

J P Xプライム150 ファンド

運用報告書(全体版) 第2期

(決算日 2026年1月30日)

(作成対象期間 2025年1月31日～2026年1月30日)

★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	2024年10月28日～2045年1月30日		
運用方針	投資成果をJ P Xプライム150指数（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行います。		
主要投資対象	ベビーファンド	J P Xプライム150マザーファンドの受益証券	
	J P Xプライム150マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）	
組入制限	ベビーファンドのマザーファンド組入上限比率	無制限	
	ベビーファンドの株式実質組入上限比率		
	マザーファンドの株式組入上限比率		
分配方針	分配対象額は、経費控除後の配当等収益と売買益（評価益を含みます。）等とし、原則として、信託財産の成長に資することを目的に、配当等収益の中から基準価額の水準等を勘案して分配金額を決定します。ただし、配当等収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。		

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。

当ファンドは、わが国の株式に投資し、投資成果をJ P Xプライム150指数（配当込み）の動きに連動させることをめざしております。当作成期につきましてもそれに沿った運用を行ないました。ここに、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。

大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号
お問い合わせ先（コールセンター）
TEL 0120-106212
(営業日の9:00～17:00)
<https://www.daiwa-am.co.jp/>

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			J P Xプライム150指数 (配当込み)		株式組入 比率	株式先物 比率	純資産 総額
	(分配落)	税込 分配金	期中 騰落率	(ベンチマーク)	期中 騰落率			
	円	円	%		%	%	%	百万円
1 期末 (2025年 1 月30日)	10,419	0	4.2	10,433	4.3	98.1	1.9	1
2 期末 (2026年 1 月30日)	12,888	0	23.7	12,968	24.3	96.6	3.2	253

(注 1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注 2) J P Xプライム150指数 (配当込み) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。

(注 3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。

(注 4) 株式および株式先物の組入比率は、マザーファンドの組入比率を当ファンドベースに換算したものを含みます。

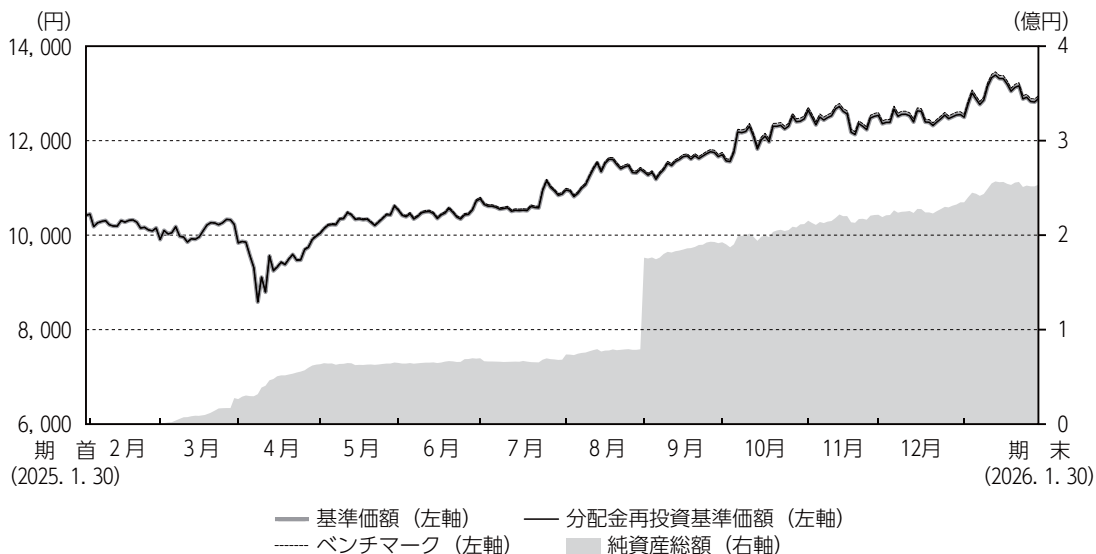
(注 5) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

配当込み J P Xプライム150指数 (本書類における「J P Xプライム150指数 (配当込み)」をいう。) の指数値及び同指数に係る標章又は商標は、株式会社 J P X総研又は株式会社 J P X総研の関連会社 (以下「J P X」という。) の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標章又は商標に関するすべての権利は J P Xが有する。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P Xは責任を負わない。



運用経過

基準価額等の推移について



(注) 分配金再投資基準価額およびベンチマークは、当作成期首の基準価額をもとに指数化したものです。

- * 分配金再投資基準価額は、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、ファンド運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。
- * 分配金を再投資するかどうかについては、お客さまがご利用のコースにより異なります（分配金を自動的に再投資するコースがないファンドもあります）。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。したがって、お客さまの損益の状況を示すものではありません。
- * ベンチマークは J P Xプライム150指数（配当込み）です。

■ 基準価額・騰落率

期首：10,419円

期末：12,888円（分配金0円）

騰落率：23.7%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「J P Xプライム150マザーファンド」の受益証券を通じてベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークが上昇したことから、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

