

■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	
信託期間	2020年9月1日から2030年9月20日まで。	
運用方針	マザーファンド受益証券への投資を通じて、主にわが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式の中から、長期的に持続的な成長が見込めると判断される株式に投資を行います。	
主な投資対象	ベビードラゴン	主としてマニュライフ・厳選日本株マザーファンド（以下「マザーファンド」といいます。）の受益証券を投資対象とします。
	マザーファンド	主にわが国の金融商品取引所に上場されている株式を投資対象とします。
マザーファンドの運用方法	主にわが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式の中から、長期的に持続的な成長が見込めると判断される株式に投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行います。	
主な投資制限	ベビードラゴン	<p>①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への実質投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>③投資信託証券（マザーファンド受益証券および上場投資信託証券を除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>
	マザーファンド	<p>①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p>
分配方針	<p>毎決算時（毎年9月20日。ただし、休業日の場合は翌営業日とします。）に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。</p> <p>①分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。</p> <p>②収益分配額は、委託者が基準価額の水準・市況動向等を勘案して決定しますが、信託財産の成長に資することに配慮して分配を行わないことがあります。</p> <p>③保留益（収益分配に充てず信託財産内に留保した利益）については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。</p>	

マニュライフ・ 厳選日本株ファンド

運用報告書（全体版）

第4期（決算日 2024年9月20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。

さて、「マニュライフ・厳選日本株ファンド」は、このたび、第4期の決算を行いました。

ここに、第4期の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。

マニュライフ・インベストメント・マネジメント株式会社

東京都千代田区丸の内1-8-1 丸の内トラストタワーN館

お問い合わせ先

サポートダイヤル：03-6267-1901

受付時間：営業日の午前9時～午後5時

ホームページアドレス：www.manulifeim.co.jp/

■設定以来の運用実績

決 算 期	基 準 価 額			参 考 指 数	株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率	純 資 産 額
	(分配落)	税 込 分 配 金	期 中 謄 落 率		期 中 謄 落 率		
(設 定 日) 2020年9月1日	円 10,000	円 —	% —	10,000	% —	% —	百万円 1,000
1期 (2021年9月21日)	13,584	0	35.8	13,035	30.3	96.7	2.2
2期 (2022年9月20日)	12,298	0	△ 9.5	12,591	△ 3.4	98.9	—
3期 (2023年9月20日)	13,955	0	13.5	15,984	26.9	98.8	—
4期 (2024年9月20日)	17,029	0	22.0	17,957	12.3	98.1	—
							659

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産額は、設定元本を表示しています。

(注3) 基準価額は1万口当たり、謄落率は分配金込みで表示しています。

(注4) 当ファンドの参考指數は、東証株価指数（TOP IX、配当込み）です。当参考指數は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注5) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」および「投資信託証券比率」は実質比率を記載しております。

参考指數に関して

東証株価指数（TOP IX）は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指數の算出、指數値の公表、利用など同指數に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指數（TOP IX）の商標または標章に関するすべての権利はJPXが有しています。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		参 考 指 数	株 式 組 入 比 率	投 資 信 託 証 券 比 率
	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2023年9月20日	円 13,955	% —	15,984	% —	% 98.8
9月末	13,693	△ 1.9	15,571	△ 2.6	98.0
10月末	13,114	△ 6.0	15,105	△ 5.5	97.9
11月末	14,067	0.8	15,924	△ 0.4	98.2
12月末	14,308	2.5	15,888	△ 0.6	98.8
2024年1月末	15,019	7.6	17,129	7.2	99.2
2月末	15,598	11.8	17,973	12.4	99.7
3月末	16,250	16.4	18,770	17.4	98.2
4月末	16,149	15.7	18,598	16.4	98.3
5月末	16,650	19.3	18,814	17.7	98.5
6月末	17,546	25.7	19,087	19.4	99.0
7月末	17,556	25.8	18,984	18.8	99.3
8月末	17,576	25.9	18,434	15.3	99.4
(期 末) 2024年9月20日	17,029	22.0	17,957	12.3	98.1

(注1) 謄落率は期首比です。(期末基準価額は分配金を含みます。)

