

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（2018年10月22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MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）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。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	ベビーファンド	<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を主要投資対象とします。なお、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。）に直接投資することがあります。</p>
	マザーファンド	<p>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。</p>
主な組入制限	ベビーファンド	<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>	


※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
 ※公募株式投資信託は税法上、「NISA（少額投資非課税制度）およびジュニアNISA（未成年者少額投資非課税制度）」の適用対象です。
 詳しくは販売会社にお問い合わせください。

運用報告書（全体版）




イーマックス

eMAXIS ジャパンESG セレクト・リーダーズインデックス



第5期（決算日：2023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 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5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国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12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。

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。

○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 配	み 金 騰 落	中 率	(配当込み) 中 率				
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	百万円
2018年10月22日	10,000	—	—	2,431.61	—	—	—	—	200
1期(2019年1月28日)	9,281	0	△ 7.2	2,252.79	△ 7.4	90.8	8.2	0.8	190
2期(2020年1月27日)	10,790	0	16.3	2,637.05	17.1	93.3	5.3	1.4	324
3期(2021年1月26日)	12,104	0	12.2	2,971.63	12.7	96.2	2.7	1.2	694
4期(2022年1月26日)	12,764	0	5.5	3,143.10	5.8	97.4	1.0	1.6	1,096
5期(2023年1月26日)	13,251	0	3.8	3,278.64	4.3	97.2	1.4	1.4	1,231

(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) 2022年1月26日	円	%		%	%	%	%
	12,764	—	3,143.10	—	97.4	1.0	1.6
1月末	12,787	0.2	3,149.39	0.2	97.3	1.0	1.7
2月末	12,566	△1.6	3,095.56	△1.5	97.4	1.0	1.6
3月末	13,159	3.1	3,244.52	3.2	96.5	1.8	1.7
4月末	12,862	0.8	3,172.34	0.9	97.1	1.8	1.7
5月末	12,951	1.5	3,194.80	1.6	96.8	1.6	1.7
6月末	12,605	△1.2	3,110.63	△1.0	97.3	1.6	1.7
7月末	13,097	2.6	3,233.54	2.9	96.7	1.5	1.7
8月末	13,125	2.8	3,241.11	3.1	97.5	0.8	1.6
9月末	12,325	△3.4	3,043.96	△3.2	96.9	1.5	1.6
10月末	12,933	1.3	3,195.53	1.7	97.5	1.5	1.6
11月末	13,321	4.4	3,293.17	4.8	97.0	1.5	1.5
12月末	12,692	△0.6	3,139.00	△0.1	97.0	1.4	1.5
(期 末) 2023年1月26日	13,251	3.8	3,278.64	4.3	97.2	1.4	1.4

(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。

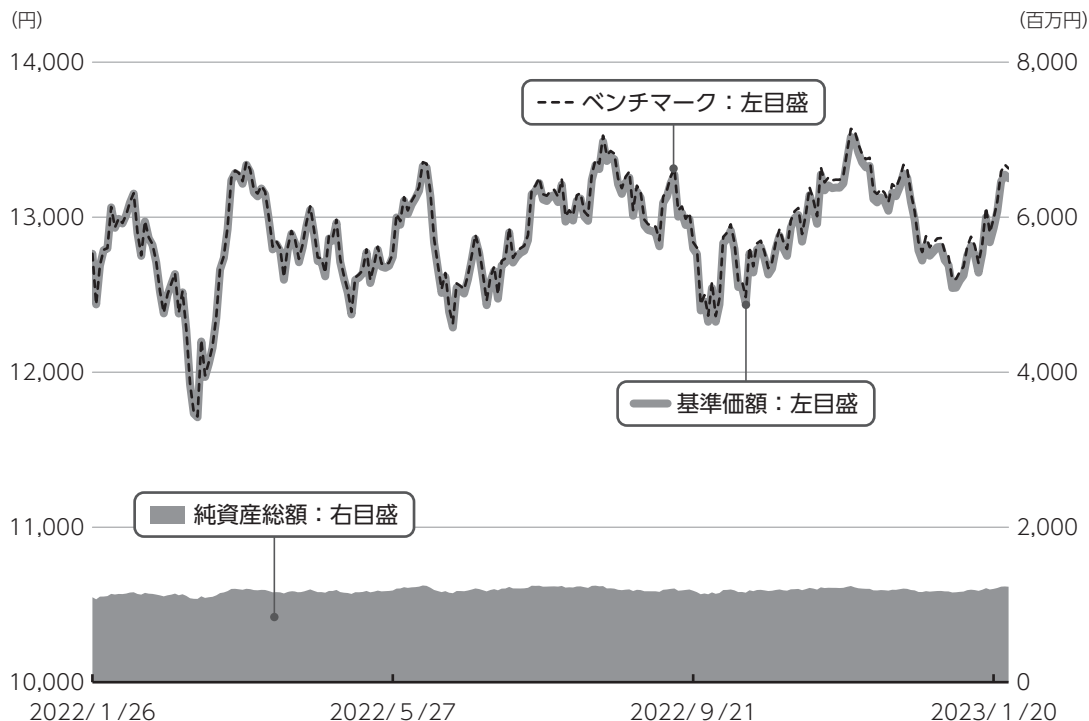
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第5期：2022年1月27日～2023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5期首	12,764円
第5期末	13,251円
既払分配金	0円
騰落率	3.8%

