

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９期

（決算日 2022年３月22日）
（作成対象期間 2021年３月23日～2022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、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	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	株式先物比率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 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			
	円	円	%		%	円	%	%	%	百万円
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
8 期末(2021年 3 月22日)	16,625	320	55.1	15,221	55.1	108.91	△ 1.7	96.9	0.1	542
9 期末(2022年 3 月22日)	18,116	0	9.0	14,845	△ 2.5	120.04	10.2	96.7	1.0	538

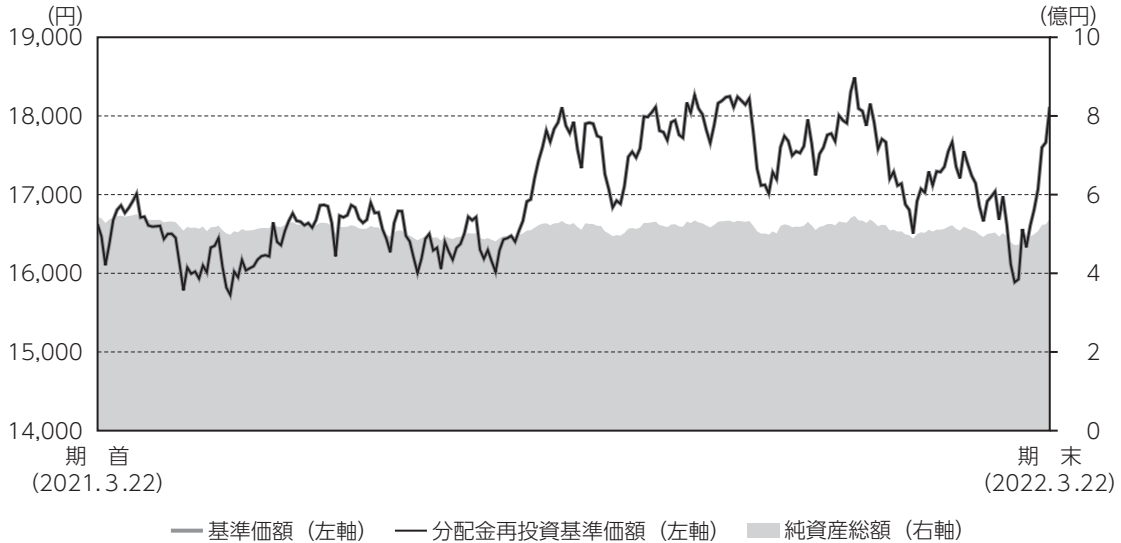
- (注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。
- (注 2) J P X 日経インデックス400は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
- (注 3) 為替レートは、計算日における対顧客直物電信売買相場の仲値をもとに投資信託協会が定める計算方法により算出されるレートを採用しています。
- (注 4) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注 5) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換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。

「J P X 日経インデックス400」は、株式会社 J P X 総研（以下「J P X 総研」といいます。）および株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）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 総研および日経は、「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 総研および日経は、「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、遅延または中断に関して、責任を負いません。本商品は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、J P X 総研および日経は、その運用および本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額は、当作成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。

■ 基準価額・騰落率

期 首：16,625円

期 末：18,116円 (分配金0円)

騰落率：9.0% (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。ウクライナ情勢の緊迫化の影響からわが国の株式市場が下落したことはマイナス要因となりましたが、為替相場において米ドルが上昇 (円安) したことがプラス要因となり、当ファンドの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 (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) 2021年 3 月22日	円	%		%	円	%	%	%
	16,625	－	15,221	－	108.91	－	96.9	0.1
3 月末	16,768	0.9	14,976	△1.6	110.71	1.7	95.2	2.3
4 月末	16,011	△3.7	14,533	△4.5	108.93	0.0	96.7	1.9
5 月末	16,399	△1.4	14,774	△2.9	109.76	0.8	97.2	1.9
6 月末	16,641	0.1	14,879	△2.2	110.58	1.5	97.3	1.8
7 月末	16,053	△3.4	14,497	△4.8	109.49	0.5	97.9	1.2
8 月末	16,666	0.2	15,005	△1.4	109.90	0.9	98.0	0.6
9 月末	17,724	6.6	15,546	2.1	111.92	2.8	95.5	2.5
10月末	17,722	6.6	15,321	0.7	113.67	4.4	97.0	2.0
11月末	17,116	3.0	14,788	△2.8	113.77	4.5	96.7	2.3
12月末	17,908	7.7	15,289	0.4	115.02	5.6	96.3	2.3
2022年 1 月末	17,072	2.7	14,521	△4.6	115.44	6.0	95.9	3.1
2 月末	16,974	2.1	14,424	△5.2	115.55	6.1	95.5	3.1
(期末) 2022年 3 月22日	18,116	9.0	14,845	△2.5	120.04	10.2	96.7	1.0

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2021.3.23～2022.3.22)

