

ダイワ・ニッポン応援ファンド Vol. 5 －ライジング・ジャパン－

運用報告書(全体版)

第10期

(決算日 2019年4月16日)

(作成対象期間 2018年10月17日～2019年4月16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、わが国の株式等の中から、東京圏の経済活性化により恩恵を受けることが期待される銘柄に投資し、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。

大和投資信託

Daiwa Asset Management

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	10年間(2014年4月17日～2024年4月16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・ライジング・ジャパン・マザーファンドの受益証券	
	ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場(上場予定を含みます。)の株式および不動産投資信託証券(不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券をいいます。)	
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、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、分配対象額が少額の場合には、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			TOPIX		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率	純資産総額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率				
6期末(2017年4月17日)	円 10,194	円 50	% 1.2	1,465.69	% 8.4	% 95.2	% —	% —	百万円 16,153
7期末(2017年10月16日)	11,605	400	17.8	1,719.18	17.3	96.2	—	—	14,759
8期末(2018年4月16日)	12,262	200	7.4	1,736.22	1.0	97.2	—	—	13,695
9期末(2018年10月16日)	11,639	0	△ 5.1	1,687.91	△ 2.8	97.1	—	—	11,845
10期末(2019年4月16日)	11,064	0	△ 4.9	1,626.46	△ 3.6	96.4	—	—	9,990

(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。

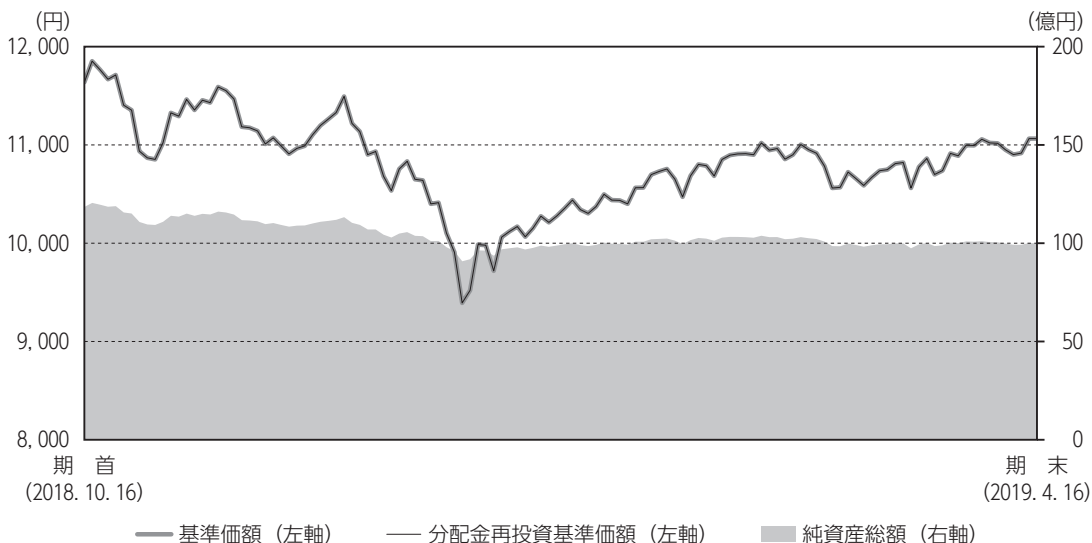
(注3) 第9期末以降の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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



* 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：11,639円

期末：11,064円（分配金0円）

騰落率：△4.9%（分配金込み）

基準価額の主な変動要因

米国や中国を中心に世界的な景気減速懸念が高まったことなどから、国内株式市況が下落したことにより、基準価額も下落しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ・ニッポン応援ファンド Vol.5 -ライジング・ジャパン-

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率	投資信託 証 券 組入比率
	円	騰 落 率	(参考指数)	騰 落 率			
(期首)2018年10月16日	11,639	—	1,687.91	—	97.1	—	—
10月末	11,327	△ 2.7	1,646.12	△ 2.5	97.0	—	—
11月末	11,330	△ 2.7	1,667.45	△ 1.2	96.3	—	—
12月末	9,980	△ 14.3	1,494.09	△ 11.5	97.5	—	—
2019年 1 月末	10,565	△ 9.2	1,567.49	△ 7.1	96.7	—	—
2 月末	10,856	△ 6.7	1,607.66	△ 4.8	97.2	—	—
3 月末	10,739	△ 7.7	1,591.64	△ 5.7	96.2	—	—
(期末)2019年 4 月16日	11,064	△ 4.9	1,626.46	△ 3.6	96.4	—	—

