

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2025年1月14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】	eMAXIS Slim 全米株式
【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。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

eMAXIS Slim 全米株式（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

基準価額は、販売会社にてご確認ください。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位

申込単位は販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位とします。

（７）【申込期間】

2025年 1月15日から2025年 7月24日まで

※申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。

販売会社によっては、確定拠出年金制度を利用する場合の申込みの取扱いを行います。

販売会社は、下記にてご確認ください。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034（受付時間：営業日の9:00～17:00）

（９）【払込期日】

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。
各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（１１）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

該当事項はありません。

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】

当ファンドは、MSCI USA インベスタブル・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、1兆円です。

※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

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	国内	株式	MMF	インデックス型
		債券		
	海外	不動産投信	MRF	
追加型	内外	その他資産 ()	ETF	特殊型 ()
資産複合				

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	年1回	グローバル	ファミリー	あり ()	日経225	ブル・ベア型	
一般	年2回	日本	ファンド		なし	TOPIX	条件付運用型
大型株	年4回	北米	ファンド・ オブ・ ファンズ			その他 (MSCI U SA インベス タブル・マー ケット指数(配 当込み、円換 算ベース))	ロング・ ショート型／
中小型株	年6回	欧州			絶対収益		
債券	(隔月)	アジア			追求型		
一般	年12回	オセアニア			その他 ()		
公債	(毎月)	中南米					
社債	日々	アフリカ					
その他債券	その他	中近東					
クレジット 属性 ()	()	(中東) エマージング					
不動産投信							
その他資産 (投資信託証 券(株式 一 般))							
資産複合 ()							

※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（BBB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

米国の株式市場(MSCI USA インベスタブル・マーケット指数(配当込み、円換算ベース))の値動きに連動する投資成果をめざします。

ファンドの特色

特色1

MSCI USA インベスタブル・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)の値動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

- MSCI USA インベスタブル・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)をベンチマーク(以下「対象インデックス」という場合があります。)とします。

「MSCI USA インベスタブル・マーケット指数」について

MSCI USA インベスタブル・マーケット指数とは、米国株式市場の時価総額99%をカバーするように設計された、大型株、中型株、小型株を対象とする時価総額加重型の株価指数です。

MSCI USA インベスタブル・マーケット指数(配当込み、円換算ベース)は、MSCI USA インベスタブル・マーケット指数(配当込み、米ドルベース)をもとに、委託会社が計算したものです。

MSCI USA インベスタブル・マーケット指数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。

<運用プロセスのイメージ>

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。

📄 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.muif.jp/investment_policy/fm.html)

特色2

主として米国の株式等(DR(預託証券)を含みます。)に投資を行います。

- 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等の実質投資比率が100%を超える場合があります。

※実際の運用は全米株式インデックスマザーファンドを通じて行います。

❑ DR(預託証券)とは、Depositary Receiptの略で、ある国の企業の株式を当該国外の市場で流通させるため、現地法に従い発行した代替証券です。株式と同様に金融商品取引所等で取引されます。

特色3

原則として、為替ヘッジは行いません。

- 為替ヘッジを行わないため、為替相場の変動による影響を受けます。

■ファンドの仕組み

運用は主に全米株式インデックスマザーファンドへの投資を通じて、米国の株式等に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合に制限を設けません。
デリバティブ	デリバティブ取引は、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。

■分配方針

- 年1回の決算時(4月25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。

当ファンドは、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者が、保証、推奨、販売、または宣伝するものではありません。MSCI指数は、MSCI Inc.が独占的に所有しています。MSCI Inc.およびMSCI指数は、MSCI Inc.およびその関係会社のサービスマークであり、委託会社は特定の目的のためにその使用を許諾されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者または不特定多数の公衆に対して、ファンド全般的またはこの特定のファンドへの投資に関する当否あるいは一般的な株式市場のパフォーマンスをトラックしているMSCI指数の能力に関して、明示的であると黙示的であるとを問わず、一切の表明または保証を行いません。MSCI Inc.とその関連会社は、特定のトレードマーク、サービスマーク、トレードネームのライセンスの所有者であり、MSCI指数は、当ファンドまたは当ファンドの委託会社あるいは受益者に関わらず、MSCI Inc.により決定、作成、および計算されています。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数の決定、作成、あるいは計算において、当ファンドの委託会社または受益者の要求を考慮にいれる義務は一切ありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの募集等に関する事項の決定について、また、当ファンドを換金するための計算式の決定また計算について責任を負うものではなく、参加もしていません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、当ファンドの受益者に対し、当ファンドの管理、マーケティングまたは募集に関連するいかなる義務または責任も負いません。

MSCI Inc.は、自らが信頼できると考える情報源からMSCI指数の計算に算入される情報またはその計算に使用するための情報を入手しますが、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数またはそれに含まれるいかなるデータの独創性、正確性および/または完全性について保証するものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的にも黙示的にも、被許諾者、その顧客または相手方、当ファンドの委託会社、当ファンドの受益者その他の個人・法人が、契約にもとづき許諾される権利またはその他使用のために許諾される権利に関連してMSCI指数またはそれに含まれるデータを使用することにより得られる結果について保証を行うものではありません。MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、MSCI指数およびそれに含まれるデータの、またはそれに関連する過誤、省略または中断に対してまたはそれらに関して責任を負うことはありません。MSCI指数およびそれに含まれるデータに関し、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、明示的、黙示的な保証を行うものでもなく、かつMSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、特定目的のための市場性または適切性について、何ら保証を行うものではないことを明記します。前記事項を制限することなく、たとえ直接的損害、間接的損害、特別損害、懲罰的損害、拡大的損害その他のあらゆる損害（逸失利益を含む。）につき、その可能性について知らせを受けていたとしても、MSCI Inc.、MSCI Inc.の関連会社およびMSCI指数の作成または編集に関与あるいは関係したその他の当事者は、いかなる場合においてもかかる損害について責任を負いません。

