

ダイワ日本株オープン

運用報告書(全体版) 第18期

(決算日 2020年7月13日)

(作成対象期間 2019年7月12日～2020年7月13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、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	無期限		
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	ダイワ日本株マザーファンドの受益証券	
	ダイワ日本株マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式および店頭登録株式	
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			T O P I X		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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
14期末(2016年7月11日)	10,168	0	△ 15.2	1,255.79	△ 22.2	97.0	—	2,537
15期末(2017年7月11日)	11,176	900	18.8	1,627.14	29.6	102.8	0.5	2,487
16期末(2018年7月11日)	11,629	150	5.4	1,701.88	4.6	92.3	—	2,354
17期末(2019年7月11日)	10,771	0	△ 7.4	1,578.63	△ 7.2	97.0	—	2,033
18期末(2020年7月13日)	10,804	0	0.3	1,573.02	△ 0.4	94.9	—	1,877

(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。

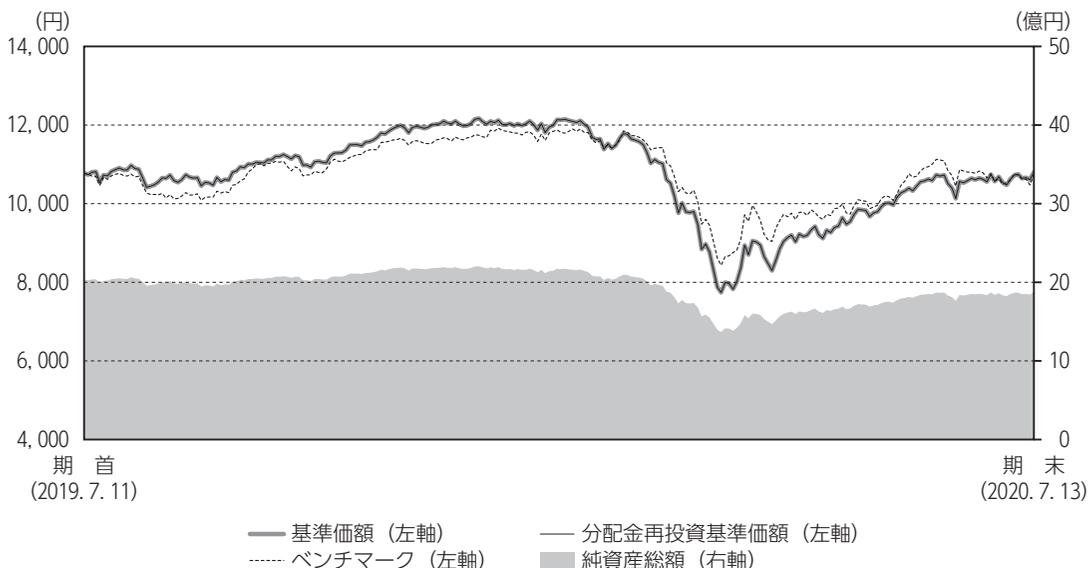
(注3) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

(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TOP I Xです。

基準価額・騰落率

期首：10,771円

期末：10,804円（分配金0円）

騰落率：0.3%（分配金込み）

基準価額の変動要因

国内株式市況は、新型コロナウイルスの感染拡大等を受けた下落局面があった一方で、経済活動の再開や各国の金融緩和策等を受けた上昇局面もあり、一進一退の推移となりました。このような環境の中で、当ファンドの基準価額はやや上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

ダイワ日本株オープン

年 月 日	基 準 価 額		T O P I X		株 式 組入比率	株 式 先物比率
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2019年 7月11日	円	%		%	%	%
	10,771	—	1,578.63	—	97.0	—
7月末	10,897	1.2	1,565.14	△ 0.9	97.3	—
8月末	10,665	△ 1.0	1,511.86	△ 4.2	97.6	—
9月末	11,136	3.4	1,587.80	0.6	94.3	—
10月末	11,620	7.9	1,667.01	5.6	94.8	—
11月末	12,034	11.7	1,699.36	7.6	97.6	—
12月末	12,014	11.5	1,721.36	9.0	93.1	—
2020年 1月末	11,526	7.0	1,684.44	6.7	96.1	—
2月末	9,762	△ 9.4	1,510.87	△ 4.3	97.3	—
3月末	8,947	△ 16.9	1,403.04	△ 11.1	98.2	—
4月末	9,641	△ 10.5	1,464.03	△ 7.3	91.4	—
5月末	10,329	△ 4.1	1,563.67	△ 0.9	91.3	—
6月末	10,685	△ 0.8	1,558.77	△ 1.3	91.2	—
(期末) 2020年 7月13日	10,804	0.3	1,573.02	△ 0.4	94.9	—

