

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（2014年4月1日設定）	
運用方針	J P X日経400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、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。）に実質的な投資を行い、J P X日経インデックス400（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。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て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	ベビードファンド	J P X日経400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。なお、わが国の金融商品取引所上場株式に直接投資することがあります。
	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	ベビードファンド	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20%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20%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）



イーマックス

eMAXIS J P X日経400インデックス

第10期（決算日：2024年1月26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「eMAXIS J P X日経400インデックス」は、去る1月26日に第10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。



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。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.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 (分配落)	準 価 額			JPX日経インデックス400 (配当込み)		株式 組入比率	株式 先物比率	純資 産額	
		税 分	込 配	み 金	期 騰	中 落				中 率
	円		円			円		%	円	
6期(2020年1月27日)	15,352		0		12.7	17,515.49		13.2	97.2	5,585
7期(2021年1月26日)	17,252		0		12.4	19,751.22		12.8	97.6	5,165
8期(2022年1月26日)	17,807		0		3.2	20,502.60		3.8	93.9	6,007
9期(2023年1月26日)	19,069		0		7.1	22,073.83		7.7	99.1	6,603
10期(2024年1月26日)	24,618		0		29.1	28,625.99		29.7	97.5	7,841

(注) JPX日経インデックス400(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400銘柄で構成される株価指数です。「JPX日経インデックス400(配当込み)」(以下「JPX日経インデックス400」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日経インデックス400」自体及び「JPX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。「JPX日経インデックス400」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日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「JPX日経インデックス400」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) 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日経インデックス400 (配当込み)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	(配当込み)	騰 落 率 %		
(期 首) 2023年1月26日	19,069	—	22,073.83	—	99.1	0.9
1月末	19,002	△ 0.4	21,999.20	△ 0.3	99.2	0.8
2月末	19,180	0.6	22,212.78	0.6	98.7	1.3
3月末	19,498	2.2	22,588.54	2.3	97.0	2.4
4月末	19,988	4.8	23,167.58	5.0	97.2	2.4
5月末	20,862	9.4	24,192.59	9.6	97.5	2.5
6月末	22,431	17.6	26,022.39	17.9	98.5	1.5
7月末	22,724	19.2	26,371.68	19.5	96.2	2.6
8月末	22,763	19.4	26,425.20	19.7	98.3	1.3
9月末	22,785	19.5	26,461.72	19.9	98.2	1.8
10月末	21,984	15.3	25,542.53	15.7	98.1	1.9
11月末	23,353	22.5	27,146.11	23.0	98.0	2.0
12月末	23,318	22.3	27,099.47	22.8	99.1	0.9
(期 末) 2024年1月26日	24,618	29.1	28,625.99	29.7	97.5	2.5

(注) 騰落率は期首比。

(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10期：2023年1月27日～2024年1月26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10期首	19,069円
第10期末	24,618円
既払分配金	0円
騰落率	29.1%

※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29.1%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（29.7%）を0.6%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10期：2023年1月27日～2024年1月26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。

企業の資本効率改善への期待、日銀の金融緩和継続姿勢、好調な企業業績等から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

▶ eMAXIS JPY日経400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400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日経インデックス400（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400インデックス
ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.6\%$ 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 $\Delta 0.6\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

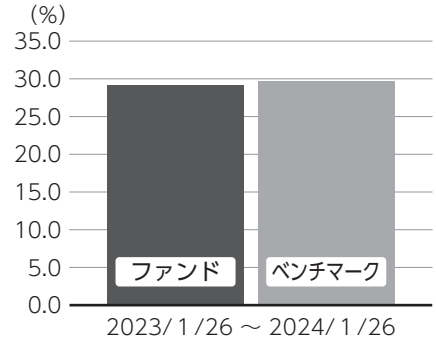
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

*訴訟和解金等が含まれます。

主なマイナス要因：組入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す。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10期 2023年1月27日～2024年1月26日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	14,618

(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 JPX日経400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。

▶ **JPX日経400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。

2023年1月27日～2024年1月26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	95	0.439	(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)	(42)	(0.192)	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)	(42)	(0.192)	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)	(12)	(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	2	0.009	(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)	(2)	(0.009)	
(c) その他費用	1	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)	(1)	(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	98	0.451	

