

ダイワ・ノーロード ＪＰＸ日経４００ファンド

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）

■2024年12月14日付で信託期間終了日を2026年 3月
19日から2031年 3月20日に変更しました。

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
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ＪＰＸ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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
（営業日の9：00～17：00）
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／インデックス型		
信託期間	2016年3月22日～2031年3月20日		
運用方針	投資成果をＪＰＸ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す。		
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワＪＰＸ日経400マザーファンドの受益証券	
	ダイワＪＰＸ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		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
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。		

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			
	円	円	%		%	%	%	百万円
5 期末(2021年 3 月22日)	16,103	0	57.9	16,544	58.9	95.9	0.1	108
6 期末(2022年 3 月22日)	15,960	0	△ 0.9	16,480	△ 0.4	99.0	1.1	211
7 期末(2023年 3 月22日)	16,540	0	3.6	17,173	4.2	97.0	2.3	211
8 期末(2024年 3 月22日)	24,244	0	46.6	25,317	47.4	98.3	1.3	352
9 期末(2025年 3 月24日)	24,455	0	0.9	25,700	1.5	99.5	0.4	361

- (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」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：24,244円

期 末：24,455円（分配金0円）

騰落率：0.9%（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。

年 月 日	基 準 価 額	騰 落 率	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
			(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期首) 2024年 3 月22日	円	%		%	%	%
	24,244	－	25,317	－	98.3	1.3
3 月末	24,088	△0.6	25,159	△0.6	97.9	2.2
4 月末	23,961	△1.2	25,045	△1.1	97.9	2.0
5 月末	24,296	0.2	25,421	0.4	97.9	2.1
6 月末	24,696	1.9	25,851	2.1	99.1	0.8
7 月末	24,606	1.5	25,770	1.8	98.4	1.5
8 月末	23,910	△1.4	25,037	△1.1	98.6	1.4
9 月末	23,472	△3.2	24,597	△2.8	98.6	1.5
10月末	23,840	△1.7	24,999	△1.3	98.1	1.9
11月末	23,634	△2.5	24,793	△2.1	97.8	2.1
12月末	24,447	0.8	25,656	1.3	99.4	0.5
2025年 1 月末	24,466	0.9	25,688	1.5	99.4	0.5
2 月末	23,535	△2.9	24,724	△2.3	98.6	1.5
(期末) 2025年 3 月24日	24,455	0.9	25,700	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

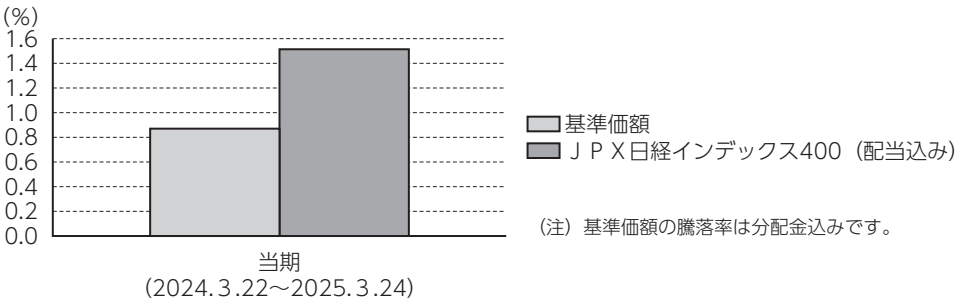
ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

*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0.9%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（1万口当たり）

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）	14,454

- （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	135円	0.564%	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23,899円です。
(投 信 会 社)	(66)	(0.276)	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)	(61)	(0.254)	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)	(8)	(0.033)	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	0.005	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
合 計	137	0.574	

