

ダイワ・ノーロード J P X日経400ファンド

運用報告書（全体版） 第7期

（決算日 2023年3月22日）

（作成対象期間 2022年3月23日～2023年3月22日）

受益者のみなさまへ

毎々、格別のご愛顧にあずかり厚くお礼申し上げます。

当ファンドは、東京証券取引所上場株式に投資し、投資成果をJ P X日経インデックス400の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、運用状況をご報告申し上げます。

今後とも一層のお引立てを賜りますよう、お願い申し上げます。

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～2026年3月19日	
運用方針	投資成果をJ P X日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	ダイワJ P X日経400マザーファンドの受益証券
	ダイワJ P X日経400マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限
	ベビーファンドの株式組入上限比率	
	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 (※ 配当なし)		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			
3期末(2019年3月22日)	円 12,442	円 0	% △ 4.2	11,846	% △ 5.8	% 99.1	% 1.0	百万円 86
4期末(2020年3月23日)	10,198	0	△18.0	9,509	△19.7	97.6	2.4	99
5期末(2021年3月22日)	16,103	0	57.9	14,748	55.1	95.9	0.1	108
6期末(2022年3月22日)	15,960	0	△ 0.9	14,383	△ 2.5	99.0	1.1	211
7期末(2023年3月22日)	16,540	0	3.6	14,578	1.4	97.0	2.3	211

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) J P X日経インデックス400は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注4) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

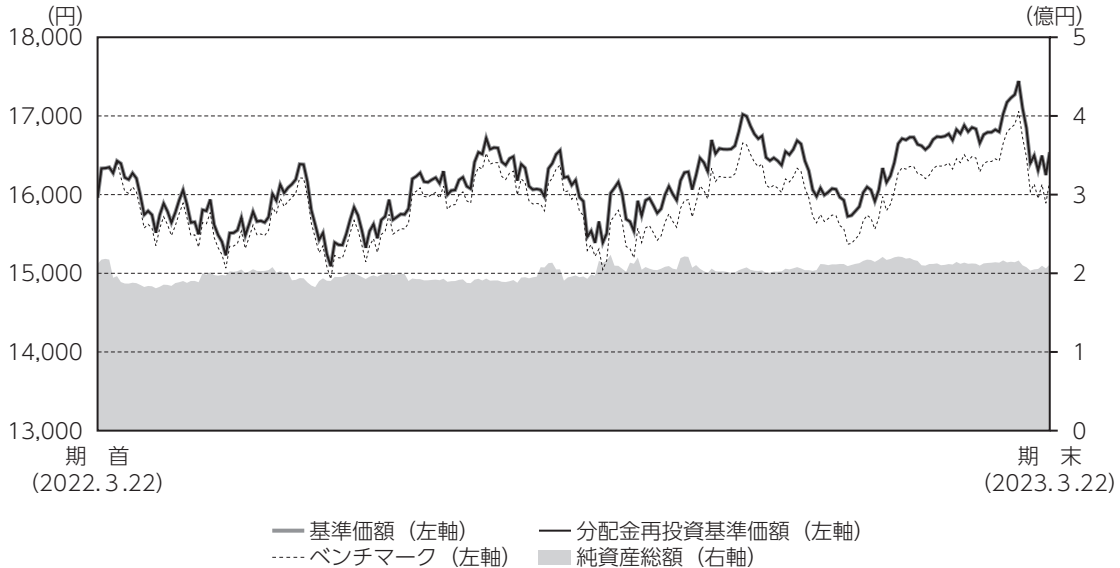
(注5) 株式先物比率は買建比率-売建比率です。

「J P X日経インデックス400」は、株式会社J P X総研（以下「J P X総研」といいます。）および株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P X総研および日経は、「J P X日経インデックス400」自体および「J P X日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。J P X総研および日経は、「J P X日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。本商品は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、J P X総研および日経は、その運用および本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- *分配金再投資基準価額は、分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- *分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- *ベンチマークはJ P X日経インデックス400（※配当なし）です。

■基準価額・騰落率

期首：15,960円

期末：16,540円（分配金0円）

騰落率：3.6%（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、わが国の株式市場は一進一退の展開となりましたが、当作成期を通じて見ると上昇したため、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・ノーロード 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(※配当なし)		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) 2022年 3月22日	円 15,960	% -	14,383	% -	% 99.0	% 1.1
3月末	16,217	1.6	14,456	0.5	98.2	1.6
4月末	15,806	△1.0	14,098	△2.0	98.4	1.6
5月末	15,925	△0.2	14,200	△1.3	98.6	1.6
6月末	15,545	△2.6	13,843	△3.8	97.7	2.3
7月末	16,143	1.1	14,379	△0.0	98.7	1.3
8月末	16,339	2.4	14,557	1.2	98.3	1.3
9月末	15,391	△3.6	13,560	△5.7	96.7	3.1
10月末	16,179	1.4	14,264	△0.8	97.9	2.4
11月末	16,711	4.7	14,738	2.5	97.9	1.9
12月末	15,930	△0.2	14,030	△2.5	97.1	2.8
2023年 1月末	16,638	4.2	14,660	1.9	98.1	1.9
2月末	16,792	5.2	14,798	2.9	98.9	1.1
(期末) 2023年 3月22日	16,540	3.6	14,578	1.4	97.0	2.3

(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

(2022.3.23~2023.3.22)