■国内株式市況

国内株式市況は下落しました。

国内株式市況は、当作成期首より、国内で新型コロナウイルスの感染が再拡大して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などから、上値の重い展開となりました。2021年8月下旬からは国内の感染状況が改善したことを受けて株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明を好感して急騰し、年初来高値を更新しました。しかし10月に入ると、新政権への期待がやや後退したことや中国の大手不動産会社の信用不安などが懸念され、株価は反落しました。10月末には、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回る議席を維持したことが好感される局面もありましたが、年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感が広がったことなどから上値の重い展開となりました。2022年に入ると、ＦＲＢ（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締めへの懸念が高まり、金利が上昇して世界的に成長株が急落したほか、ウクライナ情勢の緊迫化の影響を受けて下落しました。3月は、株価を戻しながら当作成期末を迎えました。

■為替相場

米ドル円相場は上昇しました。

米ドル円相場は、当作成期首より横ばいで推移しました。しかし2021年9月以降は、米国での利上げ観測の高まりや日米金融政策の方向性の違いを要因として、上昇しました。2022年3月以降は、米国の利上げペースの高まりから円安米ドル高となり、当作成期末にかけて上昇を強めました。

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

(2021.3.23～2022.3.22)

当ファンド

「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

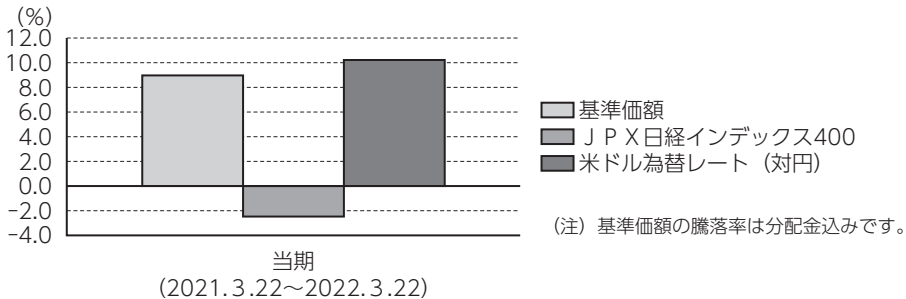
ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

*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
ダイワ J P X 日経400マザーファンド	J P X 日経インデックス400

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、経費控除後の配当等収益が少額であったことから、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	(円)	当 期
		2021年3月23日 ～2022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)	8,115

（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 (2021.3.23~2022.3.22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	123円	0.720%	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17,032円です。
(投 信 会 社)	(60)	(0.352)	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)	(56)	(0.330)	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)	(7)	(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	0.001	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	0.008	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	124	0.729	

(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。

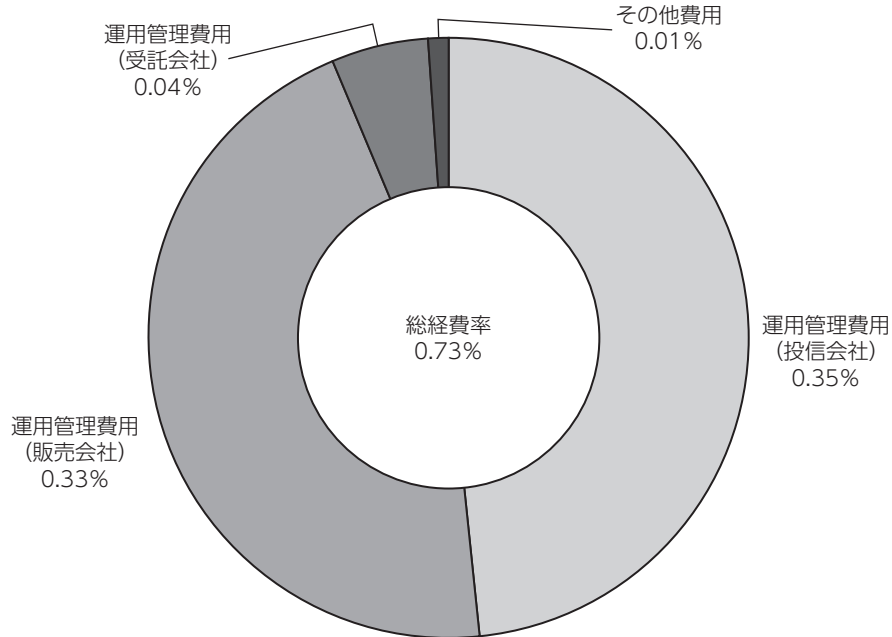
(注 3) 各比率は 1 万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して 100 を乗じたもので、小数点第 3 位未満を四捨五入してあります。

(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

(2021年3月23日から2022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ＪＰＸ日経400マザーファンド	94,110	167,949	105,844	189,153

(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

(2021年3月23日から2022年3月22日まで)

項 目	当 期 ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	5,130,723千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	15,875,822千円
(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

(2021年3月23日から2022年3月22日まで)

決 算 期	当 期					
区 分	買付額等			売付額等		
	A	うち利害 関係人との 取引状況B	B／A	C	うち利害 関係人との 取引状況D	D／C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	2,915	549	18.9	2,215	150	6.8
株式先物取引	2,276	—	—	2,095	—	—
コール・ローン	287,653	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合3.1%

※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

(2021年3月23日から2022年3月22日まで)

種 類	当 期		
	ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
	百万円	百万円	百万円
株式	7	1	47

(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

(2021年3月23日から2022年3月22日まで)

種 類	当 期
	ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド
	買 付 額
株式	百万円 8

(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総額に対する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、サムティです。

