

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／株式／インデックス型	
信託期間	無期限（2024年2月22日設定）	
運用方針	<p>①インド株式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、次の各号に掲げる運用方法のいずれかまたは複数を組み合わせた運用を行います。運用方法の選択および組合せは、効率性等を勘案のうえ決定します。</p> <ol style="list-style-type: none"> インドの株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資を行う方法 インドの株価指数への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行う方法 米国の国債に投資を行うとともに、インドの株価指数先物取引、外国為替先物取引および外国為替予約取引による運用を行う方法 <p>②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。</p> <p>③対象インデックスとの連動を維持するため、株式エクスポージャーの調整を目的として株価指数先物取引等を利用し、株式等の実質投資比率が100%を超える場合があります。</p> <p>④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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外貨エクスポージャーの調整を目的として外国為替先物取引および外国為替予約取引を利用し、実質的な外貨エクスポージャーが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	インド株式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、インドの株式等、上場投資信託証券、株価指数先物取引に係る権利および米国の国債に直接投資すること、ならびに外国為替先物取引および外国為替予約取引を直接行うことがあります。
	マザーファンド	インドの株式等、上場投資信託証券、株価指数先物取引に係る権利および米国の国債を主要投資対象とします。また、外国為替先物取引および外国為替予約取引を行います。
主な組入制限	ベビーファンド	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	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。
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。</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 インド株式インデックス

第1期（決算日：2024年3月5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 インド株式インデックス」は、去る3月5日に第1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.am.mufg.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 (分配落)			Nifty50指数 (配当込み、円換算ベース)		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	税込み 分配金	期中騰落率	騰落率	騰落率	騰落率					
(設定日)	円	円	%		%	%	%	%	%	百万円
2024年2月22日	10,000	—	—	10,476.20	—	—	—	—	—	1
1期(2024年3月5日)	10,091	0	0.9	10,574.34	0.9	—	116.9	40.7	—	5,895

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) Nifty50指数は、インドの金融商品取引所（ナショナル）に上場している、浮動株調整後の時価総額、流動性等の基準を用いて選定した50社の株式で構成される株価指数です。指数の計算方法は、浮動株調整後時価総額加重平均方式です。定期的な採用銘柄の入替は半年ごとに行なわれます。Nifty50指数は、1995年11月3日を基準日とし、基準日の指数値を1000として、インド・ルピー建てで計算されています。Nifty50指数（配当込み、円換算ベース）は、Nifty50指数（配当込み、インドルピーベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社が提供する当ファンドは、NSE INDICES LIMITEDが発起、保証、販売または販売促進を行っているものではありません。NSE INDICES LIMITEDは、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証（商品性または特定の目的または使用に対する適合性の保証を含む）も行わず、有価証券全般またはNifty50指数に関連する当ファンドへの投資の妥当性に関して、当ファンドの所有者または一般の人々に対するすべての責任、特にNifty50指数のインド株式市場全体のパフォーマンスへの連動性にかかる能力に関するいかなる責任も負わないものとします。Nifty50指数に関する免責事項の全文は、交付目論見書でご確認ください。

(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、「株式組入比率」、「株式先物比率」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」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		Nifty50指数 (配当込み、円換算ベース)		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率
	騰落率	騰落率	騰落率	騰落率				
(設定日)	円	%		%	%	%	%	%
2024年2月22日	10,000	—	10,476.20	—	—	—	—	—
2月末	9,909	△0.9	10,416.78	△0.6	—	110.7	41.0	—
(期末)								
2024年3月5日	10,091	0.9	10,574.34	0.9	—	116.9	40.7	—

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(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」、「債券組入比率」、「債券先物比率」は実質比率を記載しております。