J P Xプライム150ファンド

年 月 日	基 準 価 額		J P Xプライム150指数 (配当込み)		株 式 組 入 率 比	株 式 先 物 率 比
		騰 落 率	(ベンチマーク)	騰 落 率		
(期 首) 2025年 1月30日	円	%		%	%	%
	10,419	—	10,433	—	98.1	1.9
1月末	10,445	0.2	10,459	0.2	98.2	1.9
2月末	9,906	△ 4.9	9,924	△ 4.9	98.4	1.5
3月末	9,836	△ 5.6	9,852	△ 5.6	96.4	3.5
4月末	10,039	△ 3.6	10,071	△ 3.5	95.9	4.1
5月末	10,532	1.1	10,572	1.3	96.7	3.4
6月末	10,770	3.4	10,816	3.7	97.2	2.6
7月末	10,957	5.2	11,006	5.5	98.6	1.5
8月末	11,337	8.8	11,392	9.2	96.3	3.8
9月末	11,704	12.3	11,767	12.8	95.1	4.9
10月末	12,641	21.3	12,725	22.0	95.6	4.4
11月末	12,534	20.3	12,612	20.9	95.9	4.0
12月末	12,497	19.9	12,575	20.5	97.6	2.2
(期 末) 2026年 1月30日	12,888	23.7	12,968	24.3	96.6	3.2

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

投資環境について

(2025. 1. 31 ~ 2026. 1. 30)

国内株式市況

国内株式市況は、2025年4月の急落後上昇に転じ、史上最高値を更新しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の利上げの影響や円高進行、米国の関税引き上げへの懸念などから、上値の重い展開となりました。2025年3月中旬からは、日銀の利上げ観測などを背景に、銀行株主導で上昇しました。しかし、4月2日に発表された米国の相互関税が事前予想よりも厳しい内容であったことや、円高が急速に進行したことなどから、株価はまれに見る急落に見舞われました。ところが、同月9日に相互関税の大部分の適用が90日間停止されたことや、それを受けて円高が一服したことなどが好感され、一転して株価は急反発しました。5月以降も、米中双方が関税を大幅に引き下げるなど米国の関税をめぐる懸念が後退したことや、企業の旺盛な自社株買いに加えて海外投資家の資金流入が継続したことなどから、堅調に推移しました。7月下旬には、日米が通商交渉で合意したことから上昇に弾みが付き、その後も4 - 6月期の企業業績が事前予想ほど悪化しなかったことが好感され、続伸しました。9月以降は、活発なデータセンター投資やスマートフォンの販売好調などが好感されてAI（人工知能）・半導体関連株が上昇を主導したほか、10月には高市氏の首相就任や自維連立政権成立への期待感などもあり、上昇傾向が継続しました。その後も、日銀の利上げや日中関係の悪化などが懸念される場面はありましたが、円安進行や良好な需給環境などが相場を下支えし、堅調に推移しました。2026年1月には、高市首相が衆議院の解散を表明したことで政権基盤安定への期待感などから一段高となり、史上最高値近辺で当作成期末を迎えました。

前作成期末における「今後の運用方針」**当ファンド**

「J P Xプライム150マザーファンド」の受益証券組入比率を、おおむね100%程度に維持します。

J P Xプライム150マザーファンド

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てまいります。

ポートフォリオについて

(2025. 1. 31 ~ 2026. 1. 30)

当ファンド

「J P Xプライム150マザーファンド」の受益証券組入比率を、当作成期を通じておおむね100%程度に維持しました。

J P Xプライム150マザーファンド

主として、わが国の株式に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行いました。

当作成期を通じて、現物株式および株価指数先物取引の組入比率の合計を、おおむね純資産総額の99~100%程度に維持しました。

当作成期につきましては、J P Xプライム150指数採用銘柄すべてを組み入れて運用を行いました。

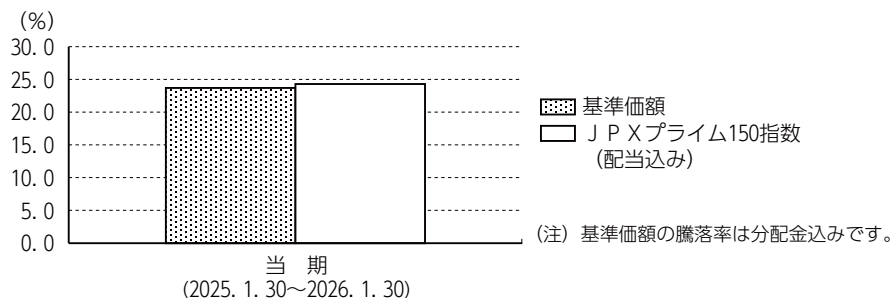
* マザーファンドのベンチマークは以下の通りです。

組入ファンド	ベンチマーク
J P Xプライム150マザーファンド	J P Xプライム150指数 (配当込み)

ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は24.3%、当ファンドの基準価額の騰落率は23.7%となりました。運用管理費用等のコストの他、マザーファンドにおける先物取引の利用が差異の要因となりました。

以下のグラフは、当ファンドの基準価額とベンチマークとの騰落率の対比です。



* ベンチマークはJ P Xプライム150指数 (配当込み) です。

分配金について

当作成期は、信託財産の成長に資することを目的に、収益分配を見送らせていただきました。
 なお、留保益につきましては、運用方針に基づき運用させていただきます。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2025年1月31日 ～2026年1月30日	
当期分配金（税込み）	(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)	2,887

- (注1) 「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2) 円未満は切捨てており、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。
- (注3) 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、ファンドの収益率とは異なります。
- (注4) 投資信託の計理上、「翌期繰越分配対象額」は当該決算期末時点の基準価額を上回る場合がありますが、実際には基準価額を超える額の分配金をお支払いすることはありません。



今後の運用方針

当ファンド

「J P Xプライム150マザーファンド」の受益証券組入比率を、おおむね100%程度に維持します。

J P Xプライム150マザーファンド

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てまいります。

1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期 (2025. 1. 31～2026. 1. 30)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	65円	0. 577%	信託報酬＝当作成期中の平均基準価額×信託報酬率 当作成期中の平均基準価額は11, 183円です。
(投 信 会 社)	(25)	(0. 220)	投信会社分は、ファンドの運用と調査、受託会社への運用指図、基準価額の計算、法定書面等の作成等の対価
(販 売 会 社)	(37)	(0. 330)	販売会社分は、運用報告書等各种書類の送付、口座内での各ファンドの管理、購入後の情報提供等の対価
(受 託 会 社)	(3)	(0. 027)	受託会社分は、運用財産の管理、投信会社からの指図の実行の対価
売 買 委 託 手 数 料	0	0. 004	売買委託手数料＝当作成期中の売買委託手数料／当作成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)	(0)	(0. 003)	
(先物・オプション)	(0)	(0. 001)	
有 価 証 券 取 引 税	—	—	有価証券取引税＝当作成期中の有価証券取引税／当作成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
そ の 他 費 用	1	0. 005	その他費用＝当作成期中のその他費用／当作成期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(1)	(0. 005)	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
合 計	66	0. 587	

(注1) 当作成期中の費用(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、項目の概要の簡便法により算出した結果です。

(注2) 各金額は項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

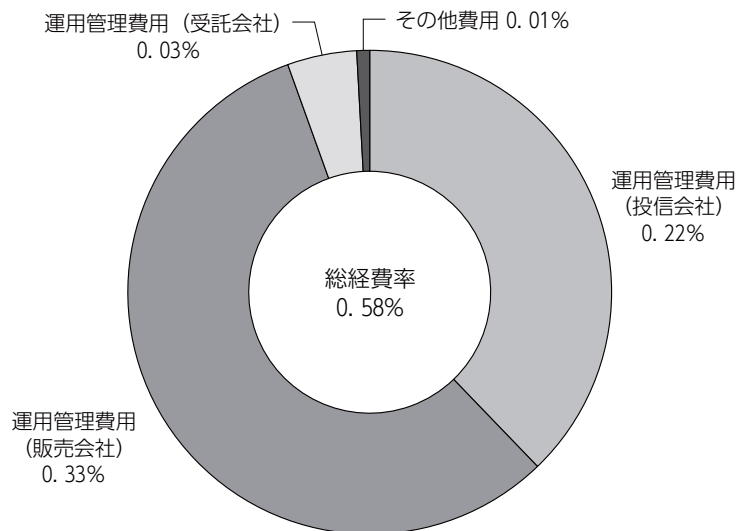
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(注4) 組み入れているマザーファンドがある場合、売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、当該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。組み入れている投資信託証券(マザーファンドを除く。)がある場合、各項目の費用は、当該投資信託証券が支払った費用を含みません。なお、当該投資信託証券の直近の計算期末時点における「1万口当りの費用の明細」が取得できるものについては「組入上位ファンドの概要」に表示することとしております。

参考情報

■ 総経費率

当作成期中の運用・管理にかかった費用の総額を、期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当り）を乗じた数で除した総経費率（年率）は0.58%です。



(注1) 1万口当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2) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を含みません。

(注3) 各比率は、年率換算した値です。

J P Xプライム150ファンド

■売買および取引の状況 親投資信託受益証券の設定・解約状況

(2025年1月31日から2026年1月30日まで)

	設 定		解 約	
	□ 数	金 額	□ 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
J P Xプライム150 マザーファンド	196,071	230,667	13,246	15,394

(注) 単位未満は切捨て。

■株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

(2025年1月31日から2026年1月30日まで)

項 目	当 期
	J P Xプライム150マザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	3,319,009千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	7,813,677千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.42

(注1) (b) は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

(注2) 単位未満は切捨て。

■利害関係人との取引状況等

(1) ベビーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(2) マザーファンドにおける当作成期中の利害関係人との取引状況

