【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2024年11月1日提出
【発行者名】	三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 横川　直
【本店の所在の場所】	東京都港区東新橋一丁目９番１号
【事務連絡者氏名】	伊藤　晃
【電話番号】	03-4223-3037
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	国内株式セレクション（ラップ向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2024年５月２日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について半期報告書の提出に伴う関係情報の更新等および指定投資信託証券の削除に伴う所要の変更を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

＜訂正前＞および＜訂正後＞に記載している下線部＿は訂正部分を示し、＜更新後＞に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。
「第二部　ファンド情報　第１　ファンド状況　５　運用状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。
なお、「第二部　ファンド情報　第３　ファンドの経理状況」において、「１　財務諸表」につきましては「中間財務諸表」が追加され、「２　ファンドの現況」につきましては原届出書の更新後の内容を記載します。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

＜更新後＞

当ファンドは、主として値上がり益の獲得をめざして運用を行います。
信託金の限度額は、5,000億円です。
＊委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。
当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	独立区分	補足分類
単位型 追加型	国内 海外 内外	株式 債券 不動産投信 その他資産（　　） 資産複合	ＭＭＦ ＭＲＦ ＥＴＦ	インデックス型 特殊型（　　）

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替ヘッジ	対象インデックス	特殊型
株式 一般 大型株 中小型株 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット 属性 （　　） 不動産投信 その他資産 （投資信託証券 （株式 一般）） 資産複合 （　　）	年１回 年２回 年４回 年６回 （隔月） 年12回 （毎月） 日々 その他 （　）	グローバル（日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり（フルヘッジ） なし	日経２２５ ＴＯＰＩＸ その他（　　）	ブル・ベア型 条件付運用型 ロング・ショート型／絶対収益追求型 その他（　　）

※当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（https://www.toushin.or.jp/）でご覧いただけます。
※ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源

泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「ＭＲＦ及びMMＦの運営に関する規則」に規定するMMＦをいいます。
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「ＭＲＦ及びMMＦの運営に関する規則」に規定するＭＲＦをいいます。
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第１号および第２号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第９条の４の２に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

※上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信		信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合		信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年１回		信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回		信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回		信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）		信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）		信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル		信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米		信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州		信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア		信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア		信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米		信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ		信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）		信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング		信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経２２５	信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

※上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

［ファンドの目的・特色］

ファンドの目的

日本を含む世界の株式を実質的な主要投資対象とし、主として値上がり益の獲得をめざします。

ファンドの特色

特色1 投資信託証券への投資を通じて、主として日本を含む世界の株式に実質的な投資を行います。

● 投資対象とする投資信託証券については、定性・定量評価等により適宜見直しを行います。また、各投資信託証券の組入比率は適宜見直しを行います。なお、2024年11月2日現在、投資対象となっている投資信託証券は以下の通りです。

<TOPIXマザーファンド>

東京証券取引所に上場されている日本の株式への投資を行います。

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)と連動する投資成果をめざして運用を行います。
・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)をベンチマークとします。
・対象インデックスとの連動を維持するため、株式(株価指数先物取引等を含む)の実質投資比率は信託財産の純資産総額を超える場合があります。

<日本株インカム・マザーファンド>

日本の株式への投資を行います。

・主としてTOPIX構成銘柄に投資しますが、TOPIX構成銘柄以外の上場株式等に投資する場合があります。
・主として、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、「高水準の配当収入」と「中長期的な株価の値上がり益」の獲得をめざして運用を行います。

<日本・小型株・ファンド・マザーファンド>

日本の小型株式の中から、『成長性が高いと判断される銘柄』を綿密な企業調査により厳選して投資します。

・原則、東京証券取引所のグロース市場上場株式、スタンダード市場上場株式およびプライム市場上場株式を中心に投資します。
・目標株価への到達もしくは接近、ファンダメンタルズの変化、新規投資候補銘柄との相対比較等を勘案し、組入銘柄は適宜入れ替えます。
・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックス(配当込み)をベンチマークとします。

<日本株式最小分散インデックスマザーファンド>

日本の金融商品取引所上場株式を主要投資対象とします。

・MSCI日本株最小分散指数(配当込み)に連動する投資成果をめざして運用を行います。
・MSCI日本株最小分散指数(配当込み)をベンチマークとします。
・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。

<ジャパン・アクティブ・マザーファンド>

日本の株式を主要投資対象とします。

・日本の株式の中から、「資産・利益等と比較して株価が割安と判断され、かつ、優れたマネジメント力で継続的な利益成長や企業再生・復活が期待できる銘柄」を厳選し投資します。
・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

<日本株ESGアクティブマザーファンド>

日本の株式を主要投資対象とします。

・株式への投資にあたっては、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業の中から、企業収益の成長性、株価水準等を考慮して、銘柄選定を行います。
・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。

<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>

日本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。

・MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）に連動する投資成果をめざして運用を行います。
・MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数（配当込み）をベンチマークとします。
・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。

<クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド（ESG）>

日本の株式を主要投資対象とします。

・株式への投資にあたっては、ESGへの取組みに対する評価が高いと委託者が判断した企業の中から、ビジネスのクオリティが高い企業の株式を厳選し、投資を行います。
・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。

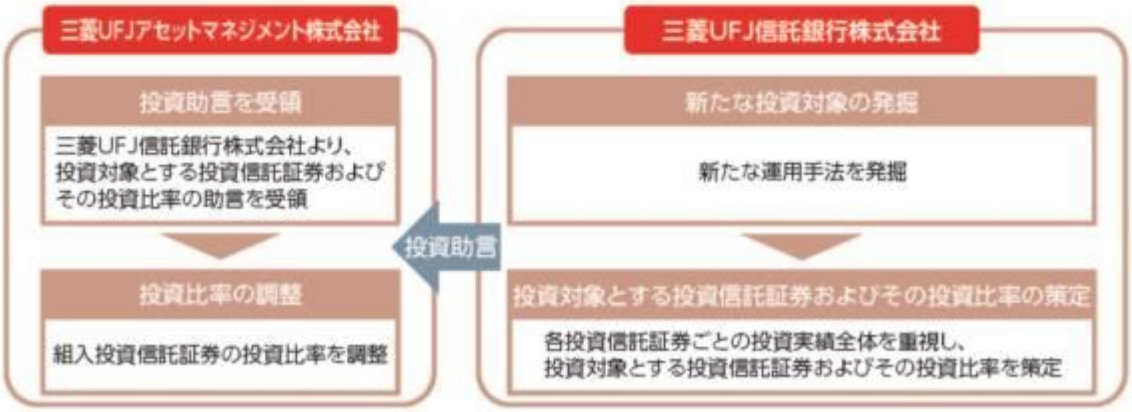
ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

特色2 三菱UFJ信託銀行からの投資助言に基づき運用を行います。

● 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。

投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、投資環境の変化等に応じて適宜変更します。
投資助言者、投資助言の内容、投資助言の有無等については、変更する場合があります。

<運用プロセスのイメージ>



上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
(https://www.am.mufg.jp/investment_policy/fm.html)

特色3 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、為替変動リスクの低減を図ります。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。

為替ヘッジの活用

為替予約取引を活用し為替ヘッジを行うことにより、為替ヘッジをしなかった場合と比較して安定した値動きが期待されます。ただし、為替ヘッジにより、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。なお、為替ヘッジを行うにあたっては、対象通貨間の金利差に基づくヘッジコストがかかります。

! 為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。

<投資リターンのイメージ図>

! 上記は為替ヘッジを理解して頂くためのイメージ図であり、ファンドの将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

特色4 年1回の決算時（2月5日（休業日の場合は翌営業日））に分配金額を決定します。

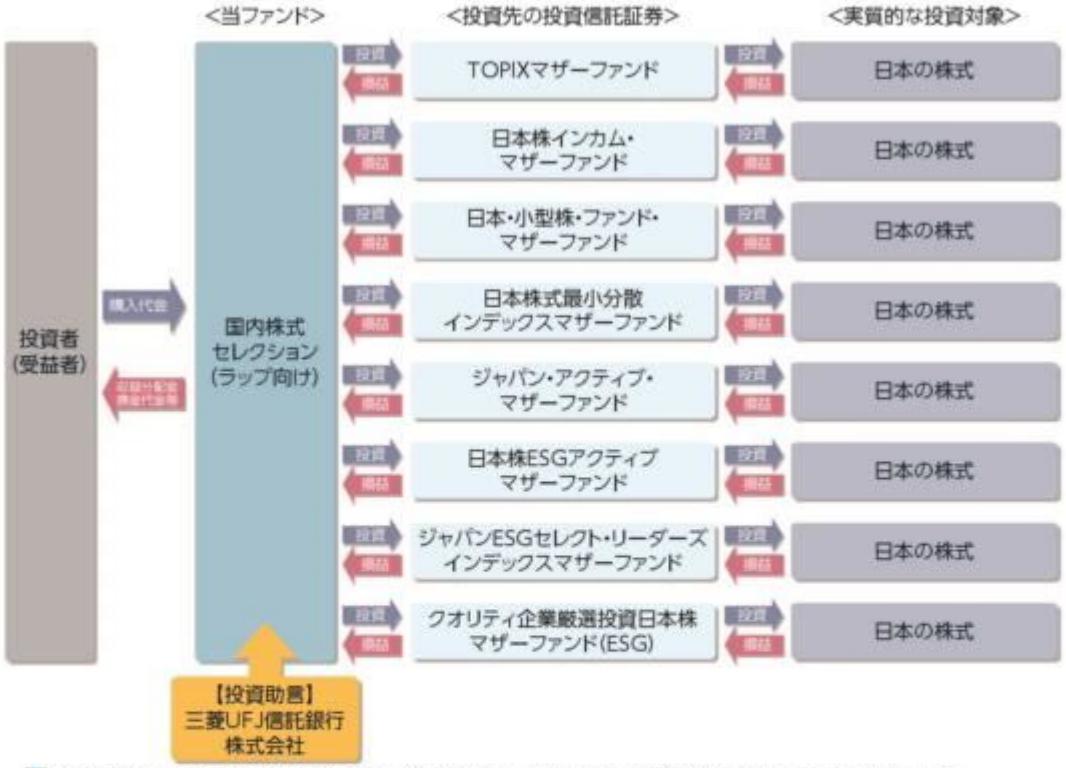
● 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。（基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。）

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

■ファンドの仕組み

ファンド・オブ・ファンズ方式により運用を行います。



- 投資対象とする投資信託証券およびその投資比率は、三菱UFJ信託銀行の投資助言に基づき決定します。
- 上記の投資対象とする投資信託証券は、今後変更される場合があります。

■主な投資制限

株式	株式への直接投資は行いません。
投資信託証券	投資信託証券への投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

■各投資信託証券の運用プロセス

<TOPIXマザーファンド／日本株式最小分散インデックスマザーファンド／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>

ステップ1：投資対象ユニバースの作成

↓ ベンチマーク採用銘柄を主要投資対象とします。

ステップ2：ポートフォリオ案の作成

↓ モニタリング結果に加えて、ファンドの資金動向やベンチマーク構成の変動などを考慮してポートフォリオ案を作成します。

ステップ3：売買執行

↓ 売買執行の際には、売買コストの抑制に留意します。

ステップ4：モニタリング

一連の投資行動を分析し、その結果をポートフォリオに反映することで、運用の継続的な改善に努めます。

! 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

「MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数」について

■MSCIジャパンESGセレクト・リーダーズ指数の構築プロセス

- 半期レビュー（毎年5・11月末）において、親指数の各業種における時価総額の50%を目標に一定の条件に従って銘柄を選定。
- 四半期レビュー（毎年2・8月末）において、継続組入条件を満たしていない既存構成銘柄を除外した上で、各業種分類時価総額の45%未満となる場合、一定の条件に従って50%の目標に達するまで新規採用。

※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。

■ESG適格基準

	内容	新規 組入基準	継続 組入基準
MSCI ESG 格付け	•ESGに関するリスクと機会への対応力を調査・分析 •各企業に係る主要な問題への対応力を同業他社と比較 •AAA～CCCの7段階で評価(BBは最上位から5番目、Bは6番目)	BB以上	B以上
不祥事 スコア	•各企業の事業、製品やサービスがESGにネガティブな影響を与え得る不祥事の深刻度やその解決のための対策を0～10で評価(0が最低評価)	3以上	1以上

■MSCI ESG格付けの評価項目(ご参考)

●環境(Environment)

地球温暖化	自然資源	廃棄物管理	環境市場機会
二酸化炭素排出、 環境配慮融資など	水資源枯渇、 生物多様性と土地利用など	有害物質と廃棄物管理、 包装材廃棄物など	クリーンテクノロジー、 再生可能エネルギーなど

●社会(Social)

人的資源	製品サービスの安全	ステークホルダーマネジメント	社会市場機会
労働マネジメント、 労働安全衛生など	製品安全・品質、 製品化学物質安全など	透明性のある物資調達、 コミュニティ関係	金融へのアクセス、 ヘルスケアへのアクセスなど

●ガバナンス(Governance)

コーポレートガバナンス	企業行動
取締役会構成、 報酬など	企業倫理、 租税回避など

※産業により重要とされる項目が異なるため、全ての項目で評価するものではありません。

※ESG適格基準やMSCI ESG格付けの評価項目は、今後変更される可能性があります。
※MSCI Inc.の資料を基に三菱UFJアセットマネジメントが作成

<日本株インカム・マザーファンド>

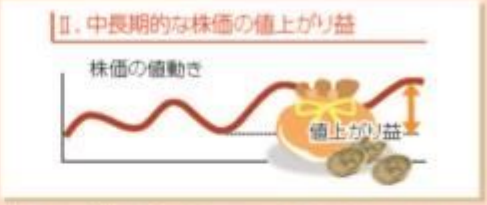
- ポートフォリオの構築にあたっては、銘柄分散を意識し、適宜組入銘柄の入替を行います。
- 株式の組入比率は原則として高位を維持します。

予想配当利回りとは、一株当たりの予想配当金(年間)を株価で割って求められる指標です。

予想配当利回りの市場平均とは、時価総額考慮後のTOPIX構成銘柄の平均予想配当利回りです。

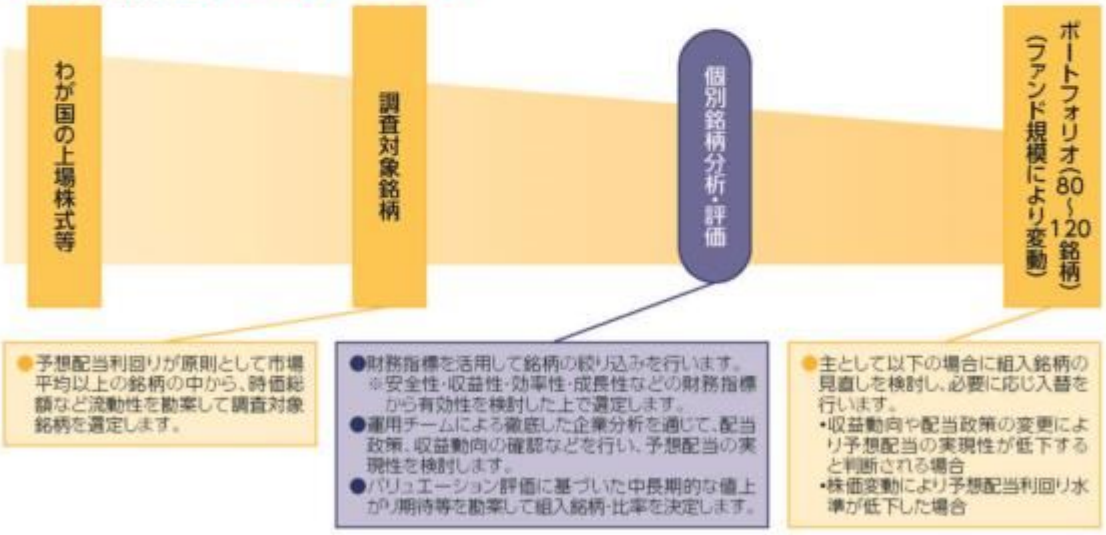
ファンドの主な収益の源泉

予想配当利回りが原則として市場平均以上の銘柄群の中から選別投資し、高水準の配当収入の獲得をめざします。



徹底した企業分析を行うことで、割安な銘柄に投資し、中長期的な株価の値上がり益の獲得をめざします。

<組入銘柄選定プロセスについて>



! 上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄が常に上記の条件を満たすわけではありません。また、こうした企業が必ず利益成長を達成し、株価が上昇するわけではなく、環境によっては業績が悪化し、株価が下落することがある点にご留意ください。