※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3.8%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（4.3%）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5期：2022年1月27日～2023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。

円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善や、新型コロナウイルス対策の入国規制緩和によるインバウンド需要期待等を背景に、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

▶ eMAXIS 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4.3%、親指数（MSCI ジャパンIMI指数（配当込み））の同期間の騰落率は6.8%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

2022年12月30日時点

親指数 (MSCI ジャパンIMI 指数)	6.663
MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数	7.884

※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。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ eMAXIS 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△0.5%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△0.5%程度でした。

マザーファンド保有による要因

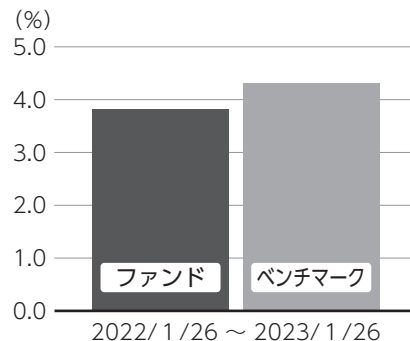
マザーファンド保有による影響は△0.0%程度でした。

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：銘柄選択要因によるものです。

主なマイナス要因：取引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5期 2022年1月27日～2023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	3,250

(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 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。

2022年1月27日～2023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	57	0.440	(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)	(25)	(0.192)	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)	(25)	(0.193)	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)	(7)	(0.055)	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	0.002	(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)	(0.001)	
(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	57	0.445	

期中の平均基準価額は、12,870円です。

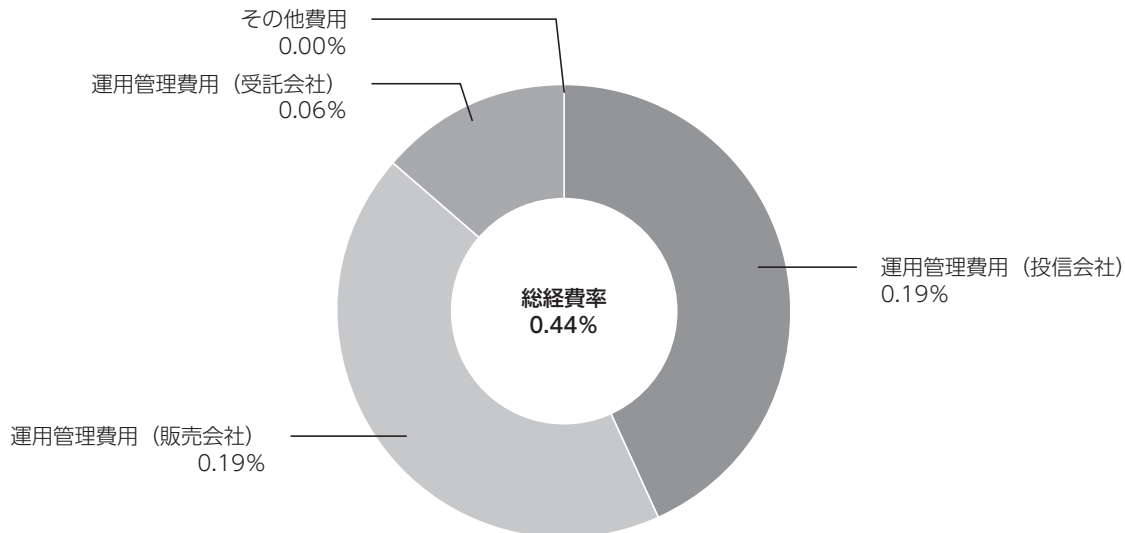
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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0.44%**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

