

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（2017年6月12日設定） |
| 運用方針 | J P X 日経中小型インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）に投資を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への実質投資割合（信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合）は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 |
| 主要運用対象 | ベビーファンド J P X 日経中小型インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。 |
| | マザーファンド わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビーファンド 株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |
| | マザーファンド 株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |
| 分配方針 | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。 分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。） |

運用報告書（全体版）

MAXIS
イーマクシス

e MAXIS
J P X 日経中小型インデックス



第8期（決算日：2025年1月27日）



受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。

さて、お手持ちの「e MAXIS J P X 日経中小型インデックス」は、去る1月27日に第8期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。

今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。

MUFG

三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル

0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様のお取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

e MAXIS 専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

本資料の表記にあたって

- 原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- 一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | | J P X 日経中小型株指数 (配当込み) | 株式比率 組入比率 | 株式比率 先物比率 | 純資産額 百万円 |
|----------------|-------------|----|--------|----------|--------------------------|--------------|--------------|--------------|
| | 税分 | 込配 | み金 | 期騰落率 | | | | |
| 4期(2021年1月26日) | 円 12,607 | | 円 0 | % 8.9 | 16,864.38 | 8.8 | 97.1 | 2.9 641 |
| 5期(2022年1月26日) | 12,776 | | 0 | 1.3 | 17,078.78 | 1.3 | 95.9 | 4.1 466 |
| 6期(2023年1月26日) | 13,734 | | 0 | 7.5 | 18,418.44 | 7.8 | 96.0 | 4.0 497 |
| 7期(2024年1月26日) | 16,142 | | 0 | 17.5 | 21,630.77 | 17.4 | 98.8 | 1.1 817 |
| 8期(2025年1月27日) | 17,991 | | 0 | 11.5 | 24,166.98 | 11.7 | 99.1 | 0.8 1,197 |

(注) J P X 日経中小型株指数(配当込み)とは、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社 J P X 総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則200銘柄で構成される株価指数です。「J P X 日経中小型株指数(配当込み)」(以下「J P X 日経中小型株指数」といいます。)は、株式会社 J P X 総研(以下「J P X 総研」といいます。)及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 総研及び日経は、「J P X 日経中小型株指数」自体及び「J P X 日経中小型株指数」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 日経中小型株指数」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全て J P X 総研、株式会社日本取引所グループ及び日経に帰属しています。ファンドは、委託会社の責任のもので運用されるものであり、J P X 総研及び日経は、その運用及びファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。J P X 総研及び日経は、「J P X 日経中小型株指数」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、責任を負いません。J P X 総研及び日経は、「J P X 日経中小型株指数」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X 日経中小型株指数」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率-売建比率。

○当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 中 小 型 株 指 数 | | 株組入比率 | 式 物 比 率 |
|---------------------|----------|------|-----------------------|---------|--------|---------|
| | 騰 落 | 率 % | (配当込み) | 騰 落 率 % | | |
| (期 首) 2024年1月26日 | 円 16,142 | % — | 21,630.77 | % — | % 98.8 | % 1.1 |
| 1月末 | 16,361 | 1.4 | 21,920.81 | 1.3 | 99.1 | 0.8 |
| 2月末 | 17,140 | 6.2 | 22,979.44 | 6.2 | 98.9 | 1.0 |
| 3月末 | 17,966 | 11.3 | 24,105.50 | 11.4 | 98.1 | 1.9 |
| 4月末 | 17,370 | 7.6 | 23,275.89 | 7.6 | 98.4 | 1.6 |
| 5月末 | 17,562 | 8.8 | 23,542.66 | 8.8 | 98.6 | 1.4 |
| 6月末 | 18,116 | 12.2 | 24,290.07 | 12.3 | 98.8 | 1.2 |
| 7月末 | 17,812 | 10.3 | 23,879.85 | 10.4 | 99.3 | 0.7 |
| 8月末 | 17,454 | 8.1 | 23,407.82 | 8.2 | 99.1 | 0.9 |
| 9月末 | 17,609 | 9.1 | 23,632.08 | 9.3 | 98.6 | 1.4 |
| 10月末 | 17,535 | 8.6 | 23,531.74 | 8.8 | 98.5 | 1.5 |
| 11月末 | 17,851 | 10.6 | 23,966.06 | 10.8 | 98.6 | 1.5 |
| 12月末 | 18,301 | 13.4 | 24,577.38 | 13.6 | 98.8 | 1.3 |
| (期 末) 2025年1月27日 | 17,991 | 11.5 | 24,166.98 | 11.7 | 99.1 | 0.8 |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第8期：2024年1月27日～2025年1月27日

〉当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------|---------|
| 第8期首 | 16,142円 |
| 第8期末 | 17,991円 |
| 既払分配金 | 0円 |
| 騰落率 | 11.5% |

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（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、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ11.5%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（11.7%）を0.2%下回りました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

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た結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第8期：2024年1月27日～2025年1月27日

〉投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

好調な企業業績や外国為替市場で円安・
米ドル高が進行したこと等を背景に、國
内株式市況は上昇しました。

〉当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS JPY日経中小型 インデックス

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資
したことにより、基準価額はマザーファ
ンドとほぼ同様の推移となりました。

