

GX Jメガトレンド・ジャパン

運用報告書（全体版） 第2期

（決算日 2023年9月15日）

（作成対象期間 2022年9月16日～2023年9月15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。

当ファンドは、日本の株式等を主要投資対象としたETF（上場投資信託証券）に投資し、信託財産の成長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/>

★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	2021年10月1日～2026年9月15日	
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。	
主要投資対象	ベビーファンド	GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンドの受益証券
	GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場のETF（上場投資信託証券）
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、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、分配対象額が少額の場合には、分配を行わないことがあります。	

設定以来の運用実績

決算期	基準価額			TOPIX (配当込み)		株式先物率 比	投資信託 組入比率	純資産額
	(分配落)	税込み 分配金	期中 騰落率	(参考指数)	期中 騰落率			
1期末(2022年9月15日)	円 8,499	円 0	% △15.0	3,157.37	% △ 2.4	% 2.8	% 96.9	百万円 2,747
2期末(2023年9月15日)	9,306	0	9.5	4,038.79	27.9	2.3	97.3	2,118

(注1) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注2) 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3) 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。

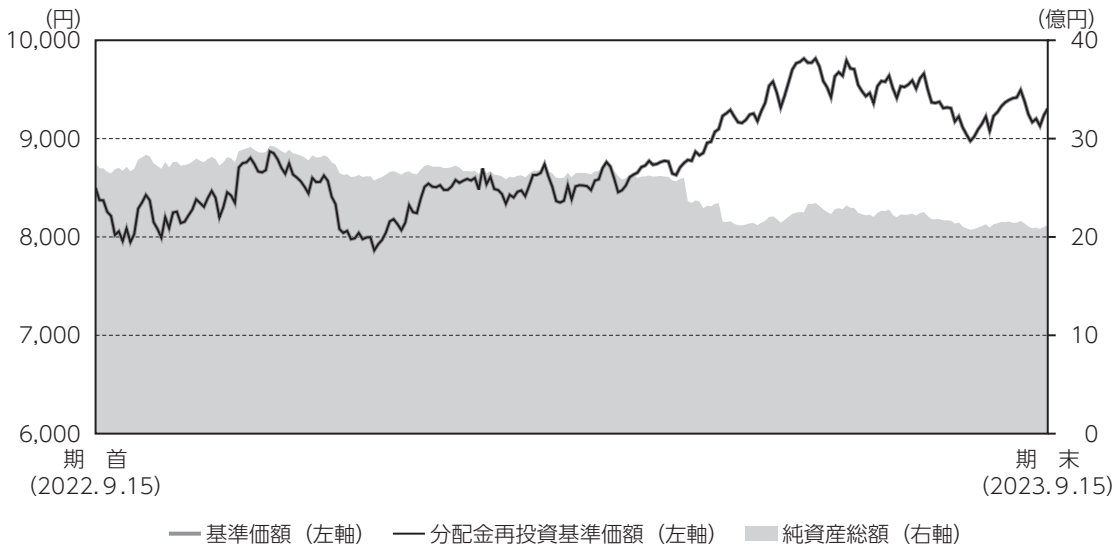
(注4) 株式先物比率は買建比率－売建比率です。

配当込みTOPIX（本書類における「TOPIX（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はありません。

* 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。

■ 基準価額・騰落率

期首：8,499円

期末：9,306円（分配金0円）

騰落率：9.5%（分配金込み）

■ 基準価額の主な変動要因

「GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド」の受益証券を通じて、Global X Japanが運用する日本の株式等（リートを含みます。）を主要投資対象としたETF（上場投資信託証券）に投資した結果、「グローバルX 半導体関連 - 日本株式ETF」や「グローバルX デジタル・イノベーション - 日本株式ETF」などの値動きがプラス要因となり、当ファンドの基準価額は上昇しました。

