益金	473,284,166
(D) 受益権総口数	719,492,693口
1万口当り基準価額 (C / D)	16,578円

* 期首における元本額は642,585,705円、当作成期間中における追加設定元本額は1,757,510,319円、同解約元本額は1,680,603,331円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は16,578円です。

■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,120円
受取利息	2,080
支払利息	△ 3,200
(B) 有価証券売買損益	81,486,548
売買益	181,662,810
売買損	△ 100,176,262
(C) 信託報酬等	△ 5,711,090
(D) 当期損益金 (A + B + C)	75,774,338
(E) 前期繰越損益金	4,775,988
(F) 追加信託差損益金	392,733,840
(配当等相当額)	(180,510,710)
(売買損益相当額)	(212,223,130)
(G) 合計 (D + E + F)	473,284,166
次期繰越損益金 (G)	473,284,166
追加信託差損益金	392,733,840
(配当等相当額)	(180,510,710)
(売買損益相当額)	(212,223,130)
分配準備積立金	80,551,446
繰越損益金	△ 1,120

(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	75,775,353
(c) 収益調整金	392,733,840
(d) 分配準備積立金	4,776,093
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	473,285,286
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	473,285,286
(h) 受益権総口数	719,492,693口

【注記】

「日経平均株価」に関する著作権、知的所有権、その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は日経平均株価を継続的に公表する義務を負うものではなく、その誤謬、遅延または中断に関して責任を負いません。また、「ダイワ・ノーロード 日経225ファンド」について、日本経済新聞社は一切の責任を負うものではありません。

ストックインデックス225・マザーファンド

運用報告書 第20期 (決算日 2021年9月21日)

(作成対象期間 2020年9月24日～2021年9月21日)

ストックインデックス225・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	わが国の株式市場の動きと長期成長をとらえることを目標に、日経平均株価をモデルとして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式のうち日経平均株価に採用された銘柄
株式組入制限	無制限

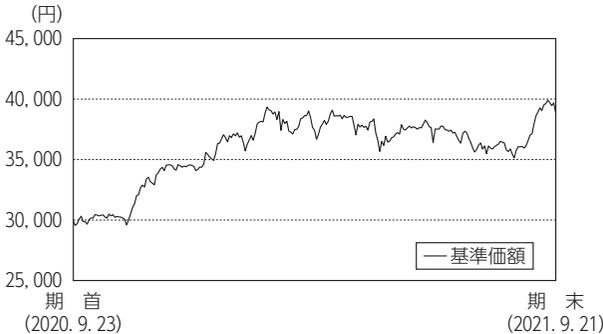
大和アセットマネジメント

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		日経平均株価 (ベンチマーク)		株式組入率	株式先物比率
	円	%	円	%		
(期首)2020年9月23日	29,884	—	23,346.49	—	98.4	0.6
9月末	29,859	△ 0.1	23,185.12	△ 0.7	98.0	2.0
10月末	29,594	△ 1.0	22,977.13	△ 1.6	98.1	1.9
11月末	34,080	14.0	26,433.62	13.2	98.5	1.4
12月末	35,428	18.6	27,444.17	17.6	98.7	1.3
2021年1月末	35,709	19.5	27,663.39	18.5	97.9	2.1
2月末	37,413	25.2	28,966.01	24.1	99.0	1.0
3月末	37,903	26.8	29,178.80	25.0	96.8	3.2
4月末	37,435	25.3	28,812.63	23.4	97.4	2.5
5月末	37,511	25.5	28,860.08	23.6	98.2	1.8
6月末	37,446	25.3	28,791.53	23.3	98.3	1.7
7月末	35,482	18.7	27,283.59	16.9	98.2	1.8
8月末	36,545	22.3	28,089.54	20.3	98.4	1.6
(期末)2021年9月21日	38,825	29.9	29,839.71	27.8	97.8	1.5