! 上記の運用プロセスは変更される場合があります。また、市場環境等によっては上記のような運用ができない場合があります。

<日本・小型株・ファンド・マザーファンド>

ファンドの主な銘柄選定基準

Ⅰ. 成長性の高い小型株式

中長期的に高い成長が期待できる小型株式に注目します。

Ⅱ. 綿密な企業調査により厳選

株価に影響を与える「企業情報」は、常に公平に株価に反映するとは限りません。綿密な企業調査により、将来的価値が株価に反映されていない銘柄の発掘に努めます。

上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。

<ジャパン・アクティブ・マザーファンド>

銘柄選定プロセス

STEP 1 利益成長のためのポテンシャルである豊富なキャッシュフローを持つ割安企業を選別

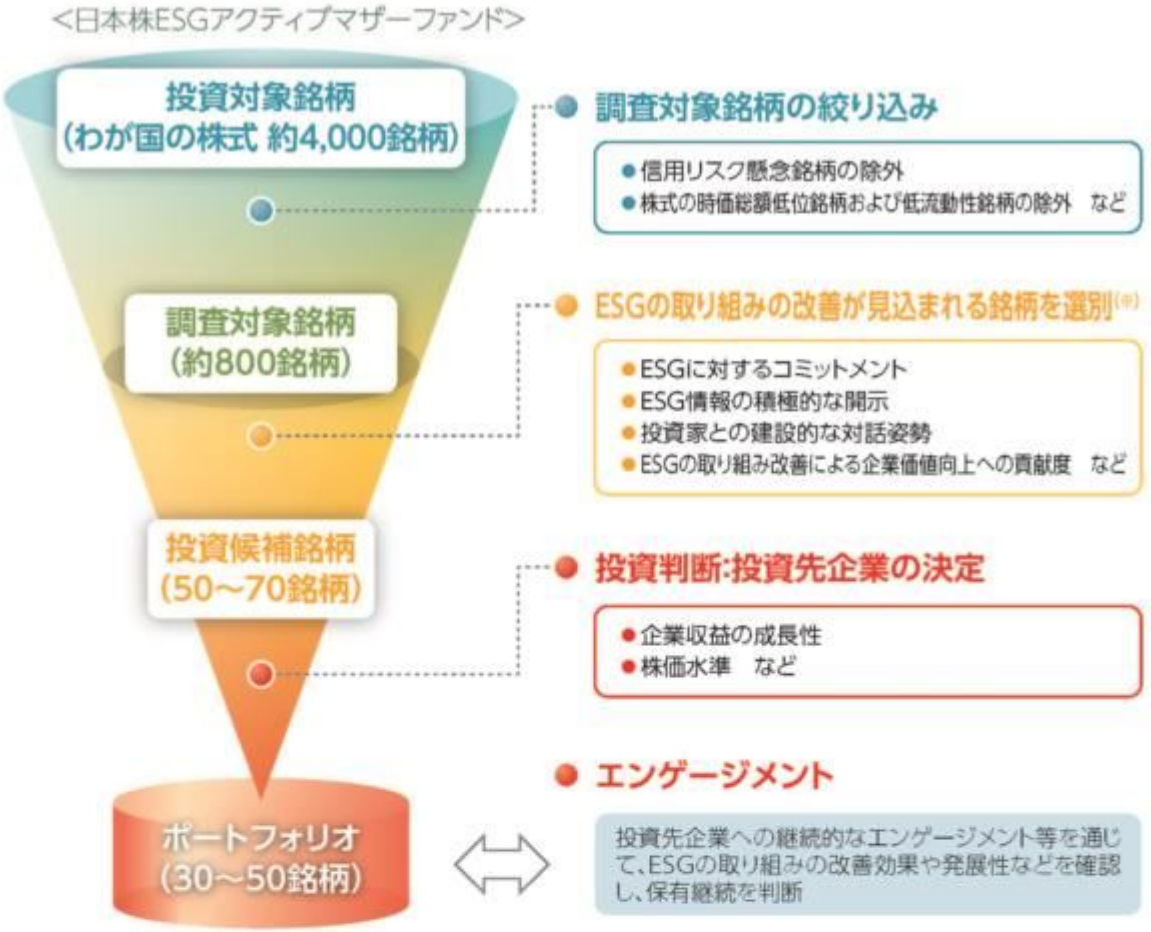
- グループ企業も含めた総合的な収益力（低PER、低PCFRなど）
- 時価で評価した保有資産の価値（低PBRなど）

STEP 2 豊富なキャッシュフローを活用し、優れたマネジメント力を発揮する企業を選別

- 資産・事業売却 ～リストラクチャリングなどの原資に
- 事業交換 ～経営資源の「選択と集中」
- 企業買収・合併 …など ～スケールメリット、残存者メリットの追求 …など

STEP 3 ポートフォリオ組入銘柄の決定

上記は銘柄選定の視点を示したものであり、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。



※ESGの取り組みの改善が見込まれる銘柄にのみ投資を行います。

上記は銘柄選定の視点を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記プロセスは、今後変更されることがあります。

委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
(https://www.am.mufg.jp/investment_policy/fm.html)

■ESGの取り組み改善に関する主な着目点

①ESGに対するコミットメント
- ステークホルダー※と利害が一致する適切な取締役報酬制度への変更
- ESGの取り組み推進に適した取締役会構成の実現　など

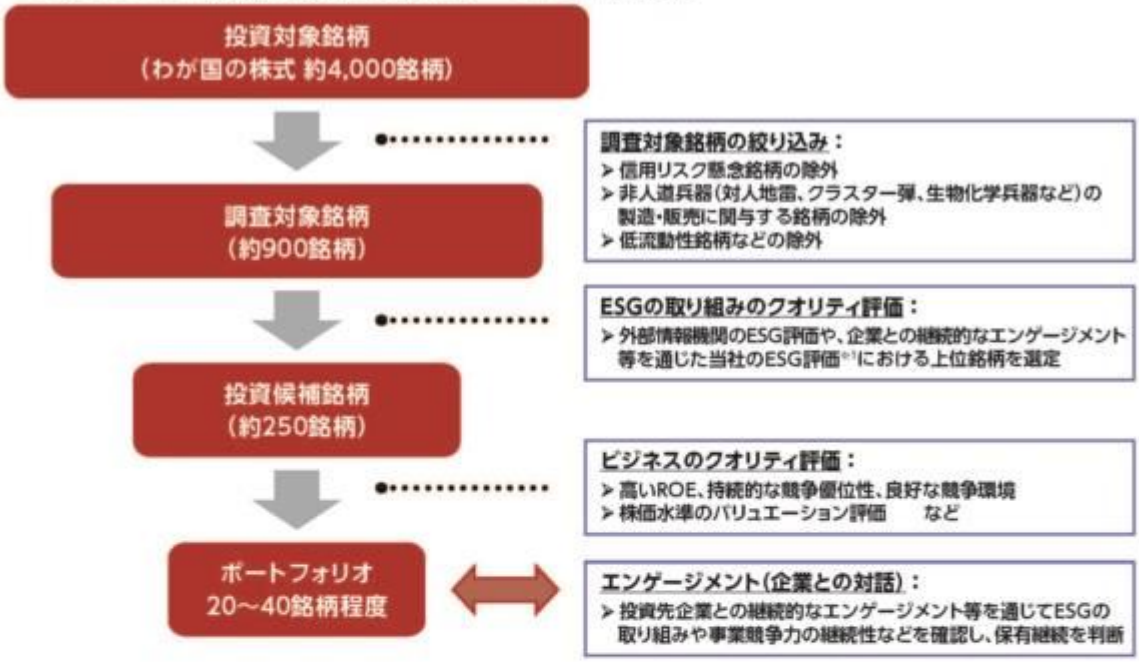
②ESG情報の積極的な開示
- 自社の中長期的な企業価値向上に直結するESG情報の開示の有無
- ESG目標に対する進捗を確認できる透明性のある開示　など

③投資家との建設的な対話姿勢
- 企業価値向上に向けた投資家の提案等の受け入れ
- 取締役等の積極的な対話参画状況　など

④ESGの取り組みによる企業価値向上への貢献度
- 企業価値を損ねているESGの課題を解決する取り組みであるか
- 株式市場の評価を更に伸ばすESGの取り組みであるか　など

※企業の経営活動の存続や発展に対して、利害関係を有するもの。株主・債権者・従業員・顧客など、企業を取り巻くあらゆる利害関係者をさします。

<クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド(ESG)>



※1　当社のESG評価とは
当社では、「気候変動」「ガバナンス体制」「情報開示」「健康と安全」「人権・ダイバーシティ」を重大なESG課題として定めているほか、個別企業ごとのマテリアリティ（重要課題）にも注意を払いながら対話テーマを設定しています。企業との対話等を通じて以下の項目について企業の取り組みを評価しています。

- 投資家との対話姿勢
- マネジメントのESGコミットメント
- ESGに関する情報開示姿勢
- マテリアリティの選定とリスク・機会の分析
- 事業戦略にESGを組み込んだビジネスモデルの企業価値向上への寄与度
- ESGの取り組み全般に対する今後の変化の見通し　など

ROE（自己資本利益率）とは、Return on Equityの略で、1株当たり当期純利益を1株当たり自己資本で割って算出されます。この数値が高いほど企業の収益力は高いと評価されます。

上記はポートフォリオ構築の概略を示したものであり、すべてを網羅するものではありません。また、実際にファンドで投資する銘柄の将来の運用成果等を示唆・保証するものではありません。上記プロセスは、今後変更されることがあります。

■日本株ESGアクティブマザーファンド、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、クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド(ESG)のスチュワードシップ方針

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す。

(ご参考)
委託会社のスチュワードシップ活動
https://www.am.mufg.jp/investment_policy/responsible_stewardshipcode.html

指数について

・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックス(配当込み)は、RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスを構成するインデックスの一つです。RUSSELL/NOMURA Small Capインデックス(配当込み)は、わが国の全金融商品取引所全上場銘柄の全時価総額(時価総額は全て安定持株控除後)の98%超をカバーするRUSSELL/NOMURA Total Marketインデックスのうち、時価総額下位約15%の銘柄により構成されています。
RUSSELL/NOMURA 日本株インデックスは、Frank Russell Companyと野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が作成している株価指数で、当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は両社に帰属します。なお、両社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。

・MSCI日本株最小分散指数(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、J-REITを除いた日本株式を対象に、ボラティリティ(価格変動率)が最も小さくなるように各銘柄の構成比率を決定し算出した指数です。
同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

・MSCI ジャパンESGセレクト・リーダーズ指数(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、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。同指数に対する著作権およびその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（３）【ファンドの仕組み】

＜訂正前＞

②委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

③委託会社の概況（2024年４月１日現在）

・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第404号

・設立年月日
1985年8月1日

・資本金
2,000百万円
・沿革

1997年5月	東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月	東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
2015年7月	三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
2023年10月	エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更

・大株主の状況

株　主　名	住　　所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内二丁目７番１号	211,581株	100.0%

＜訂正後＞

②委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

③委託会社の概況（2024年8月末現在）
・金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者　関東財務局長（金商）第404号
・設立年月日
1985年8月1日
・資本金
2,000百万円
・沿革

1997年5月	東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月	東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月	三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ投信株式会社に変更
2015年7月	三菱ＵＦＪ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社に変更
2023年10月	エム・ユー投資顧問株式会社の有価証券運用事業を三菱ＵＦＪ国際投信株式会社へ統合し、商号を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に変更

・大株主の状況

株　主　名	住　　所	所有株式数	所有比率
株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	東京都千代田区丸の内一丁目４番５号	211,581株	100.0%

２【投資方針】

（２）【投資対象】

＜更新後＞

①投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

１．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．約束手形

ハ．金銭債権

２．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

②有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、別に定める投資信託証券（投資信託および外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）ならびに投資証券および外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。）をいいます。以下同じ。）のほか、次に掲げるものとします。

１．国債証券、地方債証券、特別の法律により法人の発行する債券および社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）

２．コマーシャル・ペーパー

３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、２．の証券の性質を有するもの

４．指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）

なお、１．の証券を以下「公社債」といい、公社債に係る運用の指図は短期社債等への投資ならびに買い現先取引（売戻条件付の買入れ）および債券貸借取引（現金担保付債券借入れ）に限り行うことができます。

③金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

１．預金

２．指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）

３．コール・ローン

４．手形割引市場において売買される手形

④その他の投資対象

信託約款に定める次に掲げるもの。

・外国為替予約取引

＜投資信託証券の概要＞

ファンド名	TOPIXマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主として対象インデックスに採用されている株式に投資を行い、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。 ・対象インデックスからカイ離するリスクと運用コストの極小化を目的として、定量的なリスク管理に基づいたポートフォリオ構築と適切な売買執行を行います。 ・株式の実質投資比率(組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建額を加算し、または株価指数先物取引等の売建額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。)は原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	東京証券取引所に上場されている株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2001年3月26日
決算日	原則として毎年3月25日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本株インカム・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてTOPIX構成銘柄の中から、予想配当利回りが市場平均と比較して高いと判断される銘柄に投資し、高水準の配当収入と中長期的な株価値上がり益の獲得をめざして運用を行います。なお、TOPIX構成銘柄以外の上場株式等に投資する場合があります。 ・銘柄選定にあたっては、予想配当利回りが原則として市場平均以上の銘柄から流動性等を勘案して調査対象銘柄を選定し、その中から財務の健全性や配当の実現性等を勘案して組入候補銘柄を決定します。 ・ポートフォリオの構築にあたっては、銘柄分散を意識し、適宜組入銘柄の入替えを行います。 ・原則として株式の組入比率は高位を維持します。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・なお、市場動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	0.3%
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2005年7月15日
決算日	原則として毎年2月3日、8月3日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本・小型株・ファンド・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の小型株式の中から、ボトムアップアプローチにより成長性が高いと判断される銘柄を厳選して投資することを基本とします。 ※小型株式の分類は「RUSSELL/NOMURA 日本株インデックス」の分類に準ずるものとします。 ・RUSSELL/NOMURA Small Capインデックス(配当込み)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 ・組入銘柄については、適宜見直しを行い、必要に応じ入替えを行います。 ・株式の組入比率は、原則として高位を維持します。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式(金融商品取引所上場および店頭登録株式)
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2000年3月31日
決算日	原則として毎年6月10日、12月10日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	日本株式最小分散インデックスマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の金融商品取引所上場株式に投資を行います。 ・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。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の金融商品取引所上場株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを減じる目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2016年11月9日
決算日	原則として毎年10月29日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	ジャパン・アクティブ・マザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・わが国の株式の中から、「資産・利益等と比較して株価が割安と判断され、かつ、優れたマネジメント力で継続的な利益成長や企業再生・復活が期待できる銘柄」を厳選し投資します。 ・東証株価指数(TOPIX)(配当込み)をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・外貨建資産への投資は行いません。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は効率的な運用に資するためならびに価格変動リスクを回避するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2003年2月28日
決算日	原則として毎年10月30日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

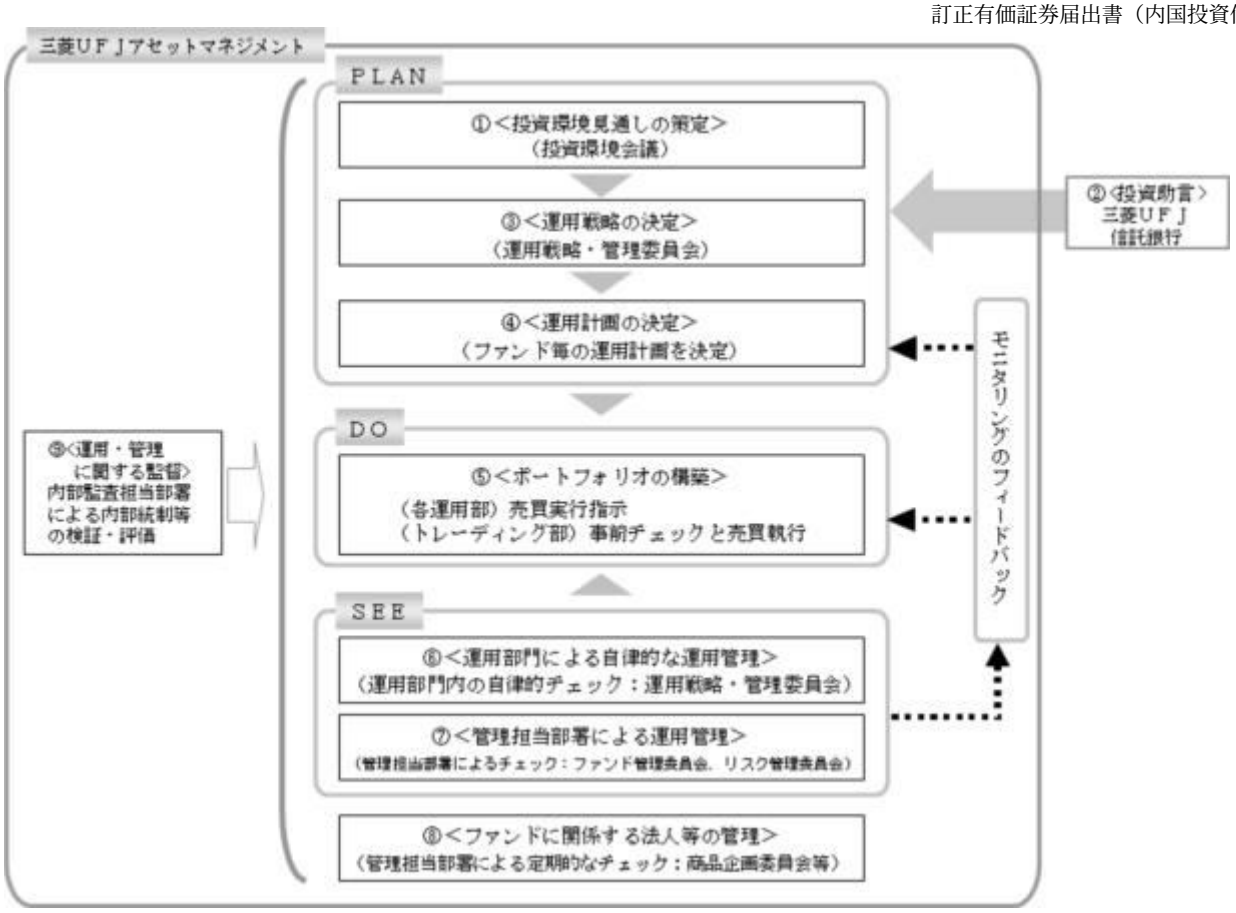
ファンド名	日本株ESGアクティブマザーファンド
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の株式に投資を行います。 ・株式への投資にあたっては、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業の中から、企業収益の成長性、株価水準等を考慮して、銘柄選定を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券（上場投資信託証券を除きます。）への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 （信託報酬）	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2019年5月15日
決算日	原則として毎年5月25日、11月25日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	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
形態	証券投資信託
投資態度	・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。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	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。)
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。 ・有価証券先物取引等を行うことができます。 ・スワップ取引を行うことができます。 ・外国為替予約取引を行うことができます。 ・デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動リスク、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的ならびに投資対象資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的以外には利用しません。 ・外国為替予約取引は、為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2018年10月22日
決算日	原則として毎年1月26日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