(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

(2018. 10. 17 ~ 2019. 4. 16)

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、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、下落して始まりました。その後も、米中首脳会談において貿易摩擦の緩和に何らかの進展が見られるとの期待により上昇する局面もありましたが、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったF R B（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、株価の下落が続きました。しかし2019年1月には、F R B議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中貿易摩擦の緩和期待が再び高まり、株価は反発しました。上昇一服後は、世界的な景気減速懸念や米中貿易摩擦などの動向で強気と弱気の見方が交錯し、一進一退で推移しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

国内株式市況は、堅調な世界景気や企業業績を背景に緩やかな上昇が続くと想定しています。ただし、世界的な貿易摩擦や米国金利上昇が世界景気に与える影響については、注意深く見守る必要があると考えています。株式組入比率（株式先物およびリートを含む。）は90%程度以上の高位を維持し、東京圏の経済活性化の恩恵を受け、中長期の成長が期待できる銘柄を中心に投資してまいります。具体的には、建設・インフラ（社会基盤）、不動産、観光・消費・サービス、A I（人工知能）・ロボット・I o T（モノのインターネット）、交通・物流、金融といった成長テーマに投資することで、信託財産の成長をめざしていきます。

ポートフォリオについて

(2018. 10. 17 ~ 2019. 4. 16)

当ファンド

「ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

株式組入比率は、底堅い世界景気や企業業績が続くととの想定のもと、90%程度以上を維持しました。

業種構成は、情報・通信業、陸運業、小売業などの比率を引き上げる一方、鉄鋼、電気機器、不動産などの比率を引き下げました。

個別銘柄では、キャッシュレス決済の拡大による恩恵に期待してT I S、建設技術者派遣が順調に拡大している夢真ホールディングス、スマートフォンによる決済事業の中長期的な成長が期待されるヤフーなどを買い付けました。一方で、業績見通しの先行き不透明感が高まったと判断してソニー、東京都競馬、日立金属などを売却しました。

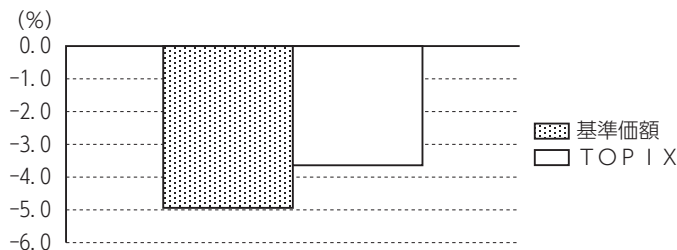
ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドは、参考指数としてTOP I Xを用いています。当作成期におけるTOP I Xの騰落率は $\Delta 3.6\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 4.9\%$ となりました。

TOP I Xの騰落率を上回った不動産業のオーバーウエート、TOP I Xの騰落率を下回った小売業や医薬品のアンダーウエートなどがプラス要因となりましたが、TOP I Xの騰落率を下回ったガラス・土石製品や鉄鋼のオーバーウエート、TOP I Xの騰落率を上回った精密機器のアンダーウエートなどはマイナス要因となりました。個別銘柄では、共立メンテナンス、オリエンタルランド、乃村工藝社などがプラスに寄与しましたが、J F Eホールディングス、電通、夢真ホールディングスなどは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参考指数との騰落率の対比です。



当期
(2018. 10. 16 ~ 2019. 4. 16)

分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案し、収益分配を見送らせていただきました。

なお、留保益につきましては、運用方針に基づいて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	
	2018年10月17日 ～2019年4月16日	
当期分配金（税込み）	（円）	—
対基準価額比率	（％）	—
当期の収益	（円）	—
当期の収益以外	（円）	—
翌期繰越分配対象額	（円）	2,146

- (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・ライジング・ジャパン・マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