(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

(2019. 7. 12 ~ 2020. 7. 13)

国内株式市況

国内株式市況は、一進一退の推移となりました。

国内株式市況は、当作成期首より、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことなどが支えとなり、底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、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ました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。

前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンド

「ダイワ日本株マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

ダイワ日本株マザーファンド

国内株式市場は、世界景気の先行きや米中通商問題に対する懸念の高まりなどから、株式市場全体の不透明感は継続しており、短期的には上にも下にも振れやすい相場状況が続くと思われます。

2019年年初より株価は上昇したものの、個別企業の株価は、依然として実力を反映していないものがあり、評価の見直し余地は非常に大きいとみています。将来のリターンを獲得するためには、目先の株価動向よりも、中長期的な企業動向を重視した運用を行うことが重要であると考えています。引き続き、個別銘柄分析を基本とし、アナリストとの協働に加えて、運用担当者自らも事業会社への取材活動を積極的に行い、個々の企業を調査・分析し、真に成長が期待できる企業に投資することで、基準価額の上昇に努めてまいります。

ポートフォリオについて

(2019. 7. 12 ~ 2020. 7. 13)

■当ファンド

「ダイワ日本株マザーファンド」の受益証券へ投資を行いました。

■ダイワ日本株マザーファンド

株式組入比率は、90%程度以上の高位を維持しました。

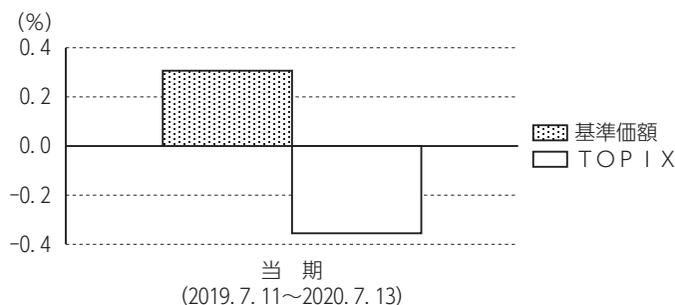
業種構成については、個別銘柄分析に基づき銘柄選別を行った結果、その他製品や情報・通信業などの比率が上昇した一方、サービス業などの比率が低下しました。

個別銘柄では、成長戦略や株価バリュエーションなどを考慮し、エニグモやビジョンなどを新たに組み入れました。一方、ディップやラウンドワンなどを売却しました。

ベンチマークとの差異について

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマーク（TOPIX）との騰落率の対比です。

ベンチマークの騰落率は $\Delta 0.4\%$ 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。基準価額へのプラス寄与度が大きかった銘柄としては、エニグモや第一工業製薬などがあり、一方で、ラウンドワンやビジョンなどがマイナスに作用しました。



分配金について

当作成期は、基準価額の水準等を勘案して、収益の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	
	2019年7月12日 ～2020年7月13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）	2,232

- (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

「ダイワ日本株マザーファンド」の受益証券へ投資を行います。

■ダイワ日本株マザーファンド

国内株式市場は上にも下にも振れやすい不安定な推移を想定しています。世界的な景気や企業業績の先行きに対する不透明感に加え、新型コロナウイルスの感染拡大や米中関係の悪化に対する懸念など、国内株式市場を取り巻く投資環境は依然として楽観視できない状況と考えます。一方で、各国政府や主要中央銀行による国際協調的な政策対応の推進、国内外における経済活動の再開に向けた動きなどが金融市場の下支え要因になると考えます。

先行きが見通しづらい市場環境ではありますが、個別企業を丹念に調査することで、この苦境を乗り越え、成長し得る企業を見極めることが、当ファンドの中長期的リターンにつながるものと考えており、引き続き、基準価額の上昇に努めてまいります。

1万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2019. 7. 12～2020. 7. 13)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	180円	1. 678%	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, 741円です。
(投 信 会 社)	(97)	(0. 906)	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)	(71)	(0. 662)	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)	(12)	(0. 110)	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	14	0. 127	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)	(14)	(0. 127)	
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. 005	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	194	1. 810	

