

iFree J P X日経400 インデックス

運用報告書（全体版） 第9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：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
	(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			
5期末(2021年3月22日)	円 16,249	円 0	% 58.5	16,391	% 58.9	% 95.9	% 0.1	百万円 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
9期末(2025年3月24日)	25,021	0	1.2	25,463	1.5	99.5	0.4	11,114

(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：24,720円

期末：25,021円（分配金0円）

騰落率：1.2%（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) 2024年 3月22日	円 24,720	% -	25,083	% -	% 98.3	% 1.3
3 月末	24,562	△0.6	24,927	△0.6	97.9	2.2
4 月末	24,440	△1.1	24,814	△1.1	97.9	2.0
5 月末	24,789	0.3	25,186	0.4	97.9	2.1
6 月末	25,204	2.0	25,612	2.1	99.1	0.8
7 月末	25,120	1.6	25,532	1.8	98.4	1.5
8 月末	24,416	△1.2	24,806	△1.1	98.6	1.4
9 月末	23,975	△3.0	24,370	△2.8	98.6	1.5
10月末	24,358	△1.5	24,768	△1.3	98.1	1.9
11月末	24,155	△2.3	24,564	△2.1	97.8	2.1
12月末	24,993	1.1	25,419	1.3	99.4	0.5
2025年 1 月末	25,021	1.2	25,450	1.5	99.4	0.5
2 月末	24,074	△2.6	24,496	△2.3	98.6	1.5
(期末) 2025年 3月24日	25,021	1.2	25,463	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JPX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JPX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。

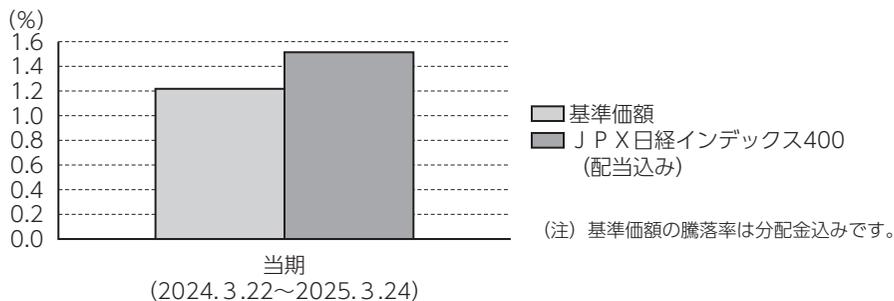
組入ファンド	ベンチマーク
ダイワJ P X日経400マザーファンド	J P X日経インデックス400 (配当込み)

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1.2%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、経費控除後の配当等収益が少額だったため、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	
	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）	15,021

(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	53円	0.216%	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24,409円です。
(投 信 会 社)	(24)	(0.100)	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)	(22)	(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)	(7)	(0.028)	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	55	0.226	

(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。

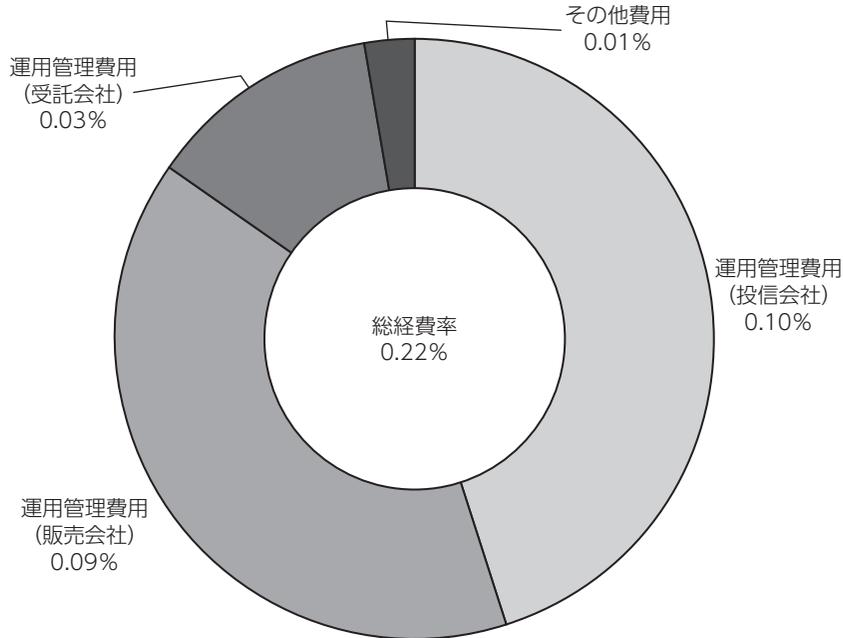
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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

