

## 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／不動産投信／インデックス型	
信託期間	2025年1月24日まで（2015年4月30日設定）	
運用方針	東証REIT指数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に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券に実質的な投資を行います。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、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。	
主要運用対象	ベビード ファンド	東証REIT指数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	東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券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	株式への投資は行いません。 投資信託証券への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	マザー ファンド	株式への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
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）

J-REITインデックス  
ファンド（ラップ向け）

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「J-REITインデックスファンド（ラップ向け）」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

お客さま専用  
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）

お客さま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。

**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)	税込み		期騰落		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託 証券組入比率	不動産投信 指数先物比率	純資産額
		分配	金額	騰落	中率	騰落	中率			
	円		円		%		%	%	%	百万円
5期(2020年1月27日)	13,437		0		22.8	4,533.90	23.5	98.3	1.6	3,595
6期(2021年1月26日)	11,392		0		△15.2	3,872.69	△14.6	98.0	2.0	1,075
7期(2022年1月26日)	12,491		0		9.6	4,269.20	10.2	98.9	1.2	760
8期(2023年1月26日)	12,404		0		△0.7	4,262.37	△0.2	98.1	1.9	227
9期(2024年1月26日)	12,718		0		2.5	4,390.19	3.0	98.4	1.8	298

(注) 東証REIT指数(配当込み)とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の指数値及び東証REIT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、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT指数に係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「投資信託証券組入比率」、「不動産投信指数先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「不動産投信指数先物比率」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		東 証 R E I T 指 数 ( 配 当 込 み )		投 資 信 託 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 数 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 12,404	% —	4,262.37	% —	% 98.1	% 1.9
1月末	12,406	0.0	4,263.06	0.0	98.2	1.9
2月末	12,597	1.6	4,331.37	1.6	98.1	1.8
3月末	12,227	△1.4	4,204.73	△1.4	98.2	1.8
4月末	12,844	3.5	4,420.34	3.7	98.1	1.8
5月末	12,923	4.2	4,448.91	4.4	97.9	2.1
6月末	12,839	3.5	4,421.28	3.7	98.0	2.2
7月末	12,987	4.7	4,472.88	4.9	98.1	1.9
8月末	13,176	6.2	4,539.20	6.5	98.1	1.9
9月末	12,967	4.5	4,468.30	4.8	98.2	1.8
10月末	12,679	2.2	4,372.14	2.6	97.9	2.1
11月末	12,922	4.2	4,455.46	4.5	98.2	1.9
12月末	12,708	2.5	4,382.85	2.8	98.0	2.0
(期 末) 2024年 1月26日	12,718	2.5	4,390.19	3.0	98.4	1.8

(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、「投資信託証券組入比率」、「不動産投信指数先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「不動産投信指数先物比率」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	12,404円
第9期末	12,718円
既払分配金	0円
騰落率	2.5%

※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2.5%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（3.0%）を0.5%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REIT市況

**国内REIT市況は上昇しました。**

日銀による金融緩和政策維持観測等により国内REIT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

### ▶ J-REITインデックスファンド（ラップ向け）

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。

### ▶ 東証REIT指数マザーファンド

資産のほぼ全額を不動産投資信託証券（REIT）（先物を含む）に投資しました。

ポートフォリオはベンチマークである東証REIT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

### ▶ J-REITインデックスファンド（ラップ向け）

ベンチマークとの乖離は△0.5%程度となりました。

#### マザーファンド保有以外の要因

大口解約およびファンドの管理コスト等による影響は△0.7%程度でした。

#### マザーファンド保有による要因

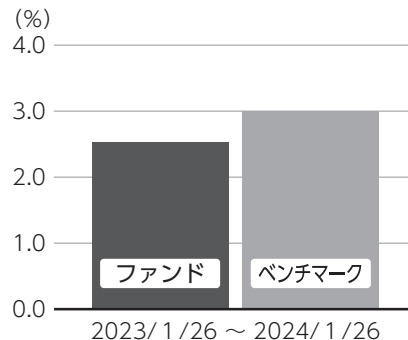
マザーファンド保有による影響は0.2%程度でした。

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：**銘柄選択要因によるものです。

**主なマイナス要因：**ありません。

### 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	4,999

（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。）

▶ **J-REITインデックスファンド（ラップ向け）**  
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **東証REIT指数マザーファンド**  
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	42	0.330	(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）	(31)	(0.242)	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）	(7)	(0.055)	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）	(4)	(0.033)	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
（投資信託証券）	(0)	(0.000)	
（先物・オプション）	(0)	(0.000)	
(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	42	0.334	

