

# iFree J P X日経400 インデックス

## 運用報告書（全体版） 第6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、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   | 無期限（設定日：2016年9月8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   |            |           | J P X 日経インデックス400 |           | 株式組入率<br>比 | 株式先物率<br>比 | 純資産額<br>総 |
|-----------------|--------|------------|-----------|-------------------|-----------|------------|------------|-----------|
|                 | (分配落)  | 税込み<br>分配金 | 期中<br>騰落率 | (ベンチマーク)          | 期中<br>騰落率 |            |            |           |
|                 | 円      | 円          | %         |                   | %         | %          | %          | 百万円       |
| 2期末(2018年3月22日) | 12,977 | 0          | 13.8      | 12,603            | 11.7      | 97.2       | 2.0        | 152       |
| 3期末(2019年3月22日) | 12,469 | 0          | △ 3.9     | 11,871            | △ 5.8     | 99.1       | 1.0        | 577       |
| 4期末(2020年3月23日) | 10,254 | 0          | △ 17.8    | 9,529             | △ 19.7    | 97.6       | 2.4        | 762       |
| 5期末(2021年3月22日) | 16,249 | 0          | 58.5      | 14,779            | 55.1      | 95.9       | 0.1        | 1,530     |
| 6期末(2022年3月22日) | 16,161 | 0          | △ 0.5     | 14,414            | △ 2.5     | 99.0       | 1.1        | 2,321     |

(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) 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。

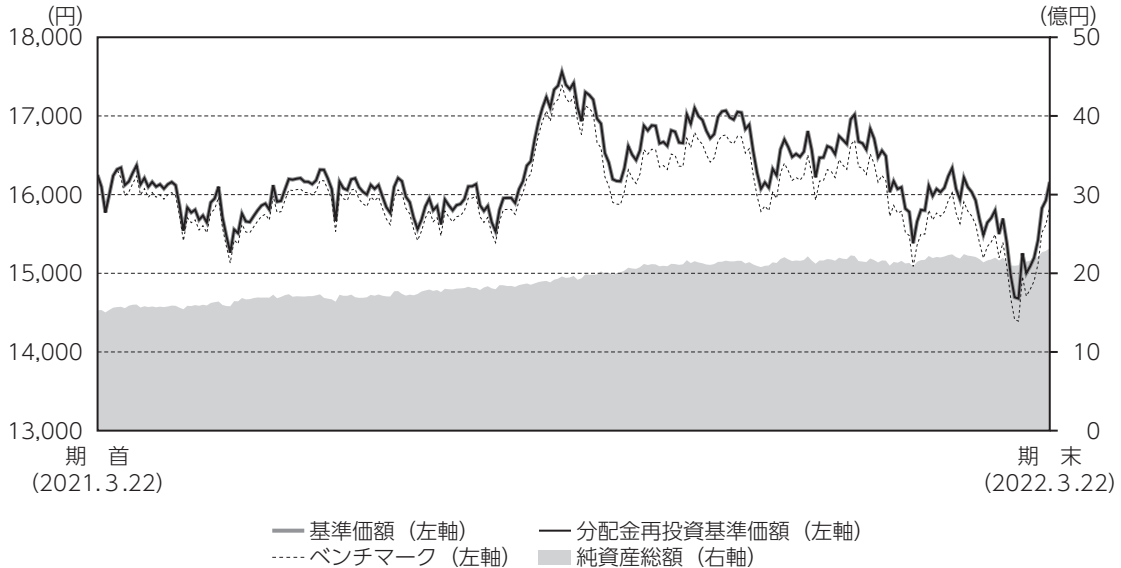
(注5) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

「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およびベンチマークは、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。
- \*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：16,249円

