

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）




イーマックス

eMAXIS

J P X日経中小型インデックス



第7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日経中小型インデックス」は、去る1月26日に第7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)	標準価額			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
		税込分配	み金	期騰落	中率	(配当込み)			
	円	円	円	%		%	%	%	百万円
3期(2020年1月27日)	11,581	0	0	15.6	15,502.40	15.8	97.4	2.6	666
4期(2021年1月26日)	12,607	0	0	8.9	16,864.38	8.8	97.1	2.9	641
5期(2022年1月26日)	12,776	0	0	1.3	17,078.78	1.3	95.9	4.1	466
6期(2023年1月26日)	13,734	0	0	7.5	18,418.44	7.8	96.0	4.0	497
7期(2024年1月26日)	16,142	0	0	17.5	21,630.77	17.4	98.8	1.1	817

(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) 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 (配当込み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	(配当込み)	騰 落 率 %		
(期 首) 2023年 1 月26日	13,734	—	18,418.44	—	96.0	4.0
1 月 末	13,784	0.4	18,494.41	0.4	96.1	4.0
2 月 末	13,742	0.1	18,426.50	0.0	96.0	4.0
3 月 末	13,885	1.1	18,625.19	1.1	96.0	4.0
4 月 末	13,984	1.8	18,748.61	1.8	95.8	4.2
5 月 末	13,952	1.6	18,684.00	1.4	95.7	4.4
6 月 末	14,735	7.3	19,715.98	7.0	96.2	3.7
7 月 末	14,891	8.4	19,929.54	8.2	97.1	2.9
8 月 末	14,870	8.3	19,903.20	8.1	98.5	1.5
9 月 末	14,781	7.6	19,791.35	7.5	97.6	2.5
10 月 末	14,348	4.5	19,213.61	4.3	98.3	1.7
11 月 末	15,428	12.3	20,672.34	12.2	98.2	1.8
12 月 末	15,644	13.9	20,972.30	13.9	98.2	1.7
(期 末) 2024年 1 月26日	16,142	17.5	21,630.77	17.4	98.8	1.1

(注) 騰落率は期首比。

(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7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7期首	13,734円
第7期末	16,142円
既払分配金	0円
騰落率	17.5%

※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17.5%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（17.4%）を0.1%上回りました。

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7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 JPX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。

▶ JPX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

▶ eMAXIS JPX日経中小型インデックス
ベンチマークとの乖離は0.1%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△0.4%程度でした。

マザーファンド保有による要因

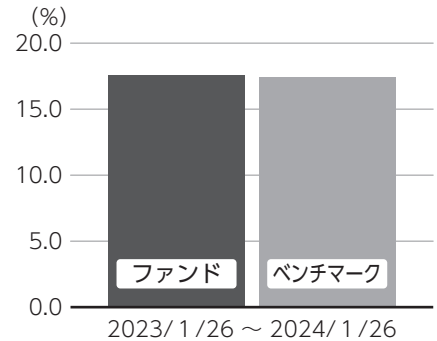
マザーファンド保有による影響は0.5%程度でした。

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：組入要因によるものです。

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7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	6,141

(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。

▶ JPX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。

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	64	0.440	(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)	(28)	(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)	(28)	(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)	(8)	(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	65	0.449	