期中の平均基準価額は、12,729円です。

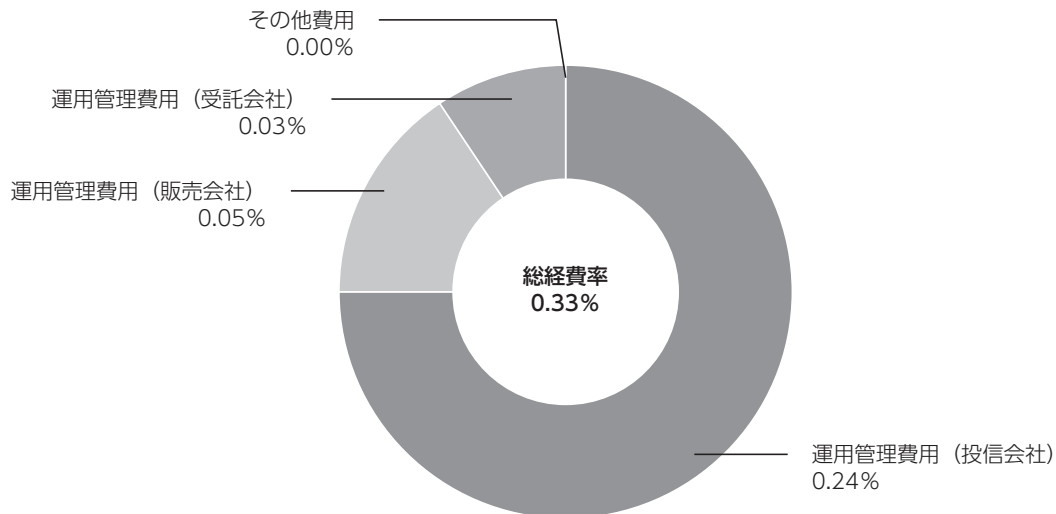
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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0.33%**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
東証REIT指数マザーファンド	千口 226,577	千円 798,910	千口 208,656	千円 732,402

○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

<J-REITインデックスファンド（ラップ向け）>

該当事項はございません。

<東証REIT指数マザーファンド>

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	$\frac{D}{C}$
不動産投信指数先物取引	8,850	6,671	75.4	8,555	8,178	95.6

平均保有割合 0.3%

※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

<東証REIT指数マザーファンド>

種類	買付額
投資信託証券	百万円 1,619

### 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	2千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	45.0%

(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です。

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)

#### 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
東証REIT指数マザーファンド	千口 66,559	千口 84,480	千円 298,054

### ○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
東証REIT指数マザーファンド	千円 298,054	% 99.1
コール・ローン等、その他	2,771	0.9
投資信託財産総額	300,825	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	300,825,043
コール・ローン等	512,739
東証REIT指数マザーファンド(評価額)	298,054,258
未収入金	2,258,046
(B) 負債	2,742,229
未払解約金	2,236,168
未払信託報酬	501,781
その他未払費用	4,280
(C) 純資産総額(A-B)	298,082,814
元本	234,371,936
次期繰越損益金	63,710,878
(D) 受益権総口数	234,371,936口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,718円

<注記事項>

- ①期首元本額 183,529,396円  
 期中追加設定元本額 627,597,454円  
 期中一部解約元本額 576,754,914円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2718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
支払利息	△ 8
(B) 有価証券売買損益	1,196,917
売買益	5,865,867
売買損	△ 4,668,950
(C) 信託報酬等	△ 932,101
(D) 当期損益金(A+B+C)	264,808
(E) 前期繰越損益金	△ 1,045,897
(F) 追加信託差損益金	64,491,967
(配当等相当額)	( 101,821,343)
(売買損益相当額)	(△ 37,329,376)
(G) 計(D+E+F)	63,710,878
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	63,710,878
追加信託差損益金	64,491,967
(配当等相当額)	( 104,381,466)
(売買損益相当額)	(△ 39,889,499)
分配準備積立金	12,799,468
繰越損益金	△ 13,580,557

