

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／海外／不動産投信／インデックス型	
信託期間	無期限（2016年1月29日設定）	
運用方針	米国・リート・マザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の不動産投資信託証券に投資を行い、S&P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）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。実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。	
主要運用対象	ベビーフンド	米国・リート・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、米国の不動産投資信託証券に直接投資することがあります。
	マザーファンド	米国の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に制限を設けません。
	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に制限を設けません。
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）



イーマックス

eMAXIS 米国リートインデックス

第8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 米国リートインデックス」は、去る1月26日に第8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 (分配額)	基準価額			S&P米国REITインデックス (配当込み、円換算ベース)		投資信託 証券組入比率	不動産 投信先物 指数比率	純資産 総額
		税 分 配	み 金	期 騰 落	中 率	期 騰 落			
	円	円	%		%	%	%	百万円	
4期(2020年1月27日)	12,229	0	16.2	50,378	16.9	98.7	—	475	
5期(2021年1月26日)	10,501	0	△14.1	43,243	△14.2	99.2	—	637	
6期(2022年1月26日)	14,751	0	40.5	60,898	40.8	99.4	—	1,536	
7期(2023年1月26日)	14,649	0	△0.7	60,427	△0.8	96.9	3.1	1,944	
8期(2024年1月26日)	17,005	0	16.1	70,181	16.1	97.4	2.6	2,226	

(注) S & P米国REITインデックス(配当込み)とは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している指数で、米国の不動産投資信託(REIT)および同様の制度に基づく銘柄を対象に浮動株修正時価総額に基づいて算出されています。S & P米国REITインデックス(配当込み、円換算ベース)は、S & P米国REITインデックス(配当込み)をもとに、委託会社が計算したものです。S & P米国REITインデックス(配当込み)はS&P Dow Jones Indices LLC(「SPDJ」)の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社に付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC(「S&P」)の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC(「Dow Jones」)の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社にそれぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJ、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P米国REITインデックス(配当込み)の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「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		S & P米国REITインデックス (配当込み、 円換算ベース)		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	%		%	%	%
	14,649	—	60,427	—	96.9	3.1
1 月末	14,938	2.0	61,620	2.0	96.8	3.1
2 月末	15,192	3.7	62,728	3.8	97.8	2.0
3 月末	14,117	△ 3.6	58,216	△ 3.7	96.6	3.0
4 月末	14,406	△ 1.7	59,415	△ 1.7	98.6	1.3
5 月末	14,670	0.1	60,542	0.2	97.6	2.2
6 月末	15,966	9.0	65,833	8.9	98.3	1.2
7 月末	15,940	8.8	65,764	8.8	97.9	2.1
8 月末	16,227	10.8	66,992	10.9	97.5	2.5
9 月末	15,318	4.6	63,201	4.6	96.2	3.6
10 月末	14,418	△ 1.6	59,497	△ 1.5	97.3	2.6
11 月末	15,774	7.7	65,077	7.7	97.3	2.5
12 月末	17,059	16.5	70,358	16.4	96.9	3.0
(期 末) 2024年 1 月26日						
	17,005	16.1	70,181	16.1	97.4	2.6

(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8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8期首	14,649円
第8期末	17,005円
既払分配金	0円
騰落率	16.1%

※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16.1%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（16.1%）と同程度となりました。

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8期：2023年1月27日～2024年1月26日

投資環境について

▶ 米国REIT市況 米国REIT市況はほぼ横ばいとなりました。

主要国の長期金利の上昇などを受けて米国REIT市況は下落する場面がみられたものの、期間末にかけては主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の

鈍化を受けて上昇し、ほぼ横ばいで終了しました。

▶ 為替市況 米ドルは円に対して上昇しました。

為替市況は、期間の初めに比べて14.3%の円安・米ドル高となりました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ eMAXIS 米国リートインデックス 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。

▶ 米国・リート・マザーファンド S & P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）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、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。

不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、各銘柄の組入比率が原則ベンチマークに準じた比率となるようにポートフォリオを構築しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ eMAXIS 米国リートインデックス

ベンチマークとの乖離は△0.0%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△0.8%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0.8%程度でした。

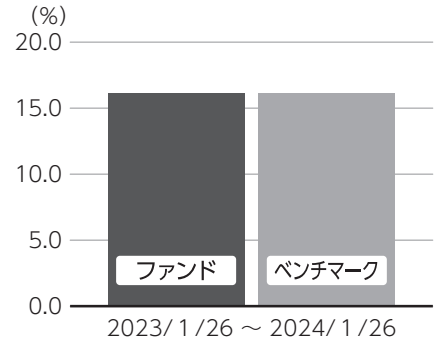
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