(注1) 基準価額の騰落率は期首比。
 (注2) 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3) 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：29,884円 期末：38,825円 騰落率：29.9%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内外の新型コロナウイルスの感染状況などに一喜一憂を繰り返す相場となり、横ばい圏で推移しました。2020年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当選確定となって選挙結果に対する不確実性が後退したことや、それによって大型経済対策への期待が高まったこと、欧米において複数のワクチンの接種が始まったことなどが好感され、株価は上昇しました。2021年に入っても、1月に行われた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、大型経済対策などの政策の実現化が現実味を帯び、3月には実際に米国で追加経済対策が発表されたことや、国内のウイルスの感染状況が改善したことなどが好感され、株価は上昇しました。その後は、国内で感染が再拡大して再び行動制限措置がとられたことや、内閣支持率の低下で政局の行方へ不透明感が増したこと、また世界的にインフレ懸念が台頭して米国の金融緩和縮小の早期化観測が高まったことなどから、上値の重い展開となりました。9月に入ると、菅首相が自民党総裁選挙への不出馬を表明したことを受けて、来たる衆議院選挙での自民党大敗リスクが後退したことや新たな経済対策による景気回復期待などを背景に上昇しました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

◆ポートフォリオについて

株式の組み入れを中心に、日経平均先物取引も一部利用し、当作成期を通じて、実質株式組入比率をおおむね99%程度以上の水準に維持しました。

株式ポートフォリオにつきましては、ベンチマーク採用銘柄のうち当社独自の基準で財務リスクが高いと判断される銘柄を除いた残りすべての銘柄に投資を行い、ベンチマークの動きに連動するように、ポートフォリオを構築し運用しております。当作成期につきましては、原則として、ベンチマークに採用されている全銘柄を組み入れて運用を行いました。

また、ベンチマーク採用銘柄の入替え時には、その都度、組入銘柄の入替えを行い、連動性の維持に努めました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は27.8%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は29.9%となりました。

- ・ファンドには保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークである日経平均株価では配当金の影響が考慮されないことが、プラス要因となりました。
- ・資金の流入に伴う現物株式および株式先物の売買等によるコスト負担等が、マイナス要因となりました。

*ベンチマークは日経平均株価です。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行ってまいります。

ストックインデックス225・マザーファンド

■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)	1円 (0) (1)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	1

(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9月24日から2021年9月21日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 5,707.3 (182)	千円 22,448,831 (—)	千株 8,877.1	千円 33,973,327

(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9月24日から2021年9月21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 70,102	百万円 69,189	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9月24日から2021年9月21日まで)

買 柄	当 期			売 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
ファーストリテイリング	千株 26	千円 2,113,040	円 81,270	ファーストリテイリング	千株 42	千円 3,369,114	円 80,217
ネクソン	548	1,589,333	2,900	ファミリーマート	1,000	2,284,914	2,284
ソフトバンクグループ	156	1,215,576	7,792	ソフトバンクグループ	252	1,742,913	6,916
東京エレクトロン	26	1,203,820	46,300	東京エレクトロン	42	1,615,012	38,452
ファナック	26	663,190	25,507	ファナック	42	1,038,393	24,723
ダイキン工業	26	581,080	22,349	ダイキン工業	42	1,035,004	24,642
KDDI	156	545,064	3,494	エムスリー	100.8	834,106	8,274
アドバンテスト	52	493,560	9,491	KDDI	252	818,323	3,247
信越化学	26	471,800	18,146	テルモ	168	757,926	4,511
エムスリー	62.4	460,982	7,387	信越化学	42	723,096	17,216

