

# iFree J P X日経400 インデックス

## 運用報告書（全体版） 第8期

（決算日 2024年3月22日）

（作成対象期間 2023年3月23日～2024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（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：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（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
	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 (配当込み)		株式組入率 比	株式先物率 比	純資産額 総
	(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			
4期末(2020年3月23日)	円 10,254	円 0	% △17.8	10,318	% △17.7	% 97.6	% 2.4	百万円 762
5期末(2021年3月22日)	16,249	0	58.5	16,391	58.9	95.9	0.1	1,530
6期末(2022年3月22日)	16,161	0	△ 0.5	16,328	△ 0.4	99.0	1.1	2,321
7期末(2023年3月22日)	16,806	0	4.0	17,015	4.2	97.0	2.3	3,451
8期末(2024年3月22日)	24,720	0	47.1	25,083	47.4	98.3	1.3	6,697

(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。

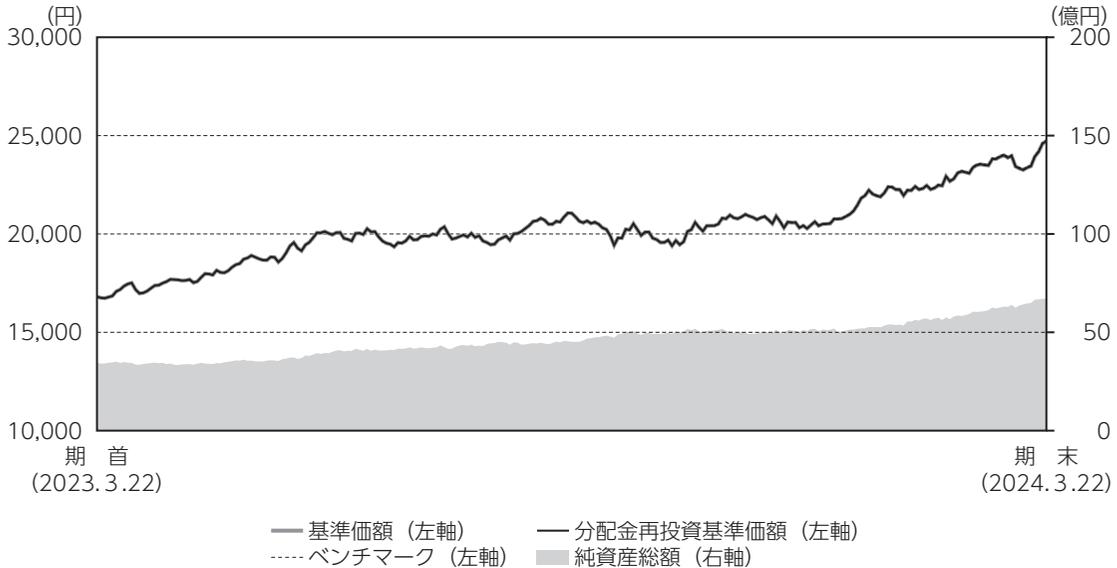
※ベンチマークを「J P X日経インデックス400」から「J P X日経インデックス400 (配当込み)」に変更しました。

「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。  
※ベンチマークを「J P X日経インデックス400」から「J P X日経インデックス400（配当込み）」に変更しました。

#### ■基準価額・騰落率

期首：16,806円

期末：24,720円（分配金0円）

騰落率：47.1%（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。

## 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 (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) 2023年 3月22日	円 16,806	% -	17,015	% -	% 97.0	% 2.3
3月末	17,348	3.2	17,563	3.2	96.8	3.2
4月末	17,791	5.9	18,013	5.9	98.0	2.0
5月末	18,572	10.5	18,810	10.6	98.5	1.4
6月末	19,973	18.8	20,233	18.9	98.6	1.4
7月末	20,237	20.4	20,505	20.5	98.4	1.6
8月末	20,278	20.7	20,546	20.8	99.1	0.8
9月末	20,309	20.8	20,575	20.9	97.3	2.7
10月末	19,601	16.6	19,860	16.7	97.2	2.8
11月末	20,824	23.9	21,107	24.1	98.3	1.6
12月末	20,780	23.6	21,071	23.8	99.5	0.4
2024年 1月末	22,412	33.4	22,727	33.6	99.1	0.8
2月末	23,484	39.7	23,828	40.0	98.9	1.2
(期末) 2024年 3月22日	24,720	47.1	25,083	47.4	98.3	1.3

(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

(2023.3.23~2024.3.22)

### ■国内株式市況

国内株式市況は、大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇しました。2023年4月以降も、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調し円安が進行したこと、米国著名投資家の強気見通しにより海外投資家の資金が大量に流入したことなどから、大幅に上昇しました。7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4-6月期GDP（国内総生産）成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、再び上昇しました。9月下旬以降は、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念されて、反落しました。11月には、欧米におけるインフレ率の鈍化や金利の低下、良好な企業決算や株主還元拡充の発表などが好感されて上昇しましたが、12月に入ると、日米金利差縮小による為替の円高進行などから上昇は一服しました。2024年1月以降は、企業業績面での評価に加え、新NISA（少額投資非課税制度）を通じた資金流入や為替の円安進行、中国市場からの資金シフト観測なども含め海外投資家が日本株投資を積極化したことなどが好感されて急上昇しました。3月には、日銀がマイナス金利解除などを決定するとの見方が広まり中旬にかけて下落しましたが、日銀金融政策決定会合での金融政策の枠組みの見直しが想定内であったことを受けて当面は緩和的な金融環境が継続するとの見方が広がったことから、当作成期末にかけて株価は反発しました。