*その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

主なマイナス要因：組入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8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	7,005

(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 米国リートインデックス
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ 米国・リート・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	102	0.660	(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)	(46)	(0.297)	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)	(46)	(0.297)	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)	(0.066)	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	0.007	(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)	(0.002)	
(先物・オプション)	(1)	(0.004)	
(c) 有価証券取引税	0	0.000	(c) 有価証券取引税 = 期中の有価証券取引税 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(投資信託証券)	(0)	(0.000)	
(d) その他費用	15	0.097	(d) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(保 管 費 用)	(12)	(0.076)	有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用
(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
(そ の 他)	(3)	(0.018)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	118	0.764	

期中の平均基準価額は、15,450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。

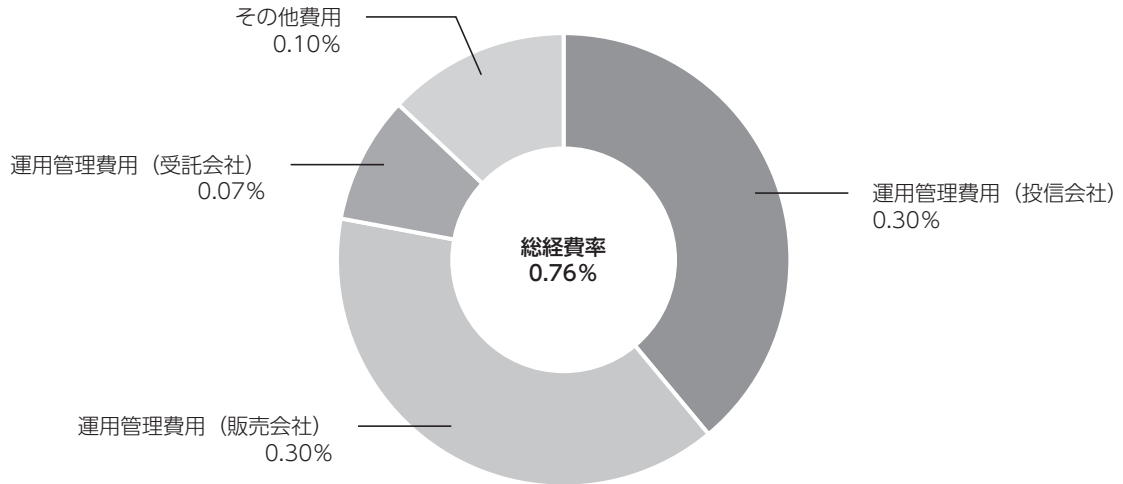
(注) 売買委託手数料、有価証券取引税およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.76%**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
米国・リート・マザーファンド	千口 364,448	千円 601,069	千口 389,771	千円 640,319

○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 米国リートインデックス>
該当事項はございません。

<米国・リート・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	$\frac{D}{C}$
			%			%
為替直物取引	百万円 586	百万円 571	% 97.4	百万円 633	百万円 620	% 97.9

平均保有割合 69.7%

※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銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○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
米国・リート・マザーファンド	千口 1,257,268	千口 1,231,945	千円 2,226,248

○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
米国・リート・マザーファンド	千円 2,226,248	% 99.3
コール・ローン等、その他	15,561	0.7
投資信託財産総額	2,241,809	100.0

(注) 米国・リート・マザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(3,158,844千円)の投資信託財産総額(3,161,968千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=147.70円			
------------------	--	--	--

○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	2,241,809,503
コール・ローン等	10,876,630
米国・リート・マザーファンド(評価額)	2,226,248,868
未収入金	4,684,005
(B) 負債	14,896,121
未払解約金	8,192,587
未払信託報酬	6,669,136
未払利息	2
その他未払費用	34,396
(C) 純資産総額(A-B)	2,226,913,382
元本	1,309,537,536
次期繰越損益金	917,375,846
(D) 受益権総口数	1,309,537,536口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,005円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,327,170,054円
 期中追加設定元本額 696,531,487円
 期中一部解約元本額 714,164,005円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7005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	72,865,464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	84,642,186円
収益調整金額	698,752,472円
分配準備積立金額	61,115,724円
当ファンドの分配対象収益額	917,375,846円
1万口当たり収益分配対象額	7,005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	△ 2,115
受取利息	47
支払利息	△ 2,162
(B) 有価証券売買損益	260,336,613
売買益	321,500,081
売買損	△ 61,163,468
(C) 信託報酬等	△ 12,847,468
(D) 当期繰越損益金(A+B+C)	247,487,030
(E) 前期繰越損益金	△ 28,863,656
(F) 追加信託差損益金	698,752,472
(配当等相当額)	(457,585,771)
(売買損益相当額)	(241,166,701)
(G) 計(D+E+F)	917,375,846
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	917,375,846
追加信託差損益金	698,752,472
(配当等相当額)	(460,373,896)
(売買損益相当額)	(238,378,576)
分配準備積立金	218,623,374