(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	2,668,040	7,162,480	1,113,148	3,058,830

(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			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
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33.8%

※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)	422千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2千円
(B) / (A)	0.7%

(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	2,445,404	4,000,296	11,114,422

(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	11,114,422	98.9
コール・ローン等、その他	124,515	1.1
投資信託財産総額	11,238,938	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	11,238,938,132円
コール・ローン等	82,215,704
ダイワJPX日経400マザーファンド(評価額)	11,114,422,428
未収入金	42,300,000
(B) 負債	124,235,807
未払解約金	113,130,513
未払信託報酬	10,825,002
その他未払費用	280,292
(C) 純資産総額(A - B)	11,114,702,325
元本	4,442,149,579
次期繰越損益金	6,672,552,746
(D) 受益権総口数	4,442,149,579口
1万口当り基準価額(C / D)	25,021円

* 期首における元本額は2,709,543,290円、当作成期間中における追加設定元本額は4,712,465,035円、同解約元本額は2,979,858,746円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は25,021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	76,600円
受取利息	76,600
(B) 有価証券売買損益	283,603,602
売買益	372,332,208
売買損	△ 88,728,606
(C) 信託報酬等	△ 20,154,036
(D) 当期損益金(A + B + C)	263,526,166
(E) 前期繰越損益金	516,357,614
(F) 追加信託差損益金	5,892,668,966
(配当等相当額)	(3,020,576,444)
(売買損益相当額)	(2,872,092,522)
(G) 合計(D + E + F)	6,672,552,746
次期繰越損益金(G)	6,672,552,746
追加信託差損益金	5,892,668,966
(配当等相当額)	(3,020,576,444)
(売買損益相当額)	(2,872,092,522)
分配準備積立金	779,883,780

(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	70,554円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	263,454,047
(c) 収益調整金	5,892,668,966
(d) 分配準備積立金	516,359,179
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	6,672,552,746
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	6,672,552,746
(h) 受益権総口数	4,442,149,579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。

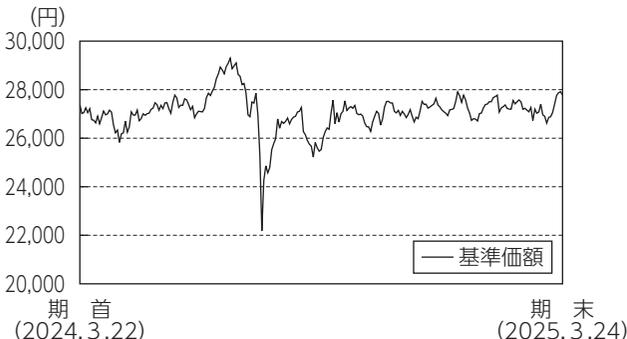
運用方針	投資成果を J P X 日経インデックス400 (配当込み) の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式 (上場予定を含みます。)
株式組入制限	無制限