(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。

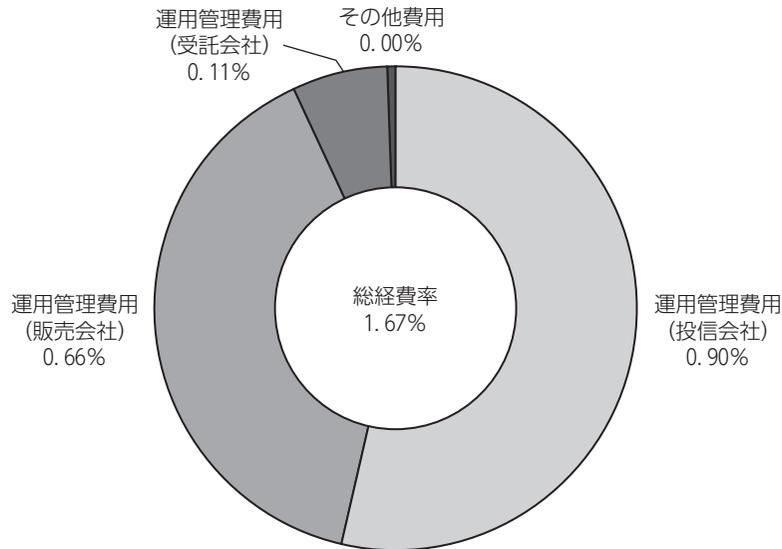
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.67%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。

ダイワ日本株オープン

■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

(2019年7月12日から2020年7月13日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
ダイワ日本株 マザーファンド	767	1,900	82,345	200,350

(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

(2019年7月12日から2020年7月13日まで)

項 目	当 期
	ダイワ日本株マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	6,193,859千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,538,732千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.36

(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利害関係人との取引状況

(2019年7月12日から2020年7月13日まで)

決 算 期	当 期					
	買 付 額 等			売 付 額 等		
区 分	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	2,844	1,023	36.0	3,349	770	23.0
コール・ローン	53,234	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合40.6%

※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) 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

(2019年7月12日から2020年7月13日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	2,447千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1,039千円
(B) / (A)	42.5%

(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	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
ダイワ日本株マザーファンド	854,626	773,048	1,875,570

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2020年7月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
ダイワ日本株マザーファンド	1,875,570	99.1
コール・ローン等、その他	16,664	0.9
投資信託財産総額	1,892,234	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

2020年7月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,892,234,496円
コール・ローン等	16,254,299
ダイワ日本株マザーファンド (評価額)	1,875,570,197
未収入金	410,000
(B) 負債	14,807,864
未払信託報酬	14,758,419
その他未払費用	49,445
(C) 純資産総額 (A - B)	1,877,426,632
元本	1,737,695,469
次期繰越損益金	139,731,163
(D) 受益権総口数	1,737,695,469口
1万口当り基準価額 (C / D)	10,804円

* 期首における元本額は1,888,080,278円、当作成期間中における追加設定元本額は5,668,388円、同解約元本額は156,053,197円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は10,804円です。

■損益の状況

当期 自 2019年7月12日 至 2020年7月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,933円
受取利息	167
支払利息	△ 4,100
(B) 有価証券売買損益	38,462,343
売買益	50,465,987
売買損	△ 12,003,644
(C) 信託報酬等	△ 32,546,831
(D) 当期損益金 (A + B + C)	5,911,579
(E) 前期繰越損益金	29,735,502
(F) 追加信託差損益金	104,084,082
(配当等相当額)	(196,331,282)
(売買損益相当額)	(△ 92,247,200)
(G) 合計 (D + E + F)	139,731,163
次期繰越損益金 (G)	139,731,163
追加信託差損益金	104,084,082
(配当等相当額)	(196,331,282)
(売買損益相当額)	(△ 92,247,200)
分配準備積立金	191,615,359
繰越損益金	△ 155,968,278

(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	5,187,967円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	196,331,282
(d) 分配準備積立金	186,427,392
(e) 当期分配対象額 (a + b + c + d)	387,946,641
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額 (e - f)	387,946,641
(h) 受益権総口数	1,737,695,469口

《お知らせ》

■商号変更について

大和証券投資信託委託株式会社は、2020年4月1日付で、商号を「大和アセットマネジメント株式会社」に変更いたしました。

ダイワ日本株マザーファンド

運用報告書 第18期 (決算日 2020年7月13日)

(作成対象期間 2019年7月12日～2020年7月13日)