- (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)

米国・リート・マザーファンド

《第8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]

「米国・リート・マザーファンド」は、1月26日に第8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8期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として米国の不動産投資信託証券に投資を行い、S & P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。不動産投資信託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。組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。
主要運用対象	米国の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	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		S & P米国REITインデックス (配当込み、円換算ベース)		投資信託証券 組入比率	不動産 投信指 先物比	純総 資産 率	純総 資産 額
	期騰落	中率	期騰落	中率				
	円	%		%	%	%		百万円
4期(2020年1月27日)	12,632	17.4	50,378	16.9	98.8	—		680
5期(2021年1月26日)	10,924	△13.5	43,243	△14.2	99.2	—		1,464
6期(2022年1月26日)	15,458	41.5	60,898	40.8	99.4	—		2,741
7期(2023年1月26日)	15,459	0.0	60,427	△0.8	96.9	3.1		2,743
8期(2024年1月26日)	18,071	16.9	70,181	16.1	97.4	2.6		3,155

(注) S & P米国REITインデックス（配当込み）とは、S & Pダウ・ジョーンズ・インデックスLLCが公表している指数で、米国の不動産投資信託（REIT）および同様の制度に基づく銘柄を対象に浮動株修正時価総額に基づいて算出されています。S & P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）は、S & P米国REITインデックス（配当込み）をもとに、委託会社が計算したものです。S & P米国REITインデックス（配当込み）はS&P Dow Jones Indices LLC（「SPDJJI」）の商品であり、これを利用するライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社が付与されています。Standard & Poor's[®]およびS&P[®]はStandard & Poor's Financial Services LLC（「S&P」）の登録商標で、Dow Jones[®]はDow Jones Trademark Holdings LLC（「Dow Jones」）の登録商標であり、これらの商標を利用するライセンスがSPDJJIに、特定目的での利用を許諾するサブライセンスが三菱UFJアセットマネジメント株式会社それぞれ付与されています。当ファンドは、SPDJJI、Dow Jones、S&Pまたはそれぞれの関連会社によってスポンサー、保証、販売、または販売促進されているものではなく、これら関係者のいずれも、かかる商品への投資の妥当性に関するいかなる表明も行わず、S & P米国REITインデックス（配当込み）の誤り、欠落、または中断に対して一切の責任も負いません。

(注) 外国の指数は、基準価額への反映に合わせて前営業日の値を使用しております。

(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		S & P米国REITインデックス (配当込み、 円換算ベース)		投 資 信 託 証 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	%		%	%	%
	15,459	—	60,427	—	96.9	3.1
1月末	15,765	2.0	61,620	2.0	96.8	3.1
2月末	16,043	3.8	62,728	3.8	97.8	2.0
3月末	14,916	△ 3.5	58,216	△ 3.7	96.6	3.0
4月末	15,229	△ 1.5	59,415	△ 1.7	98.6	1.3
5月末	15,518	0.4	60,542	0.2	97.6	2.2
6月末	16,900	9.3	65,833	8.9	98.4	1.2
7月末	16,883	9.2	65,764	8.8	97.9	2.1
8月末	17,196	11.2	66,992	10.9	97.5	2.5
9月末	16,242	5.1	63,201	4.6	96.2	3.6
10月末	15,296	△ 1.1	59,497	△ 1.5	97.3	2.6
11月末	16,744	8.3	65,077	7.7	97.3	2.5
12月末	18,119	17.2	70,358	16.4	96.9	3.0
(期 末) 2024年1月26日	18,071	16.9	70,181	16.1	97.4	2.6