期中の平均基準価額は、21,716円です。

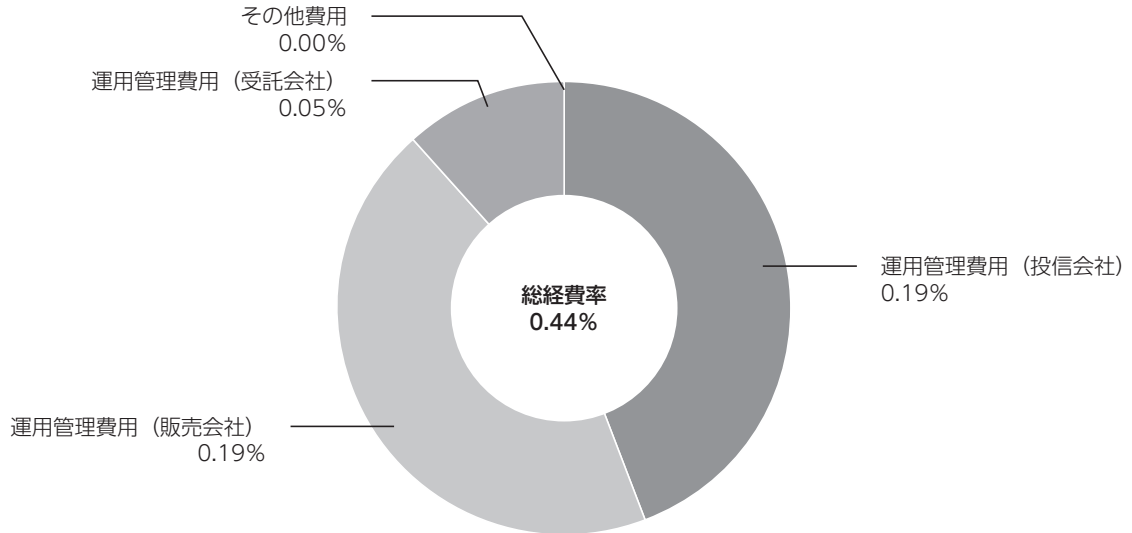
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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

(2023年1月27日～2024年1月26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
J P X日経400インデックスマザーファンド	千口 2,345,145	千円 5,302,682	千口 2,626,112	千円 5,927,334

○株式売買比率

(2023年1月27日～2024年1月26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	
	J P X日経400インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	10,842,912千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,157,689千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.32	

(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

(2023年1月27日～2024年1月26日)

利害関係人との取引状況

< eMAXIS J P X日経400インデックス >

該当事項はございません。

< J P X日経400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	B A	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	D C
株式	百万円 4,823	百万円 534	% 11.1	百万円 6,019	百万円 720	% 12.0

平均保有割合 84.3%

※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。

利害関係人の発行する有価証券等

< J P X日経400インデックスマザーファンド >

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 86	百万円 122	百万円 171

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

< J P X日経400インデックスマザーファンド >

種 類	買 付 額
株式	百万円 2

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三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2024年1月26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
J P X日経400インデックスマザーファンド	千口 3,331,465	千口 3,050,498	千円 7,840,696

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
J P X日経400インデックスマザーファンド	千円 7,840,696	% 99.5
コール・ローン等、その他	40,150	0.5
投資信託財産総額	7,880,846	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	7,880,846,665
コール・ローン等	40,150,142
JPX日経400インデックスマザーファンド(評価額)	7,840,696,523
(B) 負債	39,365,186
未払解約金	22,520,832
未払信託報酬	16,735,627
未払利息	10
その他未払費用	108,717
(C) 純資産総額(A-B)	7,841,481,479
元本	3,185,240,041
次期繰越損益金	4,656,241,438
(D) 受益権総口数	3,185,240,041口
1万口当たり基準価額(C/D)	24,618円

<注記事項>

- ①期首元本額 3,463,187,241円
 期中追加設定元本額 4,399,567,647円
 期中一部解約元本額 4,677,514,847円
 また、1口当たり純資産額は、期末2,4618円です。

○損益の状況 (2023年1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 8,601
受取利息	207
支払利息	△ 8,808
(B) 有価証券売買損益	1,017,828,728
売買益	1,675,681,392
売買損	△ 657,852,664
(C) 信託報酬等	△ 31,155,350
(D) 当期損益金(A+B+C)	986,664,777
(E) 前期繰越損益金	88,461,503
(F) 追加信託差損益金	3,581,115,158
(配当等相当額)	(2,289,241,879)
(売買損益相当額)	(1,291,873,279)
(G) 計(D+E+F)	4,656,241,438
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	4,656,241,438
追加信託差損益金	3,581,115,158
(配当等相当額)	(2,313,343,136)
(売買損益相当額)	(1,267,772,022)
分配準備積立金	1,075,126,280

- (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。

②分配金の計算過程

項 目	2023年1月27日～ 2024年1月26日
費用控除後の配当等収益額	167,281,312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	819,383,465円
収益調整金額	3,581,115,158円
分配準備積立金額	88,461,503円
当ファンドの分配対象収益額	4,656,241,438円
1万口当たり収益分配対象額	14,618円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—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】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
 (2023年10月1日)

