

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）



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6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 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6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。

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.jp/>

※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。

○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 | | 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) | 税込 分配 | み 金 騰 落 率 | (配当込み) | 期 騰 落 率 | | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | % | 百万円 |
| 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 |
| 6期(2024年1月26日) | 17,183 | 0 | 29.7 | 4,272.09 | 30.3 | 97.5 | 1.8 | 0.8 | 1,404 |

(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。

○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 | % | | % | % | % | % |
| | 13,251 | — | 3,278.64 | — | 97.2 | 1.4 | 1.4 |
| 1月末 | 13,183 | △ 0.5 | 3,262.13 | △ 0.5 | 97.2 | 1.4 | 1.4 |
| 2月末 | 13,281 | 0.2 | 3,287.05 | 0.3 | 97.9 | 0.7 | 1.4 |
| 3月末 | 13,472 | 1.7 | 3,335.25 | 1.7 | 96.5 | 2.1 | 1.3 |
| 4月末 | 13,905 | 4.9 | 3,444.38 | 5.1 | 96.6 | 2.1 | 1.3 |
| 5月末 | 14,460 | 9.1 | 3,583.93 | 9.3 | 96.0 | 2.7 | 1.3 |
| 6月末 | 15,552 | 17.4 | 3,855.66 | 17.6 | 97.4 | 1.3 | 1.2 |
| 7月末 | 15,763 | 19.0 | 3,909.60 | 19.2 | 97.4 | 1.4 | 1.2 |
| 8月末 | 15,806 | 19.3 | 3,922.56 | 19.6 | 97.4 | 1.3 | 1.3 |
| 9月末 | 15,853 | 19.6 | 3,934.10 | 20.0 | 96.8 | 2.0 | 1.2 |
| 10月末 | 15,325 | 15.7 | 3,804.11 | 16.0 | 97.5 | 1.9 | 1.3 |
| 11月末 | 16,304 | 23.0 | 4,050.69 | 23.5 | 97.3 | 1.8 | 0.8 |
| 12月末 | 16,209 | 22.3 | 4,028.68 | 22.9 | 98.0 | 1.2 | 0.8 |
| (期 末) 2024年1月26日 | 円 | % | | % | % | % | % |
| | 17,183 | 29.7 | 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6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6期首 | 13,251円 |
| 第6期末 | 17,183円 |
| 既払分配金 | 0円 |
| 騰落率 | 29.7% |

※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29.7%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0.6%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6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

▶ 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

▶ 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 $\Delta 0.6\%$ 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 $\Delta 0.6\%$ 程度でした。

マザーファンド保有による要因

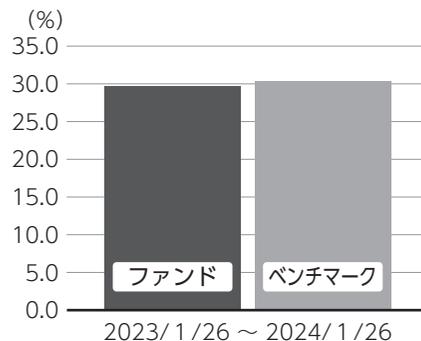
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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6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 | 7,182 |

(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。

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 | 66 | 0.439 | (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) | (29) | (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) | (29) | (0.192) | 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) | (8) | (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 | 0.001 | (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 | 66 | 0.443 | |

期中の平均基準価額は、15,089円です。

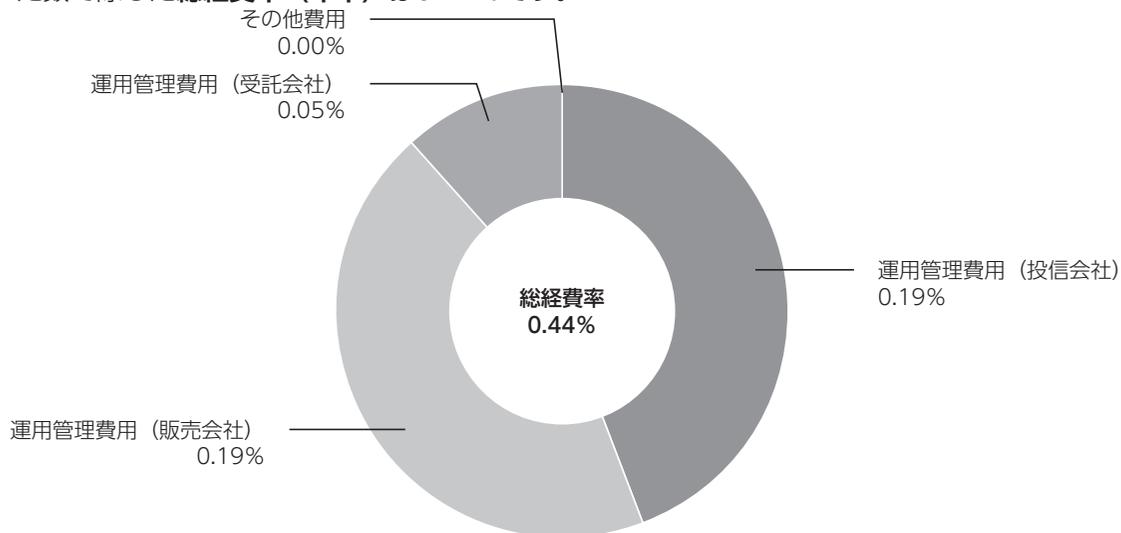
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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

(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 126,234 | 千円 198,276 | 千口 240,133 | 千円 355,209 |

○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

<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 | 1,462 | 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 |

平均保有割合 37.1%

※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) | 8千円 |
| うち利害関係人への支払額 (B) | 8千円 |
| (B) / (A) | 94.8% |

(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 912,353 | 千口 798,453 | 千円 1,404,240 |

○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 1,404,240 | % 99.7 |
| コール・ローン等、その他 | 4,388 | 0.3 |
| 投資信託財産総額 | 1,408,628 | 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 | 1,408,628,776 |
| コール・ローン等 | 4,388,119 |
| 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(併録) | 1,404,240,657 |
| (B) 負債 | 4,247,417 |
| 未払解約金 | 1,362,502 |
| 未払信託報酬 | 2,866,339 |
| 未払利息 | 1 |
| その他未払費用 | 18,575 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 1,404,381,359 |
| 元本 | 817,312,540 |
| 次期繰越損益金 | 587,068,819 |
| (D) 受益権総口数 | 817,312,540口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 17,183円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 929,760,098円
 期中追加設定元本額 298,402,918円
 期中一部解約元本額 410,850,476円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.7183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 | △ 949 |
| 受取利息 | 22 |
| 支払利息 | △ 971 |
| (B) 有価証券売買損益 | 272,226,316 |
| 売買益 | 326,498,515 |
| 売買損 | △ 54,272,199 |
| (C) 信託報酬等 | △ 5,494,417 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 266,730,950 |
| (E) 前期繰越損益金 | 40,531,153 |
| (F) 追加信託差損益金 | 279,806,716 |
| (配当等相当額) | (161,288,853) |
| (売買損益相当額) | (118,517,863) |
| (G) 計(D+E+F) | 587,068,819 |
| (H) 収益分配金 | 0 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 587,068,819 |
| 追加信託差損益金 | 279,806,716 |
| (配当等相当額) | (162,067,966) |
| (売買損益相当額) | (117,738,750) |
| 分配準備積立金 | 307,262,103 |

- (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 | 28,581,116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 | 238,149,834円 |
| 収益調整金額 | 279,806,716円 |
| 分配準備積立金額 | 40,531,153円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 587,068,819円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 7,182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)

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 |

| 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。