▶ JPY日経中小型インデックス マザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に
投資しました。
株式ポートフォリオはベンチマークであ
るJPY日経中小型株指数（配当込み）
の個別銘柄構成比率に合わせて構築しま
した。

〉当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ▶ eMAXIS JPX日経中小型インデックス
ベンチマークとのカイ離は△0.2%程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.3%程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は0.1%程度でした。

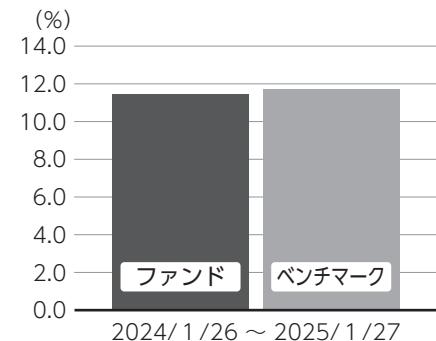
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

※留保金等が含まれます。

主なマイナス要因：取引要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）と ベンチマークの対比（騰落率）



》分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきました。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項目 | 第8期 2024年1月27日～2025年1月27日 |
|----------------|------------------------------|
| 当期分配金（対基準価額比率） | — (ー%) |
| 当期の収益 | — |
| 当期の収益以外 | — |
| 翌期繰越分配対象額 | 7,991 |

(注) 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）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針

(作成対象期間末での見解です。)

► eMAXIS JPY日経中小型インデックス
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

► JPY日経中小型インデックス
マザーファンド
ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2024年1月27日～2025年1月27日

〉1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|------------|-------|---------|--|
| | 金額(円) | 比率(%) | |
| (a)信託報酬 | 77 | 0.441 | (a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率×(期中の日数÷年間日数) |
| (投信会社) | (34) | (0.193) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 |
| (販売会社) | (34) | (0.193) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受託会社) | (10) | (0.055) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b)売買委託手数料 | 1 | 0.006 | (b)売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (株式) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (1) | (0.006) | |
| (c)その他費用 | 0 | 0.003 | (c)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 |
| (監査費用) | (0) | (0.003) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| 合計 | 78 | 0.450 | |

期中の平均基準価額は、17,426円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

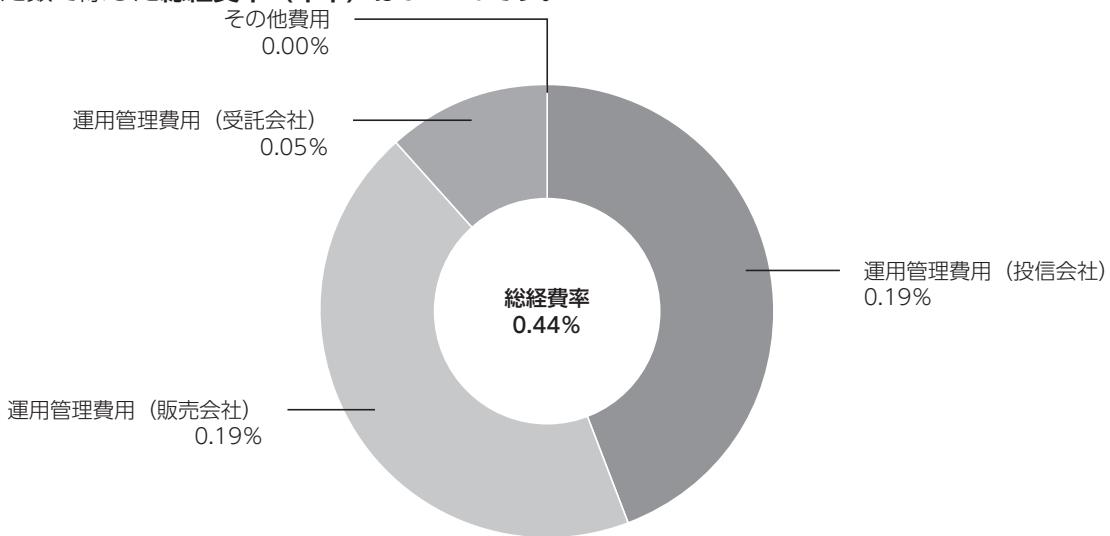
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.44%です。**



(注) 費用は、1万口当た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) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2024年1月27日～2025年1月27日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設定 | | 解約 | |
|-----------------------|---------------|---------------|---------------|---------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| JPX日経中小型インデックスマザーファンド | 千口 330,324 | 千円 581,078 | 千口 177,301 | 千円 318,881 |

○株式売買比率

(2024年1月27日～2025年1月27日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 |
|---------------------|-----------------------|
| | JPX日経中小型インデックスマザーファンド |
| (a) 期中の株式売買金額 | 1,472,523千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,083,876千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.35 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2024年1月27日～2025年1月27日)

利害関係人との取引状況

<e MAXIS JPX日経中小型インデックス>

該当事項はございません。

<JPX日経中小型インデックスマザーファンド>

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | 売付額等 C | | うち利害関係人 との取引状況D | D C |
|----|------------|--------------------|-----------|------------|--------------------|----------|
| | | | B A | % | | |
| 株式 | 百万円 883 | 百万円 82 | % 9.3 | 百万円 588 | 百万円 43 | % 7.3 |