■国内株式市況

国内株式市況は、おおむね一進一退で推移しました。

国内株式市況は、当作成期首より、ロシアによるウクライナ侵攻の停戦期待から上昇しました。4月に入ると、中国・上海市のロックダウン（都市封鎖）の影響が懸念されて上値の重い展開となりました。5月半ば以降は一時的に反発したものの、6月中旬にはF R B（米国連邦準備制度理事会）が利上げ幅拡大を決定したこともあり下落しました。しかし、6月下旬以降は悪材料出尽くし観測から上昇に転じ、また米国のインフレ率がピークアウトするとの期待感などもあり、8月中旬にかけて上昇が続きしました。その後は、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気されて9月末にかけて下落しましたが、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、11月下旬にかけて上昇しました。12月は、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで株価は下落しましたが、2023年1月は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことなどから上昇しました。2月に入ると、予想を上回る経済指標の発表により欧米の金利が上昇し株価が下落したことが逆風となった一方、日銀総裁人事への不透明感が解消し円安が進んだこともあり、3月上旬にかけて上昇しました。当作成期末にかけては、欧米における金融不安の高まりなどから、株価は大きく下落しました。

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

(2022.3.23~2023.3.22)

■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（※配当なし）

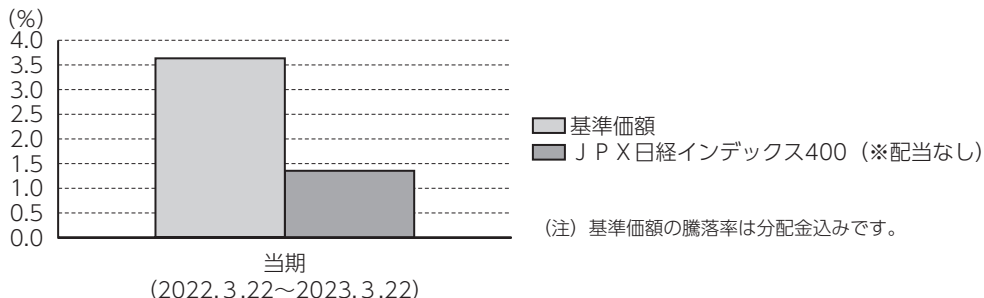
ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は1.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は3.6%となりました。

当ファンドで組み入れを行っているマザーファンドで保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、ベンチマークとかい離しました。

その他、先物取引の影響、運用管理費用等のコストがかい離の要因として挙げられます。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



*ベンチマークはJ P X日経インデックス400 (※配当なし) 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	
	2022年3月23日 ~2023年3月22日	
当期分配金 (税込み) (円)	-	
対基準価額比率 (%)	-	
当期の収益 (円)	-	
当期の収益以外 (円)	-	
翌期繰越分配対象額 (円)	6,540	

(注1) 「当期の収益」は「経費控除後の配当等収益」および「経費控除後の有価証券売却等損益」から分配に充当した金額です。また、「当期の収益以外」は「収益調整金」および「分配準備積立金」から分配に充当した金額です。

(注2) 円未満は切捨てており、当期の収益と当期の収益以外の合計が当期分配金(税込み)に合致しない場合があります。

(注3) 当期分配金の対基準価額比率は当期分配金(税込み)の期末基準価額(分配金込み)に対する比率で、ファンドの収益率とは異なります。

(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 (2022.3.23~2023.3.22)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	91円	0.561%	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16,160円です。
(投 信 会 社)	(44)	(0.275)	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)	(41)	(0.253)	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)	(5)	(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	0	0.001	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成期中の平均受益権口数 売買委託手数料は、有価証券等の売買の際、売買仲介人に支払う手数料
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成期中の平均受益権口数 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	92	0.567	

(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。

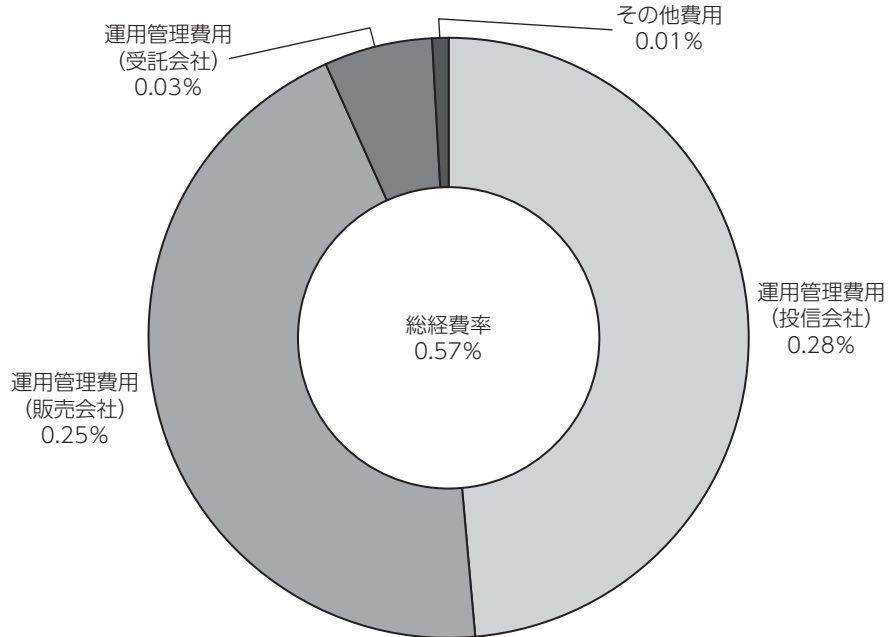
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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0.57%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