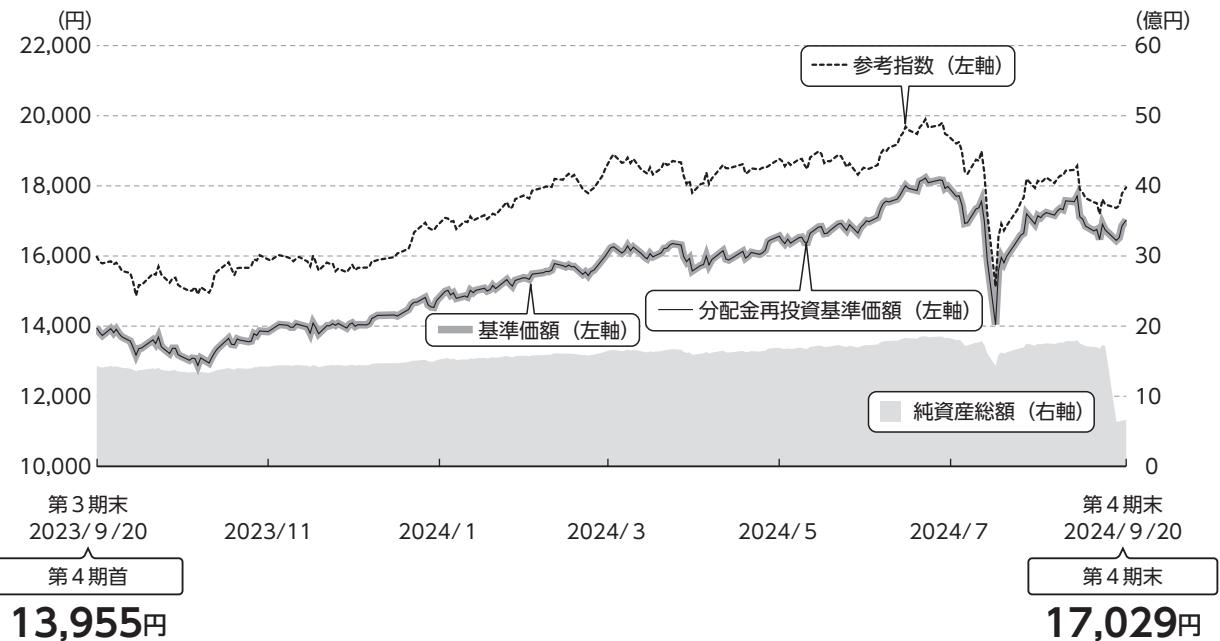
(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指數は、東証株価指數（TOP IX、配当込み）です。当参考指數は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

(注4) 当ファンドは親投資信託を組入れますので、「株式組入比率」および「投資信託証券比率」は実質比率を記載しております。

運用経過

基準価額等の推移 (2023年9月21日から2024年9月20日まで)



※分配金再投資基準価額は、税引前の分配金を再投資（複利運用）したものとして、委託会社が算出したもので、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。

※当ファンドの参考指數は、東証株価指數（TOP1X、配当込み）です。当参考指數は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

※分配金を再投資するかどうかについては、お客様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、各個人のお客様の損益状況を示すものではありません。

既払分配金	0円
騰落率 (分配金再投資ベース)	22.0%

基準価額の主な変動要因

▲ 上昇要因

- ・日立製作所（電気機器）や日本電気（電気機器）がプラスに寄与しました。
- ・ZOZO（小売業）、SOMPOホールディングス（保険業）などもプラスに寄与しました。

投資環境

日本株式市況

東証株価指数（TOPIX、配当込み）は、各国中央銀行の金融引き締め政策にも関わらず底堅い米国経済、生成AⅠ関連の期待の高まりを背景とする世界的な株高の流れ、円安環境継続の追い風などの影響を受けて上昇しました。一方では、中東などで地政学リスクが高まったこともあり、相場の不確実性も上昇しました。

日本の株式市場では、生成AⅠ関連や、地政学リスクの高まりの恩恵を受けやすいセクターが堅調となりました。具体的には、保険、石油石炭製品、その他製品、非鉄金属などがあげられます。反対に鉄鋼、空運、鉱業、陸運、などが軟調となりました。