- (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	11,471,902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	－円
収益調整金額	104,381,466円
分配準備積立金額	1,327,566円
当ファンドの分配対象収益額	117,180,934円
1万口当たり収益分配対象額	4,999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】

- 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当ファンドは信託約款に基づき、2025年1月24日に信託期間を終了し満期償還となる予定です。

## 東証REIT指数マザーファンド

## 《第15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]

「東証REIT指数マザーファンド」は、1月26日に第15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15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に上場している（上場予定を含みます。）不動産投資信託証券を主要投資対象とし、東証REIT指数（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。原則として、不動産投資信託証券の組入比率は高位を維持します。対象インデックスとの連動を維持するため、不動産投信指数先物取引を利用し不動産投資信託証券の実質投資比率が100%を超える場合があります。
主要運用対象	東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資は行いません。 投資信託証券への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		東証REIT指数 (配当込み)		投資信託証券 組入比率	不動産 投信指 先物比 率	純総 資産額
	期騰落	中率	期騰落	中率			
	円	%		%	%	%	百万円
11期(2020年1月27日)	36,432	23.6	4,533.90	23.5	98.4	1.6	35,177
12期(2021年1月26日)	31,049	△14.8	3,872.69	△14.6	98.0	2.0	42,741
13期(2022年1月26日)	34,244	10.3	4,269.20	10.2	98.9	1.2	62,254
14期(2023年1月26日)	34,199	△0.1	4,262.37	△0.2	98.1	1.9	77,896
15期(2024年1月26日)	35,281	3.2	4,390.19	3.0	98.4	1.8	102,201

(注) 東証REIT指数（配当込み）とは、東京証券取引所に上場している不動産投資信託全銘柄を対象として算出した東証REIT指数に、分配金支払いによる権利落ちの修正を加えた指数です。東証REIT指数の指数値及び東証REIT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、利用など東証REIT指数に関するすべての権利・ノウハウ及び東証REIT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が有します。

(注) 「不動産投信指数先物比率」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		東 証 R E I T 指 数		投 資 信 託 組 入 比 率	不 動 産 投 信 指 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	( 配 当 込 み )	騰 落 率		
(期首) 2023年1月26日	円	%		%	%	%
	34,199	—	4,262.37	—	98.1	1.9
1月末	34,206	0.0	4,263.06	0.0	98.2	1.9
2月末	34,744	1.6	4,331.37	1.6	98.1	1.8
3月末	33,734	△1.4	4,204.73	△1.4	98.2	1.8
4月末	35,464	3.7	4,420.34	3.7	98.1	1.8
5月末	35,695	4.4	4,448.91	4.4	98.0	2.1
6月末	35,474	3.7	4,421.28	3.7	98.0	2.2
7月末	35,894	5.0	4,472.88	4.9	98.2	1.9
8月末	36,429	6.5	4,539.20	6.5	98.1	1.9
9月末	35,860	4.9	4,468.30	4.8	98.2	1.8
10月末	35,119	2.7	4,372.14	2.6	97.9	2.1
11月末	35,802	4.7	4,455.46	4.5	98.2	1.9
12月末	35,217	3.0	4,382.85	2.8	98.0	2.0
(期末) 2024年1月26日	35,281	3.2	4,390.19	3.0	98.4	1.8

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「不動産投信指数先物比率」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

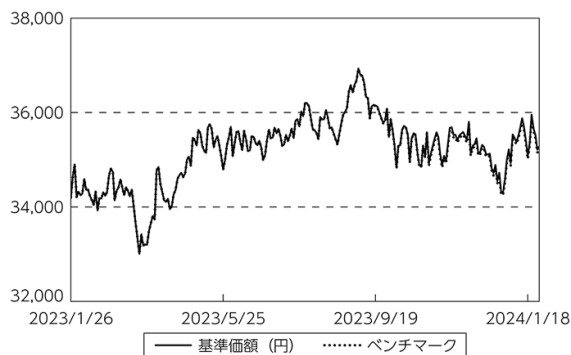
## ◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ3.2%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(3.0%)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REIT市況**