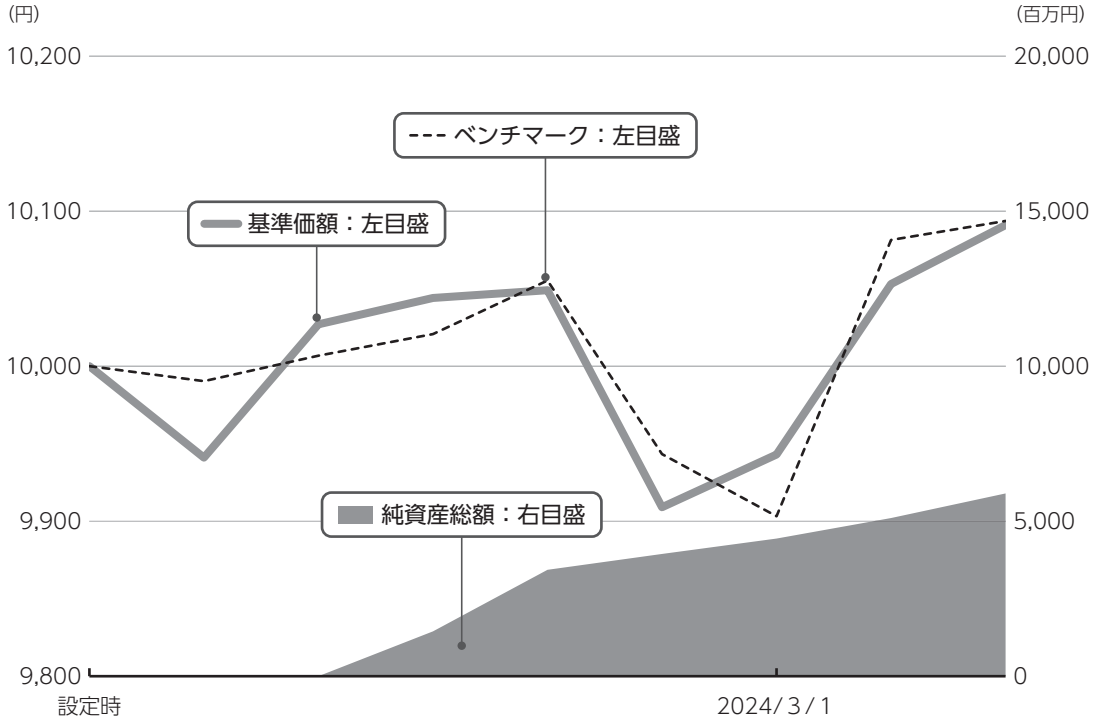
(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第1期：2024年2月22日～2024年3月5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1期首	10,000円
第1期末	10,091円
既払分配金	0円
騰落率	0.9%

※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

基準価額は設定時に比べ0.9%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（0.9%）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1期：2024年2月22日～2024年3月5日

投資環境について

▶ インド株式市況

インド株式市況は小幅に上昇しました。
インド株式市況は堅調な経済指標の発表
などを受けて、小幅に上昇しました。

▶ 為替市況

インドルピーは円に対して横ばいとなり
ました。
為替市況は、期間の初めに比べて横ばい
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 インド株式インデックス

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。

▶ インド株式インデックスマザーファンド

米国の国債に投資を行うとともに、イン
ドの株価指数先物取引、外国為替先物取
引および外国為替予約取引を行い、N i
f t y 50指数（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
を行いました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ eMAXIS インド株式インデックス

ベンチマークとの乖離は $\Delta 0.0\%$ 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 $\Delta 0.0\%$ 程度で
した。

マザーファンド保有による要因

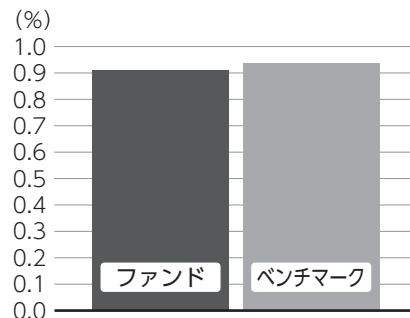
マザーファンド保有による影響は $\Delta 0.0\%$ 程度でした。

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：組入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）



設定時～2024/3/5

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1期 2024年2月22日～2024年3月5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	90

(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 インド株式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。

▶ インド株式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。

2024年2月22日～2024年3月5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	2	0.015	(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)	(1)	(0.008)	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)	(1)	(0.006)	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)	(0)	(0.001)	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	3	0.034	(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
(先物・オプション)	(3)	(0.034)	
(c) その他費用	0	0.000	(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)	(0.000)	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)	(0)	(0.000)	信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	5	0.049	

