

ダイワJ P X日経400ファンド

運用報告書（全体版） 第12期

（決算日 2025年3月24日）
（作成対象期間 2024年3月23日～2025年3月24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（配当込み）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：2014年1月6日）	
運用方針	投資成果をJ P X日経インデックス400（配当込み）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
	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。	

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 (配当込み)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額
	(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			
8 期末(2021年3月22日)	円 15,857	円 320	% 57.7	17,771	% 58.9	% 97.8	% 0.1	百万円 9,669
9 期末(2022年3月22日)	15,692	0	△ 1.0	17,703	△ 0.4	99.0	1.1	8,957
10 期末(2023年3月22日)	15,896	340	3.5	18,447	4.2	99.1	2.4	9,037
11 期末(2024年3月22日)	22,813	450	46.3	27,195	47.4	100.2	1.3	11,872
12 期末(2025年3月24日)	22,974	0	0.7	27,607	1.5	99.5	0.4	12,389

(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 (配当込み) 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」及び同指数に配当収益を加味した「配当込 J P X 日経インデックス400 (本書類における「J P X 日経インデックス400 (配当込み)」をいう。)(以下、総称して「J P X 日経400等」という。)) は、株式会社 J P X 総研 (以下「J P X 総研」という。)) 及び株式会社日本経済新聞社 (以下「日経」という。)) 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 総研及び日経は、「J P X 日経400等」自体及び「J P X 日経400等」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る。J P X 総研及び日経は、「J P X 日経400等」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、遅延又は中断に関して、責任を負わない。当ファンドは、大和アセットマネジメントの責任のもとで運用されるものであり、J P X 総研及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負わない。



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（配当込み）です。

■ 基準価額・騰落率

期 首：22,813円

期 末：22,974円（分配金0円）

騰落率：0.7%（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、わが国の株式市場が上昇したことを受け、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

年 月 日	基 準 価 額		J P X日経インデックス400(配当込み)		株 式 組 入 率	株 式 先 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2024年 3月22日	円 22,813	% -	27,195	% -	% 100.2	% 1.3
3 月末	22,665	△0.6	27,026	△0.6	97.9	2.2
4 月末	22,542	△1.2	26,903	△1.1	97.9	2.0
5 月末	22,854	0.2	27,307	0.4	97.9	2.1
6 月末	23,228	1.8	27,769	2.1	99.1	0.8
7 月末	23,140	1.4	27,682	1.8	98.4	1.5
8 月末	22,483	△1.4	26,895	△1.1	98.6	1.4
9 月末	22,067	△3.3	26,422	△2.8	98.6	1.5
10月末	22,410	△1.8	26,853	△1.3	98.1	1.9
11月末	22,214	△2.6	26,632	△2.1	97.8	2.1
12月末	22,975	0.7	27,559	1.3	99.4	0.5
2025年 1 月末	22,990	0.8	27,593	1.5	99.4	0.5
2 月末	22,112	△3.1	26,558	△2.3	98.6	1.5
(期末) 2025年 3月24日	22,974	0.7	27,607	1.5	99.5	0.4

(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

(2024.3.23~2025.3.24)

■国内株式市況

国内株式市況は、史上最高値更新後に歴史的な急落に見舞われましたが、その後は上昇トレンドに回復しました。

国内株式市況は、当作成期首より、円安進行などが好感された一方でインフレ再燃懸念による米国株の下落などが嫌気され、保ち合いとなりました。2024年6月下旬以降は、海外のAI（人工知能）関連企業の株価急騰や円安進行などが好感されて上昇し、史上最高値を更新しました。7月中旬に入ると、米国の対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落に転じました。7月末には、日銀の利上げ決定と植田日銀総裁のタカ派発言で金融政策の不透明感がにわかに強まったことに加え、8月初旬に発表された米国の雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから急速に円高が進行し、株価は歴史的な急落に見舞われました。しかし、内田日銀副総裁のハト派発言や米国の経済指標の改善などを受けて株価は急反発し、9月初旬には急落直前の水準をほぼ回復しました。その後は、9月中旬にかけて円高が進行したことや10月下旬の衆議院議員選挙で与党が過半数割れとなったこと、11月初旬の米国大統領選挙でトランプ元大統領が勝利して関税引き上げを巡る政策の不透明感が強まったことなどから、一時的に下落する局面はありましたが、高水準の自社株買いなどが支えとなり、年末にかけて徐々に下値を切上げ緩やかに上昇しました。2025年1月以降は、日銀の利上げ観測の高まりによる円高進行やトランプ米国政権による関税引き上げなどが懸念された一方、良好な決算や株主還元拡充の発表などが好感されてレンジ内での推移となり、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

(2024.3.23~2025.3.24)

■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。

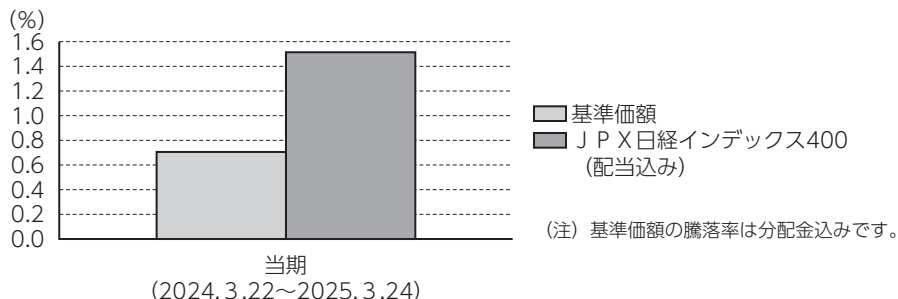
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワ J P X 日経400マザーファンド	J P X 日経インデックス400 (配当込み)