ファンド名	クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド(ESG)
形態	証券投資信託
投資態度	・主としてわが国の株式に投資を行います。 ・株式への投資にあたっては、ESGへの取組みに対する評価が高いと委託者が判断した企業の中から、ビジネスのクオリティが高い企業の株式を厳選し、投資を行います。 ・株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。 ・株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。 ・市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。
主な投資対象	わが国の株式
主な投資制限	・株式への投資割合に制限を設けません。 ・新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。 ・投資信託証券(上場投資信託証券を除きます。)への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。 ・同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。 ・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。 ・有価証券先物取引等は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・スワップ取引は価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため行うことができます。 ・外国為替予約取引は効率的な運用に資するため行うことができます。
運用管理費用 (信託報酬)	ありません。
その他の費用・手数料	売買委託手数料、監査費用、資産の保管等に要する費用等がかかる場合があります。
購入時手数料	ありません。
信託財産留保額	ありません。
投資運用会社	三菱UFJアセットマネジメント株式会社
設定日	2021年3月31日
決算日	原則として毎年2月15日、8月15日
分配方針	信託財産から生じる利益は、信託終了時まで信託財産中に留保し、分配を行いません。

（３）【運用体制】

＜更新後＞



①投資環境見通しの策定
投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

②投資助言
当ファンドは、三菱ＵＦＪ信託銀行（「助言元」といいます。）から運用戦略または運用計画の立案に資する投資助言を受けています。

③運用戦略の決定
運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通し、および②の投資助言に沿って運用戦略を決定します。

④運用計画の決定
③で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

⑤ポートフォリオの構築
各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

⑥運用部門による自律的な運用管理
運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑦管理担当部署による運用管理
運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、（b）リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、（a）についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑧ファンドに関係する法人等の管理
助言元、受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示さ

れます。

⑨運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。
なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。
「運用担当者に係る事項」　https://www.am.mufg.jp/investment_policy/fm.html

3【投資リスク】

＜更新後＞

（1）投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。
したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。
投資信託は預貯金と異なります。
ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。
（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク	一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、ファンドはその影響を受け組入株式の価格の下落は基準価額の下落要因となります。
為替変動リスク	組入外貨建資産については、為替ヘッジにより為替変動リスクの低減を図りますが、為替変動リスクを完全に排除できるものではありません。為替ヘッジを行う場合で円金利がヘッジ対象通貨建の金利より低いときには、これらの金利差相当分のヘッジコストがかかることにご留意ください。ただし、為替市場の状況によっては、金利差相当分以上のヘッジコストとなる場合があります。
信用リスク	組入有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等には、当該組入有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払い・償還金の支払いが滞ることがあります。
流動性リスク	有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない場合または取引が不可能となる場合、市場実勢から期待される価格より不利な価格での取引となる可能性があります。

※留意事項

・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の６の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
・有価証券の貸付等においては、取引先の倒産等による決済不履行リスクを伴い、当ファンドが損失を被る可能性があります。
・当ファンドは、大量の解約が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。こ

れにより、基準価額にマイナスの影響を及ぼす可能性や、換金の申込みの受付けが中止となる可能性、換金代金のお支払が遅延する可能性があります。

・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。
投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。
収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。

（２）投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行い、ファンド管理委員会およびリスク管理委員会においてそれらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を検討しています。
また、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリングなどを実施するとともに、緊急時対応策を策定し流動性リスクの評価と管理プロセスの検証などを行います。リスク管理委員会は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。
具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①コンプライアンス担当部署
法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守のための管理態勢の状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

②リスク管理担当部署
運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

③内部監査担当部署
委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

● ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

(2019年9月末～2024年8月末)

● ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2019年9月末～2024年8月末)

(注)全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものとして計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)	東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(国債)とは、野村フィデューシャリー・リサーチ&コンサルティング株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(総合)のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス(除く日本)	FTSE世界国債インデックス(除く日本)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エル エル シーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エル エル シーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

（３）【信託報酬等】

＜更新後＞

・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年0.462%（税抜0.42%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

１万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額×信託報酬率×（保有日数／365）
※上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

ファンドが投資対象とする投資信託証券では信託報酬はかかりませんので、受益者が負担する実質的な信託報酬は上記と同じです。

各投資信託証券への投資比率が変動する可能性や投資信託証券の変更の可能性があること、また別途成功報酬がかかる投資信託証券が含まれる場合があることから、今後実質的な料率は変動する場合があります。

・信託報酬は、毎計算期間の６ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.34%	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
販売会社	0.04%	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
受託会社	0.04%	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

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

＜投資信託証券の信託報酬率＞

投資信託証券の名称	信託報酬率（税込）
ＴＯＰＩＸマザーファンド	－
日本株インカム・マザーファンド	－
日本・小型株・ファンド・マザーファンド	－
日本株式最小分散インデックスマザーファンド	－
ジャパン・アクティブ・マザーファンド	－
日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド	－
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	－
クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド（ＥＳＧ）	－

上記の信託報酬率は、今後変更となる場合があります。上記の他、監査費用等の諸費用が別途かかります。申込手数料はかかりません。

（５）【課税上の取扱い】

＜更新後＞

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。
①個人の受益者に対する課税
受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。
１．収益分配金の課税
普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。
原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税５%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。
２．解約時および償還時の課税
解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税５%）の税率による申告分離課税が適用されます。
特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税５%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。
解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。
買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

②法人の受益者に対する課税
受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。
買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

※分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

◇個別元本について
①受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。
②受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。
③受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

◇収益分配金について
受益者が収益分配金を受け取る際、①当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、②当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

※上記は2024年8月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。
※課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

(参考情報)ファンドの総経費率

直近の運用報告書作成対象期間(以下「当期間」といいます。)(2023年2月7日～2024年2月5日)における当ファンドの総経費率は以下の通りです。

総経費率(①+②)	①運用管理費用の比率	②その他費用の比率
0.46%	0.46%	0.00%

(比率は年率、表示桁数未満四捨五入)

※当期間の運用・管理にかかった費用の総額(原則として購入時手数料、売買委託手数料および有価証券取引税を除く。消費税等のかかるものは消費税等を含む。)を当期間の平均受益権口数に平均基準価額(1口当たり)を乗じた数で除しています。

詳細につきましては、当期間の運用報告書(全体版)をご覧ください。

５【運用状況】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

（１）【投資状況】

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	48,161,183,388	98.01
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	976,633,914	1.99
純資産総額		49,137,817,302	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

（２）【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	親投資信託受益証券	ＴＯＰＩＸマザーファンド	6,483,008,725	3.1700	20,551,137,659	3.3328	21,606,571,478	43.97
日本	親投資信託受益証券	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	2,675,406,583	1.8931	5,064,812,203	1.9740	5,281,252,594	10.75
日本	親投資信託受益証券	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	2,328,185,459	1.9476	4,534,374,000	2.0866	4,857,991,778	9.89
日本	親投資信託受益証券	日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド	1,839,269,522	2.2728	4,180,291,770	2.3596	4,339,940,364	8.83
日本	親投資信託受益証券	ジャパン・アクティブ・マザーファンド	625,104,305	5.9791	3,737,561,151	6.1662	3,854,518,165	7.84
日本	親投資信託受益証券	日本株インカム・マザーファンド	899,267,568	3.8348	3,448,511,270	4.2576	3,828,721,597	7.79
日本	親投資信託受益証券	クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド（ＥＳＧ）	2,197,681,856	1.2074	2,653,481,073	1.3237	2,909,071,472	5.92
日本	親投資信託受益証券	日本・小型株・ファンド・マザーファンド	158,183,848	8.9793	1,420,380,227	9.3759	1,483,115,940	3.02

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	98.01
合計	98.01

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および2024年8月末日、同日前１年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額（1万口当たりの純資産価額）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1計算期間末日　(2018年 2月 5日)	3,798,197,134	3,798,197,134	11,677	11,677
第2計算期間末日　(2019年 2月 5日)	6,798,579,101	6,798,579,101	10,048	10,048
第3計算期間末日　(2020年 2月 5日)	6,734,611,028	6,734,611,028	11,120	11,120
第4計算期間末日　(2021年 2月 5日)	9,808,518,564	9,808,518,564	12,620	12,620
第5計算期間末日　(2022年 2月 7日)	15,658,464,142	15,658,464,142	13,043	13,043
第6計算期間末日　(2023年 2月 6日)	26,495,050,269	26,495,050,269	13,787	13,787
第7計算期間末日　(2024年 2月 5日)	41,325,119,939	41,325,119,939	17,741	17,741
2023年 8月末日	36,405,571,083	—	16,196	—
9月末日	36,784,392,127	—	16,202	—
10月末日	36,771,580,720	—	15,734	—
11月末日	39,340,116,595	—	16,579	—
12月末日	39,505,903,490	—	16,504	—
2024年 1月末日	41,181,397,195	—	17,734	—
2月末日	42,855,975,698	—	18,449	—
3月末日	44,120,389,694	—	19,198	—
4月末日	44,143,412,466	—	18,981	—
5月末日	45,223,168,498	—	19,201	—
6月末日	46,943,244,191	—	19,554	—
7月末日	46,312,683,879	—	19,479	—
8月末日	49,137,817,302	—	19,033	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円

第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（%）
第1計算期間	16.77
第2計算期間	△13.95
第3計算期間	10.66
第4計算期間	13.48
第5計算期間	3.35
第6計算期間	5.70
第7計算期間	28.67
第8中間計算期間	△11.26

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配付の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	4,180,718,781	927,957,119	3,252,761,662
第2計算期間	4,337,352,686	824,150,797	6,765,963,551
第3計算期間	1,480,174,624	2,189,987,840	6,056,150,335
第4計算期間	5,016,855,517	3,300,953,963	7,772,051,889
第5計算期間	6,234,909,350	2,001,689,711	12,005,271,528
第6計算期間	9,958,697,693	2,746,978,257	19,216,990,964
第7計算期間	9,618,811,145	5,542,443,158	23,293,358,951
第8中間計算期間	4,477,033,273	3,830,773,211	23,939,619,013

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

投資状況

2024年 8月30日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	1,506,103,842,090	99.19
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	12,247,500,715	0.81
純資産総額		1,518,351,342,805	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	18,085,230,000	1.19

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	20,963,800	3,614.75	75,778,957,435	2,759.50	57,849,606,100	3.81
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	2,761,700	13,076.46	36,113,260,968	14,200.00	39,216,140,000	2.58
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	23,653,100	1,582.01	37,419,497,294	1,528.00	36,141,936,800	2.38
日本	株式	日立製作所	電気機器	9,571,300	2,821.11	27,001,730,124	3,572.00	34,188,683,600	2.25
日本	株式	キーエンス	電気機器	394,500	70,197.16	27,692,783,118	69,610.00	27,461,145,000	1.81
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	2,919,700	6,681.46	19,507,876,924	9,047.00	26,414,525,900	1.74
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	2,719,800	9,058.00	24,635,973,305	9,550.00	25,974,090,000	1.71
日本	株式	三菱商事	卸売業	8,011,700	3,511.88	28,136,144,238	3,013.00	24,139,252,100	1.59
日本	株式	信越化学工業	化学	3,542,300	6,688.89	23,694,057,921	6,422.00	22,748,650,600	1.50
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	2,804,700	6,642.15	18,629,257,968	7,706.00	21,613,018,200	1.42
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	834,600	38,154.73	31,843,941,071	25,805.00	21,536,853,000	1.42
日本	株式	第一三共	医薬品	3,445,600	4,901.75	16,889,488,098	6,108.00	21,045,724,800	1.39
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	3,792,100	4,774.61	18,105,833,294	5,506.00	20,879,302,600	1.38
日本	株式	任天堂	その他製品	2,489,800	8,284.56	20,626,918,468	7,902.00	19,674,399,600	1.30
日本	株式	三井物産	卸売業	6,250,400	3,563.48	22,273,226,683	3,123.00	19,519,999,200	1.29
日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	117,648,600	179.98	21,174,783,192	155.70	18,317,887,020	1.21
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1,951,000	9,161.06	17,873,243,994	8,405.00	16,398,155,000	1.08
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	776,300	19,044.73	14,784,429,122	20,595.00	15,987,898,500	1.05
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	5,242,600	3,055.32	16,017,828,046	3,009.00	15,774,983,400	1.04
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	3,500,500	4,340.58	15,194,214,894	4,333.00	15,167,666,500	1.00
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	9,343,800	1,857.39	17,355,132,846	1,588.00	14,837,954,400	0.98
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	2,909,100	4,507.21	13,111,933,799	4,911.00	14,286,590,100	0.94
日本	株式	三菱重工業	機械	6,965,300	1,389.38	9,677,496,128	1,942.50	13,530,095,250	0.89
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	6,321,800	2,015.47	12,741,417,462	2,038.00	12,883,828,400	0.85
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	234,600	45,518.54	10,678,650,971	46,650.00	10,944,090,000	0.72
日本	株式	村田製作所	電気機器	3,522,700	2,877.54	10,136,736,751	3,033.00	10,684,349,100	0.70
日本	株式	三菱電機	電気機器	4,362,900	2,547.37	11,113,958,801	2,441.00	10,649,838,900	0.70
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	2,359,500	4,013.73	9,470,418,407	4,203.00	9,916,978,500	0.65
日本	株式	キヤノン	電気機器	1,966,900	4,475.47	8,802,814,285	5,017.00	9,867,937,300	0.65
日本	株式	富士通	電気機器	3,665,200	2,508.13	9,192,804,709	2,677.50	9,813,573,000	0.65

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	水産・農林業	0.08
	鉱業	0.29
	建設業	2.13
	食料品	3.13
	繊維製品	0.37
	パルプ・紙	0.15
	化学	5.65
	医薬品	5.06
	石油・石炭製品	0.55
	ゴム製品	0.60
	ガラス・土石製品	0.66
	鉄鋼	0.86
	非鉄金属	0.76
	金属製品	0.49
	機械	5.30
	電気機器	17.41
	輸送用機器	7.45
	精密機器	2.40
	その他製品	2.45
	電気・ガス業	1.42
	陸運業	2.31
	海運業	0.81
	空運業	0.36
	倉庫・運輸関連業	0.14
	情報・通信業	7.41
	卸売業	7.25
	小売業	4.27
	銀行業	7.51
	証券、商品先物取引業	0.87
	保険業	3.10
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.04
	サービス業	4.74
	小計	99.19
合計		99.19

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年 8月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ　２４年０９月限	買建	666	円	17,076,201,300	18,085,230,000	1.19

