

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（2015年11月6日設定）	
運用方針	<p>JAPAN クオリティ150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。）に実質的な投資を行い、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（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。</p>	
主要運用対象	ベビードファンド	JAPAN クオリティ150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（上場予定株式を含みます。）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（上場予定株式を含みます。）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	<p>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。</p> <p>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。）</p>	

運用報告書（全体版）




イーマックス

eMAXIS JAPAN クオリティ150インデックス



第9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 JAPAN クオリティ150インデックス」は、去る1月26日に第9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。

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			iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス		株式 組入比率	株式 先物比率	純資産 総額		
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落	期 騰 落	中 率					
	円	円			%	%	%	百万円		
5期(2020年1月27日)	13,072	0			19.4	270.84	19.6	99.5	0.6	1,186
6期(2021年1月26日)	15,801	0			20.9	328.59	21.3	99.6	0.4	1,611
7期(2022年1月26日)	15,475	0		△	2.1	322.52	△	99.2	0.8	2,086
8期(2023年1月26日)	15,636	0			1.0	326.36	1.2	98.7	1.3	1,845
9期(2024年1月26日)	19,933	0			27.5	417.04	27.8	99.5	0.5	2,237

(注) iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)とは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、流動性によりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し、高ROEの継続性を評価して150銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)は、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとSTOXXリミテッド(以下「STOXX社」)が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。2001年6月18日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。STOXX社は、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)及びそれに含まれるデータの発行元です。STOXX社は、報告された情報の作成に何ら関与するものではなく、かつ報告された情報、又はiSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス(配当込み)若しくはそのデータに関するエラー、遺漏若しくは中断について、何ら保証するものではなく、(過失の有無を問わず)いかなる責任も負うものではありません。これらについては、正確性、妥当性、正当性、完全性、適時性及び目的への適合性を含みますが、これらに限定されません。STOXX社に關係する情報の流布又は再配信は、一切禁止されています。

(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		iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス (配当込み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
		騰 落 率		騰 落 率		
(期 首) 2023年1月26日	円 15,636	% —	326.36	% —	% 98.7	% 1.3
1月末	15,549	△ 0.6	324.55	△ 0.6	98.7	1.3
2月末	15,525	△ 0.7	324.08	△ 0.7	96.7	0.9
3月末	16,143	3.2	337.02	3.3	98.7	1.3
4月末	16,447	5.2	343.47	5.2	98.6	1.4
5月末	17,293	10.6	361.18	10.7	98.6	1.4
6月末	18,389	17.6	384.11	17.7	98.5	1.5
7月末	18,435	17.9	385.15	18.0	98.4	1.5
8月末	18,386	17.6	384.26	17.7	98.5	1.5
9月末	18,057	15.5	377.18	15.6	97.9	2.0
10月末	17,520	12.0	366.11	12.2	98.7	2.0
11月末	18,972	21.3	396.74	21.6	98.5	1.5
12月末	19,055	21.9	398.61	22.1	99.5	0.5
(期 末) 2024年1月26日	19,933	27.5	417.04	27.8	99.5	0.5

(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9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9期首	15,636円
第9期末	19,933円
既払分配金	0円
騰落率	27.5%

※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27.5%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（27.8%）を0.3%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9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 JAPAN クオリティ150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。

▶ JAPAN クオリティ150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iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（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 JAPAN クオリティ150インデックス

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.3\%$ 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 $\Delta 0.5\%$ 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 0.2% 程度でした。

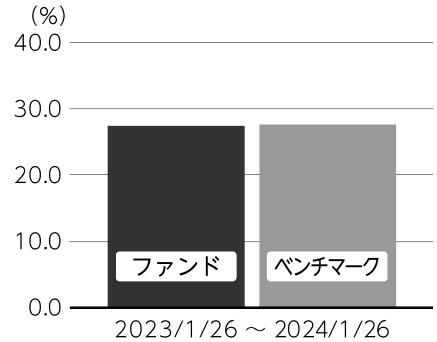
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

*配当評価差異等が含まれます。

主なマイナス要因：銘柄選択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9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	9,933

(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 JAPAN クオリティ150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。