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1.5%、当ファンドの基準価額の騰落率は0.7%となりました。

運用管理費用や売買コスト等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 (配当込み) です。

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	
	2024年3月23日 ～2025年3月24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）	12,973

- (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。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



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 (2024.3.23~2025.3.24)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	163円	0.724%	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22,470円です。
(投 信 会 社)	(80)	(0.354)	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)	(75)	(0.332)	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)	(9)	(0.039)	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	1	0.005	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)	(1)	(0.004)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 有価証券取引税は、有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
そ の 他 費 用	1	0.006	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0.006)	監査費用は、監査法人等に支払うファンドの監査に係る費用
合 計	165	0.735	

(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。

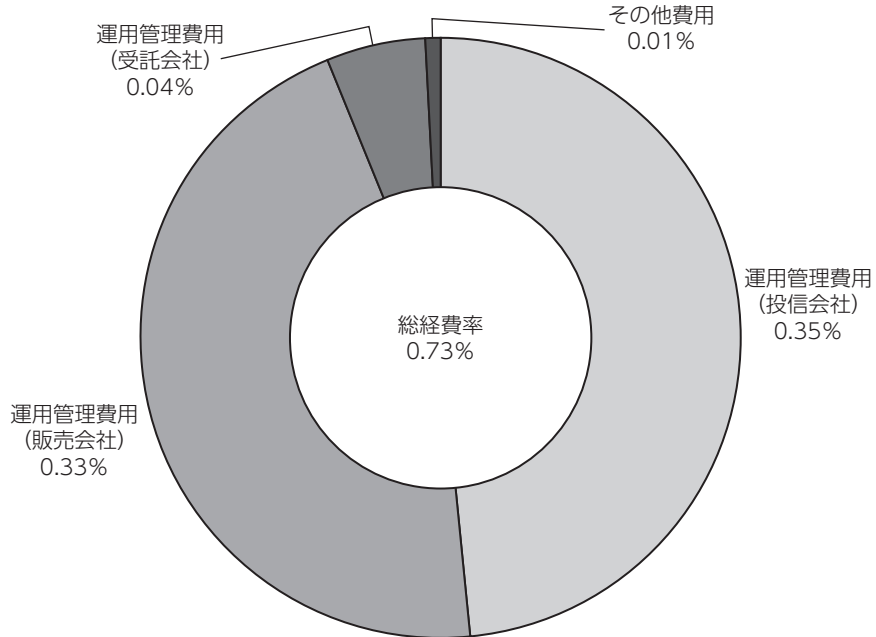
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2024年3月23日から2025年3月24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	1,095,704	2,902,200	1,056,817	2,892,800

(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

(2024年3月23日から2025年3月24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	13,958,677千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	26,494,519千円
(c) 売買高比率 (a)÷(b)	0.52

(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

(2024年3月23日から2025年3月24日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A	うち利害 関係人との 取引状況B	B/A	売付額等 C	うち利害 関係人との 取引状況D	D/C
株式	百万円 9,145	百万円 1,696	% 18.6	百万円 4,813	百万円 828	% 17.2
株式先物取引	4,829	211	4.4	5,044	162	3.2
コール・ローン	357,429	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合46.4%

*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) 利害関係人の発行する有価証券等

(2024年3月23日から2025年3月24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
株式	百万円 20	百万円 10	百万円 78

(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

(2024年3月23日から2025年3月24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 1

(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

(2024年3月23日から2025年3月24日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	598千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B)÷(A)	0.6%

(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、大和証券株式会社、株式会社大和証券グループ本社です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	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	4,420,138	4,459,025	12,388,956

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2025年3月24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	12,388,956	99.6
コール・ローン等、その他	54,646	0.4
投資信託財産総額	12,443,603	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

2025年3月24日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	12,443,603,419円
コール・ローン等	48,946,609
ダイワ J P X 日経400マザーファンド(評価額)	12,388,956,810
未収入金	5,700,000
(B) 負債	54,322,408
未払解約金	9,735,932
未払信託報酬	44,245,053
その他未払費用	341,423
(C) 純資産総額(A - B)	12,389,281,011
元本	5,392,832,881
次期繰越損益金	6,996,448,130
(D) 受益権総口数	5,392,832,881口
1万口当り基準価額(C / D)	22,974円

* 期首における元本額は5,204,285,135円、当作成期間中における追加設定元本額は1,850,931,433円、同解約元本額は1,662,383,687円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は22,974円です。