(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

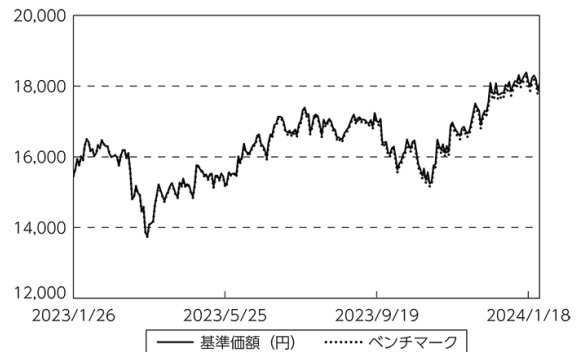
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ16.9%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(16.1%)を0.8%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

◎ 米国REIT市況

- ・ 米国REIT市況はほぼ横ばいとなりました。
- ・ 主要国の長期金利の上昇などを受けて米国REIT市況は下落する場面がみられたものの、期間末にかけては主要中銀による政策金利の据え置きやインフレ率の鈍化を受けて上昇し、ほぼ横ばいで終了しました。

◎ 為替市況

- ・ 米ドルは円に対して上昇しました。
- ・ 為替市況は、期間の初めに比べて14.3%の円安・米ドル高となりました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ S&P米国REITインデックス（配当込み、円換算ベース）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、同インデックスに連動する投資成果をめざして運用を行いました。
- ・ 不動産投資信託証券の組入比率は高位を保ち、各銘柄の組入比率が原則ベンチマークに準じた比率となるようにポートフォリオを構築しました。

● 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16.1%の上昇になったため、カイ離は0.8%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。

[※]その他の要因には、ファンドとベンチマークで適用される配当税率の差異によるプラス要因などが含まれます。

(主なマイナス要因)

- ・ 組入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 (投 資 信 託 証 券) (先 物 ・ オ プ シ ョ ン)	円 1 (0) (1)	% 0.007 (0.002) (0.004)	(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
(b) 有 価 証 券 取 引 税 (投 資 信 託 証 券)	0 (0)	0.000 (0.000)	(b) 有価証券取引税＝期中の有価証券取引税÷期中の平均受益権口数 有価証券の取引の都度発生する取引に関する税金
(c) そ の 他 費 用 (保 管 費 用) (そ の 他)	15 (12) (3)	0.093 (0.076) (0.018)	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 有価証券等を海外で保管する場合、海外の保管機関に支払われる費用 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	16	0.100	
期中の平均基準価額は、16,363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
外 国	アメリカ	百株 — (2)	千アメリカドル — (5)	百株 — (2)	千アメリカドル — (5)

(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す。

投資信託証券

銘柄	買付		売付	
	口数	金額	口数	金額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
SITE CENTERS CORP	0.624	7	0.918	12
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2	41	1	38
AGREE REALTY CORP	0.222	13	0.096	6
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	0.748	86	0.519	61
PROLOGIS INC	2	337	2	323
CAMDEN PROPERTY TRUST	0.297	30	0.378	42
NNN REIT INC	0.451	18	0.498	21
COPT DEFENSE PROPERTIES	0.361	9	0.5	12
COUSINS PROPERTIES INC	0.425	9	0.558	13
DIGITAL REALTY TRUST INC	1	154	0.855	95
EASTGROUP PROPERTIES INC	0.11	19	0.041	6
EPR PROPERTIES	0.194	8	0.263	12
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	0.682	45	0.423	29
ESSEX PROPERTY TRUST INC	0.198	44	0.203	47
EXTRA SPACE STORAGE INC	0.66 (1)	90 (162)	0.419	63
FEDERAL REALTY INVS TRUST	0.197	18	0.267	27
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	0.266	13	0.374	19
GETTY REALTY CORP	0.186	6	—	—
WELLTOWER INC	3	261	1	109
HIGHWOODS PROPERTIES INC	0.508	11	0.606	13
KILROY REALTY CORP	0.312	10	0.403	12
KITE REALTY GROUP TRUST	0.402	8	0.553	11
LXP INDUSTRIAL TRUST	0.705	6	0.65	6
BOSTON PROPERTIES INC	0.482	29	0.413	25
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	—	—	0.731	5
MID-AMERICA APARTMENT COMM	0.431	60	0.328	47
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	0.86	25	0.896	26
RPT REALTY	— (△ 1)	— (△ 12)	0.592	6
REALTY INCOME CORP	3 (2)	224 (111)	1	105
REGENCY CENTERS CORP	0.26 (0.245)	15 (13)	0.413	25
LIFE STORAGE INC	0.054 (△ 1)	6 (△ 162)	0.213	26
SUN COMMUNITIES INC	0.434	53	0.339	44
TANGER INC	0.377	8	0.558	12
CUBESMART	0.629	27	0.574	25
UDR INC	1	55	1	60
URSTADT BIDDLE - CLASS A	— (△0.708)	— (△ 13)	—	—
VENTAS INC	1	65	1	55