(2022年3月23日から2023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	105,540	187,893	110,678	201,566

(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

(2022年3月23日から2023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	6,947,354千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	16,349,931千円
(c) 売買高比率 (a)/(b)	0.42

(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

(2022年3月23日から2023年3月22日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害関係人との取引状況 B	B/A	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	3,711	1,888	50.9	3,235	1,704	52.7
株式先物取引	2,557	-	-	2,370	-	-
コール・ローン	249,010	-	-	-	-	-

(注) 平均保有割合1.2%

※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

(2022年3月23日から2023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
株式	百万円 3	百万円 8	百万円 35

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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、サムティ株式会社です。

■組入資産明細表
親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	評 価 額
	口 数	口 数	
ダイワJ P X日経400マザーファンド	千口 118,899	千口 113,762	千円 211,370

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
ダイワJ P X日経400マザーファンド	千円 211,370	% 99.4
コール・ローン等、その他	1,243	0.6
投資信託財産総額	212,614	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

2023年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	212,614,235円
コール・ローン等	967,440
ダイワJ P X日経400マザーファンド(評価額)	211,370,795
未収入金	276,000
(B) 負債	1,238,232
未払解約金	649,803
未払信託報酬	582,810
その他未払費用	5,619
(C) 純資産総額(A - B)	211,376,003
元本	127,793,917
次期繰越損益金	83,582,086
(D) 受益権総口数	127,793,917口
1万口当り基準価額(C / D)	16,540円

*期首における元本額は132,809,350円、当作成期間中における追加設定元本額は139,166,235円、同解約元本額は144,181,668円です。
*当期末の計算口数当りの純資産額は16,540円です。

■損益の状況

当期 自2022年3月23日 至2023年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 31円
受取利息	8
支払利息	△ 39
(B) 有価証券売買損益	8,123,361
売買益	12,755,109
売買損	△ 4,631,748
(C) 信託報酬等	△ 1,146,159
(D) 当期損益金(A + B + C)	6,977,171
(E) 前期繰越損益金	852,515
(F) 追加信託差損益金	75,752,400
(配当等相当額)	(27,209,448)
(売買損益相当額)	(48,542,952)
(G) 合計(D + E + F)	83,582,086
次期繰越損益金(G)	83,582,086
追加信託差損益金	75,752,400
(配当等相当額)	(27,209,448)
(売買損益相当額)	(48,542,952)
分配準備積立金	7,829,717
繰越損益金	△ 31

(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	6,903,306
(c) 収益調整金	75,752,400
(d) 分配準備積立金	926,411
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	83,582,117
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	83,582,117
(h) 受益権総口数	127,793,917口

ダイワ J P X日経400マザーファンド

運用報告書 第10期 (決算日 2023年3月22日)

(作成対象期間 2022年3月23日～2023年3月22日)

ダイワ J P X日経400マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

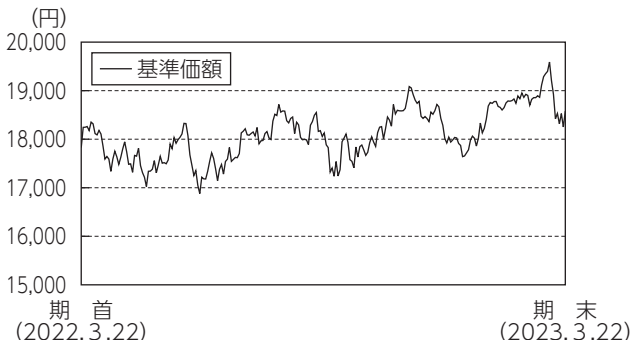
運用方針	投資成果を J P X日経インデックス400の動きに連動させることをめざして運用を行いません。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

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 な し)		株 式 先 入 率	株 式 先 比	株 式 物 率
	騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率	比			
(期首)2022年3月22日	円	%	14,845	%	%	%	%
	17,827	-	14,845	-	99.0	1.1	
3月末	18,116	1.6	14,920	0.5	98.2	1.6	
4月末	17,665	△0.9	14,551	△2.0	98.4	1.6	
5月末	17,807	△0.1	14,656	△1.3	98.6	1.6	
6月末	17,390	△2.5	14,287	△3.8	97.7	2.3	
7月末	18,067	1.3	14,840	△0.0	98.7	1.3	
8月末	18,296	2.6	15,024	1.2	98.3	1.3	
9月末	17,242	△3.3	13,995	△5.7	96.7	3.1	
10月末	18,134	1.7	14,721	△0.8	97.9	2.4	
11月末	18,739	5.1	15,211	2.5	97.9	1.9	
12月末	17,871	0.2	14,480	△2.5	97.2	2.8	
2023年1月末	18,675	4.8	15,131	1.9	98.1	1.9	
2月末	18,856	5.8	15,273	2.9	98.9	1.1	
(期末)2023年3月22日	18,580	4.2	15,046	1.4	97.0	2.3	

- (注1) 騰落率は期首比。
- (注2) J P X日経インデックス400は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
- (注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
- (注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：17,827円 期末：18,580円 騰落率：4.2%

【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、わが国の株式市場は一進一退の展開となりましたが、当作成期を通じて見ると上昇したため、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、おおむね一進一退で推移しました。