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

日本株インカム・マザーファンド

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	9,924,588,200	98.75
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	125,613,939	1.25
純資産総額		10,050,202,139	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	30,100	8,237.70	247,954,939	9,550.00	287,455,000	2.86
日本	株式	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	保険業	79,800	2,676.55	213,589,390	3,345.00	266,931,000	2.66
日本	株式	ＳＯＭＰＯホールディングス	保険業	77,200	2,548.93	196,778,046	3,430.00	264,796,000	2.63
日本	株式	ＳＡＮＫＹＯ	機械	117,400	1,383.78	162,455,932	2,097.50	246,246,500	2.45
日本	株式	三井住友トラスト・ホールディングス	銀行業	67,800	2,921.62	198,086,190	3,603.00	244,283,400	2.43
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	80,500	2,478.66	199,532,629	3,009.00	242,224,500	2.41
日本	株式	キヤノン	電気機器	45,500	3,878.42	176,468,524	5,017.00	228,273,500	2.27
日本	株式	メイテックグループホールディングス	サービス業	63,600	2,987.47	190,003,149	3,438.00	218,656,800	2.18
日本	株式	ＭＩＸＩ	サービス業	69,100	2,627.68	181,573,087	2,757.00	190,508,700	1.90
日本	株式	クレディセゾン	その他金融業	58,900	2,641.30	155,572,612	3,225.00	189,952,500	1.89
日本	株式	ＩＮＰＥＸ	鉱業	85,700	1,796.24	153,938,455	2,169.50	185,926,150	1.85
日本	株式	セイノーホールディングス	陸運業	74,200	2,190.91	162,565,806	2,315.50	171,810,100	1.71
日本	株式	ジャフコ　グループ	証券、商品先物取引業	79,600	1,754.93	139,692,992	2,015.50	160,433,800	1.60
日本	株式	アマノ	機械	36,600	3,392.98	124,183,152	4,375.00	160,125,000	1.59
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	34,300	3,479.76	119,355,811	4,203.00	144,162,900	1.43
日本	株式	アイカ工業	化学	42,000	3,197.01	134,274,517	3,349.00	140,658,000	1.40
日本	株式	山善	卸売業	101,900	1,370.65	139,669,956	1,373.00	139,908,700	1.39

日本	株式	システナ	情報・通信業	342,400	325.08	111,309,434	390.00	133,536,000	1.33
日本	株式	アマダ	機械	84,900	1,317.77	111,879,325	1,500.00	127,350,000	1.27
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	64,700	1,639.74	106,091,289	1,817.00	117,559,900	1.17
日本	株式	ＮＯＫ	輸送用機器	47,700	1,897.62	90,516,632	2,387.00	113,859,900	1.13
日本	株式	科研製薬	医薬品	27,500	3,599.93	98,998,321	4,128.00	113,520,000	1.13
日本	株式	竹内製作所	機械	26,200	3,627.11	95,030,357	4,300.00	112,660,000	1.12
日本	株式	ケーズホールディングス	小売業	69,700	1,454.93	101,408,858	1,570.00	109,429,000	1.09
日本	株式	あい　ホールディングス	卸売業	42,600	2,130.29	90,750,760	2,531.00	107,820,600	1.07
日本	株式	ポーラ・オルビスホールディングス	化学	72,900	1,396.57	101,809,982	1,472.50	107,345,250	1.07
日本	株式	セブン銀行	銀行業	369,400	245.12	90,549,362	287.90	106,350,260	1.06
日本	株式	トランス・コスモス	サービス業	29,700	3,318.74	98,566,588	3,555.00	105,583,500	1.05
日本	株式	ピジョン	その他製品	66,500	1,389.79	92,421,354	1,577.50	104,903,750	1.04
日本	株式	ディップ	サービス業	36,300	2,525.26	91,667,062	2,888.00	104,834,400	1.04

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	鉱業	1.85
	建設業	6.87
	食料品	1.89
	化学	8.35
	医薬品	2.30
	ゴム製品	0.45
	ガラス・土石製品	1.72
	鉄鋼	2.81
	金属製品	2.51
	機械	12.01
	電気機器	5.50
	輸送用機器	6.10
	精密機器	0.48
	その他製品	1.95
	陸運業	1.97
	情報・通信業	3.44
	卸売業	7.74
	小売業	1.09
	銀行業	12.44
	証券、商品先物取引業	1.60
	保険業	5.29
	その他金融業	1.89
	サービス業	8.51
	小計	98.75
合計		98.75

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	10,546,992,250	98.29
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	183,006,937	1.71
純資産総額		10,729,999,187	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	Ｓａｎｓａｎ	情報・通信業	148,400	1,603.00	237,885,200	2,190.00	324,996,000	3.03
日本	株式	ＡｎｙＭｉｎｄ　Ｇｒｏｕｐ	情報・通信業	237,500	1,048.05	248,911,875	1,331.00	316,112,500	2.95
日本	株式	デクセリアルズ	化学	48,300	6,805.36	328,699,360	6,468.00	312,404,400	2.91
日本	株式	ニチアス	ガラス・土石製品	54,100	4,595.00	248,589,500	5,660.00	306,206,000	2.85
日本	株式	住信ＳＢＩネット銀行	銀行業	98,500	2,937.11	289,305,335	3,105.00	305,842,500	2.85
日本	株式	テクマトリックス	情報・通信業	109,900	1,998.91	219,680,209	2,438.00	267,936,200	2.50
日本	株式	ＭＡＲＵＷＡ	ガラス・土石製品	6,900	36,727.25	253,418,074	38,650.00	266,685,000	2.49
日本	株式	メイコー	電気機器	41,700	6,877.77	286,803,009	6,120.00	255,204,000	2.38
日本	株式	前田工繊	その他製品	139,800	1,601.99	223,958,202	1,637.00	228,852,600	2.13
日本	株式	円谷フィールズホールディングス	卸売業	100,200	1,653.65	165,695,730	2,167.00	217,133,400	2.02
日本	株式	セイコーグループ	精密機器	51,200	4,737.69	242,569,728	3,985.00	204,032,000	1.90
日本	株式	エムアップホールディングス	情報・通信業	160,000	1,309.10	209,456,000	1,272.00	203,520,000	1.90
日本	株式	サイゼリヤ	小売業	39,400	5,471.29	215,568,826	5,090.00	200,546,000	1.87
日本	株式	ＮＥＣネッツエスアイ	情報・通信業	75,500	2,280.55	172,181,525	2,634.00	198,867,000	1.85
日本	株式	日精エー・エス・ビー機械	機械	39,600	4,932.43	195,324,228	5,020.00	198,792,000	1.85
日本	株式	九電工	建設業	28,300	6,152.00	174,101,600	6,545.00	185,223,500	1.73
日本	株式	トリケミカル研究所	化学	46,900	4,111.49	192,828,881	3,775.00	177,047,500	1.65

日本	株式	インターネットイニシアティブ	情報・通信業	59,400	2,205.50	131,006,700	2,965.00	176,121,000	1.64
日本	株式	日本アビオニクス	電気機器	14,000	11,776.76	164,874,764	12,360.00	173,040,000	1.61
日本	株式	ＢｕｙＳｅｌｌ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	卸売業	31,500	3,480.00	109,620,000	5,480.00	172,620,000	1.61
日本	株式	マネーフォワード	情報・通信業	31,000	5,042.00	156,302,000	5,564.00	172,484,000	1.61
日本	株式	フォスター電機	電気機器	103,100	1,642.82	169,375,762	1,636.00	168,671,600	1.57
日本	株式	ペプチドリーム	医薬品	64,300	2,556.33	164,372,514	2,560.00	164,608,000	1.53
日本	株式	トライアルホールディングス	小売業	48,500	2,657.01	128,865,308	3,375.00	163,687,500	1.53
日本	株式	プレミアグループ	その他金融業	78,300	2,147.12	168,119,496	2,088.00	163,490,400	1.52
日本	株式	大黒天物産	小売業	14,100	10,884.15	153,466,593	11,570.00	163,137,000	1.52
日本	株式	ＧＥＮＤＡ	サービス業	61,500	1,674.47	102,980,189	2,630.00	161,745,000	1.51
日本	株式	ライフドリンク　カンパニー	食料品	20,900	5,990.00	125,191,000	7,320.00	152,988,000	1.43
日本	株式	ＵＢＥ	化学	57,500	2,795.12	160,719,400	2,647.00	152,202,500	1.42
日本	株式	ネクセラファーマ	医薬品	107,400	1,561.61	167,716,914	1,400.00	150,360,000	1.40

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	水産・農林業	0.16
	建設業	2.55
	食料品	3.44
	繊維製品	1.31
	化学	8.34
	医薬品	2.94
	ガラス・土石製品	6.48
	金属製品	0.13
	機械	5.22
	電気機器	9.82
	精密機器	4.45
	その他製品	4.28
	陸運業	0.93
	情報・通信業	20.16
	卸売業	4.19
	小売業	9.08
	銀行業	4.00
	保険業	0.12
	その他金融業	2.54
	不動産業	0.89
	サービス業	7.25
	小計	98.29
合計		98.29

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	13,915,178,570	99.23
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	108,135,552	0.77
純資産総額		14,023,314,122	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	108,620,000	0.77

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	31,900	5,220.87	166,545,841	8,554.00	272,872,600	1.95
日本	株式	中外製薬	医薬品	36,000	4,621.48	166,373,418	7,384.00	265,824,000	1.90
日本	株式	キヤノン	電気機器	47,100	3,635.64	171,238,707	5,017.00	236,300,700	1.69
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	47,400	4,437.44	210,335,120	4,911.00	232,781,400	1.66
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	15,800	12,619.26	199,384,426	14,200.00	224,360,000	1.60
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	40,600	3,553.10	144,255,910	5,506.00	223,543,600	1.59
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	49,600	4,126.71	204,685,248	4,489.00	222,654,400	1.59
日本	株式	セコム	サービス業	20,800	10,142.95	210,973,372	10,620.00	220,896,000	1.58
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	108,200	1,718.30	185,920,208	2,038.00	220,511,600	1.57
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	28,100	5,605.61	157,517,786	7,706.00	216,538,600	1.54
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	49,900	4,055.73	202,380,935	4,333.00	216,216,700	1.54
日本	株式	積水ハウス	建設業	57,300	2,968.33	170,085,636	3,754.00	215,104,200	1.53
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	53,900	2,814.89	151,722,926	3,905.00	210,479,500	1.50

日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	1,346,000	168.31	226,549,471	155.70	209,572,200	1.49
日本	株式	日立製作所	電気機器	58,400	2,526.34	147,538,808	3,572.00	208,604,800	1.49
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	72,900	2,610.79	190,326,765	2,801.50	204,229,350	1.46
日本	株式	キリンホールディングス	食料品	92,600	2,093.14	193,825,018	2,202.50	203,951,500	1.45
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	132,900	1,268.82	168,626,566	1,528.00	203,071,200	1.45
日本	株式	日本郵政	サービス業	141,800	1,326.88	188,151,630	1,419.50	201,285,100	1.44
日本	株式	村田製作所	電気機器	66,100	2,668.24	176,371,317	3,033.00	200,481,300	1.43
日本	株式	日本マクドナルドホールディングス	小売業	31,200	5,931.25	185,055,228	6,410.00	199,992,000	1.43
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	59,100	3,383.69	199,976,558	3,380.00	199,758,000	1.42
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	20,900	7,416.25	154,999,814	9,550.00	199,595,000	1.42
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	29,300	6,910.29	202,471,777	6,807.00	199,445,100	1.42
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	65,200	2,573.53	167,794,436	3,009.00	196,186,800	1.40
日本	株式	日本たばこ産業	食料品	46,300	3,559.09	164,785,916	4,203.00	194,598,900	1.39
日本	株式	花王	化学	29,600	5,603.15	165,853,322	6,545.00	193,732,000	1.38
日本	株式	任天堂	その他製品	24,500	6,414.37	157,152,143	7,902.00	193,599,000	1.38
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	105,900	1,831.94	194,002,632	1,817.00	192,420,300	1.37
日本	株式	オービック	情報・通信業	7,500	22,312.63	167,344,798	25,300.00	189,750,000	1.35

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	鉱業	0.26
	建設業	3.46
	食料品	5.99
	繊維製品	0.08
	化学	5.78
	医薬品	11.28
	石油・石炭製品	0.91
	ゴム製品	1.21
	ガラス・土石製品	0.28
	鉄鋼	0.57
	機械	0.69
	電気機器	12.02
	輸送用機器	3.25
	精密機器	1.92
	その他製品	2.67
	電気・ガス業	2.53
	陸運業	4.62
	海運業	0.86
	空運業	1.36
	情報・通信業	10.55
	卸売業	4.22

	小売業	6.08
	銀行業	7.04
	保険業	4.23
	その他金融業	1.15
	不動産業	1.60
	サービス業	4.62
	小計	99.23
合計		99.23

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年 8月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ　２４年０９月限	買建	4	円	100,957,200	108,620,000	0.77

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	6,312,924,920	98.99
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	64,545,039	1.01
純資産総額		6,377,469,959	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	銀行業	234,100	1,478.16	346,037,465	1,528.00	357,704,800	5.61
日本	株式	日立製作所	電気機器	94,100	2,530.26	238,097,564	3,572.00	336,125,200	5.27
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	115,700	3,203.52	370,648,371	2,759.50	319,274,150	5.01
日本	株式	三菱商事	卸売業	82,900	2,770.70	229,691,713	3,013.00	249,777,700	3.92
日本	株式	ＳＷＣＣ	非鉄金属	38,200	3,802.66	145,261,871	5,370.00	205,134,000	3.22
日本	株式	三井物産	卸売業	61,600	3,461.30	213,216,360	3,123.00	192,376,800	3.02
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	37,000	4,701.71	173,963,425	5,151.00	190,587,000	2.99

日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	75,100	2,403.80	180,525,488	2,514.00	188,801,400	2.96
日本	株式	ＦＯＯＤ　＆　ＬＩＦＥ　ＣＯＭＰＡＮＩＥ	小売業	62,900	2,684.41	168,849,476	2,711.00	170,521,900	2.67
日本	株式	カプコン	情報・通信業	50,500	2,661.10	134,385,551	3,173.00	160,236,500	2.51
日本	株式	りそなホールディングス	銀行業	147,400	886.74	130,705,476	1,030.50	151,895,700	2.38
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,700	34,414.44	196,162,356	25,805.00	147,088,500	2.31
日本	株式	第一三共	医薬品	23,400	4,443.07	103,967,973	6,108.00	142,927,200	2.24
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	25,500	3,915.39	99,842,479	5,506.00	140,403,000	2.20
日本	株式	ライフドリンク　カンパニー	食料品	18,700	4,543.76	84,968,414	7,320.00	136,884,000	2.15
日本	株式	富士通	電気機器	48,300	2,181.96	105,388,702	2,677.50	129,323,250	2.03
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	9,100	12,614.10	114,788,398	14,200.00	129,220,000	2.03
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	19,300	4,784.96	92,349,869	6,641.00	128,171,300	2.01
日本	株式	三菱地所	不動産業	51,200	2,785.00	142,592,302	2,500.50	128,025,600	2.01
日本	株式	日本製鉄	鉄鋼	38,400	3,290.27	126,346,438	3,310.00	127,104,000	1.99
日本	株式	サイバーエージェント	サービス業	123,100	936.52	115,286,761	1,010.50	124,392,550	1.95
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	30,600	4,705.59	143,991,157	3,988.00	122,032,800	1.91
日本	株式	ホシザキ	機械	23,000	5,173.36	118,987,356	4,697.00	108,031,000	1.69
日本	株式	オービックビジネスコンサルタント	情報・通信業	14,400	6,503.95	93,656,909	7,130.00	102,672,000	1.61
日本	株式	楽天グループ	サービス業	98,100	835.56	81,969,077	1,033.50	101,386,350	1.59
日本	株式	マースグループホールディングス	機械	26,100	2,816.35	73,506,753	3,705.00	96,700,500	1.52
日本	株式	村田製作所	電気機器	31,800	2,716.79	86,394,204	3,033.00	96,449,400	1.51
日本	株式	京成電鉄	陸運業	20,600	5,486.70	113,026,042	4,601.00	94,780,600	1.49
日本	株式	エービーシー・マート	小売業	31,500	2,610.28	82,224,029	2,991.00	94,216,500	1.48
日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	10,900	7,129.17	77,708,046	8,405.00	91,614,500	1.44

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	建設業	1.96
	食料品	5.46
	化学	4.93
	医薬品	2.95
	石油・石炭製品	0.98
	鉄鋼	1.99
	非鉄金属	3.45
	機械	5.12
	電気機器	19.55
	輸送用機器	8.97
	その他製品	1.26
	陸運業	2.13
	海運業	1.00
	倉庫・運輸関連業	0.98
	情報・通信業	5.56

	卸売業	7.94
	小売業	4.15
	銀行業	7.99
	保険業	3.43
	その他金融業	0.99
	不動産業	2.75
	サービス業	5.45
	小計	98.99
合計		98.99

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	5,371,269,350	97.31
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	148,694,870	2.69
純資産総額		5,519,964,220	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	日立製作所	電気機器	106,400	3,210.52	341,599,574	3,572.00	380,060,800	6.89
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	35,200	7,950.62	279,861,922	9,047.00	318,454,400	5.77
日本	株式	カプコン	情報・通信業	98,900	2,800.77	276,997,034	3,173.00	313,809,700	5.68
日本	株式	ＴＯＰＰＡＮホールディングス	その他製品	59,800	3,996.01	238,961,519	4,383.00	262,103,400	4.75
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	16,000	12,608.79	201,740,786	14,200.00	227,200,000	4.12
日本	株式	ディスコ	機械	5,200	59,554.66	309,684,246	42,660.00	221,832,000	4.02
日本	株式	味の素	食料品	39,100	5,924.79	231,659,292	5,597.00	218,842,700	3.96
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	77,900	3,345.79	260,637,041	2,759.50	214,965,050	3.89
日本	株式	日本瓦斯	小売業	90,000	2,408.90	216,801,861	2,324.50	209,205,000	3.79
日本	株式	富士通	電気機器	76,300	2,393.01	182,586,663	2,677.50	204,293,250	3.70