期中の平均基準価額は、14,523円です。

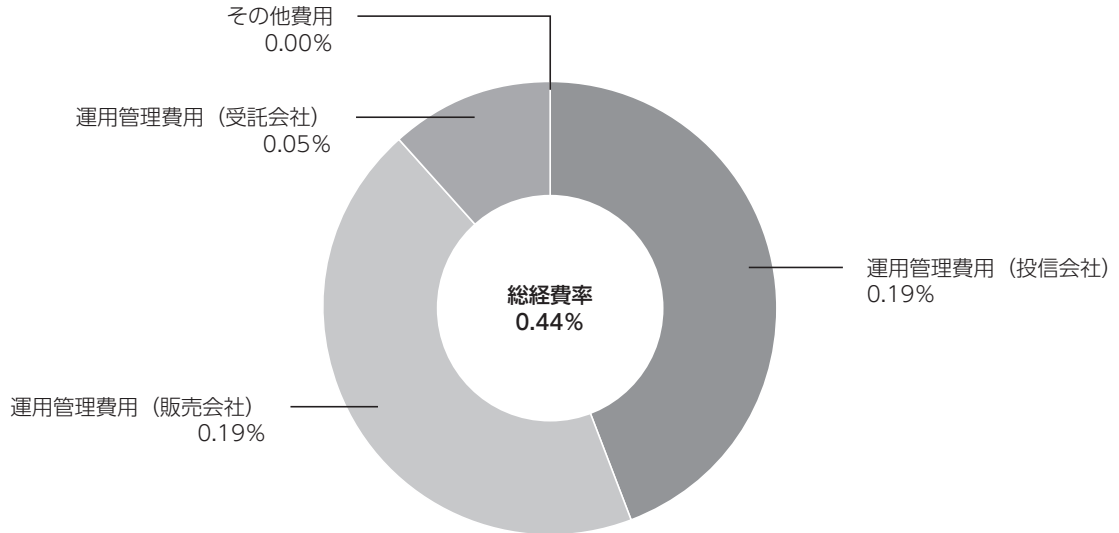
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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
JPX日経中小型インデックスマザーファンド	千口 331,662	千円 499,944	千口 192,135	千円 287,341

○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	
	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	1,207,283千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	588,050千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.05	

(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 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	$\frac{B}{A}$	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 724	百万円 373	% 51.5	百万円 482	百万円 316	% 65.6

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日経中小型インデックスマザーファンド >

種 類	買 付 額
株式	百万円 0.92491

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
J P X日経中小型インデックスマザーファンド	千口 355,152	千口 494,679	千円 817,656

○投資信託財産の構成

(2024年1月26日現在)

項 目	当 期 末	比 率
	評 価 額	
J P X日経中小型インデックスマザーファンド	千円 817,656	% 99.4
コール・ローン等、その他	5,036	0.6
投資信託財産総額	822,692	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	822,692,022
コール・ローン等	5,035,667
JPX日経中小型インデックスマザーファンド(評価額)	817,656,355
(B) 負債	4,953,788
未払解約金	3,391,868
未払信託報酬	1,551,898
未払利息	1
その他未払費用	10,021
(C) 純資産総額(A-B)	817,738,234
元本	506,595,106
次期繰越損益金	311,143,128
(D) 受益権総口数	506,595,106口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,142円

<注記事項>

- ①期首元本額 362,566,997円
 期中追加設定元本額 524,804,402円
 期中一部解約元本額 380,776,293円
 また、1口当たり純資産額は、期末1,6142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	14,661,702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	63,156,695円
収益調整金額	220,848,496円
分配準備積立金額	12,476,235円
当ファンドの分配対象収益額	311,143,128円
1万口当たり収益分配対象額	6,141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	△ 714
受取利息	23
支払利息	△ 737
(B) 有価証券売買損益	80,520,416
売買益	106,120,914
売買損	△ 25,600,498
(C) 信託報酬等	△ 2,701,305
(D) 当期損益金(A+B+C)	77,818,397
(E) 前期繰越損益金	12,476,235
(F) 追加信託差損益金	220,848,496
(配当等相当額)	(203,019,533)
(売買損益相当額)	(17,828,963)
(G) 計(D+E+F)	311,143,128
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	311,143,128
追加信託差損益金	220,848,496
(配当等相当額)	(204,373,262)
(売買損益相当額)	(16,475,234)
分配準備積立金	90,294,632

- (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)

J P X日経中小型インデックスマザーファンド

《第7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日経中小型インデックスマザーファンド」は、1月26日に第7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7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		J P X日経中小型株指数		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			
3期(2020年1月27日)	11,698	16.0%	15,502.40	15.8%	97.4%	2.6%	666
4期(2021年1月26日)	12,780	9.2%	16,864.38	8.8%	97.1%	2.9%	641
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