国内株式市況は、当作成期首より、ロシアによるウクライナ侵攻

の停戦期待などもあり上昇しました。4月に入ると、中国・上海市のロックダウン（都市封鎖）の影響が懸念されて上値の重い展開となりました。5月半ば以降は一時的に反発したものの、6月中旬にはF R B（米連邦準備制度理事会）が利上げ幅拡大を決定したこともあり下落しました。しかし、6月下旬以降は悪材料出尽くし観測から上昇に転じ、また米国のインフレ率がピークアウトするとの期待感もあり、8月中旬にかけて上昇が続きました。その後は、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気されて9月末にかけて下落しましたが、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、11月下旬にかけて上昇しました。12月は、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで株価は下落しましたが、2023年1月は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことなどから上昇しました。2月に入ると、予想を上回る経済指標の発表により欧米の金利が上昇し株価が下落したことが逆風となった一方、日銀総裁人事への不透明感が解消し円安が進んだこともあり、3月上旬にかけて上昇しました。当作成期末にかけては、欧米における金融不安の高まりなどから、株価は大きく下落しました。

◆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

ベンチマークの騰落率は1.4%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は4.2%となりました。

保有している株式の配当金が計上されたのに対して、ベンチマークは配当分が含まれていないため、ベンチマークとかい離しました。

売買を執行するにあたり、売買コスト等の負担がマイナス要因となりました。

*ベンチマークはJ P X日経インデックス400（※配当なし）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

(2022年3月23日から2023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	1,364.1 (121.84)	3,711,943 (-)	1,150.74	3,235,411

(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

(2022年3月23日から2023年3月22日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新規買付額	決 済 額	新規売付額	決 済 額
国 内	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	2,557	2,370	-	-

(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

(2022年3月23日から2023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
ソフトバンク		144	220,636	1,532	オリエンタルランド		10.1	207,331	20,527
ソフトバンクグループ		25.4	140,636	5,536	日本電信電話		32.4	123,615	3,815
キーエンス		1.8	94,105	52,280	日立		11.3	76,423	6,763
日本製鉄		40.1	89,610	2,234	三菱UFJフィナンシャルG		97.3	74,112	761
日本電信電話		21.6	83,842	3,881	KDDI		17.1	73,376	4,291
リクルートホールディングス		18	78,295	4,349	三菱商事		15.2	65,029	4,278
信越化学		3.6	60,111	16,697	ソニーグループ		4.8	55,682	11,600
第一三共		13.6	56,375	4,145	トヨタ自動車		25.6	54,037	2,110
東京エレクトロン		1	48,281	48,281	ソフトバンクグループ		8.5	50,497	5,940
KDDI		11.3	48,183	4,264	東京エレクトロン		1	48,553	48,553