■損益の状況

当期 自2024年3月23日 至2025年3月24日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	76,876円
受取利息	76,876
(B) 有価証券売買損益	285,717,502
売買益	326,834,355
売買損	△ 41,116,853
(C) 信託報酬等	△ 90,220,405
(D) 当期損益金(A + B + C)	195,573,973
(E) 前期繰越損益金	2,917,043,819
(F) 追加信託差損益金	3,883,830,338
(配当等相当額)	(3,472,964,338)
(売買損益相当額)	(410,866,000)
(G) 合計(D + E + F)	6,996,448,130
次期繰越損益金(G)	6,996,448,130
追加信託差損益金	3,883,830,338
(配当等相当額)	(3,472,964,338)
(売買損益相当額)	(410,866,000)
分配準備積立金	3,112,617,792

(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	193,488,248円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	2,085,725
(c) 収益調整金	3,883,830,338
(d) 分配準備積立金	2,917,043,819
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,996,448,130
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,996,448,130
(h) 受益権総口数	5,392,832,881口

ダイワ J P X日経400マザーファンド

運用報告書 第12期 (決算日 2025年3月24日)

(作成対象期間 2024年3月23日～2025年3月24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。

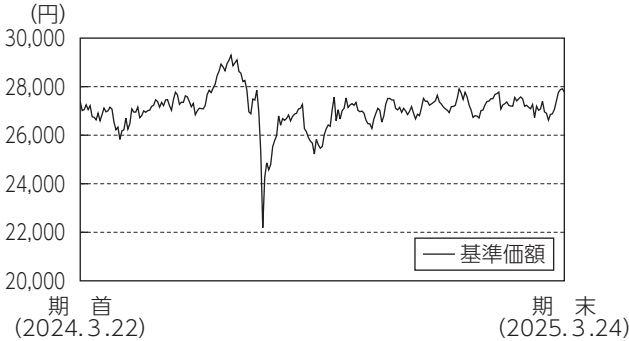
運用方針	投資成果を J P X日経インデックス400 (配当込み) の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式 (上場予定を含みます。)
株式組入制限	無制限

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 (配 当 込 み)		株 式 先 物 比	式 入 率	株 式 先 物 率
	円	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率			
(期首)2024年 3月22日	27,389	—	27,195	—	98.3	—	1.3
3月末	27,215	△0.6	27,026	△0.6	97.9	—	2.2
4月末	27,085	△1.1	26,903	△1.1	97.9	—	2.0
5月末	27,477	0.3	27,307	0.4	97.9	—	2.1
6月末	27,942	2.0	27,769	2.1	99.1	—	0.8
7月末	27,854	1.7	27,682	1.8	98.4	—	1.5
8月末	27,079	△1.1	26,895	△1.1	98.7	—	1.4
9月末	26,595	△2.9	26,422	△2.8	98.6	—	1.5
10月末	27,025	△1.3	26,853	△1.3	98.1	—	1.9
11月末	26,804	△2.1	26,632	△2.1	97.8	—	2.1
12月末	27,739	1.3	27,559	1.3	99.4	—	0.5
2025年 1月末	27,775	1.4	27,593	1.5	99.4	—	0.5
2月末	26,729	△2.4	26,558	△2.3	98.6	—	1.5
(期末)2025年 3月24日	27,784	1.4	27,607	1.5	99.5	—	0.4

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) J P X 日経インデックス400 (配当込み) 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：27,389円 期末：27,784円 騰落率：1.4%

【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、わが国の株式市場が上昇したことを受け、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、史上最高値更新後に歴史的な急落に見舞われましたが、その後は上昇トレンドに回帰しました。

国内株式市況は、当作成期首より、円安進行などが好感された一

方でインフレ再燃懸念による米国株の下落などが嫌気され、保ち合いとなりました。2024年6月下旬以降は、海外のAI（人工知能）関連企業の株価急騰や円安進行などが好感されて上昇し、史上最高値を更新しました。7月中旬に入ると、米国の対中輸出規制強化への懸念などから半導体関連株主導で下落に転じました。7月末には、日銀の利上げ決定と植田日銀総裁のタカ派発言で金融政策の不透明感がにわかにか強まったことに加え、8月初旬に発表された米国の雇用統計が市場予想よりも弱い内容であったことから急速に円高が進行し、株価は歴史的な急落に見舞われました。しかし、内田日銀副総裁のハト派発言や米国の経済指標の改善などを受けて株価は急反発し、9月初旬には急落直前の水準をほぼ回復しました。その後は、9月中旬にかけて円高が進行したことや10月下旬の衆議院議員選挙で与党が過半数割れとなったこと、11月初旬の米国大統領選挙でトランプ元大統領が勝利して関税引き上げを巡る政策の不透明感が強まったことなどから、一時的に下落する局面はありましたが、高水準の自社株買いなどが支えとなり、年末にかけて徐々に下値を切上げ緩やかに上昇しました。2025年1月以降は、日銀の利上げ観測の高まりによる円高進行やトランプ米国政権による関税引き上げなどが懸念された一方、良好な決算や株主還元拡充の発表などが好感されてレンジ内での推移となり、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

当作成期のベンチマークの騰落率は1.5%、当ファンドの基準価額の騰落率は1.4%となりました。

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

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■売買および取引の状況

(1) 株 式

(2024年3月23日から2025年3月24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	4,341.7 (2,869.2)	9,145,227 (-)	1,734.3	4,813,450

(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

(2024年3月23日から2025年3月24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	4,829	5,044	-	-