(2025年1月31日から2026年1月30日まで)

決 算 期	当 期					
	買付額等 A			売付額等 C		
区 分	うち利害 関係人との 取引状況 B	B/A	うち利害 関係人との 取引状況 D	D/C		
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	2,075	909	43.8	1,243	175	14.1
株式先物取引	2,784	2,784	100.0	2,674	2,674	100.0
コール・ローン	61,673	—	—	—	—	—

(注) 平均保有割合1.4%

※平均保有割合とは、マザーファンドの残存口数の合計に対する当該ベビーファンドのマザーファンド所有口数の割合。

(3) 当作成期中の売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

(2025年1月31日から2026年1月30日まで)

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	4千円
うち利害関係人への支払額 (B)	2千円
(B) / (A)	51.2%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み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。

※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、当作成期における当ファンドに係る利害関係人とは、大和証券株式会社です。

■投信会社（自社）による当ファンドの設定・解約および保有状況

当作成期首 保有額	当作成期中 設定額	当作成期中 解約額	当作成期末 保有額	取 引 の 理 由
百万円	百万円	百万円	百万円	
1	—	1	—	当初設定時における取得とその処分

(注1) 金額は元本ベース。

(注2) 単位未満は切捨て。

■組入資産明細表 親投資信託残高

種 類	期 首	当 期 末	
	□ 数	□ 数	評 価 額
	千口	千口	千円
J P Xプライム150 マザーファンド	940	183,765	253,228

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2026年1月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
J P Xプライム150マザーファンド	253,228	99.8
コール・ローン等、その他	582	0.2
投資信託財産総額	253,811	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2026年1月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	253,811,352円
コール・ローン等	582,714
J P Xプライム150マザー ファンド（評価額）	253,228,638
(B) 負債	564,761
未払信託報酬	559,530
その他未払費用	5,231
(C) 純資産総額（A－B）	253,246,591
元本	196,501,902
次期繰越損益金	56,744,689
(D) 受益権総口数	196,501,902口
1万口当り基準価額（C／D）	12,888円

* 期首における元本額は1,000,000円、当作成期間中における追加設定元本額は219,160,232円、同解約元本額は23,658,330円です。

* 当期末の計算口数当りの純資産額は12,888円です。

■収益分配金の計算過程（総額）

項 目	当 期
(a) 経費控除後の配当等収益	1,118円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	33,904,701
(c) 収益調整金	22,807,626
(d) 分配準備積立金	31,244
(e) 当期分配対象額（a+b+c+d）	56,744,689
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額（e－f）	56,744,689
(h) 受益権総口数	196,501,902口

■損益の状況

当期 自2025年1月31日 至2026年1月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	1,118円
受取利息	1,118
(B) 有価証券売買損益	34,592,552
売買益	36,824,250
売買損	△ 2,231,698
(C) 信託報酬等	687,851
△	
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	33,905,819
(E) 前期繰越損益金	31,244
(F) 追加信託差損益金	22,807,626
(配当等相当額)	(8,203,175)
(売買損益相当額)	(14,604,451)
(G) 合計（D＋E＋F）	56,744,689
次期繰越損益金（G）	56,744,689
追加信託差損益金	22,807,626
(配当等相当額)	(8,203,175)
(売買損益相当額)	(14,604,451)
分配準備積立金	33,937,063

(注1) 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おりません。

(注2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

(注3) 収益分配金の計算過程は下記「収益分配金の計算過程（総額）」をご参照ください。

《お知らせ》

■運用報告書にかかる信託約款の条文変更について

2025年4月1日付の投資信託及び投資法人に関する法律の改正により、運用報告書にかかる規定が変更されたため、運用報告書にかかる信託約款の条文を以下のとおり変更しました。(下線部を変更)

<変更前>

(運用報告書に記載すべき事項の提供)

- ① 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により提供します。
- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付します。

<変更後>

(運用状況にかかる情報の提供)

- ① 委託者は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める事項にかかる情報を電磁的方法により提供します。
- ② 前項の規定にかかわらず、委託者は、受益者から前項に定める情報の提供について、書面の交付の方法による提供の請求があった場合には、当該方法により行なうものとします。

2023年11月に「投資信託及び投資法人に関する法律」の一部改正が行われ、交付運用報告書については書面交付を原則としていた規定が変更されました。本件により、デジタル化の推進を通じて顧客の利便性向上を図るとともに、ペーパーレス化による地球環境の保全など、サステナビリティへの貢献に繋がるものと捉えております。今後も顧客本位の業務運営を確保しつつ、電磁的方法での情報提供を進めてまいります。

JPXプライム150マザーファンド

運用報告書 第2期 (決算日 2026年1月30日)

(作成対象期間 2025年1月31日～2026年1月30日)

JPXプライム150マザーファンドの運用状況をご報告申し上げます。

★当ファンドの仕組みは次の通りです。

運用方針	投資成果をJPXプライム150指数（配当込み）の動きに連動させることをめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定を含みます。）
株式組入制限	無制限