当該投資信託のポートフォリオ

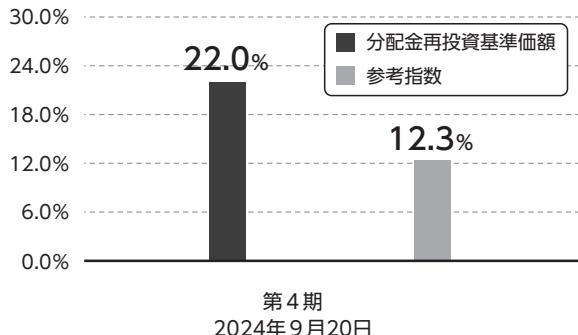
当ファンド

主要投資対象とする「マニュライフ・厳選日本株マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に維持しました。

マニュライフ・厳選日本株マザーファンド

主にわが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式の中から、長期的に持続的な成長が見込めると判断される株式に投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行いました。

当該投資信託のベンチマークとの差異



当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。左記のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指標の騰落率の対比です。

※当ファンドの参考指標は、東証株価指数（TOPIX、配当込み）です。当参考指標は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

収益分配金について

基準価額水準・市況動向等を勘案した結果、分配金のお支払いは見送りとさせていただきました。留保益の運用については、特に制限を設けず運用の基本方針に基づき運用を行います。

[分配原資の内訳]		(1万口当たり、税引前)
第4期		
自 2023年9月21日 至 2024年9月20日		
当期分配金	(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)	7,029

(注1) 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）に対する比率であり、ファンドの收益率とは異なります。

(注2) 「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3) 円未満は切り捨てており、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。

今後の運用方針

当ファンド

主要投資対象とする「マニュライフ・厳選日本株マザーファンド」受益証券の組入比率を高位に保ち、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行う方針です。

マニュライフ・厳選日本株マザーファンド

ポートフォリオは、フリーキャッシュフロー創出力を有する銘柄で構成されています。運用チームでは、これらの企業は短期的な外部要因の変化に関わらず構造的に成長できる可能性が高いと考えています。運用にあたっては、価格決定力の強さ、キャピタルアロケーションポリシー（資本配分方針）の優劣、E S Gの観点などで銘柄のファンダメンタルズの分析を行い、精緻なキャッシュフロー分析に基づいて割安な銘柄をピックアップしてまいります。

1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額	比率	
平均基準価額	15,627円	—	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。
(a) 信託報酬	280円	1.793%	(a)信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率
(投信会社)	(138)	(0.880)	委託した資金の運用の対価
(販売会社)	(138)	(0.880)	交付運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受託会社)	(5)	(0.033)	運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
(b) 募集手数料	—	—	
(c) 売買委託手数料	51	0.329	(c)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 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)	(51)	(0.329)	
(d) 有価証券取引税	—	—	(d)有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷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
(e) その他費用	22	0.142	(e)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)	(12)	(0.076)	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
(印刷)	(10)	(0.065)	印刷は、印刷会社等に支払う法定書類の作成等に係る費用
(その他)	(0)	(0.001)	その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等
合計	353	2.264	