■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ＪＰＸ日経400マザーファンド	306,618	294,884	525,690

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2022年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド	525,690	97.4
コール・ローン等、その他	14,247	2.6
投資信託財産総額	539,938	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

2022年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,059,417,444円
コール・ローン等	4,307,859
ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド(評価額)	525,690,232
未収入金	529,419,353
(B) 負債	521,341,885
未払金	519,479,360
未払解約金	5,477
未払信託報酬	1,843,059
その他未払費用	13,989
(C) 純資産総額(A－B)	538,075,559
元本	297,020,440
次期繰越損益金	241,055,119
(D) 受益権総口数	297,020,440口
1万口当り基準価額(C／D)	18,116円

*期首における元本額は326,345,890円、当作成期間中における追加設定元本額は13,584,514円、同解約元本額は42,909,964円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は18,116円です。

■損益の状況

当期 自2021年3月23日 至2022年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 1,539円
受取利息	78
支払利息	△ 1,617
(B) 有価証券売買損益	47,595,774
売買益	74,184,741
売買損	△ 26,588,967
(C) 信託報酬等	△ 3,750,151
(D) 当期損益金(A + B + C)	43,844,084
(E) 前期繰越損益金	115,104,836
(F) 追加信託差損益金	82,106,199
(配当等相当額)	(57,784,603)
(売買損益相当額)	(24,321,596)
(G) 合計(D + E + F)	241,055,119
次期繰越損益金(G)	241,055,119
追加信託差損益金	82,106,199
(配当等相当額)	(57,784,603)
(売買損益相当額)	(24,321,596)
分配準備積立金	158,948,920

(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	10,274,992円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	33,569,092
(c) 収益調整金	82,106,199
(d) 分配準備積立金	115,104,836
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	241,055,119
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e－f)	241,055,119
(h) 受益権総口数	297,020,440口

ダイワＪＰＸ日経400マザーファンド

運用報告書 第９期（決算日 2022年３月22日）

（作成対象期間 2021年３月23日～2022年３月22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。

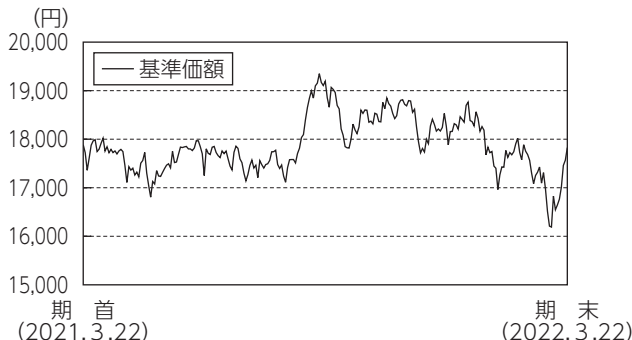
運 用 方 針	投資成果をＪＰＸ日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株 式 組 入 制 限	無制限

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		株 式 先 比	式 物 率
	円	騰 落 率	ベンチマーク	騰 落 率		
(期首)2021年 3月22日	17,885	% -	15,221	% -	95.9	0.1
3月末	17,746	△0.8	14,976	△1.6	97.7	2.3
4月末	17,225	△3.7	14,533	△4.5	97.7	2.0
5月末	17,519	△2.0	14,774	△2.9	98.0	1.9
6月末	17,661	△1.3	14,879	△2.2	98.3	1.8
7月末	17,208	△3.8	14,497	△4.8	98.7	1.2
8月末	17,814	△0.4	15,005	△1.4	99.1	0.6
9月末	18,625	4.1	15,546	2.1	97.3	2.5
10月末	18,357	2.6	15,321	0.7	97.8	2.0
11月末	17,719	△0.9	14,788	△2.8	97.7	2.3
12月末	18,350	2.6	15,289	0.4	97.4	2.4
2022年 1月末	17,429	△2.5	14,521	△4.6	96.8	3.2
2月末	17,320	△3.2	14,424	△5.2	96.5	3.2
(期末)2022年 3月22日	17,827	△0.3	14,845	△2.5	99.0	1.1

(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：17,885円 期末：17,827円 騰落率：△0.3%

【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、ウクライナ情勢の緊迫化の影響からわが国の株式市場が下落したことを受け、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、国内で新型コロナウイルスの感染が再拡大して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などから、上値の重い展開となりました。2021年8月下旬からは国内の感染状況が改善したことを受けて株価が上昇すると、9月初めには菅首相の自民党総裁選挙への不出馬表明を好感して急騰し、年初来高値を更新しました。しかし10月に入ると、新政権への期待がやや後退したことや中国の大手不動産会社の信用不安などが懸念され、株価は反落しました。10月末には、衆議院議員選挙で自民党が過半数を大きく上回る議席を維持したことが好感される局面もありましたが、年末にかけては、新型コロナウイルスの新変異株への警戒感が広がったことなどから上値の重い展開となりました。2022年に入ると、F R B（米国連邦準備制度理事会）による金融引き締めへの懸念が高まり、金利が上昇して世界的に成長株が急落したほか、ウクライナ情勢の緊迫化の影響を受けて下落しました。3月は、株価を戻しながら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」