(2022年1月27日～2023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 230,538	千円 298,062	千口 164,625	千円 218,325

○株式売買比率

(2022年1月27日～2023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	2,697,537千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,302,515千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.17	

(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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

利害関係人との取引状況

<eMAXIS 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	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	$\frac{D}{C}$
株式	1,789	408	22.8%	908	68	7.5%
投資信託証券	37	8	21.6%	26	0.758735	2.9%
株式先物取引	323	323	100.0%	304	304	100.0%

平均保有割合 49.2%

※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 90	百万円 8	百万円 108

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 0.20307

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)	20千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9千円
(B) / (A)	44.4%

(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

(2023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 846,439	千口 912,353	千円 1,231,859

○投資信託財産の構成

(2023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 1,231,859	% 99.4
コール・ローン等、その他	7,050	0.6
投資信託財産総額	1,238,909	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	1,238,909,782
コール・ローン等	4,225,536
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(附価額)	1,231,859,107
未収入金	2,825,139
(B) 負債	6,928,642
未払解約金	4,262,810
未払信託報酬	2,648,677
未払利息	1
その他未払費用	17,154
(C) 純資産総額(A-B)	1,231,981,140
元本	929,760,098
次期繰越損益金	302,221,042
(D) 受益権総口数	929,760,098口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,251円

<注記事項>

①期首元本額	858,777,708円
期中追加設定元本額	394,776,606円
期中一部解約元本額	323,794,216円
また、1口当たり純資産額は、期末1.3251円です。	

○損益の状況 (2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 881
受取利息	10
支払利息	△ 891
(B) 有価証券売買損益	49,204,273
売買益	61,088,140
売買損	△ 11,883,867
(C) 信託報酬等	△ 5,233,008
(D) 当期損益金(A+B+C)	43,970,384
(E) 前期繰越損益金	22,439,296
(F) 追加信託差損益金	235,811,362
(配当等相当額)	(161,630,412)
(売買損益相当額)	(74,180,950)
(G) 計(D+E+F)	302,221,042
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	302,221,042
追加信託差損益金	235,811,362
(配当等相当額)	(163,177,503)
(売買損益相当額)	(72,633,859)
分配準備積立金	66,409,680

- (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	2022年1月27日～ 2023年1月26日
費用控除後の配当等収益額	26,658,119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	5,373,684円
収益調整金額	235,811,362円
分配準備積立金額	34,377,877円
当ファンドの分配対象収益額	302,221,042円
1万口当たり収益分配対象額	3,250円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、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。

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5期》決算日2023年1月26日

[計算期間：2022年1月27日～2023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5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5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。

○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 (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
	期騰落	率	期騰落	率				
(設定日) 2018年10月22日	円	—	2,431.61	—	—	—	—	百万円 199
1期(2019年1月28日)	9,292	△ 7.1	2,252.79	△ 7.4	90.8	8.2	0.8	190
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

(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) 「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 組 入 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2022年 1月26日	円	%		%	%	%	%
	12,949	—	3,143.10	—	97.4	1.0	1.6
1 月末	12,973	0.2	3,149.39	0.2	97.3	1.0	1.7
2 月末	12,753	△1.5	3,095.56	△1.5	97.4	1.0	1.6
3 月末	13,360	3.2	3,244.52	3.2	96.5	1.8	1.7
4 月末	13,063	0.9	3,172.34	0.9	97.1	1.8	1.7
5 月末	13,158	1.6	3,194.80	1.6	96.8	1.6	1.7
6 月末	12,811	△1.1	3,110.63	△1.0	97.3	1.6	1.7
7 月末	13,316	2.8	3,233.54	2.9	96.7	1.5	1.7
8 月末	13,350	3.1	3,241.11	3.1	97.5	0.8	1.6
9 月末	12,541	△3.2	3,043.96	△3.2	96.9	1.5	1.6
10 月末	13,165	1.7	3,195.53	1.7	97.5	1.5	1.6
11 月末	13,564	4.7	3,293.17	4.8	97.0	1.5	1.5
12 月末	12,929	△0.2	3,139.00	△0.1	97.0	1.4	1.5
(期 末) 2023年 1月26日	13,502	4.3	3,278.64	4.3	97.2	1.4	1.4