▶ JAPAN クオリティ150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	78	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)	(34)	(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)	(34)	(0.192)	交付運用報告書等各种書類の送付、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	0	0.001	(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)	(0)	(0.001)	
(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	79	0.443	

期中の平均基準価額は、17,662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。

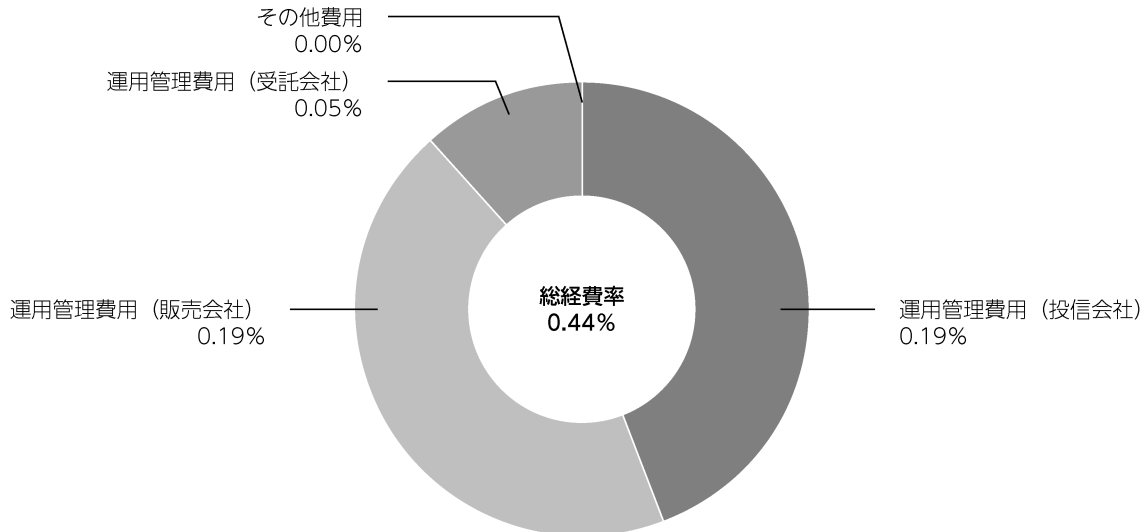
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	千口 337,435	千円 629,231	千口 398,389	千円 734,721

○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	
	JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	6,493,224千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,522,729千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.43	

(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 JAPAN クオリティ150インデックス>

該当事項はございません。

<JAPAN クオリティ150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 3,000	百万円 355	% 11.8	百万円 3,492	百万円 330	% 9.5

平均保有割合 42.7%

※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三菱UFJモルガン・スタンレー証券、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
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	千口 1,143,273	千口 1,082,318	千円 2,236,828

○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
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド	千円 2,236,828	% 99.4
コール・ローン等、その他	13,619	0.6
投資信託財産総額	2,250,447	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	2,250,447,249
コール・ローン等	10,387,595
JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド(評価額)	2,236,828,173
未収入金	3,231,481
(B) 負債	13,395,044
未払解約金	8,751,754
未払信託報酬	4,613,367
未払利息	2
その他未払費用	29,921
(C) 純資産総額(A-B)	2,237,052,205
元本	1,122,262,907
次期繰越損益金	1,114,789,298
(D) 受益権総口数	1,122,262,907口
1万口当たり基準価額(C/D)	19,933円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,180,215,301円
 期中追加設定元本額 593,418,652円
 期中一部解約元本額 651,371,046円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.9933円です。

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	38,386,694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	282,393,110円
収益調整金額	708,561,874円
分配準備積立金額	85,447,620円
当ファンドの分配対象収益額	1,114,789,298円
1万口当たり収益分配対象額	9,933円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

○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	△ 1,535
受取利息	41
支払利息	△ 1,576
(B) 有価証券売買損益	374,564,171
売買益	485,846,511
売買損	△ 111,282,340
(C) 信託報酬等	△ 8,767,517
(D) 当期損益金(A+B+C)	365,795,119
(E) 前期繰越損益金	40,432,305
(F) 追加信託差損益金	708,561,874
(配当等相当額)	(537,782,062)
(売買損益相当額)	(170,779,812)
(G) 計(D+E+F)	1,114,789,298
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	1,114,789,298
追加信託差損益金	708,561,874
(配当等相当額)	(540,039,276)
(売買損益相当額)	(168,522,598)
分配準備積立金	406,227,424