(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) 「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 (配当込み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率 %	(配当込み)	騰 落 率 %	%	%
(期 首) 2023年1月26日	14,019	—	18,418.44	—	96.0	4.0
1月末	14,071	0.4	18,494.41	0.4	96.1	4.0
2月末	14,032	0.1	18,426.50	0.0	96.0	4.0
3月末	14,183	1.2	18,625.19	1.1	96.0	4.0
4月末	14,288	1.9	18,748.61	1.8	95.8	4.2
5月末	14,260	1.7	18,684.00	1.4	95.7	4.4
6月末	15,061	7.4	19,715.98	7.0	96.2	3.7
7月末	15,224	8.6	19,929.54	8.2	97.1	2.9
8月末	15,207	8.5	19,903.20	8.1	98.5	1.5
9月末	15,120	7.9	19,791.35	7.5	97.6	2.5
10月末	14,682	4.7	19,213.61	4.3	98.3	1.7
11月末	15,792	12.6	20,672.34	12.2	98.2	1.8
12月末	16,017	14.3	20,972.30	13.9	98.2	1.7
(期 末) 2024年1月26日	16,529	17.9	21,630.77	17.4	98.8	1.1

(注) 騰落率は期首比。

(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

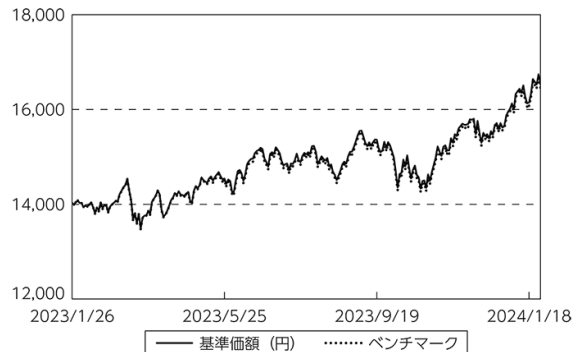
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ17.9%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(17.4%)を0.5%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 J P X 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17.4%の上昇になったため、カイ離は0.5%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)

- ・ 組入要因によるものです。

(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)	1	0.006	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(1)	(0.006)	
期中の平均基準価額は、14,850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	上場	千株	千円	千株	千円
内		495	724,700	315	482,582
		(8)	(-)		

(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	株式先物取引	百万円	百万円	百万円	百万円
内		385	399	8	8

○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	1,207,283千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	588,050千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.05

(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 724	百万円 373	51.5	百万円 482	百万円 316	65.6

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 0.92491

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	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
鉱業 (0.5%)				
三井松島ホールディングス	—	1.4	3,971	
建設業 (3.9%)				
ウエストホールディングス	—	2	6,620	
タマホーム	1.1	1.4	5,642	
東建コーポレーション	0.5	—	—	
オリエンタル白石	5.6	—	—	
東鉄工業	1.5	—	—	
ピーエス三菱	1.4	—	—	
新日本建設	—	2.3	2,753	
東洋建設	3.5	4	5,180	
ライト工業	2.1	3.3	6,774	
住友電設	1	1.5	4,269	
高砂熱学工業	2.6	—	—	
レイズネクスト	1.6	—	—	
食料品 (1.0%)				
S Foods	1.2	1.8	5,940	
ファーマフーズ	1.7	2.3	2,327	
化学 (4.8%)				
北の達人コーポレーション	4.7	6.9	1,656	
関東電化工業	2.1	3.2	2,841	
田岡化学工業	0.4	—	—	
KHネオケム	1.8	2.5	5,797	
恵和	—	1.2	1,674	
扶桑化学工業	1	1.7	7,140	
トリケミカル研究所	1.5	2	7,210	
新日本製菓	0.6	0.9	1,575	
東洋合成工業	0.4	0.5	4,325	
J C U	1.3	1.8	6,759	
医薬品 (0.9%)				
栄研化学	1.8	3	5,304	
東和薬品	1.7	—	—	
ミズホメディー	0.4	0.6	2,079	
石油・石炭製品 (0.2%)				
富士石油	—	4.8	1,776	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額	評 価 額
	千株	千株	千円	千円
ガラス・土石製品 (—%)				
日本カーボン	0.6	—	—	
ニチハ	1.4	—	—	
鉄鋼 (0.7%)				
日本冶金工業	0.8	1.2	5,562	
非鉄金属 (1.0%)				
大紀アルミニウム工業所	1.6	2.1	2,601	
SWCC	1.3	1.9	5,589	
金属製品 (2.2%)				
宮地エンジニアリンググループ	0.3	—	—	
トーカロ	3.1	4.9	7,531	
RS Technologies	0.7	1.1	3,290	
横河ブリッジホールディングス	1.5	2.6	7,196	
機械 (8.8%)				
ツガミ	2.5	—	—	
オプトラン	1.7	2.7	4,706	
野村マイクロ・サイエンス	0.4	0.6	8,454	
日精エー・エス・ビー機械	0.5	0.7	3,024	
TOWA	—	1.8	13,770	
澁谷工業	1	1.6	3,982	
オルガノ	1.5	2	12,220	
フクシマガリレイ	0.8	1.1	5,643	
竹内製作所	2	2.5	11,762	
新晃工業	1.1	—	—	
日本ビラー工業	—	1.5	7,327	
電気機器 (9.1%)				
芝浦メカトロニクス	—	0.9	6,426	
ヤーマン	2.2	2.9	2,908	
JVCケンウッド	—	13.1	9,405	
I D E C	—	2.4	7,185	
MC J	4.6	6.9	8,445	
メルコホールディングス	0.3	—	—	
ワコム	7.1	12.6	8,416	
日本電波工業	—	2	2,522	
メイコー	1.2	1.6	6,600	