(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4.3%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(4.3%)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。

円安・米ドル高進行に伴う輸出企業の採算改善や、新型コロナウイルス対策の入国規制緩和によるインバウンド需要期待等を背景に、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4.3%、親指数（MSCI ジャパンIMI指数（配当込み））の同期間の騰落率は6.8%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 (2022年12月30日時点)	
親指数（MSCI ジャパンIMI指数）	6.663
MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数	7.884

※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。

- 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4.3%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)

- ・銘柄選択要因によるものです。

(主なマイナス要因)

- ・取引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

(2022年1月27日～2023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	0.002	
(先物・オプション)	(0)	(0.001)	
合 計	(0)	(0.001)	
期中の平均基準価額は、13,085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

(2022年1月27日～2023年1月26日)

株式

国	上場	買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国		千株	千円	千株	千円
内		705	1,789,233	272	908,303
		(12)	()		

(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	0.016	2,473	0.001	161
	産業ファンド投資法人	0.005	898	0.017	3,177
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	0.001	325	0.005	1,702
	日本プロロジスリート投資法人	0.01	3,381	0.003	971
	ヒューリックリート投資法人	0.006	964	0.002	331
	積水ハウス・リート投資法人	0.044	3,595	0.004	317
	野村不動産マスターファンド投資法人	0.011	1,756	0.038	6,413
	日本ビルファンド投資法人	0.006	3,944	0.001	639
	ジャパンリアルエステイト投資法人	0.012	7,688	—	—
	日本都市ファンド投資法人	0.018	1,811	0.063	6,897
	オリックス不動産投資法人	0.006	1,046	0.023	4,346
	日本プライムリアルティ投資法人	0.004	1,584	0.001	399
	ユナイテッド・アーバン投資法人	0.031	4,539	0.003	455
	日本ロジスティクスファンド投資法人	0.008	2,564	—	—
ジャパンエクセレント投資法人	0.006	766	0.003	392	
合 計	0.184	37,341	0.164	26,205	

(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 323	百万円 304	百万円 —	百万円 —

○株式売買比率

(2022年1月27日～2023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	2,697,537千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	2,302,515千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.17

(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

(2022年1月27日～2023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	1,789	408	22.8	908	68	7.5
投資信託証券	37	8	21.6	26	0.758735	2.9
株式先物取引	323	323	100.0	304	304	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	90	8	108

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	0.20307

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)	44千円
うち利害関係人への支払額 (B)	18千円
(B) / (A)	41.0%

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

(2023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
水産・農林業 (-%)				
マルハニチロ	0.3	—	—	—
鉱業 (0.5%)				
I N P E X	6.6	9.9	14,612	
建設業 (1.8%)				
コムシスホールディングス	0.7	—	—	—
大成建設	1.2	—	—	—
大林組	4.2	6.2	6,169	
清水建設	3.6	5.3	3,805	
鹿島建設	2.9	—	—	—
戸田建設	1.5	—	—	—
住友林業	0.9	1.3	3,126	
大和ハウス工業	3.7	5.7	17,761	
積水ハウス	4	5.9	14,791	
エクシオグループ	0.6	—	—	—
高砂熱学工業	0.3	0.4	730	
大気社	—	0.2	697	
千代田化工建設	—	1.5	570	
食料品 (3.5%)				
明治ホールディングス	—	1.1	7,304	
サッポロホールディングス	0.4	0.6	1,872	
アサヒグループホールディングス	2.9	4.4	18,854	
麒麟ホールディングス	5.3	7.8	15,576	
サントリー食品インターナショナル	0.9	1.3	5,648	
伊藤園	—	0.5	2,227	
不二製油グループ本社	0.3	0.4	813	
キッコーマン	0.9	1.4	9,590	
味の素	3	4.4	18,805	
キュービー	0.7	0.9	2,014	
ハウス食品グループ本社	0.4	0.6	1,639	
カゴメ	—	0.7	2,149	
ニチレイ	0.7	1	2,691	
日清食品ホールディングス	0.4	0.6	6,060	