平均保有割合 100.0%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

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、当ファンドに係る利害関係人とはモルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2025年1月27日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------------|---------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| JPX日経中小型インデックスマザーファンド | 千口 494,679 | 千口 647,702 | 千円 1,197,278 |

○投資信託財産の構成

(2025年1月27日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|-----------------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| JPX日経中小型インデックスマザーファンド | 千円 1,197,278 | % 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 4,997 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 1,202,275 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年1月27日現在)

| 項目 | 当期末 |
|----------------------------|---------------|
| (A) 資産 | 円 |
| コール・ローン等 | 1,202,275,341 |
| JPX日経中小型インデックスマザーファンド(評価額) | 4,401,576 |
| 未収入金 | 1,197,278,838 |
| 未収利息 | 594,872 |
| 未利回り | 55 |
| (B) 負債 | 4,877,862 |
| 未払解約金 | 2,297,313 |
| 未払信託報酬 | 2,563,944 |
| その他未払費用 | 16,605 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,197,397,479 |
| 元本 | 665,537,753 |
| 次期繰越損益金 | 531,859,726 |
| (D) 受益権総口数 | 665,537,753口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,991円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 506,595,106円
 期中追加設定元本額 565,686,099円
 期中一部解約元本額 406,743,452円
 また、1口当たり純資産額は、期末1,7991円です。

②分配金の計算過程

| 項目 | 目 | 2024年1月27日～ 2025年1月27日 |
|---------------------------|---|---------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | | 28,430,435円 |
| 費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額 | | 51,097,155円 |
| 収益調整金額 | | 404,505,270円 |
| 分配準備積立金額 | | 47,826,866円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | | 531,859,726円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | | 7,991円 |
| 1万口当たり分配金額 | | 一円 |
| 収益分配金額 | | 一円 |

*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

[お知らせ]

東京証券取引所の取引時間の延伸に伴い、申込締切時間の変更を行いました。詳細は、当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/>) から当該ファンドページの目論見書をご覧ください。
 (2024年11月5日)

○損益の状況 (2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目 | 当期 |
|------------------|----------------|
| (A) 配当等収益 | 円 |
| 受取利息 | 5,181 |
| 支払利息 | 5,201 |
| △ | 20 |
| (B) 有価証券売買損益 | 84,386,918 |
| 売買益 | 117,851,717 |
| 売買損 | △ 33,464,799 |
| (C) 信託報酬等 | △ 4,864,509 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 79,527,590 |
| (E) 前期繰越損益金 | 47,826,866 |
| (F) 追加信託差損益金 | 404,505,270 |
| (配当等相当額) | (340,408,277) |
| (売買損益相当額) | (64,096,993) |
| (G) 計(D+E+F) | 531,859,726 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 531,859,726 |
| 追加信託差損益金 | 404,505,270 |
| (配当等相当額) | (342,684,319) |
| (売買損益相当額) | (61,820,951) |
| 分配準備積立金 | 127,354,456 |

(注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (C) 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います。

(注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

JPX日経中小型インデックスマザーファンド

《第8期》決算日2025年1月27日

[計算期間：2024年1月27日～2025年1月27日]

「JPX日経中小型インデックスマザーファンド」は、1月27日に第8期の決算を行いました。

以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第8期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 主としてわが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）に投資を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 |
| 主要運用対象 | わが国の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | JPX日経中小型株指数 | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|----------------|----------|-------------|----|-------------|--------|--------------------|
| | | 期騰落 | 中率 | | | |
| 4期(2021年1月26日) | 円 12,780 | % 9.2 | % | % 16,864.38 | % 8.8 | % 97.1 2.9 641 百万円 |
| 5期(2022年1月26日) | 12,994 | 1.7 | | 17,078.78 | 1.3 | 95.9 4.1 466 |
| 6期(2023年1月26日) | 14,019 | 7.9 | | 18,418.44 | 7.8 | 96.0 4.0 497 |
| 7期(2024年1月26日) | 16,529 | 17.9 | | 21,630.77 | 17.4 | 98.8 1.1 817 |
| 8期(2025年1月27日) | 18,485 | 11.8 | | 24,166.98 | 11.7 | 99.1 0.8 1,197 |