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
ホシデン	2.7	—	—	—
日本マイクロニクス	—	2.9	11,904	—
メガチップス	0.9	1.3	6,435	—
OBARA GROUP	0.5	—	—	—
山一電機	1	1.5	3,201	—
輸送用機器 (1.0%)				
カヤバ	—	1.6	8,128	—
精密機器 (1.3%)				
ブイ・テクノロジー	0.5	—	—	—
インターアクション	0.7	—	—	—
ノーリツ銅機	—	1.6	5,304	—
A&Dホロンホールディングス	—	2.4	4,872	—
その他製品 (1.8%)				
トランザクション	—	1.1	2,608	—
フルヤ金属	0.3	0.5	4,660	—
N I S S H A	—	2.8	4,491	—
グローブライド	0.9	1.5	3,108	—
電気・ガス業 (1.5%)				
北海道電力	10.7	—	—	—
イーレックス	—	2.9	2,262	—
レノバ	—	4.4	5,244	—
メタウォーター	1.4	2	4,320	—
陸運業 (1.1%)				
SBSホールディングス	1	1.5	3,780	—
ハマキョウレックス	0.9	—	—	—
サカイ引越センター	0.5	1.8	5,002	—
海運業 (1.8%)				
NSユナイテッド海運	0.6	0.9	4,590	—
飯野海運	—	6	7,572	—
乾汽船	1.4	1.9	2,109	—
倉庫・運輸関連業 (1.3%)				
トランコム	0.4	—	—	—
三井倉庫ホールディングス	1	1.5	7,447	—
エーアイティー	—	1	1,817	—
内外トランスライン	—	0.7	1,713	—
情報・通信業 (11.1%)				
システナ	—	24.8	7,489	—
デジタルアーツ	0.7	1	5,040	—
ソフトクリエイトホールディングス	0.5	—	—	—
GMOペパボ	0.2	—	—	—