## 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

(2023.3.23~2024.3.22)

### ■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。

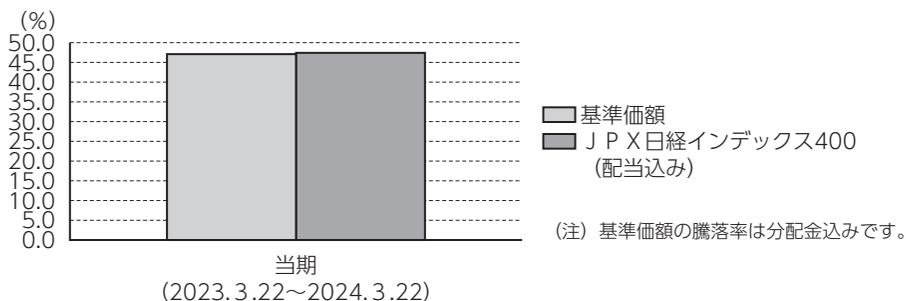
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワJ P X日経400マザーファンド	J P X日経インデックス400 (配当込み)

## 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47.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は47.1%となりました。

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 (配当込み) 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	
	2023年3月23日 ～2024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）	14,719

(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 (2023.3.23~2024.3.22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	43円	0.214%	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20,273円です。
(投 信 会 社)	(20)	(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)	(18)	(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)	(6)	(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	0.002	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.001)	
(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	45	0.222	

(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。

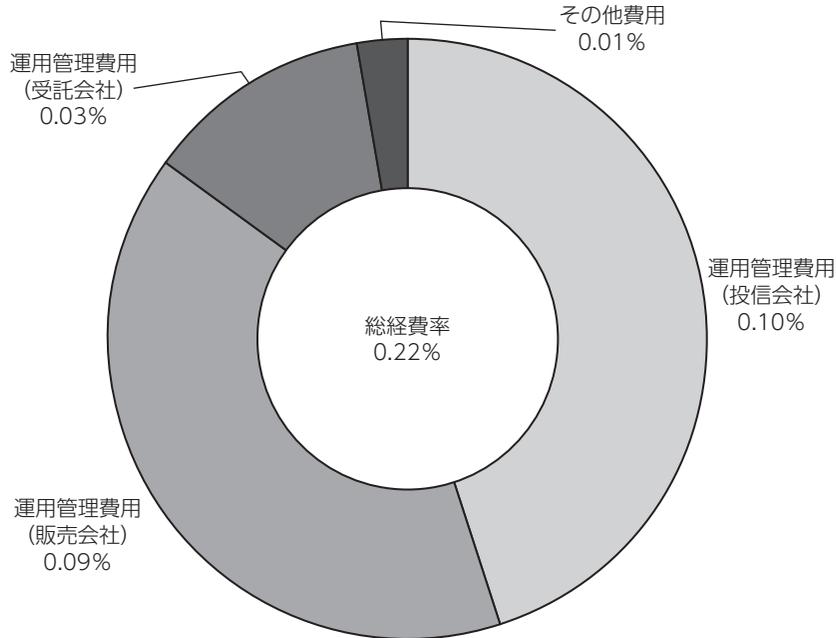
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(2023年3月23日から2024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	2,178,554	4,947,240	1,590,822	3,559,770

(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

(2023年3月23日から2024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	9,746,299千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	20,005,537千円
(c) 売買高比率(a)/(b)	0.48

(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

(2023年3月23日から2024年3月22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
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	4,673	1,815	38.9	5,073	2,563	50.5
株式先物取引	3,654	—	—	3,871	—	—
コール・ローン	161,226	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合22.3%

※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

(2023年3月23日から2024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	12	8	76

(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

(2023年3月23日から2024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	
	百万円	
株式	4	

(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、当作成期中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	1,857,672	2,445,404	6,697,719

(注) 単位未満は切捨て。

## ■投資信託財産の構成

2024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	6,697,719	97.1
コール・ローン等、その他	200,393	2.9
投資信託財産総額	6,898,112	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

2024年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	6,898,112,623円
コール・ローン等	74,343,348
ダイワJPX日経400マザーファンド(評価額)	6,697,719,275
未収入金	126,050,000
(B) 負債	200,231,003
未払解約金	194,396,673
未払信託報酬	5,688,565
その他未払費用	145,765
(C) 純資産総額(A - B)	6,697,881,620
元本	2,709,543,290
次期繰越損益金	3,988,338,330
(D) 受益権総口数	2,709,543,290口
1万口当り基準価額(C / D)	24,720円

\* 期首における元本額は2,053,787,213円、当作成期間中における追加設定元本額は4,045,055,070円、同解約元本額は3,389,298,993円です。

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,720円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年3月23日 至2024年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,591円
受取利息	4,819
支払利息	△ 8,410
(B) 有価証券売買損益	1,163,913,536
売買益	1,694,990,942
売買損	△ 531,077,406
(C) 信託報酬等	△ 10,163,313
(D) 当期損益金(A + B + C)	1,153,746,632
(E) 前期繰越損益金	31,631,099
(F) 追加信託差損益金	2,802,960,599
(配当等相当額)	( 972,011,540)
(売買損益相当額)	( 1,830,949,059)
(G) 合計(D + E + F)	3,988,338,330
次期繰越損益金(G)	3,988,338,330
追加信託差損益金	2,802,960,599
(配当等相当額)	( 972,011,540)
(売買損益相当額)	( 1,830,949,059)
分配準備積立金	1,185,381,322
繰越損益金	△ 3,591