当ファンドの購入者、販売者、または受益者あるいはいかなる個人・法人は、MSCI Inc.の許諾が必要かどうかの決定をあらかじめMSCI Inc.に問い合わせることなく、当ファンドを保証、推奨、売買、または宣伝するためにいかなるMSCI Inc.のトレードネーム、トレードマーク、またはサービスマークを使用または言及することはできません。いかなる場合においても、いかなる個人または法人は、事前にMSCI Inc.の書面による許諾を得ることなくMSCI Inc.との関係を一切主張することはできません。

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。

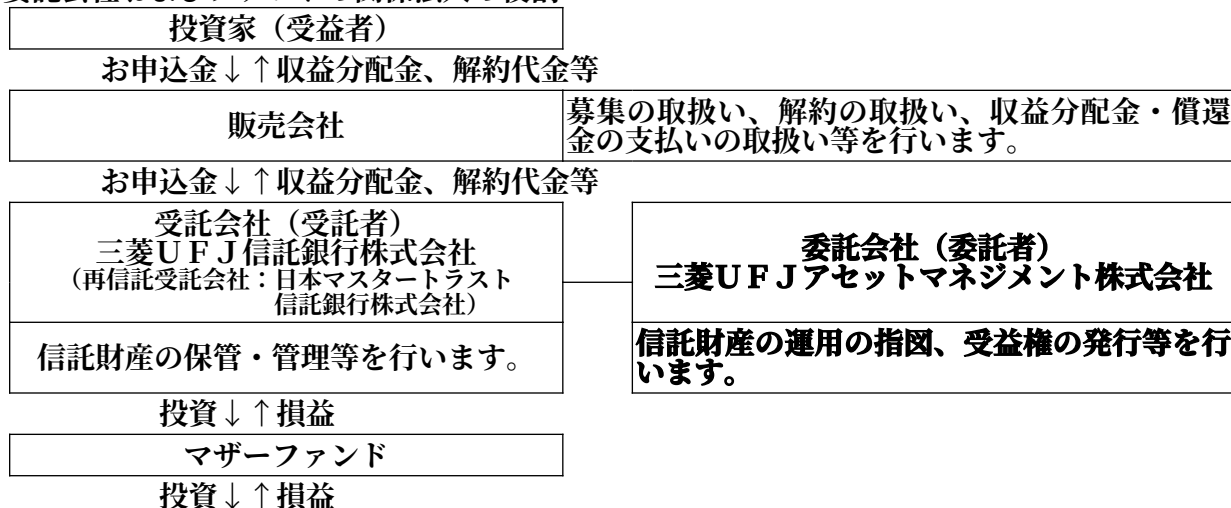
(2) 【ファンドの沿革】

2023年9月15日

設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



有価証券等

※委託会社は、自らファンドの募集等を行い、特定の販売会社と共同でファンドの販売に係る業務を行っています。

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いに関する契約」	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10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】

(1)【投資方針】

全米株式インデックスマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、米国の株式等（ＤＲ（預託証書）を含みます。以下同じ。）に直接投資することがあります。

全米株式インデックスマザーファンド受益証券への投資を通じて、主として米国の株式等に投資を行います。

マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式等の実質投資比率が100%を超える場合があります。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

(2)【投資対象】

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. デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）
 - a. 有価証券先物取引等
 - b. スワップ取引
 - ハ. 約束手形
- ニ. 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、三菱UFJアセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする全米株式インデックスマザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。

1. 株券または新株引受権証書
2. 国債証券
3. 地方債証券
4. 特別の法律により法人の発行する債券
5. 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（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
6. 資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
10. 資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）
11. コマーシャル・ペーパー
12. 新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、1. から12. の証券または証書の性質を有するもの
14. 投資信託または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。）
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（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。16. において同じ。）で16. で定めるものの以外のもの
16. 投資法人債券（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。以下16. において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19. 預託証書（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。）
22. 外国の者に対する権利で21. の有価証券の性質を有するもの

23. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）

なお、1. の証券または証書ならびに13. および19. の証券または証書のうち1. の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2. から6. までの証券ならびに16. の証券ならびに13. および19. の証券または証書のうち2. から6. までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14. および15. の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5. の権利の性質を有するもの

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

<全米株式インデックスマザーファンドの概要>

（基本方針）

この投資信託は、MSCI USA インベスタブル・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）に連動する投資成果をめざして運用を行います。

（運用方法）

①投資対象

米国の株式等（DR（預託証書）を含みます。以下同じ。）を主要投資対象とします。

②投資態度

主として米国の株式等に投資を行います。

株式等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等の実質投資比率が100%を超える場合があります。