- ・ 国内REIT市況は上昇しました。
- ・ 日銀による金融緩和政策維持観測等により国内REIT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**

- ・ 資産のほぼ全額を不動産投資信託証券(REIT)(先物を含む)に投資しました。
- ・ ポートフォリオはベンチマークである東証REIT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3.0%の上昇となったため、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：銘柄選択要因によるものです。

主なマイナス要因：ありません。

**○ 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
( 投 資 信 託 証 券 )	0	0.001	
( 先 物 ・ オ プ シ ョ ン )	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.000)	
期中の平均基準価額は、35,190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)

## 投資信託証券

銘	柄	買		付		売		付	
		口	数	金	額	口	数	金	額
		千口		千円		千口		千円	
国	エスコンジャパンリート投資法人	0.589		68,569		0.119		13,762	
	サンケイリアルエステート投資法人	0.932		83,311		0.191		16,804	
	S O S i L A 物流リート投資法人	1		186,581		0.301		38,817	
	東海道リート投資法人	0.537		65,461		0.243		29,300	
		( 0.251)	(	29,166)					
	日本アコモデーションファンド投資法人	1		630,616		0.208		132,188	
	森ヒルズリート投資法人	3		497,680		0.705		103,786	
	産業ファンド投資法人	4		676,435		0.916		135,377	
	アドバンス・レジデンス投資法人	3		1,046,782		1		345,474	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	1		350,106		0.378		80,870	
		(△ 6)	(△	1,349,790)					
	アクティビア・プロパティーズ投資法人	1		612,503		0.344		137,962	
	GLP投資法人	10		1,546,030		1		281,494	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	1		525,560		0.29		96,363	
		( 0.029)	(	8,340)					
	日本プロロジスリート投資法人	5		1,508,958		1		294,956	
		( 0.189)	(	54,838)					
	星野リゾート・リート投資法人	0.608		391,007		0.11		72,461	
	One リート投資法人	0.51		128,143		0.106		26,221	
	イオンリート投資法人	4		650,382		0.71		106,378	
		( 0.104)	(	15,031)					
	ヒューリックリート投資法人	2		425,166		0.561		87,682	
	日本リート投資法人	0.949		321,358		0.198		66,625	
	積水ハウス・リート投資法人	8		692,841		1		142,408	
	トーセイ・リート投資法人	0.621		83,336		0.218		29,469	
	ケネディクス商業リート投資法人	0.954		253,932		0.219		57,051	
		(△ 3)	(△	989,706)					
	ヘルスケア&メディカル投資法人	0.717		110,408		0.147		23,041	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	0.88		100,089		0.157		17,959	
	野村不動産マスターファンド投資法人	9		1,530,870		1		315,011	
	いちごホテルリート投資法人	0.482		52,569		0.099		10,584	
	ラサールロジポート投資法人	4		627,569		0.754		116,743	
スターアジア不動産投資法人	6		365,519		0.805		46,339		
マリモ地方創生リート投資法人	0.458		58,148		0.091		11,666		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	1		650,570		0.244		118,613		
大江戸温泉リート投資法人	0.454		29,667		0.164		10,699		
投資法人みらい	5		229,880		0.75		34,306		
森トラスト・ホテルリート投資法人	0.051		6,687		0.008		1,018		
	(△ 1)	(△	232,898)						
三菱地所物流リート投資法人	1		402,226		0.207		83,044		
CRE ロジスティクスファンド投資法人	1		271,474		0.253		44,483		
ザイマックス・リート投資法人	0.472		54,226		0.097		10,998		
タカラレーベン不動産投資法人	1		145,391		0.288		27,255		
	( 0.132)	(	11,671)						
アドバンス・ロジスティクス投資法人	1		170,147		0.26		34,500		
日本ビルファンド投資法人	3		1,997,039		0.706		408,635		
ジャパンリアルエステイト投資法人	3		1,792,468		0.614		339,815		



## ○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			売付額等		
	A	うち利害関係人との取引状況B	$\frac{B}{A}$	C	うち利害関係人との取引状況D	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
投資信託証券	32,198	19,004	59.0	6,789	4,118	60.7
不動産投信指数先物取引	8,850	6,671	75.4	8,555	8,178	95.6