(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

(2024年3月23日から2025年3月24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
キャノン		54	271,828	5,033	ソフトバンクグループ		50	410,225	8,204
オリエンタルランド		64.7	253,985	3,925	日立		81.5	292,875	3,593
日本電信電話		1,338.2	210,626	157	リクルートホールディングス		28.8	250,508	8,698
リクルートホールディングス		17.5	142,013	8,115	三井住友フィナンシャルG		22	181,135	8,233
キーエンス		2.1	141,966	67,603	東京海上HD		31.4	172,603	5,496
ソニーグループ		15.5	141,370	9,120	東京エレクトロン		5.9	156,428	26,513
日立		28.6	140,556	4,914	三菱UFJフィナンシャルG		94.8	147,930	1,560
武田薬品		32.9	140,101	4,258	ニデック		22.4	132,567	5,918
東海旅客鉄道		41.6	138,668	3,333	伊藤忠		17.4	131,308	7,546
三菱UFJフィナンシャルG		80.3	128,100	1,595	三菱商事		40.1	118,485	2,954

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内株式

銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末			銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
		千株	千株			千円			千株	千株			千円			千株	千株			千円
水産・農林業 (0.0%)							日産化学	4	5.3	24,305				ゴム製品 (0.9%)						
ニッスイ	11.9	14.6	13,598				東ソー	11.3	13.9	30,204				横浜ゴム	4.3	5.3	19,196			
鉱業 (0.4%)							トクヤマ	2.7	-	-				TOYO TIRE	4.9	6	16,275			
INPEX	39.8	44	92,444				デンカ	3.1	-	-				ブリヂストン	24.8	30.5	186,934			
石油資源開発	-	8	9,904				信越化学	67.3	67.1	297,454				住友ゴム	8.3	10.2	19,915			
建設業 (2.2%)							エア・ウォーター	8	9.8	19,418				ガラス・土石製品 (0.6%)						
ウエストホールディングス	1	-	-				日本酸素HLDGS	8.2	10.1	48,025				AGC	7.6	10.1	46,682			
ショーボンHD	1.6	1.9	9,220				三菱瓦斯化学	6.2	8.4	20,743				東海カーボン	-	9.6	9,414			
ミライト・ワン	3.9	-	-				三井化学	7	9.4	33,755				TOTO	5.6	7.6	30,787			
タマホーム	0.7	0.9	3,204				東京応化工業	4	5	16,675				日本碍子	9.9	11.6	22,770			
安藤・間	6.9	8.4	11,659				三菱ケミカルグループ	6.2	7.6	59,903				日本特殊陶業	7.1	8.5	40,128			
コムシスホールディングス	3.8	5.2	16,988				KHネオケム	1.3	1.9	4,938				MARUWA	0.3	0.4	12,708			
大成建設	7.8	9.2	64,731				ダイセル	10.9	11.8	16,024				フジミコンポーレテッド	2.3	2.8	5,824			
大林組	29.7	33.6	69,518				住友ベークライト	1.2	3.3	11,685				ニチアス	2.1	2.6	11,936			
清水建設	23.5	-	-				積水化学	17	20.7	53,995				鉄鋼 (1.2%)						
長谷工コーポレーション	7.6	9.3	18,516				日本ゼオン	5.8	-	-				日本製鉄	39.1	54.2	185,526			
鹿島建設	18.4	22.6	71,416				アイカ工業	2.1	-	-				神戸製鋼所	-	21.5	40,054			
住友林業	7.2	8.8	40,779				扶桑化学工業	0.9	1	3,535				JFEホールディングス	24.3	32.3	63,308			
大和ハウス	22.9	30.7	155,311				ADEKA	3	3.6	10,116				東京製鐵	2.5	3	4,950			
積水ハウス	25.2	30.9	103,978				日油	2.6	12.2	25,949				大和工業	-	2	16,564			
関電工	5.2	5.6	15,313				花王	19.2	25.3	164,627				丸一鋼管	2.7	3.3	11,672			