日本	株式	三菱ケミカルグループ	化学	240,000	819.32	196,637,046	848.80	203,712,000	3.69
日本	株式	セブン＆アイ・ホールディングス	小売業	96,700	2,035.50	196,832,850	2,098.50	202,924,950	3.68
日本	株式	第一三共	医薬品	31,800	5,652.37	179,745,675	6,108.00	194,234,400	3.52
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	39,700	4,142.42	164,454,213	4,333.00	172,020,100	3.12
日本	株式	村田製作所	電気機器	56,200	3,028.22	170,185,965	3,033.00	170,454,600	3.09
日本	株式	三菱商事	卸売業	54,400	3,351.13	182,301,472	3,013.00	163,907,200	2.97
日本	株式	積水ハウス	建設業	38,700	3,564.82	137,958,563	3,754.00	145,279,800	2.63
日本	株式	ブリヂストン	ゴム製品	25,400	6,843.06	173,813,741	5,682.00	144,322,800	2.61
日本	株式	京セラ	電気機器	77,900	1,830.38	142,586,836	1,792.50	139,635,750	2.53
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	33,900	4,458.12	151,130,537	3,988.00	135,193,200	2.45
日本	株式	奥村組	建設業	28,100	4,867.76	136,784,122	4,635.00	130,243,500	2.36
日本	株式	リコー	電気機器	83,400	1,324.00	110,421,600	1,520.00	126,768,000	2.30
日本	株式	三菱マテリアル	非鉄金属	46,200	3,000.63	138,629,106	2,576.50	119,034,300	2.16
日本	株式	北國フィナンシャルホールディングス	銀行業	22,900	5,079.98	116,331,635	4,920.00	112,668,000	2.04
日本	株式	都築電気	情報・通信業	45,500	2,263.00	102,966,500	2,351.00	106,970,500	1.94
日本	株式	日本製紙	パルプ・紙	110,100	961.00	105,806,100	925.00	101,842,500	1.84
日本	株式	バンダイナムコホールディングス	その他製品	26,600	3,000.00	79,800,000	3,127.00	83,178,200	1.51
日本	株式	ニフコ	化学	18,500	3,516.00	65,046,000	3,723.00	68,875,500	1.25
日本	株式	オムロン	電気機器	11,000	5,446.02	59,906,247	6,026.00	66,286,000	1.20
日本	株式	丸井グループ	小売業	22,300	2,313.50	51,591,050	2,462.50	54,913,750	0.99

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	建設業	4.99
	食料品	4.76
	パルプ・紙	1.84
	化学	4.94
	医薬品	6.64
	ゴム製品	2.61
	非鉄金属	2.16
	機械	4.80
	電気機器	23.82
	輸送用機器	3.89
	精密機器	0.40
	その他製品	7.14
	情報・通信業	7.62
	卸売業	2.97
	小売業	8.46
	銀行業	2.04
	サービス業	8.22
	小計	97.31
合計		97.31

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

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

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	9,103,648,780	98.30
投資証券	日本	45,859,800	0.50
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	111,140,746	1.20
純資産総額		9,260,649,326	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

その他の資産の投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	建別	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	108,620,000	1.17

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)
日本	株式	トヨタ自動車	輸送用機器	238,900	3,080.00	735,812,000	2,759.50	659,244,550	7.12
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	29,100	13,169.67	383,237,465	14,200.00	413,220,000	4.46
日本	株式	日立製作所	電気機器	107,900	2,636.61	284,490,968	3,572.00	385,418,800	4.16
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	34,600	6,666.20	230,650,540	9,047.00	313,026,200	3.38
日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	29,100	8,371.20	243,601,920	9,550.00	277,905,000	3.00
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	10,400	30,682.73	319,100,392	25,805.00	268,372,000	2.90
日本	株式	第一三共	医薬品	43,000	4,877.95	209,751,850	6,108.00	262,644,000	2.84
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	43,700	4,447.76	194,367,182	5,506.00	240,612,200	2.60
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	27,700	6,814.27	188,755,296	7,706.00	213,456,200	2.30
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	4,400	40,498.74	178,194,488	46,650.00	205,260,000	2.22
日本	株式	任天堂	その他製品	24,200	8,116.59	196,421,701	7,902.00	191,228,400	2.06

日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	35,700	4,651.79	166,068,987	4,911.00	175,322,700	1.89
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	8,200	18,311.31	150,152,756	20,595.00	168,879,000	1.82
日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	56,100	2,844.81	159,593,898	3,009.00	168,804,900	1.82
日本	株式	三菱重工業	機械	74,600	1,186.04	88,478,983	1,942.50	144,910,500	1.56
日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	66,500	1,928.90	128,272,448	2,038.00	135,527,000	1.46
日本	株式	村田製作所	電気機器	39,400	2,926.28	115,295,432	3,033.00	119,500,200	1.29
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	17,800	5,661.41	100,773,098	6,641.00	118,209,800	1.28
日本	株式	ダイキン工業	機械	6,100	23,347.91	142,422,251	18,510.00	112,911,000	1.22
日本	株式	富士通	電気機器	38,600	2,223.63	85,832,118	2,677.50	103,351,500	1.12
日本	株式	富士フイルムホールディングス	化学	26,100	3,274.25	85,458,076	3,905.00	101,920,500	1.10
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	25,400	4,959.81	125,979,189	3,988.00	101,295,200	1.09
日本	株式	ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホール	保険業	29,900	2,461.34	73,594,066	3,345.00	100,015,500	1.08
日本	株式	ルネサスエレクトロニクス	電気機器	39,200	2,542.16	99,652,777	2,514.00	98,548,800	1.06
日本	株式	オリックス	その他金融業	26,900	3,087.71	83,059,548	3,644.00	98,023,600	1.06
日本	株式	三井不動産	不動産業	62,100	1,347.22	83,662,849	1,568.00	97,372,800	1.05
日本	株式	ファナック	電気機器	22,000	4,383.75	96,442,500	4,287.00	94,314,000	1.02
日本	株式	ＴＤＫ	電気機器	9,000	7,444.47	67,000,230	9,847.00	88,623,000	0.96
日本	株式	小松製作所	機械	21,500	4,218.82	90,704,630	4,056.00	87,204,000	0.94
日本	株式	丸紅	卸売業	33,200	2,657.42	88,226,511	2,487.00	82,568,400	0.89

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	鉱業	0.52
	建設業	1.73
	食料品	2.96
	繊維製品	0.34
	化学	5.60
	医薬品	4.89
	石油・石炭製品	0.57
	ゴム製品	0.83
	ガラス・土石製品	0.49
	鉄鋼	1.18
	非鉄金属	0.54
	金属製品	0.13
	機械	5.50
	電気機器	22.78
	輸送用機器	7.58
	精密機器	2.25
	その他製品	3.13
	電気・ガス業	1.16
	陸運業	1.82

	海運業	0.61
	空運業	0.12
	倉庫・運輸関連業	0.01
	情報・通信業	4.81
	卸売業	3.59
	小売業	4.31
	銀行業	5.41
	証券、商品先物取引業	1.00
	保険業	4.79
	その他金融業	1.12
	不動産業	2.56
	サービス業	5.98
	小計	98.30
投資証券	―	0.50
合計		98.80

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

2024年 8月30日現在

資産の種類	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額（円）	評価金額（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	大阪取引所	ＴＯＰＩＸ　２４年０９月限	買建	4	円	102,392,200	108,620,000	1.17

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該投資資産の評価金額の比率です。

クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド（ＥＳＧ）

投資状況

2024年 8月30日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（%）
株式	日本	3,677,037,970	98.05
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	73,069,540	1.95
純資産総額		3,750,107,510	100.00

（注）投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

ａ評価額上位３０銘柄

2024年 8月30日現在

国／地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価単価(円)	簿価金額(円)	評価単価(円)	評価金額(円)	投資比率(%)

日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	26,900	7,077.79	190,392,748	7,706.00	207,291,400	5.53
日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	21,100	8,286.00	174,834,600	9,047.00	190,891,700	5.09
日本	株式	第一三共	医薬品	30,600	5,751.00	175,980,600	6,108.00	186,904,800	4.98
日本	株式	ＫＤＤＩ	情報・通信業	37,500	4,586.31	171,986,941	4,911.00	184,162,500	4.91
日本	株式	ＺＯＺＯ	小売業	39,300	4,279.00	168,164,700	4,643.00	182,469,900	4.87
日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	32,200	5,406.02	174,073,989	5,506.00	177,293,200	4.73
日本	株式	ソニーグループ	電気機器	11,400	12,928.61	147,386,209	14,200.00	161,880,000	4.32
日本	株式	ファーストリテイリング	小売業	3,400	41,210.00	140,114,000	46,650.00	158,610,000	4.23
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	98,700	1,550.08	152,993,423	1,588.00	156,735,600	4.18
日本	株式	アドバンテスト	電気機器	23,400	6,286.50	147,104,109	6,641.00	155,399,400	4.14
日本	株式	ＨＯＹＡ	精密機器	7,300	19,570.06	142,861,509	20,595.00	150,343,500	4.01
日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	35,100	4,034.00	141,593,400	4,177.00	146,612,700	3.91
日本	株式	村田製作所	電気機器	48,000	2,904.23	139,403,084	3,033.00	145,584,000	3.88
日本	株式	野村総合研究所	情報・通信業	29,600	4,665.43	138,096,811	4,910.00	145,336,000	3.88
日本	株式	りそなホールディングス	銀行業	133,700	986.80	131,935,160	1,030.50	137,777,850	3.67
日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	5,300	27,797.26	147,325,514	25,805.00	136,766,500	3.65
日本	株式	川崎重工業	輸送用機器	25,600	4,880.32	124,936,436	5,151.00	131,865,600	3.52
日本	株式	三浦工業	機械	37,600	3,252.00	122,275,200	3,308.00	124,380,800	3.32
日本	株式	カプコン	情報・通信業	37,900	2,982.50	113,036,750	3,173.00	120,256,700	3.21
日本	株式	パン・パシフィック・インターナショナルホ	小売業	30,700	3,625.83	111,313,175	3,708.00	113,835,600	3.04
日本	株式	オムロン	電気機器	18,700	5,342.34	99,901,895	6,026.00	112,686,200	3.00
日本	株式	ヤマハ	その他製品	29,800	3,034.56	90,429,988	3,497.00	104,210,600	2.78
日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	23,400	3,884.54	90,898,245	3,988.00	93,319,200	2.49
日本	株式	クボタ	機械	40,400	2,015.00	81,406,000	2,035.00	82,214,000	2.19
日本	株式	ダイキン工業	機械	3,200	17,735.00	56,752,000	18,510.00	59,232,000	1.58
日本	株式	シスメックス	電気機器	19,700	2,696.00	53,111,200	2,820.00	55,554,000	1.48
日本	株式	日本ペイントホールディングス	化学	60,100	879.40	52,851,940	922.20	55,424,220	1.48

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

2024年 8月30日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	化学	1.48
	医薬品	4.98
	機械	7.09
	電気機器	20.48
	輸送用機器	7.70
	精密機器	4.01
	その他製品	2.78
	情報・通信業	11.99
	卸売業	5.53
	小売業	12.13
	銀行業	3.67

	保険業	8.64
	サービス業	7.58
	小計	98.05
合計		98.05

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

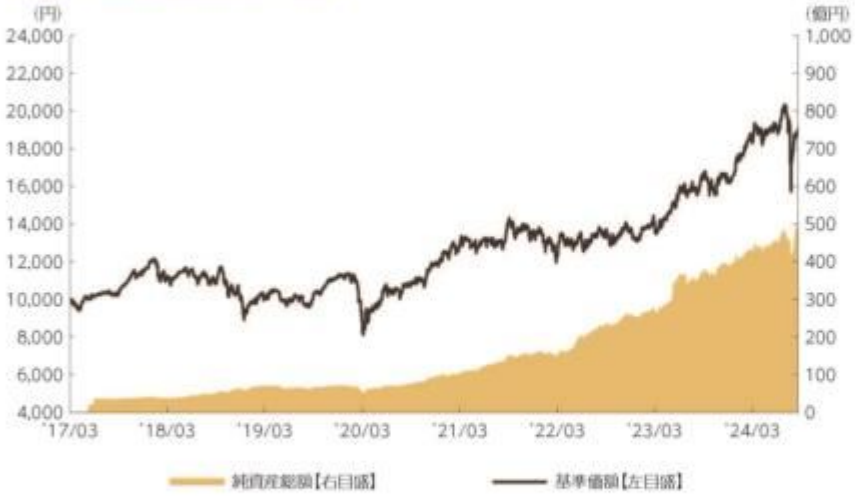
該当事項はありません。

≪参考情報≫

運用実績

2024年8月30日現在

■基準価額・純資産の推移　2017年3月13日(設定日)～2024年8月30日



•基準価額は10,000を起点として表示
•基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	19,033円
純資産総額	491.3億円

•純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024 年 2月	0円
2023 年 2月	0円
2022 年 2月	0円
2021 年 2月	0円
2020 年 2月	0円
2019 年 2月	0円
設定来累計	0円

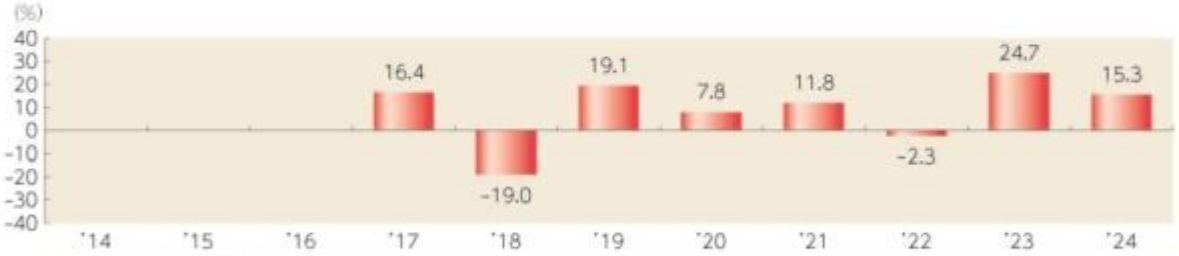
•分配金は1万口当たり、税引前

■主要な資産の状況

	組入上位銘柄	比率
1	TOPIXマザーファンド	44.0%
2	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	10.7%
3	日本株式最小分散インデックスマザーファンド	9.9%
4	日本株ESGアクティブマザーファンド	8.8%
5	ジャパン・アクティブ・マザーファンド	7.8%
6	日本株インカム・マザーファンド	7.8%
7	クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド(ESG)	5.9%
8	日本・小型株・ファンド・マザーファンド	3.0%

•比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

■年間収益率の推移



•収益率は基準価額で計算
•2017年は設定日から年末までの、2024年は年初から8月30日までの収益率を表示
•ファンドにベンチマークはありません。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第３【ファンドの経理状況】

１　当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）ならびに同規則第３８条の３および第５７条の２の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
　なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

２　当ファンドは、金融商品取引法第１９３条の２第１項の規定に基づき、当中間計算期間（2024年 2月 6日から2024年 8月 5日まで）の中間財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により中間監査を受けております。

【中間財務諸表】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

（１）【中間貸借対照表】

（単位：円）

	第7期 ［ 2024年 2月 5日現在 ］	第8期中間計算期間末 ［ 2024年 8月 5日現在 ］
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	884,670,321	1,294,561,902
親投資信託受益証券	40,647,108,774	36,546,966,301
未収利息	-	7,563
流動資産合計	41,531,779,095	37,841,535,766
資産合計	41,531,779,095	37,841,535,766
負債の部		
流動負債		
未払解約金	117,891,606	52,559,654
未払受託者報酬	8,392,100	9,690,884
未払委託者報酬	79,724,998	92,063,305
未払利息	128	-
その他未払費用	650,324	750,988
流動負債合計	206,659,156	155,064,831
負債合計	206,659,156	155,064,831
純資産の部		
元本等		
元本	23,293,358,951	23,939,619,013
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	18,031,760,988	13,746,851,922
（分配準備積立金）	9,650,956,956	8,193,851,448
元本等合計	41,325,119,939	37,686,470,935
純資産合計	41,325,119,939	37,686,470,935
負債純資産合計	41,531,779,095	37,841,535,766

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第7期中間計算期間 自　2023年 2月 7日 至　2023年 8月 6日	第8期中間計算期間 自　2024年 2月 6日 至　2024年 8月 5日
営業収益		
受取利息	2,544	340,265
有価証券売買等損益	4,277,820,184	△4,698,316,993