(注) JPX日経中小型株指数（配当込み）とは、東京証券取引所のプライム市場、スタンダード市場、グロース市場を主市場とする普通株式等のうち、時価総額、売買代金、ROE等を基に、株式会社JPX総研及び株式会社日本経済新聞社が選定した、原則200銘柄で構成される株価指数です。「JPX日経中小型株指数（配当込み）」（以下「JPX日経中小型株指数」といいます。）は、株式会社JPX総研（以下「JPX総研」といいます。）及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、JPX総研及び日経は、「JPX日経中小型株指数」自体及び「JPX日経中小型株指数」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。「JPX日経中小型株指数」を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、全てJPX総研、株式会社日本取引所グループ及び日経に帰属しています。ファンドは、委託会社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、その運用及びファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。JPX総研及び日経は、「JPX日経中小型株指数」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、責任を負いません。JPX総研及び日経は、「JPX日経中小型株指数」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経中小型株指数」の内容を変える権利及び公表を停止する権利を有しています。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | JPX日経中小型株指数 | | 株組入比率 | 式 物 比 率 |
|---------------------|----------|-------------|-----------|-------|----------|
| | | 騰 落 率 | (配当込み) | | |
| (期 首) 2024年1月26日 | 円 16,529 | % — | 21,630.77 | % — | % 98.8 |
| 1月末 | 16,754 | 1.4 | 21,920.81 | 1.3 | 99.2 0.8 |
| 2月末 | 17,557 | 6.2 | 22,979.44 | 6.2 | 98.9 1.0 |
| 3月末 | 18,406 | 11.4 | 24,105.50 | 11.4 | 98.1 1.9 |
| 4月末 | 17,801 | 7.7 | 23,275.89 | 7.6 | 98.4 1.6 |
| 5月末 | 18,003 | 8.9 | 23,542.66 | 8.8 | 98.6 1.4 |
| 6月末 | 18,576 | 12.4 | 24,290.07 | 12.3 | 98.8 1.2 |
| 7月末 | 18,270 | 10.5 | 23,879.85 | 10.4 | 99.3 0.7 |
| 8月末 | 17,906 | 8.3 | 23,407.82 | 8.2 | 99.1 0.9 |
| 9月末 | 18,071 | 9.3 | 23,632.08 | 9.3 | 98.6 1.4 |
| 10月末 | 18,000 | 8.9 | 23,531.74 | 8.8 | 98.5 1.5 |
| 11月末 | 18,330 | 10.9 | 23,966.06 | 10.8 | 98.6 1.5 |
| 12月末 | 18,798 | 13.7 | 24,577.38 | 13.6 | 98.8 1.3 |
| (期 末) 2025年1月27日 | 18,485 | 11.8 | 24,166.98 | 11.7 | 99.1 0.8 |

(注) 謄落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ11.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(11.7%)を0.1%上回りました。



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

●基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

- ・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た結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

●投資環境について

◎国内株式市況

- ・国内株式市況は上昇しました。
- ・好調な企業業績や外国為替市場で円安・米ドル高が進行したこと等を背景に、国内株式市況は上昇しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・株式ポートフォリオはベンチマークであるJPX日経中小型株指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について
ベンチマークは11.7%の上昇になったため、カイ離は0.1%程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・その他の要因※によるものです。
※留保金等が含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・取引要因によるものです。

○今後の運用方針

- ・ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-----------------------------------|----------------------|----------------------------------|--|
| | 金額 | 比率 | |
| (a) 売買委託手数料 (株式) (先物・オプション) | 円 1 (0) (1) | % 0.006 (0.000) (0.006) | (a)売買委託手数料=期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| 合計 | 1 | 0.006 | |
| 期中の平均基準価額は、17,873円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入しております。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入しております。

○売買及び取引の状況

(2024年1月27日～2025年1月27日)

株式

| 国内 | 上場 | 買付 | | 売付 | |
|----|----|--------------------|-----------------------|-----------|---------------|
| | | 株数 | 金額 | 株数 | 金額 |
| | | 千株 525 (34) | 千円 883,621 (-) | 千株 317 | 千円 588,902 |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および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。

先物取引の種類別取引状況

| 国内 | 種類別 | 買建 | | 売建 | |
|----|--------|------------|------------|-----------|-----------|
| | | 新規買付額 | 決済額 | 新規売付額 | 決済額 |
| | 株式先物取引 | 百万円 696 | 百万円 698 | 百万円 76 | 百万円 76 |

○株式売買比率

(2024年1月27日～2025年1月27日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 |
|---------------------|-------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 1,472,523千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 1,083,876千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 1.35 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2024年1月27日～2025年1月27日)

利害関係人との取引状況

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|----|------------|--------------------|---------------|------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 株式 | 百万円 883 | 百万円 82 | 9.3 | 百万円 588 | 百万円 43 | 7.3 |

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、当ファンドに係る利害関係人とはモルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2025年1月27日現在)