(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。

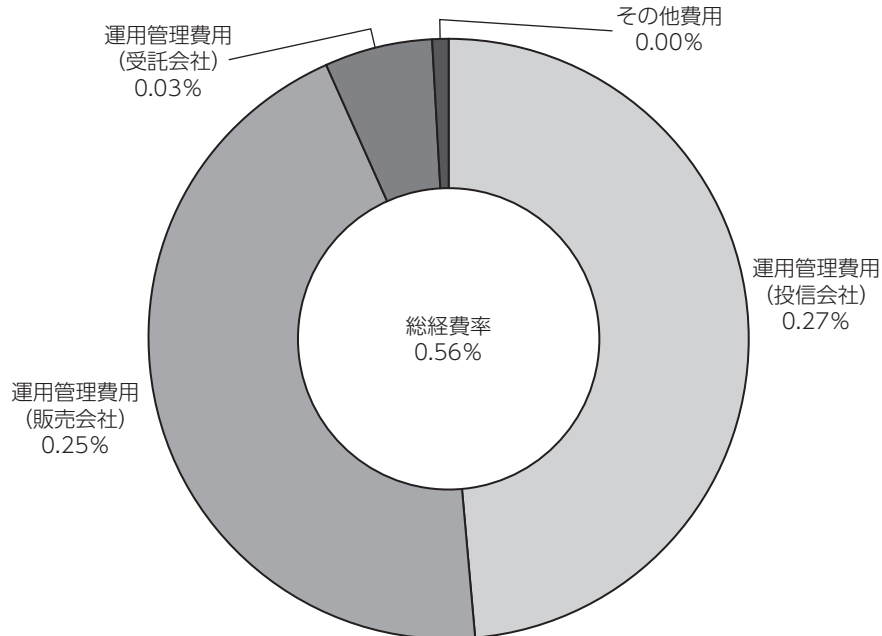
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.56%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	110,600	294,687	108,914	297,813

(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					
区 分	買付額等 A		B／A	売付額等 C		D／C
	うち利害 関係人との 取引状況B			うち利害 関係人との 取引状況D		
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1.3%

※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

(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)	16千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0千円
(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	千円
ダイワJ P X日経400マザーファンド	128,591	130,277 361,963

(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	361,963 93.0
コール・ローン等、その他	27,046 7.0
投資信託財産総額	389,010 100.0

(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	389,010,552円
コール・ローン等	1,218,788
ダイワ J P X日経400マザーファンド(評価額)	361,963,764
未収入金	25,828,000
(B) 負債	27,037,606
未払解約金	26,049,095
未払信託報酬	978,902
その他未払費用	9,609
(C) 純資産総額(A - B)	361,972,946
元本	148,018,307
次期繰越損益金	213,954,639
(D) 受益権総口数	148,018,307口
1万口当り基準価額(C / D)	24,455円

* 期首における元本額は145,274,187円、当作成期間中における追加設定元本額は159,572,756円、同解約元本額は156,828,636円です。
* 当期末の計算口数当りの純資産額は24,455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	2,337円
受取利息	2,337
(B) 有価証券売買損益	11,280,791
売買益	16,132,934
売買損	△ 4,852,143
(C) 信託報酬等	△ 1,990,677
(D) 当期損益金(A + B + C)	9,292,451
(E) 前期繰越損益金	27,481,693
(F) 追加信託差損益金	177,180,495
(配当等相当額)	(91,675,070)
(売買損益相当額)	(85,505,425)
(G) 合計(D + E + F)	213,954,639
次期繰越損益金(G)	213,954,639
追加信託差損益金	177,180,495
(配当等相当額)	(91,675,070)
(売買損益相当額)	(85,505,425)
分配準備積立金	36,774,144

(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	1,939円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	9,290,474
(c) 収益調整金	177,180,495
(d) 分配準備積立金	27,481,731
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	213,954,639
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	213,954,639
(h) 受益権総口数	148,018,307口

《お知らせ》

■信託期間の延長について

2024年12月14日付で信託期間終了日を2026年3月19日から2031年3月20日に変更しました。

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。

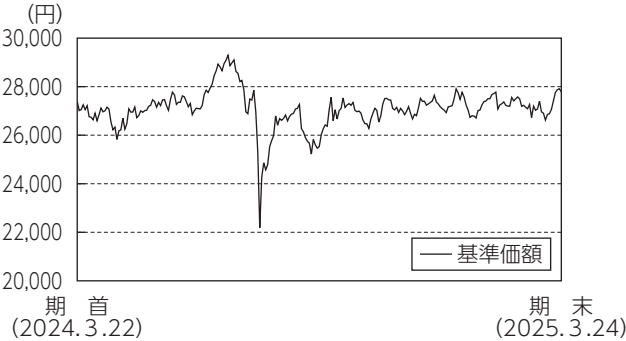
運 用 方 針	投資成果を J P X 日経インデックス400（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行います。
主 要 投 資 対 象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株 式 組 入 制 限	無制限