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△2.5%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△0.3%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。

*ベンチマークは J P X日経インデックス400です。

《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

(2021年3月23日から2022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
	992.5 (133.95)	2,915,280 (-)	881.45	2,215,443

(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

(2021年3月23日から2022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	百万円	百万円	百万円
		2,276	2,095	-	-

(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

(2021年3月23日から2022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
富士フィルムH L D G S		15.3	134,210	8,771	東日本旅客鉄道		13.8	103,771	7,519
三菱商事		18.7	65,474	3,501	キャノン		39	100,165	2,568
日本郵船		6.9	59,536	8,628	イオン		29.8	87,102	2,922
東京エレクトロン		1.1	54,872	49,884	三菱U F J フィナンシャルG		137.8	83,016	602
武田薬品		14.8	53,352	3,604	日本製鉄		37.1	80,459	2,168
リクルートホールディングス		7.5	49,173	6,556	キーエンス		0.9	57,899	64,333
任天堂		0.9	48,047	53,386	ソフトバンクグループ		9.4	57,832	6,152
S Gホールディングス		15.6	46,231	2,963	A N A ホールディングス		20.1	53,471	2,660
商船三井		4.9	40,450	8,255	信越化学		2.5	47,786	19,114
オリエンタルランド		2.2	38,557	17,525	ソニーグループ		4.2	47,642	11,343

(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 (0.0%)				繊維製品 (0.4%)				中外製薬	23.7	26.5	105,920
日本水産	9.6	11.5	6,555	帝人	7	7.8	10,857	科研製薬	1.3	1.3	5,122
マルハニチロ	1.6	—	—	東レ	53.7	60.1	38,127	エーザイ	8.4	10.1	59,287
鉱業 (0.4%)				ゴールドウィン	1.2	1.5	9,060	ロート製薬	3.6	4.4	16,544
I N P E X	37.9	46.2	66,297	パルプ・紙 (0.2%)				小野薬品	17.4	19.5	59,260
建設業 (2.5%)				王子ホールディングス	33.4	34.7	21,062	久光製薬	2.2	—	—
ミライト・ホールディングス	—	3.7	7,407	大王製紙	—	4	6,572	参天製薬	13.2	15.8	20,461
安藤・間	6.6	5.7	4,941	レンゴー	—	7.8	6,279	J C R ファーマ	—	2.4	5,119
東急建設	3	3.4	2,369	化学 (7.3%)				東和薬品	—	1.2	3,480
コムシスホールディングス	3.6	3.7	10,286	クラレ	11.7	12.1	12,596	沢井製薬	1.7	—	—
東建コーポレーション	0.3	0.3	2,649	旭化成	49.2	55	59,620	第一三共	61.7	66.6	161,072
大成建設	7.4	7.7	28,990	昭和電工	5.6	7.2	17,020	大塚ホールディングス	15.8	17.6	73,004
大林組	23.8	26.6	25,296	住友化学	58.4	61	34,953	ペプチドリーム	—	4.4	8,672
清水建設	22.3	24.9	19,422	日産化学	4.1	4.5	31,275	サワイグループHD	—	1.9	8,683
長谷工コーポレーション	7.8	7.9	11,613	東ソー	11.5	12	22,188	石油・石炭製品 (0.6%)			
鹿島建設	17.4	19.5	30,849	トクヤマ	2.2	2.7	4,681	出光興産	8.4	9.4	32,289