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
繊維製品 (0.5%)				
東洋紡	0.5	0.8	814	
帝人	1.2	1.7	2,216	
東レ	9	13.2	10,400	
パルプ・紙 (-%)				
日本製紙	0.6	—	—	—
レンゴー	1.1	—	—	—
化学 (6.1%)				
クラレ	1.9	3	3,189	
旭化成	8.1	12	11,520	
住友化学	9.6	14.2	7,014	
東ソー	—	2.5	4,135	
デンカ	—	0.7	1,864	
信越化学工業	2.3	—	—	—
カネカ	0.3	0.5	1,687	
三井化学	1.2	1.8	5,490	
J S R	—	1.7	5,006	
東京応化工業	0.2	0.3	1,935	
三菱ケミカルグループ	8.3	12.2	8,963	
ダイセル	1.7	2.5	2,372	
積水化学工業	2.4	3.5	6,755	
UBE	0.7	0.9	1,803	
日本化薬	0.9	—	—	—
花王	3.1	4.5	23,472	
日本ペイントホールディングス	—	7.9	9,369	
関西ペイント	1.1	1.7	3,009	
D I C	0.5	0.7	1,669	
東洋インキSCホールディングス	0.2	—	—	—
富士フィルムホールディングス	2.3	3.4	23,528	
資生堂	2.6	—	—	—
ライオン	—	2.2	3,108	
小林製薬	—	0.5	4,560	
デクセリアルズ	—	0.5	1,384	
日東電工	0.9	1.4	11,424	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
信越ポリマー	—	0.4	506
ニフコ	0.5	0.8	2,668
ユニ・チャーム	2.6	3.8	18,783
医薬品 (6.9%)			
協和キリン	1.7	2.6	7,649
アステラス製薬	12	17.5	34,562
住友ファーマ	1.2	—	—
塩野義製薬	1.7	2.5	15,785
中外製薬	4.3	6.4	22,310
エーザイ	1.5	2.4	19,874
小野薬品工業	2.4	3.5	10,256
持田製薬	0.2	—	—
参天製薬	2.3	3.4	3,427
第一三共	11.3	16.7	73,095
石油・石炭製品 (0.5%)			
ENEOSホールディングス	19.8	29.3	13,917
ゴム製品 (1.0%)			
ブリヂストン	—	5.4	26,276
住友理工	—	0.3	195
ガラス・土石製品 (0.5%)			
太平洋セメント	—	1.1	2,403
TOTO	0.9	1.4	7,056
日本碍子	1.7	—	—
日本特殊陶業	1	1.5	3,846
ニチアス	0.4	—	—
鉄鋼 (1.1%)			
日本製鉄	—	7.7	20,955
神戸製鋼所	—	3.2	2,224
JFEホールディングス	—	4.7	8,107
日立金属	1.4	—	—
非鉄金属 (0.8%)			
日本軽金属ホールディングス	0.4	0.5	802
三井金属鉱業	—	0.5	1,710
三菱マテリアル	0.7	1.1	2,470
住友金属鉱山	1.6	2.4	12,756
DOWAホールディングス	0.3	0.5	2,230
UACJ	—	0.3	743
金属製品 (0.2%)			
LIXIL	—	2.7	5,853