(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	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		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
水産・農林業 (0.1%)																					
日本水産	250	234	150,228					宇部興産	25	23.4	53,539					金属製品 (0.2%)					
マルハニチロ	25	23.4	62,103					日本化薬	250	—	—					SUMCO	25	23.4	55,809		
								花王	250	234	1,563,822					東洋製罐グループHD	250	234	314,730		
鉱業 (0.0%)								D I C	25	23.4	76,986					機械 (5.1%)					
I N P E X	100	93.6	73,756					富士フィルム HLDGS	250	234	2,268,396					日本製鋼所	50	46.8	138,387		
								資生堂	250	234	1,787,292					オークマ	50	46.8	263,952		
建設業 (1.7%)								日東電工	250	234	1,944,540					アマダ	250	234	281,034		
コムシスホールディングス	250	234	698,724					医薬品 (7.4%)								小松製作所	250	234	635,193		
大成建設	50	46.8	168,480					協和キリン	250	234	966,420					住友重機械	50	46.8	141,570		
大林組	250	234	219,024					武田薬品	250	234	879,606					日立建機	250	234	746,460		
清水建設	250	234	197,964					アステラス製薬	1,250	1,170	2,194,920					クボタ	250	234	566,046		
長谷工コーポレーション	50	46.8	70,200					大日本住友製薬	250	234	481,338					荏原製作所	50	46.8	272,376		
鹿島建設	125	117	171,522					塩野義製薬	250	234	1,724,814					ダイキン工業	250	234	6,243,120		
大和ハウス	250	234	889,200					中外製薬	750	702	2,898,558					日本精工	250	234	177,138		
積水ハウス	250	234	555,867					エーザイ	250	234	1,960,686					NTN	250	234	58,500		
日揮ホールディングス	250	234	229,320					第一三共	250	702	2,120,040					ジェイテクト	250	234	224,874		
								大塚ホールディングス	250	234	1,136,538					日立造船	50	46.8	43,056		
食料品 (3.8%)								石油・石炭製品 (0.2%)								三菱重工業	25	23.4	70,036		
日清製粉G本社	250	234	450,684					出光興産	100	93.6	270,597					I H I	25	23.4	60,114		
明治ホールディングス	50	46.8	343,044					ENEOSホールディングス	250	234	107,663					電気機器 (23.7%)					
日本ハム	125	117	512,460					ゴム製品 (0.8%)								日清紡ホールディングス	250	234	195,858		
サッポロホールディングス	50	46.8	117,889					横浜ゴム	125	117	232,128					コニカミノルタ	250	234	140,634		
アサヒグループホールディングス	250	234	1,283,490					ブリヂストン	250	234	1,240,902					ミネベアミツミ	250	234	688,662		
キリンHD	250	234	479,466					ガラス・土石製品 (1.0%)								日立	50	46.8	301,532		
宝ホールディングス	250	234	366,210					A G C	50	46.8	266,760					三菱電機	250	234	368,901		
キッコーマン	250	234	2,227,680					日本板硝子	25	23.4	13,455					富士電機	50	46.8	240,084		
味の素	250	234	810,576					日本電気硝子	75	70.2	169,041					安川電機	250	234	1,373,580		
ニチレイ	125	117	348,660					住友大阪セメント	25	23.4	73,827					オムロン	250	234	2,686,320		
日本たばこ産業	250	234	506,376					太平洋セメント	25	23.4	57,330					ジーエス・ユアサコーポ	50	46.8	120,931		
								東海カーボン	250	234	358,956					日本電気	25	23.4	145,548		
繊維製品 (0.1%)								T O T O	125	117	652,860					富士通	25	23.4	492,102		
東洋紡	25	23.4	32,666					日本碍子	250	234	440,856					沖電気	25	23.4	23,002		
ユニチカ	25	23.4	9,032					鉄鋼 (0.1%)								セイコーエプソン	500	468	1,066,572		
帝人	50	46.8	76,003					日本製鉄	25	23.4	48,122					パナソニック	250	234	323,973		
東レ	250	234	170,188					神戸製鋼所	25	23.4	16,029					シャープ	—	234	324,324		
								J F Eホールディングス	25	23.4	41,230					ソニーグループ	250	234	2,887,560		
パルプ・紙 (0.1%)								大太平洋金属	25	23.4	44,319					T D K	250	234	2,915,640		
王子ホールディングス	250	234	136,188					非鉄金属 (0.8%)								アルプスアルパイン	250	234	283,842		
日本製紙	25	23.4	28,711					日本軽金属HD	250	23.4	47,174					横河電機	250	234	460,512		
								三井金属	25	23.4	76,752						アドバンテス	500	468	5,194,800	
化学 (8.2%)								東邦亜鉛	25	23.4	67,134						カシオ	250	234	424,242	
クラレ	250	234	247,338					三菱マテリアル	25	23.4	52,392					ファナック	250	234	5,984,550		
旭化成	250	234	290,979					住友鉱山	125	117	484,497					京セラ	500	468	3,274,128		
昭和電工	25	23.4	63,671					DOWAホールディングス	50	46.8	214,110					太陽誘電	250	234	1,729,260		
住友化学	250	234	138,294					古河電工	25	23.4	56,277					SCREENホールディングス	50	46.8	477,828		
日産化学	250	234	1,619,280					住友電工	250	234	349,245					キャノン	375	351	943,488		
東ソー	125	117	243,477					フジクラ	250	234	160,758					リコー	250	234	257,634		
トクヤマ	50	46.8	103,615																		
デンカ	50	46.8	189,306																		
信越化学	250	234	4,949,100																		
三井化学	50	46.8	184,392																		
三菱ケミカル HLDGS	125	117	120,744																		