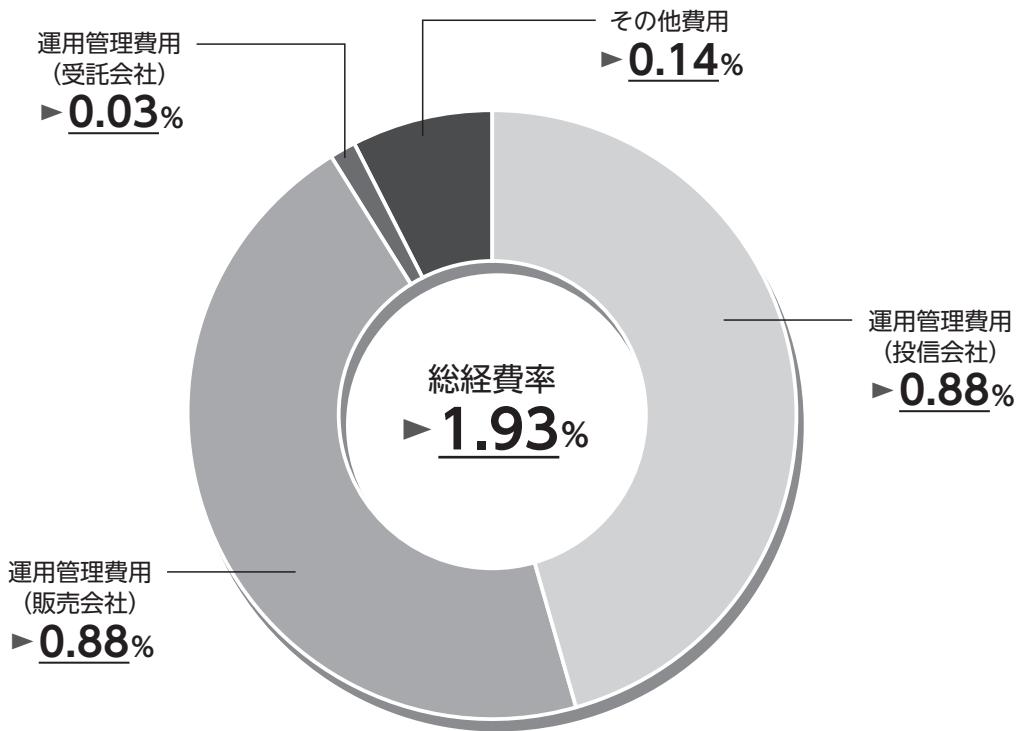
*期中の費用（消費税のかかるものは消費税を含む）は追加、解約によって受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

*各項目毎に円未満は四捨五入してあります。

*売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組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。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

(参考情報) 総経費率



*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。

*各比率は、年率換算した値です。

*上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。

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1.93%です。

■売買及び取引の状況（2023年9月21日から2024年9月20日まで）

親投資信託受益証券の設定、解約状況

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
マニュライフ・厳選日本株マザーファンド	千口 17,214	千円 31,009	千口 627,663	千円 1,131,621

(注) 単位未満は切り捨てております。

■親投資信託の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
	マニュライフ・厳選日本株マザーファンド
(a) 期 中 の 株 式 売 買 金 額	3,700,211千円
(b) 期 中 の 平 均 組 入 株 式 時 価 総 額	1,577,711千円
(c) 売 買 高 比 率(a)／(b)	2.34

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等（2023年9月21日から2024年9月20日まで）

期中の利害関係人との取引状況

当ファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

マニュライフ・厳選日本株マザーファンド

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■第一種金融商品取引業又は第二種金融商品取引業を兼業している委託会社の自己取引状況

(2023年9月21日から2024年9月20日まで)

該当事項はありません。

■自社による当ファンドの設定・解約状況（2023年9月21日から2024年9月20日まで）

該当事項はありません。

■組入資産の明細 (2024年9月20日現在)

親投資信託残高

項目	期首(前期末)		当期末		
	口数	千口	口数	千口	評価額
マニュライフ・厳選日本株マザーファンド	969,360	969,360	358,912	358,912	659,464

(注1) マザーファンドの2024年9月20日現在の受益権総口数は358,912千口です。

(注2) 口数・評価額の単位未満は切り捨てております。

■有価証券の貸付及び借入の状況 (2024年9月20日現在)

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2024年9月20日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
マニュライフ・厳選日本株マザーファンド	659,464	97.6
コール・ローン等、その他	16,270	2.4
投資信託財産総額	675,734	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	当期末 2024年9月20日
(A) 資産	675,734,804円
マニュライフ・厳選日本株マザーファンド(評価額)	659,464,945
未収入金	16,269,859
(B) 負債	16,269,859
未払解約金	139
未払信託報酬	15,121,578
その他未払費用	1,148,142
(C) 純資産額(A-B)	659,464,945
元本	387,254,834
次期繰越損益金	272,210,111
(D) 受益権総口数	387,254,834口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,029円