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
機械 (5.5%)			
三浦工業	0.6	0.8	2,580
タクマ	0.4	—	—
ナブテスコ	0.7	1	3,655
サトーホールディングス	0.2	—	—
小松製作所	5.7	8.8	27,526
日立建機	0.7	1	3,090
クボタ	6.6	9.7	18,691
住原製作所	0.6	0.9	4,914
ダイキン工業	1.6	2.4	54,084
栗田工業	0.6	1	5,900
ダイフク	0.7	1	7,170
グローリー	0.3	0.5	1,124
セガサミーホールディングス	1.1	1.5	3,058
ホシザキ	0.4	—	—
NTN	2.6	—	—
日立造船	1	1.5	1,260
三菱重工業	2.1	3.1	15,862
電気機器 (20.4%)			
日清紡ホールディングス	0.9	—	—
イビデン	0.7	1.1	5,599
コニカミノルタ	2.9	4.3	2,377
日立製作所	6.2	9.2	63,654
三菱電機	11.8	—	—
富士電機	—	1.2	6,372
安川電機	1.5	2.3	11,201
明電舎	—	0.3	574
東芝テック	0.2	—	—
オムロン	1.2	1.8	12,945
ジーエス・ユアサ コーポレーション	0.4	—	—
日本電気	1.6	—	—
富士通	1.3	1.9	35,539
セイコーエプソン	—	2.7	5,351
アルパック	0.3	—	—
パナソニック ホールディングス	14.3	21.1	25,267
アンリツ	0.9	1.3	1,661
ソニーグループ	8.1	12	138,180
TDK	2.5	3.7	17,168
アルプスアルパイン	—	1.9	2,447

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
ヒロセ電機	0.2	—	—
日本航空電子工業	0.3	0.4	894
横河電機	1.5	2.2	4,958
アズビル	0.8	1.1	3,987
日本光電工業	0.5	—	—
アドバンテスト	—	1.8	17,316
キーエンス	1.2	—	—
シスメックス	1.1	1.6	13,812
スタンレー電気	0.8	1.2	3,242
ウシオ電機	0.6	—	—
ファナック	—	1.8	40,086
ローム	—	0.8	8,208
京セラ	—	3.1	20,807
太陽誘電	—	1.1	4,856
村田製作所	3.7	5.5	41,079
リコー	—	5.5	5,566
東京エレクトロン	1	1.4	63,756
輸送用機器 (7.7%)			
デンソー	2.8	—	—
川崎重工業	0.9	1.4	4,137
トヨタ自動車	68.5	101.2	191,571
日野自動車	1.9	—	—
マツダ	—	5.4	5,437
ヤマハ発動機	1.9	2.8	8,862
精密機器 (1.3%)			
テルモ	4.2	6.2	23,715
島津製作所	1.5	2.3	9,131
ニコン	2	2.9	3,697
シチズン時計	1.7	—	—
その他製品 (3.0%)			
前田工繊	—	0.2	659
大建工業	—	0.1	219
大日本印刷	1.4	2.1	6,573
N I S S H A	—	0.4	754
アシックス	1	1.5	4,456
ヤマハ	0.9	1.3	6,500
リンテック	0.3	0.4	878
任天堂	0.7	10.5	59,167
コクヨ	0.5	0.8	1,463

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
美津濃	—	0.2	560
電気・ガス業 (1.0%)			
中部電力	4.2	—	—
中国電力	1.9	—	—
東北電力	—	4.3	2,838
九州電力	2.6	3.8	2,717
電源開発	—	1.4	2,893
レノバ	0.2	0.3	676
東京瓦斯	2.4	3.7	9,349
大阪瓦斯	2.4	3.6	7,329
東邦瓦斯	0.5	0.7	1,656
陸運業 (2.3%)			
東武鉄道	1.2	—	—
相鉄ホールディングス	0.5	0.7	1,547
東急	3.2	5.1	8,445
小田急電鉄	1.9	—	—
京王電鉄	0.7	1	4,665
東日本旅客鉄道	2	—	—
西日本旅客鉄道	1.4	2.1	11,673
西武ホールディングス	1.5	2.2	3,256
西日本鉄道	0.4	0.6	1,432
近鉄グループホールディングス	1.1	—	—
阪急阪神ホールディングス	1.5	2.2	8,558
南海電気鉄道	0.7	1	2,844
京阪ホールディングス	—	0.9	3,240
名古屋鉄道	1.2	—	—
山九	0.4	0.5	2,402
センコーグループホールディングス	0.7	1	975
福山通運	0.2	—	—
日立物流	0.2	—	—
九州旅客鉄道	0.9	1.3	3,816
SGホールディングス	2.1	2.7	5,043
N I P P O N E X P R E S Sホールディン	0.5	0.7	5,166
海運業 (0.5%)			
日本郵船	1	4.6	14,559
倉庫・運輸関連業 (0.0%)			
トランコム	—	0.1	767
情報・通信業 (6.3%)			
T I S	—	2.2	8,217