西松建設	1.7	1.6	6,232	デンカ	2.7	3	10,440	E N E O S ホールディングス	114	127.5	59,861
三井住友建設	5.7	6	2,562	信越化学	13.7	12.3	226,381	コスモエネルギーHLDGS	2.4	2.5	6,860
前田建設	6	—	—	エア・ウォーター	7.6	7.9	13,588	ゴム製品 (0.8%)			
戸田建設	9.9	11	8,481	日本酸素HLDGS	6.1	8	18,840	横浜ゴム	4.4	4.9	7,898
熊谷組	1.1	1.4	4,060	三菱瓦斯化学	7.4	7.7	16,570	T O Y O T I R E	4	4.5	6,871
大東建託	2.6	2.7	35,208	三井化学	6.4	7.5	23,175	ブリヂストン	20.2	24.4	110,946
N I P P O	2	—	—	J S R	7.4	—	—	住友ゴム	6.8	7.6	8,344
五洋建設	10.1	10.5	6,510	三菱ケミカルHLDGS	49.6	55.5	45,576	ガラス・土石製品 (0.7%)			
住友林業	5.6	6.8	14,892	K H ネオケム	1.2	—	—	A G C	7	7.8	37,596
大和ハウス	21.9	24.5	81,095	ダイセル	10	12	9,960	太平洋セメント	4.5	4.8	9,984
積水ハウス	25.8	28.8	69,177	積水化学	15.7	17.4	31,511	東海カーボン	7.4	7.1	7,909
関電工	—	4.3	3,771	日本ゼオン	—	7.5	9,997	T O T O	5.4	6.1	29,951
エクシオグループ	3.6	4	9,364	アイカ工業	2.1	2.3	7,026	日本碍子	8.3	9.2	16,017
九電工	1.7	2.1	6,321	宇部興産	3.7	3.9	7,995	日本特殊陶業	5.8	6.4	12,729
インフロンアHD	—	11.2	12,835	日油	2.8	2.8	14,084	ニチラス	1.9	2	4,998
食料品 (3.7%)				花王	18.1	18.8	93,924	鉄鋼 (—)			
森永製菓	1.8	2	7,720	日本ペイントHOLD	6.1	31.2	33,727	日本製鉄	35.8	—	—
寿スピリッツ	0.7	—	—	関西ペイント	8.3	8.6	17,991	J F E ホールディングス	21.7	—	—
カルビー	3.5	3.9	9,594	D I C	3.1	3.5	8,701	非鉄金属 (0.8%)			
森永乳業	1.4	1.6	8,464	富士フイルムHLDGS	—	14.9	110,677	三井金属	—	2.3	8,073
ヤクルト	5.2	6.3	40,950	資生堂	15.1	15.8	96,617	住友鉱山	9.6	10.7	64,467
明治ホールディングス	5	5.6	37,520	ライオン	9.9	10.2	14,555	古河電工	2.3	—	—
プリマハム	—	1.1	2,508	ファンケル	2.8	3.4	9,792	住友電工	26.2	31.3	45,823
日本ハム	2.9	3.3	13,893	コーセー	1.4	1.6	20,496	アサヒHD	1.4	3.4	7,786
アサヒグループホールディン	16.6	20	87,800	ポーラ・オルビスHD	3.2	3.6	5,965	金属製品 (0.3%)			
キリンHD	32.3	31.3	56,840	小林製薬	2.1	2.4	24,168	S U M C O	9.6	12.9	24,613
サントリー食品インター	5.1	5.7	26,590	日東電工	4.9	5.1	44,523	三和ホールディングス	7.1	7.9	9,685
伊藤園	2.3	2.6	16,224	エフピコ	—	1.6	4,832	リンナイ	1.5	1.6	14,720
キッコーマン	5.5	6.1	49,105	ニフコ	2.8	2.8	8,170	機械 (5.9%)			
味の素	18.1	18.8	65,612	ユニ・チャーム	16.1	16.3	69,112	日本製鋼所	2.3	2.5	8,862
キューピー	4.2	4.5	10,831	医薬品 (6.3%)				三浦工業	3.2	3.6	11,214
カゴメ	3.1	3.2	9,920	協和キリン	7.6	9.9	29,749	アマダ	11	13.2	14,137
アリアケジャパン	0.7	0.8	4,256	武田薬品	53.2	62.4	224,390	F U J I	3	3.9	8,697
ニチレイ	3.6	3.9	9,519	アステラス製薬	65.7	73.5	142,994	オーエスジー	3.7	3.9	7,367
東洋水産	3.9	4.1	18,409	大日本住友製薬	5.6	5.2	6,567	DMG森精機	4.7	5	8,070
日清食品HD	3	3.3	28,578	塩野義製薬	9.5	10.7	79,875	ディスコ	1	1.2	38,400
日本たばこ産業	40.8	45.6	94,118	日本新薬	2.1	2.2	18,370	オプトラ	—	1.1	2,227