(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		千株	千株		千円	
水産・農林業 (0.0%)							東レ	60.1	55.8	41,347	科研製薬	1.3	1.4	5,159										
ニッスイ	11.5	11.7	6,341				ゴールドウイン	1.5	1.5	17,010	エーザイ	10.1	10.1	73,881										
鉱業 (0.3%)							バルブ・紙 (0.2%)				ロート製薬	4.4	8.1	21,003										
I N P E X	46.2	43.1	59,133				王子ホールディングス	34.7	34.7	18,217	小野薬品	19.5	16.1	45,015										
建設業 (2.1%)							大王製紙	4	3.7	3,722	参天製薬	15.8	15.7	17,285										
ウエストホールディングス	-	1.1	3,377				レンゴー	7.8	7.6	6,376	J C R ファーマ	2.4	2.8	4,174										
ショーボンドHD	-	1.6	8,448				化学 (7.2%)				東和薬品	1.2	1.3	2,416										
ミライト・ワン	3.7	4	6,528				クラレ	12.1	13.2	15,391	第一三共	66.6	72.7	339,509										
安藤・間	5.7	6.8	5,827				旭化成	55	52	47,106	大塚ホールディングス	17.6	19.1	75,597										
東急建設	3.4	-	-				レゾナック・ホールディング	7.2	-	-	ペプチドリーム	4.4	4	7,292										
コムシスホールディングス	3.7	3.9	9,535				住友化学	61	61.8	26,759	サワイグループHD	1.9	-	-										
東建コーポレーション	0.3	-	-				日産化学	4.5	4	23,720	石油・石炭製品 (0.6%)													
大成建設	7.7	8.1	32,886				東ソー	12	11.1	19,580	出光興産	9.4	9.3	27,053										
大林組	26.6	29.2	29,024				トクヤマ	2.7	2.7	5,599	ENEOSホールディングス	127.5	150.7	69,367										
清水建設	24.9	24.5	18,081				デンカ	3	3	8,160	コスモエネルギーHDGS	2.5	3.3	12,688										
長谷工コーポレーション	7.9	8.4	12,801				信越化学	12.3	13.9	286,479	ゴム製品 (1.0%)													
鹿島建設	19.5	18.1	28,380				エア・ウォーター	7.9	7.9	12,956	横浜ゴム	4.9	4.7	11,750										
西松建設	1.6	1.4	4,774				日本酸素HLDGS	8	8.1	19,067	TOYO TIRE	4.5	4.8	7,022										
三井住友建設	6	-	-				三菱瓦斯化学	7.7	6.2	11,910	ブリヂストン	24.4	26.6	136,990										
戸田建設	11	10	6,930				三井化学	7.5	6.9	22,425	住友ゴム	7.6	8.2	9,216										
熊谷組	1.4	1.4	3,812				三菱ケミカルグループ	55.5	56.2	43,105	ガラス・土石製品 (0.8%)													
五洋建設	10.5	11.6	7,203				KHネオケム	-	1.4	3,157	AGC	7.8	8.5	40,800										
住友林業	6.8	6.3	16,644				ダイセル	12	12.3	11,967	太平洋セメント	4.8	5.3	12,958										
大和ハウス	24.5	22.8	70,497				積水化学	17.4	17	31,603	東海カーボン	7.1	7	8,428										
積水ハウス	28.8	25.6	68,224				日本ゼオン	7.5	5	6,830	TOYO	6.1	5.5	24,557										
関電工	4.3	4.5	4,104				アイカ工業	2.3	2.1	6,384	日本碍子	9.2	9.9	17,265										
エクシオグループ	4	3.8	9,150				UBE	3.9	4.3	8,535	日本特殊陶業	6.4	6.4	17,209										
九電工	2.1	2	6,660				日油	2.8	2.6	15,418	MARUWA	-	0.3	5,253										
インフロンニアHD	11.2	8.5	8,755				花王	18.8	20.3	103,530	ニチアス	2	2.1	5,533										
食料品 (4.0%)							日本ペイントHOLD	31.2	36.9	44,243	鉄鋼 (0.9%)													
森永製菓	2	1.5	5,632				関西ペイント	8.6	7.6	13,300	日本製鉄	-	38.4	115,353										
カルビー	3.9	3.7	10,323				D I C	3.5	-	-	J F Eホールディングス	-	22.9	36,502										
森永乳業	1.6	1.5	7,200				富士フイルムHLDGS	14.9	16	104,480	東京製鐵	-	2.4	3,228										
ヤクルト	6.3	5.9	55,578				資生堂	15.8	17.4	104,382	非鉄金属 (0.7%)													
明治ホールディングス	5.6	5.1	32,640				ライオン	10.2	10	14,580	三井金属	2.3	2.5	7,975										
アサヒグループホールディング	1.1	1.1	2,398				ファンケル	3.4	3.6	8,899	住友鉱山	10.7	10	48,710										
キリンHD	3.3	3.2	12,240				コーセー	1.6	1.7	25,568	DOWAホールディングス	-	1.9	8,046										
宝ホールディングス	20	18.9	89,812				ポーラ・オルビスHD	3.6	-	-	住友電工	31.3	29.6	47,833										
サントリー食品インター	31.3	37	76,904				小林製薬	2.4	2.4	19,272	アサヒHD	3.4	3.5	7,080										
伊藤園	-	5.6	5,824				タカラバイオ	-	2.2	3,836	金属製品 (0.3%)													
キッコーマン	6.1	5.4	34,938				デクセラリアルズ	-	2.4	6,314	SUMCO	12.9	16.3	30,660										
味の素	18.8	20	88,740				日東電工	5.1	6.1	52,277	三和ホールディングス	7.9	7.9	11,036										
キューピー	4.5	4.4	9,644				エフピコ	1.6	1.6	5,096	リンナイ	1.6	1.6	15,552										
カゴメ	3.2	3.8	11,628				ニフコ	2.8	3	10,575	機械 (5.8%)													
アリアケジャパン	0.8	-	-				ユニ・チャーム	16.3	17.4	90,967	日本製鋼所	2.5	-	-										
ニチレイ	3.9	3.8	10,241				医薬品 (7.1%)				三浦工業	3.6	3.5	11,602										
東洋水産	4.1	4.1	22,509				協和キリン	9.9	10.1	28,744	アマダ	13.2	13.4	16,348										
日清食品HD	3.3	2.9	34,191				武田薬品	62.4	64.2	280,233	F U J I	3.9	3.7	8,106										
日本たばこ産業	45.6	53.9	147,820				アステラス製薬	73.5	79.9	149,093	オーエスジー	3.9	-	-										
繊維製品 (0.4%)							住友ファーマ	5.2	6.2	4,960	DMG森精機	5	5.1	10,710										
帝人	7.8	8	10,952				塩野義製薬	10.7	10.7	63,643	ディスコ	1.2	1.3	56,550										
							日本新薬	2.2	2	11,900	オプトラン	1.1	1.2	2,565										
							中外製薬	26.5	26.1	86,756	ナプテスコ	4.8	5.3	16,854										