年 月 日	基 準 価 額		TOPIX (配当込み)		株 式 先 物 率	投 資 組 入	信 託 証 比	託 券 率
	騰 落 率		(参考指数)	騰 落 率				
(期首) 2022年 9月15日	円 8,499	% -	3,157.37	% -	% 2.8		% 96.9	
9月末	7,947	△ 6.5	3,003.39	△ 4.9	2.8		96.9	
10月末	8,396	△ 1.2	3,156.44	△ 0.0	2.8		97.0	
11月末	8,642	1.7	3,249.61	2.9	2.8		97.0	
12月末	7,998	△ 5.9	3,101.25	△ 1.8	2.9		96.7	
2023年 1月末	8,478	△ 0.2	3,238.48	2.6	2.2		97.4	
2月末	8,459	△ 0.5	3,269.12	3.5	2.3		97.3	
3月末	8,701	2.4	3,324.74	5.3	2.2		97.3	
4月末	8,707	2.4	3,414.45	8.1	2.4		97.2	
5月末	9,178	8.0	3,537.93	12.1	2.0		97.7	
6月末	9,639	13.4	3,805.00	20.5	2.0		97.6	
7月末	9,612	13.1	3,861.80	22.3	2.1		98.1	
8月末	9,368	10.2	3,878.51	22.8	2.2		97.4	
(期末) 2023年 9月15日	9,306	9.5	4,038.79	27.9	2.3		97.3	

(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

(2022.9.16~2023.9.15)

■国内株式市況

国内株式市況は、一進一退で推移した後、当作成期末にかけて大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気され、2022年9月末にかけて下落しました。11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見直しにより日本株見直しの動きが強まったことなどから、大幅に上昇しました。7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などを受け、8月中旬にかけてレンジでの推移となりましたが、良好な企業業績や株式需給が相場を下支えし、当作成期末にかけて上昇しました。

前作成期末における「今後の運用方針」

■当ファンド

「GXJメガトレンド・ジャパン・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れます。

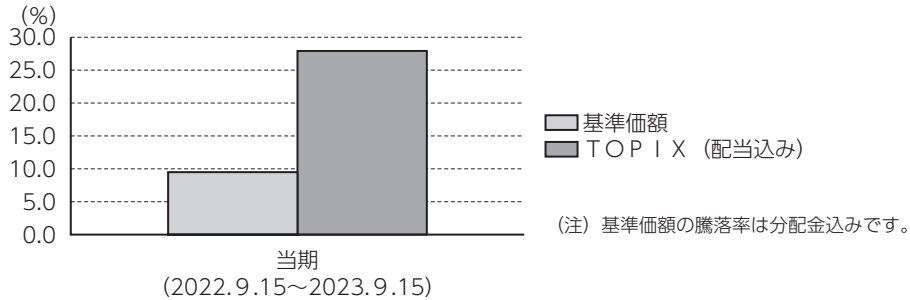
■GXJメガトレンド・ジャパン・マザーファンド

主として、Global X Japanが運用する日本の株式等（リートを含みます。）を主要投資対象としたわが国のETF（上場投資信託証券）に投資し、信託財産の成長をめざして運用を行います。また、当ファンドにおけるETFの選定および組入比率の決定にあたっては、以下の方針を基本として運用を行います。

- イ. メガトレンド（世界の長期的な構造変化）を捉え、成長が期待できるテーマのETFを選定します。
- ロ. 中長期的な成長性と短期的なモメンタムをもとに、各ETFの組入比率を決定します。
- ハ. ETFの選定および組入比率については、適宜見直しを行います。

ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
以下のグラフは、当ファンドの基準価額と参考指数との騰落率の対比です。



分配金について

当作成期は、分配対象額が計上できなかったため、収益分配を見送らせていただきました。

分配原資の内訳（1万口当り）

項 目	当 期	
	2022年9月16日 ～2023年9月15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）	—

(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

「GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド」の受益証券を高位に組み入れます。

■GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド

主として、Global X Japanが運用する日本の株式等（リートを含みます。）を主要投資対象としたわが国のETF（上場投資信託証券）に投資し、信託財産の成長をめざして運用を行います。また、当ファンドにおけるETFの選定および組入比率の決定にあたっては、以下の方針を基本として運用を行います。

- イ. メガトレンド（世界の長期的な構造変化）を捉え、成長が期待できるテーマのETFを選定します。
- ロ. 中長期的な成長性と短期的なモメンタムをもとに、各ETFの組入比率を決定します。
- ハ. ETFの選定および組入比率については、適宜見直しを行います。

1万口当りの費用の明細

項 目	当期 (2022.9.16~2023.9.15)		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
信 託 報 酬	79円	0.902%	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8,790円です。
(投 信 会 社)	(19)	(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)	(58)	(0.660)	販売会社分は、運用報告書等各種書類の送付、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)	(2)	(0.022)	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	11	0.126	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
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(投資信託受益証券)	(11)	(0.125)	
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	0	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)	(0)	(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	91	1.033	