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
ナブテスコ	4.4	4.8	15,144	SCREENホールディングス	1.3	1.5	17,310	近鉄グループHLDGS	7.2	—	—
S M C	2.2	2.5	168,475	キャノン	37.7	—	—	阪急阪神HLDGS	9.6	10	35,800
小松製作所	34.3	38.4	112,339	東京エレクトロン	4.4	5.4	321,192	南海電鉄	4.5	—	—
住友重機械	4.3	4.9	14,312	輸送用機器 (6.3%)				京阪ホールディングス	4.3	—	—
日立建機	3.5	3.4	10,557	トヨタ紡織	2.2	3.5	6,930	名古屋鉄道	7.9	—	—
クボタ	39.8	41.1	92,598	豊田自動織機	6.1	6.9	58,305	日本通運	2.5	—	—
荏原製作所	—	3.4	22,372	デンソー	16.7	18.7	142,606	ヤマトホールディングス	10.1	11.2	25,860
ダイキン工業	9.7	10.8	247,968	いすゞ自動車	22	26.6	41,921	山九	1.8	2.1	8,316
ダイワフク	4.2	4.7	39,997	トヨタ自動車	26.1	126.5	259,957	セコグループHLDGS	—	4	3,784
竹内製作所	1.3	1.3	3,400	日野自動車	9.5	10.6	7,642	日立物流	1.6	1.5	10,260
ホシザキ	2.4	2.5	20,925	アイシン	5.5	6.2	25,575	丸和運輸機関	—	1.7	1,739
日本精工	15.6	16	11,776	マツダ	23.8	—	—	九州旅客鉄道	5.6	6.2	16,132
T H K	4.7	—	—	本田技研	59.7	66.7	226,446	S Gホールディングス	—	15.2	35,583
マキタ	9.9	10.3	41,735	スズキ	15	19.4	80,374	NIPPON EXPRESS	—	2.8	24,388
三菱重工業	11.9	13.3	49,848	S U B A R U	21.7	24.3	45,659	海運業 (0.8%)			
I H I	5.1	5.3	15,073	ヤマハ発動機	10.7	11.1	28,438	日本郵船	—	6.7	81,539
電気機器 (17.4%)				豊田合成	2.4	2.7	5,375	商船三井	—	4.4	50,336
ブラザー工業	9.3	10.4	23,025	シマノ	2.8	3.4	92,990	空運業 (—)			
ミネベアミツミ	13.1	14.6	37,186	テイ・エス テック	1.8	3.6	5,068	日本航空	17.5	—	—
日立	36.4	38.6	228,782	精密機器 (3.0%)				ANAホールディングス	19.4	—	—
三菱電機	75.8	84.8	119,144	テルモ	23.2	24	90,792	倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
富士電機	4.6	5.1	30,345	島津製作所	9.8	10.9	44,145	近鉄エクスプレス	—	1.5	5,205
安川電機	8.2	9.1	43,998	バイ・テクノロジー	0.4	0.4	1,346	情報・通信業 (7.6%)			
東芝テック	0.8	—	—	東京精密	1.3	1.4	6,671	N E C ネットエスアイ	—	2.8	4,998
日本電産	18.2	20.5	196,513	ニコン	11.6	—	—	システナ	2.7	11.9	5,152
オムロン	6.3	7.1	58,610	オリンパス	41.9	44.5	99,034	日鉄ソリューションズ	1.1	1.2	4,380
MC J	2.4	2.9	2,740	H O Y A	15	16.5	226,875	T I S	7.4	7.9	22,483
日本電気	9.6	10.8	54,000	朝日インテック	8	9.3	21,008	コーエーテクモHD	1.5	2.7	11,083
富士通	6.8	7.6	135,356	その他製品 (2.1%)				ネクソン	18.8	18.8	54,125
ルネサスエレクトロニクス	32.6	46	60,030	バンダイナムコHLDGS	6.3	7.6	67,480	ティーガイア	0.8	0.7	1,188
セイコーエプソン	9.4	10.5	19,078	パイロットコーポレーション	1.3	1.4	7,434	ガンホー・オンライン・エンター	1.8	2.2	5,537
ワコム	—	6.6	6,006	ヤマハ	4.5	4.9	26,215	GMOペイメントゲートウェイ	1.6	1.6	17,872
アルバック	1.4	1.7	10,251	ビジョン	4.9	5.1	10,710	ラクス	—	3.8	5,749
エレコム	0.9	1.9	2,939	任天堂	3.1	3.7	228,919	アカツキ	0.3	0.4	1,113
パナソニック	80.8	90.4	107,214	電気・ガス業 (1.3%)				野村総合研究所	13.6	16.1	68,264
シャープ	8.8	—	—	中部電力	23.2	25.9	31,857	インフォコム	0.7	0.9	1,895
アンリツ	4.6	5.5	8,514	関西電力	28.7	32.1	38,391	オービック	2.3	2.6	47,060
ソニーグループ	24.8	22.7	285,339	中国電力	10.9	13.2	11,998	ジャストシステム	1.1	1.2	6,516
T D K	3.7	12.3	50,307	東北電力	17.8	19.9	14,925	Zホールディングス	102.2	120.9	64,729
アルプスアルパイン	6.2	—	—	九州電力	16.7	17.5	15,277	トレンドマイクロ	4	4.4	31,020
横河電機	7.6	8.5	18,113	北海道電力	7.1	7.4	3,729	日本オラクル	1.5	1.4	12,180
アズビル	5.1	5	21,600	電源開発	6	7.2	13,903	伊藤忠テクノソリューションズ	3.4	3.8	11,191
日本光電工業	3.1	3.5	10,692	イーレックス	—	1.2	2,163	大塚商会	4	4.5	19,260
堀場製作所	1.5	1.6	10,480	レノバ	—	1.7	2,917	電通国際情報S	—	1.2	4,554
アドバンテスト	5.6	6.3	57,330	東京瓦斯	14.6	16.2	36,709	東映アニメーション	0.3	0.3	2,898
キーエンス	4.4	4	219,560	大阪瓦斯	13.7	15.4	32,586	デジタルガレージ	1.2	1.4	5,999
シスメックス	5.9	7.2	61,531	陸運業 (1.7%)				日本ユニシス	2.6	2.6	8,086
O B A R A G R O U P	0.4	—	—	東武鉄道	7.9	—	—	USEN-NEXT HLDGS	—	0.8	1,848
レーザーテック	3.3	3.7	69,504	相鉄ホールディングス	3.5	—	—	日本電信電話	81.1	75.9	271,570
スタンレー電気	5.3	5.9	14,702	東急	19.1	—	—	K D D I	59.6	60.6	249,308
カシオ	6.1	6.1	8,710	小田急電鉄	12.1	—	—	光通信	0.9	1	13,750
ファナック	6.7	7.4	157,916	京王電鉄	4.2	—	—	東宝	4.4	4.9	23,201
浜松ホトニクス	5.4	6.1	36,295	京成電鉄	5.7	—	—	N T T データ	19.8	22.1	52,244
京セラ	11.6	11.9	79,634	東日本旅客鉄道	13.3	—	—	スクウェア・エニックス・HD	3.2	3.9	21,567
太陽誘電	3.4	4.1	21,771	西日本旅客鉄道	6.8	—	—	カプコン	3.2	7.8	22,815
村田製作所	22.3	24.9	200,494	東海旅客鉄道	6.3	7	113,540	S C S K	1.7	5.8	12,267
小糸製作所	4.5	4.7	23,876	西武ホールディングス	9.1	—	—	コナミホールディングス	2.7	3	21,900