- (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。

*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】

- ①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)
- ②新NISA (成長投資枠) の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
(2023年10月26日)

JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド

《第9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]

「JAPAN クオリティ150インデックスマザーファンド」は、1月26日に第9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9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、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（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（上場予定株式を含みます。）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		iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス (配当込み)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	円	騰落率	騰落率	騰落率			
5期(2020年1月27日)	13,315	19.9%	270.84	19.6%	99.5%	0.6%	3,025 百万円
6期(2021年1月26日)	16,166	21.4%	328.59	21.3%	99.6%	0.4%	4,814
7期(2022年1月26日)	15,903	△1.6%	322.52	△1.8%	99.2%	0.8%	5,018
8期(2023年1月26日)	16,140	1.5%	326.36	1.2%	98.7%	1.3%	4,569
9期(2024年1月26日)	20,667	28.0%	417.04	27.8%	99.5%	0.5%	5,116

(注) iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（配当込み）とは、東京証券取引所を主たる市場とする普通株式等の中から時価総額、流動性によりスクリーニングされる投資ユニバースのうち、高ROEかつ、①財務健全性、②キャッシュフロー収益性、③利益安定性の3点に着目し、高ROEの継続性を評価して150銘柄を選定し算出される株価指数です。iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（配当込み）は、三菱UFJ信託銀行が有するアクティブ運用機関としてのノウハウとSTOXXリミテッド（以下「STOXX社」）が有する指数提供機関としての経験を活用し、両社で共同開発したものです。2001年6月18日の時価総額を100として、STOXX社が算出・公表しています。STOXX社は、iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（配当込み）及びそれに含まれるデータの発行元です。STOXX社は、報告された情報の作成に何ら関与するものではなく、かつ報告された情報、又はiSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（配当込み）若しくはそのデータに関するエラー、遺漏若しくは中断について、何ら保証するものではなく、（過失の有無を問わず）いかなる責任も負うものではありません。これらについては、正確性、妥当性、正当性、完全性、適時性及び目的への適合性を含みますが、これらに限定されません。STOXX社に關係する情報の流布又は再配信は、一切禁止されています。

(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		i STOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス (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	%		%	%	%
	16,140	—	326.36	—	98.7	1.3
1月末	16,051	△ 0.6	324.55	△ 0.6	98.7	1.3
2月末	16,031	△ 0.7	324.08	△ 0.7	96.7	0.9
3月末	16,676	3.3	337.02	3.3	98.7	1.3
4月末	16,996	5.3	343.47	5.2	98.6	1.4
5月末	17,877	10.8	361.18	10.7	98.6	1.4
6月末	19,017	17.8	384.11	17.7	98.5	1.5
7月末	19,072	18.2	385.15	18.0	98.4	1.5
8月末	19,028	17.9	384.26	17.7	98.5	1.5
9月末	18,694	15.8	377.18	15.6	97.9	2.0
10月末	18,146	12.4	366.11	12.2	98.7	2.0
11月末	19,657	21.8	396.74	21.6	98.5	1.5
12月末	19,750	22.4	398.61	22.1	99.5	0.5
(期 末) 2024年1月26日	20,667	28.0	417.04	27.8	99.5	0.5

(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

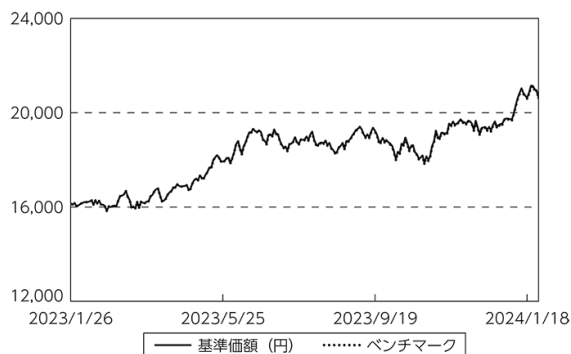
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ28.0%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(27.8%)を0.2%上回りました。

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 iSTOXX MUTB JAPAN クオリティ150インデックス（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27.8%の上昇になったため、乖離は0.2%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。
※配当評価差異等が含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・銘柄選択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	0.001	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、18,272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 865 (677)	千円 3,000,787 ()	千株 897	千円 3,492,436