(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	1,153,749,807
(c) 収益調整金	2,802,960,599
(d) 分配準備積立金	31,631,515
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	3,988,341,921
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	3,988,341,921
(h) 受益権総口数	2,709,543,290口

## 《お知らせ》

## ■ベンチマークの変更について

当ファンドおよび当ファンドの主要投資対象である「ダイワJPX日経400マザーファンド」のベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前：JPX日経インデックス400

変更後：JPX日経インデックス400(配当込み)

# ダイワ J P X日経400マザーファンド

## 運用報告書 第11期 (決算日 2024年3月22日)

(作成対象期間 2023年3月23日～2024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。

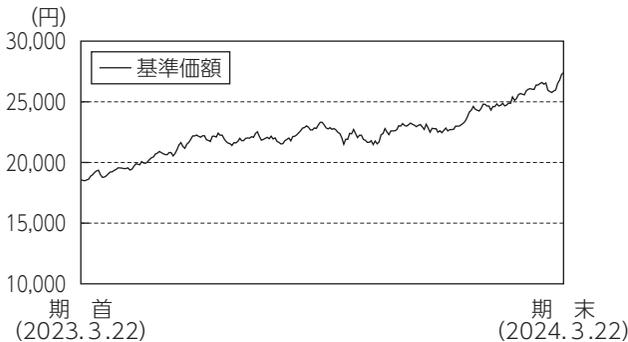
運用方針	投資成果を J P X日経インデックス400 (配当込み) の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式 (上場予定を含みます。)
株式組入制限	無制限

## 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) (ベンチマーク)		株 式 先 物 比	株 式 先 物 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期首)2023年 3月22日	円 18,580	% -	円 18,447	% -	% 97.0	% 2.3
3月末	19,180	3.2	19,042	3.2	96.8	3.2
4月末	19,673	5.9	19,530	5.9	98.0	2.0
5月末	20,541	10.6	20,394	10.6	98.5	1.4
6月末	22,094	18.9	21,937	18.9	98.6	1.4
7月末	22,391	20.5	22,231	20.5	98.4	1.6
8月末	22,440	20.8	22,276	20.8	99.1	0.8
9月末	22,478	21.0	22,307	20.9	97.3	2.7
10月末	21,699	16.8	21,532	16.7	97.2	2.8
11月末	23,057	24.1	22,884	24.1	98.3	1.6
12月末	23,012	23.9	22,845	23.8	99.5	0.4
2024年 1月末	24,825	33.6	24,640	33.6	99.1	0.8
2月末	26,017	40.0	25,835	40.0	98.9	1.2
(期末)2024年 3月22日	27,389	47.4	27,195	47.4	98.3	1.3

(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。  
 ※ベンチマークを「J P X 日経インデックス400 (配当込み)」に変更しました。

《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：18,580円 期末：27,389円 騰落率：47.4%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの運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、大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、欧州金融機関の破綻回避など

を受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇しました。2023年4月以降も、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調し円安が進行したこと、米国著名投資家の強気見通しにより海外投資家の資金が大量に流入したことなどから、大幅に上昇しました。7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などから下落する場面もありましたが、8月半ばに発表された2023年4－6月期GDP (国内総生産) 成長率が予想を上回る高い伸びとなったことなどが好感され、再び上昇しました。9月下旬以降は、米国における長期金利の上昇や景気の先行き不透明感、パレスチナ情勢の悪化などが懸念されて、反落しました。11月には、欧米におけるインフレ率の鈍化や金利の低下、良好な企業決算や株主還元拡充の発表などが好感されて上昇しましたが、12月に入ると、日米金利差縮小による為替の円高進行などから上昇は一服しました。2024年1月以降は、企業業績面での評価に加え、新NISA (少額投資非課税制度) を通じた資金流入や為替の円安進行、中国市場からの資金シフト観測なども含め海外投資家が日本株投資を積極化したことなどが好感されて急上昇しました。3月には、日銀がマイナス金利解除などを決定するとの見方が広まり中旬にかけて下落しましたが、日銀金融政策決定会合での金融政策の枠組みの見直しが想定内であったことを受けて当面は緩和的な金融環境が継続するとの見方が広がったことから、当作成期末にかけて株価は反発しました。

◆ 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、当ファンドの基準価額の騰落率ともに47.4%となり、当作成期においてベンチマークとのかい離は生じませんでした。

\* 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)	0円 (0)
(先物・オプション)	(0)
有価証券取引税	-
その他費用	-
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

(2023年3月23日から2024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	1,825.3 (2,359.2)	4,673,100 (-)	1,965.8	5,073,198

(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

(2023年3月23日から2024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	3,654	3,871	-	-

(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

(2023年3月23日から2024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
KDD I		22.1	96,838	4,381	三菱商事		31.3	153,594	4,907
ソフトバンクグループ		14.1	93,666	6,643	三井住友フィナンシャルG		21.8	147,853	6,782
三菱商事		14.5	82,336	5,678	東海旅客鉄道		6.8	124,352	18,287
伊藤忠		14.7	82,080	5,583	三菱UFJフィナンシャルG		101.9	119,833	1,175
信越化学		16.9	79,034	4,676	三井物産		20	106,323	5,316
任天堂		12	78,251	6,520	東京エレクトロン		4.5	104,303	23,178
三井物産		14	76,841	5,488	信越化学		19.1	96,103	5,031
リクルートホールディングス		15.2	76,258	5,017	キーエンス		1.5	95,024	63,349
トヨタ自動車		27.2	71,908	2,643	第一三共		19.4	85,359	4,399
日本電信電話		388.2	70,671	182	ソフトバンクグループ		13	76,084	5,852