	第7期中間計算期間 自　2023年 2月 7日 至　2023年 8月 6日	第8期中間計算期間 自　2024年 2月 6日 至　2024年 8月 5日
営業収益合計	4,277,822,728	△4,697,976,728
営業費用		
支払利息	202,205	5,133
受託者報酬	6,751,003	9,690,884
委託者報酬	64,134,532	92,063,305
その他費用	523,144	750,988
営業費用合計	71,610,884	102,510,310
営業利益又は営業損失（△）	4,206,211,844	△4,800,487,038
経常利益又は経常損失（△）	4,206,211,844	△4,800,487,038
中間純利益又は中間純損失（△）	4,206,211,844	△4,800,487,038
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額（△）	401,647,576	519,482,216
期首剰余金又は期首欠損金（△）	7,278,059,305	18,031,760,988
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,944,788,678	4,033,236,169
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,944,788,678	4,033,236,169
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,164,011,477	2,998,175,981
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,164,011,477	2,998,175,981
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	12,863,400,774	13,746,851,922

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。

（中間貸借対照表に関する注記）

	第7期 [2024年 2月 5日現在]	第8期中間計算期間末 [2024年 8月 5日現在]
１．　期首元本額	19,216,990,964円	23,293,358,951円
期中追加設定元本額	9,618,811,145円	4,477,033,273円
期中一部解約元本額	5,542,443,158円	3,830,773,211円
２．　受益権の総数	23,293,358,951口	23,939,619,013口

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第7期中間計算期間 自 2023年 2月 7日 至 2023年 8月 6日	第8期中間計算期間 自 2024年 2月 6日 至 2024年 8月 5日
該当事項はありません。	該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	第7期 [2024年 2月 5日現在]	第8期中間計算期間末 [2024年 8月 5日現在]
１.中間貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。	（１）有価証券 同左
	（２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。	（２）デリバティブ取引 同左
	（３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	（３）上記以外の金融商品 同左
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	第7期 ［2024年 2月 5日現在］	第8期中間計算期間末 ［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7741円 (17,741円)	1.5742円 (15,742円)

（参考）
当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

ＴＯＰＩＸマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	47,689,891,485
株式	1,221,143,292,520
未収入金	48,009,024
未収配当金	1,850,662,702
未収利息	278,626
前払金	737,545,000
その他未収収益	13,432,037
差入委託証拠金	726,555,911
流動資産合計	1,272,209,667,305
資産合計	1,272,209,667,305
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	2,095,693,200
未払金	263,590,000
未払解約金	8,000,941,659
未払利息	1,890,317
受入担保金	30,224,283,051
流動負債合計	40,586,398,227
負債合計	40,586,398,227
純資産の部	
元本等	
元本	450,326,130,591
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	781,297,138,487
元本等合計	1,231,623,269,078
純資産合計	1,231,623,269,078
負債純資産合計	1,272,209,667,305

注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
２.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
１． 期首	2024年 2月 6日
期首元本額	417,450,895,195円
期中追加設定元本額	115,000,885,830円
期中一部解約元本額	82,125,650,434円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ トピックスインデックスオープン	6,588,035,567円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定型）	742,879,366円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（安定成長型）	3,623,036,000円
三菱ＵＦＪ ライフセレクトファンド（成長型）	3,812,636,529円
三菱ＵＦＪ トピックスオープン（確定拠出年金）	3,753,511,099円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定型）（確定拠出年金）	5,481,501,904円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（安定成長型）（確定拠出年金）	32,478,895,552円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（成長型）（確定拠出年金）	41,617,179,836円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（２ヵ月分配型）	81,098,694円
三菱ＵＦＪ ６資産バランスファンド（成長型）	229,088,917円
ファンド・マネジャー（国内株式）	382,063,405円
ｅＭＡＸＩＳ ＴＯＰＩＸインデックス	8,145,393,317円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（８資産均等型）	1,932,833,304円
ｅＭＡＸＩＳ バランス（波乗り型）	207,544,206円
三菱ＵＦＪ プライムバランス（８資産）（確定拠出年金）	2,741,823,563円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３０（確定拠出年金）	842,757,425円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４０（確定拠出年金）	1,142,673,844円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５０（確定拠出年金）	1,129,661,393円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 国内株式（ＴＯＰＩＸ）	61,836,141,126円
国内株式セレクション（ラップ向け）	6,004,050,864円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ バランス（８資産均等型）	10,687,870,612円
つみたて日本株式（ＴＯＰＩＸ）	11,647,931,800円
つみたて８資産均等バランス	5,409,462,337円
つみたて４資産均等バランス	2,083,953,780円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー １９７０ｓ	3,242,843円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー １９８０ｓ	5,331,025円
ｅＭＡＸＩＳ マイマネージャー １９９０ｓ	10,146,542円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０３５（確定拠出年金）	726,298,734円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０４５（確定拠出年金）	976,367,377円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０５５（確定拠出年金）	711,989,543円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式１５）	511,605,630円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式４０）	1,766,084,408円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式６５）	4,485,540,857円
ｅＭＡＸＩＳ Ｓｌｉｍ 全世界株式（３地域均等型）	1,681,979,039円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金インデックス（国内株式）	5,323,923,129円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６０（確定拠出年金）	667,960,881円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式２５）	150,051,021円
国内株式インデックス・オープン（ラップ向け）	22,143,085,519円
三菱ＵＦＪ ターゲット・イヤー・ファンド２０６５（確定拠出年金）	331,944,550円
ラップ向けインデックスｆ 国内株式	4,079,008,136円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（保守型）	150,798,956円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（標準型）	4,148,037,638円
ＭＵＦＧ ウェルス・インサイト・ファンド（積極型）	2,597,824,023円
三菱ＵＦＪ ＤＣ年金バランス（株式８０）	64,256,280円
ダイナミックアロケーションファンド（ラップ向け）	2,123,768,676円
ラップ向けダイナミックアロケーションファンド	65,142,165円

	[2024年 8月 5日現在]
ラップ向けアクティブアロケーションファンド	21,247,557円
アクティブアロケーションファンド（ラップ向け）	33,621,387円
三菱ＵＦＪ　ターゲット・イヤー・ファンド２０７０（確定拠出年金）	5,915,654円
ＭＵＦＧ　ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）コンサバティブコース	3,267,618円
ＭＵＦＧ　ウェルス・インサイト・ファンド・アネックス（為替リスク軽減型）スタンダードコース	64,774,842円
三菱ＵＦＪ　バランス・イノベーション（株式抑制型）	777,377,355円
三菱ＵＦＪ　バランス・イノベーション（株式重視型）	1,793,810,446円
三菱ＵＦＪ　バランス・イノベーション（新興国投資型）	99,516,456円
三菱ＵＦＪ　ＤＣバランス・イノベーション（ＫＡＫＵＳＨＩＮ）	1,188,901,221円
三菱ＵＦＪ　バランス・イノベーション（債券重視型）	268,380,515円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	16,790,705円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	126,103,102円
ｅＭＡＸＩＳ　バランス（４資産均等型）	873,421,848円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイゴールキーパー）	151,882,200円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイディフェンダー）	194,191,968円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイミッドフィルダー）	820,463,905円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイフォワード）	674,418,579円
ｅＭＡＸＩＳ　最適化バランス（マイストライカー）	1,269,852,838円
三菱ＵＦＪ　トピックスオープン	916,727,503円
三菱ＵＦＪ　ＤＣトピックスオープン	8,063,113,324円
三菱ＵＦＪ　トピックスオープンＶＡ（適格機関投資家限定）	40,852,545円
三菱ＵＦＪ　トピックスインデックスファンドＶＡ（適格機関投資家限定）	3,625,926,610円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４５ＶＡ（適格機関投資家限定）	6,823,263円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド４０ＶＡ（適格機関投資家限定）	3,314,899,385円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　２０型（適格機関投資家限定）	54,721,286円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　４０型（適格機関投資家限定）	1,113,741,956円
ＭＵＡＭ　日本株式インデックスファンド（適格機関投資家限定）	57,125,260,037円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　５０型（適格機関投資家限定）	171,626,698円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５５ＶＡ（適格機関投資家限定）	201,116円
三菱ＵＦＪ　バランスファンドＶＡ　３０型（適格機関投資家限定）	117,583円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド５０ＶＡ（適格機関投資家限定）	176,526,091円
三菱ＵＦＪ　バランスファンド２０ＶＡ（適格機関投資家限定）	307,101,142円
ＭＵＡＭ　インデックスファンドＴＯＰＩＸｉ（適格機関投資家限定）	4,014,724,706円
ＭＵＫＡＭ　バランス・イノベーション（株式抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	2,552,062,588円
ＭＵＫＡＭ　バランス・イノベーション（リスク抑制型）（適格機関投資家転売制限付）	773,798,829円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	355,323,452円
世界８資産バランスファンドＶＬ（適格機関投資家限定）	89,516,016円
ＭＵＫＡＭ　下方リスク抑制型バランスファンド（適格機関投資家限定）	1,677,814,976円
ＭＵＫＡＭ　バランス・イノベーション（債券重視型）（適格機関投資家転売制限付）	140,884,285円
ＭＵＫＡＭ　日本株式インデックスファンド２（適格機関投資家限定）	3,773,410,566円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	236,842,446円
ＭＵＫＡＭ　バランス・イノベーション（リスク抑制型）２（適格機関投資家転売制限付）	33,379,078円
マルチアセット運用戦略ファンド（適格機関投資家限定）	269,377円
日米コアバランス（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	84,993,882円
日本株式インデックスファンドＳ	4,304,287,532円
グローバルバランスオープンＶ（適格機関投資家限定）	4,807,410円
ＭＵＡＭ　グローバルバランス（退職給付信託向け）（適格機関投資家限定）	9,798,010,251円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	35,419,113円

	[2024年 8月 5日現在]
ＭＵＫＡＭ　米国国債プラス日本株式ファンド２０２０－０７（適格機関投資家限定）	79,523,277円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－０９（適格機関投資家限定）	34,940,101円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２０－１１（適格機関投資家限定）	34,951,319円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０１（適格機関投資家限定）	34,742,713円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０３（適格機関投資家限定）	34,935,203円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０５（適格機関投資家限定）	35,058,940円
ＭＵＫＡＭ　日米コアバランス　２０２１－０７（適格機関投資家限定）	228,354,366円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０７（適格機関投資家限定）	34,450,377円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－０９（適格機関投資家限定）	34,305,177円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２１－１１（適格機関投資家限定）	34,874,281円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２２－０１（適格機関投資家限定）	35,762,664円
ＭＵＫＡＭ　日米コアバランス（除く米国株）２０２２－０３（適格機関投資家限定）	430,485,690円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２２－０３（適格機関投資家限定）	37,565,083円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２２－０５（適格機関投資家限定）	38,774,804円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２２－０７（適格機関投資家限定）	39,792,135円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２２－０９（適格機関投資家限定）	39,241,585円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２２－１１（適格機関投資家限定）	39,102,095円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２３－０１（適格機関投資家限定）	39,096,327円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２３－０３（適格機関投資家限定）	39,100,255円
ＭＵＫＡＭ　アセットアロケーションファンド２０２３－０５（適格機関投資家限定）	39,088,327円
三菱ＵＦＪ　ＴＯＰＩＸ・ファンド	5,508,055,299円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定型）ＶＡ	2,497,904円
インデックス・ライフ・バランスファンド（安定成長型）ＶＡ	6,068,301円
インデックス・ライフ・バランスファンド（成長型）ＶＡ	1,420,581円
インデックス・ライフ・バランスファンド（積極型）ＶＡ	5,453,899円
三菱ＵＦＪ　ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ１	437,729,773円
三菱ＵＦＪ　ＴＯＰＩＸ・ファンドＶＡ	61,970,551円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｄ（適格機関投資家限定）	2,792,807円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｄ（適格機関投資家限定）	24,096,461円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ３０Ｇ（適格機関投資家限定）	1,332,601円
三菱ＵＦＪ　バランスＶＡ６０Ｇ（適格機関投資家限定）	14,075,437円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞ＴＯＰＩＸ・ファンド	1,569,304,820円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（安定型）	298,214,972円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（安定成長型）	1,284,381,477円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（成長型）	1,240,695,645円
三菱ＵＦＪ　＜ＤＣ＞インデックス・ライフ・バランス　ファンド（積極型）	1,215,738,584円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ国内株式インデックスファンド	60,784,624,106円
合計	450,326,130,591円
２．　貸付有価証券 　貸借取引契約により以下の通り有価証券の貸付を行っております。	
株式	24,593,128,230円
３．　受益権の総数	450,326,130,591口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
株式関連
［2024年 8月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	11,421,340,000	—	9,325,880,000	△2,095,460,000
合計		11,421,340,000	—	9,325,880,000	△2,095,460,000

（注）時価の算定方法

１　先物取引の時価については、以下のように評価しております。
原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

２　先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

３　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.7350円 (27,350円)

日本株インカム・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	116,909,250
株式	8,156,367,160
未収配当金	23,891,800
未収利息	683
流動資産合計	8,297,168,893
資産合計	8,297,168,893
負債の部	
流動負債	
未払解約金	279,504
流動負債合計	279,504

	［2024年 8月 5日現在］
負債合計	279,504
純資産の部	
元本等	
元本	2,295,457,951
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	6,001,431,438
元本等合計	8,296,889,389
純資産合計	8,296,889,389
負債純資産合計	8,297,168,893

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
１． 期首	2024年 2月 6日
期首元本額	3,323,531,723円
期中追加設定元本額	103,387,222円
期中一部解約元本額	1,131,460,994円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ 好配当日本株ファンド（２ヵ月決算型）	1,442,689,146円
国内株式セレクション（ラップ向け）	832,303,815円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	2,535,336円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	17,929,654円
合計	2,295,457,951円
２． 受益権の総数	2,295,457,951口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	3.6145円 (36,145円)

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	161,341,648
株式	8,563,756,500
未収入金	73,218,490
未収配当金	8,794,840
未収利息	942
流動資産合計	8,807,112,420
資産合計	8,807,112,420
負債の部	
流動負債	
未払金	76,906,387
未払解約金	2,156,829
流動負債合計	79,063,216
負債合計	79,063,216
純資産の部	
元本等	
元本	1,167,921,322
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	7,560,127,882
元本等合計	8,728,049,204
純資産合計	8,728,049,204
負債純資産合計	8,807,112,420

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
１． 期首	2024年 2月 6日
期首元本額	1,349,171,880円
期中追加設定元本額	93,614,194円
期中一部解約元本額	274,864,752円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ ジャパン・アクティブ・プラス	34,592,342円
国内株式セレクション（ラップ向け）	145,473,424円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	430,739円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	3,228,546円
日本・小型株・ファンド	228,350,593円
日本株スタイル・ミックス・ファンド	23,139,574円
三菱ＵＦＪ 日本株スタイル・ミックス・ファンドＦ（適格機関投資家限定）	2,753,446円
三菱ＵＦＪ国際 日本・小型株・ファンド（適格機関投資家用）	199,564,037円
＜ＤＣ＞日本株スタイル・ミックス・ファンド	530,388,621円
合計	1,167,921,322円
２． 受益権の総数	1,167,921,322口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。

区分	［2024年 8月 5日現在］
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	（２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	7.4731円 (74,731円)

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	62,042,975
株式	11,304,618,100
未収入金	17,583,240
未収配当金	33,192,050
未収利息	362
前払金	8,885,000
差入委託証拠金	7,265,560
流動資産合計	11,433,587,287
資産合計	11,433,587,287
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	5,940,550
未払金	17,733,300
未払解約金	18,741,537
流動負債合計	42,415,387
負債合計	42,415,387
純資産の部	
元本等	
元本	6,518,042,536
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	4,873,129,364
元本等合計	11,391,171,900
純資産合計	11,391,171,900
負債純資産合計	11,433,587,287

注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
２.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
１． 期首	2024年 2月 6日
期首元本額	6,907,757,739円
期中追加設定元本額	367,498,176円
期中一部解約元本額	757,213,379円
元本の内訳※	
国内株式セレクション（ラップ向け）	2,172,358,296円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	6,219,999円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	46,717,982円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション（適格機関投資家転売制限付）	288,887,700円
日本株式最小分散インデックスファンド（適格機関投資家限定）	3,800,656,031円
ＭＵＫＡＭ　スマート・クオリティ・セレクション２（適格機関投資家限定）	203,202,528円
合計	6,518,042,536円
２． 受益権の総数	6,518,042,536口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
株式関連
［2024年 8月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引 買建	27,935,000	—	21,995,000	△5,940,000
合計		27,935,000	—	21,995,000	△5,940,000

（注）時価の算定方法

１　先物取引の時価については、以下のように評価しております。
　原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

２　先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

３　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.7476円 (17,476円)

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	62,509,562
株式	4,758,337,890
未収配当金	1,979,200
未収利息	365
流動資産合計	4,822,827,017
資産合計	4,822,827,017
負債の部	
流動負債	
未払解約金	90,370
流動負債合計	90,370
負債合計	90,370
純資産の部	
元本等	
元本	974,275,263
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,848,461,384
元本等合計	4,822,736,647
純資産合計	4,822,736,647
負債純資産合計	4,822,827,017