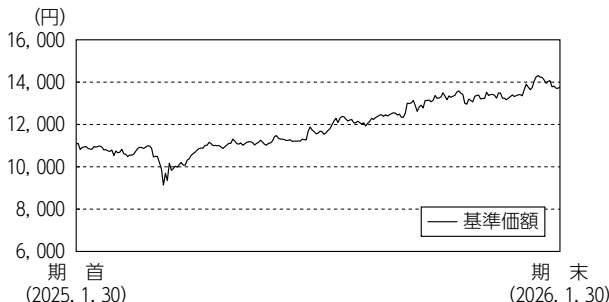
大和アセットマネジメント

Daiwa Asset Management

大和アセットマネジメント株式会社
東京都千代田区丸の内一丁目9番1号

<https://www.daiwa-am.co.jp/>

■当作成期中の基準価額と市況等の推移



年月日	基準価額		J P Xプライム150 指数 (配当込み)		株式 組入 比率	株式 先物 比率
	円	騰落率	(ベンチマーク)	騰落率		
(期首) 2025年1月30日	11,076	—	11,051	—	98.1	1.9
1月末	11,104	0.3	11,078	0.2	98.2	1.9
2月末	10,536	△ 4.9	10,511	△ 4.9	98.4	1.5
3月末	10,466	△ 5.5	10,435	△ 5.6	96.4	3.5
4月末	10,687	△ 3.5	10,667	△ 3.5	95.9	4.1
5月末	11,217	1.3	11,197	1.3	96.7	3.4
6月末	11,476	3.6	11,456	3.7	97.2	2.6
7月末	11,682	5.5	11,657	5.5	98.6	1.5
8月末	12,092	9.2	12,066	9.2	96.3	3.8
9月末	12,490	12.8	12,464	12.8	95.1	4.9
10月末	13,497	21.9	13,478	22.0	95.6	4.4
11月末	13,388	20.9	13,358	20.9	95.9	4.0
12月末	13,356	20.6	13,319	20.5	97.6	2.2
(期末) 2026年1月30日	13,780	24.4	13,735	24.3	96.6	3.2

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) J P Xプライム150指数 (配当込み) は、同指数の原データをもとに、当ファンド設定日の前営業日を10,000として大和アセットマネジメントが計算したものです。
 (注3) 指数値は、指数提供会社により過去に遡って修正される場合があります。上記の指数は直近で知り得るデータを使用しております。
 (注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

《運用経過》

◆基準価額等の推移について

【基準価額・騰落率】

期首：11,076円 期末：13,780円 騰落率：24.4%

【基準価額の主な変動要因】

ベンチマークへの連動をめざした運用を行った結果、ベンチマークの動きを反映して、基準価額は上昇しました。くわしくは「投資環境について」をご参照ください。

◆投資環境について

○国内株式市況

国内株式市況は、2025年4月の急落後上昇に転じ、史上最高値を更新しました。

国内株式市況は、当作成期首より、日銀の利上げの影響や円高進行、米国の関税引き上げへの懸念などから、上値の重い展開となりました。2025年3月中旬からは、日銀の利上げ観測などを背景に、銀行株主導で上昇しました。しかし、4月2日に発表された米国の相互関税が事前予想よりも厳しい内容であったことや、円高が急速に進行したことなどから、株価はまれに見る急落に見舞われました。ところが、同月9日に相互関税の大部分の適用が90日間停止されたことや、それを受けて円高が一服したことなどが好感され、一転して株価は急反発しました。5月以降も、米中双方が関税を大幅に引き下げるなど米国の関税をめぐる懸念が後退したことや、企業の旺盛な自社株買いに加えて海外投資家の資金流入が継続したことなどから、堅調に推移しました。7月下旬には、日米が通商交渉で合意したことから上昇に弾みが付き、その後も4～6月期の企業業績が事前予想ほど悪化しなかったことが好感され、続伸しました。9月以降は、活発なデータセンター投資やスマートフォンの販売好調などが好感されてA I (人工知能)・半導体関連株が上昇を主導したほか、10月には高市氏の首相就任や自維連立政権成立への期待感などもあり、上昇傾向が継続しました。その後も、日銀の利上げや日中関係の悪化などが懸念される場面はありましたが、円安進行や良好な需給環境などが相場を下支えし、堅調に推移しました。2026年1月には、高市首相が衆議院の解散を表明したことで政権基盤安定への期待感などから一段高となり、史上最高値近辺で当作成期末を迎えました。

◆前作成期末における「今後の運用方針」

当ファンドの運用方針に基づき、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てまいります。

◆ポートフォリオについて

主として、わが国の株式に投資し、投資成果をベンチマークの動きに連動させることをめざして運用を行いました。

当作成期を通じて、現物株式および株価指数先物取引の組入比率の合計を、おおむね純資産総額の99～100%程度に維持しました。

当作成期につきましては、J P Xプライム150指数採用銘柄すべてを組み入れて運用を行いました。

◆ベンチマークとの差異について

当作成期のベンチマークの騰落率は24.3%、当ファンドの基準価額の騰落率は24.4%となりました。

先物取引の利用が差異の要因となりました。

*ベンチマークはJ P Xプライム150指数 (配当込み) です。

《今後の運用方針》

当ファンドの運用方針に基づき、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てまいります。

■ 1 万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料 (株式) (先物・オプション)	1円 (0) (0)
有価証券取引税	—
その他費用	—
合 計	1