組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

（投資制限）

①株式への投資割合に制限を設けません。

②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。

③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。

④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。

⑤外貨建資産への投資割合に制限を設けません。

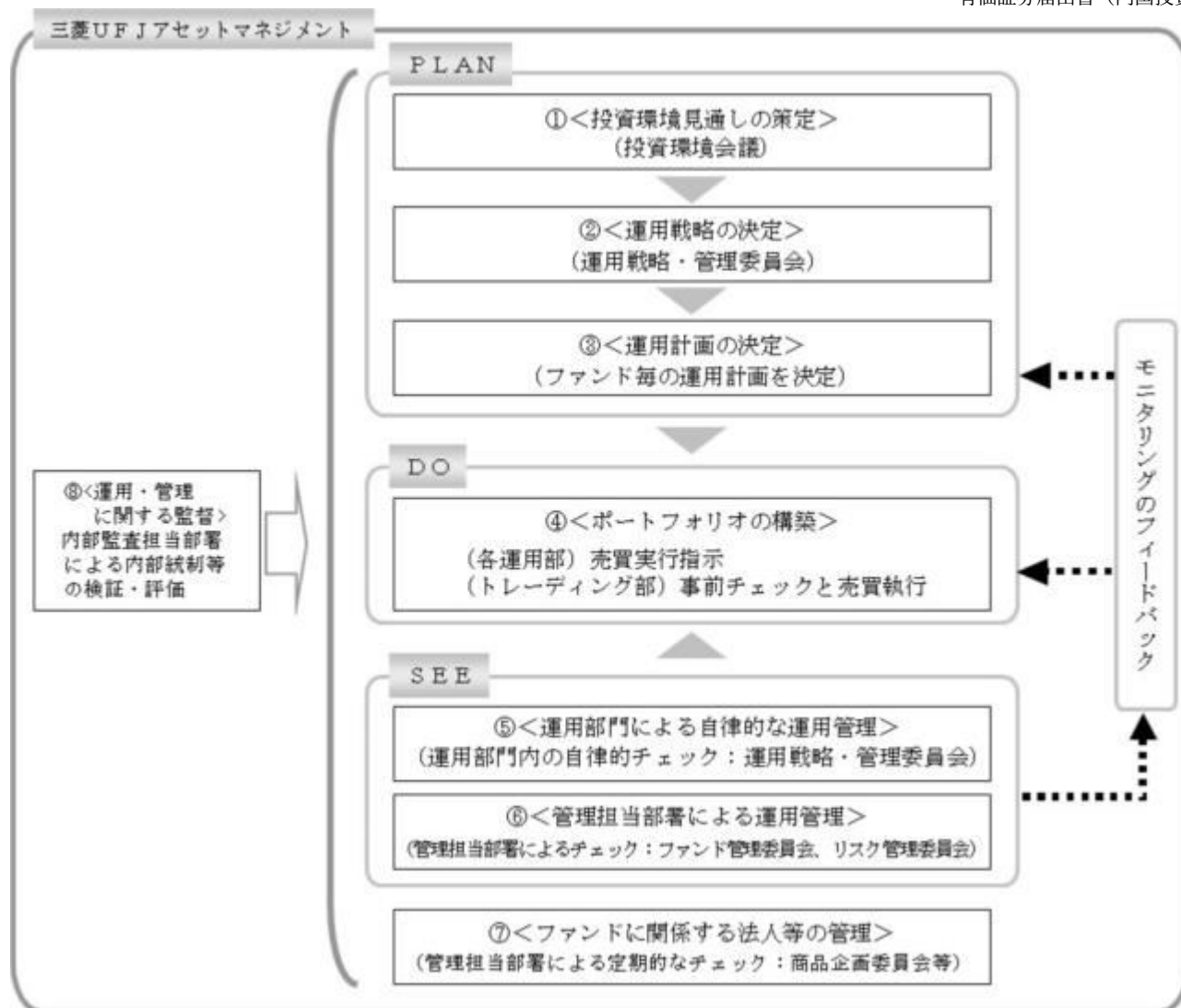
⑥有価証券先物取引等を行うことができます。

⑦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。

⑧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。

⑨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。

（3）【運用体制】



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（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。

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（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

（４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

- ①分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
- ②収益分配金額は、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。
- ③収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

（５）【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

①新株引受権証券および新株予約権証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

②投資信託証券

- a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（上場投資信託証券（金融商品取引所に上場等され、かつ当該取引所において常時売却可能（市場急変等により一時的に流動性が低下している場合を除きます。）な投資信託証券をいいます。）を除きます。以下a. およびb. において同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

③同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する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（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

④スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、原則として、当該取引契約の相手方が提示する価額または価格情報会社の提供する価額によるものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めたときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑤信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
 1. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
 2. 株式分割により取得する株券
 3. 有償増資により取得する株券
 4. 売出しにより取得する株券
 5. 信託財産に属する転換社債の転換請求および新株予約権（③に規定する転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限り、）の行使により取得可能な株券
 6. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債の新株引受権の行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債の新株予約権（5. に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

⑥外国為替予約取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. a. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. b. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額とします。
- d. b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

⑦公社債の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入れの指図をすることができます。なお、当該公社債の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めたときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。