国内株式

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|----------------------|---------|--------|--------|-------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 水産・農林業 (0.3%) | | | | |
| 雪国まいたけ | — | 2.7 | 3,083 | |
| 鉱業 (0.3%) | | | | |
| 住石ホールディングス | — | 4 | 3,060 | |
| 三井松島ホールディングス | 1.4 | — | — | |
| 建設業 (1.3%) | | | | |
| ウエストホールディングス | 2 | 2.8 | 4,564 | |
| タマホーム | 1.4 | 2 | 6,550 | |
| 新日本建設 | 2.3 | 3.1 | 4,832 | |
| 東洋建設 | 4 | — | — | |
| ライト工業 | 3.3 | — | — | |
| 住友電設 | 1.5 | — | — | |
| 食料品 (0.8%) | | | | |
| S Foods | 1.8 | — | — | |
| ファーマーズ | 2.3 | 3 | 2,916 | |
| 理研ビタミン | — | 2.6 | 6,104 | |
| 化学 (4.4%) | | | | |
| 北の達人コーポレーション | 6.9 | — | — | |
| 関東電化工業 | 3.2 | — | — | |
| KHネオケム | 2.5 | 4.1 | 8,659 | |
| 旭有機材 | — | 1.5 | 6,517 | |
| 恵和 | 1.2 | 1.5 | 1,494 | |
| 扶桑化学工業 | 1.7 | 2.1 | 7,161 | |
| トリケミカル研究所 | 2 | — | — | |
| 新日本製薬 | 0.9 | — | — | |
| I-ne | — | 0.8 | 1,648 | |
| 東洋合成工業 | 0.5 | 0.6 | 3,192 | |
| タカラバイオ | — | 7.2 | 7,444 | |
| J C U | 1.8 | 2.5 | 9,012 | |
| クミアイ化工業 | — | 9.1 | 6,843 | |
| 医薬品 (2.6%) | | | | |
| ジーエヌアイグループ | — | 7.5 | 23,887 | |
| 栄研化学 | 3 | — | — | |
| J C R ファーマ | — | 7.8 | 4,438 | |
| ミズホメディー | 0.6 | 1.6 | 2,438 | |