(注1) 費用の項目および算出法については前掲しております項目の概要をご参照ください。

(注2) 項目ごとに円未満を四捨五入してあります。

■ 売買および取引の状況

(1) 株 式

(2025年1月31日から2026年1月30日まで)

	買 付		売 付	
	株 数	金 額	株 数	金 額
	千株	千円	千株	千円
国内	923.5 (395.2)	2,075,234 (—)	549.2	1,243,774

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) ()内は株式分割、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。

(注3) 金額の単位未満は切捨て。

(2) 先物取引の種類別取引状況

(2025年1月31日から2026年1月30日まで)

種 類 別	買 建		売 建	
	新 規 買付額	決 済 額	新 規 売付額	決 済 額
	百万円	百万円	百万円	百万円
国 内 株式先物取引	2,784	2,674	—	—

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

■ 主要な売買銘柄

株 式

(2025年1月31日から2026年1月30日まで)

銘 柄	当 期			銘 柄	期 付		
	株 数	金 額	平均単価		株 数	金 額	平均単価
	千株	千円	円		千株	千円	円
三菱UFJフィナンシャルG	211.6	485,311	2,293	トヨタ自動車	167.2	487,225	2,914
第一生命HLDGS	64.9	80,318	1,237	住友商事	20	81,961	4,098
りそなホールディングス	40.5	60,945	1,504	NTTデータグループ	8.3	32,604	3,928
ソニーグループ	15.4	59,331	3,852	クボタ	16.3	28,779	1,765
日立	11.4	51,531	4,520	ニデック	14.3	28,364	1,983
三菱商事	13.8	48,454	3,511	阪急阪神HLDGS	4.2	18,298	4,356
三菱重工業	12	48,402	4,033	リクルートホールディングス	2.2	17,947	8,157
IHI	4.5	43,364	9,636	ソニーグループ	4.4	17,027	3,869
東京海上HD	6.6	37,838	5,733	NTT	109.2	17,024	155
ソフトバンクグループ	3.7	34,721	9,384	ヤマハ発動機	15.5	16,984	1,095

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 金額の単位未満は切捨て。

J P Xプライム150マザーファンド

■組入資産明細表

(1)国内株式

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
建設業 (0.9%)				
住友林業	2.6	—	—	—
大和ハウス	9	9.1	47,866	
積水ハウス	9	10	34,380	
食料品 (3.1%)				
寿スピリッツ	1.8	1.8	3,218	
ヤフルト	4.3	4.6	11,463	
アサヒグループホールディング	22.4	24.8	39,990	
麒麟HD	12.4	13.7	32,770	
サントリー食品インター	2.1	2.3	11,207	
キッコーマン	9.9	10.9	15,156	
味の素	6.9	16.4	57,728	
日清食品HD	3.8	3.7	11,581	
日本たばこ産業	18.1	20.1	112,178	
繊維製品 (0.1%)				
ゴールドウイン	0.5	2	5,154	
化学 (4.1%)				
日産化学	1.6	1.7	9,049	
信越化学	27	29.9	153,357	
日本酸素HLDGS	2.9	3.8	17,814	
花王	7.4	8	49,488	
日本ペイントHOLD	13.4	17.8	18,236	
関西ペイント	2.5	—	—	
富士フイルムHLDGS	18.3	20.3	62,666	
資生堂	6.3	6.5	17,088	
デクセリアルズ	2.7	2.9	7,796	
日東電工	9.6	10.2	34,945	
ユニ・チャーム	19	21	19,727	
医薬品 (4.0%)				
協和キリン	3.6	4	10,018	
アステラス製薬	26.7	29.5	63,248	
塩野義製薬	10.1	12.3	39,040	
中外製薬	9.5	10.5	92,410	
エーザイ	4	4.4	18,968	
小野薬品	6.2	—	—	
第一三共	28.7	30.9	87,632	
大塚ホールディングス	7.5	7.5	69,307	
石油・石炭製品 (—)				
出光興産	14.2	—	—	
ゴム製品 (0.7%)				
ブリヂストン	8.9	19.7	68,654	
非鉄金属 (0.2%)				
三井金属	—	0.9	18,333	
金属製品 (0.1%)				
三和ホールディングス	—	3.3	11,550	
機械 (8.1%)				
ディスコ	1.5	1.6	105,904	
S M C	0.9	1	60,150	
小松製作所	15.1	16.3	96,642	
ローツェ	—	2	6,576	