⑧資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。

- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

⑨投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

⑩有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めたときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑪特別の場合の外貨建有価証券への投資制限

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制限されることがあります。

⑫デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

⑬信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

・特定の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、インサイダー取引防止の観点から米国証券取引所法に抵触する場合および、銀行の企業支配防止の観点から委託会社やその親会社に係る BHC（Banking Holding Company）法に抵触する場合においては、投資信託財産をもって特定の法人の発行する株式を取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

（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、原則として為替ヘッジを行いませんので、為替変動の影響を大きく受けます。
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。
ファンドは、中小型株にも投資を行うため、大型株中心に投資する場合に比べ、価格変動・信用・流動性の各リスクが大きくなる可能性があります。	

※留意事項

- ・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。
- ・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性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。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。
- ・ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・ファンドは、MSCI USA インベスタブル・マーケット指数（配当込み、円換算ベース）の動きに連動することをめざして運用を行います。したがって、信託報酬、売買委託手数料等を負担すること、現物株式投資の代替で投資した株価指数先物取引等と当該指数の動きが連動しないこ

と、売買約定価格と当該指数の評価価格の差が生じること、指数構成銘柄と組入銘柄の違いおよびそれらの構成比に違いが生じること、当該指数を構成する銘柄が変更になること、委託会社やその親会社に係る資本規制により、特定の銘柄への投資を行わないことがある等の要因により乖離を生じることがあります。

（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

ファンドの年間騰落率は、2024年9月～2024年10月です。

ベンチマークの年間騰落率は、2019年11月～2024年8月です。

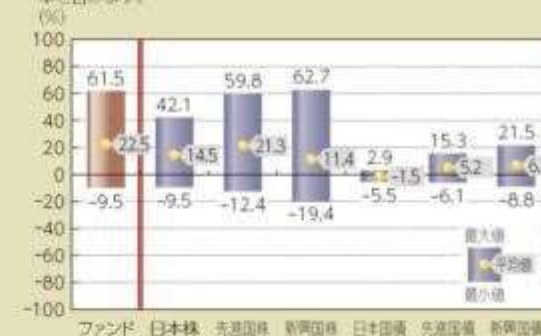
基準価額(分配金再投資)は、2023年9月末～2024年10月末です。



● 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11月末～2024年10月末)

ファンドの年間騰落率はベンチマーク(2024年8月以前)の年間騰落率を含みます。



ファンド 日本株 先進国株 新興国株 日本国債 先進国債 新興国債

(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。

ベンチマークの年間騰落率は参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

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。

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に係る標準又は商標は、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に係る標準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。当該指数の著作権は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】

(1)【申込手数料】

ありません。

※申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

（２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

※換金（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

（３）【信託報酬等】

- ・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0.09372%（税抜0.08520%）以内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。

- ・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。
- ・信託報酬率ならびに各支払先への配分は、以下の通りです。

ファンドの純資産総額 に応じて	信託報酬率 (税込 年率)	配分（税抜 年率）			
		合計	委託会社	販売会社	受託会社
2,500億円未満の部分	0.09372%	0.08520%	0.0336%	0.0336%	0.0180%
2,500億円以上 5,000億円未満の部分	0.09361%	0.08510%	0.0335%	0.0336%	0.0180%
5,000億円以上の部分	0.09350%	0.08500%	0.0334%	0.0336%	0.0180%

※上記各支払先への配分には、別途消費税等相当額がかかります。

※委託会社が特定の販売会社と共同で行う投資信託取引サービスにおいては、上記信託報酬の販売会社への配分については委託会社が受領します。

各支払先が信託報酬の対価として提供する役務の内容は以下の通りです。

支払先	対価として提供する役務の内容
委託会社	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	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	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

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）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一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

※売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等

を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

（５）【課税上の取扱い】

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。

※公募株式投資信託は税法上、一定の要件を満たした場合に「NISA（少額投資非課税制度）」の適用対象となります。ファンドは、NISAの「成長投資枠（特定非課税管理勘定）」の対象です。販売会社により取扱いが異なる場合があります。詳しくは、販売会社にお問い合わせください。

NISAをご利用の場合、一定の額を上限として、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託などから生じる配当所得および譲渡所得が無期限で非課税となります。他の口座で生じた配当所得・譲渡所得との損益通算はできません。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設し、税法上の要件を満たした商品を購入するなど、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは、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。

（＊）確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得の申込みを行う資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合、所得税および地方税がかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

※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10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9月15日～2024年4月25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
0.22%	0.09%	0.13%

（比率は年率、表示桁数未満四捨五入）

※上記の詳細な総経費率は以下の通りです。

0.22581%〔内訳①運用管理費用:0.09330%、②その他費用:0.13251%〕（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】

【eMAXIS Slim 全米株式】

（１）【投資状況】

2024年10月31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	14,644,945,890	99.99
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	734,037	0.01
純資産総額		14,645,679,927	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10月31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	全米株式インデックスマザーファンド	10,709,284,015	1.2216	13,082,461,353	1.3675	14,644,945,890	99.99

（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10月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.99
合計	99.99