エフシオグループ	4.1	10.5	18,333				日本ペイントHOLD	45	46	53,774				大同特殊鋼	-	6.7	8,589			
九電工	1.8	2.2	10,527				関西ペイント	8.3	8.7	19,418				日本冶金工	0.6	0.7	3,122			
高砂熱学	-	2.5	14,350				太陽ホールディングス	1.5	1.8	8,460				非鉄金属 (0.9%)						
インフロンニアHD	9.6	10.7	13,011				富士フイルムHLDGS	15.7	62.8	187,646				大紀アルミニウム	1.1	-	-			
食料品 (3.5%)							資生堂	17.7	21.7	61,356				三井金属	2.5	2.7	12,441			
森永製菓	3.6	4.3	11,025				ライオン	11.1	13.2	23,548				住友鉱山	10.1	13.5	46,588			
寿スピリッツ	-	6	15,180				コーセー	1.7	-	-				DOWAホールディングス	2.2	2.9	14,189			
カルビー	3.8	4.7	13,651				小林製菓	2.5	2.7	15,660				住友電工	32.7	37	103,285			
森永乳業	2.9	3.8	12,129				タカラバイオ	2.3	3.3	2,791				フジクラ	-	11.5	70,345			
ヤクルト	11.9	14.6	43,705				デクセラリアルズ	2.1	9	18,441				AREホールディングス	3.3	4.3	8,655			
明治ホールディングス	10.2	13.1	44,540				日東電工	5.5	32.9	95,689				金属製品 (0.4%)						
日本ハム	3.6	4.4	22,334				ニフコ	2.5	3.9	14,710				SUMCO	15.5	20.4	23,378			
アサヒグループホールディング	19.2	76.7	150,025				ユニ・チャーム	17.7	65.1	76,232				三和ホールディングス	8.8	10.6	51,696			
キリンHD	34.7	42.6	88,182				医薬品 (5.4%)							リンナイ	4.2	5.7	20,337			
宝ホールディングス	5.7	6.9	8,041				協和キリン	10.3	12.2	26,230				日本発条	-	9.5	16,297			
サントリー食品インター	5.9	7.2	35,373				武田薬品	65.7	92.6	420,404				機械 (6.6%)						
キッコーマン	5.5	33.9	50,426				アステラス製薬	74.4	91.3	137,132				三浦工業	3.6	4.9	14,842			
味の素	19.8	23.7	144,475				塩野義製薬	10.7	34.5	79,419				ツガミ	-	2.2	4,221			
ニチレイ	3.8	4	14,684				日本新薬	2.2	2.7	10,746				アマダ	13.6	14.6	22,192			
東洋水産	4.2	4.7	45,251				中外製薬	26.6	32.6	225,624				FUJI	4	-	-			
日清食品HD	8.8	12.9	40,854				エーザイ	10.3	13.6	58,616				DMG森精機	5.2	6.6	20,262			
日本たばこ産業	50.6	62.1	252,126				ロート製薬	8.2	11	24,095				ディスコ	4.1	5	165,300			
繊維製品 (0.3%)							小野薬品	18	21.3	35,581				野村マイクロ・サイエンス	-	1.7	4,506			
東レ	56.8	76	80,180				JCRファーマ	2.9	-	-				ナブテスコ	5.4	6.6	16,203			
ゴールドウイン	1.5	1.8	14,347				第一三共	65.4	81.1	301,529				SMC	2.6	3.1	171,120			
パルプ・紙 (0.1%)							大塚ホールディングス	17.6	25.7	208,375				小松製作所	40.1	51.7	236,630			
王子ホールディングス	35.3	39.4	25,539				ベプテドリーム	4.1	5	10,627				住友重機械	5.1	6.2	20,205			
レンゴー	7.7	-	-				石油・石炭製品 (0.8%)							日立建機	3.4	4.2	17,669			
化学 (5.1%)							出光興産	47.1	48.6	56,157				TOWA	-	3.2	5,350			
クラレ	12.4	13.9	26,486				ENEOSホールディングス	134.3	176.6	149,739				ローツェ	0.4	5.5	8,692			
旭化成	57.3	-	-				コスモエネルギーHLDGS	2.5	3.4	23,500				クボタ	44.7	53.6	103,072			
住友化学	62.9	-	-											荏原製作所	3.5	21.5	51,299			