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
１． 期首	2024年 2月 6日
期首元本額	779,755,040円
期中追加設定元本額	239,964,197円
期中一部解約元本額	45,443,974円
元本の内訳※	
三菱ＵＦＪ ジャパン・アクティブ・プラス	216,025,507円
国内株式セレクション（ラップ向け）	567,123,971円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定型）	1,024,835円
三菱ＵＦＪ アドバンスト・バランス（安定成長型）	12,339,105円
世界ソブリン債券・日本株ファンド（毎月分配型）	164,958,360円
ＭＵＡＭ ジャパン・アクティブ・ニュートラル（適格機関投資家限定）	12,803,485円
合計	974,275,263円
２． 受益権の総数	974,275,263口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。

区分	［2024年 8月 5日現在］
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	（３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。 金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	4.9501円 (49,501円)

日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	170,839,534
株式	4,103,365,240
未収配当金	4,682,400
未収利息	998
流動資産合計	4,278,888,172
資産合計	4,278,888,172
負債の部	
流動負債	
未払解約金	3,322,184
流動負債合計	3,322,184
負債合計	3,322,184
純資産の部	
元本等	
元本	2,182,465,143
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,093,100,845
元本等合計	4,275,565,988
純資産合計	4,275,565,988
負債純資産合計	4,278,888,172

注記表
（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

１.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
１． 期首	2024年 2月 6日
期首元本額	1,319,131,841円
期中追加設定元本額	932,224,310円
期中一部解約元本額	68,891,008円
元本の内訳※	
国内株式セレクション（ラップ向け）	1,692,033,114円

	[2024年 8月 5日現在]
三菱ＵＦＪ　ＤＣ日本株ＥＳＧアクティブファンド	425,716,870円
三菱ＵＦＪ　ＤＣ世界ＥＳＧバランスファンド	24,722,906円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	2,725,837円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	37,266,416円
合計	2,182,465,143円
２．　受益権の総数	2,182,465,143口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.9591円 (19,591円)

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

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	112,429,934
株式	6,950,022,920
投資証券	37,861,400
未収配当金	9,203,561
未収利息	656
前払金	7,065,000
差入委託証拠金	7,265,560
流動資産合計	7,123,849,031
資産合計	7,123,849,031
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	20,787,200
未払金	21,580,914
未払解約金	3,685,300
流動負債合計	46,053,414
負債合計	46,053,414
純資産の部	

	［2024年 8月 5日現在］
元本等	
元本	4,393,861,258
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	2,683,934,359
元本等合計	7,077,795,617
純資産合計	7,077,795,617
負債純資産合計	7,123,849,031

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 投資証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2.デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引は金融商品取引所等における清算値段で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
1． 期首	2024年 2月 6日
期首元本額	2,455,548,821円
期中追加設定元本額	2,138,448,291円
期中一部解約元本額	200,135,854円
元本の内訳※	
国内株式セレクション（ラップ向け）	2,447,050,232円
ｅＭＡＸＩＳ　ジャパンＥＳＧセレクト・リーダーズインデックス	852,806,674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	1,028,782,402円
アドバンスト・バランスⅢ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	8,770,103円
アドバンスト・バランスⅣ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	56,451,847円
合計	4,393,861,258円
2． 受益権の総数	4,393,861,258口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）

該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

［2024年 8月 5日現在］

区分	種類	契約額等（円）	うち1年超	時価（円）	評価損益（円）
市場取引	株価指数先物取引				

買建	108,765,000	—	87,980,000	△20,785,000
合計	108,765,000	—	87,980,000	△20,785,000

（注）時価の算定方法

1　先物取引の時価については、以下のように評価しております。
　原則として、直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または終値で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、最も近い終値や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2　先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3　契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

※上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6108円 (16,108円)

クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド（ＥＳＧ）

貸借対照表

（単位：円）

	［2024年 8月 5日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	90,111,592
株式	2,764,018,010
未収配当金	2,336,300
未収利息	526
流動資産合計	2,856,466,428
資産合計	2,856,466,428
負債の部	
流動負債	
流動負債合計	-
負債合計	-
純資産の部	
元本等	
元本	2,645,891,243
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	210,575,185
元本等合計	2,856,466,428
純資産合計	2,856,466,428
負債純資産合計	2,856,466,428

注記表

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1.有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 8月 5日現在]
1.　期首	2024年 2月 6日
期首元本額	4,738,891,320円
期中追加設定元本額	53,510,674円
期中一部解約元本額	2,146,510,751円
元本の内訳※	
国内株式セレクション（ラップ向け）	2,010,080,857円
クオリティ企業厳選投資日本株ファンド（ＥＳＧ）（適格機関投資家限定）	581,919,443円
アドバンスト・バランスⅢ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	7,698,079円
アドバンスト・バランスⅣ（ＦＯＦｓ用）（適格機関投資家限定）	46,192,864円

	[2024年 8月 5日現在]
合計	2,645,891,243円
２． 受益権の総数	2,645,891,243口

※当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）
金融商品の時価等に関する事項

区分	［2024年 8月 5日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
２.時価の算定方法	（１）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （２）デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 （３）上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
３.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

（有価証券に関する注記）
該当事項はありません。

（デリバティブ取引に関する注記）
取引の時価等に関する事項
該当事項はありません。

（１口当たり情報）

	［2024年 8月 5日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0796円 (10,796円)

２【ファンドの現況】

【国内株式セレクション（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ 資産総額	49,597,890,560
Ⅱ 負債総額	460,073,258
Ⅲ 純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	49,137,817,302
Ⅳ 発行済口数	25,817,734,989口
Ⅴ 1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9033
（10,000口当たり）	（19,033）

（参考）

ＴＯＰＩＸマザーファンド

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ 資産総額	1,564,815,073,365
Ⅱ 負債総額	46,463,730,560

Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	1,518,351,342,805
Ⅳ　発行済口数	455,576,253,110口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	3.3328
（10,000口当たり）	（33,328）

日本株インカム・マザーファンド

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	10,109,255,490
Ⅱ　負債総額	59,053,351
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,050,202,139
Ⅳ　発行済口数	2,360,537,810口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	4.2576
（10,000口当たり）	（42,576）

日本・小型株・ファンド・マザーファンド

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	10,730,395,897
Ⅱ　負債総額	396,710
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,729,999,187
Ⅳ　発行済口数	1,144,425,598口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	9.3759
（10,000口当たり）	（93,759）

日本株式最小分散インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	14,134,907,537
Ⅱ　負債総額	111,593,415
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	14,023,314,122
Ⅳ　発行済口数	6,720,694,594口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2.0866
（10,000口当たり）	（20,866）

ジャパン・アクティブ・マザーファンド

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	6,377,511,296
Ⅱ　負債総額	41,337
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	6,377,469,959
Ⅳ　発行済口数	1,034,270,648口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	6.1662
（10,000口当たり）	（61,662）

日本株ＥＳＧアクティブマザーファンド

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	5,523,418,298
Ⅱ　負債総額	3,454,078
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,519,964,220
Ⅳ　発行済口数	2,339,373,038口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	2.3596
（10,000口当たり）	（23,596）

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

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	9,316,973,227
Ⅱ　負債総額	56,323,901
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	9,260,649,326
Ⅳ　発行済口数	4,691,343,478口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.9740
（10,000口当たり）	（19,740）

クオリティ企業厳選投資日本株マザーファンド（ＥＳＧ）

純資産額計算書

2024年 8月30日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	3,750,155,393
Ⅱ　負債総額	47,883
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	3,750,107,510
Ⅳ　発行済口数	2,833,063,375口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3237
（10,000口当たり）	（13,237）

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

＜更新後＞

（１）資本金の額等

2024年8月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近５年間における資本金の額の増減はありません。

（２）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の３分の１以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

①投資環境見通しの策定

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

②運用戦略の決定

運用戦略・管理委員会において、①で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

③運用計画の決定

②で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

④ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

⑤運用部門による自律的な運用管理

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、運用部門内の管理担当部署は逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。また、運用戦略・管理委員会を通じて運用状況のモニタリングを行い、運用部門内での自律的牽制により運用改善を図ります。

⑥管理担当部署による運用管理

運用部から独立した管理担当部署は、（a）運用に関するパフォーマンス測定・分析のほか、（b）リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、（a）についてはファンド管理委員会を経て運用担当部・商品開発担当部にフィードバックされ、（b）についてはリスク管理委員会を通じて運用担当部にフィードバックされ、必要に応じて部署間連携の上で是正・改善の検討が行われます。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、商品企画委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

＜更新後＞

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。
2024年 8月30日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本　数 （本）	純資産総額 （百万円）
追加型株式投資信託	826	36,181,337
追加型公社債投資信託	16	1,516,173
単位型株式投資信託	92	396,293
単位型公社債投資信託	46	102,306
合　計	980	38,196,110

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

＜更新後＞

（１）財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

なお、財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

（２）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第39期事業年度（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

（１）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)		第39期 (2024年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	※2	51,733,041	※2	58,206,340

有価証券		1,579,691		15,283
前払費用		770,747		679,199
未収入金		81,854		138,388
未収委託者報酬		16,753,855		21,064,747
未収収益	※2	688,142	※2	1,485,701
金銭の信託		10,400,000		10,500,500
その他		745,576		371,400
流動資産合計		82,752,908		92,461,561
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	181,551	※1	2,936,036
器具備品	※1	730,357	※1	1,531,857
土地		628,433		628,433
建設仮勘定		1,111,177		45,140
有形固定資産合計		2,651,520		5,141,467
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		4,183,644		5,008,987
ソフトウェア仮勘定		1,907,739		1,587,548
無形固定資産合計		6,107,206		6,612,357
投資その他の資産				
投資有価証券		12,022,365		13,788,071
関係会社株式		159,536		159,536
投資不動産	※1	807,066	※1	1,788,120
長期差入保証金		689,492		689,867
前払年金費用		118,832		47,573
繰延税金資産		1,675,132		1,088,836
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		15,494,056		17,583,636
固定資産合計		24,252,782		29,337,461
資産合計		107,005,691		121,799,022

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)		第39期 (2024年3月31日現在)	
(負債の部)				
流動負債				
預り金		507,559		807,451
未払金				
未払収益分配金		114,094		105,550
未払償還金		7,418		43,553
未払手数料	※2	6,139,595	※2	7,523,485
その他未払金	※2	955,697	※2	885,002
未払費用	※2	5,778,896	※2	8,611,140
未払消費税等		439,657		623,219
未払法人税等		2,375,281		2,235,007
賞与引当金		849,840		1,182,242
役員賞与引当金		154,872		175,992
その他		5,517		12,303

流動負債合計	17,328,431	22,204,949
固定負債		
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
役員退職慰労引当金	75,667	30,105
時効後支払損引当金	254,296	250,350
資産除去債務	-	1,428,586
その他	-	29,109
固定負債合計	1,663,846	3,346,253
負債合計	18,992,277	25,551,202
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	33,267,700	40,236,787
利益剰余金合計	40,608,289	47,577,377
株主資本合計	87,341,133	94,310,221

(単位：千円)

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	672,279	1,937,598
評価・換算差額等合計	672,279	1,937,598
純資産合計	88,013,413	96,247,820
負債純資産合計	107,005,691	121,799,022

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

		第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）		第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
営業収益				
委託者報酬		84,121,445		98,635,342
投資顧問料		2,750,601		3,117,320
その他営業収益		10,412		148,442
営業収益合計		86,882,459		101,901,104
営業費用				
支払手数料	※4	31,461,274	※4	34,494,219
広告宣伝費		798,894		593,586

公告費	375	1,017
調査費		
調査費	2,849,042	3,537,103
委託調査費	19,236,505	27,296,058
事務委託費	1,751,807	1,861,577
営業雑経費		
通信費	113,480	137,737
印刷費	367,379	390,143
協会費	58,128	68,869
諸会費	18,447	20,108
事務機器関連費	2,238,382	2,531,009
その他営業雑経費	-	139,012
営業費用合計	58,893,717	71,070,444
一般管理費		
給料		
役員報酬	416,461	400,592
給料・手当	6,565,766	7,202,711
賞与引当金繰入	849,840	1,182,242
役員賞与引当金繰入	154,872	175,992
福利厚生費	1,279,885	1,424,215
交際費	8,942	10,054
旅費交通費	75,274	108,782
租税公課	403,955	397,138
不動産賃借料	719,707	728,550
退職給付費用	388,176	381,449
固定資産減価償却費	2,418,341	2,469,755
諸経費	444,313	490,104
一般管理費合計	13,725,534	14,971,590
営業利益	14,263,207	15,859,070

(単位：千円)

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）		第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		47,353		54,618
受取利息	※4	10,279	※4	12,836
投資有価証券償還益		609,102		204,527
収益分配金等時効完成分		94,351		17,722
受取賃貸料	※4	65,808	※4	162,111
その他		36,894		44,734
営業外収益合計		863,788		496,550
営業外費用				
投資有価証券償還損		32,995		234,700
時効後支払損引当金繰入		31,951		-
事務過誤費		2,680		10,822
賃貸関連費用		14,262		108,773
その他		32,394		25,903
営業外費用合計		114,284		380,199

経常利益		15,012,711		15,975,421
特別利益				
投資有価証券売却益		387,113		464,927
固定資産売却益		-	※1	16,229
資産除去債務履行差額		-		87,050
特別利益合計		387,113		568,207
特別損失				
投資有価証券売却損		15,828		57,011
投資有価証券評価損		104,554		31,651
固定資産除却損	※3	32,791	※3	20,246
固定資産売却損		-	※2	65,427
減損損失	※5	315,350		-
企業結合関連費用		-	※6	1,187,136
特別損失合計		468,524		1,361,473
税引前当期純利益		14,931,300		15,182,154
法人税、住民税及び事業税	※4	4,860,444	※4	4,542,085
法人税等調整額		△271,471		102,468
法人税等合計		4,588,973		4,644,553
当期純利益		10,342,327		10,537,601

（３）【株主資本等変動計算書】

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	29,000,498	36,341,088	83,073,932
当期変動額					
剰余金の配当			△6,075,125	△6,075,125	△6,075,125
当期純利益			10,342,327	10,342,327	10,342,327
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)					

当期変動額合計	—	—	4,267,201	4,267,201	4,267,201
当期末残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,626,775	1,626,775	84,700,707
当期変動額			
剰余金の配当			△6,075,125
当期純利益			10,342,327
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	△954,495	△954,495	△954,495
当期変動額合計	△954,495	△954,495	3,312,705
当期末残高	672,279	672,279	88,013,413

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712
当期変動額				
企業結合による増加				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)				
当期変動額合計	—	—	—	—
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712

	利益剰余金				株主資本合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	342,589	6,998,000	33,267,700	40,608,289	87,341,133
当期変動額					
企業結合による増加			1,602,526	1,602,526	1,602,526
剰余金の配当			△5,171,039	△5,171,039	△5,171,039
当期純利益			10,537,601	10,537,601	10,537,601
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	—	—	6,969,087	6,969,087	6,969,087
当期末残高	342,589	6,998,000	40,236,787	47,577,377	94,310,221

	評価・換算差額等	

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	672,279	672,279	88,013,413
当期変動額			
企業結合による増加			1,602,526
剰余金の配当			△5,171,039
当期純利益			10,537,601
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)	1,265,319	1,265,319	1,265,319
当期変動額合計	1,265,319	1,265,319	8,234,406
当期末残高	1,937,598	1,937,598	96,247,820

[注記事項]

（重要な会計方針）

1.有価証券の評価基準及び評価方法

(1)子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2)その他有価証券

市場価格のない株式等以外のもの

時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

市場価格のない株式等

移動平均法による原価法を採用しております。

2.金銭の信託の評価基準及び評価方法

時価法を採用しております。

3.固定資産の減価償却の方法

(1)有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、1998年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに2016年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物　5年～50年
器具備品　2年～20年
投資不動産　3年～50年

(2)無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

4.外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、期末日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5.引当金の計上基準

(1)貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2)賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づ

き計上しております。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5)役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

(6)時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

6.収益及び費用の計上基準

当社の顧客との契約から生じる収益に関する主要な事業における主要な履行義務の内容及び当該履行義務を充足する通常の時点（収益を認識する通常の時点）は以下のとおりであります。

(1)委託者報酬

投資信託の信託約款に基づき信託財産の運用指図等を行っております。委託者報酬は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて日々計算され、確定した報酬を投資信託によって主に年2回受領しております。当該報酬は投資信託の運用期間にわたり収益として認識しております。

(2)投資顧問料

顧客との投資一任及び投資助言契約に基づき運用及び助言を行っております。投資顧問料は、純資産総額に一定の報酬率を乗じて計算され、確定した報酬を主に年4回受領しております。当該報酬は契約期間にわたり収益として認識しております。

7.その他財務諸表作成のための基礎となる事項

グループ通算制度の適用

グループ通算制度を適用しております。

（貸借対照表関係）

※1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
建物	1,006,606千円	498,805千円
器具備品	1,985,072千円	1,643,689千円
投資不動産	163,978千円	211,090千円

※2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
預金	40,165,058千円	39,776,992千円
未収収益	15,046千円	12,312千円
未払手数料	790,279千円	886,173千円
その他未払金	77,007千円	105,407千円
未払費用	277,358千円	599,493千円