(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>パルプ・紙 (0.1%)</b>				中外製薬	26.1	26.6	156,434
ニッスイ	11.7	11.9	11,711	王子ホールディングス	34.7	35.3	22,376	科研製薬	1.4	-	-
<b>鉱業 (0.4%)</b>				大王製紙	3.7	-	-	エーザイ	10.1	10.3	65,672
三井松島HLDGS	-	0.7	2,080	レンゴー	7.6	7.7	9,220	ロート製薬	8.1	8.2	25,830
I N P E X	43.1	39.8	90,903	<b>化学 (6.6%)</b>				小野薬品	16.1	18	45,423
<b>建設業 (2.2%)</b>				クラレ	13.2	12.4	20,007	参天製薬	15.7	-	-
ウエストホールディングス	1.1	1	2,846	旭化成	52	57.3	65,493	J C R ファーマ	2.8	2.9	2,598
ショーボンドHD	1.6	1.6	10,393	住友化学	61.8	62.9	21,423	東和薬品	1.3	-	-
ミライト・ワン	4	3.9	7,569	日産化学	4	4	24,268	第一三共	72.7	65.4	321,310
タマホーム	-	0.7	2,992	東ソー	11.1	11.3	24,018	大塚ホールディングス	19.1	17.6	113,836
安藤・間	6.8	6.9	8,673	トクヤマ	2.7	2.7	7,344	ペプチドリーム	4	4.1	5,830
コムシスホールディングス	3.9	3.8	13,908	デンカ	3	3.1	7,664	<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>			
大成建設	8.1	7.8	45,879	信越化学	13.9	67.3	462,620	出光興産	9.3	47.1	49,266
大林組	29.2	29.7	56,667	エア・ウォーター	7.9	8	19,036	ENEOSホールディングス	150.7	134.3	98,603
清水建設	24.5	23.5	24,169	日本酸素HLDGS	8.1	8.2	40,400	コスモエネルギーHLDGS	3.3	2.5	18,982
長谷工コーポレーション	8.4	7.6	14,664	三菱瓦斯化学	6.2	6.2	16,554	<b>ゴム製品 (0.9%)</b>			
鹿島建設	18.1	18.4	58,199	三井化学	6.9	7	31,780	横浜ゴム	4.7	4.3	17,961
西松建設	1.4	-	-	東京応化工業	-	4	18,400	TOYO TIRE	4.8	4.9	14,001
戸田建設	10	-	-	三菱ケミカルグループ	56.2	62	59,086	ブリヂストン	26.6	24.8	168,292
熊谷組	1.4	-	-	KHネオケム	1.4	1.3	2,957	住友ゴム	8.2	8.3	15,334
五洋建設	11.6	-	-	ダイセル	12.3	10.9	16,535	<b>ガラス・土石製品 (0.6%)</b>			
住友林業	6.3	7.2	32,997	住友ベークライト	-	1.2	11,074	AGC	8.5	7.6	42,362
大和ハウス	22.8	22.9	105,591	積水化学	17	17	38,241	太平洋セメント	5.3	-	-
積水ハウス	25.6	25.2	87,267	日本ゼオン	5	5.8	7,963	東海カーボン	7	-	-
関電工	4.5	5.2	9,100	アイカ工業	2.1	2.1	8,001	TOTO	5.5	5.6	23,419
エクシオグループ	3.8	4.1	13,771	UBE	4.3	-	-	日本碍子	9.9	9.9	20,062
九電工	2	1.8	11,388	扶桑化学工業	-	0.9	4,459	日本特殊陶業	6.4	7.1	36,224
インフロニアHD	8.5	9.6	14,352	ADEKA	-	3	9,954	MARUWA	0.3	0.3	9,585
<b>食料品 (3.3%)</b>				日油	2.6	2.6	17,266	フジミンコーポレートッド	-	2.3	8,395
森永製菓	1.5	3.6	9,603	花王	20.3	19.2	109,094	ニチアス	2.1	2.1	8,568
カルビー	3.7	3.8	13,205	日本ペイントHOLD	36.9	45	49,072	<b>鉄鋼 (1.0%)</b>			
森永乳業	1.5	2.9	9,207	関西ペイント	7.6	8.3	18,417	日本製鉄	38.4	39.1	147,250
ヤフルト	5.9	11.9	37,901	太陽ホールディングス	-	1.5	5,062	JFEホールディングス	22.9	24.3	63,823
明治ホールディングス	5.1	10.2	35,302	富士フイルムHLDGS	16	15.7	162,652	東京製鐵	2.4	2.5	4,290
プリマハム	1.1	-	-	資生堂	17.4	17.7	74,623	丸一鋼管	-	2.7	11,134
日本ハム	3.2	3.6	18,932	ライオン	10	11.1	14,929	日本冶金工	-	0.6	2,988
アサヒグループホールディ	18.9	19.2	104,832	ファンケル	3.6	-	-	<b>非鉄金属 (0.6%)</b>			
キリンHD	37	34.7	73,581	コーセー	1.7	1.7	13,414	大紀アルミニウム	-	1.1	1,384
宝ホールディングス	5.6	5.7	6,398	小林製薬	2.4	2.5	15,140	三井金属	2.5	2.5	11,765
サントリー食品インター	5.8	5.9	30,721	タカラバイオ	2.2	2.3	2,323	住友鉱山	10	10.1	46,571
キッコーマン	5.4	5.5	54,879	デクセラリアルズ	2.4	2.1	13,345	DOWAホールディングス	1.9	2.2	12,005
味の素	20	19.8	108,583	日東電工	6.1	5.5	79,090	住友電工	29.6	32.7	77,760
キューピー	4.4	-	-	エフピコ	1.6	-	-	AREホールディングス	3.5	3.3	6,583
カゴメ	3.8	-	-	ニフコ	3	2.5	9,927	<b>金属製品 (0.3%)</b>			
ニチレイ	3.8	3.8	15,618	ユニ・チャーム	17.4	17.7	87,013	SUMCO	16.3	15.5	38,750
東洋水産	4.1	4.2	40,979	<b>医薬品 (5.3%)</b>				三和ホールディングス	7.9	8.8	23,500
日清食品HD	2.9	8.8	38,051	協和キリン	10.1	10.3	28,793	リンナイ	1.6	4.2	14,868
日本たばこ産業	53.9	50.6	201,286	武田薬品	64.2	65.7	289,539	<b>機械 (6.3%)</b>			
<b>繊維製品 (0.2%)</b>				アステラス製薬	79.9	74.4	124,396	三浦工業	3.5	3.6	10,668
帝人	8	-	-	住友ファーマ	6.2	-	-	アマダ	13.4	13.6	24,650
東レ	55.8	56.8	42,401	塩野義製薬	10.7	10.7	83,791	FUJI	3.7	4	10,800
ゴールドウイン	1.5	1.5	15,000	日本新薬	2	2.2	10,243	DMG森精機	5.1	5.2	21,164