(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。

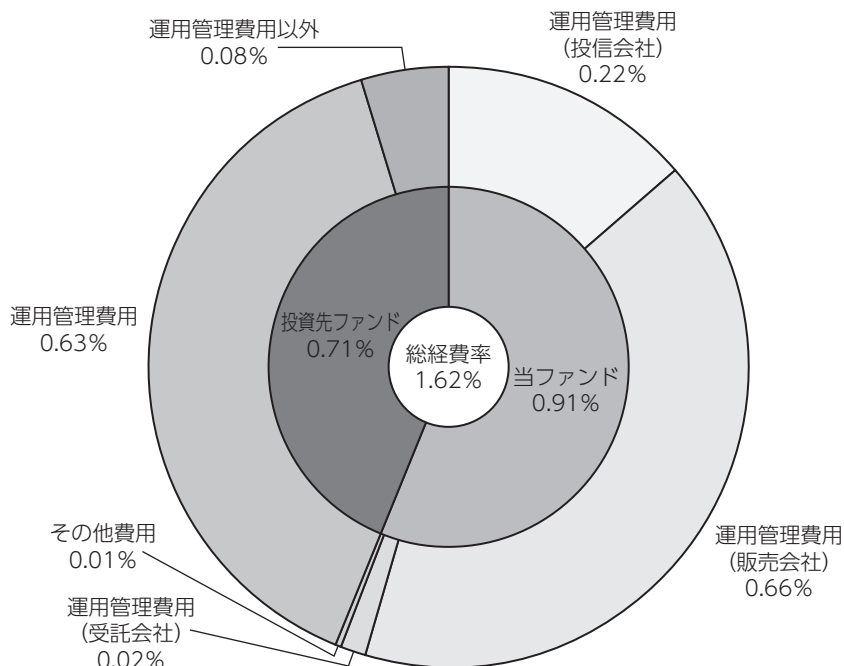
(注3) 各比率は1万口当りのそれぞれの費用金額を当作成期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、小数点第3位未満を四捨五入してあります。

(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1.62%です。



総経費率 (①+②+③)	1.62%
①当ファンドの費用の比率	0.91%
②投資先ファンドの運用管理費用の比率	0.63%
③投資先ファンドの運用管理費用以外の比率	0.08%

(注1) 投資先ファンドとは、当ファンドが組み入れている投資信託証券（マザーファンドを除く。）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) 投資先ファンドにおいて、上記以外に含まれていない費用は認識しておりません。

(注4) 各比率は、年率換算した値です。

(注5) ①の費用は、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6) ①の費用は、マザーファンドが支払った費用を含みます。

(注7) ①の費用と②③の費用は、計上された期間が異なる場合があります。

(注8) 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異なります。

■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

(2022年9月16日から2023年9月15日まで)

	設 定		解 約	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド	309,526	266,400	1,300,627	1,128,900

(注) 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

当作成期中における利害関係人との取引はありません。

(3) 利害関係人の発行する有価証券等

(2022年9月16日から2023年9月15日まで)

種 類	当 期		
	GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド		
	買 付 額	売 付 額	作成期末保有額
投資証券	百万円 940	百万円 1,745	百万円 2,060

(注1) 金額は受渡し代金。

(注2) 単位未満は切捨て。

(4) 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

当作成期中における売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払いはありません。

※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、Global X Japan株式会社です。

■組入資産明細表

親投資信託残高

種 類	期 首	当 期	末
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド	3,291,785	2,300,684	2,118,009

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド	千円 2,118,009	% 99.4
コール・ローン等、その他	13,553	0.6
投資信託財産総額	2,131,563	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

2023年9月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,131,563,701円
コール・ローン等	13,553,783
GX Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド(評価額)	2,118,009,918
(B) 負債	13,218,811
未払解約金	2,618,716
未払信託報酬	10,535,938
その他未払費用	64,157
(C) 純資産総額(A - B)	2,118,344,890
元本	2,276,435,883
次期繰越損益金	△ 158,090,993
(D) 受益権総口数	2,276,435,883口
1万口当り基準価額(C / D)	9,306円