(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 823	百万円 870	百万円 -	百万円 -

○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	6,493,224千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	4,522,729千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.43

(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			売付額等 C		
	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$		うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$	
株式	百万円 3,000	百万円 355	% 11.8	百万円 3,492	百万円 330	% 9.5

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、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
鉱業 (1.0%)				
INPEX	—	26.3	52,192	
建設業 (0.3%)				
ショーボンドホールディングス	1.6	1.2	7,837	
積水ハウス	23	—	—	
九電工	—	1.4	7,088	
食料品 (5.3%)				
森永製菓	1.5	—	—	
寿スピリッツ	0.7	—	—	
カルビー	3	2.1	6,461	
森永乳業	—	2.4	7,021	
ヤクルト本社	5.3	8.2	26,330	
明治ホールディングス	4.7	7.3	25,834	
キッコーマン	6.5	5.1	46,619	
ニチレイ	4.5	3.5	12,372	
東洋水産	—	2.7	21,127	
日清食品ホールディングス	—	6.6	31,792	
日本たばこ産業	31.9	25.1	94,501	
繊維製品 (0.3%)				
ゴールドウイン	1.4	1.1	10,890	
デサント	—	1.2	4,296	
化学 (5.9%)				
日産化学	3.5	2.7	15,943	
東ソー	10.9	—	—	
信越化学工業	5.3	19.1	109,634	
日本酸素ホールディングス	—	5.6	20,759	
東京応化工業	1.4	—	—	
積水化学工業	14.7	—	—	
日油	2.8	2.1	13,866	
関西ペイント	—	6.3	15,532	
ミルボン	1.1	—	—	
ファンケル	—	2.1	4,954	
ポーラ・オルビスホールディングス	3.4	—	—	
小林製薬	2.1	1.7	11,566	

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
デクセリアルズ	2	1.5	6,291	
日東電工	3.7	2.7	30,388	
ニフコ	2.8	2.4	9,129	
ユニ・チャーム	15.7	12.3	62,348	
医薬品 (4.2%)				
塩野義製薬	9.9	8.1	57,534	
日本新薬	2.4	1.9	9,976	
中外製薬	22.7	17.6	95,321	
ロート製薬	7.9	6.2	18,934	
小野薬品工業	16.4	12.5	33,212	
JCRファーマ	2.8	—	—	
ゴム製品 (2.1%)				
TOYO TIRE	—	3.2	7,732	
ブリヂストン	—	15.6	97,952	
ガラス・土石製品 (0.5%)				
日本特殊陶業	6.9	5.4	20,860	
MARUWA	0.3	0.2	5,744	
鉄鋼 (0.2%)				
大和工業	1.6	1.3	10,401	
非鉄金属 (—%)				
住友金属鉱山	9.2	—	—	
DOWAホールディングス	2.1	—	—	
金属製品 (0.7%)				
SUMCO	11.8	9.2	20,907	
三和ホールディングス	7.8	6.1	13,969	
機械 (5.6%)				
三浦工業	—	2.9	7,944	
FUJ I	3.3	—	—	
ディスコ	1	2.4	95,040	
SMC	1.5	1.3	106,756	
荏原製作所	—	2.4	22,072	
ダイキン工業	4.1	—	—	
ダイフク	4.3	10	29,030	
SANKYO	1.5	1.1	9,656	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
竹内製作所	—	1.1	5,175
セガサミーホールディングス	5.8	4.5	9,623
ホシザキ	4.1	—	—
電気機器 (23.3%)			
イビデン	4.7	—	—
日立製作所	—	9.5	106,115
富士電機	5	3.9	28,388
富士通	4.9	4.5	92,812
ルネサスエレクトロニクス	47.6	39.2	97,255
セイコーエプソン	11.4	—	—
アルパック	1.7	—	—
パナソニックホールディングス	—	64.7	90,256
アンリツ	4.6	—	—
ソニーグループ	8.4	7.4	103,637
TDK	13.1	—	—
ヒロセ電機	1.1	—	—
横河電機	—	7.1	20,856
アズビル	—	3.5	16,810
日本光電工業	3	—	—
堀場製作所	1.4	1.1	12,963
アドバンテスト	4.3	13.7	78,309
キーエンス	1.6	1.6	106,144
シスメックス	6.3	4.6	36,395
フェローテックホールディングス	1.5	—	—
日本電子	1.7	—	—
ファナック	4.4	23.6	101,480
ローム	3.1	—	—
浜松ホトニクス	4.9	3.9	23,185
三井ハイテック	0.8	0.7	4,799
新光電気工業	—	1.8	9,842
太陽誘電	4.4	—	—
村田製作所	12.5	33.7	100,560
SCREENホールディングス	1.6	2.5	35,700
東京エレクトロン	2	4.3	120,271
輸送用機器 (4.1%)			
いすゞ自動車	—	16.4	33,292
スズキ	—	12.9	81,244
SUBARU	—	16.2	47,004
シマノ	2.8	2.2	47,344