銘柄	期首		当期末	
	株数	株数	株数	評価額
	千株	千株	千株	千円
クボタ	15.7	—	—	—
ダイキン工業	4	4.4	81,774	
オルガン	—	0.5	8,115	
ダイフク	—	5.7	31,566	
SANKYO	3.5	3.6	8,695	
マキタ	3.8	4.2	22,474	
三井E & S	—	1.7	11,679	
三菱重工業	53.5	63.4	286,504	
I H I	—	17.6	62,796	
電気機器 (26.8%)				
ミネベアミツミ	5.3	5.9	18,496	
日立	78.8	86.1	461,582	
三菱電機	31.1	37.1	179,193	
安川電機	3.3	3.7	18,185	
ソシオネクスト	3.1	—	—	
ニデック	13.5	—	—	
オムロン	2.8	—	—	
日本電気	4.3	22.2	115,662	
富士通	28.2	31.1	133,201	
ルネサスエレクトロニクス	23.3	32.8	84,492	
ソニーグループ	104.6	115.6	399,282	
T D K	26.4	29.2	57,845	
アドバンテスト	9.6	10.6	270,353	
キーエンス	3	3.4	191,896	
シスメックス	7.8	8.7	12,762	
レーザーテック	1.2	1.4	50,946	
ファナック	14.7	16	100,304	
浜松ホトニクス	4.9	—	—	
新光電気工業	1.1	—	—	
村田製作所	26.7	32	100,352	
S C R E E Nホールディングス	1.3	1.2	23,592	
キヤノン	15.1	15	70,275	
東京エレクトロン	6.4	7.1	293,301	
輸送用機器 (1.5%)				
デンソー	29.7	32.8	70,290	
トヨタ自動車	161.2	—	—	
三菱自動車工業	11.6	—	—	
スズキ	24.5	24.6	51,819	
ヤマハ発動機	12.8	—	—	
シマノ	1.3	1.4	24,682	
精密機器 (2.8%)				
テルモ	20.3	22.3	44,990	
島津製作所	4.4	4.5	18,738	
オリンパス	17.4	18.2	33,506	
HOYA	5.9	6.5	168,155	
その他製品 (3.1%)				
バンダイナムコHLDGS	8.2	9	36,090	
アシックス	11.2	12.9	47,923	
ヤマハ	5.4	—	—	
任天堂	19.1	21.2	213,166	

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
電気・ガス業 (0.1%)			
東北電力	—	8.8	9,820
陸運業 (1.3%)			
東急	8.5	8.6	15,011
東日本旅客鉄道	16.7	18.5	72,020
西日本旅客鉄道	7.5	8	25,272
阪急阪神HLDGS	4	—	—
SGホールディングス	5.1	5.6	8,344
空運業 (0.5%)			
日本航空	6.9	7.7	22,518
ANAホールディングス	8.2	9.1	27,345
情報・通信業 (9.4%)			
T I S	3.2	3.6	16,192
ネクソン	6.7	8.3	30,568
S H I F T	3	3	2,195
ガンホー・オンライン・エンター	0.8	—	—
GMOペイメントゲートウェイ	0.7	0.7	6,255
インターネットイニシアティブ	1.7	1.8	4,487
ラクス	1.4	3.2	2,817
ビジョナル	0.4	0.4	3,407
野村総合研究所	6.6	6.6	31,026
メルカリ	—	1.4	4,799
オービック	5.6	6.2	26,641
L I N E ヤフー	—	51.8	20,543
電通総研	0.3	1.2	2,923
ANYCOLOR	—	0.5	2,202
ネットワンシステムズ	0.4	—	—
B I P R O G Y	1	1.1	5,639
U-NEXT HOLDINGS	—	1.1	2,048
NTT	904.4	922.9	142,957
KDDI	22.4	47.2	123,026
ソフトバンク	486.7	540.6	112,985
光通信	0.4	0.3	12,753
GMOインターネットグループ	1	1.1	4,236
東宝	1.9	1.8	14,178
NTTデータグループ	7.9	—	—
カプコン	6	6.7	26,371
NSD	1.2	1.2	3,891
コナミグループ	1.1	1.4	31,458
ソフトバンクグループ	15	64.4	273,893
卸売業 (10.5%)			
神戸物産	2.5	3.1	11,795
マクニカホールディングス	2.5	—	—
伊藤忠	21.6	119.2	234,943
丸紅	26.4	27.1	138,616
豊田通商	9.6	10.6	59,423
三井物産	47.1	51	256,785
住友商事	19.2	—	—
三菱商事	59.3	70.7	289,657
サンリオ	2.6	3.5	16,642
小売業 (4.6%)			
パルグループHLDGS	—	1.4	2,335