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

ダイワ J P X 日経400マザーファンド

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
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	バンドナムコ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		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
SCSK	5.9	8.5	32,393			
NSD	3	4	13,652			
コナミグループ	3.2	3.9	69,322			
ソフトバンクグループ	41.9	-	-			
卸売業 (6.9%)						
東京エレクトロンデバイス	-	1.1	3,415			
双日	10	12.2	42,370			
アルフレッサホールディングス	9	-	-			
神戸物産	6.9	8.5	29,180			
ダイワボウHD	4	4.9	12,446			
マグニカホールディングス	2.1	8.4	16,275			
シップヘルスケアHD	3.2	4.3	8,718			
メディアパルHD	9.1	11.9	28,036			
IDOM	2.4	3.7	4,491			
伊藤忠	57.1	53.7	384,223			
丸紅	74.6	90.2	228,206			
豊田通商	7.8	33	87,582			
兼松	3.7	4.6	11,937			
三井物産	58.4	113.4	333,282			
住友商事	54.2	65.8	236,551			
三菱商事	135.2	129	356,040			
キャノンマーケティングJPN	2.1	2.2	11,206			
阪和興業	1.6	1.8	9,378			
岩谷産業	2	10.9	17,025			
稲畑産業	1.8	3	9,750			
伊藤忠エネクス	2.2	2.7	4,465			
サンリオ	-	8.9	62,389			
加賀電子	0.8	2.2	6,109			
PALTAC	1.2	-	-			
ミスミグループ本社	13.5	16.6	42,595			
小売業 (4.3%)						
ローソン	1.9	-	-			
エービーシー・マート	3.9	4.8	13,608			
アスクル	2.2	2.6	4,212			
アグストリア	-	1.5	4,408			
日本マクドナルドHLDG	5.5	6.7	38,458			
パルグループHLDGS	-	2.5	7,850			
セリア	2.6	3.2	8,188			
MonotaRO	12.7	15.6	42,120			
マツコヨコカラ&カンパニー	16.3	19.4	45,900			
ZOZO	5.7	8.2	36,096			
ウエルシアHD	4.6	5.7	12,280			
クリエイトSDH	1.3	1.6	4,569			
ネクステージ	2	2.5	4,017			
コスモス薬品	0.8	2.2	16,412			
セブ&アイ・HLDGS	92.6	121.3	272,561			
ツルハホールディングス	1.9	1.9	17,850			
ツクリのアオキHLDGS	2.7	2.9	9,662			
FOOD&LIFE COMPAN	4.8	5.9	26,508			
ノジマ	2.6	3.6	8,974			
良品計画	9.8	13.1	53,985			
コーナン商事	1.1	-	-			
パンパシフィックHD	18.1	22.2	93,262			
ゼンショーホールディングス	4.6	6.2	50,145			
ワークマン	1	1.6	6,592			
V1ホールディングス	3.4	-	-			