（損益計算書関係）

※1.固定資産売却益の内訳

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
器具備品	-	16,229千円
計	-	16,229千円

※2.固定資産売却損の内訳

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
器具備品	-	65,427千円
計	-	65,427千円

※3.固定資産除却損の内訳

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
建物	1,047千円	15,825千円
器具備品	29,762千円	3,986千円
ソフトウェア	1,981千円	434千円
計	32,791千円	20,246千円

※4.関係会社に対する主な取引
区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
支払手数料	4,893,312千円	5,006,309千円
受取利息	10,236千円	12,747千円
受取賃貸料	68,168千円	152,876千円
法人税、住民税及び事業税	3,947,200千円	132,303千円

※5.減損損失
第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
当社は、以下のとおり減損損失を計上しました。

場所	用途	種類	金額
東京都千代田区（本社）	ホームページ	ソフトウェア	315,350千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。
ホームページのリニューアルに伴い、現行のホームページについて将来の利用終了が見込まれるため帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。
なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、割引率については使用見込期間が短いため考慮していません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
当事業年度については、該当事項はありません。

※6.企業結合関連費用
第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
前事業年度については、該当事項はありません。

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
企業結合に伴うものであり、主にシステム統合費用などであります。

（株主資本等変動計算書関係）
第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）
1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数　(株)	当事業年度増加 株式数　(株)	当事業年度減少 株式数　(株)	当事業年度末 株式数　(株)
発行済株式				
普通株式	211,581	－	－	211,581
合計	211,581	－	－	211,581

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

2022年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

① 配当金の総額 6,075,125千円
② １株当たり配当額 28,713円
③ 基準日 2022年3月31日
④ 効力発生日 2022年6月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

① 配当金の総額 5,171,039千円
② 配当の原資 利益剰余金
③ １株当たり配当額 24,440円
④ 基準日 2023年3月31日
⑤ 効力発生日 2023年6月29日

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数　(株)	当事業年度増加 株式数　(株)	当事業年度減少 株式数　(株)	当事業年度末 株式数　(株)
発行済株式				
普通株式	211,581	－	－	211,581
合計	211,581	－	－	211,581

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

2023年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

① 配当金の総額 5,171,039千円
② １株当たり配当額 24,440円
③ 基準日 2023年3月31日
④ 効力発生日 2023年6月29日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

2024年6月26日開催の定時株主総会の議案として、普通株式の配当に関する事項を次のとおり提案しております。

① 配当金の総額 45,747,620千円
② 配当の原資 利益剰余金
③ １株当たり配当額 216,218円
④ 基準日 2024年3月31日
⑤ 効力発生日 2024年6月27日

（リース取引関係）

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第38期 （2023年3月31日現在）	第39期 （2024年3月31日現在）
1年内	962,809千円	681,212千円

1年超	1,532,728千円	851,515千円
合計	2,495,537千円	1,532,728千円

（金融商品関係）

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、金銭の信託（合同運用指定金銭信託）で運用し、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

2.金融商品の時価等に関する事項

貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、市場価格のない株式等は、次表には含まれておりません（（注２）参照）。

第38期(2023年3月31日現在)

		貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1)	有価証券	1,579,691	1,579,691	－
(2)	金銭の信託	10,400,000	10,400,000	－
(3)	投資有価証券	12,022,365	12,022,365	－
	資産計	24,002,056	24,002,056	－

（注1）　「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注2）　市場価格のない株式等

関連会社株式（前事業年度の貸借対照表計上額 159,536千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

（注3）　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

（注4）　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第38期(2023年3月31日現在)　（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	51,733,041	－	－	－
金銭の信託	10,400,000	－	－	－
未収委託者報酬	16,753,855	－	－	－
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,579,691	4,859,714	1,433,213	－
合計	80,466,587	4,859,714	1,433,213	－

第39期(2024年3月31日現在)

		貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1)	有価証券	15,283	15,283	－
(2)	金銭の信託	10,500,500	10,500,500	－
(3)	投資有価証券	13,788,071	13,788,071	－
	資産計	24,303,855	24,303,855	－

（注1）　「現金及び預金」、「未収委託者報酬」、「未払手数料」については短期間で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

（注2）　市場価格のない株式等

関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額159,536千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

（注3）　金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することもあります。

（注4）　金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第39期(2024年3月31日現在)　（単位：千円）

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	58,206,340	―	―	―
金銭の信託	10,500,500	―	―	―
未収委託者報酬	21,064,747	―	―	―
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	15,283	5,351,373	347,505	11,696
合計	89,786,871	5,351,373	347,505	11,696

3.金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を、時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

レベル1の時価：　観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価

レベル2の時価：　観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価

レベル3の時価：　観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

時価の算定に重要な影響を与えるインプットを複数使用している場合には、それらのインプットがそれぞれ属するレベルのうち、時価の算定における優先順位が最も低いレベルに時価を分類しております。

時価をもって貸借対照表計上額とする金融資産及び金融負債

第38期(2023年3月31日現在)

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	―	1,579,691	―	1,579,691
金銭の信託	―	10,400,000	―	10,400,000
投資有価証券	1,794,704	10,227,661	―	12,022,365
資産計	1,794,704	22,207,352	―	24,002,056

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

第39期(2024年3月31日現在)

区分	時価（千円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計

有価証券	―	15,283	―	15,283
金銭の信託	―	10,500,500	―	10,500,500
投資有価証券	2,014,968	11,773,103	―	13,788,071
資産計	2,014,968	22,288,887	―	24,303,855

（注）時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

有価証券及び投資有価証券

ETF（上場投資信託）は相場価格を用いて評価しております。ETFは活発な市場で取引されているため、レベル1の時価に分類しております。

ETF（上場投資信託）以外の投資信託は基準価額を用いて評価しております。基準価額は観察可能なインプットを用いて算出しているため、レベル2の時価に分類しております。

金銭の信託

取引先金融機関から提示された価格等に基づき算定しており、レベル2の時価に分類しております。

（有価証券関係）

1.子会社株式及び関連会社株式

第38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024年3月31日現在）

関連会社株式（貸借対照表計上額は159,536千円）は、市場価格がないため、記載しておりません。

2.その他有価証券

第38期(2023年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	8,983,713	7,558,314	1,425,399
	小計	8,983,713	7,558,314	1,425,399
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	15,018,343	15,474,760	△456,417
	小計	15,018,343	15,474,760	△456,417
合計		24,002,056	23,033,074	968,982

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は10,400,000千円、取得原価は10,400,000千円）を含めております。

第39期(2024年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額（千円）	取得原価（千円）	差額（千円）
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	17,364,277	14,269,984	3,094,293
	小計	17,364,277	14,269,984	3,094,293
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	―	―	―
	債券	―	―	―
	その他	6,939,577	7,241,136	△301,559
	小計	6,939,577	7,241,136	△301,559
合計		24,303,855	21,511,121	2,792,733

(注)「その他」には、貸借対照表の「金銭の信託」（貸借対照表計上額は10,500,500千円、取得原価は10,500,000千円）を含めております。

3.売却したその他有価証券

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	17,240	―	14,120
債券	―	―	―
その他	1,551,405	387,113	1,708
合計	1,568,645	387,113	15,828

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	―	―	―
債券	―	―	―
その他	3,750,272	464,927	57,011
合計	3,750,272	464,927	57,011

4.減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について104,554千円（その他有価証券のその他104,554千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について31,651千円（その他有価証券のその他31,651千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（退職給付関係）

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
退職給付債務の期首残高	3,723,521 千円	3,582,778 千円
勤務費用	196,190	182,947
利息費用	25,925	39,626
数理計算上の差異の発生額	△186,130	△79,379
退職給付の支払額	△176,727	△300,286
過去勤務費用の発生額	―	―
企業結合による影響額	―	226,499
退職給付債務の期末残高	3,582,778	3,652,185

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
年金資産の期首残高	2,583,927 千円	2,425,752 千円
期待運用収益	46,453	43,626
数理計算上の差異の発生額	△103,934	227,699
事業主からの拠出額	―	―
退職給付の支払額	△100,694	△204,536
年金資産の期末残高	2,425,752	2,492,542

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	2,468,195　千円	2,250,427　千円
年金資産	△2,425,752	△2,492,542
	42,442	△242,114
非積立型制度の退職給付債務	1,114,583	1,401,758
未積立退職給付債務	1,157,025	1,159,643
未認識数理計算上の差異	281,343	558,841
未認識過去勤務費用	△223,319	△157,957
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527
退職給付引当金	1,333,882	1,608,101
前払年金費用	△118,832	△47,573
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	1,215,049	1,560,527

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
勤務費用	196,190　千円	182,947　千円
利息費用	25,925	39,626
期待運用収益	△46,453	△43,626
数理計算上の差異の費用処理額	△6,532	△29,581
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
退職給付制度の統合に係る調整額	-	34,505
その他	1,600	2,196
確定給付制度に係る退職給付費用	236,091	251,429

（注）「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額及び退職金です。「退職給付制度の統合に係る調整額」は企業結合関連費用の一部として特別損失に計上しております。

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
債券	63.6　%	62.0　%
株式	34.2	35.9
その他	2.2	2.1
合計	100	100

②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
割引率	0.066～1.13%	1.39～1.41%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3.確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度152,084千円、当事業年度164,524千円であります。

（税効果会計関係）

1.繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	499,742千円	389,750千円
投資有価証券評価損	47,876	30,021
未払事業税	169,997	126,161
賞与引当金	260,221	362,002
役員賞与引当金	29,828	33,564
役員退職慰労引当金	23,169	9,218
退職給付引当金	408,434	492,400
減価償却超過額	227,100	199,986
差入保証金	52,869	―
資産除去債務	―	16,900
時効後支払損引当金	77,865	76,657
その他	212,315	227,182
繰延税金資産　小計	2,009,420	1,963,847
評価性引当額	―	―
繰延税金資産　合計	2,009,420	1,963,847
繰延税金負債		
前払年金費用	△36,386	△14,567
その他有価証券評価差額金	△296,702	△855,135
その他	△1,199	△5,308
繰延税金負債　合計	△334,288	△875,010
繰延税金資産の純額	1,675,132	1,088,836

2.法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第38期（2023年3月31日現在）及び第39期（2024年3月31日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

3.法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理

当社は、グループ通算制度を適用しております。また、「グループ通算制度を適用する場合の会計処理及び開示に関する取扱い」（実務対応報告第42号2021年8月12日）に従って、法人税及び地方法人税の会計処理又はこれらに関する税効果会計の会計処理並びに開示を行っております。

（企業結合等関係）

当社は、2023年7月31日開催の取締役会において、三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社(旧商号：ＭＵ投資顧問株式会社)と吸収分割契約を締結することを決議し、同日、吸収分割の効力発生日を2023年10月1日とする吸収分割契約を締結いたしました。本吸収分割契約に基づき、当社と三菱ＵＦＪ不動産投

資顧問株式会社は、2023年10月1日付で吸収分割を実施いたしました。

なお、2023年10月1日付で当社は「三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社」へ商号変更しました。

1.取引の概要

(1)被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称　三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

事業の内容　投資顧問業、私募投資信託の設定・運用等

(2)企業結合日

2023年10月1日

(3)企業結合の法的形式

当社と兄弟会社である三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社を吸収分割会社、当社を吸収分割承継会社とする無対価吸収分割

(4)結合後企業の名称

分割会社：三菱ＵＦＪ不動産投資顧問株式会社

承継会社：三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社

(5)企業結合を行った主な理由

法人投資家の運用ニーズが拡大しており、両社で取り組みを強化している法人投資家ビジネスにかかる運用・営業等の関連機能を三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社に統合することで、リソースやノウハウの集約を通じた運用機能等の強化を図ってまいります。

2.会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準（企業会計基準第21号2019年１月16日）」及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針（企業会計基準適用指針第10号2019年１月16日）」に基づき、共通支配下の取引として処理いたしました。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

1.当該資産除去債務の概要

建物の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務等であります。

2.当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を取得から15年と見積り、割引率は1.1%を使用して資産除去債務の金額を計算しております。

3.当該資産除去債務の総額の増減

	第38期 (2023年3月31日現在)	第39期 (2024年3月31日現在)
期首残高	－	－
有形固定資産の取得に伴う増加	－	1,420,750千円
時の経過による調整額	－	7,835千円
期末残高	－	1,428,586千円

（収益認識関係）

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

収益及び契約から生じるキャッシュ・フローの性質、金額、時期及び不確実性に影響を及ぼす主要な要因に基づく区分に当該収益を分解した情報については、重要性が乏しいため記載を省略しております。

2.顧客との契約から生じる収益を理解するための基礎となる情報

収益を理解するための基礎となる情報は、「（重要な会計方針）の6.収益および費用の計上基準」に記載のとおりであります。

3.顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当事業年度末において存在する顧客との契約から翌事業年度以降に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

重要性が乏しいため記載を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第38期（自2022年4月1日 至 2023年3月31日）及び第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

1.製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2.地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3.主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1.関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注5）	科目	期末残高（注5）
親会社	㈱三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税等	連結納税等に伴う支払（注1）	3,947,200千円	その他未払金	77,007千円
親会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	4,893,312千円	未払手数料	790,279千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料（注3）	463,416千円	未払費用	253,093千円

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注5）	科目	期末残高（注5）
親会社	㈱三菱UFJフィナンシャル・グループ	東京都千代田区	2,141,513百万円	銀行持株会社業	被所有 間接 100.0%	グループ通算制度	グループ通算制度に伴う通算税効果額（注4）	132,303千円	その他未払金	105,407千円

親会社	三菱UFJ信託銀行㈱	東京都千代田区	324,279百万円	信託業、銀行業	被所有直接100.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等 投資の助言 役員の兼任	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2） 投資助言料（注3）	5,006,309千円 463,831千円	未払手数料 未払費用	886,173千円 260,800千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注）１．連結納税制度及びグループ通算制度に基づく法人税の支払予定額であります。
２．投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
３．投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
４．グループ通算制度に基づく通算税効果額であります。
５．上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第38期（自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	4,052,979千円	未払手数料	868,785千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	6,661,991千円	未払手数料	1,218,051千円

第39期（自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額（注2）	科目	期末残高（注2）
同一の親会社を持つ会社	㈱三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	4,354,007千円	未払手数料	1,028,586千円

同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券㈱	東京都千代田区	40,500百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注1）	7,493,449千円	未払手数料	1,449,414千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注）１．投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

２．上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2.親会社に関する注記

株式会社三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（非上場）

（１株当たり情報）

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
１株当たり純資産額	415,979.76円	454,898.22円
１株当たり当期純利益金額	48,881.17円	49,804.10円

（注）1．潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

2．１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第38期 （自 2022年4月1日 至 2023年3月31日）	第39期 （自 2023年4月1日 至 2024年3月31日）
当期純利益金額　（千円）	10,342,327	10,537,601
普通株主に帰属しない金額　（千円）	―	―
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	10,342,327	10,537,601
普通株式の期中平均株式数　（株）	211,581	211,581

第２【その他の関係法人の概況】

１【名称、資本金の額及び事業の内容】

＜更新後＞

（１）受託会社

①名称：三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社
（再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社）
②資本金の額：324,279百万円（2024年３月末現在）
③事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

（２）販売会社

①名称	②資本金の額 （2024年３月末現在）	③事業の内容

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社	324,279　百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。

３【資本関係】

＜訂正前＞

該当ありません。（2024年４月１日現在）

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が３％以上のものを記載しています。

＜訂正後＞

該当ありません。（2024年8月末現在）

（注）関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が３％以上のものを記載しています。

独　立　監　査　人　の　中　間　監　査　報　告　書

2024年10月9日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　御　中

PwC Japan有限責任監査法人
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　西郷　篤

中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている国内株式セレクション（ラップ向け）の2024年2月6日から2024年8月5日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、国内株式セレクション（ラップ向け）の2024年8月5日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2024年2月6日から2024年8月5日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき中間財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得て、中間監査報告書において独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に従って、中間監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要に応じて追加の監査手続が選択及び適用される。

・　中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、中間監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む中間監査上の重要な発見事項、及び中間監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

利害関係

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）1. 上記の中間監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2024年6月7日

三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社
取　締　役　会　　御　中

有限責任監査法人ト　ー　マ　ツ
東　京　事　務　所

指定有限責任社員　業務執行社員　公認会計士　山　田　信　之

指定有限責任社員　業務執行社員　公認会計士　田　嶋　大　士

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社の2023年4月1日から2024年3月31日までの第39期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱ＵＦＪアセットマネジメント株式会社の2024年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

その他の記載内容

その他の記載内容は、監査した財務諸表を含む開示書類に含まれる情報のうち、財務諸表及びその監査報告書以外の情報である。

当監査法人は、その他の記載内容が存在しないと判断したため、その他の記載内容に対するいかなる作業も実施していない。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
・　財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去するための対応策を講じている場合又は阻害要因を許容可能な水準にまで軽減するためのセーフガードを適用している場合はその内容について報告を行う。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以　上

（注）１．　上記の監査報告書の原本は当社が別途保管しております。
　　２．　XBRLデータは監査の対象には含まれていません。