

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（2020年8月31日設定）	
運用方針	<p>ジャパンESGセレクト・リーダーズ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、主としてわが国の株式に投資を行います。</p> <p>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。</p>	
主要運用対象	ベビーフンド	ジャパンESGセレクト・リーダーズ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。なお、わが国の株式に直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の金融商品取引所上場株式（上場予定株式を含みます。）を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーフンド	<ul style="list-style-type: none"> ・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	<ul style="list-style-type: none"> ・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	<p>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。</p> <p>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。）</p>	

運用報告書（全体版）

三菱UFJ DCジャパンESG
セレクト・リーダーズインデックス

第4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「三菱UFJ DCジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス」は、去る1月26日に第4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。

※当ファンドは「サステナブル・ファンド」です。

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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			MSCI ジャパンESG セレクト・リーダーズ指数		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 証券組入比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分	込 配	み 金	期 騰				
(設定日)	円								
2020年8月31日	10,000	—	—	2,535.10	—	—	—	—	1
1期(2021年1月26日)	11,708	0	17.1	2,971.63	17.2	96.2	2.7	1.2	1
2期(2022年1月26日)	12,372	0	5.7	3,143.10	5.8	97.4	1.0	1.6	101
3期(2023年1月26日)	12,870	0	4.0	3,278.64	4.3	97.2	1.4	1.4	504
4期(2024年1月26日)	16,724	0	29.9	4,272.09	30.3	97.5	1.8	0.8	1,217

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、MSCI ESGリサーチが提供する企業格付けと調査を利用し、業種内において相対的にESG（環境、社会、ガバナンス）評価が優れた企業で構成されています。MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は、親指数（MSCI ジャパンIMI指数）構成銘柄の中から、親指数における各業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数に対する著作権およびその他の知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

(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」、「投資信託証券組入比率」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。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		MSCI ジャパンESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 券 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2023年1月26日	円	%		%	%	%	%
	12,870	—	3,278.64	—	97.2	1.4	1.4
1月末	12,805	△ 0.5	3,262.13	△ 0.5	97.2	1.4	1.4
2月末	12,902	0.2	3,287.05	0.3	97.9	0.7	1.4
3月末	13,089	1.7	3,335.25	1.7	96.5	2.1	1.3
4月末	13,513	5.0	3,444.38	5.1	96.6	2.1	1.3
5月末	14,055	9.2	3,583.93	9.3	96.0	2.7	1.3
6月末	15,118	17.5	3,855.66	17.6	97.4	1.3	1.2
7月末	15,327	19.1	3,909.60	19.2	97.4	1.4	1.2
8月末	15,371	19.4	3,922.56	19.6	97.4	1.3	1.3
9月末	15,419	19.8	3,934.10	20.0	96.8	2.0	1.2
10月末	14,908	15.8	3,804.11	16.0	97.5	1.9	1.3
11月末	15,863	23.3	4,050.69	23.5	97.3	1.8	0.8
12月末	15,774	22.6	4,028.68	22.9	98.0	1.2	0.8
(期 末) 2024年1月26日	16,724	29.9	4,272.09	30.3	97.5	1.8	0.8

(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、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「投資信託証券組入比率」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。

※当ファンドは「サステナブル・ファンド」です。

サステナブル・ファンドとは、ファンドの投資判断プロセスにおいてESG要素を主要とし、環境や社会の課題解決・改善に寄与する企業等への投資を行い、お客さまの資産形成および持続可能な社会の実現に貢献するファンドとして、三菱UFJアセットマネジメントが定めたファンドをいいます。サステナブル・ファンドへの認定および除外は今後見直す場合があります。

詳細については、委託会社のホームページ (<https://www.am.mufg.jp/corp/sustainability/sustainability.html>) でご覧いただけます。

ESGとは、環境 (Environment)、社会 (Social)、ガバナンス (Governance) の頭文字を取ったものです。

運用経過

第4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4期首	12,870円
第4期末	16,724円
既払分配金	0円
騰落率	29.9%

※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29.9%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（30.3%）を0.4%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4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

▶ 三菱UFJ DCジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス

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。

▶ ジャパンESGセレクト・リーダーズ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・不動産投資信託証券（REIT）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MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。

なお、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は各業界ごとに相対的にESG評価に優れると判断した企業を選別して構成される指数で、ファンドはその構成比率を高位に維持しました。

加えて、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）の対象期間の騰落率は30.3%、親指数（MSCI ジャパンIMI指数（配当込み））の同期間の騰落率は28.9%となっております。