*期首における元本額は3,233,245,565円、当作成期間中における追加設定元本額は361,811,977円、同解約元本額は1,318,621,659円です。

*当期末の計算口数当りの純資産額は9,306円です。

*当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は158,090,993円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月16日 至2023年9月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	△ 3,085円
受取利息	726
支払利息	△ 3,811
(B) 有価証券売買損益	192,898,410
売買益	243,185,595
売買損	△ 50,287,185
(C) 信託報酬等	△ 22,845,832
(D) 当期損益金(A + B + C)	170,049,493
(E) 前期繰越損益金	△245,225,664
(F) 追加信託差損益金	△ 82,914,822
(配当等相当額)	(△ 578)
(売買損益相当額)	(△ 82,914,244)
(G) 合計(D + E + F)	△158,090,993
次期繰越損益金(G)	△158,090,993
追加信託差損益金	△ 82,914,822
(配当等相当額)	(△ 578)
(売買損益相当額)	(△ 82,914,244)
繰越損益金	△ 75,176,171

(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。

(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。

■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	0円
(b) 経費控除後の有価証券売買等損益	0
(c) 収益調整金	0
(d) 分配準備積立金	0
(e) 当期分配対象額(a + b + c + d)	0
(f) 分配金	0
(g) 翌期繰越分配対象額(e - f)	0
(h) 受益権総口数	2,276,435,883口

G X Jメガトレンド・ジャパン・マザーファンド

運用報告書 第2期 (決算日 2023年9月15日)

(作成対象期間 2022年9月16日～2023年9月15日)

G X Jメガトレンド・ジャパン・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。

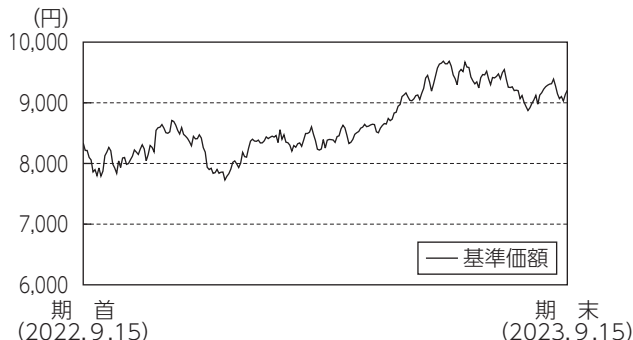
運用方針	信託財産の成長をめざして運用を行ないます。
主要投資対象	わが国の金融商品取引所上場のETF (上場投資信託証券)
株式組入制限	無制限

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		TOPIX (配当込み)		株 先 式 物 率	投資信託 受益証券 組入比率
	円	騰落率	(参考指数)	騰落率		
期首)2022年9月15日	8,337	-	3,157.37	-	2.8	97.1
9月末	7,791	△ 6.5	3,003.39	△ 4.9	2.8	97.0
10月末	8,238	△ 1.2	3,156.44	△ 0.0	2.8	97.0
11月末	8,486	1.8	3,249.61	2.9	2.8	97.1
12月末	7,859	△ 5.7	3,101.25	△ 1.8	2.9	96.8
2023年1月末	8,338	0.0	3,238.48	2.6	2.2	97.5
2月末	8,325	△ 0.1	3,269.12	3.5	2.3	97.3
3月末	8,570	2.8	3,324.74	5.3	2.2	97.4
4月末	8,582	2.9	3,414.45	8.1	2.4	97.3
5月末	9,054	8.6	3,537.93	12.1	2.0	97.6
6月末	9,515	14.1	3,805.00	20.5	2.0	97.6
7月末	9,498	13.9	3,861.80	22.3	2.1	98.2
8月末	9,265	11.1	3,878.51	22.8	2.2	97.0
期末)2023年9月15日	9,206	10.4	4,038.79	27.9	2.3	97.3

(注1) 騰落率は期首比。
 (注2) 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3) 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：8,337円 期末：9,206円 騰落率：10.4%

【基準価額の主な変動要因】

Global X Japanが運用する日本の株式等（リートを含みます。）を主要投資対象としたETF（上場投資信託証券）に投資した結果、「グローバルX 半導体関連 - 日本株式ETF」や「グローバルX デジタル・イノベーション - 日本株式ETF」などの動向がプラス要因となり、当ファンドの基準価額は上昇しました。