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
ソフトバンクグループ	千株	千株	千円	サンドラッグ	千株	千株	千円	サービス業 (5.1%)	千株	千株	千円
卸売業 (7.3%)	30.8	23.9	120,838	銀行業 (5.8%)	2.8	3.1	9,470	ミクシィ	1.8	1.9	4,170
双日	41.2	9.2	19,099	めぶきフィナンシャルG	38.8	43.4	11,587	日本M&Aセンターホールデ	5.9	13.3	20,907
アルフレッサホールディングス	7.7	9.3	16,619	コンコルディア・フィナンシャル	45.5	47.8	23,039	U T グループ	1	1.2	3,379
神戸物産	5.2	6.5	25,122	新生銀行	6.1	5.5	12,749	エス・エム・エス	2.5	2.8	9,310
ダイワボウHD	0.7	4.1	7,109	あおぞら銀行	4.5	4.7	12,483	パーソルホールディングス	7.2	8.1	19,472
TOKAIホールディングス	3.6	4	3,584	三菱UFJフィナンシャルG	479.1	375.2	301,660	総合警備保障	2.9	3.2	13,616
シッパヘルスケアHD	1.3	2.7	5,613	リそなホールディングス	81.3	94.8	52,718	カカココム	5.4	5.9	16,354
コメダホールディングス	1.6	1.8	3,699	三井住友トラストHD	14.1	15.8	65,443	ディップ	1.1	1.4	4,410
第一興商	1.5	—	—	三井住友フィナンシャルG	53	57.9	240,806	ベネフィット・ワン	2.6	2.9	7,429
メディアバルHD	7.5	9	19,017	千葉銀行	24.9	27.9	21,622	エムスリー	12.8	14.3	59,874
日本ライフライン	2.4	2.5	2,695	ひくおかフィナンシャルG	6.7	7	17,171	アウトソーシング	4.1	4.6	5,589
伊藤忠	52.2	58.4	238,680	セブン銀行	25	24.8	6,299	博報堂D Y H L D G S	10.1	11.3	17,594
丸紅	73.6	82.4	117,667	みずほフィナンシャルG	101.6	107.6	175,226	電通グループ	8.1	—	—
豊田通商	7.5	8.4	41,538	証券、商品先物取引業 (1.0%)	—	—	—	フルキャストホールランド	7.7	9.6	222,672
兼松	3	3.1	4,405	F P G	2.3	2.8	2,114	ユー・エス・エス	8.1	9.1	18,382
三井物産	60.6	64.8	215,913	GMOフィナンシャルHLDGS	—	1.6	1,292	楽天グループ	33.8	—	—
住友商事	47.1	52.7	114,016	S B I ホールディングス	9.2	10.3	33,372	フルキャストホールディングス	—	0.7	1,691
三菱商事	45.5	62.6	287,459	ジャフコグループ	—	3.2	6,153	エン・ジャパン	1.3	1.3	3,534
岩谷産業	1.8	2	10,760	大和証券G本社	56	61.6	44,327	テクノプロ・ホールディング	1.4	4.9	16,341
P A L T A C	1.2	1.2	5,898	野村ホールディングス	114.1	127.7	67,949	アイ・アールジャパンHD	0.3	0.4	1,678
日鉄物産	0.5	0.6	3,300	保険業 (3.1%)	—	—	—	ジャパンマテリアル	—	2.5	4,302
ミスミグループ本社	9.4	10.5	39,952	SOMPOホールディングス	13.2	13.7	75,788	リクルートホールディングス	47.9	48.4	258,456
小売業 (3.8%)	—	—	—	M S & A D	18.2	18.7	77,848	ベルシステム24HLDGS	—	1.2	1,597
ローソン	1.9	1.8	8,631	第一生命HLDGS	39.5	41.2	109,653	ペイカレントコンサルティング	0.5	0.6	25,590
エービーシー・マート	1.2	1.3	6,116	東京海上HD	24.8	27.5	206,607	ジャパンエレベーターズHD	—	2.6	4,269
日本マクドナルドHLDG	3.1	3.8	18,962	T & Dホールディングス	22.3	21.7	37,931	リログループ	4	4.4	7,735
セリア	1.8	2	5,352	その他金融業 (1.4%)	—	—	—	エイチ・アイ・エス	1.1	—	—
ビックカメラ	4.4	5	5,325	全国保証	1.9	2	9,410	カナモト	1.3	1.4	2,826
Monotaro	5.3	10.6	27,750	芙蓉総合リース	0.8	0.9	6,417	セコム	7.1	8	70,736
J. フロントリテイリング	8.9	—	—	みずほリース	—	1.3	3,958	メイテック	0.9	1	6,660
マツコヨコカラ&カンパニー	3.1	3.8	16,359	東京センチュリー	1.7	1.6	7,328	イオンディライト	—	1	3,075
Z O Z O	4.4	5.7	18,382	イオンフィナンシャルサービス	4.6	4.5	5,400	合計	株数、金額	株数	千円
ウエルシアHD	3.9	4.4	13,116	アコム	15	16.5	5,181	銘柄数<比率>	5,431.4	5,676.4	16,247,274
クリエイトSDH	1.1	1.2	3,852	オリコ	20.2	22.6	2,870	399銘柄	399銘柄	<99.0%>	
すかいらーくHD	8.4	—	—	オリックス	45.4	49.7	120,969				
コスモス薬品	0.8	0.8	12,296	三菱HCキャピタル	16.9	30.9	18,014				
セブン・アイ・HLDGS	29.2	32.7	183,021	日本取引所グループ	20.2	21.2	48,569				
ツルハホールディングス	1.6	1.8	15,192	不動産業 (2.4%)	—	—	—				
クスリのアオキHLDGS	0.7	0.8	5,704	いちご	8.3	9.3	2,920				
FOOD&LIFE COMPAN	4.1	4.9	16,096	ヒューリック	15.9	20	21,940				
ノジマ	1.3	1.3	3,034	野村不動産HLDGS	4.5	4.3	13,007				
良品計画	9.9	9.6	14,380	サムディ	—	1.3	2,905				
コーナン商事	—	1.2	4,302	プルサンコーポレーション	—	1.1	2,246				
パナソニックHD	14.9	16.7	30,978	オープンハウスグループ	2.4	2.7	14,553				
ゼンショーホールディングス	4	4.1	11,283	東急不動産HD	20.3	24.6	16,752				
ワークマン	1	1.1	5,566	飯田GHD	6.2	7	15,393				
スギホールディングス	1.5	1.7	10,251	パーク24	4	—	—				
ライフコーポレーション	—	0.8	2,572	三井不動産	34.1	38.1	104,317				
丸井グループ	6.3	6.6	14,988	三菱地所	49.1	54.9	99,423				
イオン	28.7	—	—	東京建物	7.4	8.3	15,280				
イズミ	1.5	1.5	4,785	住友不動産	16.8	17.5	60,882				
ヤオコー	0.8	0.9	6,048	スターツコーポレーション	0.9	1.1	2,735				
ケーズホールディングス	6.6	7.7	9,871	日本エスコン	—	1.6	1,256				
アインホールディングス	1	1.1	6,721	イオンモール	3.7	4.2	6,904				
ニトリホールディングス	3	3.3	53,295	カチタス	—	2.1	7,129				
ファーストリテイリング	1	1.1	66,715	日本空港ビルデング	2.5	—	—				