ストックインデックス225・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	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株		株数	千株	株数	千株
			千円	千円				千円	千円				千円	千円
東京エレクトロン	250	234	12,652,380		空運業 (0.0%)					証券・商品先物取引業 (0.2%)				
輸送用機器 (4.5%)					ANAホールディングス	25	23.4	63,414		大和証券G本社	250	234	156,241	
デンソー	250	234	1,811,160		倉庫・運輸関連業 (0.2%)					野村ホールディングス	250	234	128,957	
三井E&SHD	25	23.4	11,349		三菱倉庫	125	117	384,930		松井証券	250	234	194,922	
川崎重工業	25	23.4	57,236		情報・通信業 (11.1%)					保険業 (0.7%)				
日産自動車	250	234	130,174		ネクソン	—	468	818,064		SOMPOホールディングス	62.5	58.5	297,063	
いすゞ自動車	125	117	173,043		Zホールディングス	100	93.6	68,749		MS&AD	75	70.2	269,357	
トヨタ自動車	250	234	2,323,386		トレンドマイクロ	250	234	1,453,140		第一生命HLDGS	25	23.4	55,188	
日野自動車	250	234	237,042		スカパーJSATHD	25	23.4	9,968		東京海上HD	125	117	702,000	
三菱自動車工業	25	23.4	6,528		日本電信電話	100	93.6	301,953		T&Dホールディングス	50	46.8	72,072	
マツダ	50	46.8	43,758		KDDI	1,500	1,404	5,315,544		その他金融業 (0.5%)				
本田技研	500	468	1,562,184		ソフトバンク	—	234	364,104		クレディセゾン	250	234	317,538	
スズキ	250	234	1,190,124		N T T ドコモ	25	—	—		日本取引所グループ	250	234	680,472	
SUBARU	250	234	481,338		東宝	25	23.4	123,084		不動産業 (1.2%)				
ヤマハ発動機	250	234	721,890		N T T データ	1,250	1,170	2,544,750		東急不動産HD	250	234	155,376	
精密機器 (3.9%)					コナミホールディングス	250	234	1,600,560		三井不動産	250	234	590,265	
テルモ	1,000	936	4,975,776		ソフトバンクグループ	1,500	1,404	8,885,916		三菱地所	250	234	404,937	
ニコン	250	234	307,476		卸売業 (2.0%)					東京建物	125	117	198,783	
オリンパス	1,000	936	2,177,136		双日	25	23.4	8,283		住友不動産	250	234	909,792	
シチズン時計	250	234	122,850		伊藤忠	250	234	808,470		サービス業 (7.1%)				
その他製品 (2.2%)					丸紅	250	234	216,309		エムスリー	600	561.6	4,823,020	
パナソニックHLDGS	250	234	2,078,622		豊田通商	250	234	1,117,350		ディー・エヌ・エー	75	70.2	139,276	
凸版印刷	125	117	233,064		三井物産	250	234	572,130		電通グループ	250	234	982,800	
大日本印刷	125	117	322,803		住友商事	250	234	374,400		サイバーエージェント	50	187.2	410,529	
ヤマハ	250	234	1,701,180		三菱商事	250	234	826,488		楽天グループ	250	234	259,740	
電気・ガス業 (0.1%)					小売業 (10.5%)					リクルートホールディングス	750	702	4,902,066	
東京電力HD	25	23.4	7,230		J.フロントリテイリング	125	117	118,638		日本郵政	250	234	226,231	
中部電力	25	23.4	31,917		三越伊勢丹HD	250	234	186,966		セコム	250	234	1,965,600	
関西電力	25	23.4	26,945		セブン&アイ・HLDGS	250	234	1,199,016						
東京瓦斯	50	46.8	101,017		ファミリーマート	1,000	—	—						
大阪瓦斯	50	46.8	99,637		高島屋	125	117	135,486						
陸運業 (1.5%)					丸井グループ	250	234	489,762						
東武鉄道	50	46.8	139,370		イオン	250	234	706,212						
東急	125	117	188,136		ファーストリテイリング	250	234	17,463,420						
小田急電鉄	125	117	301,275		銀行業 (0.6%)									
京王電鉄	50	46.8	280,332		コンコルディア・フィナンシャル	250	234	103,896						
京成電鉄	125	117	415,935		新生銀行	25	23.4	44,132						
東日本旅客鉄道	25	23.4	165,859		あおぞら銀行	25	23.4	63,975						
西日本旅客鉄道	25	23.4	121,492		三菱UFJフィナンシャルG	250	234	148,005						
東海旅客鉄道	25	23.4	382,941		りそなホールディングス	25	23.4	10,387						
日本通運	25	23.4	190,008		三井住友トラストHD	25	23.4	89,622						
ヤマトホールディングス	250	234	681,876		三井住友フィナンシャルG	25	23.4	91,938						
海運業 (0.3%)					千葉銀行	250	234	166,842						
日本郵船	25	23.4	235,404		ふくおかフィナンシャルG	50	46.8	94,348						
商船三井	25	23.4	215,046		静岡銀行	250	234	217,152						
川崎汽船	25	23.4	171,054		みずほフィナンシャルG	250	23.4	37,486						