銘 柄	買 付		売 付	
	口 数	金 額	口 数	金 額
アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	—	—	(0.727)	(6)
DOUGLAS EMMETT INC	0.721	9	1	13
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	0.533	7	0.882	12
RLJ LODGING TRUST	0.774	7	1	11
STAG INDUSTRIAL INC	0.32	12	0.205	6
SABRA HEALTH CARE REIT INC	0.721	8	1	13
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	0.996	18	0.756	14
WP CAREY INC	0.753	50	0.386	26
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	0.099	8	0.071	5
TERRENO REALTY CORP	0.489	29	0.211	12
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	—	—	0.163	6
	(△ 2)	(△ 111)		
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	1	57	0.463	26
PHYSICIANS REALTY TRUST	0.504	6	0.446	6
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	1	37	1	38
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	0.61	12	0.849	18
CARETRUST REIT INC	0.528	11	—	—
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	1	64	1	55
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	0.521	8	0.68	12
IRON MOUNTAIN INC	1	66	1	62
STORE CAPITAL CORP	—	—	—	—
			(5)	(172)
EQUINIX INC	0.312	234	0.261	198
UNITI GROUP INC	4	24	—	—
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	—	—	0.159	6
GLOBAL NET LEASE INC	0.883	9	1	12
	(1)	(16)		
PARK HOTELS & RESORTS INC	0.585	7	1	13
EQUITY RESIDENTIAL	1	88	1	71
INVITATION HOMES INC	2	74	1	68
VICI PROPERTIES INC	4	136	2	83
AMERICOLD REALTY TRUST INC	1	33	1	34
SAFEHOLD INC	—	—	—	—
	(△0.546)	(△ 18)		
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	—	—	—	—
	(△ 2)	(△ 16)		
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	0.285	6	—	—
BROADSTONE NET LEASE INC	0.426	6	0.397	6
APARTMENT INCOME REIT CO	—	—	0.184	6
INDUS REALTY TRUST INC	—	—	—	—
			(0.105)	(6)
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	0.306	10	0.376	12
BLUEROCK HOMES TRUST INC	—	—	0.056	0.74086

外

国

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
外国	アメリカ	千口	千アメリカドル	千口	千アメリカドル
	NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	— (0.017)	— (0.14625)	—	—
	STAR HOLDINGS	— (0.256)	— (5)	0.256	3
	PEAKSTONE REALTY TRUST	0.699	13	—	—
	NET LEASE OFFICE PROPERTY	— (0.276)	— (—)	—	—
	HOST HOTELS & RESORTS INC	1	27	1	29
	SAFEHOLD INC	— (0.546)	— (18)	— (1)	— (5)
	PUBLIC STORAGE	0.499	143	0.445	129
	SIMON PROPERTY GROUP INC	1	126	0.976	116
	VORNADO REALTY TRUST	0.474	9	0.635	13
	KIMCO REALTY CORP	1 (0.772)	33 (12)	1	29
	AVALONBAY COMMUNITIES INC	0.475	84	0.36	66
	APARTMENT INVT & MGMT CO -A	—	—	0.906	6
小計	62 (△ 2)	3,314 (5)	52 (7)	2,712 (191)	

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は分割・合併および償還等による増減分で、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
外国	不動産投信指数先物取引	百万円 842	百万円 854	百万円 —	百万円 —

(注) 外国の取引金額は、各月末(決算日の属する月の月初から決算日までの分については決算日)の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算した金額の合計です。

○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	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	$\frac{D}{C}$
為替直物取引	百万円 586	百万円 571	% 97.4	百万円 633	百万円 620	% 97.9

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銀行、三菱UFJ信託銀行です。

○組入資産の明細

(2024年1月26日現在)