（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。

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10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（2024年 4月25日）	10,421,126,303	10,421,126,303	12,050	12,050
2023年10月末日	5,619,570,941	—	9,445	—
11月末日	6,621,548,572	—	10,188	—
12月末日	7,139,517,363	—	10,411	—
2024年 1月末日	8,636,098,285	—	11,101	—
2月末日	9,499,693,163	—	11,672	—
3月末日	9,612,983,650	—	12,170	—
4月末日	10,674,260,454	—	12,264	—
5月末日	11,603,585,834	—	12,529	—
6月末日	12,929,791,252	—	13,420	—
7月末日	13,070,497,445	—	12,688	—
8月末日	12,774,263,797	—	12,366	—
9月末日	13,255,034,717	—	12,513	—
10月末日	14,645,679,927	—	13,660	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
第1計算期間	20.50
第2中間計算期間	12.11

（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	12,585,480,819	3,937,183,167	8,648,297,652
第2中間計算期間	3,933,782,606	1,821,758,099	10,760,322,159

（参考）

全米株式インデックスマザーファンド

投資状況

2024年10月31日現在
（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	アメリカ	14,063,220,749	96.03
投資証券	アメリカ	370,019,900	2.53
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	211,688,041	1.44
純資産総額		14,644,928,690	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10月31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	アメリカ	211,288,800	1.44

（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10月31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 (%)
アメリカ	株式	NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	41,556	21,572.59	896,470,650	21,407.42	889,607,136	6.07
アメリカ	株式	APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	24,569	35,424.77	870,351,292	35,352.56	868,577,145	5.93

アメリカ	株式	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	11,904	65,255.51	776,801,677	66,453.90	791,067,335	5.40
アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	15,834	28,635.42	453,413,291	29,611.03	468,861,163	3.20
アメリカ	株式	META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	3,711	87,233.71	323,724,332	90,924.15	337,419,528	2.30
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	9,895	25,000.30	247,377,976	26,804.03	265,225,920	1.81
アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	8,521	25,278.38	215,397,155	27,062.14	230,596,577	1.57
アメリカ	株式	BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	7,518	26,326.21	197,920,476	27,138.96	204,030,773	1.39
アメリカ	株式	TESLA INC	自動車・自動車部品	4,891	40,020.14	195,738,540	39,569.98	193,536,782	1.32
アメリカ	株式	ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	1,370	136,942.40	187,611,095	130,106.96	178,246,537	1.22
アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	4,857	34,565.92	167,886,709	34,478.35	167,461,358	1.14
アメリカ	株式	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	金融サービス	2,219	70,331.78	156,066,226	69,900.05	155,108,221	1.06
アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	7,627	18,373.80	140,137,031	17,928.25	136,738,775	0.93
アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	1,564	86,162.84	134,758,695	86,493.17	135,275,325	0.92
アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	金融サービス	2,653	43,513.92	115,442,432	44,580.18	118,271,224	0.81
アメリカ	株式	MASTERCARD INC - A	金融サービス	1,373	78,451.65	107,714,124	78,923.33	108,361,734	0.74
アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	一般消費財・サービス流通・小売り	1,700	61,867.75	105,175,184	60,306.77	102,521,514	0.70
アメリカ	株式	COSTCO WHOLESALE CORP	生活必需品流通・小売り	755	137,265.04	103,635,112	135,063.38	101,972,858	0.70
アメリカ	株式	PROCTER & GAMBLE CO/THE	家庭用品・パーソナル用品	3,939	26,060.41	102,651,981	25,528.82	100,558,031	0.69
アメリカ	株式	JOHNSON & JOHNSON	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,986	25,146.25	100,232,988	24,676.12	98,359,016	0.67
アメリカ	株式	ABBVIE INC	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	3,051	29,137.82	88,899,507	30,958.45	94,454,261	0.64
アメリカ	株式	WALMART INC	生活必需品流通・小売り	7,413	12,758.26	94,577,023	12,504.75	92,697,783	0.63
アメリカ	株式	NETFLIX INC	メディア・娯楽	736	115,929.06	85,323,790	115,804.61	85,232,196	0.58
アメリカ	株式	BANK OF AMERICA CORP	銀行	12,101	6,552.74	79,294,779	6,500.50	78,662,652	0.54
アメリカ	株式	SALESFORCE INC	ソフトウェア・サービス	1,683	44,057.80	74,149,288	45,538.89	76,641,962	0.52
アメリカ	株式	ORACLE CORP	ソフトウェア・サービス	2,818	26,791.74	75,499,133	26,819.39	75,577,065	0.52

アメリカ	株式	MERCK & CO. INC.	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	4,345	16,267.40	70,681,867	16,106.08	69,980,923	0.48
アメリカ	株式	COCA-COLA CO/THE	食品・飲料・タバコ	6,798	10,339.97	70,291,130	10,127.94	68,849,796	0.47
アメリカ	株式	CHEVRON CORP	エネルギー	2,982	23,115.13	68,929,342	22,746.40	67,829,771	0.46
アメリカ	株式	ADVANCED MICRO DEVICES	半導体・半導体製造装置	2,811	23,574.52	66,267,980	22,830.90	64,177,671	0.44