期中の平均基準価額は、10,007円です。

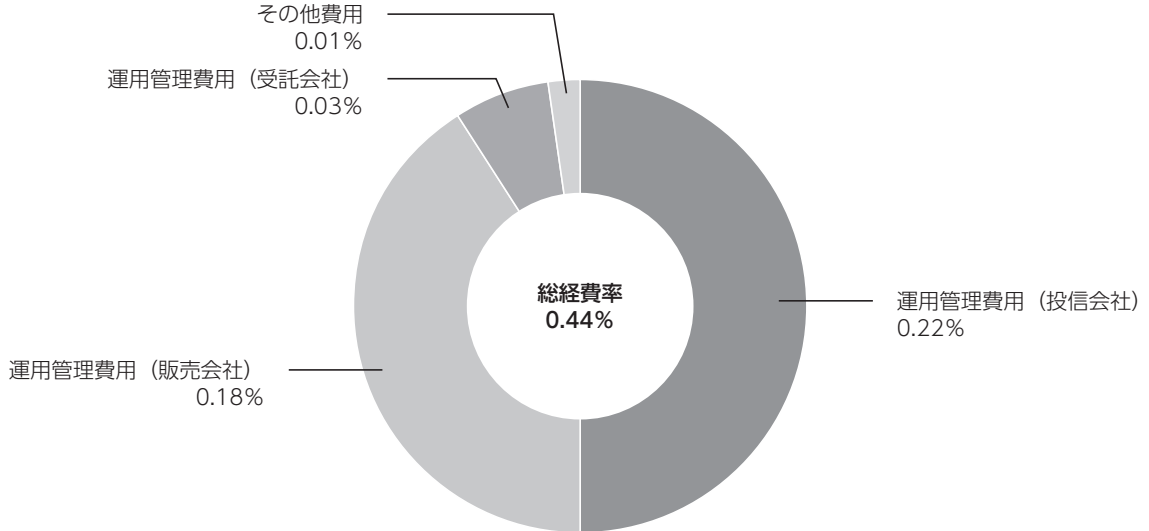
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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

(2024年2月22日～2024年3月5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
インド株式インデックスマザーファンド	5,613,040 千口	5,852,547 千円	— 千口	— 千円

○利害関係人との取引状況等

(2024年2月22日～2024年3月5日)

該当事項はございません。

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す。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2024年2月22日～2024年3月5日)

設定時残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○組入資産の明細

(2024年3月5日現在)

親投資信託残高

銘柄	当期末	
	口数	評価額
インド株式インデックスマザーファンド	5,613,040 千口	5,894,253 千円

○投資信託財産の構成

(2024年3月5日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
インド株式インデックスマザーファンド	5,894,253 千円	99.8 %
コール・ローン等、その他	14,261	0.2
投資信託財産総額	5,908,514	100.0

(注) インド株式インデックスマザーファンドにおいて、期末における外貨建純資産(5,596,677千円)の投資信託財産総額(7,032,483千円)に対する比率は79.6%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=150.42円		
------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年3月5日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	5,908,514,040
コール・ローン等	14,260,363
インド株式インデックスマザーファンド(評価額)	5,894,253,677
(B) 負債	13,156,865
未払解約金	12,826,343
未払信託報酬	327,575
未払利息	2
その他未払費用	2,945
(C) 純資産総額(A-B)	5,895,357,175
元本	5,842,460,809
次期繰越損益金	52,896,366
(D) 受益権総口数	5,842,460,809口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,091円

<注記事項>

- ①設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 5,854,343,208円
 期中一部解約元本額 12,882,399円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0091円です。

②分配金の計算過程

項 目	2024年2月22日～ 2024年3月5日
費用控除後の配当等収益額	2,381,073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	39,086,895円
収益調整金額	11,428,398円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	52,896,366円
1万口当たり収益分配対象額	90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。

○損益の状況 (2024年2月22日～2024年3月5日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 3
支払利息	△ 3
(B) 有価証券売買損益	41,798,491
売買益	41,808,296
売買損	△ 9,805
(C) 信託報酬等	△ 330,520
(D) 当期損益金(A+B+C)	41,467,968
(E) 追加信託差損益金 (売買損益相当額)	(11,428,398)
(F) 計(D+E)	52,896,366
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	52,896,366
追加信託差損益金 (配当等相当額)	(1,605,837)
(売買損益相当額)	(9,822,561)
分配準備積立金	41,467,968

- (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) (E)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。

インド株式インデックスマザーファンド

《第1期》決算日2024年3月5日

[計算期間：2024年1月17日～2024年3月5日]