ESGスコアは下表の通りとなっております。

ESGスコア

2023年12月29日時点

親指数 (MSCI ジャパンIMI 指数)	6.990
MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数	8.217

- ※ ESGスコアとは、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数を構成する個別銘柄ごとのスコア（評点）を、指数構成銘柄の組入比率によって加重平均し0～10点（0が最低評価）で示したものです。ESGリスク（ESGへの取り組み姿勢）を相対的に比較することができます。個別銘柄ごとのスコアは、業種ごとに直面するESGリスク特性などを勘案して相対的に評価・算出したものです。
- ※ MSCI ジャパンIMI 指数とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、わが国の金融商品取引所に上場する大型・中型・小型銘柄で構成されています。

委託会社のステewardシップ活動

委託会社はお客さまから委託された資産の運用を行う立場として、投資先企業が株主利益を考慮して企業価値の向上や持続的な成長を果たすことに資するため、気候変動や人権・ダイバーシティ、ガバナンス体制などの投資先企業におけるESG課題を重視し、企業との「目的を持った対話」や明確な方針のもとでの議決権行使などのステewardシップ活動を実施しました。

2023年1月から2023年12月に開催された投資先国内企業の株主総会における議決権行使状況についてご案内します。

会社提案の23,068議案に関しては4,667議案に反対、株主提案435議案に関しては38議案に賛成しました。この結果、会社提案に対する反対行使比率は20.23%となりました。

委託会社のステewardシップ活動は当社ホームページ (<https://www.am.mufg.jp/corp/responsible/stewardshipcode.html>) にて開示を行っています。

▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ 三菱UFJ DCジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.4\%$ 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 $\Delta 0.4\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

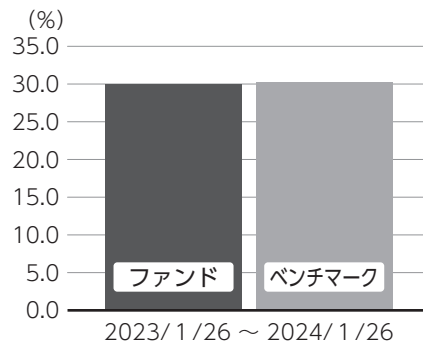
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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：取引要因によるものです。

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4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	6,723

(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。)

▶ **三菱UFJ DCジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス**
マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ **ジャパンESGセレクト・リーダーズ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	35	0.236	(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)	(17)	(0.115)	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)	(15)	(0.099)	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)	(3)	(0.022)	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
(株 式)	(0)	(0.000)	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
(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	35	0.240	

期中の平均基準価額は、14,671円です。

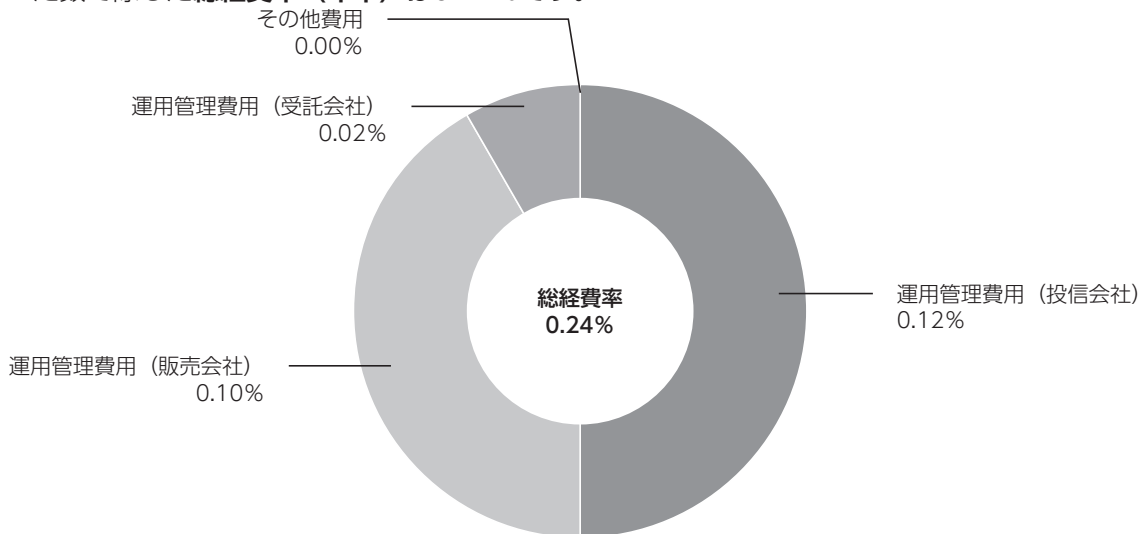
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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0.24%**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
ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	千口 402,663	千円 643,722	千口 84,156	千円 129,386