国内株式市況は、世界的な貿易摩擦の動向について注意深く見守る必要があると考えますが、米国ではF R B（米国連邦準備制度理事会）が金融市場に配慮したスタンスへと転換し、中国も金融財政面で景気刺激策を打ち出すなどのプラス材料もあり、今後は、国内外で底堅い経済指標の発表が確認できれば、株価は上昇基調を取り戻すと考えています。株式組入比率（株式先物およびリートを含む。）は90%程度以上の高位を維持し、東京圏の経済活性化の恩恵を受け、中長期の成長が期待できる銘柄を中心に投資してまいります。具体的には、建設・インフラ、不動産、観光・消費・サービス、AI（人工知能）・ロボット・IoT（モノのインターネット）、交通・物流、金融といった成長テーマに投資することで、信託財産の成長をめざしていきます。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2018. 10. 17～2019. 4. 16)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	84円	0. 778%	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10, 805円です。
(投 信 会 社)	(41)	(0. 375)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託銀行への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(41)	(0. 375)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 銀 行)	(3)	(0. 027)	受託銀行分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	5	0. 044	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)	(5)	(0. 044)	
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	0	0. 003	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)	(0)	(0. 003)	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	89	0. 824	

(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。

■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

(2018年10月17日から2019年4月16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・ライジ ング・ジャパン・ マザーファンド	—	—	1,472,241	1,317,000

(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

(2018年10月17日から2019年4月16日まで)

項 目	当 期
	ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	5,315,432千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,062,272千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.44

(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

(2018年10月17日から2019年4月16日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区分	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	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	2,088	373	17.9	3,227	728	22.6
コール・ローン	28,918	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合83.4%

※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) 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

(2018年10月17日から2019年4月16日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4,552千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,292千円
(B) / (A)	28.4%

(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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券です。

■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・ライジング・ ジャパン・マザーファンド	12,336,267	10,864,025	9,947,101

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2019年4月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ・ライジング・ ジャパン・マザーファンド	9,947,101	98.2
コール・ローン等、その他	186,321	1.8
投資信託財産総額	10,133,423	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

2019年4月16日現在

項 目	当 期 末
(A)資産	10,133,423,730円
コール・ローン等	126,321,920
ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド(評価額)	9,947,101,810
未収入金	60,000,000
(B)負債	142,512,012
未払解約金	61,353,448
未払信託報酬	80,879,631
その他未払費用	278,933
(C)純資産総額(A-B)	9,990,911,718
元本	9,030,151,400
次期繰越損益金	960,760,318
(D)受益権総口数	9,030,151,400口
1万口当り基準価額(C/D)	11,064円

*期首における元本額は10,177,497,981円、当作成期間中における追加設定元本額は48,438,098円、同解約元本額は1,195,784,679円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は11,064円です。

■損益の状況

当期 自 2018年10月17日 至 2019年4月16日

項 目	当 期
(A)配当等収益	△ 30,250円
受取利息	793
その他収益金	1,366
支払利息	△ 32,409
(B)有価証券売買損益	△ 433,073,825
売買益	85,185,398
売買損	△ 518,259,223
(C)信託報酬等	△ 81,161,586
(D)当期損益金(A+B+C)	△ 514,265,661
(E)前期繰越損益金	1,138,934,290
(F)追加信託差損益金	336,091,689
(配当等相当額)	(176,944,783)
(売買損益相当額)	(159,146,906)
(G)合計(D+E+F)	960,760,318
次期繰越損益金(G)	960,760,318
追加信託差損益金	336,091,689
(配当等相当額)	(176,944,783)
(売買損益相当額)	(159,146,906)
分配準備積立金	1,761,072,366
繰越損益金	△ 1,136,403,737

(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いません。

(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	53,300,891円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	176,944,783
(d) 分配準備積立金	1,707,771,475
(e) 当期分配対象額(a+b+c+d)	1,938,017,149
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e-f)	1,938,017,149
(h) 受益権総口数	9,030,151,400口

当ファンドは少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」の適用対象です。非課税口座における取扱いについては販売会社にお問い合わせください。

ダイワ・ライジング・ジャパン・マザーファンド

運用報告書 第1期（決算日 2019年4月16日）

（作成対象期間 2018年7月10日～2019年4月16日）

ダイワ・ライジング・ジャパン・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	信託財産の成長をめざ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（上場予定を含みます。）の株式および不動産投資信託証券（不動産投資信託の受益証券または不動産投資法人の投資証券をいいます。）
株式組入制限	無制限