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
ブレインパッド	1.1	—	—	—
ポルトゥウインホールディングス	1.9	—	—	—
エニグモ	1.4	2.1	764	—
ブロードリーフ	6.5	—	—	—
クロス・マーケティンググループ	—	1.1	639	—
デジタルハーツホールディングス	0.7	1	1,050	—
フィックスターズ	1.3	1.9	3,173	—
ティーガイア	1.2	1.7	3,355	—
テクマトリックス	2	3	4,992	—
ドリコム	1	1.4	1,177	—
アパントグループ	1.4	2.1	3,042	—
コムチュア	1.5	2.4	4,435	—
アステリア	0.9	—	—	—
アイル	0.6	0.8	2,548	—
マークライنز	0.6	0.9	2,713	—
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	0.6	0.9	1,516	—
P R T I M E S	0.3	0.3	643	—
ダブルスタンダード	0.4	0.5	823	—
アカツキ	0.5	0.8	2,124	—
カナミックネットワーク	—	1.8	752	—
オークネット	—	0.6	1,266	—
オロ	0.3	0.6	1,782	—
UUUM	0.7	—	—	—
ウオンテッドリー	—	0.1	145	—
プロトコーポレーション	1.4	—	—	—
インフォコム	—	2.1	5,365	—
I P S	0.4	0.5	986	—
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディング	0.3	—	—	—
ベース	—	0.6	2,013	—
クレスコ	0.9	—	—	—
フューチャー	2.8	3.5	6,198	—
SBテクノロジー	0.5	0.7	1,731	—
サイボウズ	1.5	—	—	—
アルゴグラフィックス	1	1.5	5,940	—
兼松エレクトロニクス	0.7	—	—	—
USEN-NEXT HOLDINGS	1	1.8	7,731	—
日本通信	—	16.2	3,742	—
ファイバーゲート	0.6	0.9	858	—
福井コンピュータホールディングス	0.8	1	2,608	—
ミロク情報サービス	1	1.5	2,733	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
卸売業 (11.7%)			
トーマンデバイス	0.2	0.2	1,068
東京エレクトロン デバイス	0.4	1.7	10,013
あい ホールディングス	1.9	2.8	7,025
グリムス	0.5	0.7	1,463
TOKAIホールディングス	—	9.4	9,174
歯愛メディカル	0.1	—	—
コマダホールディングス	2.9	4.2	11,680
松田産業	—	1.3	3,481
日本ライフライン	3.4	5.1	6,686
IDOM	3.5	4.6	3,951
BuySell Technologies	—	0.4	1,280
兼松	4.5	6.1	13,560
日本紙パルプ商事	—	0.8	4,024
山善	3.2	—	—
ユアサ商事	1.1	—	—
伊藤忠エネクス	2.9	4.3	6,789
加賀電子	0.9	1.6	10,816
KPPグループホールディングス	—	4.5	3,262
小売業 (7.8%)			
ハローズ	0.7	1	4,440
ジンズホールディングス	0.7	—	—
アークランドサービスホールディングス	1	—	—
Hamee	0.5	0.6	677
シュッピン	0.9	1.6	1,673
オイシックス・ラ・大地	1.6	2.3	3,180
日本調剤	0.8	—	—
JMホールディングス	1	1.3	2,925
G-7ホールディングス	1.5	1.9	2,378
コジマ	2.3	—	—
コーナン商事	—	2.1	8,148
西松屋チェーン	—	3.4	7,102
VTホールディングス	4.4	6.6	3,471
薬王堂ホールディングス	0.7	—	—
スクロール	1.7	2.6	2,631
アクシアル リテイリング	1.1	—	—
Genky DrugStores	0.6	0.8	5,000
アークランズ	1.7	5.2	8,767
日本KFCホールディングス	1.2	1.8	5,913
ベルク	0.8	1.1	6,952

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
銀行業 (1.0%)			
あいちフィナンシャルグループ	—	3.3	8,431
証券、商品先物取引業 (4.6%)			
FPG	4.4	5.5	9,196
GMOフィナンシャルホールディングス	2.4	4.5	3,370
ジャフコ グループ	—	4.8	8,217
マネックスグループ	12.2	15.8	11,818
トレイダーズホールディングス	—	1.8	1,063
スパークス・グループ	1.2	1.8	3,205
その他金融業 (1.6%)			
ジェイリース	0.4	0.6	1,413
SBIアルヒ	1.3	1.5	1,285
プレミアムグループ	1.8	2.7	4,830
日本リビング保証	—	0.2	600
イー・ギャランティ	1.8	2.6	5,231
不動産業 (4.4%)			
日本駐車場開発	13	17.1	3,231
LAホールディングス	0.3	0.5	2,417
三栄建築設計	0.5	—	—
ディア・ライフ	1.7	2.7	2,708
地主	0.8	—	—
プレサンスコーポレーション	1.4	2.6	4,274
シーアールイー	—	0.9	1,291
ケイアイスター不動産	0.5	0.8	2,792
グッドコムアセット	1	1.5	1,125
ジェイ・エス・ピー	0.3	0.8	2,088
ロードスターキャピタル	0.6	1.1	2,163
ウエルス・マネジメント	0.4	0.7	662
日本エスコ	2.4	3	2,895
MIRARTHホールディングス	5.5	—	—
トーセイ	1.8	2.7	5,791
サンフロンティア不動産	1.8	2.4	4,209
FJネクストホールディングス	1.1	—	—
サービス業 (14.9%)			
ジェイエイシーリクルートメント	1	6.1	4,111
メンバーズ	0.3	0.6	598
UTグループ	1.7	2.2	5,238
アイティメディア	0.4	0.6	634
ケアネット	2.3	3.4	2,791
パソナグループ	1.4	2	5,478