○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
	ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド
(a) 期中の株式売買金額	2,292,248千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,218,274千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.71

(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

<三菱UFJ DCジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス>

該当事項はございません。

<ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

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 1,462	百万円 341	% 23.3	百万円 829	百万円 181	% 21.8
投資信託証券	12	4	33.3	18	0.666709	3.7
株式先物取引	469	469	100.0	449	449	100.0

平均保有割合 22.0%

※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。

利害関係人の発行する有価証券等

<ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

種類	買付額	売付額	当期末保有額
株式	百万円 9	百万円 116	百万円 -

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

<ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 9
投資信託証券	0.292207

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)	5千円
うち利害関係人への支払額 (B)	4千円
(B) / (A)	94.9%

(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、三菱UFJフィナンシャル・グループ、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
ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	千口 373,976	千口 692,483	千円 1,217,871

○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
ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド	千円 1,217,871	% 99.7
コール・ローン等、その他	3,300	0.3
投資信託財産総額	1,221,171	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	1,221,171,845
コール・ローン等	3,300,738
ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド(信託)	1,217,871,107
(B) 負債	3,206,479
未払解約金	2,130,567
未払信託報酬	1,063,113
その他未払費用	12,799
(C) 純資産総額(A-B)	1,217,965,366
元本	728,290,729
次期繰越損益金	489,674,637
(D) 受益権総口数	728,290,729口
1万口当たり基準価額(C/D)	16,724円

<注記事項>

- ①期首元本額 392,370,328円
 期中追加設定元本額 543,991,630円
 期中一部解約元本額 208,071,229円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.6724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	16,142,087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	149,865,525円
収益調整金額	311,486,972円
分配準備積立金額	12,180,053円
当ファンドの分配対象収益額	489,674,637円
1万口当たり収益分配対象額	6,723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】

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	△ 468
受取利息	9
支払利息	△ 477
(B) 有価証券売買損益	167,759,251
売買益	197,724,283
売買損	△ 29,965,032
(C) 信託報酬等	△ 1,751,171
(D) 当期損益金(A+B+C)	166,007,612
(E) 前期繰越損益金	12,180,053
(F) 追加信託差損益金	311,486,972
(配当等相当額)	(155,977,895)
(売買損益相当額)	(155,509,077)
(G) 計(D+E+F)	489,674,637
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	489,674,637
追加信託差損益金	311,486,972
(配当等相当額)	(157,109,264)
(売買損益相当額)	(154,377,708)
分配準備積立金	178,187,665

- (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。

ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

《第6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]

「ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド」は、
1月26日に第6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6期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主として対象インデックスに採用されている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、信託財産の1口当たりの純資産額の変動率を対象インデックスの変動率に一致させることを目的とした運用を行います。 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。
主要運用対象	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。）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		MSCI ジャパンESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み)		株式 組入比率	株式 先物比率	投資信託 組入比率	純資産 総額
	円	騰落 中率 %	騰落 中率 %	騰落 中率 %				
2期(2020年1月27日)	10,850	16.8	2,637.05	17.1	93.3	5.3	1.4	324
3期(2021年1月26日)	12,225	12.7	2,971.63	12.7	96.2	2.7	1.2	695
4期(2022年1月26日)	12,949	5.9	3,143.10	5.8	97.4	1.0	1.6	1,834
5期(2023年1月26日)	13,502	4.3	3,278.64	4.3	97.2	1.4	1.4	2,804
6期(2024年1月26日)	17,587	30.3	4,272.09	30.3	97.5	1.8	0.8	4,269

(注) MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数とは、MSCI Inc. が開発した株価指数で、MSCI ESG リサーチが提供する企業格付けと調査を利用し、業種内において相対的にESG（環境、社会、ガバナンス）評価が優れた企業で構成されています。MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は、親指数（MSCI ジャパンIMI 指数）構成銘柄の中から、親指数における各業種分類の時価総額50%を目標に、ESG評価に優れた企業を選別して構築される指数です。この選別手法により、ESG評価の高い企業を選ぶことで発生しがちな業種の偏りが抑制されています。MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数に対する著作権およびその他の知的財産権はすべてMSCI Inc. に帰属します。