◆ 投資環境について

○ 国内株式市況

国内株式市況は、一進一退で推移した後、当作成期末にかけて大幅に上昇しました。

国内株式市況は、当作成期首より、英国の財政悪化や欧米の金利上昇などが嫌気され、2022年9月末にかけて下落しました。11月下旬にかけては、欧米の金利上昇が一服したことや国内で経済活動正常化への期待が高まったことなどから、上昇しました。12月には、世界的な景況感の悪化や日銀の政策変更による急速な円高などで下落しましたが、2023年1月以降は、中国のゼロコロナ政策見直しにより景気回復期待が高まったことや、日銀総裁人事への不透明感が解消して円安が進んだことなどが好感され、3月上旬にかけて上昇しました。3月半ばにかけては、米国地方銀行の経営破綻や欧州金融機関の破綻懸念などで金融不安が高まり下落しましたが、その後は、欧州金融機関の破綻回避などを受けて金融不安が一定程度後退したことにより、上昇に転じました。4月以降は、経済活動正常化や供給制約解消により企業業績の回復が期待されたこと、日

銀新総裁が金融緩和継続の方針を強調したこと、米国著名投資家の強気見直しにより日本株見直しの動きが強まったことなどから、大幅に上昇しました。7月に入り、日銀の政策修正観測や米国における長期金利の上昇、中国の不動産大手の債務不履行懸念などを受け、8月中旬にかけてレンジでの推移となりましたが、良好な企業業績や株式需給が相場を下支えし、当作成期末にかけて上昇しました。

◆ 前作成期末における「今後の運用方針」

主として、Global X Japanが運用する日本の株式等（リートを含みます。）を主要投資対象としたわが国のETF（上場投資信託証券）に投資し、信託財産の成長をめざして運用を行います。また、当ファンドにおけるETFの選定および組入比率の決定にあたっては、以下の方針を基本として運用を行います。

- イ. メガトレンド（世界の長期的な構造変化）を捉え、成長が期待できるテーマのETFを選定します。
- ロ. 中長期的な成長性と短期的なモメンタムをもとに、各ETFの組入比率を決定します。
- ハ. ETFの選定および組入比率については、適宜見直しを行います。

◆ ポートフォリオについて

主として、Global X Japanが運用する日本の株式等（リートを含みます。）を主要投資対象としたわが国のETF（上場投資信託証券）に投資し、信託財産の成長をめざして運用を行いました。また、当ファンドにおけるETFの選定および組入比率の決定にあたっては、以下の方針を基本として運用を行いました。

- イ. メガトレンド（世界の長期的な構造変化）を捉え、成長が期待できるテーマのETFを選定します。
- ロ. 中長期的な成長性と短期的なモメンタムをもとに、各ETFの組入比率を決定します。
- ハ. ETFの選定および組入比率については、適宜見直しを行います。

また、運用の効率性を高めるため、一部先物を使った運用を行いました。

◆ ベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の評価または目標基準となるベンチマークを設けておりません。
 当作成期の参考指数（TOPIX（配当込み））の騰落率は27.9%となりました。一方、当ファンドの基準価額の騰落率は10.4%となりました。

《今後の運用方針》

主として、Global X Japanが運用する日本の株式等（リートを含みます。）を主要投資対象としたわが国のETF（上場投資信託証券）に投資し、信託財産の成長をめざして運用を行います。また、当ファンドにおけるETFの選定および組入比率の決定にあたっては、以下の方針を基本として運用を行います。

- イ. メガトレンド（世界の長期的な構造変化）を捉え、成長が期待できるテーマのETFを選定します。
- ロ. 中長期的な成長性と短期的なモメンタムをもとに、各ETFの組入比率を決定します。
- ハ. ETFの選定および組入比率については、適宜見直しを行います。

■ 1万口当りの費用の明細

項 目	当 期
売買委託手数料	11円
(先物・オプション)	(0)
(投資信託受益証券)	(11)
有価証券取引税	-
その他費用	-
合 計	11

(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) 投資信託受益証券

(2022年9月16日から2023年9月15日まで)

	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
	千口	千円	千口	千円
国内	498.987	940,935	891.02 (-)	1,745,558 (-)

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 売付()内は償還による減少分で、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