（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10月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	エネルギー	3.44
	素材	2.52
	資本財	6.52
	商業・専門サービス	1.62
	運輸	1.36
	自動車・自動車部品	1.67
	耐久消費財・アパレル	0.99
	消費者サービス	2.25
	メディア・娯楽	7.64
	一般消費財・サービス流通・小売り	5.52
	生活必需品流通・小売り	1.79
	食品・飲料・タバコ	2.32
	家庭用品・パーソナル用品	1.18
	ヘルスケア機器・サービス	4.51
	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	6.53
	銀行	3.71
	金融サービス	7.51
	保険	2.21
	ソフトウェア・サービス	11.04
	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	7.83
	電気通信サービス	0.86
	公益事業	2.33
	半導体・半導体製造装置	10.50
	不動産管理・開発	0.19
小計		96.03
投資証券	—	2.53
合計		98.55

（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10月31日現在											
資産の種類	地域	取引所名	資産の名称	建別	数量	通貨	簿価金額	簿価金額（円）	評価金額	評価金額（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	アメリカ	シカゴ商業取引所	SP500MIC2412	買建	47	アメリカドル	1,374,497.35	211,177,772	1,375,220	211,288,800	1.44

（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。

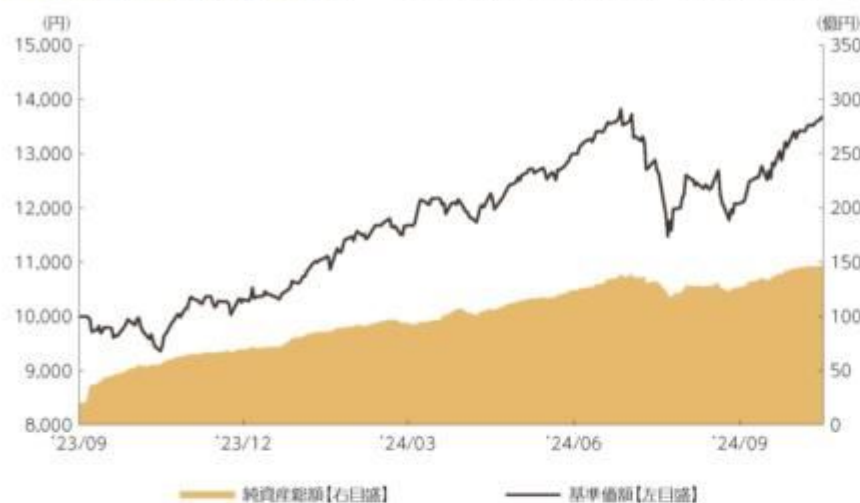
《参考情報》



運用実績

2024年10月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2023年9月15日(設定日)～2024年10月31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	13,660円
純資産総額	146.4億円

・純資産総額は表示桁未満切捨て

■分配の推移

2024年4月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万口当たり、税引前

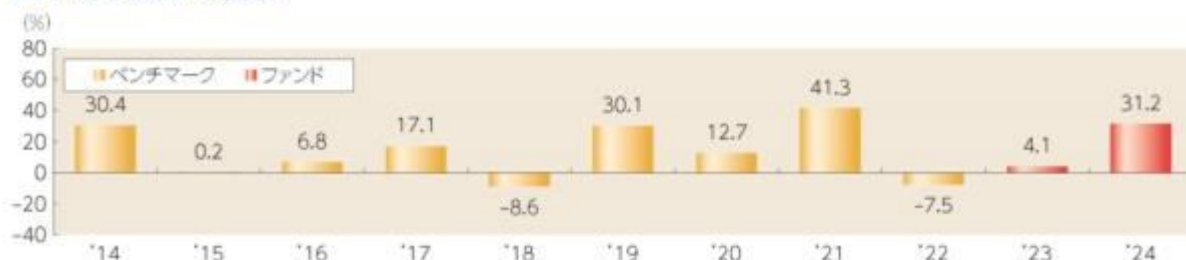
■主要な資産の状況

組入上位銘柄	業種	国・地域	比率
1 NVIDIA CORP	半導体・半導体製造装置	アメリカ	6.1%
2 APPLE INC	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	アメリカ	5.9%
3 MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	アメリカ	5.4%
4 AMAZON.COM INC	一般消費財・サービス流通・小売り	アメリカ	3.2%
5 META PLATFORMS INC-CLASS A	メディア・娯楽	アメリカ	2.3%
6 ALPHABET INC-CL A	メディア・娯楽	アメリカ	1.8%
7 ALPHABET INC-CL C	メディア・娯楽	アメリカ	1.6%
8 BROADCOM INC	半導体・半導体製造装置	アメリカ	1.4%
9 TESLA INC	自動車・自動車部品	アメリカ	1.3%
10 ELI LILLY & CO	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	アメリカ	1.2%

その他資産の状況	比率
株価指数先物取引（買建）	1.4%

- ・各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）
- ・外国株式の業種は、GICS（世界産業分類基準）によるもの。Global Industry Classification Standard（“GICS”）は、MSCI Inc.とS&Pが開発した業種分類です。GICSに関する知的財産所有権はMSCI Inc.およびS&Pに帰属します。
- ・「国・地域」は原則、発行通貨ベースで分類しています。（ただし、発行通貨がユーロの場合は発行地）

■年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額で計算
- ・2023年は設定日から年末までの、2024年は年初から10月31日までの収益率を表示
- ・2022年以前はベンチマークの年間収益率を表示

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。
ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
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。

1【申込（販売）手続等】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

ただし、以下の日は申込みができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②申込単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては、1円以上1円単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いには販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の取得申込みについては上記と異なる取扱いをしている場合があります。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