(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		MSCI ジャパンESG セレクト・リーダーズ指数 (配当込み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率	投 資 信 託 証 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2023年1月26日	円	%		%	%	%	%
	13,502	—	3,278.64	—	97.2	1.4	1.4
1月末	13,434	△ 0.5	3,262.13	△ 0.5	97.2	1.4	1.4
2月末	13,538	0.3	3,287.05	0.3	97.9	0.7	1.4
3月末	13,738	1.7	3,335.25	1.7	96.5	2.1	1.3
4月末	14,185	5.1	3,444.38	5.1	96.6	2.1	1.3
5月末	14,757	9.3	3,583.93	9.3	96.0	2.7	1.3
6月末	15,877	17.6	3,855.66	17.6	97.4	1.3	1.2
7月末	16,099	19.2	3,909.60	19.2	97.4	1.4	1.2
8月末	16,149	19.6	3,922.56	19.6	97.4	1.3	1.3
9月末	16,202	20.0	3,934.10	20.0	96.8	2.0	1.2
10月末	15,669	16.0	3,804.11	16.0	97.5	1.9	1.3
11月末	16,676	23.5	4,050.69	23.5	97.3	1.8	0.8
12月末	16,585	22.8	4,028.68	22.9	98.0	1.2	0.8
(期 末) 2024年1月26日	17,587	30.3	4,272.09	30.3	97.5	1.8	0.8

(注) 騰落率は期首比。

(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30.3%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(30.3%)と同程度となりました。

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・不動産投資信託証券（REIT）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MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）の個別銘柄構成比率に合わせて構築しました。
 - ・なお、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数は各業界ごとに相対的にESG評価に優れると判断した企業を選別して構成される指数で、ファンドはその構成比率を高位に維持しました。
- 加えて、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）の対象期間の騰落率は30.3%、親指数（MSCI ジャパンIMI指数（配当込み））の同期間の騰落率は28.9%となっております。

ESGスコアは下表の通りとなっております。

ESGスコア (2023年12月29日時点)	
親指数 (MSCI ジャパンIMI指数)	6.990
MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数	8.217

※ESGスコアとは、MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数を構成する個別銘柄ごとのスコア（評点）を、指数構成銘柄の組入比率によって加重平均し0～10点（0が最低評価）で示したものです。ESGリスク（ESGへの取り組み姿勢）を相対的に比較することができます。

個別銘柄ごとのスコアは、業種ごとに直面するESGリスク特性などを勘案して相対的に評価・算出したものです。

※MSCI ジャパンIMI指数とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、わが国の金融商品取引所に上場する大型・中型・小型銘柄で構成されています。

委託会社のスチュワードシップ活動

委託会社はお客さまから委託された資産の運用を行う立場として、投資先企業が株主利益を考慮して企業価値の向上や持続的な成長を果たすことに資するため、気候変動や人権・ダイバーシティ、ガバナンス体制などの投資先企業におけるESG課題を重視し、企業との「目的を持った対話」や明確な方針のもとでの議決権行使などのスチュワードシップ活動を実施しました。

2023年1月から2023年12月に開催された投資先国内企業の株主総会における議決権行使状況についてご案内します。

会社提案の23,068議案に関しては4,667議案に反対、株主提案435議案に関しては38議案に賛成しました。この結果、会社提案に対する反対行使比率は20.23%となりました。

委託会社のスチュワードシップ活動は当社ホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/responsible/stewardshipcode.html>)にて開示を行っています。

- 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30.3%の上昇になったため、カイ離は△0.0%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)

- ・取引要因によるものです。

(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	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)	0	0.001	
(先物・オプション)	(0)	(0.000)	
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、15,411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		517	1,462,335	354	829,913
		(56)	()		

(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。

投資信託証券

銘柄		買付		売付	
		口数	金額	口数	金額
国内	森ヒルズリート投資法人	0.006	862	0.003	450
	日本プロロジスリート投資法人	0.005	1,445	0.025	7,010
	ヒューリックリート投資法人	0.002	314	0.014	2,171
	積水ハウス・リート投資法人	0.013	1,047	0.004	309
	日本ビルファンド投資法人	0.007	4,051	0.004	2,258
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.003	1,673	—	—
	日本プライムリアルティ投資法人	0.002	703	0.01	3,686
	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.009	1,359	0.004	605
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.002	617	—	—
	ジャパンエクセレント投資法人	0.003	380	0.014	1,967
合 計	0.052	12,454	0.078	18,458	

(注) 金額は受渡代金。

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
国内	株式先物取引	百万円 469	百万円 449	百万円 —	百万円 —