J P X日経400インデックスマザーファンド

《第10期》決算日2024年1月26日

〔計算期間：2023年1月27日～2024年1月26日〕

「J P X日経400インデックスマザーファンド」は、1月26日に第10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10期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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。）を主要投資対象とし、J P X日経インデックス400（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。株式の組入比率は原則として高位を保ちます。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20%以下とします。

○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)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	円	騰落率	（配当込み）	騰落率			
6期(2020年1月27日)	15,747	13.2	17,515.49	13.2	97.2	2.8	6,370
7期(2021年1月26日)	17,774	12.9	19,751.22	12.8	97.6	2.4	6,206
8期(2022年1月26日)	18,427	3.7	20,502.60	3.8	93.9	6.1	6,968
9期(2023年1月26日)	19,821	7.6	22,073.83	7.7	99.2	0.9	8,201
10期(2024年1月26日)	25,703	29.7	28,625.99	29.7	97.5	2.5	9,073

(注) J P X日経インデックス400（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400銘柄で構成される株価指数です。「J P X日経インデックス400（配当込み）」（以下「J P X日経インデックス400」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日経インデックス400」自体及び「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日経インデックス400」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日経インデックス400」の構成銘柄、計算方法、その他「J P X日経インデックス400」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日経インデックス400 (配当込み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2023年1月26日	円 19,821	% —	22,073.83	% —	% 99.2	% 0.9
1月末	19,753	△ 0.3	21,999.20	△ 0.3	99.2	0.8
2月末	19,944	0.6	22,212.78	0.6	98.7	1.3
3月末	20,283	2.3	22,588.54	2.3	97.0	2.4
4月末	20,800	4.9	23,167.58	5.0	97.2	2.4
5月末	21,718	9.6	24,192.59	9.6	97.5	2.5
6月末	23,360	17.9	26,022.39	17.9	98.5	1.5
7月末	23,674	19.4	26,371.68	19.5	96.2	2.6
8月末	23,723	19.7	26,425.20	19.7	98.3	1.3
9月末	23,755	19.8	26,461.72	19.9	98.2	1.8
10月末	22,928	15.7	25,542.53	15.7	98.1	1.9
11月末	24,365	22.9	27,146.11	23.0	98.0	2.0
12月末	24,337	22.8	27,099.47	22.8	99.1	0.9
(期 末) 2024年1月26日	25,703	29.7	28,625.99	29.7	97.5	2.5

(注) 騰落率は期首比。

(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

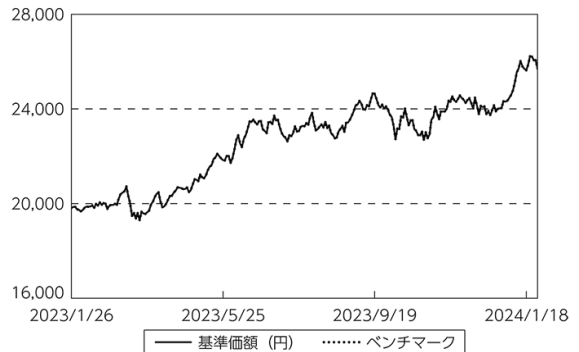
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ29.7%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(29.7%)と同程度となりました。

基準価額等の推移



(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。

企業の資本効率改善への期待、日銀の金融緩和継続姿勢、好調な企業業績等から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J P X日経インデックス400（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29.7%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.0\%$ 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。

※訴訟和解金等が含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・ 組入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

(2023年1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料	円	%	(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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(2)	(0.009)	
合 計	2	0.009	
期中の平均基準価額は、22,624円です。			

(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) 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。

○ 売 買 及 び 取 引 の 状 況

(2023年1月27日～2024年1月26日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 1,842 (930)	千円 4,823,327 ()	千株 2,234	千円 6,019,584

(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

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 6,592	百万円 6,504	百万円 100	百万円 101

○株式売買比率

(2023年1月27日～2024年1月26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	10,842,912千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	8,157,689千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.32

(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

(2023年1月27日～2024年1月26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		売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 4,823	百万円 534	% 11.1	百万円 6,019	百万円 720	% 12.0