外国投資信託証券

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
SITE CENTERS CORP	3	3	48	7,153	0.2
HEALTHPEAK PROPERTIES INC	10	11	215	31,888	1.0
MACERICH CO/THE	4	4	71	10,564	0.3
ACADIA REALTY TRUST	1	1	33	4,980	0.2
AGREE REALTY CORP	1	1	114	16,877	0.5
ALEXANDER'S INC	0.056	0.056	12	1,895	0.1
ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	2	3	390	57,749	1.8
PROLOGIS INC	18	18	2,345	346,438	11.0
ASHFORD HOSPITALITY TRUST	0.693	0.693	0.98406	145	0.0
BRANDYWINE REALTY TRUST	3	3	17	2,641	0.1
CAMDEN PROPERTY TRUST	2	2	198	29,308	0.9
NNN REIT INC	3	3	147	21,759	0.7
COPT DEFENSE PROPERTIES	2	2	52	7,818	0.2
COUSINS PROPERTIES INC	3	2	67	10,023	0.3
DIAMONDRock HOSPITALITY CO	4	4	40	6,040	0.2
DIGITAL REALTY TRUST INC	5	6	868	128,276	4.1
EASTGROUP PROPERTIES INC	0.88	0.949	169	25,028	0.8
EPR PROPERTIES	1	1	64	9,558	0.3
EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	3	3	251	37,161	1.2
ESSEX PROPERTY TRUST INC	1	1	304	45,018	1.4
EXTRA SPACE STORAGE INC	2	4	634	93,776	3.0
FEDERAL REALTY INVS TRUST	1	1	147	21,758	0.7
FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	2	2	133	19,782	0.6
GETTY REALTY CORP	0.659	0.845	23	3,467	0.1
WELLTOWER INC	9	11	972	143,690	4.6
HIGHWOODS PROPERTIES INC	2	2	45	6,741	0.2
SERVICE PROPERTIES TRUST	3	3	27	4,001	0.1
EQUITY COMMONWEALTH	2	2	42	6,244	0.2
KILROY REALTY CORP	2	2	79	11,683	0.4
KITE REALTY GROUP TRUST	4	4	92	13,705	0.4
LXP INDUSTRIAL TRUST	5	5	54	8,027	0.3
LTC PROPERTIES INC	0.87	0.87	27	4,091	0.1
VERIS RESIDENTIAL INC	1	1	25	3,718	0.1
BOSTON PROPERTIES INC	2	2	210	31,143	1.0
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	12	11	38	5,713	0.2
MID-AMERICA APARTMENT COMM	2	2	312	46,179	1.5
NATL HEALTH INVESTORS INC	0.893	0.893	48	7,126	0.2
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	4	4	137	20,303	0.6
ONE LIBERTY PROPERTIES INC	0.365	0.365	7	1,143	0.0
RPT REALTY	1	—	—	—	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
REALTY INCOME CORP	12	16	921	136,068	4.3
REGENCY CENTERS CORP	3	3	204	30,253	1.0
SAUL CENTERS INC	0.302	0.302	12	1,786	0.1
DIVERSIFIED HEALTHCARE TRUST	5	5	16	2,406	0.1
SL GREEN REALTY CORP	1	1	62	9,171	0.3
LIFE STORAGE INC	1	—	—	—	—
SUN COMMUNITIES INC	2	2	315	46,565	1.5
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	4	4	45	6,677	0.2
TANGER INC	2	2	56	8,337	0.3
CUBESMART	4	4	207	30,717	1.0
UDR INC	6	6	225	33,268	1.1
UNIVERSAL HEALTH RLTY INCOME	0.275	0.275	11	1,715	0.1
URSTADT BIDDLE - CLASS A	0.708	—	—	—	—
VENTAS INC	7	8	386	57,113	1.8
ELME COMMUNITIES	1	1	25	3,773	0.1
HERSHA HOSPITALITY TRUST-A	0.727	—	—	—	—
UMH PROPERTIES INC	1	1	15	2,296	0.1
GLADSTONE COMMERCIAL CORP	0.839	0.839	11	1,653	0.1
FRANKLIN STREET PROPERTIES C	1	1	3	561	0.0
CENTERSPACE	0.289	0.289	16	2,407	0.1
DOUGLAS EMMETT INC	3	3	47	6,982	0.2
PEBBLEBROOK HOTEL TRUST	2	2	36	5,433	0.2
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	2	2	19	2,877	0.1
HUDSON PACIFIC PROPERTIES IN	2	2	22	3,284	0.1
AMERICAN ASSETS TRUST INC	1	1	24	3,546	0.1
SUMMIT HOTEL PROPERTIES INC	2	2	16	2,449	0.1
OFFICE PROPERTIES INCOME TRU	1	1	3	581	0.0
RLJ LODGING TRUST	3	3	35	5,291	0.2
RETAIL OPPORTUNITY INVESTMEN	2	2	36	5,456	0.2
STAG INDUSTRIAL INC	3	3	141	20,847	0.7
SABRA HEALTH CARE REIT INC	4	4	58	8,685	0.3
HEALTHCARE REALTY TRUST INC	7	7	124	18,333	0.6
WP CAREY INC	4	4	281	41,641	1.3
WHITESTONE REIT	0.74	0.74	9	1,394	0.0
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	1	1	125	18,555	0.6
CHATHAM LODGING TRUST	1	1	12	1,835	0.1
TERRENO REALTY CORP	1	1	98	14,502	0.5
SPIRIT REALTY CAPITAL INC	2	—	—	—	—
ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	1	1	15	2,348	0.1
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	3	4	231	34,183	1.1
PHYSICIANS REALTY TRUST	4	4	61	9,015	0.3
AMERICAN HOMES 4 RENT- A	6	6	215	31,822	1.0
BRAEMAR HOTELS & RESORTS INC	1	1	3	584	0.0
EMPIRE STATE REALTY TRUST-A	2	2	28	4,265	0.1
BRIXMOR PROPERTY GROUP INC	6	5	132	19,606	0.6