また、信託金の限度額に達しない場合でも、ファンドの運用規模・運用効率等を勘案し、市況動向や資金流入の動向等に応じて、取得申込みの受付を中止することがあります。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

ただし、以下の日は解約の請求ができません。

ニューヨーク証券取引所の休業日

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

②解約単位

販売会社が定める単位

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については、1口単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額

④信託財産留保額

ありません。

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から販売会社において支払います。

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時30分までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。

確定拠出年金制度を利用する場合の解約請求については上記と異なる取扱いをしている場合があります。

⑨解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

また、市況動向等により、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

（１）【資産の評価】

①基準価額の算出方法

基準価額＝信託財産の純資産総額÷受益権総口数

なお、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

（資産の評価方法）

・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

残存期間1年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJアセットマネジメント株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

eMAXIS専用サイト <https://emaxis.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2023年9月15日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

（４）【計算期間】

毎年４月26日から翌年４月25日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

①ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還）

- ・受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、対象インデックスが改廃されたときまたはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

②信託約款の変更等

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは受託会社を同一とする他ファンドとの併合を行うことができます。委託会社は、変更または併合しようとするときは、あらかじめその旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

③ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還（信託契約に係るすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたとき、また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、書面決議の手続を行うことが困難な場合を除きます。）、信託約款の変更または併合（変更にあつては、その変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合にあつては、その併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下、「重大な約款変更等」といいます。）をしようとする場合には、書面による決議（「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに任意償還等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の２週間前までに、受益者に対し書面をもって書面決議の通知を発します。受益者は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、受益者が議決権を行行使しないときは書面決議について賛成するものとみなします。書面決議は、議決権を行行使することができる受益者の議決権の３分の２以上をもって行います。書面決議の効力は、ファンドのすべての受益者に対してそ

の効力を生じます。

併合に係るいずれかのファンドにおいて、書面決議が否決された場合、併合を行うことはできません。

④反対受益者の受益権買取請求の不適用

委託会社がファンドの任意償還、重大な約款変更等を行う場合、書面決議において反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。この規定は、受益者が自己に帰属する受益権についてその全部または一部の償還を請求したときに、委託会社が信託約款の規定に基づいて信託契約の一部解約をすることにより当該請求に応じることとする場合には適用しません。

⑤関係法人との契約の更改

委託会社と販売会社との間で締結された「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から1年とします。ただし双方から契約満了日の3ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに1年間延長するものとし、その後も同様とします。

⑥運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

⑦委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

⑧受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

⑨信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

⑩公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払いま

す。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から５年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

②分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

（２）償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して５営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から１０年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

（３）換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第２ 管理及び運営 ２ 換金（解約）手続等」を参照してください。

第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「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）ならびに同規則第2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、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 当ファンドの第1計算期間は、約款の規定に従い、2023年9月15日から2024年4月25日までとしております。
- 3 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、当期（2023年9月15日から2024年4月25日まで）の財務諸表について、PwC Japan有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【eMAXIS Slim 全米株式】

（１）【貸借対照表】

(単位：円)

第1期 [2024年 4月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	30,638,576
親投資信託受益証券	10,420,297,321
未収利息	53
流動資産合計	10,450,935,950
資産合計	10,450,935,950
負債の部	
流動負債	
未払解約金	25,389,495
未払受託者報酬	901,085
未払委託者報酬	3,363,959
その他未払費用	155,108
流動負債合計	29,809,647
負債合計	29,809,647
純資産の部	
元本等	
元本	8,648,297,652
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（△）	1,772,828,651
（分配準備積立金）	1,226,455,392
元本等合計	10,421,126,303
純資産合計	10,421,126,303
負債純資産合計	10,450,935,950

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	自 至	第1期 2023年 9月15日 2024年 4月25日
営業収益		
受取利息		2,297
有価証券売買等損益		1,596,845,607
営業収益合計		1,596,847,904
営業費用		
支払利息		2,567
受託者報酬		901,085
委託者報酬		3,363,959
その他費用		155,108
営業費用合計		4,422,719
営業利益又は営業損失（△）		1,592,425,185
経常利益又は経常損失（△）		1,592,425,185
当期純利益又は当期純損失（△）		1,592,425,185
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額（△）		365,969,793
期首剰余金又は期首欠損金（△）		-
剰余金増加額又は欠損金減少額		619,175,748
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		619,175,748
剰余金減少額又は欠損金増加額		72,802,489
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		72,802,489
分配金		-
期末剰余金又は期末欠損金（△）		1,772,828,651

(3) 【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。
--------------------	---

(重要な会計上の見積りに関する注記)

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌計算期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

(貸借対照表に関する注記)

	第1期 [2024年 4月25日現在]
1. 期首元本額	2,000,000,000円
期中追加設定元本額	10,585,480,819円
期中一部解約元本額	3,937,183,167円
2. 受益権の総数	8,648,297,652口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2023年 9月15日 至 2024年 4月25日		
1. 分配金の計算過程		
項目		
費用控除後の配当等収益額	A	67,624,815円
費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額	B	1,158,830,577円
収益調整金額	C	546,373,259円
分配準備積立金額	D	－円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	1,772,828,651円
当ファンドの期末残存口数	F	8,648,297,652口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,049円
1万口当たり分配金額	H	－円
収益分配金金額	I=F*H/10,000	－円