(注1) 当ファンドの期首元本額は1,026,773,848円、期中追加設定元本額は18,512,380円、期中一部解約元本額は658,031,394円です。

(注2) 1口当たり純資産額は1.7029円です。

■損益の状況

項目	当期 自2023年9月21日至2024年9月20日
(A) 有価証券売買損益	147,673,652円
売買益	332,397,426
売買損	△184,723,774
(B) 信託報酬等	△30,545,491
(C) 当期損益金(A+B)	117,128,161
(D) 前期繰越損益金	141,322,719
(E) 追加信託差損益金	13,759,231
(配当等相当額)	(9,843,078)
(売買損益相当額)	(3,916,153)
(F) 計(C+D+E)	272,210,111
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	272,210,111
追加信託差損益金	13,759,231
(配当等相当額)	(9,853,174)
(売買損益相当額)	(3,906,057)
分配準備積立金	258,450,880

(注1) 損益の状況の中で**(A)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2) 損益の状況の中で**(B)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3) 損益の状況の中で**(E)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4) 収益分配金の計算過程は以下の通りです。
計算期間末における費用控除後の配当等収益(10,146,087円)、費用控除後の有価証券等損益額(106,982,074円)、信託約款に規定する収益調整金(13,759,231円)および分配準備積立金(141,322,719円)より分配対象収益は272,210,111円(10,000口当たり7,029円)ですが、当期に分配した金額はありません。

※本運用報告書作成時点において、本計算期間に係るファンド監査は終了していません。

お知らせ

約款変更

ファンド名称変更のため、信託約款に所要の変更を行いました（旧ファンド名称：2.0 厳選日本株ファンド）。

（2024年9月6日）

運用体制の変更

該当事項はありません。

マニュライフ・厳選日本株マザーファンド

第4期

決算日 2024年9月20日

(計算期間：2023年9月21日から2024年9月20日まで)

■当ファンドの仕組みは次の通りです。

決 算 日	毎年9月20日
運 用 方 針	<p>①主にわが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式の中から、長期的に持続的な成長が見込めると判断される株式に投資を行います。</p> <p>②株式の組入比率は、通常の状態においては高位を維持することを基本とします。</p> <p>③当初の設定日直後、大量の追加設定または解約が発生したとき、金融商品市況の急激な変化が発生または予想されるとき、償還の準備により資金化が必要なときなど、また信託財産の規模によっては、上記の運用ができない場合があります。</p>
主 な 投 資 対 象	主にわが国の金融商品取引所に上場されている株式を投資対象とします。
主 な 投 資 制 限	<p>①株式（新株引受権証券および新株予約権証券を含みます。）への投資割合には制限を設けません。</p> <p>②外貨建資産への投資は行いません。</p> <p>③投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。</p> <p>④一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則としてそれぞれ10%、合計で20%以内とすることとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。</p> <p>⑤デリバティブ取引は行いません。</p> <p>⑥信用取引、空売り、有価証券の貸付け・借入れは行いません。</p>

■設定以来の運用実績

決算期	基準価額	参考指數		株式組入比率	投資信託証券比率	純資産額
		期騰落率	中騰落率			
(設定日) 2020年9月1日	円 10,000	% —	10,000	% —	% —	百万円 1,000
1期 (2021年9月21日)	13,842	38.4	13,035	30.3	96.7	2.2
2期 (2022年9月20日)	12,783	△ 7.7	12,591	△ 3.4	98.9	—
3期 (2023年9月20日)	14,781	15.6	15,984	26.9	98.8	—
4期 (2024年9月20日)	18,374	24.3	17,957	12.3	98.1	—
						659

(注1) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注2) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しています。

(注3) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注4) 当ファンドの参考指數は、東証株価指数（TOPIX、配当込み）です。当参考指數は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

参考指數に関して

東証株価指数（TOPIX）は、株式会社JPX総研または株式会社JPX総研の関連会社（以下「JPX」という。）の知的財産であり、指數の算出、指數値の公表、利用など同指數に関するすべての権利・ノウハウ及び東証株価指数（TOPIX）の商標または標章に関するすべての権利はJPXが有しています。