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
S M C		2.5	2.7			186,570	東京エレクトロン		5.4	5.4			261,198	川崎汽船		-	7.1			22,542
小松製作所		38.4	39.4			126,552	輸送用機器 (5.5%)							倉庫・運輸関連業 (0.0%)		-				
住友重機械		4.9	5			15,425	トヨタ紡織		3.5	3.5			7,080	三井倉庫H O L D		-	0.8			3,116
日立建機		3.4	3.3			9,771	豊田自動織機		6.9	6.1			43,249	近鉄エクスプレス		1.5	-			-
ローツエ		-	0.4			4,628	デンソー		18.7	17.2			122,206	情報・通信業 (9.2%)						
クボタ		41.1	44.5			87,197	いすゞ自動車		26.6	24.2			38,163	NEC ネットエスアイ		2.8	2.8			4,494
荏原製作所		3.4	3.4			19,720	トヨタ自動車		126.5	124.4			224,044	システナ		11.9	14			4,186
ダイキン工業		10.8	10			230,000	日野自動車		10.6	-			-	日鉄ソリューションズ		1.2	1.4			4,928
ダイワフ		4.7	4.3			30,874	アイシン		6.2	6.4			22,496	T I S		7.9	9.4			32,571
竹内製作所		1.3	1.5			4,257	本田技研		66.7	67.6			230,178	コーエーテックモHD		2.7	5.2			12,745
ホシザキ		2.5	5.4			25,380	スズキ		19.4	15.3			69,982	ネクソン		18.8	21.6			64,368
日本精工		16	-			-	S U B A R U		24.3	26.3			54,085	ティーガイア		0.7	0.9			1,495
マキタ		10.3	10.5			34,440	ヤマハ発動機		11.1	13.1			41,854	ガホー・オンライン・エンター		2.2	2.6			6,497
三菱重工業		13.3	14.7			66,870	豊田合成		2.7	2.4			5,100	GMOペイメントゲートウェイ		1.6	1.9			22,401
I H I		5.3	5.3			16,774	シマノ		3.4	3.4			73,542	インターネットインシアティブ		-	4.7			12,473
電気機器 (17.7%)							テイ・エス・テック		3.6	3.8			6,140	ラクス		3.8	3.9			7,371
イビデン		-	4.8			23,256	精密機器 (3.1%)							アカツキ		0.4	-			-
ブラザー工業		10.4	11.2			21,806	テルモ		24	25.6			92,416	チェンジ		-	2			4,858
ミネベアミツミ		14.6	14.6			35,083	島津製作所		10.9	10.1			42,218	野村総合研究所		16.1	17.1			51,556
日立		38.6	34.4			236,396	ブイ・テックノロジー		0.4	-			-	インフocom		0.9	1.1			2,524
三菱電機		84.8	86.8			132,890	東京精密		1.4	1.8			9,036	オービック		2.6	2.8			57,652
富士電機		5.1	5.1			25,602	オリンパス		44.5	52			117,910	ジャストシステム		1.2	1.2			4,038
安川電機		9.1	10			56,200	H O Y A		16.5	17.8			249,912	Zホールディングス		120.9	118.7			44,939
日本電産		20.5	20.4			138,801	朝日インテック		9.3	9.3			21,241	トレンドマイクロ		4.4	4.8			30,672
オムロン		7.1	7.7			57,965	その他製品 (1.9%)							日本オラクル		1.4	1.6			14,256
MC J		2.9	3.5			3,297	バンダイナムコH L D G S		7.6	7.6			63,710	伊藤忠テクノソリューションズ		3.8	4.5			14,535
日本電気		10.8	11.9			58,964	パイロットコーポレーション		1.4	1.3			5,239	大塚商会		4.5	4.7			21,361
富士通		7.6	8.4			152,418	ヤマハ		4.9	5.2			25,766	電通国際情報S		1.2	1			4,995
ルネサスエレクトロニクス		46	54.8			99,736	ビジョン		5.1	5.3			10,812	東映アニメーション		0.3	0.4			4,940
セイコーエプソン		10.5	11.2			21,078	任天堂		3.7	41.3			209,804	デジタルガレージ		1.4	1.5			6,352
ワコム		6.6	6.7			4,609	電気・ガス業 (1.2%)							ネットワンシステムズ		-	3.1			9,253
アルパック		1.7	2			10,840	中部電力		25.9	30.7			42,673	B I P R O G Y		2.6	3.1			9,982
エレコム		1.9	2			2,548	関西電力		32.1	32.1			40,349	USEN-NEXT H L D G S		0.8	0.7			1,728
パナソニック ホールディング		90.4	99.2			114,625	中国電力		13.2	-			-	日本電信電話		75.9	65.1			263,264
シャープ		-	10.1			9,473	東北電力		19.9	-			-	K D D I		60.6	54.8			225,173
アンリツ		5.5	5.9			7,198	九州電力		17.5	19.2			13,881	ソフトバンク		-	134			208,370
ソニーグループ		22.7	22.1			259,233	北海道電力		7.4	8			3,752	光通信		1	1			18,530
T D K		12.3	13.3			62,111	電源開発		7.2	6.3			13,160	GMOインターネットグループ		-	3.1			8,022
横河電機		8.5	9.2			18,970	イーレックス		1.2	1.5			2,796	東宝		4.9	5.2			25,714
アズビル		5	5.8			20,097	レノバ		1.7	2.2			4,468	N T T データ		22.1	26.2			44,802
日本光電工業		3.5	3.8			13,737	東京瓦斯		16.2	17.6			43,912	D T S		-	1.8			5,670
堀場製作所		1.6	1.9			14,421	大阪瓦斯		15.4	16.8			37,480	スウェア・エニックス・HD		3.9	4.2			26,460
アドバンテスト		6.3	6.6			78,408	陸運業 (1.2%)							カブコン		7.8	8.3			38,885
キーエンス		4	5.2			326,352	S B S ホールディングス		-	0.7			2,254	S C S K		5.8	6.8			13,171
シスメックス		7.2	7.2			62,143	東海旅客鉄道		7	6.4			98,784	N S D		-	3			7,140
フェーテックH L D G S		-	2.5			7,875	阪急阪神H L D G S		10	-			-	コナミグループ		3	3.6			22,896
レーザーテック		3.7	3.8			83,296	ヤマトホールディングス		11.2	10.6			23,500	ソフトバンクグループ		23.9	40.8			203,469
スタンレー電気		5.9	-			-	山丸		2.1	2.1			10,143	卸売業 (7.0%)						
カシオ		6.1	6.2			7,948	センコーグループH L D G S		4	4.4			4,109	双日		9.2	9.3			23,975
ファナック		7.4	8.2			190,568	日立物流		1.5	-			-	アルフラッサホールディングス		9.3	8.8			14,784
浜松ホトニクス		6.1	6.7			46,297	A Z - C O M 株式会社ホールディ		1.7	2			3,934	神戸物産		6.5	6.8			24,888
新光電気工業		-	2.9			10,744	九州旅客鉄道		6.2	-			-	ダイワボウHD		4.1	3.6			7,531
京セラ		11.9	12.9			88,145	S G ホールディングス		15.2	15.9			30,353	T O K A I ホールディングス		4	4.3			3,736
太陽誘電		4.1	4.1			17,548	N I P P O N E X P R E S S		2.8	3.1			23,560	シップヘルスケアHD		2.7	3.2			7,766
村田製作所		24.9	25.2			198,500	海運業 (0.9%)							コマダホールディングス		1.8	-			-
小糸製作所		4.7	10			22,540	日本郵船		6.7	22.2			72,882	メディアバルHD		9	9.1			16,389
S C R E E N ホールディングス		1.5	1.4			15,526	商船三井		4.4	14.6			50,881	日本ライフライン		2.5	-			-