## 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
投資信託証券	百万円 1,619

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	607千円
うち利害関係人への支払額 (B)	283千円
(B) / (A)	46.6%

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)

## 国内投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額	比 率
	千口	千口	千円	%
エスコンジャパンリート投資法人	1	1	242,200	0.2
サンケイリアルエステート投資法人	2	3	288,032	0.3
S O S i L A 物流リート投資法人	3	4	583,313	0.6
東海道リート投資法人	0.902	1	185,939	0.2
日本アコモデーションファンド投資法人	2	3	2,047,136	2.0
森ヒルズリート投資法人	8	11	1,609,966	1.6
産業ファンド投資法人	11	14	2,060,603	2.0
アドバンス・レジデンス投資法人	7	9	3,166,677	3.1
ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	5	—	—	—
アクティビア・プロパティーズ投資法人	3	5	2,092,444	2.0
GLP投資法人	24	32	4,354,403	4.3
コンフォリア・レジデンシャル投資法人	3	4	1,515,220	1.5
日本プロロジスリート投資法人	12	16	4,588,188	4.5
星野リゾート・リート投資法人	1	1	948,073	0.9
One リート投資法人	1	1	463,352	0.5
イオンリート投資法人	8	11	1,703,246	1.7
ヒューリックリート投資法人	6	9	1,427,749	1.4
日本リート投資法人	2	3	1,086,281	1.1
積水ハウス・リート投資法人	22	29	2,300,128	2.3
トーセイ・リート投資法人	1	2	288,035	0.3
ケネディクス商業リート投資法人	3	—	—	—
ヘルスケア&メディカル投資法人	1	2	331,752	0.3
サムティ・レジデンシャル投資法人	1	2	294,661	0.3
野村不動産マスターファンド投資法人	24	31	5,073,659	5.0
いちごホテルリート投資法人	1	1	194,123	0.2
ラサールロジポート投資法人	9	12	1,873,489	1.8
スターアジア不動産投資法人	9	15	892,663	0.9
マリモ地方創生リート投資法人	1	1	186,822	0.2
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	2	4	1,877,928	1.8
大江戸温泉リート投資法人	1	1	112,570	0.1
投資法人みらい	9	13	605,535	0.6
森トラスト・ホテルリート投資法人	1	—	—	—
三菱地所物流リート投資法人	2	3	1,269,359	1.2
CREロジスティクスファンド投資法人	2	4	645,232	0.6
ザイマックス・リート投資法人	1	1	190,156	0.2
タカラレーベン不動産投資法人	3	4	485,415	0.5
アドバンス・ロジスティクス投資法人	3	4	549,935	0.5
日本ビルファンド投資法人	8	11	6,756,750	6.6
ジャパンリアルエステイト投資法人	7	10	5,669,056	5.5
日本都市ファンド投資法人	37	46	4,678,674	4.6
オリックス不動産投資法人	14	19	3,316,530	3.2
日本プライムリアルティ投資法人	5	6	2,364,160	2.3
NTT都市開発リート投資法人	7	9	1,248,601	1.2
東急リアル・エステート投資法人	4	6	1,154,610	1.1
グローバル・ワン不動産投資法人	5	7	790,560	0.8
ユナイテッド・アーバン投資法人	16	21	3,295,944	3.2

銘	柄	期首(前期末)		当 期 末	
		口 数	口 数	評 価 額	比 率
		千口	千口	千円	%
森トラストリート投資法人		5	18	1,403,986	1.4
インヴィンシブル投資法人		32	47	2,875,271	2.8
フロンティア不動産投資法人		2	3	1,555,740	1.5
平和不動産リート投資法人		5	7	1,008,244	1.0
日本ロジスティクスファンド投資法人		5	6	1,768,242	1.7
福岡リート投資法人		3	5	874,960	0.9
KDX不動産投資法人		4	28	4,534,819	4.4
いちごオフィスリート投資法人		6	7	660,773	0.6
大和証券オフィス投資法人		1	2	1,242,300	1.2
阪急阪神リート投資法人		3	4	675,964	0.7
スターツプロシード投資法人		1	1	344,253	0.3
大和ハウスリート投資法人		11	14	3,742,110	3.7
ジャパン・ホテル・リート投資法人		23	32	2,480,792	2.4
大和証券リビング投資法人		10	14	1,532,105	1.5
ジャパンエクセレント投資法人		6	8	1,028,743	1.0
東海道リート投資法人(新)		0.251	0.075	9,387	0.0
コンフォリア・レジデンシャル投資法人(新)		0.029	—	—	—
イオンリート投資法人(新)		0.104	—	—	—
合 計	口 数 ・ 金 額	443	616	100,546,877	
	銘 柄 数 < 比 率 >	64	59	< 98.4% >	