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
株式	百万円 86	百万円 122	百万円 171

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 2

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三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、三菱HCキャピタル、アコム、ジャックス、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2024年1月26日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
水産・農林業 (0.0%)				
ニッスイ	5.5	4.9		3,850
鉱業 (0.4%)				
三井松島ホールディングス	—	0.3		851
I N P E X	20.4	18.2		36,117
建設業 (2.2%)				
ウエストホールディングス	0.5	0.4		1,324
ショーボンドホールディングス	0.8	0.7		4,571
ミライト・ワン	1.9	1.6		3,058
タマホーム	—	0.3		1,209
安藤・間	3.2	2.8		3,239
コムシスホールディングス	1.9	1.6		5,128
大成建設	3.8	3.2		16,940
大林組	13.8	12.3		16,500
清水建設	11.6	9.7		9,581
長谷工コーポレーション	4	3.2		6,016
鹿島建設	8.6	7.6		19,695
西松建設	0.7	—		—
戸田建設	4.7	—		—
熊谷組	0.7	—		—
五洋建設	5.5	—		—
住友林業	3	3		12,969
大和ハウス工業	10.8	9.5		42,693
積水ハウス	12.1	10.4		35,235
関電工	2.1	2.2		3,124
エクシオグループ	1.8	1.7		5,424
九電工	0.9	0.7		3,544
インフロニア・ホールディングス	4	4		6,196
食料品 (3.7%)				
森永製菓	0.7	1.5		4,116
カルビー	1.8	1.6		4,923
森永乳業	0.7	1.2		3,510
ヤクルト本社	2.8	4.9		15,733
明治ホールディングス	2.4	4.2		14,863

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
プリマハム	0.5	—		—
日本ハム	1.5	1.5		7,414
アサヒグループホールディングス	8.9	8		43,480
キリンホールディングス	17.5	14.4		30,052
宝ホールディングス	2.6	2.4		2,964
サントリー食品インターナショナル	2.7	2.4		11,481
キッコーマン	2.6	2.3		21,024
味の素	9.5	8.2		48,585
キュービー	2.1	—		—
カゴメ	1.8	—		—
ニチレイ	1.8	1.6		5,656
東洋水産	2	1.7		13,302
日清食品ホールディングス	1.4	3.6		17,341
日本たばこ産業	25.5	21		79,065
繊維製品 (0.3%)				
帝人	3.8	—		—
東レ	26.4	23.5		16,974
ゴールドウイン	0.7	0.6		5,940
パルプ・紙 (0.1%)				
王子ホールディングス	16.4	14.6		8,355
大王製紙	1.7	—		—
レンゴー	3.6	3.2		3,045
化学 (6.8%)				
クラレ	6.3	5.1		7,746
旭化成	24.6	23.7		26,105
住友化学	29.2	26.1		8,910
日産化学	1.9	1.6		9,448
東ソー	5.3	4.7		8,789
トクヤマ	1.3	1.1		2,714
デンカ	1.4	1.3		3,320
信越化学工業	6.6	28.2		161,868
エア・ウォーター	3.7	3.3		6,357
日本酸素ホールディングス	3.8	3.4		12,603
三菱瓦斯化学	2.9	2.6		6,199

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
三井化学	3.3	2.9	12,499
東京応化工業	—	1.7	5,754
三菱ケミカルグループ	26.6	25.7	22,795
KHネオケム	0.7	0.5	1,159
ダイセル	5.8	4.5	6,414
住友ベークライト	—	0.5	3,680
積水化学工業	8.1	7.1	15,300
日本ゼオン	2.4	2.4	3,189
アイカ工業	1	0.9	3,081
UBE	2	—	—
扶桑化学工業	—	0.4	1,680
ADEKA	—	1.2	3,425
日油	1.2	1.1	7,263
花王	9.6	7.9	46,215
日本ペイントホールディングス	17.4	18.6	21,520
関西ペイント	3.6	3.4	8,382
太陽ホールディングス	—	0.6	1,869
富士フイルムホールディングス	7.6	6.5	59,923
資生堂	8.2	7.3	29,557
ライオン	4.7	4.6	5,986
ファンケル	1.7	—	—
コーセー	0.8	0.7	6,645
小林製薬	1.1	1	6,804
タカラバイオ	1.1	0.9	1,128
デクセリアルズ	1.1	0.9	3,774
日東電工	2.9	2.3	25,886
エフピコ	0.7	—	—
ニフコ	1.4	1.1	4,184
ユニ・チャーム	8.2	7.3	37,003
医薬品 (5.6%)			
協和キリン	4.8	4.2	9,821
武田薬品工業	30.3	27.2	117,232
アステラス製薬	37.8	30.8	51,990
住友ファーマ	2.9	—	—
塩野義製薬	5	4.4	31,253
日本新薬	0.9	0.9	4,725
中外製薬	12.3	11	59,576
科研製薬	0.7	—	—
エーザイ	4.8	4.3	29,906