「インド株式インデックスマザーファンド」は、3月5日に第1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1期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	<p>①次の各号に掲げる運用方法のいずれかまたは複数を組み合わせた運用を行います。運用方法の選択および組合せは、効率性等を勘案のうえ決定します。</p> <ol style="list-style-type: none"> インドの株式等（DR（預託証券）を含みます。以下同じ。）に投資を行う方法 インドの株価指数への連動をめざす上場投資信託証券に投資を行う方法 米国の国債に投資を行うとともに、インドの株価指数先物取引、外国為替先物取引および外国為替予約取引による運用を行う方法 <p>②対象インデックスとの連動を維持するため、株式エクスポージャーの調整を目的として株価指数先物取引等を利用し、株式等の実質投資比率が100%を超える場合があります。</p> <p>③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。なお、対象インデックスとの連動を維持するため、外貨エクスポージャーの調整を目的として外国為替先物取引および外国為替予約取引を利用し、実質的な外貨エクスポージャーが100%を超える場合があります。</p>
主要運用対象	インドの株式等、上場投資信託証券、株価指数先物取引に係る権利および米国の国債を主要投資対象とします。また、外国為替先物取引および外国為替予約取引を行います。
主な組入制限	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		Nifty50指数		株式組入比率	株式先物比率	債券組入比率	債券先物比率	純資産総額
	期騰落	中率	(配当込み、円換算ベース)	期騰落					
(設定日)	円	%		%	%	%	%	%	百万円
2024年1月17日	10,000	—	10,000.00	—	—	—	—	—	499
1期(2024年3月5日)	10,501	5.0	10,574.34	5.7	—	116.9	40.7	—	6,419

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) Nifty50指数は、インドの金融商品取引所（ナショナル）に上場している、浮動株調整後の時価総額、流動性等の基準を用いて選定した50社の株式で構成される株価指数です。指数の計算方法は、浮動株調整後時価総額加重平均方式です。定期的な採用銘柄の入替は半年ごとに行なわれます。Nifty50指数は、1995年11月3日を基準日とし、基準日の指数値を1000として、インド・ルピー建てで計算されています。Nifty50指数（配当込み、円換算ベース）は、Nifty50指数（配当込み、インドルピーベース）をもとに、委託会社が計算したものです。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社が提供する当ファンドは、NSE INDICES LIMITEDが発起、保証、販売または販売促進を行っているものではありません。NSE INDICES LIMITEDは、明示的か黙示的かを問わず、何らの表明もしくは保証（商品性または特定の目的または使用に対する適合性の保証を含む）も行わず、有価証券全般またはNifty50指数に関連する当ファンドへの投資の妥当性に関して、当ファンドの所有者または一般の人々に対するすべての責任、特にNifty50指数のインド株式市場全体のパフォーマンスへの連動性にかかる能力に関するいかなる責任も負わないものとします。Nifty50指数に関する免責事項の全文は、交付目

論見書でご確認ください。

(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) 「株式先物比率」、「債券先物比率」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		N i f t y 5 0 指 数 (配当込み、 円換算ベース)		株 式 組 入 比 率	株 式 先 物 比 率	債 券 組 入 比 率	債 券 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率				
(設定日) 2024年1月17日	円 10,000	% —	10,000.00	% —	% —	% —	% —	% —
1月末	9,906	△0.9	9,980.22	△0.2	—	99.2	41.4	—
2月末	10,311	3.1	10,416.78	4.2	—	110.7	41.0	—
(期 末) 2024年3月5日	10,501	5.0	10,574.34	5.7	—	116.9	40.7	—

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(注) 「株式先物比率」、「債券先物比率」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

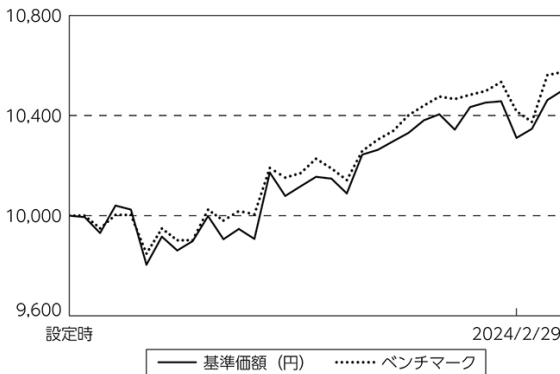
◎基準価額の動き

基準価額は設定時に比べ5.0%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ベンチマークは5.7%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.7\%$ 程度となりました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは設定時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