■当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額	参考指數		株式組入比率	投資信託証券比率
		騰落率	騰落率		
(期首) 2023年9月20日	円 14,781	% —	15,984	% —	% 98.8
9月末	14,511	△ 1.8	15,571	△ 2.6	98.0
10月末	13,922	△ 5.8	15,105	△ 5.5	97.7
11月末	14,954	1.2	15,924	△ 0.4	97.8
12月末	15,233	3.1	15,888	△ 0.6	98.3
2024年1月末	16,013	8.3	17,129	7.2	98.6
2月末	16,651	12.7	17,973	12.4	98.9
3月末	17,370	17.5	18,770	17.4	98.2
4月末	17,290	17.0	18,598	16.4	98.1
5月末	17,854	20.8	18,814	17.7	98.1
6月末	18,838	27.4	19,087	19.4	98.5
7月末	18,882	27.7	18,984	18.8	98.6
8月末	18,931	28.1	18,434	15.3	98.6
(期末) 2024年9月20日	18,374	24.3	17,957	12.3	98.1

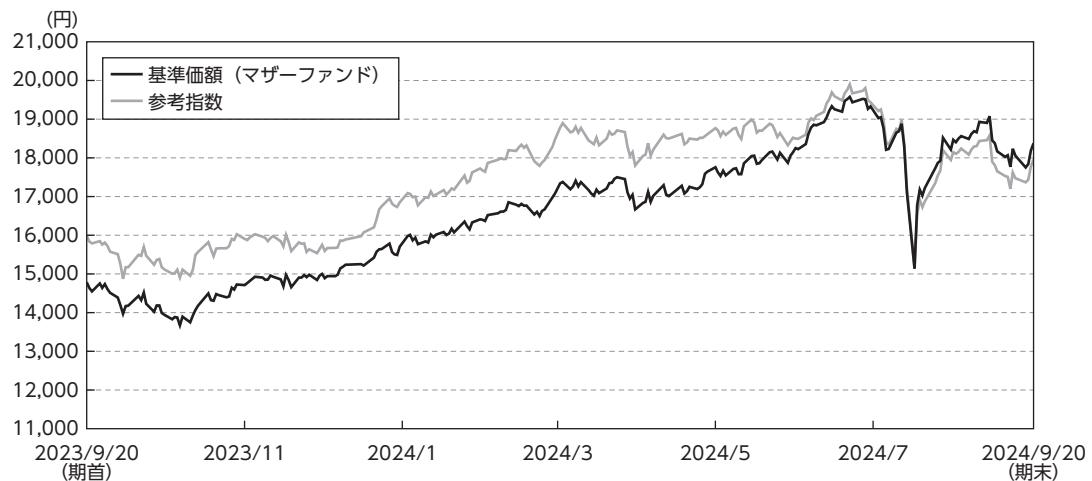
(注1) 謄落率は期首比です。

(注2) 基準価額は1万口当たりで表示しています。

(注3) 当ファンドの参考指數は、東証株価指数（TOPIX、配当込み）です。当参考指數は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

運用経過

■基準価額等の推移 (2023年9月21日から2024年9月20日まで)



期 首：14,781円

期 末：18,374円

騰 落 率： 24.3%

※当ファンドの参考指数は、東証株価指数（TOP INDEX、配当込み）です。当参考指数は、ファンドの設定日の前日を10,000として、委託会社が算出したものです。

■基準価額の主な変動要因

上昇要因

- ・日立製作所（電気機器）や日本電気（電気機器）がプラスに寄与しました。
- ・ZOZO（小売業）、SOMP（ホールディングス）（保険業）などもプラスに寄与しました。

■投資環境

[日本株式市況]

東証株価指数（T O P I X、配当込み）は、各国中央銀行の金融引き締め政策にも関わらず底堅い米国経済、生成A I関連の期待の高まりを背景とする世界的な株高の流れ、円安環境継続の追い風などの影響を受けて上昇しました。一方では、中東などで地政学リスクが高まったこともあり、相場の不確実性も上昇しました。

日本の株式市場では、生成A I関連や、地政学リスクの高まりの恩恵を受けやすいセクターが堅調となりました。具体的には、保険、石油石炭製品、その他製品、非鉄金属などがあげられます。反対に鉄鋼、空運、鉱業、陸運、などが軟調となりました。