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ロート製薬	3.8	3.4	10,383
小野薬品工業	7.6	7.5	19,927
参天製薬	7.4	—	—
JCRファーマ	1.3	1.2	1,326
東和薬品	0.6	—	—
第一三共	34.4	27.1	116,069
大塚ホールディングス	9	7.3	42,230
ペプチドリーム	1.9	1.7	2,264
石油・石炭製品 (0.6%)			
出光興産	4.4	19.5	15,882
ENEOSホールディングス	71.3	55.6	32,887
コスモエネルギーホールディングス	1.6	1	6,088
ゴム製品 (0.9%)			
横浜ゴム	2.2	1.8	6,226
TOYO TIRE	2.3	2	4,833
ブリヂストン	12.6	10.3	64,673
住友ゴム工業	3.9	3.4	5,640
ガラス・土石製品 (0.6%)			
AGC	4	3.1	16,950
太平洋セメント	2.5	—	—
東海カーボン	3.3	—	—
TOTO	2.6	2.3	9,218
日本碍子	4.7	4.1	7,462
日本特殊陶業	3	2.9	11,202
MARUWA	0.1	0.1	2,872
フジミインコーポレーテッド	—	0.9	2,682
ニチアス	1	0.9	3,046
鉄鋼 (1.0%)			
日本製鉄	18.2	16.2	56,181
JFEホールディングス	10.8	10.1	23,088
東京製鐵	1.1	1	1,759
丸一銅管	—	1.1	4,165
日本冶金工業	—	0.3	1,390
非鉄金属 (0.6%)			
大紀アルミニウム工業所	—	0.5	619
三井金属鉱業	1.2	1.1	5,067
住友金属鉱山	4.7	4.2	17,224
DOWAホールディングス	0.9	0.9	4,711
住友電気工業	14	13.5	25,758