銘柄	期首	当期末	
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
MonotaRO	4.5	5	10,457
マツキヨコカラ&カンパニー	5.7	6.2	15,363
ZOZO	2.4	5.6	7,145
セブン&アイ・HLDGS	35.4	39.2	86,671
FOOD & LIFE COMPAN	—	2	16,942
ノジマ	—	3.5	3,776
パンパシフィックHD	6.5	35.8	32,789
ゼンショーホールディングス	—	1.8	15,078
日本瓦斯	1.5	1.7	4,982
イオン	11.9	41.9	88,618
ニトリホールディングス	1.2	5.7	15,133
ファーストリテイリング	1.8	2.4	141,120
銀行業 (6.8%)			
三菱UFJフィナンシャルG	—	208.2	583,896
りそなホールディングス	—	40.5	72,474
保険業 (4.9%)			
SOMPOホールディングス	14.6	16.4	87,182
MS&AD	21.9	20.6	80,999
ソニーフィナンシャルグループ	—	115.6	17,975
第一生命HLDGS	—	64.9	87,777
東京海上HD	29.2	33.9	194,145
その他金融業 (0.3%)			
日本取引所グループ	17.8	18.1	30,534
不動産業 (2.5%)			
大東建託	1	5.6	17,556
オープンハウスグループ	1.1	1	9,094
パーク24	—	2.4	5,170
三井不動産	41	48.8	86,254
三菱地所	17	19.8	78,012
住友不動産	4.9	9.4	40,373
サービス業 (3.8%)			
日本M&Aセンターホールデ	4.6	5.5	3,900
カカココム	2.2	2.2	4,642
エムスリー	6.2	6.8	12,991
電通グループ	3.3	3.3	9,875
オリエンタルランド	18.4	20.3	55,002
ユー・エス・エス	—	6.5	11,095
テクノプロ・ホールディング	1.9	—	—
リクルートホールディングス	24.3	25.5	206,550
ペイカレント	2.3	2.5	13,602
ジャパンエレベーターSHD	1.2	2.9	4,713
アンビスホールディングス	0.7	—	—
クオンツ総研ホールディンク	0.3	—	—
セコム	6.3	6.4	36,217
メイテックグループホールデ	1.1	1.3	4,495
合計	株数、金額	千株	千円
	銘柄数<比率>	150銘柄	149銘柄 <96.6%>

(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。

(注2) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注3) 評価額の単位未満は切捨て。

J P Xプライム150マザーファンド

(2)先物取引の銘柄別期末残高（評価額）

銘柄別		当 期 末	
		買 建 額	売 建 額
国 内	TOPIX	百万円 321	百万円 —

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2026年 1月30日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	9,616,631	96.5
コール・ローン等、その他	352,528	3.5
投資信託財産総額	9,969,159	100.0

(注) 評価額の単位未満は切捨て。

■資産、負債、元本および基準価額の状況

2026年 1月30日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	10,058,378,623円
コール・ローン等	328,355,152
株式（評価額）	9,616,631,530
未収入金	5,179,941
未取配当金	12,249,100
差入委託証拠金	95,962,900
(B) 負債	99,295,694
未払金	9,012,794
差入委託証拠金代用有価証券	90,282,900
(C) 純資産総額（A－B）	9,959,082,929
元本	7,226,953,178
次期繰越損益金	2,732,129,751
(D) 受益権総口数	7,226,953,178口
1万口当り基準価額（C/D）	13,780円

* 期首における元本額は6,601,527,382円、当作成期間中における追加設定元本額は1,381,921,212円、同解約元本額は756,495,416円です。

* 当期末における当マザーファンドを投資対象とする投資信託の元本額：

i F r e e J P Xプライム150	7,043,187,838円
J P Xプライム150ファンド	183,765,340円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は13,780円です。

■損益の状況

当期 自2025年 1月31日 至2026年 1月30日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	153,161,509円
受取配当金	151,865,974
受取利息	1,283,430
その他収益金	12,105
(B) 有価証券売買損益	1,613,488,994
売買益	2,016,377,356
売買損	△ 402,888,362
(C) 先物取引等損益	73,048,100
取引益	99,618,100
取引損	△ 26,570,000
(D) 当期損益金（A＋B＋C）	1,839,698,603
(E) 前期繰越損益金	710,344,649
(F) 解約差損益金	△ 98,149,439
(G) 追加信託差損益金	280,235,938
(H) 合計（D＋E＋F＋G）	2,732,129,751
次期繰越損益金（H）	2,732,129,751

(注 1) 解約差損益金とは、一部解約時の解約価額と元本との差額をいい、元本を下回る場合は利益として、上回る場合は損失として処理されます。

(注 2) 追加信託差損益金とは、追加信託金と元本との差額をいい、元本を下回る場合は損失として、上回る場合は利益として処理されます。

配当込み J P Xプライム150指数（本書類における「J P Xプライム150指数（配当込み）」をいう。）の指数値及び同指数に係る標準又は商標は、株式会社 J P X総研又は株式会社 J P X総研の関連会社（以下「J P X」という。）の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利・ノウハウ及び同指数に係る標準又は商標に関するすべての権利は J P Xが有する。J P Xは、同指数の指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負わない。当ファンドは、J P Xにより提供、保証又は販売されるものではなく、当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても J P Xは責任を負わない。