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		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
ディスコ	1.3	4.1	224,639		8.2	41.3	181,183		山九	2.1	2.1	11,499		2.1	2.1	11,499		2.1	2.1	11,499	
オプトラン	1.2	-	-		-	-	-		セコグループHDGS	4.4	4.5	5,211		4.4	4.5	5,211		4.4	4.5	5,211	
ナプテスコ	5.3	5.4	14,126		6.7	6.8	37,583		AZ-COM丸和ホールディ	2	2.2	3,146		2	2.2	3,146		2	2.2	3,146	
S M C	2.7	2.6	226,200		-	0.7	6,234		S Gホールディングス	15.9	14.2	28,222		15.9	14.2	28,222		15.9	14.2	28,222	
小松製作所	39.4	40.1	180,730		2.9	3	17,145		NIPPON EXPRESS	3.1	2.9	22,419		3.1	2.9	22,419		3.1	2.9	22,419	
住友重機	5	5.1	24,311		12.9	52.6	111,012		<b>海運業 (1.0%)</b>												
日立建機	3.3	3.4	15,742		4.1	4.1	14,760		日本郵船	22.2	24.2	102,704		22.2	24.2	102,704		22.2	24.2	102,704	
ローツェ	0.4	0.4	8,056		25.2	77	224,493		商船三井	14.6	18.3	86,284		14.6	18.3	86,284		14.6	18.3	86,284	
クボタ	44.5	44.7	107,816		10	8.8	17,661		川崎汽船	7.1	6.8	43,098		7.1	6.8	43,098		7.1	6.8	43,098	
荏原製作所	3.4	3.5	46,515		1.4	2.9	54,346		N Sユナイテッド海運	-	0.5	2,560		-	0.5	2,560		-	0.5	2,560	
ダイキン工業	10	10.2	210,732		5.4	14.5	570,285		<b>倉庫・運輸関連業 (0.0%)</b>												
オルガン	-	1	7,370						三井倉庫HOLD	0.8	0.8	3,764		0.8	0.8	3,764		0.8	0.8	3,764	
ダイフク	4.3	14.4	52,473		3.5	3.6	9,432		<b>情報・通信業 (8.4%)</b>												
SANKYO	-	9.8	16,792		6.1	7.2	116,496		NECネットエスアイ	2.8	3.3	8,923		2.8	3.3	8,923		2.8	3.3	8,923	
竹内製作所	1.5	1.6	9,296		17.2	69.8	205,770		システナ	14	12.8	3,622		14	12.8	3,622		14	12.8	3,622	
セガミーホールディングス	-	7.6	14,443		24.2	24.6	52,398		日鉄ソリューションズ	1.4	1.4	7,308		1.4	1.4	7,308		1.4	1.4	7,308	
ホンザキ	5.4	5	27,865		124.4	128.8	498,713		T I S	9.4	9.3	31,694		9.4	9.3	31,694		9.4	9.3	31,694	
マキタ	10.5	9.7	41,312		-	0.8	4,144		コーエーテックモHD	5.2	5.3	9,195		5.2	5.3	9,195		5.2	5.3	9,195	
三菱重工業	14.7	14.9	202,416		6.4	6.5	40,033		ネクソン	21.6	19	50,682		21.6	19	50,682		21.6	19	50,682	
I H I	5.3	6.4	23,494		マツダ	-	28	50,610		S H I F T	-	0.6	14,883		-	0.6	14,883		-	0.6	14,883
<b>電気機器 (17.9%)</b>					本田技研	67.6	205.5	394,868		ティーガイア	0.9	0.9	1,881		0.9	0.9	1,881		0.9	0.9	1,881
イビデン	4.8	4.5	29,835		スズキ	15.3	15.5	105,725		ガホ・オンライン・エンター	2.6	2.2	5,183		2.6	2.2	5,183		2.6	2.2	5,183
ブラザー工業	11.2	11.4	32,330		S U B A R U	26.3	26.2	90,992		GMOペイメントゲートウェイ	1.9	1.7	17,442		1.9	1.7	17,442		1.9	1.7	17,442
ミネベアミツミ	14.6	14.9	44,729		ヤマハ発動機	13.1	36.6	51,368		インターネットアジアティフ	4.7	4.1	11,775		4.7	4.1	11,775		4.7	4.1	11,775
日立	34.4	33	454,740		豊田合成	2.4	2.4	8,162		ラクス	3.9	4	8,508		3.9	4	8,508		3.9	4	8,508
三菱電機	86.8	95.1	244,692		シマン	3.4	3.4	77,027		チェンジホールディングス	2	1.8	2,309		2	1.8	2,309		2	1.8	2,309
富士電機	5.1	5.2	50,096		テイ・エス・テック	3.8	-	-		野村総合研究所	17.1	18.8	79,054		17.1	18.8	79,054		17.1	18.8	79,054
安川電機	10	9.3	60,208		<b>精密機器 (2.8%)</b>					インフォコム	1.1	-	-		1.1	-	-		1.1	-	-