ダイワ日本株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および店頭登録株式
株式組入制限	無制限

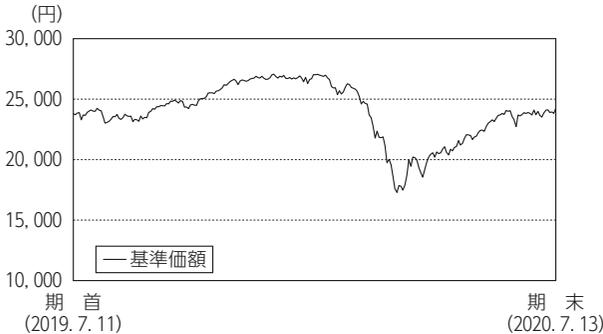
大和アセットマネジメント

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		T O P I X		株式組入率 %	株式先物比率 %
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2019年7月11日	23,786	—	1,578.63	—	97.1	—
7月末	24,085	1.3	1,565.14	△ 0.9	97.4	—
8月末	23,604	△ 0.8	1,511.86	△ 4.2	97.7	—
9月末	24,681	3.8	1,587.80	0.6	94.4	—
10月末	25,792	8.4	1,667.01	5.6	94.9	—
11月末	26,748	12.5	1,699.36	7.6	97.7	—
12月末	26,742	12.4	1,721.36	9.0	93.2	—
2020年1月末	25,692	8.0	1,684.44	6.7	96.2	—
2月末	21,784	△ 8.4	1,510.87	△ 4.3	97.4	—
3月末	19,993	△ 15.9	1,403.04	△ 11.1	98.3	—
4月末	21,575	△ 9.3	1,464.03	△ 7.3	91.5	—
5月末	23,146	△ 2.7	1,563.67	△ 0.9	91.4	—
6月末	23,980	0.8	1,558.77	△ 1.3	91.3	—
(期末) 2020年7月13日	24,262	2.0	1,573.02	△ 0.4	95.0	—

(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】
 期首：23,786円 期末：24,262円 騰落率：2.0%
 【基準価額の主な変動要因】

国内株式市況は、新型コロナウイルスの感染拡大等を受けた下落局面があった一方で、経済活動の再開や各国の金融緩和策等を受けた上昇局面もあり、一進一退の推移となりました。このような環境の中で、当ファンドの基準価額はやや上昇しました。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、一進一退の推移となりました。

国内株式市況は、当作成期首より、2019年6月末に開催された米中首脳会談で一定の関係改善が見られたことなどが支えとなり、底堅く推移しました。8月には、米国が再び対中追加関税の対象を拡大する方針を表明したことが嫌気され株価は下落したものの、9月以降は、米国が連続利下げを実施したことで過度な景気後退懸念が和らいだことや、米中間で通商問題の部分合意がなされたことなどが好感され、株価は上昇しました。しかし2020年1月下旬に、中国において新型コロナウイルスの感染拡大が懸念され下落したことに続き、2月後半以降は中国以外における感染拡大が懸念され、3月に入ると米国において感染者の増加が目立ち始めたほか、国内においても感染者の急激な増加が懸念される状況となり、株価は2月後半から3月中旬にかけて大幅に下落しました。3月下旬以降は、主要国の中央銀行による金融緩和策を受けて株価は上昇に転じました。新型コロナウイルスの新規感染者数がピークアウトしてきた欧米で経済活動の再開が進展したことや、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ました。しかし6月中旬以降は、米国において新型コロナウイルスの感染拡大が再び懸念され、株価は頭打ちとなりました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

国内株式市場は、世界景気の先行きや米中通商問題に対する懸念の高まりなどから、株式市場全体の不透明感は継続しており、短期的には上にも下にも振れやすい相場状況が続くと思われる。

2019年年初より株価は上昇したものの、個別企業の株価は、依然として実力を反映していないものがあり、評価の見直し余地は非常に大きいとみています。将来のリターンを獲得するためには、目先の株価動向よりも、中長期的な企業動向を重視した運用を行うことが重要であると考えています。引き続き、個別銘柄分析を基本とし、アナリストとの協働に加えて、運用担当者自らも事業会社への取材活動を積極的にを行い、個々の企業を調査・分析し、真に成長が期待できる企業に投資することで、基準価額の上昇に努めてまいります。