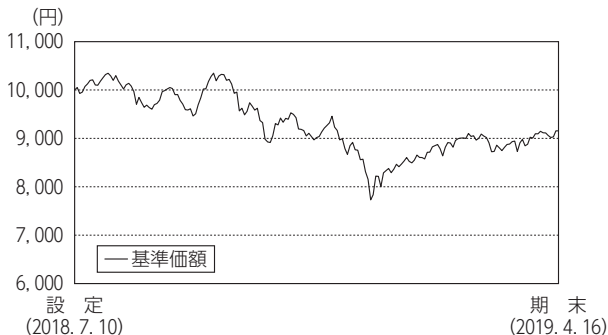
大和投資信託

Daiwa Asset Management

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		T O P I X		株式組入比率	株式先物比率	投資信託証券組入比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率			
(期首)2018年7月10日	10,000	—	1,711.79	—	—	—	—
7月末	10,200	2.0	1,753.29	2.4	95.2	—	—
8月末	10,029	0.3	1,735.35	1.4	95.8	—	—
9月末	10,288	2.9	1,817.25	6.2	96.8	—	—
10月末	9,307	△ 6.9	1,646.12	△ 3.8	97.4	—	—
11月末	9,322	△ 6.8	1,667.45	△ 2.6	96.8	—	—
12月末	8,216	△ 17.8	1,494.09	△ 12.7	98.0	—	—
2019年1月末	8,713	△ 12.9	1,567.49	△ 8.4	97.2	—	—
2月末	8,965	△ 10.4	1,607.66	△ 6.1	97.6	—	—
3月末	8,879	△ 11.2	1,591.64	△ 7.0	96.6	—	—
(期末)2019年4月16日	9,156	△ 8.4	1,626.46	△ 5.0	96.8	—	—

(注1) 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】

設定時：10,000円 期末：9,156円 騰落率：△8.4%

【基準価額の主な変動要因】

米国や中国を中心に世界的な景気減速懸念が高まったことなどから、国内株式市況が下落したことにより、基準価額も下落しました。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、米国の保護主義的な政策への警戒感が強まる一方、堅調な景気や企業業績が評価される局面があったこと、また通商問題でも一部で妥協点を探る動きなどがあったことから、横ばい圏で推移しました。2018年10月以降は、米国の長期金利が上昇したことに対する懸念や、国内外の決算発表において一部の分野で事業環境の悪化が見られたことが嫌気され、株価は下落しました。その後も、中国経済の減速懸念や利上げの停止に言及しなかったFRB（米国連邦準備制度理事会）議長の発言などが嫌気され、株価は下落しました。しかし2019年1月には、FRB議長が一転して引き締め方向にある金融政策の軟化を示唆したことが好感されたほか、2月に入ると閣僚級協議の開催などにより米中貿易摩擦の緩和期待が再び高まり、株価は反発しました。上昇一服後は、世界的な景気減速懸念や米中貿易摩擦などの動向で強気と弱気の見方が交錯し、一進一退で推移しました。

◆ ポートフォリオについて

株式組入比率は、底堅い世界景気や企業業績が続くとの想定のもと、90%程度以上を維持しました。

業種構成は、情報・通信業、陸運業、不動産業などの比率を引き上げる一方、保険業、金属製品、石油・石炭製品などの比率を引き下げました。

個別銘柄では、キャッシュレス決済の拡大による恩恵に期待してTIS、建設技術者派遣が順調に拡大している夢真ホールディングス、スマートフォンによる決済事業の中長期的な成長が期待されるヤフーなどを買い付けました。一方で、業績見通しの先行き不透明感が高まったと判断してソニー、東京競馬、日立金属などを売却しました。

◆ ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。

当ファンドは、参考指数としてTOPIXを用いています。当作成期におけるTOPIXの騰落率は△5.0%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は△8.4%となりました。

TOPIXの騰落率を上回ったサービス業のオーバーウート、TOPIXの騰落率を下回った小売業や食料品のアンダーウートなどがプラス要因となりましたが、TOPIXの騰落率を下回ったガラス・土石製品や金属製品のオーバーウート、TOPIXの騰落率を上回った精密機器のアンダーウートなどはマイナス要因となりました。個別銘柄では、乃村工藝社、オリエンタルランド、ソフトバンク・テクノロジーなどがプラスに寄与しましたが、MARUWA、SUMCO、ラサ工業などはマイナス要因となりました。