(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	172	—

(注) 単位未満は切捨て。

■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 401,400 (200)	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200株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2022年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 16,247,274	% 91.5
コール・ローン等、その他	1,506,905	8.5
投資信託財産総額	17,754,179	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

2022年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	17,929,654,689円
コール・ローン等	1,464,485,342
株式(評価額)	16,247,274,010
未収入金	15,205,050
未収配当金	19,109,600
未収利息	65,675
その他未収収益	8,040,012
差入委託証拠金	175,475,000
(B) 負債	1,514,559,221
未払解約金	16,010,646
差入委託証拠金代用有価証券	188,840,000
受入担保金	1,309,708,575
(C) 純資産総額(A－B)	16,415,095,468
元本	9,207,900,732
次期繰越損益金	7,207,194,736
(D) 受益権総口数	9,207,900,732口
1万口当り基準価額(C／D)	17,827円

* 期首における元本額は9,270,336,794円、当作成期間中における追加設定元本額は1,834,948,708円、同解約元本額は1,897,384,770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：
 ダイワ J P X 日経400ファンド (米ドル投資型) 294,884,295円
 i Free J P X 日経400インデックス 1,302,021,690円
 ダイワ J P X 日経400ファンド (適格機関投資家専用) 222,186,122円
 ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド 118,899,862円
 ダイワ J P X 日経400ファンド 5,024,640,295円
 ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 2,245,268,468円
 * 当期末の計算口数当りの純資産額は17,827円です。

■損益の状況

当期 自2021年3月23日 至2022年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	358,831,526円
受取配当金	330,309,395
受取利息	995,395
その他収益金	27,879,369
支払利息	△ 352,633
(B) 有価証券売買損益	△ 355,109,314
売買益	1,296,255,284
売買損	△1,651,364,598
(C) 先物取引等損益	△ 28,207,400
取引益	36,577,850
取引損	△ 64,785,250
(D) その他費用	△ 4,344
(E) 当期損益金(A＋B＋C＋D)	△ 24,489,532
(F) 前期繰越損益金	7,309,467,509
(G) 解約差損益金	△1,497,918,720
(H) 追加信託差損益金	1,420,135,479
(I) 合計(E＋F＋G＋H)	7,207,194,736
次期繰越損益金(I)	7,207,194,736

(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。

「ＪＰＸ日経インデックス400」は、株式会社ＪＰＸ総研（以下「ＪＰＸ総研」といいます。）および株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）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総研および日経は、「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総研および日経は、「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、遅延または中断に関して、責任を負いません。本商品は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、ＪＰＸ総研および日経は、その運用および本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。