◎インド株式市況

インド株式市況は上昇しました。

- ・ 堅調な経済指標や企業決算等が支援材料となり、インド株式市況は設定時と比べ上昇しました。

◎為替市況

インドルピーは円に対して上昇しました。

- ・ 為替市況は、設定時に比べて円安・インドルピー高となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 米国の国債に投資を行うとともに、インドの株価指数先物取引、外国為替先物取引および外国為替予約取引を行い、Nifty 50指数（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5.7%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.7\%$ 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)

- ・ ありません。

(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

(2024年1月17日～2024年3月5日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (先物・オプション)	円 12 (12)	% 0.115 (0.115)	(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) そ の 他 費 用 (そ の 他)	0 (0)	0.001 (0.001)	(b)その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用
合 計	12	0.116	
期中の平均基準価額は、10,158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

(2024年1月17日～2024年3月5日)

公社債

			買 付 額	売 付 額
外国	アメリカ	国債証券	千アメリカドル 17,338	千アメリカドル -

(注) 金額は受渡代金。(経過利子分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	株式先物取引	百万円 8,458	百万円 1,013	百万円 -	百万円 -
	その他先物取引	7,433	1,034	-	-

(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

(2024年1月17日～2024年3月5日)

該当事項はございません。

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す。

○組入資産の明細

(2024年3月5日現在)

外国公社債

(A) 外国(外貨建)公社債 種類別開示

区 分	当 期 末							
	額面金額	評 価 額		組入比率	うちBB格以下 組入比率	残存期間別組入比率		
		外貨建金額	邦貨換算金額			5年以上	2年以上	2年未満
	千アメリカドル	千アメリカドル	千円	%	%	%	%	%
アメリカ	17,940	17,352	2,610,112	40.7	—	—	—	40.7
合 計	17,940	17,352	2,610,112	40.7	—	—	—	40.7

(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) 組入比率は、純資産総額に対する評価額の割合。

(注) 評価については金融商品取引業者、価格情報会社等よりデータを入手しています。

(B) 外国(外貨建)公社債 銘柄別開示

銘 柄	当 期 末					
	利 率	額面金額	評 価 額		償還年月日	
			外貨建金額	邦貨換算金額		
アメリカ	%	千アメリカドル	千アメリカドル	千円		
国債証券	—	17,940	17,352	2,610,112	2024/10/31	
合 計				2,610,112		

(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。

先物取引の銘柄別期末残高

銘 柄 別	当 期 末	
	買 建 額	売 建 額
外 国	百万円	百万円
株式先物取引	7,503	—
その他先物取引	6,403	—

(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3月5日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
公社債	千円 2,610,112	% 37.1
コール・ローン等、その他	4,422,371	62.9
投資信託財産総額	7,032,483	100.0

(注) 期末における外貨建純資産 (5,596,677千円) の投資信託財産総額 (7,032,483千円) に対する比率は79.6%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=150.42円		
------------------	--	--

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2024年3月5日現在)

○損益の状況 (2024年1月17日～2024年3月5日)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	8,882,184,803
コール・ローン等	1,457,656,624
公社債(評価額)	2,610,112,796
未収入金	1,902,177,890
差入委託証拠金	2,912,237,493
(B) 負債	2,462,885,598
未払金	2,462,854,823
未払解約金	30,654
未払利息	121
(C) 純資産総額(A-B)	6,419,299,205
元本	6,112,808,028
次期繰越損益金	306,491,177
(D) 受益権総口数	6,112,808,028口
1万口当たり基準価額(C/D)	10,501円

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	2,991,225
受取利息	2,991,847
支払利息	△ 622
(B) 有価証券売買損益	6,417,338
売買益	7,129,269
売買損	△ 711,931
(C) 先物取引等取引損益	57,585,740
取引益	63,090,811
取引損	△ 5,505,071
(D) 保管費用等	△ 7,700
(E) 当期損益金(A+B+C+D)	66,986,603
(F) 追加信託差損益金	239,507,493
(G) 解約差損益金	△ 2,919
(H) 計(E+F+G)	306,491,177
次期繰越損益金(H)	306,491,177

<注記事項>

- ①設定元本額 499,975,000円
 期中追加設定元本額 5,613,040,356円
 期中一部解約元本額 207,328円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.0501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)

e MAX I S インド株式インデックス	5,613,040,356円
インド株式インデックスファンド(適格機関投資家限定)	499,767,672円
合計	6,112,808,028円

(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。