(注) 比率および合計欄の<>内は、純資産総額に対する評価額の比率。

(注) エスコンジャパンリート投資法人、サンケイリアルエステート投資法人、SOSILA物流リート投資法人、東海道リート投資法人、日本アコモデーションファンド投資法人、森ヒルズリート投資法人、産業ファンド投資法人、アドバンス・レジデンス投資法人、アクティビア・プロパティーズ投資法人、GLP投資法人、コンフォリア・レジデンシャル投資法人、日本プロロジスリート投資法人、星野リゾート・リート投資法人、Oneリート投資法人、イオンリート投資法人、ヒューリックリート投資法人、日本リート投資法人、積水ハウス・リート投資法人、トーセイ・リート投資法人、サムティ・レジデンシャル投資法人、野村不動産マスターファンド投資法人、いちごホテルリート投資法人、ラサールロジポート投資法人、スターアジア不動産投資法人、マリモ地方創生リート投資法人、三井不動産ロジスティクスパーク投資法人、投資法人みらい、三菱地所物流リート投資法人、CREロジスティクスファンド投資法人、ザイマックス・リート投資法人、タカラレーベン不動産投資法人、アドバンス・ロジスティクス投資法人、日本ビルファンド投資法人、ジャパンリアルエステイト投資法人、日本都市ファンド投資法人、オリックス不動産投資法人、日本プライムリアルティ投資法人、NTT都市開発リート投資法人、東急リアル・エステート投資法人、グローバル・ワン不動産投資法人、ユナイテッド・アーバン投資法人、インヴィンシブル投資法人、フロンティア不動産投資法人、平和不動産リート投資法人、日本ロジスティクスファンド投資法人、福岡リート投資法人、いちごオフィスリート投資法人、大和証券オフィス投資法人、阪急阪神リート投資法人、スターツプロシード投資法人、大和ハウスリート投資法人、ジャパン・ホテル・リート投資法人、大和証券リビング投資法人、ジャパンエクセレント投資法人につきましては、委託会社の利害関係人である三菱UFJ信託銀行、三菱UFJ銀行、三菱UFJモルガン・スタンレー証券、モルガン・スタンレーMUFJ証券が当該ファンドの一般事務受託会社等となっています。(各ファンドで開示されている2023年7月31日時点の有価証券報告書または有価証券届出書等より記載)

純資産総額の10%を超える不動産ファンドに関する組入投資証券の内容  
当期末において10%を超える銘柄の組入れはございません。

## 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	不動産投信指数先物取引	東証REIT指数	百万円 1,792	百万円 -

## ○有価証券の貸付及び借入の状況

(2024年1月26日現在)