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
ダイキン工業	10.2	13.7	231,598				キャノン	-	51.8	248,122				近鉄グループHLDGS	-	11.1	37,273			
オルガノ	1	1.6	11,152				東京エレクトロン	14.5	12.1	268,499				ヤマトホールディングス	10.8	12.6	25,785			
ダイフク	14.4	17.7	66,392				輸送用機器 (5.8%)							山九	2.1	2.5	15,722			
SANKYO	9.8	12.1	27,454				トヨタ紡織	3.6	4.4	9,222				センコーグループHLDGS	4.5	6.8	10,526			
竹内製作所	1.6	1.9	10,279				豊田自動織機	7.2	8.9	122,108				AZ-COM丸和ホールディ	2.2	3.2	4,006			
セガサミーホールディングス	7.6	9.4	28,063				デンソー	69.8	101.7	203,400				S Gホールディングス	14.2	17.4	27,718			
ホシザキ	5	6.7	42,015				三菱ロジスネクスト	-	1.7	3,617				NIPPON EXPRESS	2.9	11.1	30,963			
マキタ	9.7	13	68,276				いすゞ自動車	24.6	32.1	65,291				海運業 (1.0%)						
三菱重工業	14.9	183.3	515,347				トヨタ自動車	128.8	128.3	367,322				日本郵船	24.2	21.5	113,219			
IHI	6.4	-	-				三菱自動車工業	-	39.7	17,424				商船三井	18.3	19.7	108,113			
電気機器 (17.1%)							カヤバ	0.8	1.8	5,472				川崎汽船	6.8	23.6	51,341			
イビデン	4.5	6	25,932				アイシン	6.5	22	41,305				NSユナイテッド海運	0.5	0.7	2,873			
プラザー工業	11.4	14	39,508				マツダ	28	31.9	34,834				飯野海運	-	3.8	4,035			
ミネベアミツミ	14.9	18.2	41,086				本田技研	205.5	245.4	368,468				倉庫・運輸関連業 (0.0%)						
日立	33	124.1	464,382				スズキ	15.5	83.9	154,040				三井倉庫HOLD	0.8	1.1	8,932			
三菱電機	95.1	106.6	305,568				SUBARU	26.2	31.3	91,724				情報・通信業 (7.8%)						
富士電機	5.2	6.4	42,284				ヤマハ発動機	36.6	43.8	53,260				NECネットエスアイ	3.3	-	-			
安川電機	9.3	11.4	46,044				豊田合成	2.4	3	8,398				システナ	12.8	14.9	5,423			
ニデック	18.9	-	-				シマノ	3.4	4.5	101,880				日鉄ソリューションズ	1.4	3.6	14,598			
JVCケンウッド	-	8.3	10,897				精密機器 (2.8%)						TIS	9.3	11	46,310				
オムロン	6.5	9.6	41,980				テルモ	23.7	69	189,267				コーエーテクモHD	5.3	7.8	15,997			
MCJ	3.5	4.3	5,916				島津製作所	11.2	14.9	57,871				ネクソン	19	22.9	46,967			
日本電気	11.2	14.8	233,026				ナカニシ	3.6	4.4	9,728				SHOFT	0.6	10.4	12,916			
富士通	7.9	96.5	295,193				東京精密	1.7	2.1	17,852				ティーガイア	0.9	-	-			
ルネサスエレクトロニクス	55.8	79.9	184,249				オリンパス	52.1	58.6	115,354				ガホー・オンライン・エンター	2.2	2.6	7,659			
セイコーエプソン	11	13.4	33,406				HOYA	16.2	20.3	355,047				GMOペイメントゲートウェイ	1.7	2.4	18,468			
ワコム	6.5	-	-				ノーリツ鋼機	-	1	4,900				インターネットインシアティブ	4.1	5.7	14,438			
アルパック	1.9	2.3	12,647				朝日インテック	10.3	12.7	30,048				ラクス	4	4.9	9,998			
エレコム	2	-	-				シチズン時計	-	9.5	8,949				チェンジホールディングス	1.8	-	-			
パナソニックホールディング	100.9	123.8	229,896				その他製品 (3.1%)						ビジョナル	-	1.2	9,339				
アンリツ	6	-	-				三井島島HLDGS	0.7	0.7	2,964				野村総合研究所	18.8	22.6	110,446			
ソニーグループ	22.9	152.4	573,633				フルヤ金属	-	0.9	2,522				オービック	2.8	19.3	83,742			
TDK	13.5	90.5	144,845				パナダイナムコHLDGS	23.2	28.2	146,329				ジャストシステム	1.2	1.5	5,265			
メイコー	-	1	7,440				パイロットコーポレーション	1.2	1.6	6,830				L INEヤフー	120.8	166.6	87,148			
ヒロセ電機	1.3	1.5	26,797				大日本印刷	-	21.5	46,622				トレンドマイクロ	4	5.5	56,622			
横河電機	9.3	11.5	34,684				アシックス	-	38.3	128,534				日本オラクル	1.6	2	31,420			
アズビル	5.8	28.3	33,563				ローランド	-	0.8	3,080				フューチャー	-	2.6	4,698			
日本光電工業	3.6	9.3	19,037				ヤマハ	5.3	18.5	22,570				大塚商会	4.2	11.8	38,715			
堀場製作所	1.6	2	20,460				ビジョン	5.4	-	-				電通総研	1	1	6,350			
アドバンテスト	24.2	32.7	261,763				任天堂	45.5	49.3	527,017				東映アニメーション	0.4	4.1	13,243			
キーエンス	4.4	6	366,840				電気・ガス業 (1.4%)						デジナルガレージ	1.4	-	-				
シスメックス	7.3	26.9	75,158				中部電力	31.2	38.2	65,398				ネットワンシステムズ	3.4	-	-			
フェローテックHLDGS	2.7	3.3	9,533				関西電力	32.7	50.6	95,330				B I P R O G Y	2.8	3.5	15,841			
レーザータック	3.9	4	56,160				九州電力	-	23.9	33,388				U-NEXT HOLDINGS	1	3.5	6,058			
日本電子	2.1	2.4	11,556				電源開発	6.9	7.8	20,962				日本電信電話	1,619.8	2,780.2	410,357			
ファナック	41.3	50.2	216,914				イーレックス	1.5	-	-				KDDI	65.6	76.6	367,450			
ローム	15.6	18.8	29,393				レノバ	2.3	-	-				ソフトバンク	136.6	1,666.6	359,152			
浜松ホトニクス	6.8	16.7	25,551				東京瓦斯	17.9	19.6	97,647				光通信	0.9	1.2	47,400			
三井ハイテック	0.7	4.6	3,394				大阪瓦斯	17.1	20.4	71,053				GMOインターネットグループ	3.1	3.4	10,992			
新光電気工業	3	-	-				陸運業 (1.3%)						KADOKAWA	4.5	-	-				
京セラ	52.6	64.5	112,133				SBSホールディングス	0.8	0.9	2,620				東宝	4.7	6.5	47,307			
太陽誘電	4.1	4.5	11,823				京浜急行	-	12.8	19,942				NTTデータグループ	22.2	27.2	75,466			
村田製作所	77	91.4	225,803				小田急電鉄	-	17.2	26,247				DT S	1.8	-	-			
小糸製作所	8.8	10.8	21,875				東海旅客鉄道	-	40	118,100				スクウェア・エニックス・HD	3.9	5.2	35,744			
SCREENホールディングス	2.9	4.3	45,064				西武ホールディングス	-	11.3	41,267				カブコン	7.6	20.7	76,693			