銘柄	期首(前期末)		当 期 末		
	口 数	口 数	評 価 額		比 率
			外貨建金額	邦貨換算金額	
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%
CARETRUST REIT INC	2	2	54	8,052	0.3
GAMING AND LEISURE PROPERTIE	5	5	250	36,959	1.2
INDEPENDENCE REALTY TRUST IN	4	4	65	9,712	0.3
IRON MOUNTAIN INC	5	5	404	59,783	1.9
STORE CAPITAL CORP	5	—	—	—	—
URBAN EDGE PROPERTIES	2	2	40	5,967	0.2
EQUINIX INC	1	1	1,540	227,596	7.2
PARAMOUNT GROUP INC	3	3	15	2,330	0.1
EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	1	1	23	3,408	0.1
XENIA HOTELS & RESORTS INC	2	2	31	4,706	0.1
UNITI GROUP INC	—	4	25	3,744	0.1
NATIONAL STORAGE AFFILIATES	1	1	60	8,967	0.3
NEXPOINT RESIDENTIAL	0.469	0.469	15	2,239	0.1
APPLE HOSPITALITY REIT INC	4	4	69	10,330	0.3
GLOBAL NET LEASE INC	2	3	32	4,748	0.2
CITY OFFICE REIT INC	0.751	0.751	4	625	0.0
FOUR CORNERS PROPERTY TRUST	1	1	41	6,138	0.2
COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	0.534	0.534	13	2,058	0.1
FARMLAND PARTNERS INC	0.946	0.946	10	1,612	0.1
PARK HOTELS & RESORTS INC	4	4	64	9,514	0.3
EQUITY RESIDENTIAL	6	6	411	60,811	1.9
INVITATION HOMES INC	11	11	387	57,250	1.8
JBG SMITH PROPERTIES	1	1	32	4,757	0.2
ALEXANDER & BALDWIN INC	1	1	27	4,073	0.1
CLIPPER REALTY INC	0.04	0.04	0.2024	29	0.0
GLADSTONE LAND CORP	0.603	0.603	8	1,244	0.0
GLOBAL MEDICAL REIT INC	1	1	14	2,106	0.1
VICI PROPERTIES INC	19	20	637	94,159	3.0
AMERICOLD REALTY TRUST INC	5	5	156	23,061	0.7
INDUSTRIAL LOGISTICS PROPERT	1	1	4	738	0.0
BRT APARTMENTS CORP	0.369	0.369	6	968	0.0
INNOVATIVE INDUSTRIAL PROPER	0.576	0.576	53	7,966	0.3
SAFEHOLD INC	0.546	—	—	—	—
NECESSITY RETAIL REIT INC/TH	2	—	—	—	—
ESSENTIAL PROPERTIES REALTY	2	3	77	11,472	0.4
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	0.704	0.704	16	2,378	0.1
NETSTREIT CORP	1	1	21	3,151	0.1
BROADSTONE NET LEASE INC	3	3	59	8,780	0.3
APARTMENT INCOME REIT CO	3	2	94	13,929	0.4
CTO REALTY GROWTH INC	0.422	0.422	7	1,048	0.0
ALPINE INCOME PROPERTY TRUST	0.2	0.2	3	472	0.0
INDUS REALTY TRUST INC	0.105	—	—	—	—
POSTAL REALTY TRUST INC- A	0.24	0.24	3	513	0.0
ORION OFFICE REIT INC	1	1	5	831	0.0
PHILLIPS EDISON & COMPANY IN	2	2	80	11,961	0.4