■当該投資信託のポートフォリオ

主にわが国の金融商品取引所に上場（これに準ずるものを含みます。）されている株式の中から、長期的に持続的な成長が見込めると判断される株式に投資を行い、信託財産の中長期的な成長をめざして運用を行いました。

■今後の運用方針

ポートフォリオは、フリーキャッシュフロー創出力を有する銘柄で構成されています。運用チームでは、これらの企業は短期的な外部要因の変化に関わらず構造的に成長できる可能性が高いと考えています。運用にあたっては、価格決定力の強さ、キャピタルアロケーションポリシー（資本配分方針）の優劣、E S Gの観点などで銘柄のファンダメンタルズの分析を行い、精緻なキャッシュフロー分析に基づいて割安な銘柄をピックアップしてまいります。

■ 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要	
	(2023年9月21日~2024年9月20日)			
	金額	比率		
平均基準価額	16,704円	一	期中の平均基準価額（月末値の平均値）です。	
(a) 売買委託手数料 (株式)	55円 (55)	0.328% (0.328)	(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 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	
(b) その他費用 (その他)	0 (0)	0.001 (0.001)	(b) その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 ・その他は、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用等	
合計	55	0.329		

*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、簡便法により算出した結果です。

*各項目毎に円未満は四捨五入しております。

*各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額を期中の平均基準価額で除して100を乗じたものです。

■ 売買及び取引の状況（2023年9月21日から2024年9月20日まで）

株式

		買付		売付	
		株数	金額	株数	金額
国内	上場	千株 449 (56)	千円 1,318,200 (-)	千株 856	千円 2,382,011

(注1) 金額は受け渡し代金です。

(注2) 単位未満は切り捨てております。

(注3) ()内は株式分割、予約権行使、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。

■ 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	3,700,211千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,577,711千円
(c) 売買高比率(a)／(b)	2.34

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均です。

■利害関係人との取引状況等 (2023年9月21日から2024年9月20日まで)

当期中における利害関係人との取引等はありません。

(注) 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す。

■組入資産の明細 (2024年9月20日現在)

国内株式

上場株式

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
建設業(-%)				
九電工	15.8	—	—	
食料品(2.7%)				
アサヒグループホールディングス	—	1.4	7,796	
サントリー食品インターナショナル	14	1.8	9,775	
化学(6.8%)				
信越化学工業	—	2.1	12,310	
東京応化工業	5.1	3.6	12,229	
積水化学工業	—	3.9	8,603	
日本ペイントホールディングス	—	3.7	3,224	
富士フィルムホールディングス	—	2.1	7,900	
医薬品(2.3%)				
ロート製薬	—	2	7,006	
参天製薬	—	4.4	7,726	
ガラス・土石製品(2.2%)				
TOTO	—	2.9	14,186	
金属製品(4.5%)				
三和ホールディングス	—	5	17,270	
リンナイ	12.1	3.5	12,138	
機械(6.0%)				
日本製鋼所	18.2	2.9	12,876	
三浦工業	10.7	—	—	
小松製作所	15.1	3	11,562	
グローリー	—	1.7	4,419	
マキタ	—	2.1	10,170	
日立造船	42.8	—	—	
電気機器(22.3%)				
日立製作所	5.2	9.8	35,985	
富士電機	6.5	2	16,702	
日本電気	8.8	1.8	24,669	
ルネサスエレクトロニクス	—	7.2	15,253	
ソニーグループ	6.1	2.2	29,403	
TDK	7.1	1.9	17,100	
オプティックスグループ	—	1.1	1,773	
ファナック	—	0.9	3,568	
輸送用機器(6.6%)				
豊田自動織機	—	1.3	14,443	