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
AREホールディングス	1.6	1.4	2,811	
金属製品 (0.3%)				
SUMCO	7.7	6.4	14,544	
三和ホールディングス	3.7	3.6	8,244	
リンナイ	0.7	1.8	6,053	
機械 (6.3%)				
三浦工業	1.7	1.5	4,109	
アマダ	6.3	5.6	8,775	
FUJ I	1.7	1.7	4,227	
DMG森精機	2.4	2.1	6,100	
ディスコ	0.6	1.7	67,320	
オプトラン	0.6	—	—	
ナブテスコ	2.5	2.2	6,319	
SMC	1.3	1.1	90,332	
小松製作所	18.6	16.6	64,806	
住友重機械工業	2.4	2.1	7,812	
日立建機	1.6	1.4	5,735	
ローツェ	0.2	0.2	3,256	
クボタ	21	18.6	41,106	
荏原製作所	1.6	1.5	13,795	
ダイキン工業	4.7	4.2	100,443	
オルガノ	—	0.4	2,444	
ダイフク	2	6	17,418	
SANKYO	—	0.8	7,023	
竹内製作所	0.7	0.6	2,823	
セガサミーホールディングス	—	3.2	6,843	
ホシザキ	2.6	2.1	11,138	
マキタ	4.9	4	15,752	
三菱重工業	6.9	6.2	58,311	
I H I	2.5	2.6	7,281	
電気機器 (17.9%)				
イビデン	2.3	1.8	13,437	
ブラザー工業	5.3	4.7	11,627	
ミネベアミツミ	6.9	6.2	18,637	
日立製作所	16.8	13.7	153,029	
三菱電機	41.1	39.4	84,808	
富士電機	2.4	2.2	16,013	
安川電機	4.7	3.8	21,979	
ニデック	9.6	7.8	43,898	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
オムロン	3.6	2.7	18,260	
MC J	1.6	1.5	1,836	
日本電気	5.6	4.6	42,605	
富士通	4	3.3	68,062	
ルネサスエレクトロニクス	25.9	23.1	57,311	
セイコーエプソン	5.3	4.5	9,861	
ワコム	3.1	2.7	1,803	
アルバック	0.9	0.8	5,797	
エレコム	0.9	0.8	1,383	
パナソニック ホールディングス	46.9	41.8	58,311	
シャープ	4.8	—	—	
アンリツ	2.8	2.5	3,372	
ソニーグループ	10.4	9.5	133,047	
TDK	6.3	5.6	40,605	
ヒロセ電機	—	0.5	8,750	
横河電機	4.3	3.9	11,456	
アズビル	2.7	2.4	11,527	
日本光電工業	1.8	1.5	6,684	
堀場製作所	0.9	0.7	8,249	
アドバンテスト	3.1	10	57,160	
キーエンス	2.4	1.8	119,412	
シスメックス	3.4	3	23,736	
フェローテックホールディングス	1.2	1.1	3,229	
レーザーテック	1.9	1.6	64,016	
日本電子	—	0.9	6,256	
カシオ計算機	2.9	—	—	
ファナック	3.9	17.1	73,530	
ローム	—	6.5	16,942	
浜松トニクス	3.2	2.8	16,646	
三井ハイテック	—	0.3	2,057	
新光電気工業	1.4	1.2	6,561	
京セラ	6.1	21.8	47,142	
太陽誘電	1.9	1.7	6,211	
村田製作所	11.9	31.9	95,189	
小糸製作所	4.7	3.6	8,411	
S C R E E Nホールディングス	0.7	1.2	17,136	
東京エレクトロン	2.6	6	167,820	
輸送用機器 (6.5%)				
トヨタ紡織	1.7	1.5	3,638	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
豊田自動織機	2.9	3	37,950	
デンソー	8.1	28.9	66,022	
いすゞ自動車	11.4	10.2	20,706	
トヨタ自動車	58.8	53.4	154,459	
カヤバ	—	0.3	1,524	
アイシン	3	2.7	14,555	
マツダ	—	11.6	19,754	
本田技研工業	32	85.1	134,755	
スズキ	7.2	6.4	40,307	
SUBARU	12.4	10.9	31,626	
ヤマハ発動機	6.2	15.1	20,966	
豊田合成	1.1	1	2,817	
シマノ	1.6	1.4	30,128	
テイ・エス テック	1.8	—	—	
精密機器 (2.9%)				
テルモ	12.3	9.8	48,343	
島津製作所	4.8	4.7	19,246	
ナカニシ	—	1.5	3,759	
東京精密	0.9	0.7	6,720	
オリンパス	24.6	21.6	46,861	
HOYA	8.4	6.7	121,873	
朝日インテック	5.2	3.9	11,232	
その他製品 (2.2%)				
バンダイナムコホールディングス	3.6	9.6	30,249	
パイロットコーポレーション	0.6	0.5	2,058	
ヤマハ	2.5	2.2	7,180	
ビジョン	2.5	2.2	3,555	
任天堂	19.6	18.8	148,426	
電気・ガス業 (1.2%)				
中部電力	14.5	12.9	23,968	
関西電力	15.2	13.5	25,960	
九州電力	9.1	—	—	
北海道電力	3.8	—	—	
電源開発	3	2.9	7,042	
イーレックス	0.7	0.6	468	
レノバ	1	0.9	1,072	
東京瓦斯	8.3	7.4	24,383	
大阪瓦斯	8	7.1	21,214	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
陸運業 (0.5%)				
SBSホールディングス	0.4	0.3	756	
東海旅客鉄道	3	—	—	
ヤマトホールディングス	5	4.5	11,659	
山九	1	0.9	4,674	
センコーグループホールディングス	2.1	1.9	2,167	
日立物流	0.2	—	—	
AZ-COM丸和ホールディングス	0.9	0.9	1,395	
SGホールディングス	7.5	5.9	11,841	
NIPPON EXPRESSホールディン	1.5	1.2	10,484	
海運業 (1.2%)				
日本郵船	10.5	10	49,700	
商船三井	6.9	7.6	38,858	
川崎汽船	3.3	3	21,018	
NSユナイテッド海運	—	0.2	1,020	
倉庫・運輸関連業 (0.0%)				
三井倉庫ホールディングス	0.4	0.3	1,489	
情報・通信業 (8.8%)				
NECネットエスアイ	1.3	1.4	3,152	
システナ	6.6	5.3	1,600	
日鉄ソリューションズ	0.7	0.6	2,901	
T I S	4.4	3.8	12,597	
コーエーテックモホールディングス	2.5	2.2	3,933	
ネクソン	10.2	7.9	18,786	
SHIFT	—	0.2	5,320	
ティーガイア	0.4	0.4	789	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.2	0.9	2,230	
GMOペイメントゲートウェイ	0.9	0.7	6,120	
インターネットイニシアティブ	2.2	1.7	5,015	
ラクス	1.9	1.7	4,136	
チェンジホールディングス	1	0.8	1,128	
野村総合研究所	8.1	7.8	33,828	
インフォコム	0.5	—	—	
オービック	1.3	1.2	27,318	
ジャストシステム	0.6	0.5	1,600	
L I N Eヤフー	56.1	50	23,395	
トレンドマイクロ	2.3	1.7	13,926	
日本オラクル	0.8	0.7	8,179	
伊藤忠テクノソリューションズ	2.1	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
大塚商会	2.2	1.7	10,427
電通総研	0.5	0.4	2,256
東映アニメーション	0.2	0.2	3,480
デジタルガレージ	0.7	0.6	2,157
ネットワンシステムズ	1.5	1.4	3,323
B I P R O G Y	1.5	1.1	4,763
USEN-NEXT HOLDINGS	0.4	0.4	1,718
日本電信電話	30.8	671	123,061
KDD I	25.9	27.2	132,164
ソフトバンク	63.4	56.6	109,436
光通信	0.5	0.4	10,128
GMOインターネットグループ	1.5	1.3	3,432
KADOKAWA	—	1.9	5,971
東宝	2.5	2	9,578
NTTデータグループ	12.4	9.2	19,347
D T S	0.8	0.7	2,537
スクウェア・エニックス・ホールディングス	2	1.6	9,339
カブコン	3.9	3.1	17,065
S C S K	3.2	2.5	7,131
NSD	1.4	1.3	3,588
コナミグループ	1.7	1.3	11,533
ソフトバンクグループ	19.3	17.3	112,796
卸売業 (8.1%)			
双日	4.4	4.1	14,013
アルフレッサ ホールディングス	4.2	3.7	8,889
神戸物産	3.2	2.9	11,107
ダイワボウホールディングス	1.7	1.6	5,153
マクニカホールディングス	—	0.9	7,200
TOKAIホールディングス	2.1	—	—
シップヘルスケアホールディングス	1.5	1.3	2,999
メディカルホールディングス	4.3	3.8	8,711
I D O M	—	1	859
伊藤忠商事	25.6	23.6	154,226
丸紅	32.9	30.9	75,998
豊田通商	3.6	3.2	30,332
兼松	1.6	1.6	3,556
三井物産	30.4	24.2	140,432
住友商事	25.8	22.4	73,852
三菱商事	26	57.8	143,199