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|-----------------------------|---------|--------|--------|-------------|
| | | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 石油・石炭製品 (0.2%) | | | | |
| 富士石油 | 4.8 | 6 | 1,950 | |
| ガラス・土石製品 (0.4%) | | | | |
| 品川リフラクトリーズ | — | 2.8 | 4,802 | |
| 鉄鋼 (0.5%) | | | | |
| 日本冶金工業 | 1.2 | 1.6 | 6,360 | |
| 非鉄金属 (2.3%) | | | | |
| 大紀アルミニウム工業所 | 2.1 | 3.4 | 3,621 | |
| SWCC | 1.9 | 3.2 | 23,776 | |
| 金属製品 (2.4%) | | | | |
| トーカロ | 4.9 | 6.8 | 12,240 | |
| R S T e c h n o l o g i e s | 1.1 | 1.8 | 5,463 | |
| 横河ブリッジホールディングス | 2.6 | 4.1 | 11,283 | |
| 機械 (4.1%) | | | | |
| ツガミ | — | 4.9 | 7,678 | |
| 岡本工作機械製作所 | — | 0.6 | 2,307 | |
| オブトラン | 2.7 | — | — | |
| 野村マイクロ・サイエンス | 0.6 | 3.8 | 9,424 | |
| 日精エー・エス・ビー機械 | 0.7 | 0.8 | 4,280 | |
| TOWA | 1.8 | — | — | |
| 澁谷工業 | 1.6 | — | — | |
| オルガノ | 2 | — | — | |
| フクシマガリレイ | 1.1 | 3.4 | 8,741 | |
| 竹内製作所 | 2.5 | — | — | |
| PILLAR | 1.5 | 2.1 | 9,145 | |
| スター精密 | — | 3.9 | 7,542 | |
| 電気機器 (12.9%) | | | | |
| 芝浦メカトロニクス | 0.9 | 1.7 | 14,263 | |
| ヤーマン | 2.9 | 4.5 | 3,303 | |
| JVCケンウッド | 13.1 | 18.2 | 32,086 | |
| I DEC | 2.4 | 3.4 | 8,751 | |
| シライ電子工業 | — | 1.8 | 1,134 | |
| MCJ | 6.9 | 9.6 | 12,844 | |
| ワコム | 12.6 | 16.2 | 10,951 | |
| s a n t e c H o l d i n g s | — | 0.8 | 5,424 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|------------------------|---------|-----|--------|-----|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 日本電波工業 | 2 | 2.2 | 1,918 | |
| マイコー | 1.6 | 2.3 | 19,665 | |
| 日置電機 | — | 1.2 | 9,768 | |
| 日本マイクロニクス | 2.9 | — | — | |
| メガチップス | 1.3 | 1.8 | 11,430 | |
| フェローテックホールディングス | — | 6.4 | 17,305 | |
| 山一電機 | 1.5 | 1.9 | 4,655 | |
| 輸送用機器 (1.0%) | | | | |
| カヤバ | 1.6 | 3.9 | 11,360 | |
| 精密機器 (1.4%) | | | | |
| ノーリツ鋼機 | 1.6 | 2.2 | 10,912 | |
| A&Dホロンホールディングス | 2.4 | 2.9 | 5,478 | |
| その他製品 (3.6%) | | | | |
| 三井松島ホールディングス | — | 1.6 | 7,016 | |
| 壽屋 | — | 0.7 | 1,010 | |
| トランザクション | 1.1 | 1.5 | 2,827 | |
| フルヤ金属 | 0.5 | 2.2 | 7,359 | |
| SHOEI | — | 6.4 | 13,856 | |
| NISSHA | 2.8 | — | — | |
| ローランド | — | 1.7 | 6,519 | |
| グローブライド | 1.5 | 2.3 | 4,420 | |
| 電気・ガス業 (0.6%) | | | | |
| グリムス | — | 1 | 2,401 | |
| イーレックス | 2.9 | — | — | |
| レノバ | 4.4 | — | — | |
| 北海道瓦斯 | — | 9.1 | 4,877 | |
| メタウォーター | 2 | — | — | |
| 陸運業 (0.4%) | | | | |
| SBSホールディングス | 1.5 | 2 | 5,010 | |
| サカイ引越センター | 1.8 | — | — | |
| 海運業 (1.8%) | | | | |
| NSユナイテッド海運 | 0.9 | 1.4 | 5,509 | |
| 明海グループ | — | 2.8 | 1,898 | |
| 飯野海運 | 6 | 8.4 | 9,559 | |
| 乾汽船 | 1.9 | 2.9 | 4,776 | |
| 倉庫・運輸関連業 (1.9%) | | | | |
| 三井倉庫ホールディングス | 1.5 | 2.4 | 18,000 | |
| エーアイティー | 1 | 1.4 | 2,360 | |
| 内外トランスライン | 0.7 | 0.9 | 2,344 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|-----------------------|---------|------|--------|-----|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 情報・通信業 (11.6%) | | | | |
| システム | 24.8 | 32.8 | 11,480 | |
| デジタルアーツ | 1 | 1.5 | 8,850 | |
| ソフトクリエイトホールディングス | — | 1.6 | 3,598 | |
| エニグモ | 2.1 | — | — | |
| クロス・マーケティンググループ | 1.1 | — | — | |
| デジタルハーツホールディングス | 1 | — | — | |
| じげん | — | 5.7 | 2,616 | |
| フィックススターズ | 1.9 | 2.3 | 3,749 | |
| ティーガイア | 1.7 | 1 | 2,659 | |
| テクマトリックス | 3 | 4.9 | 11,505 | |
| ドリコム | 1.4 | — | — | |
| アバントグループ | 2.1 | 2.9 | 5,631 | |
| コムチュア | 2.4 | 3 | 6,525 | |
| アイル | 0.8 | 1.3 | 3,356 | |
| マークライinz | 0.9 | 1.4 | 2,993 | |
| デジタル・インフォメーション・テクノロジ | 0.9 | 1.2 | 2,492 | |
| PR TIMES | 0.3 | 0.5 | 1,052 | |
| ダブルスタンダード | 0.5 | 0.8 | 1,358 | |
| アカツキ | 0.8 | — | — | |
| カナミックネットワーク | 1.8 | 2.9 | 1,331 | |
| チェンジホールディングス | — | 5.7 | 8,139 | |
| オークネット | 0.6 | — | — | |
| マクロミル | — | 4.5 | 5,638 | |
| オロ | 0.6 | 1 | 2,300 | |
| ウォンテッドリー | 0.1 | — | — | |
| プラスアルファ・コンサルティング | — | 2.9 | 5,130 | |
| インフォコム | 2.1 | — | — | |
| IPS | 0.5 | 0.7 | 1,797 | |
| ウイングアーク1st | — | 2.4 | 7,992 | |
| ベース | 0.6 | 1.1 | 3,235 | |
| フューチャー | 3.5 | 5.7 | 10,168 | |
| S Bテクノロジー | 0.7 | — | — | |
| ビジネスエンジニアリング | — | 0.7 | 2,520 | |
| アルゴグラフィックス | 1.5 | 2.1 | 10,216 | |
| U-NEXT HOLDINGS | 1.8 | — | — | |
| 日本通信 | 16.2 | 18.4 | 2,244 | |
| ファイバーゲート | 0.9 | 1.2 | 1,088 | |
| 福井コンピュータホールディングス | 1 | 1.6 | 4,635 | |
| ミクロク情報サービス | 1.5 | 2.1 | 3,885 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|-----------------------|---------|------|--------|-----|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| 卸売業 (10.5%) | | 千株 | 千株 | 千円 |
| トーメンデバイス | 0.2 | — | — | |
| 東京エレクトロン デバイス | 1.7 | 2.4 | 7,356 | |
| 円谷フィールズホールディングス | — | 3.9 | 7,289 | |
| あい ホールディングス | 2.8 | 3.9 | 7,901 | |
| グリムス | 0.7 | — | — | |
| TOKAIホールディングス | 9.4 | — | — | |
| コメダホールディングス | 4.2 | 6.3 | 17,148 | |
| 松田産業 | 1.3 | 1.8 | 5,436 | |
| 日本ライフライン | 5.1 | 6.5 | 9,087 | |
| I DOM | 4.6 | 8.2 | 9,364 | |
| Buy Sell Technologies | 0.4 | 1 | 2,725 | |