《今後の運用方針》

国内株式市況は、世界的な貿易摩擦の動向について注意深く見守る必要があると考えますが、米国ではFRB（米国連邦準備制度理事会）が金融市場に配慮したスタンスへと転換し、中国も金融財政面で景気刺激策を打ち出すなどのプラス材料もあり、今後は、国内外で底堅い経済指標の発表が確認できれば、株価は上昇基調を取り戻すと考えています。株式組入比率（株式先物およびリートを含む。）は90%程度以上の高位を維持し、東京圏の経済活性化の恩恵を受け、中長期の成長が期待できる銘柄を中心に投資してまいります。具体的には、建設・インフラ（社会基盤）、不動産、観光・消費・サービス、AI（人工知能）・ロボット・IoT（モノのインターネット）、交通・物流、金融といった成長テーマに投資することで、信託財産の成長をめざしてまいります。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	8円 (8)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	8

(注1) 費用の項目および算出法については前掲の「1万口当りの費用の明細」の項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 現物株式による設定・交換状況

(2018年7月10日から2019年4月16日まで)

	設 定		交 換	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国内	6,712.3	12,673,075	—	—

(注) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 株 式

(2018年7月10日から2019年4月16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	3,056.7 (△ 170.6)	5,683,428 (—)	3,010.5	5,183,764

(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。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2018年7月10日から2019年4月16日まで)

銘 柄	当 期			買 付			売 付		
	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価	株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円	千株	千円	円	千株	千円	円
日本空港ビルデング	91	491,541	5,401	第一生命 HLDGS	306	634,244	2,072		
夢真ホールディングス	450	414,109	920	ソニー	92.5	527,184	5,699		
T I S	73	383,212	5,249	ビジョン	65	290,118	4,463		
J F E ホールディングス	145	355,730	2,453	JXTG ホールディングス	315	243,296	772		
三井不動産	113	306,498	2,712	J F E ホールディングス	127	230,600	1,815		
T D K	19	237,387	12,494	ヒューリック	195	207,580	1,064		
ヤフー	730	233,649	320	乃村工藝社	63	195,836	3,108		
第一生命 HLDGS	105	220,591	2,100	小松製作所	54	179,580	3,325		
オカダアイヨン	114	198,850	1,744	東京都競馬	50	158,655	3,173		
ソニー	31	181,592	5,857	伊藤忠	70	148,644	2,123		