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		
SCSK	5.9	8.5	32,393				スギホールディングス	5.4	5.9	16,599			ケイアイスター不動産	0.4	0.6	2,766				
NSD	3	4	13,652				日本瓦斯	4.7	5.3	12,097			三井不動産	38.5	140.4	195,577				
コナミグループ	3.2	3.9	69,322				ライフコーポレーション	0.9	2.3	4,397			三菱地所	54.5	58.3	144,234				
ソフトバンクグループ	41.9	-	-				コメリ	1.4	-	-			東京建物	7.3	8.9	23,344				
卸売業 (6.9%)							しまむら	2.1	2.6	21,801			住友不動産	12.1	16.6	100,297				
東京エレクトロンデバイス	-	1.1	3,415				丸井グループ	-	7.3	19,929			スターツコーポレーション	1.2	1.7	6,970				
双日	10	12.2	42,370				イズミ	1.6	-	-			カチタス	2.2	2.7	5,405				
アルフレッサホールディングス	9	-	-				ヤオコー	1.1	1.3	12,044			サービス業 (3.8%)							
神戸物産	6.9	8.5	29,180				ケースホールディングス	6	-	-			ジェイエイシークルトメント	-	3.9	3,073				
ダイワボウHD	4	4.9	12,446				ニトリホールディングス	3.3	4	57,280			日本M&Aセンターホールディングス	13.9	15.7	10,037				
マクニカホールディングス	2.1	8.4	16,275				ファーストリテイリング	4	6.2	280,736			UTグループ	1.1	1.4	3,115				
シップヘルスケアHD	3.2	4.3	8,718				サンドラッグ	3	3.7	15,625			パソナグループ	1.1	1.3	2,847				
メディアパルHD	9.1	11.9	28,036				銀行業 (7.4%)						エス・エム・エス	3	4.1	4,942				
IDOM	2.4	3.7	4,491				めびきフィナンシャルG	41.3	51.3	38,290			パルセルホールディングス	88.5	97.3	24,879				
伊藤忠	57.1	53.7	384,223				コンコルディア・フィナンシャル	44.7	54.4	55,651			総合警備保障	14.5	17.8	20,585				
丸紅	74.6	90.2	228,206				三菱UFJフィナンシャルG	271.6	257.1	560,863			カカコム	5.7	7.7	16,647				
豊田通商	7.8	33	87,582				りそなホールディングス	96.4	125.4	178,068			ディップ	1.3	1.9	4,303				
兼松	3.7	4.6	11,937				三井住友トラストグループ	29.9	36.4	145,381			ベネフィット・ワン	3	-	-				
三井物産	58.4	113.4	333,282				三井住友フィナンシャルG	47	116.8	471,521			エムスリー	17.2	21.1	36,439				
住友商事	54.2	65.8	236,551				千葉銀行	23.2	31.7	47,058			博報堂DYHLDGS	11.1	12.1	13,588				
三菱商事	135.2	129	356,040				ふくおかフィナンシャルG	7.3	8.9	36,952			HUグループHD	2.5	-	-				
キャノンマーケティングJPN	2.1	2.2	11,206				セブン銀行	26.1	36.6	10,775			オリエンタルランド	-	62.9	195,178				
阪和興業	1.6	1.8	9,378				みずほフィナンシャルG	112.5	125.7	550,817			ラウンドワン	-	10.1	10,847				
岩谷産業	2	10.9	17,025				証券・商品先物取引業 (1.2%)						ピー・エム・エル	1.1	1.3	3,932				
稲畑産業	1.8	3	9,750				F P G	-	3.6	8,841			ユー・エス・エス	9.8	21.9	31,360				
伊藤忠エネクス	2.2	2.7	4,465				SBIホールディングス	12.2	16.5	70,735			サイバーエージェント	19.2	23.6	30,066				
サンリオ	-	8.9	62,389				ジャフコグループ	2.5	-	-			フルキャストホールディングス	0.8	-	-				
加賀電子	0.8	2.2	6,109				大和証券G本社	64.4	73.1	78,619			テクノプロ・ホールディング	5.1	6.5	21,099				
PAL TAC	1.2	-	-				野村ホールディングス	140.1	171.9	169,974			ジャパンマテリアル	2.7	3.3	4,488				
ミスミグループ本社	13.5	16.6	42,595				マネックスG	8.2	10	7,430			リクルートホールディングス	64.4	53.1	438,075				
小売業 (4.3%)							保険業 (4.0%)						ベルジステム24HLDGS	0.9	1.1	1,438				
ローソン	1.9	-	-				SOMPONホールディングス	12.5	50	230,450			ペイカレント	6.4	7.8	51,331				
エービーシー・マート	3.9	4.8	13,608				MS & AD	18.7	74.9	256,307			ジャパンエレベーターSHD	2.8	4.1	11,070				
アスクル	2.2	2.6	4,212				第一生命HLDGS	40.7	48.1	221,308			アンビスホールディングス	-	2.3	1,182				
アグストリア	-	1.5	4,408				東京海上HD	82.4	70.3	418,214			リログループ	4.4	-	-				
日本マクドナルドHLDG	5.5	6.7	38,458				その他金融業 (1.5%)						トランス・コスモス	1.1	1.4	4,557				
パルグループHLDGS	-	2.5	7,850				全国保証	2.2	2.7	16,254			セコム	8.9	21.7	111,993				
セリア	2.6	3.2	8,188				クレディセゾン	-	6.5	24,583			メイテックグループホールディングス	3.1	3.9	11,766				
MonotaRO	12.7	15.6	42,120				芙蓉総合リース	0.8	0.9	10,701			イオンディライト	0.9	1.1	5,929				
マツコヨコカラ&カンパニー	16.3	19.4	45,900				みずほリース	1.4	7.7	8,231					千株	千株	千円			
ZOZO	5.7	8.2	36,096				東京センチュリー	6.2	7.6	11,555			合計	株数、金額	8,230.3	13,706.9	28,395,492			
ウエルシアHD	4.6	5.7	12,280				イオンフィナンシャルサービス	4.8	5.9	8,085			銘柄数<比率>	399銘柄	396銘柄	<99.5%>				
クリエイトSDH	1.3	1.6	4,569				アコム	14.9	24.3	9,654			(注1)							
ネクステージ	2	2.5	4,017				ジャックス	0.9	1.2	4,860			(注2)							
コスモス薬品	0.8	2.2	16,412				オリコ	2.7	-	-			(注3)							
ゼン&アイ・HLDGS	92.6	121.3	272,561				オリックス	50	58.7	189,542										
ツルハホールディングス	1.9	1.9	17,850				三菱HCキャピタル	37.1	51.2	53,555										
ツクリのアオキHLDGS	2.7	2.9	9,662				日本取引所グループ	21.7	60.8	100,046										
FOOD&LIFE COMPAN	4.8	5.9	26,508				不動産業 (2.4%)													
ノジマ	2.6	3.6	8,974				大東建託	3.1	3.5	55,037										
良品計画	9.8	13.1	53,985				ヒューリック	19.4	23.8	34,974										
コーナン商事	1.1	-	-				野村不動産HLDGS	4.6	6.4	28,544										
パンパシフィックHD	18.1	22.2	93,262				プラスワンコーポレーション	1.3	-	-										
ゼンショーホールディングス	4.6	6.2	50,145				オープンハウスグループ	3.1	3.7	21,193										
ワークマン	1	1.6	6,592				東急不動産HD	25.1	30.7	32,004										
V Tホールディングス	3.4	-	-				飯田GHHD	8	9.8	22,829										