◆ポートフォリオについて

株式組入率は、90%程度以上の高位を維持しました。業種構成については、個別銘柄分析に基づき銘柄選別を行った結果、その他製品や情報・通信業などの比率が上昇した一方、サービス業などの比率が低下しました。個別銘柄では、成長戦略や株価バリュエーションなどを考慮し、エニグモやビジョンなどを新たに組み入れました。一方、ディップやラウンドワンなどを売却しました。

◆ベンチマークとの差異について

ベンチマーク(TOPIX)の騰落率は△0.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は2.0%となりました。基準価額へのプラス寄与度が大きかった銘柄としては、エニグモや第一工業製薬などがあり、一方で、ラウンドワンやビジョンなどがマイナスに作用しました。

《今後の運用方針》

国内株式市場は上にも下にも振れやすい不安定な推移を想定しています。世界的な景気や企業業績の先行きに対する不透明感に加え、新型コロナウイルスの感染拡大や米中関係の悪化に対する懸念など、国内株式市場を取り巻く投資環境は依然として楽観視できない状況と考えます。一方で、各国政府や主要中央銀行による国際協力的な政策対応の推進、国内における経済活動の再開に向けた動きなどが金融市場の支え要因内外と考えます。

先行きが見通しづらい市場環境ではありますが、個別企業を丹念に調査することで、この苦境を乗り越え、成長し得る企業を見極めることが、当ファンドの中長期的リターンにつながるものと考えており、引き続き、基準価額の上昇に努めてまいります。

ダイワ日本株マザーファンド

■1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式)	30円 (30)
有価証券取引税	—
その他費用 (その他)	0 (0)
合 計	30

(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) 項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

株 式

(2019年7月12日から2020年7月13日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
国内	千株 1,569.9 (112.6)	千円 2,844,697 (ー)	千株 2,258.3	千円 3,349,162

(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

(2019年7月12日から2020年7月13日まで)

銘 柄	当 期			期			
	株 数	金 額	平均単価	銘 柄	株 数	金 額	平均単価
ピジョン	千株 55.6	千円 214,585	円 3,859	ディップ	千株 99.5	千円 218,805	円 2,199
エニグモ	200.5	192,314	959	J S R	122.4	217,369	1,775
ポート	165	154,292	935	野村総合研究所	82	201,603	2,458
日本電信電話	47	117,985	2,510	フィル・カンパニー	47.5	185,970	3,915
B E E N O S	81.6	103,719	1,271	ヒロセ電機	14	185,402	13,243
日産化学	29.5	103,674	3,514	シグマクシス	103.8	148,348	1,429
日本瓦斯	32.1	102,077	3,179	ラウンドワン	206	132,953	645
明電舎	58.4	101,259	1,733	ポート	165	128,370	778
ラウンドワン	93.2	99,374	1,066	日本特殊陶業	62.1	112,849	1,817
レッグス	59.4	95,868	1,613	ネクステージ	177.2	107,842	608

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

ダイワ日本株マザーファンド

■投資信託財産の構成

2020年7月13日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	4,390,248 千円	90.3 %
コール・ローン等、その他	469,491	9.7
投資信託財産総額	4,859,739	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

2020年7月13日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	4,859,739,608円
コール・ローン等	414,318,014
株式 (評価額)	4,390,248,500
未収入金	48,961,794
未取配当金	6,211,300
(B) 負債	238,122,808
未払金	235,161,872
未払解約金	2,960,000
その他未払費用	936
(C) 純資産総額 (A - B)	4,621,616,800
元本	1,904,895,903
次期繰越損益金	2,716,720,897
(D) 受益権総口数	1,904,895,903口
1万口当り基準価額 (C / D)	24,262円

* 期首における元本額は2,111,150,355円、当作成期間中における追加設定元本額は40,084,670円、同解約元本額は246,339,122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、ダイワ日本株オープンV A1,131,847,433円、ダイワ日本株オープン773,048,470円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,262円です。

■損益の状況

当期 自 2019年7月12日 至 2020年7月13日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	85,887,207円
受取配当金	85,979,450
受取利息	829
その他収益金	7,090
支払利息	△ 100,162
(B) 有価証券売買損益	19,898,055
売買益	792,984,111
売買損	△ 773,086,056
(C) その他費用	△ 1,655
(D) 当期損益金 (A + B + C)	105,783,607
(E) 前期繰越損益金	2,910,512,838
(F) 解約差損益金	△ 352,670,878
(G) 追加信託差損益金	53,095,330
(H) 合計 (D + E + F + G)	2,716,720,897
次期繰越損益金 (H)	2,716,720,897

(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。