○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	2,292,248千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,218,274千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.71

(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	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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	1,462	341	23.3	829	181	21.8
投資信託証券	12	4	33.3	18	0.666709	3.7
株式先物取引	469	469	100.0	449	449	100.0

利害関係人の発行する有価証券等

種 類	買 付 額	売 付 額	当 期 末 保 有 額
	百万円	百万円	百万円
株式	9	116	—

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
	百万円
株式	9
投資信託証券	0.292207

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)	23千円
うち利害関係人への支払額 (B)	22千円
(B) / (A)	94.9%

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モルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、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	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
鉱業 (0.5%)				
INPEX	9.9	11.4	22,623	
建設業 (1.8%)				
大林組	6.2	7.6	10,195	
清水建設	5.3	6.1	6,025	
住友林業	1.3	—	—	
大和ハウス工業	5.7	7	31,458	
積水ハウス	5.9	7	23,716	
高砂熱学工業	0.4	0.5	1,635	
大気社	0.2	0.3	1,281	
千代田化工建設	1.5	—	—	
食料品 (3.3%)				
明治ホールディングス	1.1	2.8	9,909	
サッポロホールディングス	0.6	0.7	4,801	
アサヒグループホールディングス	4.4	5.6	30,436	
麒麟ホールディングス	7.8	9.1	18,991	
サントリー食品インターナショナル	1.3	1.6	7,654	
伊藤園	0.5	0.6	2,575	
不二製油グループ本社	0.4	—	—	
キッコーマン	1.4	1.6	14,625	
味の素	4.4	5.2	30,810	
キュービー	0.9	—	—	
ハウス食品グループ本社	0.6	—	—	
カゴメ	0.7	0.9	2,828	
ニチレイ	1	1.3	4,595	
日清食品ホールディングス	0.6	2.3	11,079	
繊維製品 (0.4%)				
東洋紡	0.8	0.9	981	
帝人	1.7	2.1	2,840	
東レ	13.2	16.2	11,701	
化学 (6.1%)				
クラレ	3	3.3	5,012	
旭化成	12	14.7	16,192	
住友化学	14.2	16.5	5,633	

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
東ソー	2.5	3	5,610	
デンカ	0.7	0.9	2,299	
カネカ	0.5	0.6	2,147	
三井化学	1.8	2	8,620	
JSR	1.7	2.1	8,505	
東京応化工業	0.3	1.1	3,723	
三菱ケミカルグループ	12.2	15	13,305	
ダイセル	2.5	2.7	3,848	
積水化学工業	3.5	4.5	9,697	
UBE	0.9	1.1	2,655	
日本化薬	—	1.5	1,971	
花王	4.5	5.5	32,175	
日本ペイントホールディングス	7.9	11.1	12,842	
関西ペイント	1.7	2.1	5,177	
DIC	0.7	0.9	2,527	
富士フイルムホールディングス	3.4	4.4	40,563	
資生堂	—	4.7	19,030	
ライオン	2.2	2.7	3,514	
小林製薬	0.5	—	—	
デクセリアルズ	0.5	—	—	
日東電工	1.4	1.7	19,133	
信越ポリマー	0.4	0.5	825	
ニフコ	0.8	0.9	3,423	
ユニ・チャーム	3.8	4.7	23,824	
医薬品 (4.6%)				
協和キリン	2.6	3.2	7,483	
アステラス製薬	17.5	21.2	35,785	
塩野義製薬	2.5	3.1	22,019	
中外製薬	6.4	—	—	
エーザイ	2.4	3	20,865	
小野薬品工業	3.5	4.5	11,956	
参天製薬	3.4	—	—	
第一三共	16.7	21.7	92,941	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
石油・石炭製品 (0.5%)			
ENEOSホールディングス	29.3	33.8	19,992
ゴム製品 (1.0%)			
ブリヂストン	5.4	6.7	42,069
住友理工	0.3	0.4	455
ガラス・土石製品 (0.5%)			
太平洋セメント	1.1	1.4	4,118
東海カーボン	—	2.4	2,466
TOTO	1.4	1.6	6,412
日本特殊陶業	1.5	1.8	6,953
鉄鋼 (1.4%)			
日本製鉄	7.7	10	34,680
神戸製鋼所	3.2	4.2	8,211
JFEホールディングス	4.7	6.7	15,316
非鉄金属 (0.6%)			
日本軽金属ホールディングス	0.5	0.7	1,271
三井金属鉱業	0.5	0.6	2,764
三菱マテリアル	1.1	1.5	4,006
住友金属鉱山	2.4	2.9	11,892
DOWAホールディングス	0.5	0.6	3,141
UACJ	0.3	0.4	1,642
金属製品 (0.2%)			
LIXIL	2.7	3.4	6,701
機械 (5.7%)			
三浦工業	0.8	1	2,739
アマダ	—	4	6,268
ナブテスコ	1	1.3	3,734
小松製作所	8.8	10.8	42,163
日立建機	1	1.3	5,326
クボタ	9.7	11.8	26,078
荏原製作所	0.9	1.1	10,116
ダイキン工業	2.4	3.1	74,136
栗田工業	1	1.2	6,565
ダイフク	1	3.6	10,450
グローリー	0.5	0.5	1,513
セガサミーホールディングス	1.5	1.8	3,849
NTN	—	4.7	1,250
日立造船	1.5	1.9	1,749
三菱重工業	3.1	3.8	35,739