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	千円	
SHIFT	—	0.1	2,515	
オープンドア	—	0.1	181	
マネーフォワード	—	0.4	1,954	
ビジョナル	—	0.2	1,944	
野村総合研究所	2.2	3.8	12,464	
メルカリ	0.7	1	2,709	
Zホールディングス	17.3	25.5	9,626	
伊藤忠テクノソリューションズ	—	0.9	2,826	
サイボウズ	—	0.2	524	
ネットワンシステムズ	0.6	—	—	
BIPROGY	0.5	0.7	2,394	
ビジョン	—	0.4	582	
日本電信電話	8.3	—	—	
KDDI	10.4	15.4	63,263	
ソフトバンク	18.5	27.4	40,812	
エヌ・ティ・ティ・データ	—	6	12,084	
カブコン	—	1.7	7,140	
SCSK	1	1.5	3,162	
卸売業 (4.8%)				
あらた	—	0.1	414	
アルフレッサ ホールディングス	1.2	—	—	
TOKAIホールディングス	0.6	0.9	769	
シップヘルスケアホールディングス	0.5	—	—	
アズワン	0.2	0.3	1,740	
日本ライフライン	0.4	—	—	
伊藤忠商事	7.7	11.3	47,008	
丸紅	—	14.7	23,483	
三井物産	—	13.7	53,553	
キヤノンマーケティングジャパン	0.3	0.4	1,210	
サンゲツ	0.3	0.4	900	
モスフードサービス	—	0.2	611	
イエローハット	—	0.3	516	
スズケン	0.4	—	—	
小売業 (3.5%)				
ローソン	0.3	0.4	2,040	
ゲオホールディングス	—	0.2	374	
ハローズ	—	0.1	308	
DCMホールディングス	0.8	1	1,179	
マツキヨココカラ&カンパニー	—	1	6,520	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円	
ZOZO	—	1.2	3,978	
オイシックス・ラ・大地	—	0.3	639	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	—	0.5	556	
イオン北海道	—	0.2	190	
スギホールディングス	—	0.3	1,695	
日本瓦斯	—	1	2,038	
マックスバリュ東海	—	0.1	284	
丸井グループ	1.2	1.7	3,707	
イオン	4.2	6.2	16,219	
平和堂	—	0.3	628	
ヤオコー	—	0.2	1,338	
ケーズホールディングス	1.1	—	—	
Genky DrugStores	—	0.1	364	
ヤマダホールディングス	4.4	6.9	3,229	
ファーストリテイリング	0.4	0.6	46,398	
サンドラッグ	—	0.7	2,520	
銀行業 (7.9%)				
しずおかフィナンシャルグループ	—	4.3	4,609	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	—	114	108,528	
りそなホールディングス	13.3	20.6	15,095	
三井住友トラスト・ホールディングス	2.2	3.2	15,222	
三井住友フィナンシャルグループ	8.4	12.5	70,575	
千葉銀行	3.4	—	—	
静岡銀行	2.9	—	—	
山口フィナンシャルグループ	1.3	—	—	
証券、商品先物取引業 (0.8%)				
大和証券グループ本社	—	12.7	7,683	
野村ホールディングス	19.8	27.8	14,344	
マネックスグループ	—	1.7	829	
保険業 (4.1%)				
SOMPOホールディングス	2	3	17,226	
MS&ADインシュアランスグループホール	2.9	4.2	17,871	
第一生命ホールディングス	6.5	9.3	28,467	
東京海上ホールディングス	4.1	17.5	48,457	
T&Dホールディングス	3.5	—	—	
その他金融業 (1.0%)				
芙蓉総合リース	0.1	—	—	
東京センチュリー	0.2	0.4	1,792	
オリックス	7.9	11.4	25,826	

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
不動産業 (2.2%)				
ヒューリック	2.4	3.7	3,888	
野村不動産ホールディングス	0.8	1.1	3,198	
東急不動産ホールディングス	3.9	—	—	
三井不動産	5.9	8.6	21,027	
三菱地所	7.6	11.3	19,040	
平和不動産	—	0.3	1,110	
東京建物	—	1.8	2,917	
住友不動産	—	3	9,582	
サービス業 (4.3%)				
総合警備保障	0.5	0.7	2,460	
ディップ	—	0.3	1,165	
エスプール	—	0.6	480	
H. U. グループホールディングス	0.3	0.5	1,398	
オリエンタルランド	1.3	1.9	40,365	