銘柄	期首			期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
伊藤忠	58.4	54.2	225,526			
丸紅	82.4	69.5	120,026			
豊田通商	8.4	7.7	40,733			
兼松	3.1	3.4	5,368			
三井物産	64.8	64.4	244,462			
住友商事	52.7	54.5	123,224			
三菱商事	62.6	55	256,465			
阪和興業	—	1.6	5,888			
岩谷産業	2	2	11,140			
PAL TAC	1.2	1.4	6,685			
日鉄物産	0.6	0.6	5,568			
ミスミグループ本社	10.5	13.3	42,892			
小売業 (4.1%)						
ローソン	1.8	2.2	11,968			
エービーシー・マート	1.3	1.3	9,165			
日本マクドナルドHLDG	3.8	5	26,850			
セリア	2	2.4	6,175			
ビックカメラ	5	—	—			
MonotaRO	10.6	12.5	20,937			
マツコココカラ&カンパー	3.8	5.3	36,040			
ZOZO	5.7	5.8	17,777			
ウエルシアHD	4.4	4.6	12,962			
クリエイトSDH	1.2	1.5	5,017			
ネクステージ	—	2	5,518			
コスモス薬品	0.8	0.9	10,611			
セブン&アイ・HLDGS	32.7	30.3	174,952			
ツルハホールディングス	1.8	1.8	15,354			
クサりのアオキHLDGS	0.8	0.8	5,328			
FOOD&LIFE COMPAN	4.9	5.1	17,901			
ノジマ	1.3	2.9	3,975			
良品計画	9.6	11.4	16,062			
コーナン商事	1.2	1.2	3,780			
パンパシフィックHD	16.7	17.8	43,894			
ゼンショーホールディングス	4.1	4.8	19,296			
ワークマン	1.1	1	5,540			
スギホールディングス	1.7	1.8	10,098			
日本瓦斯	—	4.7	9,009			
ライフコーポレーション	0.8	0.8	2,014			
丸井グループ	6.6	6.5	13,084			
イズミ	1.5	1.3	3,965			
ヤオコー	0.9	1	6,770			
ケースホールディングス	7.7	7	8,302			
アインホールディングス	1.1	—	—			
ニトリホールディングス	3.3	3.6	58,788			
ファーストリテイリング	1.1	4	111,480			
サンドラッグ	3.1	3.3	11,715			
銀行業 (6.1%)						
めがきフィナンシャルG	43.4	40.7	13,146			
コンソリア・フィナンシャル	47.8	45.2	21,967			
SBI新生銀行	5.5	2.4	5,517			
あおぞら銀行	4.7	5.2	12,443			
三菱UFJフィナンシャルG	375.2	322.1	274,042			
りそなホールディングス	94.8	103.5	64,190			
三井住友トラストHD	15.8	14.9	68,644			
三井住友フィナンシャルG	57.9	59.9	315,972			
千葉銀行	27.9	22.8	19,494			
ひくおかフィナンシャルG	7	6.5	16,568			

銘柄	期首			期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
セブン銀行	24.8	29.3	7,735			
みずほフィナンシャルG	107.6	118.5	221,239			
証券・商品先物取引業 (0.7%)						
F P G	2.8	—	—			
GMOフィナンシャルHLDGS	1.6	1.8	1,026			
SBIホールディングス	10.3	—	—			
ジャフコグループ	3.2	2.7	5,570			
大和証券G本社	61.6	58.2	35,502			
野村ホールディングス	127.7	150.9	75,963			
マネックスG	—	9.2	4,572			
保険業 (2.9%)						
SOMP Oホールディングス	13.7	14.1	76,097			
MS & AD	18.7	16.7	69,956			
第一生命HLDGS	41.2	41.7	100,559			
東京海上HD	27.5	82.5	214,293			
T&Dホールディングス	21.7	22	35,244			
その他金融業 (1.3%)						
全国保証	2	2.1	11,067			
芙蓉総合リース	0.9	0.8	7,080			
みずほリース	1.3	1.2	4,152			
東京センチュリー	1.6	1.5	6,600			
イオンフィナンシャルサービス	4.5	4.7	5,687			
アコム	16.5	14.6	4,628			
オリコ	22.6	2.1	2,339			
オリックス	49.7	53.8	118,171			
三菱HCキャピタル	30.9	31.9	21,819			
日本取引所グループ	21.2	23	46,678			
不動産業 (2.1%)						
大東建託	2.7	3	38,220			
いちご	9.3	—	—			
ヒューリック	20	19.1	19,959			
野村不動産HLDGS	4.3	5.1	14,677			
サムティ	1.3	—	—			
プレサンスコーポレーション	1.1	1.1	1,831			
オープンハウスグループ	2.7	3	14,670			
東急不動産HD	24.6	24.6	15,473			
飯田GHD	7	7.2	15,350			
ケイアイスター不動産	—	0.4	1,668			
三井不動産	38.1	35.6	85,297			
三菱地所	54.9	49.4	77,805			
東京建物	8.3	7.8	12,160			
住友不動産	17.5	14.8	43,371			
スターツコーポレーション	1.1	1.2	2,944			
日本エスコン	1.6	1.8	1,459			
イオンモール	4.2	4.2	7,140			
カチタス	2.1	2.2	5,651			
サービス業 (3.4%)						
MIXI	1.9	—	—			
日本M&Aセンターホルデ	13.3	—	—			
UTグループ	1.2	1.3	3,012			
エス・エム・エス	2.8	3.3	10,411			
パーソルホールディングス	8.1	9.6	24,960			
総合警備保障	3.2	3.2	11,360			
カカココム	5.9	6.3	11,535			
ディップ	1.4	1.5	5,107			
ベネフィット・ワン	2.9	4	7,928			
エムスリー	14.3	16.9	57,307			