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
IHI	—	1.6	4,480
電気機器 (22.8%)			
イビデン	1.1	1.3	9,704
コニカミノルタ	4.3	5.3	2,188
ブラザー工業	—	2.7	6,679
日立製作所	9.2	10.9	121,753
富士電機	1.2	1.5	10,918
安川電機	2.3	2.8	16,195
明電舎	0.3	—	—
オムロン	1.8	2.1	14,202
日本電気	—	2.9	26,859
富士通	1.9	2.1	43,312
ルネサスエレクトロニクス	—	17.2	42,673
セイコーエプソン	2.7	3.4	7,451
アルパック	—	0.5	3,623
パナソニック ホールディングス	21.1	25.9	36,130
シャープ	—	3	3,102
アンリツ	1.3	1.6	2,158
ソニーグループ	12	14.8	207,274
TDK	3.7	4.6	33,354
アルプスアルパイン	1.9	2.2	2,800
日本航空電子工業	0.4	—	—
横河電機	2.2	2.7	7,931
アズビル	1.1	1.3	6,243
アドバンテスト	1.8	9	51,444
シスメックス	1.6	2	15,824
スタンレー電気	1.2	1.5	4,249
ファナック	1.8	11.2	48,160
ローム	0.8	—	—
京セラ	3.1	—	—
太陽誘電	1.1	1.4	5,115
村田製作所	5.5	20.2	60,276
リコー	5.5	6.4	7,456
東京エレクトロン	1.4	5.5	153,835
輸送用機器 (9.1%)			
川崎重工業	1.4	1.8	5,905
トヨタ自動車	101.2	124.2	359,248
マツダ	5.4	—	—
ヤマハ発動機	2.8	10.5	14,579

ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
精密機器 (2.2%)			
テルモ	6.2	—	—
島津製作所	2.3	2.8	11,466
ニコン	2.9	3.5	5,218
HOYA	—	4.1	74,579
ノーリツ銅機	—	0.2	663
その他製品 (3.0%)			
前田工繊	0.2	0.2	634
大建工業	0.1	—	—
大日本印刷	2.1	2.4	10,075
N I S S H A	0.4	0.4	641
アシックス	1.5	1.9	8,576
ヤマハ	1.3	1.5	4,896
リンテック	0.4	0.4	1,107
任天堂	10.5	12.2	96,319
コクヨ	0.8	0.9	2,139
美津濃	0.2	0.2	868
電気・ガス業 (1.1%)			
東北電力	4.3	5.3	5,121
九州電力	3.8	4.7	4,977
電源開発	1.4	1.7	4,128
レノバ	0.3	0.5	596
東京瓦斯	3.7	4.3	14,168
大阪瓦斯	3.6	4.4	13,147
東邦瓦斯	0.7	0.9	2,659
西部ガスホールディングス	—	0.3	575
陸運業 (2.4%)			
東武鉄道	—	2.2	8,544
相鉄ホールディングス	0.7	0.9	2,441
東急	5.1	5.9	10,150
京王電鉄	1	1.2	5,228
西日本旅客鉄道	2.1	2.6	15,683
西武ホールディングス	2.2	2.8	5,740
西日本鉄道	0.6	0.7	1,691
阪急阪神ホールディングス	2.2	2.7	12,077
南海電気鉄道	1	1.2	3,388
京阪ホールディングス	0.9	1.2	4,321
名古屋鉄道	—	2.2	4,963
ヤマトホールディングス	—	3.1	8,032