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キヤノンマーケティングジャパン	—	0.9	3,925
阪和興業	0.7	0.7	3,724
岩谷産業	0.9	0.8	5,220
稲畑産業	—	0.7	2,198
伊藤忠エネクス	—	0.9	1,421
加賀電子	—	0.3	2,028
P A L T A C	0.7	0.5	2,278
日鉄物産	0.3	—	—
ミスミグループ本社	6.3	5.6	13,708
小売業 (4.0%)			
ローソン	1	0.8	6,628
エービーシー・マート	0.6	1.6	4,183
アスクル	—	0.8	1,675
日本マクドナルドホールディングス	2.3	2.3	14,835
セリア	1.1	1.1	3,011
M o n o t a R O	5.9	5.3	7,629
マツキヨココカラ&カンパニー	2.5	6.7	17,842
Z O Z O	2.8	2.4	7,819
ウエルシアホールディングス	2.2	1.9	4,565
クリエイトSDホールディングス	0.7	0.6	1,905
ネクステージ	0.9	0.8	1,812
コスモス薬品	0.5	0.4	6,266
セブン&アイ・ホールディングス	14.3	12.8	74,278
ツルハホールディングス	1	0.8	9,972
クスリのアオキホールディングス	0.4	1	3,250
FOOD & LIFE COMPANIE	2.4	2	5,854
ノジマ	1.4	1.1	2,041
良品計画	5.4	4	9,128
コーナン商事	0.6	0.5	1,940
パン・パシフィック・インターナショナルホ	9.3	7.5	23,782
ゼンショーホールディングス	2.3	1.9	13,541
ワークマン	0.5	0.4	1,644
V T ホールディングス	—	1.4	736
スギホールディングス	0.8	0.7	4,850
日本瓦斯	2.2	2	4,681
ライフコーポレーション	0.4	0.4	1,488
コメリ	—	0.6	1,983
しまむら	—	0.4	6,530
丸井グループ	3.1	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
イズミ	0.6	0.7	2,398	
ヤオコー	0.5	0.4	3,361	
ケーズホールディングス	3.3	2.6	3,429	
ニトリホールディングス	1.7	1.3	24,693	
ファーストリテイリング	0.6	1.7	66,079	
サンドラッグ	1.6	1.3	5,903	
銀行業 (6.0%)				
めぶきフィナンシャルグループ	19.2	17.1	7,501	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	21.3	18.5	12,796	
SBI新生銀行	1.1	—	—	
あおぞら銀行	2.4	—	—	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	152.3	112.5	150,862	
りそなホールディングス	49.4	40.2	32,079	
三井住友トラスト・ホールディングス	7	12.4	36,412	
三井住友フィナンシャルグループ	28.3	19.5	145,080	
千葉銀行	10.8	9.6	10,262	
ふくおかフィナンシャルグループ	3.1	3	10,491	
セブン銀行	13.9	10.8	3,290	
みずほフィナンシャルグループ	56	46.6	121,626	
証券、商品先物取引業 (1.1%)				
GMOフィナンシャルホールディングス	0.9	—	—	
SBIホールディングス	—	5.1	18,196	
ジャフコグループ	1.3	1	1,712	
大和証券グループ本社	27.7	26.7	27,687	
野村ホールディングス	71.3	58	43,105	
マネックスグループ	4.3	3.4	2,543	
保険業 (3.0%)				
SOMPOホールディングス	6.6	5.2	38,953	
MS&ADインシュアランスグループホール	7.9	7.7	45,838	
第一生命ホールディングス	19.7	16.9	53,201	
東京海上ホールディングス	39	34.1	127,295	
T&Dホールディングス	10.4	—	—	
その他金融業 (1.4%)				
全国保証	1	0.9	4,905	
芙蓉総合リース	0.4	0.3	3,895	
みずほリース	0.6	0.6	3,168	
東京センチュリー	0.7	2.6	4,183	
イオンフィナンシャルサービス	2.2	2	2,632	
アコム	6.1	6.1	2,256	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ジャックス	—	0.4	2,288	
オリエントコーポレーション	1	1.1	1,225	
オリックス	25.9	21	59,220	
三菱HCキャピタル	15.1	15.4	15,669	
日本取引所グループ	10.9	9	28,476	
不動産業 (2.3%)				
大東建託	1.4	1.3	20,995	
ヒューリック	9	8.1	12,510	
野村不動産ホールディングス	2.4	1.9	7,472	
プレサンスコーポレーション	0.5	0.5	822	
オープンハウスグループ	1.4	1.3	5,837	
東急不動産ホールディングス	11.6	10.4	10,205	
飯田グループホールディングス	3.4	3.3	7,398	
ケイアイスター不動産	0.2	0.2	698	
三井不動産	16.8	16	58,272	
三菱地所	23.4	22.6	45,798	
東京建物	3.7	3	6,637	
住友不動産	7	5	22,740	
スターツコーポレーション	0.6	0.5	1,505	
日本エスコン	0.9	—	—	
イオンモール	2	—	—	
カチタス	1	0.9	1,727	
サービス業 (3.5%)				
日本M&Aセンターホールディングス	—	5.7	4,304	
UTグループ	0.6	0.5	1,190	
パソナグループ	—	0.4	1,095	
エス・エム・エス	1.5	1.3	3,454	
パーソルホールディングス	4.5	36.7	8,631	
総合警備保障	1.5	6	4,774	
カカコム	3	2.4	4,065	
ディップ	0.7	0.6	1,561	
ベネフィット・ワン	1.9	1.3	2,769	
エムスリー	8	7.1	16,890	
博報堂DYホールディングス	5.2	4.6	5,227	
パリュエコマース	0.3	—	—	
H. U. グループホールディングス	1.2	1.1	2,974	
ピー・エム・エル	0.5	0.4	1,137	
ユー・エス・エス	4.2	4	11,266	
サイバーエージェント	9.7	8	7,610	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
フルキャストホールディングス	0.4	0.3		542
エン・ジャパン	0.7	—		—
テクノプロ・ホールディングス	2.7	2.1		7,360
ジャパンマテリアル	1.2	1.1		2,750
リクルートホールディングス	28.5	26.7	157,423	
ベルシステム24ホールディングス	0.5	0.4		708
ベイカレント・コンサルティング	3.2	2.6		9,009
ジャパンエレベーターサービスホールディン	1.4	1.2		2,676