期末：16,161円（分配金0円）

騰落率：△0.5%（分配金込み）

### ■ 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。

## iFree J P X日経400インデックス

| 年 月 日            | 基 準 価 額     |        | J P X日経インデックス400<br>(ベンチマーク) |        | 株 式 組 入 率<br>比 | 株 式 先 物 率<br>比 |
|------------------|-------------|--------|------------------------------|--------|----------------|----------------|
|                  | 騰 落 率       | 騰 落 率  | 騰 落 率                        | 騰 落 率  |                |                |
| (期首) 2021年 3月22日 | 円<br>16,249 | %<br>- | 14,779                       | %<br>- | %<br>95.9      | %<br>0.1       |
| 3月末              | 16,122      | △0.8   | 14,541                       | △1.6   | 97.7           | 2.3            |
| 4月末              | 15,646      | △3.7   | 14,111                       | △4.5   | 97.7           | 2.0            |
| 5月末              | 15,910      | △2.1   | 14,345                       | △2.9   | 98.0           | 1.9            |
| 6月末              | 16,036      | △1.3   | 14,447                       | △2.2   | 98.3           | 1.8            |
| 7月末              | 15,622      | △3.9   | 14,075                       | △4.8   | 98.7           | 1.2            |
| 8月末              | 16,169      | △0.5   | 14,569                       | △1.4   | 99.1           | 0.6            |
| 9月末              | 16,902      | 4.0    | 15,094                       | 2.1    | 97.3           | 2.5            |
| 10月末             | 16,655      | 2.5    | 14,876                       | 0.7    | 97.8           | 2.0            |
| 11月末             | 16,074      | △1.1   | 14,358                       | △2.8   | 97.7           | 2.3            |
| 12月末             | 16,643      | 2.4    | 14,845                       | 0.4    | 97.4           | 2.4            |
| 2022年 1月末        | 15,805      | △2.7   | 14,099                       | △4.6   | 96.8           | 3.2            |
| 2月末              | 15,703      | △3.4   | 14,005                       | △5.2   | 96.5           | 3.2            |
| (期末) 2022年 3月22日 | 16,161      | △0.5   | 14,414                       | △2.5   | 99.0           | 1.1            |

(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

(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」

### 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、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。

## 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。

### 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 |

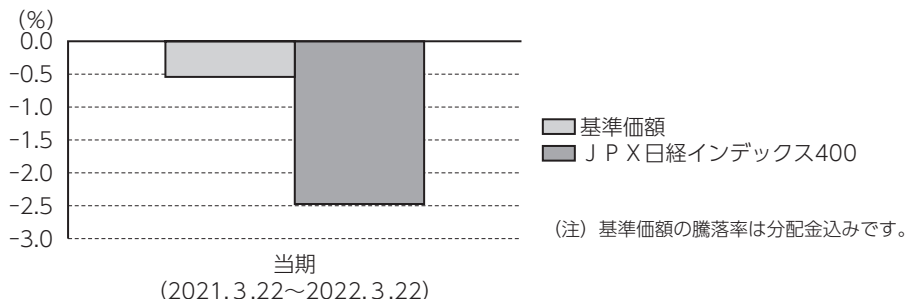
## ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は $\Delta 2.5\%$ となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は $\Delta 0.5\%$ 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。



\*ベンチマークはJ P X日経インデックス400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                       |       |
|------------|---------------------------|-------|
|            | 2021年3月23日<br>～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)                       | 6,160 |

(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却等損益」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」の受益証券を通じ、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<br>(2021.3.23~2022.3.22) |         | 項 目 の 概 要   |
|---------------|-----------------------------|---------|---|
|               | 金 額                         | 比 率     |   |
| 信 託 報 酬       | 35円                         | 0.214%  | 信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率<br>当作成期中の平均基準価額は16,221円です。                      |
| (投 信 会 社)     | (16)                        | (0.099) | 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)     | (14)                        | (0.088) | 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)     | (4)                         | (0.027) | 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<br>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<br>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           | 36                          | 0.221   |   |