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
ダスキン	0.2	0.4	1,200	
サイバーエージェント	—	4.1	5,067	
テクノプロ・ホールディングス	0.7	1	4,040	
リクルートホールディングス	8.8	13.7	58,512	
エラン	—	0.3	298	
インソース	—	0.4	597	
カーブスホールディングス	—	0.5	405	
LITALICO	—	0.2	492	
乃村工藝社	0.5	0.7	643	
セコム	1.4	—	—	
メイテック	0.2	—	—	
ベネッセホールディングス	0.4	0.7	1,389	
合 計	株 数 ・ 金 額	594	1,039	2,726,755
	銘柄数<比率>	212	238	<97.2%>

(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	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	2,274	0.1
産業ファンド投資法人		0.012	—	—	—
コンフォリア・レジデンシャル投資法人		0.004	—	—	—
日本プロロジスリート投資法人		0.013	0.02	5,832	0.2
ヒューリックリート投資法人		0.008	0.012	1,848	0.1
積水ハウス・リート投資法人		—	0.04	2,840	0.1
野村不動産マスターファンド投資法人		0.027	—	—	—
日本ビルファンド投資法人		0.01	0.015	8,535	0.3
ジャパンリアルエステイト投資法人		—	0.012	6,720	0.2
日本都市ファンド投資法人		0.045	—	—	—
オリックス不動産投資法人		0.017	—	—	—
日本プライムリアルティ投資法人		0.005	0.008	2,852	0.1
ユナイテッド・アーバン投資法人		—	0.028	4,186	0.1
日本ロジスティクスファンド投資法人		—	0.008	2,432	0.1
ジャパンエクセレント投資法人		0.008	0.011	1,373	0.0
合 計	口 数 ・ 金 額	0.149	0.169	38,892	
	銘柄数<比率>	10	10	<1.4%>	

(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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘柄別		当	期	末	
		買	建	額	売
国内	株式先物取引	TOPIX		百万円 39	百万円 -

○投資信託財産の構成

(2023年1月26日現在)

項目	当	期	末	
	評	価	額	比
株式	千円		%	
	2,726,755		96.9	
投資証券	38,892		1.4	
コール・ローン等、その他	48,013		1.7	
投資信託財産総額	2,813,660		100.0	

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年1月26日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,813,040,400
コール・ローン等	35,353,385
株式(評価額)	2,726,755,750
投資証券(評価額)	38,892,900
未収入金	7,361,572
未収配当金	3,706,793
差入委託証拠金	970,000
(B) 負債	8,754,569
未払解約金	8,754,554
未払利息	15
(C) 純資産総額(A-B)	2,804,285,831
元本	2,076,953,121
次期繰越損益金	727,332,710
(D) 受益権総口数	2,076,953,121口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,502円

<注記事項>

- ①期首元本額 1,416,807,270円
 期中追加設定元本額 874,212,060円
 期中一部解約元本額 214,066,209円
 また、1口当たり純資産額は、期末13,502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 ジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス	912,353,064円
国内株式セレクション(ラップ向け)	760,882,506円
三菱UFJ DCSジャパンESGセレクト・リーダーズインデックス	373,976,569円
アドバンスト・バランスⅣ(FOFs用)(適格機関投資家限定)	25,424,352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	2,076,953,121円

○損益の状況 (2022年1月27日～2023年1月26日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	59,712,816
受取配当金	59,721,172
受取利息	118
その他収益金	275
支払利息	△ 8,749
(B) 有価証券売買損益	57,364,955
売買益	215,575,436
売買損	△158,210,481
(C) 先物取引等取引損益	1,828,850
取引益	6,332,000
取引損	△ 4,503,150
(D) 当期損益金(A+B+C)	118,906,621
(E) 前期繰越損益金	417,861,104
(F) 追加信託差損益金	259,968,967
(G) 解約差損益金	△ 69,403,982
(H) 計(D+E+F+G)	727,332,710
次期繰越損益金(H)	727,332,710

(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。