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
山九	0.5	0.6	3,116
センコーグループホールディングス	1	1.3	1,483
九州旅客鉄道	1.3	1.6	5,073
SGホールディングス	2.7	3.8	7,626
N I P P O N E X P R E S S ホールディン	0.7	—	—
海運業 (0.7%)			
日本郵船	4.6	5.7	28,329
空運業 (0.1%)			
ANAホールディングス	—	1.9	6,007
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
トランコム	0.1	0.1	715
情報・通信業 (5.2%)			
T I S	2.2	2.6	8,619
S H I F T	0.1	0.1	2,660
ティーガイア	—	0.2	394
オープンドア	0.1	—	—
マネーフォワード	0.4	0.5	2,713
ビジョナル	0.2	—	—
野村総合研究所	3.8	4.5	19,516
メルカリ	1	1.3	3,186
フリー	—	0.5	1,458
L I N E ヤフー	25.5	31.3	14,645
伊藤忠テクノソリューションズ	0.9	—	—
サイボウズ	0.2	—	—
ネットワンシステムズ	—	1	2,374
B I P R O G Y	0.7	0.9	3,897
ビジョン	0.4	—	—
K D D I	15.4	17.5	85,032
ソフトバンク	27.4	33.7	65,158
NTTデータグループ	6	—	—
カブコン	1.7	—	—
S C S K	1.5	1.8	5,134
卸売業 (3.5%)			
あらた	0.1	—	—
双日	—	2.6	8,886
T O K A I ホールディングス	0.9	1.1	1,073
アズワン	0.3	0.3	1,667
伊藤忠商事	11.3	13.9	90,836
丸紅	14.7	16.8	41,319

ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックスマザーファンド

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
三井物産	13.7	—	—	—
キヤノンマーケティングジャパン	0.4	0.5	2,181	—
サンゲツ	0.4	—	—	—
伊藤忠エネクス	—	0.6	947	—
モスフードサービス	0.2	—	—	—
イエローハット	0.3	—	—	—
小売業 (4.1%)				
ローソン	0.4	0.5	4,142	—
ゲオホールディングス	0.2	0.3	689	—
アダストリア	—	0.3	985	—
ハローズ	0.1	—	—	—
ジーンズホールディングス	—	0.2	839	—
DCMホールディングス	1	—	—	—
J. フロント リテイリング	—	2.9	3,880	—
マツキヨココカラ&カンパニー	1	4	10,652	—
ZOZO	1.2	1.6	5,212	—
三越伊勢丹ホールディングス	—	4	6,700	—
オイシックス・ラ・大地	0.3	0.3	414	—
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	0.5	0.6	607	—
イオン北海道	0.2	0.5	473	—
バン・バンフィック・インターナショナルホ	—	4.5	14,269	—
スギホールディングス	0.3	0.4	2,771	—
日本瓦斯	1	1.2	2,808	—
マックスバリュ東海	0.1	0.1	322	—
丸井グループ	1.7	2.1	5,143	—
イオン	6.2	7.7	26,665	—
平和堂	0.3	—	—	—
ヤオコー	0.2	0.2	1,680	—
ケーズホールディングス	—	1.6	2,110	—
Genky DrugStores	0.1	—	—	—
ヤマダホールディングス	6.9	6.8	3,047	—
ファーストリテイリング	0.6	2	77,740	—
サンドラッグ	0.7	—	—	—
銀行業 (5.5%)				
しずおかフィナンシャルグループ	4.3	—	—	—
三菱UFJフィナンシャル・グループ	114	—	—	—
りそなホールディングス	20.6	24.9	19,870	—
三井住友トラスト・ホールディングス	3.2	7.7	22,611	—
三井住友フィナンシャルグループ	12.5	14.9	110,856	—