銘柄	期首			期末		
	株数	株数	評価額	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円			
アウトソーシング	4.6	—	—			
博報堂DYHLDGS	11.3	10.9	15,946			
バリューコマース	—	0.6	1,020			
HUグループHD	—	2.5	6,700			
オリエンタルランド	9.6	—	—			
ビー・エム・エル	—	1.1	3,426			
ユー・エス・エス	9.1	8.8	19,826			
サイバーエージェント	—	20.5	23,554			
フルキャストホールディングス	0.7	0.8	1,858			
エン・ジャパン	1.3	1.5	3,528			
テクノプロ・ホールディング	4.9	5.1	17,697			
アイ・アールジャパンHD	0.4	—	—			
ジャパンマテリアル	2.5	2.6	5,954			
リクルートホールディングス	48.4	60.4	210,977			
ペルシステム24HLDGS	1.2	1.1	1,547			
ペイカレントコンサルティング	0.6	6.8	36,652			
ジャパンエレベーターズHD	2.6	3	5,667			
リログループ	4.4	4.8	10,032			
カナモト	1.4	—	—			
トランス・コスモス	—	1.1	3,382			
セコム	8	8.7	70,470			
メイテック	1	3.4	7,850			
イオンディライト	1	0.9	2,645			
合計	株数・金額	株数	千円	株数	株数	千円
	銘柄数<比率>	399銘柄	5,676.4	399銘柄	6,011.6	17,019.506
			<97.0%>			

(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	買 建 額	売 建 額
国内	TOPIX	百万円	百万円	百万円
		407	—	—

(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 184,500 (400)	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400株を貸付けています。

■投資信託財産の構成

2023年3月22日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 17,019,506	% 93.8
コール・ローン等、その他	1,118,743	6.2
投資信託財産総額	18,138,250	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

2023年3月22日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	18,324,282,441円
コール・ローン等	1,070,477,159
株式(評価額)	17,019,506,320
未収入金	1,653,450
未収配当金	26,812,800
未収利息	45,124
その他未収収益	6,187,588
差入委託証拠金	199,600,000
(B) 負債	783,902,465
未払金	3,284,400
未払解約金	276,000
差入委託証拠金代用有価証券	188,840,000
受入担保金	591,502,065
(C) 純資産総額(A - B)	17,540,379,976
元本	9,440,541,060
次期繰越損益金	8,099,838,916
(D) 受益権総口数	9,440,541,060口
1万口当り基準価額(C/D)	18,580円

* 期首における元本額は9,207,900,732円、当作成期間中における追加設定元本額は2,760,006,299円、同解約元本額は2,527,365,971円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：
 ダイワ J P X 日経400ファンド (米ドル投資型) 262,577,614円
 i F r e e J P X 日経400インデックス 1,857,672,252円
 ダイワ・ノーロード J P X 日経400ファンド 113,762,538円
 ダイワ J P X 日経400ファンド 4,967,810,049円
 ダイワ・インデックスセレクト J P X 日経400 2,238,718,607円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は18,580円です。

■損益の状況

当期 自2022年3月23日 至2023年3月22日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	448,400,910円
受取配当金	429,569,002
受取利息	849,730
その他収益金	18,324,980
支払利息	△ 342,802
(B) 有価証券売買損益	295,699,851
売買益	1,278,480,217
売買損	△ 982,780,366
(C) 先物取引等損益	47,395,300
取引益	59,241,050
取引損	△ 11,845,750
(D) 当期損益金(A + B + C)	791,496,061
(E) 前期繰越損益金	7,207,194,736
(F) 解約差損益金	△2,111,207,892
(G) 追加信託差損益金	2,212,356,011
(H) 合計(D + E + F + G)	8,099,838,916
次期繰越損益金(H)	8,099,838,916

(注1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

「J P X 日経インデックス400」は、株式会社 J P X 総研（以下「J P X 総研」といいます。）および株式会社日本経済新聞社（以下「日経」といいます。）によって独自に開発された手法によって算出される著作物であり、J P X 総研および日経は、「J P X 日経インデックス400」自体および「J P X 日経インデックス400」を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。J P X 総研および日経は、「J P X 日経インデックス400」を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。本商品は、投資信託委託業者等の責任のもとで運用されるものであり、J P X 総研および日経は、その運用および本商品の取引に関して、一切の責任を負いません。