| 蝶理 | — | 1.3 | 4,517 | |
| 兼松 | 6.1 | 6.5 | 16,727 | |
| 日本紙パルプ商事 | 0.8 | 11.6 | 7,621 | |
| 神鋼商事 | — | 0.5 | 3,005 | |
| 中央自動車工業 | — | 2.1 | 9,397 | |
| 伊藤忠エネクス | 4.3 | — | — | |
| 加賀電子 | 1.6 | 4.9 | 13,426 | |
| KPPグループホールディングス | 4.5 | 5 | 3,285 | |
| 小売業 (7.7%) | | | | |
| ハローズ | 1 | 1.3 | 4,985 | |
| コメ兵ホールディングス | — | 1.1 | 4,328 | |
| トレジャー・ファクトリー | — | 1.7 | 2,815 | |
| 物語コーポレーション | — | 4.4 | 14,850 | |
| Hamee | 0.6 | — | — | |
| ショッピング | 1.6 | 2.4 | 2,611 | |
| オイシックス・ラ・大地 | 2.3 | — | — | |
| JMホールディングス | 1.3 | 1.7 | 4,064 | |
| 力の源ホールディングス | — | 1.8 | 2,145 | |
| リミックスポイント | — | 17.8 | 10,377 | |
| G-7ホールディングス | 1.9 | 2.6 | 3,541 | |
| コーナン商事 | 2.1 | — | — | |
| 西松屋チェーン | 3.4 | — | — | |
| VITホールディングス | 6.6 | 9.4 | 4,747 | |
| スクロール | 2.6 | 3.6 | 3,798 | |
| Genky Drug Stores | 0.8 | 2.1 | 6,541 | |
| ギフトホールディングス | — | 1.2 | 3,870 | |
| アークランズ | 5.2 | 7.2 | 12,146 | |
| 日本KFCホールディングス | 1.8 | — | — | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|---------------------|---------|------|--------|-----|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| ベルク | 千株 | 千株 | 千円 | |
| | 1.1 | 1.6 | 10,064 | |
| 銀行業 (0.9%) | | | | |
| あいちファイナンシャルグループ | 3.3 | 4.2 | 10,747 | |
| 証券、商品先物取引業 (5.8%) | | | | |
| FPG | 5.5 | 7.8 | 21,769 | |
| GMOファイナンシャルホールディングス | 4.5 | 6.3 | 4,491 | |
| ジャコフ グループ | 4.8 | 6.7 | 14,612 | |
| マネックスグループ | 15.8 | 22.1 | 19,890 | |
| H S ホールディングス | — | 1.8 | 1,558 | |
| トレイダーズホールディングス | 1.8 | 2.5 | 2,520 | |
| スパークス・グループ | 1.8 | 2.5 | 3,655 | |
| その他金融業 (1.7%) | | | | |
| ジェイリース | 0.6 | 1.7 | 2,123 | |
| SBIアルヒ | 1.5 | — | — | |
| プレミアグループ | 2.7 | 3.8 | 9,739 | |
| Solvvy | 0.2 | 0.4 | 1,332 | |
| イー・ギャランティ | 2.6 | 3.7 | 6,367 | |
| 不動産業 (5.8%) | | | | |
| タスキホールディングス | — | 3.1 | 2,058 | |
| 日本駐車場開発 | 17.1 | 26.8 | 5,654 | |
| LAホールディングス | 0.5 | 0.7 | 4,144 | |
| ディア・ライフ | 2.7 | 3.8 | 3,834 | |
| プレサンスコーポレーション | 2.6 | — | — | |
| シーアールイー | 0.9 | 1 | 1,309 | |
| ケイアイスター不動産 | 0.8 | 1.2 | 5,178 | |
| グッドコムアセット | 1.5 | 1.8 | 1,674 | |
| ジェイ・エス・ピー | 0.8 | 0.9 | 2,693 | |
| ロードスター・キャピタル | 1.1 | 1.3 | 3,439 | |
| グローバル・リンク・マネジメント | — | 0.5 | 1,467 | |
| ウェルス・マネジメント | 0.7 | 1.1 | 1,126 | |
| レーサム | — | 0.2 | 1,180 | |
| 日本エスコン | 3 | 5.9 | 5,882 | |
| カチタス | — | 6.1 | 13,249 | |
| トーセイ | 2.7 | 3.7 | 8,887 | |
| サンフロンティア不動産 | 2.4 | 3.8 | 7,444 | |
| サービス業 (12.8%) | | | | |
| ジェイエイシーリクルートメント | 6.1 | 8.5 | 5,933 | |
| メンバーズ | 0.6 | — | — | |
| UTグループ | 2.2 | 3.1 | 6,820 | |
| アイティメディア | 0.6 | 1.3 | 2,078 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|--------------------|---------|-------|-------|-----|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| ケアネット | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 3.4 | 4.8 | 2,740 | | |
| パソナグループ | 2 | 2.9 | 5,788 | |
| リンクアンドモチベーション | — | 5.6 | 3,012 | |
| アミタホールディングス | 0.4 | — | — | |
| シミックホールディングス | 0.8 | — | — | |
| デジタルホールディングス | 0.9 | 1.2 | 1,588 | |
| 新日本科学 | 1.5 | 2.5 | 4,207 | |
| ワールドホールディングス | 0.8 | 0.9 | 1,791 | |
| ライク | 0.6 | 0.9 | 1,314 | |
| エスプール | 4.8 | 7.4 | 2,101 | |
| バリューコマース | 1.5 | 2.1 | 2,543 | |
| JPホールディングス | 4.3 | 6 | 3,876 | |
| プレステージ・インターナショナル | 7.9 | 11 | 7,183 | |
| クイック | 1.2 | 1.6 | 3,496 | |
| アルプス技研 | 1.6 | 2 | 4,974 | |
| ビー・エム・エル | 2.1 | 2.9 | 8,444 | |
| リゾー教育 | 8.6 | — | — | |
| クリーク・アンド・リバー社 | 0.8 | 1.2 | 2,001 | |
| SB1グローバルアセットマネジメント | 3.3 | 4.6 | 3,164 | |
| シダックス | 2.4 | — | — | |
| フルキャストホールディングス | 1.6 | 1.9 | 2,912 | |
| アドベンチャー | 0.2 | 0.3 | 1,080 | |
| アイ・アールジャパンホールディングス | 0.9 | 1.2 | 896 | |
| Ke e p e r 技研 | 1 | 1.5 | 6,712 | |
| イー・ガーディアン | 0.6 | 1.1 | 2,080 | |
| ベクトル | 2.1 | 3.2 | 3,315 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当期末 | | |
|----------------------------|---------|-------|--------|-----------|
| | | 株数 | 株数 | 評価額 |
| チャーム・ケア・コーポレーション | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 1.4 | 2 | 2,548 | | |
| キャリアリンク | 0.6 | 0.9 | 2,193 | |
| I B J | 1.3 | 1.8 | 1,162 | |
| M&Aキャピタルパートナーズ | 1.4 | 1.9 | 4,721 | |
| E R I ホールディングス | — | 0.7 | 1,535 | |
| シグマクシス・ホールディングス | 2.3 | 6.8 | 6,120 | |
| ウィルグループ | 1.4 | — | — | |
| フリークアウト・ホールディングス | — | 1.1 | 685 | |
| エラン | 2.2 | 3.1 | 2,321 | |
| ペルシステム24ホールディングス | 1.8 | 2.5 | 3,115 | |
| エアトリ | — | 1.7 | 1,961 | |
| ストライク | 0.7 | 1.2 | 4,356 | |
| ソラスト | 4.6 | 6.5 | 3,126 | |
| インソース | 3.7 | 5.1 | 5,650 | |
| O r c h e s t r a Holdings | 0.4 | — | — | |
| アイモバイル | — | 3 | 1,467 | |
| ジーニー | 0.4 | 0.8 | 1,243 | |
| ミダックホールディングス | 1 | — | — | |
| マネジメントソリューションズ | — | 1.2 | 2,019 | |
| ポート | 0.8 | 1.1 | 2,070 | |
| M a c b e e P l a n e t | 0.1 | 0.9 | 2,790 | |
| L I T A L I C O | 1.3 | 2.1 | 1,835 | |
| 船井総研ホールディングス | 3.5 | 4.7 | 11,223 | |
| 合計 | 株数・金額 | 497 | 739 | 1,187,058 |
| 銘柄数<比率> | | 198 | 200 | <99.1%> |