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
アマタホールディングス	—	0.4	242
シミックホールディングス	—	0.8	2,114
デジタルホールディングス	0.9	0.9	1,135
新日本科学	1.2	1.5	2,622
ワールドホールディングス	0.5	0.8	2,375
ライク	0.4	0.6	911
エスプール	3.3	4.8	1,526
WDBホールディングス	0.6	—	—
バリューコマース	0.9	1.5	2,343
J Pホールディングス	—	4.3	1,960
プレステージ・インターナショナル	4.8	7.9	4,732
クイック	0.9	1.2	3,024
アルプス技研	1	1.6	4,614
ビー・エム・エル	—	2.1	5,972
りらいあコミュニケーションズ	1.9	—	—
リソー教育	5.2	8.6	2,089
クリーク・アンド・リバー社	0.7	0.8	1,564
SBIグローバルアセットマネジメント	—	3.3	2,112
シダックス	—	2.4	1,929
フルキャストホールディングス	1.1	1.6	2,892
エン・ジャパン	2.1	—	—
アドベンチャー	0.2	0.2	1,022
アイ・アールジャパンホールディングス	—	0.9	1,399
Keeper 技研	0.8	1	6,380
イー・ガーディアン	0.4	0.6	955
ベクトル	—	2.1	2,520

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
チャーム・ケア・コーポレーション	0.9	1.4	1,678	
キャリアリンク	0.4	0.6	1,539	
I B J	0.7	1.3	917	
M&Aキャピタルパートナーズ	1.1	1.4	3,375	
シグマクス・ホールディングス	1.7	2.3	3,146	
ウィルグループ	0.9	1.4	1,670	
エラン	1.5	2.2	2,246	
ベルシステム24ホールディングス	1.5	1.8	3,189	
ストライク	0.6	0.7	3,185	
ソラスト	3.1	4.6	2,714	
インソース	2.8	3.7	3,093	
Orchestra Holdings	0.2	0.4	404	
ウエルビー	0.8	—	—	
ジーニー	—	0.4	397	
ミダックホールディングス	0.7	1	1,885	
日総工産	0.9	—	—	
スプリックス	0.4	—	—	
ポート	—	0.8	2,038	
Macbee Planet	—	0.1	1,730	
LITALICO	0.9	1.3	2,429	
カナモト	2.1	—	—	
船井総研ホールディングス	2.4	3.5	9,138	
合 計	株 数 ・ 金 額	309	497	808,064
	銘柄数<比率>	198	198	<98.8%>

(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 9	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 808,064	% 98.7
コール・ローン等、その他	10,850	1.3
投資信託財産総額	818,914	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	818,914,266
コール・ローン等	8,357,633
株式(評価額)	808,064,800
未収配当金	1,993,040
差入委託証拠金	498,793
(B) 負債	1,259,031
未払金	1,259,029
未払利息	2
(C) 純資産総額(A-B)	817,655,235
元本	494,679,869
次期繰越損益金	322,975,366
(D) 受益権総口数	494,679,869口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,529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	15,171,342
受取配当金	15,177,496
受取利息	131
その他収益金	154
支払利息	△ 6,439
(B) 有価証券売買損益	87,960,148
売買益	139,191,828
売買損	△ 51,231,680
(C) 先物取引等取引損益	4,029,670
取引益	6,076,770
取引損	△ 2,047,100
(D) 当期損益金(A+B+C)	107,161,160
(E) 前期繰越損益金	142,737,639
(F) 追加信託差損益金	168,282,708
(G) 解約差損益金	△ 95,206,141
(H) 計(D+E+F+G)	322,975,366
次期繰越損益金(H)	322,975,366

<注記事項>

- ①期首元本額 355,152,690円
 期中追加設定元本額 331,662,247円
 期中一部解約元本額 192,135,068円
 また、1口当たり純資産額は、期末16,529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 M A X I S J P X 日経中小型インデックス 494,679,869円

[お知らせ]

- ①新N I S A (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)