区 分	当 期 末	
	数	量
貸付有価証券<投資証券>総口数		口 56,735

## ○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
投資証券	千円 100,546,877	% 89.4
コール・ローン等、その他	11,886,516	10.6
投資信託財産総額	112,433,393	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	112,431,510,257
コール・ローン等	11,019,994,112
投資証券(評価額)	100,546,877,425
未収配当金	749,152,064
その他未収収益	231,550
差入委託証拠金	115,255,106
(B) 負債	10,230,265,380
未払金	586,860,686
未払解約金	67,188,016
未払利息	△ 106,197
受入担保金	9,576,322,875
(C) 純資産総額(A-B)	102,201,244,877
元本	28,967,583,332
次期繰越損益金	73,233,661,545
(D) 受益権総口数	28,967,583,332口
1万口当たり基準価額(C/D)	35,281円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 22,777,413,306円  
 期中追加設定元本額 9,412,859,047円  
 期中一部解約元本額 3,222,689,021円  
 また、1口当たり純資産額は、期末3.5281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 Slim バランス(8資産均等型)	8,498,954,748円
eMAXIS Slim 国内リートインデックス	4,416,581,169円
つみたて8資産均等バランス	4,160,894,592円
eMAXIS 国内リートインデックス	4,005,255,931円
eMAXIS バランス(8資産均等型)	1,695,074,917円
オルタナティブ資産セレクトション(ラップ向け)	1,157,018,741円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(標準型)	865,517,622円
三菱UFJ <DC>J-REITインデックスファンド	698,361,080円
ラップ向けインデックスf 国内リート	513,469,091円
三菱UFJ プライムバランス(8資産)(確定拠出年金)	438,307,742円
日本リートインデックスファンドS	397,889,264円
MUKAM 3資産インカムバランスファンド(適格機関投資家販売制限付)	377,898,956円
eMAXIS 最適化バランス(マイミッドフィルダー)	201,173,222円
eMAXIS 最適化バランス(マイフォワード)	171,204,247円
eMAXIS バランス(波乗り型)	150,884,725円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(積極型)	105,723,123円
MUFG ウェルス・インサイト・ファンド(保守型)	104,487,466円
J-REITインデックスファンド(ラップ向け)	84,480,105円
eMAXIS 最適化バランス(マイストライカー)	70,532,341円
eMAXIS 最適化バランス(マイディフェンダー)	45,142,333円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-01(適格機関投資家限定)	43,683,780円
MUKAM アセットアロケーションファンド2023-03(適格機関投資家限定)	42,265,508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	3,788,505,135
受取配当金	3,738,881,398
受取利息	95,723
その他収益金	50,559,197
支払利息	△ 1,031,183
(B) 有価証券売買損益	△ 1,274,717,794
売買益	1,900,893,387
売買損	△ 3,175,611,181
(C) 先物取引等取引損益	37,767,440
取引益	131,205,530
取引損	△ 93,438,090
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,551,554,781
(E) 前期繰越損益金	55,119,541,415
(F) 追加信託差損益金	23,685,554,148
(G) 解約差損益金	△ 8,122,988,799
(H) 計(D+E+F+G)	73,233,661,545
次期繰越損益金(H)	73,233,661,545

(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。



MUKAM アセットアロケーションファンド2023-05 (適格機関投資家限定)	41,745,917円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-11 (適格機関投資家限定)	41,380,171円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-07 (適格機関投資家限定)	41,189,187円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-03 (適格機関投資家限定)	41,025,580円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-05 (適格機関投資家限定)	40,524,225円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-09 (適格機関投資家限定)	40,129,598円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-07 (適格機関投資家限定)	36,872,615円
三菱UFJ 国内リートインデックスファンド	36,663,864円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-11 (適格機関投資家限定)	36,383,347円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-05 (適格機関投資家限定)	36,375,423円
MUKAM アセットアロケーションファンド2020-09 (適格機関投資家限定)	36,352,853円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-03 (適格機関投資家限定)	36,247,289円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-11 (適格機関投資家限定)	36,183,882円
MUKAM アセットアロケーションファンド2022-01 (適格機関投資家限定)	36,150,033円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-01 (適格機関投資家限定)	36,098,235円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-07 (適格機関投資家限定)	35,735,992円
MUKAM アセットアロケーションファンド2021-09 (適格機関投資家限定)	35,712,758円
eMAXIS 最適化バランス (マイゴールキーパー)	27,504,631円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定成長型)	22,277,579円
世界8資産バランスファンドVL (適格機関投資家限定)	13,433,589円
アクティブアロケーションファンド (ラップ向け)	4,977,713円
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	3,885,032円
三菱UFJ アドバンスト・バランス (安定型)	2,964,387円
eMAXIS マイマネージャー 1980s	1,427,207円
eMAXIS マイマネージャー 1970s	759,099円
eMAXIS マイマネージャー 1990s	538,674円
マルチアセット運用戦略ファンド (適格機関投資家限定)	243,749円
合計	28,967,583,332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)