銘柄	期首			当期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
スギホールディングス	5.4	5.9	16,599			
日本瓦斯	4.7	5.3	12,097			
ライフコーポレーション	0.9	2.3	4,397			
コメリ	1.4	-	-			
しまむら	2.1	2.6	21,801			
丸井グループ	-	7.3	19,929			
イズミ	1.6	-	-			
ヤオコー	1.1	1.3	12,044			
ケースホールディングス	6	-	-			
ニトリホールディングス	3.3	4	57,280			
ファーストリテイリング	4	6.2	280,736			
サンドラッグ	3	3.7	15,625			
銀行業 (7.4%)						
めびきフィナンシャルG	41.3	51.3	38,290			
コンコルディア・フィナンシャル	44.7	54.4	55,651			
三菱UFJフィナンシャルG	271.6	257.1	560,863			
りそなホールディングス	96.4	125.4	178,068			
三井住友トラストグループ	29.9	36.4	145,381			
三井住友フィナンシャルG	47	116.8	471,521			
千葉銀行	23.2	31.7	47,058			
ふくおかフィナンシャルG	7.3	8.9	36,952			
セブン銀行	26.1	36.6	10,775			
みずほフィナンシャルG	112.5	125.7	550,817			
証券・商品先物取引業 (1.2%)						
FPG	-	3.6	8,841			
SBIホールディングス	12.2	16.5	70,735			
ジャフコグループ	2.5	-	-			
大和証券G本社	64.4	73.1	78,619			
野村ホールディングス	140.1	171.9	169,974			
マネックスG	8.2	10	7,430			
保険業 (4.0%)						
SOMPONホールディングス	12.5	50	230,450			
MS&AD	18.7	74.9	256,307			
第一生命HLDGS	40.7	48.1	221,308			
東京海上HD	82.4	70.3	418,214			
その他金融業 (1.5%)						
全国保証	2.2	2.7	16,254			
クレディセゾン	-	6.5	24,583			
芙蓉総合リース	0.8	0.9	10,701			
みずほリース	1.4	7.7	8,231			
東京センチュリー	6.2	7.6	11,555			
イオンフィナンシャルサービス	4.8	5.9	8,085			
アコム	14.9	24.3	9,654			
ジャックス	0.9	1.2	4,860			
オリコ	2.7	-	-			
オリックス	50	58.7	189,542			
三菱HCキャピタル	37.1	51.2	53,555			
日本取引所グループ	21.7	60.8	100,046			
不動産業 (2.4%)						
大東建託	3.1	3.5	55,037			
ヒューリック	19.4	23.8	34,974			
野村不動産HLDGS	4.6	6.4	28,544			
プレサンスコーポレーション	1.3	-	-			
オープンハウスグループ	3.1	3.7	21,193			
東急不動産HD	25.1	30.7	32,004			
飯田GHHD	8	9.8	22,829			

銘柄	期首			当期末				
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額		
	千株	千株	千円					
ケイアイスター不動産	0.4	0.6	2,766					
三井不動産	38.5	140.4	195,577					
三菱地所	54.5	58.3	144,234					
東京建物	7.3	8.9	23,344					
住友不動産	12.1	16.6	100,297					
スターツコーポレーション	1.2	1.7	6,970					
カチタス	2.2	2.7	5,405					
サービス業 (3.8%)								
ジェイエシークリートメント	-	3.9	3,073					
日本M&Aセンターホールディング	13.9	15.7	10,037					
UTグループ	1.1	1.4	3,115					
パソナグループ	1.1	1.3	2,847					
エス・エム・エス	3	4.1	4,942					
パルソールホールディングス	88.5	97.3	24,879					
総合警備保障	14.5	17.8	20,585					
カカコム	5.7	7.7	16,647					
ディップ	1.3	1.9	4,303					
ベネフィット・ワン	3	-	-					
エムスリー	17.2	21.1	36,439					
博報堂DYHLDGS	11.1	12.1	13,588					
HUグループHD	2.5	-	-					
オリエンタルランド	-	62.9	195,178					
ラウンドワン	-	10.1	10,847					
ピー・エム・エル	1.1	1.3	3,932					
ユー・エス・エス	9.8	21.9	31,360					
サイバーエージェント	19.2	23.6	30,066					
フルキャストホールディングス	0.8	-	-					
テクノプロ・ホールディング	5.1	6.5	21,099					
ジャパンマテリアル	2.7	3.3	4,488					
リクルートホールディングス	64.4	53.1	438,075					
ベルジシステム24HLDGS	0.9	1.1	1,438					
ペイカレント	6.4	7.8	51,331					
ジャパンエレベーターSHD	2.8	4.1	11,070					
アンビスホールディングス	-	2.3	1,182					
リログループ	4.4	-	-					
トランス・コスモス	1.1	1.4	4,557					
セコム	8.9	21.7	111,993					
メイトックグループホールディング	3.1	3.9	11,766					
イオンディライト	0.9	1.1	5,929					
合計	株数、金額	8,230.3	13,706.9	28,395.492	銘柄数<比率>	399銘柄	396銘柄	<99.5%>

(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。