(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
国内株式

銘柄	当期末		銘柄	当期末		銘柄	当期末	
	株数	評価額		株数	評価額		株数	評価額
	千株	千円		千株	千円		千株	千円
建設業 (3.5%)			マツダ	27	35,505	日本取引所グループ	2	3,656
大成建設	3	14,625	本田技研	16	50,208	不動産業 (7.8%)		
大豊建設	27	81,135	SUBARU	4	11,194	三井不動産	117	308,061
五洋建設	55	27,775	ヤマハ発動機	48	115,008	三菱地所	10	18,805
大和ハウス	68	215,152	陸運業 (4.7%)			平和不動産	47	94,188
関電工	74	69,560	SBS ホールディングス	70	136,360	東京建物	18	23,166
化学 (12.1%)			東京急行	57.5	103,040	レーサム	34	34,238
ラサ工業	114	176,130	京浜急行	52	94,952	トーセイ	61	58,560
トクヤマ	111	321,567	東海旅客鉄道	5	121,100	日本空港ビルデング	81	367,740
関東電化	15	12,225	西武ホールディングス	48	87,216	サービス業 (15.6%)		
信越化学	38	402,420	空運業 (0.1%)			夢真ホールディングス	450	359,550
三菱ケミカル HLDGS	180	145,224	日本航空	3	11,454	ヒビノ	32	77,856
住友ベークライト	26.8	116,580	情報・通信業 (11.7%)			電通	85	391,850
旭有機材	45	81,810	NEC ネットズエスアイ	56	152,824	オリエンタルランド	30	375,300
信越ポリマー	173	155,181	ソフトクリエイイト HD	18.5	30,025	エイチ・アイ・エス	20	77,400
石油・石炭製品 (0.7%)			ピリングシステム	6.5	23,042	共立メンテナンス	60	342,000
JXTG ホールディングス	160	86,480	T I S	73	385,440	東京都競馬	44	149,600
ガラス・土石製品 (3.3%)			豆蔵ホールディングス	60	66,600	乃村工藝社	13	42,055
オハラ	26	37,518	テクマトリックス	45	88,110			
MARUWA	57.8	346,800	ヤフー	730	205,860	合計		
鉄鋼 (0.3%)			伊藤忠テクノソリューションズ	50	132,300	株数、金額	6,587.9	11,637,495
J F E ホールディングス	18	35,253	アイティフォー	30	27,720	銘柄数 < 比率 >	91銘柄	< 96.8% >
東京鐵鋼	3	3,657	ビジョン	9	49,140			
非鉄金属 (0.2%)			日本電信電話	17	79,696			
古河機金	15	21,750	N T T ドコモ	10	23,865			
金属製品 (1.6%)			ソフトバンクグループ	8	95,800			
ケー・エフ・シー	16	27,120	卸売業 (4.7%)					
SUMCO	107	158,467	J A L U X	33	82,467			
機械 (4.6%)			伊藤忠	12	24,000			
平田機工	2	15,400	三井物産	110	196,020			
オカダアイヨン	114	148,428	三菱商事	80	241,920			
小松製作所	106	294,839	小売業 (1.3%)					
酒井重工業	25	71,625	J. フロントリテイリング	9	11,907			
電気機器 (11.7%)			ファーストリテイリング	2.3	142,209			
イビデン	55	96,140	銀行業 (6.9%)					
I D E C	7	15,316	三菱 UFJ フィナンシャル G	580	326,772			
ホーチキ	36	45,072	りそなホールディングス	192	88,646			
ソニー	15.5	82,987	三井住友フィナンシャル G	64	255,296			
TDK	28.8	272,736	みずほフィナンシャル G	730	126,728			
タムラ製作所	35	24,535	証券、商品先物取引業 (0.2%)					
リオン	35	72,520	野村ホールディングス	50	21,375			
新電元工業	8	37,200	保険業 (3.6%)					
キーエンス	3.8	272,004	M S & A D	54	185,868			
村田製作所	56.4	324,187	第一生命 HLDGS	40	65,000			
K O A	72	122,544	東京海上 H D	30	171,810			
輸送用機器 (4.3%)			その他金融業 (1.1%)					
トヨタ自動車	42	286,230	オリックス	80	128,800			

(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。

■投資信託財産の構成

2019年4月16日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	11,637,495 千円	96.3 %
コール・ローン等、その他	452,544	3.7
投資信託財産総額	12,090,039	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

2019年4月16日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	12,090,039,938円
コール・ローン等	292,925,079
株式(評価額)	11,637,495,600
未収入金	19,451,759
未収配当金	140,167,500
(B) 負債	66,912,888
未払金	6,912,568
未払解約金	60,000,000
その他未払費用	320
(C) 純資産総額 (A - B)	12,023,127,050
元本	13,131,058,665
次期繰越損益金	△ 1,107,931,615
(D) 受益権総口数	13,131,058,665口
1万口当り基準価額 (C/D)	9,156円

* 期首における元本額は12,673,075,600円、当作成期間中における追加設定元本額は2,793,870,048円、同解約元本額は2,335,886,983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、きらぼし・東京圏応援株式ファンド2,267,033,097円、ダイワ・ニッポン応援ファンドVol.5-ライジング・ジャパン-10,864,025,568円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,156円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は1,107,931,615円です。

■損益の状況

当期 自 2018年7月10日 至 2019年4月16日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	273,782,486円
受取配当金	273,946,450
受取利息	98
その他収益金	20,258
支払利息	△ 184,320
(B) 有価証券売買損益	△ 1,535,244,025
売買益	547,026,720
売買損	△ 2,082,270,745
(C) その他費用	△ 17,011
(D) 当期損益金 (A + B + C)	△ 1,261,478,550
(E) 解約差損益金	160,146,983
(F) 追加信託差損益金	△ 6,600,048
(G) 合計 (D + E + F)	△ 1,107,931,615
次期繰越損益金 (G)	△ 1,107,931,615

(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。