銘柄	期首		当期末	
	株数	千株	株数	千株
合計	45,587.5	42,599.7	193,896,831	<97.8%>

(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
日経平均	2,886	—

(注) 単位未満は切捨て。

■有価証券の貸付及び借入の状況

区 分	当 期 末	
	貸 付	借 入
株式	1,461,700 株 ()	株 ()

(注) ()内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

■投資信託財産の構成

2021年9月21日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	193,896,831 千円	93.6 %
コール・ローン等、その他	13,352,544	6.4
投資信託財産総額	207,249,376	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9月21日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	209,030,267,077円
コール・ローン等	11,594,808,498
株式 (評価額)	193,896,831,960
未収入金	1,657,155,991
未収配当金	96,876,500
未収利息	515,646
その他未収収益	360,722
差入委託証拠金	1,783,717,760
(B) 負債	10,801,260,975
未払金	30,879,510
未払解約金	589,590,000
差入委託証拠金代用有価証券	1,810,860,000
受入担保金	8,369,931,465
(C) 純資産総額 (A - B)	198,229,006,102
元本	51,056,738,772
次期繰越損益金	147,172,267,330
(D) 受益権総口数	51,056,738,772口
1万口当り基準価額 (C / D)	38,825円

* 期首における元本額は55,323,152,743円、当作成期間中における追加設定元本額は12,733,160,542円、同解約元本額は16,999,574,513円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額は、ストックインデックス ファンド225 20,583,545,296円、適格機関投資家専用・ダイワ・ストックインデックスファンド225 V A333,474,643円、大和 ストックインデックス 225 ファンド7,295,860,497円、D-1's 日経225インデックス113,106,768円、iFree 日経225インデックス6,285,660,509円、D C・ダイワ・ストックインデックス225 (確定拠出年金専用ファンド) 5,483,055,624円、ダ

イワ・ノーロード 日経225ファンド307,165,744円、ダイワファンドラップ 日経225インデックス3,954,737,892円、ダイワ日経225インデックス (ダイワ S M A 専用) 169,533,410円、ダイワ・インデックスセレクト 日経225 6,530,598,389円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は38,825円です。

■損益の状況

当期 自 2020年9月24日 至 2021年9月21日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	2,842,355,761円
受取配当金	2,804,132,530
受取利息	5,995,539
その他収益金	36,011,662
支払利息	△ 3,783,970
(B) 有価証券売買損益	42,818,862,667
売買益	46,108,931,694
売買損	△ 3,290,069,027
(C) 先物取引等損益	999,915,770
取引益	1,395,396,780
取引損	△ 395,481,010
(D) その他費用	△ 38,717
(E) 当期損益金 (A + B + C + D)	46,661,095,481
(F) 前期繰越損益金	110,002,206,988
(G) 解約差損益金	△ 42,547,538,597
(H) 追加信託差損益金	33,056,503,458
(I) 合計 (E + F + G + H)	147,172,267,330
次期繰越損益金 (I)	147,172,267,330

(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。