(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。

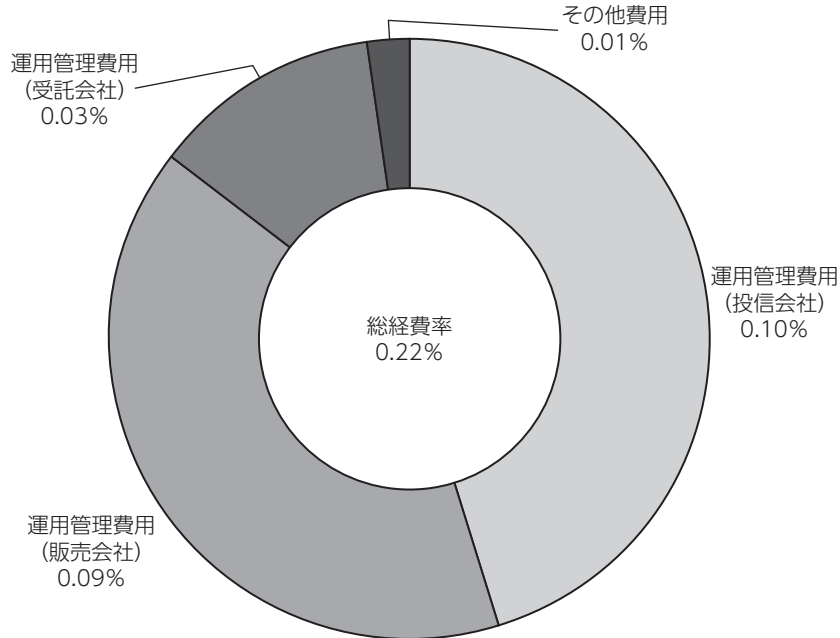
(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該マザーファンドが支払った金額のうち、このファンドに対応するものを含みます。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。



## 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0.22%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J P X日経400マザーファンド | 786,942 | 1,397,510 | 340,766 | 615,280 |

(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J P X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     |                |      |       |                |     |
|---------|---------|----------------|------|-------|----------------|-----|
|         | 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 |
|         | 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11.7%

\*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J P X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J P X日経400マザーファンド |
|     | 買 付 額                |
| 株式  | 百万円<br>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J P X日経400マザーファンド | 855,846 | 1,302,021 | 2,321,114 |

(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J P X日経400マザーファンド | 2,321,114 | 99.6  |
| コール・ローン等、その他         | 9,253     | 0.4   |
| 投資信託財産総額             | 2,330,367 | 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                 |
|-------------------------|-----------------------|
| <b>(A) 資産</b>           | <b>2,330,367,519円</b> |
| コール・ローン等                | 9,153,453             |
| ダイワJPX日経400マザーファンド(評価額) | 2,321,114,066         |
| 未収入金                    | 100,000               |
| <b>(B) 負債</b>           | <b>9,193,097</b>      |
| 未払解約金                   | 6,858,178             |
| 未払信託報酬                  | 2,276,632             |
| その他未払費用                 | 58,287                |
| <b>(C) 純資産総額(A - B)</b> | <b>2,321,174,422</b>  |
| 元本                      | 1,436,316,699         |
| 次期繰越損益金                 | 884,857,723           |
| <b>(D) 受益権総口数</b>       | <b>1,436,316,699口</b> |
| <b>1万口当り基準価額(C / D)</b> | <b>16,161円</b>        |

\*期首における元本額は942,051,811円、当作成期間中における追加設定元本額は1,179,198,043円、同解約元本額は684,933,155円です。

\*当期末の計算口数当りの純資産額は16,161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                |
|-----------------------------|--------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>            | <b>△ 1,027円</b>    |
| 受取利息                        | 286                |
| 支払利息                        | △ 1,313            |
| <b>(B) 有価証券売買損益</b>         | <b>△ 2,400,059</b> |
| 売買益                         | 17,453,954         |
| 売買損                         | △ 19,854,013       |
| <b>(C) 信託報酬等</b>            | <b>△ 4,238,113</b> |
| <b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b> | <b>△ 6,639,199</b> |
| <b>(E) 前期繰越損益金</b>          | <b>157,676,269</b> |
| <b>(F) 追加信託差損益金</b>         | <b>733,820,653</b> |
| (配当等相当額)                    | ( 316,692,743)     |
| (売買損益相当額)                   | ( 417,127,910)     |
| <b>(G) 合計(D + E + F)</b>    | <b>884,857,723</b> |
| <b>次期繰越損益金(G)</b>           | <b>884,857,723</b> |
| 追加信託差損益金                    | 733,820,653        |
| (配当等相当額)                    | ( 316,692,743)     |
| (売買損益相当額)                   | ( 417,127,910)     |
| 分配準備積立金                     | 157,676,762        |
| 繰越損益金                       | △ 6,639,692        |