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
みずほフィナンシャルグループ	—	28.3	73,863	—
証券、商品先物取引業 (1.0%)				
大和証券グループ本社	12.7	15.6	16,177	—
野村ホールディングス	27.8	35.2	26,160	—
マネックスグループ	1.7	—	—	—
保険業 (3.6%)				
SOMPOホールディングス	3	3.5	26,218	—
MS&ADインシュアランスグループホール	4.2	5	29,765	—
第一生命ホールディングス	9.3	—	—	—
東京海上ホールディングス	17.5	21.1	78,766	—
T&Dホールディングス	—	5.9	13,903	—
その他金融業 (1.0%)				
東京センチュリー	0.4	1.7	2,735	—
オリックス	11.4	13.7	38,634	—
不動産業 (2.5%)				
ヒューリック	3.7	4.5	6,950	—
野村不動産ホールディングス	1.1	1.3	5,112	—
東急不動産ホールディングス	—	7.2	7,065	—
三井不動産	8.6	10.4	37,876	—
三菱地所	11.3	13.2	26,749	—
平和不動産	0.3	—	—	—
東京建物	1.8	2.2	4,867	—
住友不動産	3	3.3	15,008	—
サービス業 (5.6%)				
パーソルホールディングス	—	21.9	5,150	—
総合警備保障	0.7	—	—	—
ディップ	0.3	—	—	—
エスプール	0.6	—	—	—
H. U. グループホールディングス	0.5	0.6	1,622	—
オリエンタルランド	1.9	12.8	69,734	—
ダスキン	0.4	0.5	1,700	—
リゾートトラスト	—	0.9	2,255	—
ビー・エム・エル	—	0.2	568	—
ユー・エス・エス	—	2.4	6,759	—
サイバーエージェント	4.1	—	—	—
楽天グループ	—	17.5	11,982	—
テクノプロ・ホールディングス	1	1.3	4,556	—
リクルートホールディングス	13.7	16.9	99,642	—
エラン	0.3	0.4	408	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
インソース	0.4	0.6	501
カーブスホールディングス	0.5	0.6	418
LITALICO	0.2	0.3	560
乃村工藝社	0.7	0.9	780
セコム	—	2.5	26,562

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	千株	千株	千円	
ベネッセホールディングス	0.7	0.8	2,083	
合 計	株 数 ・ 金 額	1,039	1,259	4,161,490
	銘柄数<比率>	238	233	<97.5%>

(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。

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	%
森ヒルズリート投資法人	0.015	0.018	2,527	0.1
日本プロジスリート投資法人	0.02	—	—	—
ヒューリックリート投資法人	0.012	—	—	—
積水ハウス・リート投資法人	0.04	0.049	3,846	0.1
日本ビルファンド投資法人	0.015	0.018	10,692	0.3
ジャパンリアルエステイト投資法人	0.012	0.015	8,490	0.2
日本プライムリアルティ投資法人	0.008	—	—	—
ユナイテッド・アーバン投資法人	0.028	0.033	4,986	0.1
日本ロジスティクスファンド投資法人	0.008	0.01	2,831	0.1
ジャパンエクセレント投資法人	0.011	—	—	—
合 計	口 数 ・ 金 額	0.169	0.143	33,373
	銘柄数<比率>	10	6	<0.8%>

(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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
国内	百万円	百万円
株式先物取引	74	—
TOPIX		

○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 4,161,490	% 96.9
投資証券	33,373	0.8
コール・ローン等、その他	99,549	2.3
投資信託財産総額	4,294,412	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	4,291,561,774
コール・ローン等	89,581,302
株式(評価額)	4,161,490,460
投資証券(評価額)	33,373,000
未収入金	1,578,350
未収配当金	4,444,876
差入委託証拠金	1,093,786
(B) 負債	21,605,032
未払金	15,525,010
未払解約金	6,080,000
未払利息	22
(C) 純資産総額(A-B)	4,269,956,742
元本	2,427,881,731
次期繰越損益金	1,842,075,011
(D) 受益権総口数	2,427,881,731口
1万口当たり基準価額(C/D)	17,587円

<注記事項>

- ①期首元本額 2,076,953,121円
 期中追加設定元本額 753,157,446円
 期中一部解約元本額 402,228,836円
 また、1口当たり純資産額は、期末17,587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)

国内株式セレクション(ラップ向け)	910,611,521円
eMAXIS ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス	798,453,777円
三菱UFJ DCジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス	692,483,714円
アドバンスト・バランスⅣ(FOFs用)(適格機関投資家限定)	22,016,089円
アドバンスト・バランスⅢ(FOFs用)(適格機関投資家限定)	4,316,630円
合計	2,427,881,731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)

○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	78,036,140
受取配当金	78,050,849
受取利息	358
その他収益金	4,483
支払利息	△ 19,550
(B) 有価証券売買損益	802,796,105
売買益	856,670,546
売買損	△ 53,874,441
(C) 先物取引等取引損益	15,815,450
取引益	17,616,500
取引損	△ 1,801,050
(D) 当期損益金(A+B+C)	896,647,695
(E) 前期繰越損益金	727,332,710
(F) 追加信託差損益金	427,731,408
(G) 解約差損益金	△ 209,636,802
(H) 計(D+E+F+G)	1,842,075,011
次期繰越損益金(H)	1,842,075,011

- (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。