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
精密機器 (3.2%)			
島津製作所	10	7.8	31,941
東京精密	1.4	—	—
マニー	2.9	2.3	4,746
オリンパス	34.1	—	—
HOYA	6.7	5.8	105,502
朝日インテック	8.4	6.6	19,008
メニコン	2.4	—	—
その他製品 (3.4%)			
バンダイナムコホールディングス	7.5	17.6	55,457
ビジョン	4.1	3.2	5,171
任天堂	15.8	14	110,530
電気・ガス業 (1.4%)			
東京瓦斯	—	11.5	37,892
大阪瓦斯	—	11	32,868
陸運業 (0.5%)			
SGホールディングス	16.3	12.8	25,689
情報・通信業 (10.2%)			
NECネットエスアイ	3.1	—	—
システナ	9.5	—	—
日鉄ソリューションズ	1.1	0.9	4,351
T I S	8.5	6.4	21,216
コーエーテックモホールディングス	4.7	3.7	6,615
ネクソン	16.9	9.3	22,115
SHIFT	0.4	0.3	7,980
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1.7	1.3	3,221
GMOペイメントゲートウェイ	1.5	—	—
インターネットイニシアティブ	4.9	3.8	11,210
ラクス	3.7	2.9	7,055
野村総合研究所	15.7	13.2	57,248
オービック	2.4	1.9	43,253
ジャストシステム	1.1	—	—
トレンドマイクロ	4.7	—	—
日本オラクル	1.1	0.9	10,516
伊藤忠テクノソリューションズ	3.5	—	—
大塚商会	4.3	3.3	20,242
東映アニメーション	0.4	0.3	5,220
ネットワンシステムズ	—	2.2	5,222
B I P R O G Y	2.7	2.1	9,093

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日本電信電話	24.3	556.3	102,025
KDDI	22.5	20.8	101,067
光通信	0.7	0.6	15,192
NTTデータグループ	21.6	—	—
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3.1	—	—
カブコン	6.3	4.9	26,974
SCSK	5.2	4.1	11,695
NSD	—	1.9	5,244
コナミグループ	3.5	2.7	23,954
卸売業 (5.4%)			
神戸物産	5	3.9	14,937
マクニカホールディングス	1.7	—	—
アズワン	1.1	0.8	4,445
伊藤忠商事	21.5	16.5	107,827
三井物産	22.6	18.4	106,775
三菱商事	20.1	—	—
岩谷産業	—	1.4	9,135
サンリオ	—	1.8	10,983
ミスミグループ本社	9.6	7.5	18,360
小売業 (6.7%)			
エービーシー・マート	—	2.6	6,797
日本マクドナルドホールディングス	2.9	2.3	14,835
Monotaro	8.5	6.6	9,500
マツキヨココカラ&カンパニー	—	10.7	28,494
ZOZO	—	4.2	13,683
物語コーポレーション	—	1	5,100
ウエルシアホールディングス	3.5	2.7	6,488
コスモス薬品	0.8	0.7	10,965
クスリのアオキホールディングス	0.7	1.8	5,850
パン・パシフィック・インターナショナルホ	13.3	10.4	32,978
ゼンショーホールディングス	3.5	2.7	19,242
ワークマン	0.9	0.7	2,877
スギホールディングス	—	1.1	7,621
日本瓦斯	3.9	3	7,021
ヤオコー	0.9	0.7	5,882
ニトリホールディングス	3.2	2.5	47,487
吉野家ホールディングス	2.2	—	—
ファーストリテイリング	1.1	2.7	104,949