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 (配 当 込 み)		株 式 入 率	株 式 先 比	株 式 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
国内	千株	千円	千株	千円
	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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
		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
キャノン		千株	千円	円	ソフトバンクグループ		千株	千円	円
		54	271,828	5,033			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
		1,338.2	210,626	157			28.8	250,508	8,698
日本電信電話		17.5	142,013	8,115	リクルートホールディングス		22	181,135	8,233
		2.1	141,966	67,603			31.4	172,603	5,496
キーエンス		15.5	141,370	9,120	東京海上HD		5.9	156,428	26,513
		28.6	140,556	4,914			94.8	147,930	1,560
ソニーグループ		32.9	140,101	4,258	三菱UFJフィナンシャルG		22.4	132,567	5,918
		41.6	138,668	3,333			17.4	131,308	7,546
日立		80.3	128,100	1,595	伊藤忠		40.1	118,485	2,954
武田薬品					三菱商事				
東海旅客鉄道									
三菱UFJフィナンシャルG									

(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
	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
ショーボンド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	62	76	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	MA RUWA	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	フジミインコーポレーテッド	2.3	2.8	5,824
大和組	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
エクシオグループ	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	住友鋁山	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	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%)				石油・石炭製品 (0.8%)				TOWA	—	3.2	5,350
クラレ	12.4	13.9	26,486	出光興産	47.1	48.6	56,157	ローツェ	0.4	5.5	8,692
旭化成	57.3	—	—	ENEOSホールディングス	134.3	176.6	149,739	クボタ	44.7	53.6	103,072
住友化学	62.9	—	—	コスモエネルギーHLDGS	2.5	3.4	23,500	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	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額	銘柄	期首株数	当期末株数	期末評価額
	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快和ホールディ	2.2	3.2	4,006
セガ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	SHI FT	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	—	—	三井松島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	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%)				デジタルガレージ	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
レーザーテック	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	DTS	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	カプコン	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		
	千株	千株	千円		千株	千株	千円		千株	千株	千円		
S C S K	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		
N S D	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		
東京エレクトロデバイス	—	1.1	3,415	丸井グループ	—	7.3	19,929	スタートコーポレーション	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	—	—	ジェイエイシクルートメント	—	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	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	U T グループ	1.1	1.4	3,115		
シッパヘルスケア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		
I D O M	2.4	3.7	4,491	めびきフィナンシャルG	41.3	51.3	38,290	パナー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	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%)				ビー・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	S B I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		
P A L T A C	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	—	—	S O M P O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	M S & A D	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		
アダストリア	—	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	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	合計	株数、金額	8,230.3	13,706.9		
ZOZO	5.7	8.2	36,096	東京センチュリー	6.2	7.6	11,555	銘柄数<比率>	399銘柄	396銘柄	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						
クリエイトSDH	1.3	1.6	4,569	アコム	14.9	24.3	9,654	(注1) 銘柄欄の()内は国内株式の評価総額に対する各					
ネクステージ	2	2.5	4,017	ジャックス	0.9	1.2	4,860	業種の比率。					
コスモス薬品	0.8	2.2	16,412	オリコ	2.7	—	—	(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額					
セブン&アイ・HLDGS	92.6	121.3	272,561	オリックス	50	58.7	189,542	の比率。					
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	(注3) 評価額の単位未満は切捨て。					
フスリのオキHLDGS	2.7	2.9	9,662	日本取引所グループ	21.7	60.8	100,046	(2) 先物取引の銘柄別期末残高 (評価額)					
FOOD&LIFE COMPAN	4.8	5.9	26,508	不動産業 (2.4%)				銘柄別	当	期	末		
ノジマ	2.6	3.6	8,974	大東建託	3.1	3.5	55,037	買	建	額	売	建	額
良品計画	9.8	13.1	53,985	ビュリック	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	国内	百万円	百万円	百万円	百万円	百万円
パンパシフィックHD	18.1	22.2	93,262	プレサンスコーポレーション	1.3	—	—	TOPIX	110	—	—	—	—
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						
VTホールディングス	3.4	—	—	飯田GHHD	8	9.8	22,829						

■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 一 (一)

(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 F r e e 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。

「ＪＰＸ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ＪＰＸ日経インデックス400（本書類における「ＪＰＸ日経インデックス400（配当込み）」をいう。）」（以下、総称して「ＪＰＸ日経400等」という。）は、株式会社ＪＰＸ総研（以下「ＪＰＸ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、ＪＰＸ総研及び日経は、「ＪＰＸ日経400等」自体及び「ＪＰＸ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。ＪＰＸ総研及び日経は、「ＪＰＸ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、ＪＰＸ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。