(2022年9月16日から2023年9月15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
国 内	百万円	百万円	百万円	百万円
株式先物取引	497	538	-	-

(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

投資信託受益証券

(2022年9月16日から2023年9月15日まで)

当 期					期 付				
買		付			売		付		
銘	柄	口 数	金 額	平均単価	銘	柄	口 数	金 額	平均単価
		千口	千円	円			千口	千円	円
G X 半導体日株		83.6	197,083	2,357	G X 半導体日株		182.6	469,190	2,569
G X クリーン日株 E T F		107.5	167,235	1,555	G X ゲームアニメ日株 E T F		106.34	284,787	2,678
G X バイオ&メド日株 E T F		87.1	139,657	1,603	G X クリーン日株 E T F		142.58	223,432	1,567
G X デジタル日株 E T F		62.8	124,208	1,977	G X バイオ&メド日株 E T F		123.3	191,988	1,557
G X ゲームアニメ日株 E T F		35.6	101,918	2,862	G X E コマース日株 E T F		132.3	184,006	1,390
G X ロボ&A I日株 E T F		37.8	72,294	1,912	G X レジ&エンタ日株		83.1	157,424	1,894
G X E コマース日株 E T F		50.887	72,112	1,417	G X ロボ&A I日株 E T F		62.2	123,821	1,990
G X レジ&エンタ日株		33.7	66,425	1,971	G X デジタル日株 E T F		58.6	110,907	1,892

(注1) 金額は受渡し代金。
 (注2) 金額の単位未満は切捨て。

■組入資産明細表

(1) 国内投資信託受益証券

銘 柄	期 首	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
G X デジタル日株 E T F	143.8	148	306,952
G X E コマース日株 E T F	344.6	263.187	342,143
G X クリーン日株 E T F	135.9	100.82	157,984
G X ロボ&A I日株 E T F	136.4	112	225,456
G X バイオ&メド日株 E T F	175.3	139.1	225,342
G X ゲームアニメ日株 E T F	157	86.26	242,821
G X 半導体日株	251.2	152.2	476,386
G X レジ&エンタ日株	91.7	42.3	83,711
合 計	口 数、金額	1,435.9	1,043,867
	銘柄数<比率>	8銘柄	8銘柄 <97.3%>

(注1) 合計欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。
 (注2) 評価額の単位未満は切捨て。

(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	百万円	百万円
TO P I X	48	-

(注) 単位未満は切捨て。

■投資信託財産の構成

2023年9月15日現在

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
投資信託受益証券	2,060,797	97.3
コール・ローン等、その他	57,912	2.7
投資信託財産総額	2,118,709	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

2023年9月15日現在

項 目	当 期 末
(A) 資産	2,118,089,805円
コール・ローン等	54,993,265
投資信託受益証券(評価額)	2,060,797,640
未収入金	1,028,900
差入委託証拠金	1,270,000
(B) 負債	—
(C) 純資産総額(A - B)	2,118,089,805
元本	2,300,684,248
次期繰越損益金	△ 182,594,443
(D) 受益権総口数	2,300,684,248口
1万口当り基準価額(C / D)	9,206円

* 期首における元本額は3,291,785,077円、当作成期間中における追加設定元本額は309,526,933円、同解約元本額は1,300,627,762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：G X Jメガトレンド・ジャパン 2,300,684,248円

* 当期末の計算口数当りの純資産額は9,206円です。

* 当期末の純資産総額が元本額を下回っており、その差額は182,594,443円です。

■損益の状況

当期 自2022年9月16日 至2023年9月15日

項 目	当 期
(A) 配当等収益	23,605,459円
受取配当金	23,635,248
受取利息	23
支払利息	△ 29,812
(B) 有価証券売買損益	201,781,886
売買益	301,679,545
売買損	△ 99,897,659
(C) 先物取引等損益	10,886,500
取引益	13,659,200
取引損	△ 2,772,700
(D) 当期損益金(A + B + C)	236,273,845
(E) 前期繰越損益金	△547,469,117
(F) 解約差損益金	171,727,762
(G) 追加信託差損益金	△ 43,126,933
(H) 合計(D + E + F + G)	△182,594,443
次期繰越損益金(H)	△182,594,443

(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TOPIX（本書類における「TOPIX（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JPX総研又は株式会社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JPXが有する。JPX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、JPX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JPXは責任を負わない。