(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        | 0              |
| (c) 収益調整金                  | 727,182,481    |
| (d) 分配準備積立金                | 157,676,762    |
| (e) 当期分配対象額(a + b + c + d) | 884,859,243    |
| (f) 分配金                    | 0              |
| (g) 翌期繰越分配対象額(e - f)       | 884,859,243    |
| (h) 受益権総口数                 | 1,436,316,699口 |

# ダイワ J P X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 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<br>(ベンチマーク) |       | 株 式<br>組 入<br>比 率 | 株 先<br>比 率 | 式 物<br>率 率 |
|-----------------|--------|-------|------------------------------|-------|-------------------|------------|------------|
|                 | 円      | 騰 落 率 | 円                            | 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<br>(株式)<br>(先物・オプション) | 0円<br>(0)<br>(0) |
| 有価証券取引税                       | —                |
| その他費用<br>(その他)                | 0<br>(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       |
|    | 千株                | 千円               | 千株     | 千円        |
| 国内 | 992.5<br>(133.95) | 2,915,280<br>(-) | 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    | 百万円   | 百万円   | 百万円   | 百万円   |
| 株式先物取引 | 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HLDGS   |   | 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UFJ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  |
| SGホールディングス    |   | 15.6 | 46,231  | 2,963  | ANA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   |      |        | 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     |
|                      | 千株   | 千株   | 千円     |                     | 千株   | 千株   | 千円      |                        | 千株   | 千株    | 千円      |
| <b>水産・農林業 (0.0%)</b> |      |      |        | <b>繊維製品 (0.4%)</b>  |      |      |         | 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  |
| <b>鉱業 (0.4%)</b>     |      |      |        | ゴールドウイン             | 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 | <b>パルプ・紙 (0.2%)</b> |      |      |         | 小野薬品                   | 17.4 | 19.5  | 59,260  |
| <b>建設業 (2.5%)</b>    |      |      |        | 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  | <b>化学 (7.3%)</b>    |      |      |         | 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  | <b>石油・石炭製品 (0.6%)</b>  |      |       |         |
| 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  | ENEOS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HDGS           | 2.4  | 2.5   | 6,860   |
| 前田建設                 | 6    | -    | -      | エア・ウォーター            | 7.6  | 7.9  | 13,588  | <b>ゴム製品 (0.8%)</b>     |      |       |         |
| 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  | TOYO TIRE              | 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  | <b>ガラス・土石製品 (0.7%)</b> |      |       |         |
| 住友林業                 | 5.6  | 6.8  | 14,892 | KHネオケム              | 1.2  | -    | -       | AGC                    | 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   | TOTO                   | 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  | ニチアス                   | 1.9  | 2     | 4,998   |
| <b>食料品 (3.7%)</b>    |      |      |        | 花王                  | 18.1 | 18.8 | 93,924  | <b>鉄鋼 (-)</b>          |      |       |         |
| 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   | <b>非鉄金属 (0.8%)</b>     |      |       |         |
| 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  | -     | -       |
| アリマハム                | -    | 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         | 16.6 | 20   | 87,800 | ポーラ・オルビスHD          | 3.2  | 3.6  | 5,965   | <b>金属製品 (0.3%)</b>     |      |       |         |
| キリンHD                | 32.3 | 31.3 | 56,840 | 小林製薬                | 2.1  | 2.4  | 24,168  | SUMCO                  | 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   | <b>機械 (5.9%)</b>       |      |       |         |
| 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 | <b>医薬品 (6.3%)</b>   |      |      |         | 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   |      |         | 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  |
| 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/MC                | 2.2  | 2.5  | 168,475 |     |    |     | キヤノン                 | 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  |     |    |     | <b>輸送用機器 (6.3%)</b>  |      |       |         |     |    |                   | 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  |     |    |     |
| THK                 | 4.7  | -    | -       |     |    |     | 本田技研                 | 59.7 | 66.7  | 226,446 |     |    |                   | SG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  |     |    |     | SUBARU               | 21.7 | 24.3  | 45,659  |     |    | <b>海運業 (0.8%)</b> |                        |       |        |         |     |    |     |
| IHI                 | 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  |     |    |     |
| <b>電気機器 (17.4%)</b> |      |      |         |     |    |     | 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  |     |    |                   | <b>空運業 (-)</b>         |       |        |         |     |    |     |
| 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 |     |    |     | <b>精密機器 (3.0%)</b>   |      |       |         |     |    |                   | ANAホールディングス            | 19.4  | -      | -       |     |    |     |
| 三菱電機                | 75.8 | 84.8 | 119,144 |     |    |     | デルモ                  | 23.2 | 24    | 90,792  |     |    |                   | <b>倉庫・運輸関連業 (0.0%)</b> |       |        |         |     |    |     |
| 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  |     |    |     | アイ・テクノロジー            | 0.4  | 0.4   | 1,346   |     |    |                   | <b>情報・通信業 (7.6%)</b>   |       |        |         |     |    |     |
| 東芝テック               | 0.8  | -    | -       |     |    |     | 東京精密                 | 1.3  | 1.4   | 6,671   |     |    |                   | NEC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   |     |    |     |
| MCJ                 | 2.4  | 2.9  | 2,740   |     |    |     | HOYA                 | 15   | 16.5  | 226,875 |     |    |                   | TIS                    | 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  |     |    |                   | コーエーテックモHD             | 1.5   | 2.7    | 11,083  |     |    |     |
| 富士通                 | 6.8  | 7.6  | 135,356 |     |    |     | <b>その他製品 (2.1%)</b>  |      |       |         |     |    | 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 |     |    |     | <b>電気・ガス業 (1.3%)</b> |      |       |         |     |    |                   | 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   |     |    |     |
| TDK                 | 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  |     |    |     | <b>陸運業 (1.7%)</b>    |      |       |         |     |    |                   | 日本ユニシス                 | 2.6   | 2.6    | 8,086   |     |    |     |
| OBARA GROUP         | 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 | -     | -       |     |    |                   | KDDI                   | 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  | -     | -       |     |    |                   | カブコム                   | 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  |     |    |     |