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
サンドラッグ	2.5	2	9,082	
銀行業 (0.1%)				
セブン銀行	—	19.1	5,819	
保険業 (4.7%)				
SOMPOホールディングス	—	9.2	68,917	
MS&ADインシュアランスグループホール	—	12.7	75,603	
東京海上ホールディングス	—	25.4	94,818	
その他金融業 (1.1%)				
全国保証	2.3	1.8	9,810	
日本取引所グループ	—	13.9	43,979	
不動産業 (2.6%)				
大東建託	2.3	1.7	27,455	
ヒューリック	23.1	18.1	27,955	
野村不動産ホールディングス	4	3.1	12,192	
オープンハウスグループ	—	2.2	9,878	
住友不動産	—	12.5	56,850	
サービス業 (7.2%)				
日本M&Aセンターホールディングス	10.6	8.3	6,268	
エス・エム・エス	2.4	1.9	5,048	
パーソルホールディングス	6.6	50.4	11,854	
カカコム	4.3	3.3	5,590	
ディップ	1.2	0.9	2,342	
ベネフィット・ワン	2.6	—	—	
エムスリー	15.1	11.8	28,072	
博報堂DYホールディングス	10.7	—	—	
H. U. グループホールディングス	1.9	—	—	
オリエンタルランド	—	18.5	100,788	
ユー・エス・エス	8.7	6.3	17,743	
サイバーエージェント	14	—	—	
テクノプロ・ホールディングス	3.6	2.8	9,814	
ジャパンマテリアル	—	1.9	4,750	
リクルートホールディングス	21.3	18.1	106,717	
ジャパンエレベーターサービスホールディン	2.1	1.7	3,791	
セコム	—	5.6	59,500	
ダイセキ	1.6	1.3	5,460	
計	株数・金額	996	1,642	5,089,153
	銘柄数<比率>	150	150	<99.5%>

(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	
		買 建 額	売 建 額
国内	株式先物取引	TOPIX	
		百万円 24	百万円 —

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期	
	評 価 額	比 率
株式	千円 5,089,153	% 99.4
コール・ローン等、その他	32,292	0.6
投資信託財産総額	5,121,445	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	5,119,750,829
コール・ローン等	20,989,937
株式(評価額)	5,089,153,530
未収入金	1,334,450
未収配当金	8,716,650
差入委託証拠金	△ 443,738
(B) 負債	3,231,486
未払解約金	3,231,481
未払利息	5
(C) 純資産総額(A-B)	5,116,519,343
元本	2,475,730,635
次期繰越損益金	2,640,788,708
(D) 受益権総口数	2,475,730,635口
1万口当たり基準価額(C/D)	20,667円

○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	92,296,820
受取配当金	92,319,957
受取利息	545
その他収益金	424
支払利息	△ 24,106
(B) 有価証券売買損益	1,071,740,986
売買益	1,258,848,684
売買損	△ 187,107,698
(C) 先物取引等取引損益	12,233,300
取引益	17,817,900
取引損	△ 5,584,600
(D) 当期損益金(A+B+C)	1,176,271,106
(E) 前期繰越損益金	1,738,286,104
(F) 追加信託差損益金	551,895,843
(G) 解約差損益金	△ 825,664,345
(H) 計(D+E+F+G)	2,640,788,708
次期繰越損益金(H)	2,640,788,708

<注記事項>

- ①期首元本額 2,831,156,561円
 期中追加設定元本額 638,920,825円
 期中一部解約元本額 994,346,751円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.0667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 JAPAN クオリティ150インデックス	1,082,318,756円
国内株式セレクション(ラップ向け)	770,619,108円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション(適格機関投資家転売制限付)	365,584,886円
MUKAM スマート・クオリティ・セレクション2(適格機関投資家限定)	235,485,878円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	18,880,316円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	2,841,691円
合計	2,475,730,635円

[お知らせ]

- ①新NISA(成長投資枠)の要件対応のため、デリバティブ取引にかかる投資制限について記載整備を行い、信託約款に所要の変更を行いました。(2023年7月3日)
- ②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)