銘柄	期首(前期末)		当 期 末			
	口 数	口 数	評 価 額		比 率	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
(アメリカ)	千口	千口	千アメリカドル	千円	%	
CBL & ASSOCIATES PROPERTIES	0.5	0.5	12	1,787	0.1	
INVENTRUST PROPERTIES CORP	1	1	33	5,009	0.2	
BLUEROCK HOMES TRUST INC	0.056	—	—	—	—	
NEXPOINT DIVERSIFIED REAL ES	0.7	0.717	4	738	0.0	
PEAKSTONE REALTY TRUST	—	0.699	11	1,661	0.1	
NET LEASE OFFICE PROPERTY	—	0.276	6	1,016	0.0	
HOST HOTELS & RESORTS INC	14	14	280	41,438	1.3	
SAFEHOLD INC	1	0.813	16	2,467	0.1	
PUBLIC STORAGE	3	3	930	137,428	4.4	
SIMON PROPERTY GROUP INC	6	6	939	138,727	4.4	
VORNADO REALTY TRUST	3	3	88	13,133	0.4	
KIMCO REALTY CORP	12	13	282	41,681	1.3	
AVALONBAY COMMUNITIES INC	2	2	505	74,683	2.4	
APARTMENT INVT & MGMT CO -A	3	2	17	2,526	0.1	
合 計	口 数 ・ 金 額	446	446	20,808	3,073,430	
	銘 柄 数 < 比 率 >	141	134	—	<97.4%>	

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

(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。

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信託証券の内容

●PROLOGIS INC (期末組入比率11.0%)

① 信託の概要

S & P米国REITインデックスにおいて約11%を占めます。

米国を中心に世界各地の産業用不動産に対して、投資・開発を行います。

② 1口当たりの資産運用報酬額等

投資信託の資産運用報酬額等に相当する詳細な開示がないため、1口当たりの資産運用報酬額等に関する開示は出来ません。

ホームページアドレス <https://www.prologis.com/>

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別			当 期	
			買 建 額	売 建 額
外国	不動産投信指数先物取引	DJREIT2403	百万円 80	百万円 -

(注) 邦貨換算金額は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。

○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
投資証券	千円 3,073,430	% 97.2
コール・ローン等、その他	88,538	2.8
投資信託財産総額	3,161,968	100.0

(注) 期末における外貨建純資産(3,158,844千円)の投資信託財産総額(3,161,968千円)に対する比率は99.9%です。

(注) 外貨建資産は、期末の時価をわが国の対顧客電信売買相場の仲値により邦貨換算したものです。なお、期末における邦貨換算レートは以下の通りです。

1 アメリカドル=147.70円			
------------------	--	--	--

○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	3,169,022,957
コール・ローン等	53,300,479
投資証券(評価額)	3,073,430,465
未収入金	7,195,711
未収配当金	1,467,222
差入委託証拠金	33,629,080
(B) 負債	13,879,218
未払金	9,195,213
未払解約金	4,684,005
(C) 純資産総額(A-B)	3,155,143,739
元本	1,745,927,631
次期繰越損益金	1,409,216,108
(D) 受益権総口数	1,745,927,631口
1万口当たり基準価額(C/D)	18,071円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,774,712,757円
 期中追加設定元本額 378,273,873円
 期中一部解約元本額 407,058,999円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.8071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 米国リートインデックス | 1,231,945,586円 |
| MUKAM バランスファンド2019-12 (適格機関投資家限定) | 109,111,539円 |
| MUKAM バランスファンド2020-07 (適格機関投資家限定) | 107,906,848円 |
| MUKAM バランスファンド2020-10 (適格機関投資家限定) | 107,823,931円 |
| MUKAM バランスファンド2021-03 (適格機関投資家限定) | 95,419,622円 |
| MUKAM バランスファンド2021-06 (適格機関投資家限定) | 93,720,105円 |
| 合計 | 1,745,927,631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)

○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	114,319,819
受取配当金	111,351,130
受取利息	2,764,681
その他収益金	206,198
支払利息	△ 2,190
(B) 有価証券売買損益	349,579,565
売買益	540,960,461
売買損	△ 191,380,896
(C) 先物取引等取引損益	△ 3,962,835
取引益	17,099,096
取引損	△ 21,061,931
(D) 保管費用等	△ 2,620,000
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	457,316,549
(F) 前期繰越損益金	968,903,120
(G) 追加信託差損益金	244,534,535
(H) 解約差損益金	△ 261,538,096
(I) 計(E+F+G+H)	1,409,216,108
次期繰越損益金(I)	1,409,216,108

- (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) (G)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) (H)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。