# 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<br>401,400<br>( 200) | 株<br>—<br>(—) |

(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<br>16,247,274 | %<br>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                  |
|-------------------------|------------------------|
| <b>(A) 資産</b>           | <b>17,929,654,689円</b> |
| 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>(B) 負債</b>           | <b>1,514,559,221</b>   |
| 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          |
| <b>(C) 純資産総額(A - B)</b> | <b>16,415,095,468</b>  |
| 元本                      | 9,207,900,732          |
| 次期繰越損益金                 | 7,207,194,736          |
| <b>(D) 受益権総口数</b>       | <b>9,207,900,732口</b>  |
| 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                   |
|---------------------------------|-----------------------|
| <b>(A) 配当等収益</b>                | <b>358,831,526円</b>   |
| 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>(B) 有価証券売買損益</b>             | <b>△ 355,109,314</b>  |
| 売買益                             | 1,296,255,284         |
| 売買損                             | △1,651,364,598        |
| <b>(C) 先物取引等損益</b>              | <b>△ 28,207,400</b>   |
| 取引益                             | 36,577,850            |
| 取引損                             | △ 64,785,250          |
| <b>(D) その他費用</b>                | <b>△ 4,344</b>        |
| <b>(E) 当期損益金(A + B + C + D)</b> | <b>△ 24,489,532</b>   |
| <b>(F) 前期繰越損益金</b>              | <b>7,309,467,509</b>  |
| <b>(G) 解約差損益金</b>               | <b>△1,497,918,720</b> |
| <b>(H) 追加信託差損益金</b>             | <b>1,420,135,479</b>  |
| <b>(I) 合計(E + F + G + H)</b>    | <b>7,207,194,736</b>  |
| 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。

「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。