(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	110	-

(注) 単位未満は切捨て。

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 161,600 (33,200)	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、大和証券株式会社へ33,200株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2025年3月24日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 28,395,492	% 97.6
コール・ローン等、その他	690,509	2.4
投資信託財産総額	29,086,001	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

2025年3月24日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	29,355,251,956円
コール・ローン等	613,412,179
株式(評価額)	28,395,492,680
未収入金	26,529,800
未収配当金	46,201,475
その他未収収益	1,359,655
差入委託証拠金	272,256,167
(B) 負債	822,487,055
未払解約金	76,008,000
未払利息	260,307
差入委託証拠金代用有価証券	275,110,000
受入担保金	471,108,748
(C) 純資産総額(A - B)	28,532,764,901
元本	10,269,486,630
次期繰越損益金	18,263,278,271
(D) 受益権総口数	10,269,486,630口
1万口当り基準価額(C/D)	27,784円

* 期首における元本額は8,927,225,570円、当作成期間中における追加設定元本額は3,874,344,841円、同解約元本額は2,532,083,781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：
 i Free J P X 日経400インデックス 4,000,296,008円
 ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド 130,277,773円
 ダイワ J P X 日経400ファンド 4,459,025,630円
 ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 1,679,887,219円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,784円です。

■損益の状況

当期 自2024年3月23日 至2025年3月24日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	610,716,532円
受取配当金	598,668,380
受取利息	3,684,072
その他収益金	11,107,875
支払利息	△ 2,743,795
(B) 有価証券売買損益	35,225,469
売買益	2,965,373,076
売買損	△ 2,930,147,607
(C) 先物取引等損益	18,190,350
取引益	77,216,600
取引損	△ 59,026,250
(D) 当期損益金(A + B + C)	664,132,351
(E) 前期繰越損益金	15,523,812,980
(F) 解約差損益金	△ 4,409,689,219
(G) 追加信託差損益金	6,485,022,159
(H) 合計(D + E + F + G)	18,263,278,271
次期繰越損益金(H)	18,263,278,271

(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」及び同指数に配当収益を加味した「配当込 J P X 日経インデックス400（本書類における「J P X 日経インデックス400（配当込み）」をいう。）」（以下、総称して「J P X 日経400等」という。）は、株式会社 J P X 総研（以下「J P X 総研」という。）及び株式会社日本経済新聞社（以下「日経」という。）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 総研及び日経は、「J P X 日経400等」自体及び「J P X 日経400等」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る。J P X 総研及び日経は、「J P X 日経400等」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、遅延又は中断に関して、責任を負わない。当ファンドは、大和アセットマネジメントの責任のもとで運用されるものであり、J P X 総研及び日経は、その運用及び当ファンドの取引に関して、一切の責任を負わない。