ニデック	20.4	18.9	121,035		テルモ	25.6	23.7	133,691		オービック	2.8	2.8	65,772		2.8	2.8	65,772		2.8	2.8	65,772
オムロン	7.7	6.5	36,335		島津製作所	10.1	11.2	49,683		ジャストシステム	1.2	1.2	3,271		1.2	1.2	3,271		1.2	1.2	3,271
MC J	3.5	3.5	4,886		ナカニシ	-	3.6	8,301		L I N Eヤフー	118.7	120.8	48,090		118.7	120.8	48,090		118.7	120.8	48,090
日本電気	11.9	11.2	126,280		東京精密	1.8	1.7	20,629		トレンドマイクロ	4.8	4	31,196		4.8	4	31,196		4.8	4	31,196
富士通	8.4	7.9	205,716		オリンパス	52	52.1	115,896		日本オラクル	1.6	1.6	19,176		1.6	1.6	19,176		1.6	1.6	19,176
ルネサスエレクトロニクス	54.8	55.8	145,749		H O Y A	17.8	16.2	318,735		伊藤忠テクノソリューション	4.5	-	-		4.5	-	-		4.5	-	-
セイコーエプソン	11.2	11	29,100		朝日インテック	9.3	10.3	29,355		大塚商会	4.7	4.2	28,476		4.7	4.2	28,476		4.7	4.2	28,476
ワコム	6.7	6.5	4,329		<b>その他製品 (2.0%)</b>					電通総研	1	1	5,060		1	1	5,060		1	1	5,060
アルパック	2	1.9	18,574		バンダイナムコHDGS	7.6	23.2	67,593		東映アニメーション	0.4	0.4	6,420		0.4	0.4	6,420		0.4	0.4	6,420
エレコム	2	2	3,142		パイロットコーポレーション	1.3	1.2	4,689		デジタルガレージ	1.5	1.4	4,718		1.5	1.4	4,718		1.5	1.4	4,718
パナソニックホールディング	99.2	100.9	150,189		ヤマハ	5.2	5.3	17,490		ネットワンシステムズ	3.1	3.4	9,418		3.1	3.4	9,418		3.1	3.4	9,418
シャープ	10.1	-	-		ビジョン	5.3	5.4	8,351		B I P R O G Y	3.1	2.8	13,406		3.1	2.8	13,406		3.1	2.8	13,406
アンリツ	5.9	6	7,734		任天堂	41.3	45.5	383,383		USEN-NEXT HDGS	0.7	1	5,170		0.7	1	5,170		0.7	1	5,170
ソニーグループ	22.1	22.9	308,005		<b>電気・ガス業 (1.2%)</b>					日本電信電話	65.1	1,619.8	297,233		65.1	1,619.8	297,233		65.1	1,619.8	297,233
T D K	13.3	13.5	101,790		中部電力	30.7	31.2	63,320		K D D I	54.8	65.6	300,776		54.8	65.6	300,776		54.8	65.6	300,776
ヒロセ電機	-	1.3	20,319		関西電力	32.1	32.7	70,975		ソフトバンク	134	136.6	279,347		134	136.6	279,347		134	136.6	279,347
横河電機	9.2	9.3	32,866		九州電力	19.2	-	-		光通信	1	0.9	29,970		1	0.9	29,970		1	0.9	29,970
アズビル	5.8	5.8	24,766		北海道電力	8	-	-		GMOインターネットグループ	3.1	3.1	8,934		3.1	3.1	8,934		3.1	3.1	8,934
日本光電工業	3.8	3.6	14,457		電源開発	6.3	6.9	17,629		K A D O K A W A	-	4.5	12,393		-	4.5	12,393		-	4.5	12,393
堀場製作所	1.9	1.6	25,328		イーレックス	1.5	1.5	1,081		東宝	5.2	4.7	24,411		5.2	4.7	24,411		5.2	4.7	24,411
アドバンテスト	6.6	24.2	158,413		レノバ	2.2	2.3	2,946		N T Tデータグループ	26.2	22.2	55,622		26.2	22.2	55,622		26.2	22.2	55,622
キーエンス	5.2	4.4	316,052		東京瓦斯	17.6	17.9	63,741		D T S	1.8	1.8	7,389		1.8	1.8	7,389		1.8	1.8	7,389
シスメックス	7.2	7.3	61,239		大阪瓦斯	16.8	17.1	59,918		スクウェア・エニックス・HD	4.2	3.9	23,778		4.2	3.9	23,778		4.2	3.9	23,778
フェローテックHDGS	2.5	2.7	8,067		<b>陸運業 (0.4%)</b>					カブコン	8.3	7.6	48,548		8.3	7.6	48,548		8.3	7.6	48,548
レーザーテック	3.8	3.9	167,388		S B Sホールディングス	0.7	0.8	1,984		S C S K	6.8	5.9	17,602		6.8	5.9	17,602		6.8	5.9	17,602
日本電子	-	2.1	13,391		東海旅客鉄道	6.4	-	-		N S D	3	3	9,015		3	3	9,015		3	3	9,015
カシオ	6.2	-	-		ヤマトホールディングス	10.6	10.8	24,024		コナミグループ	3.6	3.2	33,200		3.6	3.2	33,200		3.6	3.2	33,200