(注) 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) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当期末 | | |
|----|--------|----------|----------|----------|
| | | 買建額 | 売建額 | |
| 国内 | 株式先物取引 | JPX日経400 | 百万円 9 | 百万円 — |

○投資信託財産の構成

(2025年1月27日現在)

| 項目 | 当期末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評価額 | 比率 |
| 株式 | 千円 1,187,058 | % 99.1 |
| コール・ローン等、その他 | 10,993 | 0.9 |
| 投資信託財産総額 | 1,198,051 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2025年1月27日現在)

| 項目 | 当期末 |
|-----------------|--------------------|
| (A) 資産 | 円 1,197,847,127 |
| コール・ローン等 | 6,501,759 |
| 株式(評価額) | 1,187,058,250 |
| 未収入金 | 225,560 |
| 未収配当金 | 3,753,520 |
| 未収利息 | 82 |
| 差入委託証拠金 | 307,956 |
| (B) 負債 | 594,872 |
| 未払解約金 | 594,872 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,197,252,255 |
| 元本 | 647,702,915 |
| 次期継越損益金 | 549,549,340 |
| (D) 受益権総口数 | 647,702,915口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 18,485円 |

<注記事項>

| | |
|----------------------------|--------------|
| ①期首元本額 | 494,679,869円 |
| 期中追加設定元本額 | 330,324,932円 |
| 期中一部解約元本額 | 177,301,886円 |
| また、1口当たり純資産額は、期末1,8485円です。 | |

②期末における元本の内訳 (当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

e MAXIS JPX日経中小型インデックス 647,702,915円

○損益の状況 (2024年1月27日～2025年1月27日)

| 項目 | 当期 |
|------------------|-----------------|
| (A) 配当等収益 | 円 30,164,316 |
| 受取配当金 | 30,150,474 |
| 受取利息 | 13,621 |
| その他収益金 | 301 |
| 支払利息 | △ 80 |
| (B) 有価証券売買損益 | 84,274,490 |
| 売買益 | 181,931,994 |
| 売買損 | △ 97,657,504 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 2,960,620 |
| 取引益 | 7,732,240 |
| 取引損 | △ 4,771,620 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 117,399,426 |
| (E) 前期繰越損益金 | 322,975,366 |
| (F) 追加信託差損益金 | 250,753,760 |
| (G) 解約差損益金 | △141,579,212 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 549,549,340 |
| 次期繰越損益金(H) | 549,549,340 |

(注) (B) 有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含みます。

(注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。