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
リログループ	2.3	1.8		2,808
トランス・コスモス	0.5	0.4		1,250
セコム	4.1	3.7		39,312
メイテックグループホールディングス	1.6	1.3		3,759
イオンディライト	0.4	0.4		1,480
合 計	株 数・金 額	2,843	3,382	8,848,644
	銘柄数<比率>	400	399	<97.5%>

(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	J P X日経400	百万円 225	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 8,848,644	% 96.8
コール・ローン等、その他	296,283	3.2
投資信託財産総額	9,144,927	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,144,502,040
コール・ローン等	271,948,507
株式(評価額)	8,848,644,220
未収配当金	12,520,410
差入委託証拠金	11,388,903
(B) 負債	71,106,048
未払金	71,105,940
未払解約金	39
未払利息	69
(C) 純資産総額(A-B)	9,073,395,992
元本	3,530,156,300
次期繰越損益金	5,543,239,692
(D) 受益権総口数	3,530,156,300口
1万口当たり基準価額(C/D)	25,703円

<注記事項>

- ①期首元本額 4,137,819,966円
 期中追加設定元本額 2,416,526,963円
 期中一部解約元本額 3,024,190,629円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.5703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)

eMAXIS J P X日経400インデックス	3,050,498,589円
国内株式セレクション(ラップ向け)	466,165,014円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	10,967,442円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	1,703,210円
国際 J P X日経インデックス400オープン(適格機関投資家専用)	822,045円
合計	3,530,156,300円

【お知らせ】

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。
 2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。
 (2023年10月1日)

○損益の状況 (2023年1月27日～2024年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	212,615,948
受取配当金	208,278,407
受取利息	1,322
その他収益金	4,428,117
支払利息	△ 91,898
(B) 有価証券売買損益	1,913,101,343
売買益	2,153,124,570
売買損	△ 240,023,227
(C) 先物取引等取引損益	66,275,132
取引益	97,248,013
取引損	△ 30,972,881
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,191,992,423
(E) 前期繰越損益金	4,063,570,502
(F) 追加信託差損益金	3,042,835,502
(G) 解約差損益金	△3,755,158,735
(H) 計(D+E+F+G)	5,543,239,692
次期繰越損益金(H)	5,543,239,692

(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。