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	
ソフトバンクグループ	千株	千株	千円				しまむら	千株	千株	千円				三井不動産	千株	千株	千円				
卸売業 (8.3%)	40.8	41.9	387,449				丸井グループ	—	2.1	19,019				三菱地所	35.6	38.5	189,959				
双日	9.3	10	40,800				イズミ	6.5	—	—				東京建物	49.4	54.5	149,084				
アルフレッサホールディングス	8.8	9	20,650				ヤオコー	1.3	1.6	5,627				住友不動産	7.8	7.3	17,764				
神戸物産	6.8	6.9	25,185				ケーズホールディングス	1	1.1	10,421				スターツコーポレーション	14.8	12.1	65,848				
ダイワボウHD	3.6	4	10,200				ニトリホールディングス	7	6	8,091				日本エスコ	1.2	1.2	3,870				
マクニカホールディングス	—	2.1	15,737				ファーストリテイリング	3	3.3	78,474				イオンモール	1.8	—	—				
TOKAIホールディングス	4.3	—	—				サンドラッグ	4	4	189,640				カチタス	4.2	—	—				
シッパヘルスケアHD	3.2	3.2	7,139				<b>銀行業 (6.4%)</b>	3.3	3	14,610				<b>サービス業 (3.3%)</b>	2.2	2.2	4,393				
メディアバルHD	9.1	9.1	21,435				めびきフィナンシャルG	40.7	41.3	21,162				日本M&Aセンターホールデ	—	13.9	13,888				
I DOM	—	2.4	2,522				コンソリア・フィナンシャル	45.2	44.7	35,737				U Tグループ	1.3	1.1	3,954				
伊藤忠	54.2	57.1	379,429				SBI 新生銀行	2.4	—	—				パソナグループ	—	1.1	3,188				
丸紅	69.5	74.6	199,741				あおぞら銀行	5.2	—	—				エス・エム・エス	3.3	3	7,651				
豊田通商	7.7	7.8	82,095				三菱UFJフィナンシャルG	322.1	271.6	435,103				パーソルホールディングス	9.6	88.5	19,647				
兼松	3.4	3.7	9,509				リそなホールディングス	103.5	96.4	91,695				総合警備保障	3.2	14.5	12,654				
三井物産	64.4	58.4	417,268				三井住友トラストHD	14.9	29.9	101,988				カカコム	6.3	5.7	10,958				
住友商事	54.5	54.2	202,382				三井住友フィナンシャルG	59.9	47	427,465				ディップ	1.5	1.3	3,629				
三菱商事	55	135.2	482,934				千葉銀行	22.8	23.2	30,276				ベネフィット・ワン	4	3	6,519				
キャノンマーケティングJPN	—	2.1	9,531				ふくおかフィナンシャルG	6.5	7.3	30,608				エムスリー	16.9	17.2	36,403				
阪和興業	1.6	1.6	9,504				セブン銀行	29.3	26.1	7,918				博報堂DYHL DGS	10.9	11.1	15,329				
岩谷産業	2	2	15,990				みずほフィナンシャルG	118.5	112.5	348,637				パリュエコマース	0.6	—	—				
稲畑産業	—	1.8	5,859				<b>証券、商品先物取引業 (1.2%)</b>						HUグループHD	2.5	2.5	6,475					
伊藤忠エネクス	—	2.2	3,500				GMOフィナンシャルHLDGS	1.8	—	—				ピー・エム・エル	1.1	1.1	3,366				
加賀電子	—	0.8	5,208				SBIホールディングス	—	12.2	50,373				ユー・エス・エス	8.8	9.8	25,759				
PAL TAC	1.4	1.2	4,933				ジャフコグループ	2.7	2.5	4,677				サイバーエージェント	20.5	19.2	21,331				
日鉄物産	0.6	—	—				大和証券G本社	58.2	64.4	76,958				フルキャストホールディングス	0.8	0.8	1,189				
ミスミグループ本社	13.3	13.5	29,409				野村ホールディングス	150.9	140.1	137,970				エン・ジャパン	1.5	—	—				
<b>小売業 (3.9%)</b>							マネックスG	9.2	8.2	7,437				テクノプロ・ホールディング	5.1	5.1	16,019				
ローソン	2.2	1.9	19,589				<b>保険業 (3.4%)</b>							ジャパンマテリアル	2.6	2.7	6,455				
エービーシー・マート	1.3	3.9	11,230				SOMPOホールディングス	14.1	12.5	119,500				リクルートホールディングス	60.4	64.4	434,313				
アスクル	—	2.2	4,697				M S & A D	16.7	18.7	149,861				ベルシステム24HLDGS	1.1	0.9	1,417				
日本マクドナルドHLDG	5	5.5	37,730				第一生命HLDGS	41.7	40.7	158,323				ペイカレントコンサルティング	6.8	6.4	19,398				
セリア	2.4	2.6	8,099				東京海上HD	82.5	82.4	393,789				ジャパンエレベーターSHD	3	2.8	7,114				
Menot aRO	12.5	12.7	22,764				T & Dホールディングス	22	—	—				リログループ	4.8	4.4	5,596				
マツキヨコカラ&カンパニー	5.3	16.3	40,057				<b>その他金融業 (1.5%)</b>							トランス・コスモス	1.1	1.1	3,602				
ZOZO	5.8	5.7	22,708				全国保証	2.1	2.2	12,518				セコム	8.7	8.9	104,530				
ウエルシアHD	4.6	4.6	12,061				芙蓉総合リース	0.8	0.8	11,040				メテックグループホールデ	3.4	3.1	9,535				
クリエイトSDH	1.5	1.3	4,244				みずほリース	1.2	1.4	8,050				イオンディライト	0.9	0.9	3,190				
ネクステージ	2	2	5,574				東京センチュリー	1.5	6.2	10,214				<b>合計</b>	<b>株数、金額</b>	<b>6,011.6</b>	<b>8,230.3</b>	<b>24,028,489</b>			
コスモス薬品	0.9	0.8	11,368				イオンフィナンシャルサービス	4.7	4.8	6,568				<b>銘柄数&lt;比率&gt;</b>	<b>399銘柄</b>	<b>399銘柄</b>	<b>&lt;98.3%&gt;</b>				
セブ&アイ・HLDGS	30.3	92.6	202,655				アコム	14.6	14.9	6,035											
ツルハホールディングス	1.8	1.9	21,099				ジャックス	—	0.9	5,157											
クスリのアオキHLDGS	0.8	2.7	8,602				オリコ	2.1	2.7	3,042											
FOOD&LIFE COMPAN	5.1	4.8	14,510				オリックス	53.8	50	168,250											
ノジマ	2.9	2.6	4,433				三菱HCキャピタル	31.9	37.1	40,383											
良品計画	11.4	9.8	23,426				日本取引所グループ	23	21.7	87,689											
コーナン商事	1.2	1.1	4,774				<b>不動産業 (2.5%)</b>														
パンパシフィックHD	17.8	18.1	71,748				大東建託	3	3.1	54,792											
ゼンショーホールディングス	4.8	4.6	29,831				ヒューリック	19.1	19.4	30,322											
ワークマン	1	1	4,150				野村不動産HLDGS	5.1	4.6	18,860											
V Tホールディングス	—	3.4	1,791				プレサンスコーポレーション	1.1	1.3	2,303											
スギホールディングス	1.8	5.4	13,902				オープンハウスグループ	3	3.1	14,756											
日本瓦斯	4.7	4.7	12,722				東急不動産HD	24.6	25.1	29,969											
ライフコーポレーション	0.8	0.9	3,510				飯田GH D	7.2	8	16,184											
コメリ	—	1.4	5,054				ケイアイスター不動産	0.4	0.4	1,494											