銘柄	期首(前期末)	当期末		
		株数	株数	評価額
	千株	千株	千円	
トヨタ自動車	—	10.7	28,183	
精密機器(3.1%)				
タムロン	8.7	—	—	
HOYA	—	1	19,735	
その他製品(3.2%)				
パラマウントベッドホールディングス	14.2	—	—	
バンダイナムコホールディングス	—	4.6	15,285	
大日本印刷	—	1.1	5,590	
情報・通信業(8.1%)				
TIS	9.1	—	—	
インターネットイニシアティブ	25.5	4.7	13,907	
BIPROGY	—	1.3	6,363	
KDDI	—	4	19,216	
ゼンリン	39.3	—	—	
SCSK	—	4.3	12,755	
卸売業(3.4%)				
伊藤忠商事	—	1.5	11,476	
三井物産	—	3.5	10,678	
小売業(7.9%)				
マツキヨココカラ&カンパニー	4.7	5.9	13,457	
ZOZO	21	4	19,580	
セブン&アイ・ホールディングス	—	8.4	18,072	
FOOD & LIFE COMPANIE	8	—	—	
銀行業(8.6%)				
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	9	13,338	
三井住友フィナンシャルグループ	—	3.4	30,980	
千葉銀行	—	9.6	11,040	
保険業(5.1%)				
SOMPOホールディングス	11.4	3.4	11,186	
アニコム ホールディングス	77.6	—	—	
第一生命ホールディングス	—	5.9	21,481	
その他金融業(0.3%)				
イー・ギャランティ	18.6	1.3	1,849	
不動産業(3.0%)				
大東建託	—	0.4	7,008	
三井不動産	—	5.7	7,817	
カチタス	21.4	2.4	4,586	

銘柄	期首(前期末)	当期末	
	株数	株数	評価額
サービス業(3.9%)	千株	千株	千円
エス・エム・エス	—	1.9	4,109
サイバーエージェント	30	—	—
M&Aキャピタルパートナーズ	11.9	—	—
リクルートホールディングス	9.1	2.3	21,309
ベルシステム24ホールディングス	30	—	—
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	17.2	—	—
合計	株数・金額	525	174 647,102
	銘柄数<比率>	30	49 <98.1%>

(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です。

(注2) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率です。

(注3) 評価額の単位未満は切捨てております。

(注4) —印は組入れなしです。

■有価証券の貸付及び借入の状況 (2024年9月20日現在)

該当事項はありません。

■投資信託財産の構成

(2024年9月20日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 647,102	% 95.8
コール・ローン等、その他	28,619	4.2
投資信託財産総額	675,721	100.0

(注) 金額の単位未満は切り捨てております。

■資産、負債、元本及び基準価額の状況

項目	当期末 2024年9月20日
(A) 資産	675,721,132円
コール・ローン等	27,331,820
株式(評価額)	647,102,530
未収配当金	1,286,700
未収利息	82
(B) 負債	16,269,859
未払解約金	16,269,859
(C) 純資産額(A-B)	659,451,273
元本	358,912,020
次期繰越損益金	300,539,253
(D) 受益権総口数	358,912,020口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,374円

(注1) 当親ファンドの期首元本額は969,360,382円、期中追加設定元本額は17,214,661円、期中一部解約元本額は627,663,023円です。

(注2) 当親ファンドを投資対象とする投資信託の当期末元本額は以下の通りです。

マニュライフ・厳選日本株ファンド 358,912,020円

(注3) 1口当たり純資産額は1.8374円です。

※当ファンドは監査対象ではありません。

お知らせ

◆約款変更

ファンド名称変更のため、信託約款に所要の変更を行いました(旧ファンド名称:2.0 厳選日本株マザーファンド)。

(2024年9月6日)

◆運用体制の変更

該当事項はありません。

■損益の状況

項目	当期 自2023年9月21日 至2024年9月20日
(A) 配当等収益	32,173,259円
受取配当金	32,170,730
受取利息	2,419
その他収益金	110
(B) 有価証券売買損益	295,086,419
売買益	380,449,153
売買損	△ 85,362,734
(C) 信託報酬等	△ 12,270
(D) 当期損益金(A+B+C)	327,247,408
(E) 前期繰越損益金	463,455,838
(F) 追加信託差損益金	13,794,724
(G) 解約差損益金	△ 503,958,717
(H) 計(D+E+F+G)	300,539,253
次期繰越損益金(H)	300,539,253

(注1) 損益の状況の中で**(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2) 損益の状況の中で**(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3) 損益の状況の中で**(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4) 損益の状況の中で**(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。