(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	307	—

(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 121,600 (-)	株 (-)

(注) ( )内は、利害関係人等に貸付もしくは借入をしているもの。

## ■投資信託財産の構成

2024年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 24,028,489	% 95.0
コール・ローン等、その他	1,264,883	5.0
投資信託財産総額	25,293,372	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

2024年3月22日現在

項 目	当 期 末
<b>(A) 資産</b>	<b>25,544,647,397円</b>
コール・ローン等	1,003,789,679
株式(評価額)	24,028,489,370
未収入金	223,656,434
未収配当金	33,569,650
未収利息	57,742
その他未収収益	3,809,522
差入委託証拠金	251,275,000
<b>(B) 負債</b>	<b>1,093,608,847</b>
未払解約金	160,705,000
差入委託証拠金代用有価証券	261,910,000
受入担保金	670,993,847
<b>(C) 純資産総額(A - B)</b>	<b>24,451,038,550</b>
元本	8,927,225,570
次期繰越損益金	15,523,812,980
<b>(D) 受益権総口数</b>	<b>8,927,225,570口</b>
1万口当り基準価額(C/D)	27,389円

\* 期首における元本額は9,440,541,060円、当作成期間中における追加設定元本額は3,262,940,915円、同解約元本額は3,776,256,405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 F r e e J P X 日経400インデックス 2,445,404,825円  
 ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド 128,591,624円  
 ダイワ J P X 日経400ファンド 4,420,138,316円  
 ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 1,933,090,805円

\* 当期末の計算口数当りの純資産額は27,389円です。

## ■損益の状況

当期 自2023年3月23日 至2024年3月22日

項 目	当 期
<b>(A) 配当等収益</b>	<b>488,741,637円</b>
受取配当金	476,635,787
受取利息	427,543
その他収益金	11,863,086
支払利息	△ 184,779
<b>(B) 有価証券売買損益</b>	<b>7,409,080,608</b>
売買益	7,797,595,722
売買損	△ 388,515,114
<b>(C) 先物取引等損益</b>	<b>117,214,200</b>
取引益	121,762,550
取引損	△ 4,548,350
<b>(D) 当期損益金(A + B + C)</b>	<b>8,015,036,445</b>
<b>(E) 前期繰越損益金</b>	<b>8,099,838,916</b>
<b>(F) 解約差損益金</b>	<b>△ 4,681,249,618</b>
<b>(G) 追加信託差損益金</b>	<b>4,090,187,237</b>
<b>(H) 合計(D + E + F + G)</b>	<b>15,523,812,980</b>
次期繰越損益金(H)	15,523,812,980

(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。

## 《お知らせ》

## ■ベンチマークの変更について

ベンチマークとしている株価指数を、以下の通り配当を含む株価指数に変更しました。

変更前： J P X 日経インデックス400

変更後： J P X 日経インデックス400（配当込み）

「 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。