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第1期 自 2023年 9月15日 至 2024年 4月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性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	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、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っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第1期 [2024年 4月25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る場合、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）

売買目的有価証券

種類	第1期 [2024年 4月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額（円）
親投資信託受益証券	1,423,891,201
合計	1,423,891,201

（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。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	第1期 [2024年 4月25日現在]
1口当たり純資産額	1.2050円
(1万口当たり純資産額)	(12,050円)

（4）【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	全米株式インデックスマザーファンド	8,642,529,088	10,420,297,321	
合計		8,642,529,088	10,420,297,321	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

（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。

全米株式インデックスマザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[2024年 4月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
預金	215,967,734
コール・ローン	32,292,617
株式	9,739,807,532

[2024年 4月25日現在]

投資証券	248,518,707
派生商品評価勘定	1,146,307
未収配当金	5,322,209
未収利息	56
差入委託証拠金	185,016,486
流動資産合計	10,428,071,648
資産合計	10,428,071,648
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	7,618,443
流動負債合計	7,618,443
負債合計	7,618,443
純資産の部	
元本等	
元本	8,642,529,088
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	1,777,924,117
元本等合計	10,420,453,205
純資産合計	10,420,453,205
負債純資産合計	10,428,071,648

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。 為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

（重要な会計上の見積りに関する注記）

財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌期間の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクは識別していないため、注記を省略しております。

（貸借対照表に関する注記）

	[2024年 4月25日現在]
1. 期首	2023年 9月15日
期首元本額	1,999,900,000円
期中追加設定元本額	8,048,396,230円
期中一部解約元本額	1,405,767,142円
元本の内訳※	
eMAXIS Slim 全米株式	8,642,529,088円
合計	8,642,529,088円
2. 受益権の総数	8,642,529,088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）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	自 2023年 9月15日 至 2024年 4月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。

区分	自 2023年 9月15日 至 2024年 4月25日
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、投資証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク、為替リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、運用の効率化を図るために、株価指数先物取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、価格変動リスク等の市場リスクおよび信用リスク等を有しております。 当ファンドは、外貨の決済のために為替予約取引を利用しております。当該デリバティブ取引は、為替相場の変動による市場リスクおよび信用リスク等を有しておりますが、ごく短期間で実際に外貨の受渡を伴うことから、為替相場の変動によるリスクは限定的であります。 また、デリバティブ取引の時価等に関する事項についての契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。
3.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに依じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、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っており、この結果はリスク管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[2024年 4月25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）

売買目的有価証券

種類	[2024年 4月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	1,263,128,974
投資証券	14,840,273
合計	1,277,969,247

(注)当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（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 4月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	475,286,071	—	468,677,990	△6,608,081
合計		475,286,071	—	468,677,990	△6,608,081

（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。

通貨関連

[2024年 4月25日現在]

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引 買建				
	アメリカドル	62,510,240	—	62,646,185	135,945
合計		62,510,240	—	62,646,185	135,945

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- ①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
- ②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- （イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
- （ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

※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。

（関連当事者との取引に関する注記）
該当事項はありません。

（1口当たり情報）

	[2024年 4月25日現在]
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2057円 (12,057円)

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1)株式

(単位：円)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
アメリカドル	ANTERO MIDSTREAM CORP	590	14.02	8,271.80	
	ANTERO RESOURCES CORP	821	31.44	25,812.24	
	APA CORP	431	32.05	13,813.55	
	BAKER HUGHES CO	1,102	32.67	36,002.34	
	CACTUS INC - A	252	52.32	13,184.64	
	CHAMPIONX CORP	110	34.65	3,811.50	
	CHENIERE ENERGY INC	359	157.42	56,513.78	
	CHESAPEAKE ENERGY CORP	203	90.69	18,410.07	
	CHEVRON CORP	2,295	163.57	375,393.15	
	CHORD ENERGY CORP	20	183.59	3,671.80	
	CIVITAS RESOURCES INC	68	73.56	5,002.08	
	CNX RESOURCES CORP	564	24.21	13,654.44	

COMSTOCK RESOURCES INC	327	10.15	3,319.05
CONOCOPHILLIPS	1,658	129.28	214,346.24
CONSOL ENERGY INC	44	83.43	3,670.92
COTERRA ENERGY INC	998	28.46	28,403.08
DEVON ENERGY CORP	1,146	52.10	59,706.60
DIAMONDBACK ENERGY INC	302	205.24	61,982.48
DT MIDSTREAM INC	215	64.17	13,796.55
ENLINK MIDSTREAM LLC	484	13.78	6,669.52
EOG RESOURCES INC	684	135.60	92,750.40
EQT CORP	654	39.43	25,787.22
EQUITRANS MIDSTREAM CORP	581	13.44	7,808.64
EXXON MOBIL CORP	5,302	121.05	641,807.10
HALLIBURTON CO	1,520	38.72	58,854.40
HELMERICH & PAYNE	72	42.43	3,054.96
HESS CORP	341	159.13	54,263.33
HF SINCLAIR CORP	293	57.43	16,826.99
KINDER MORGAN INC	2,219	18.81	41,739.39
KOSMOS ENERGY LTD	764	5.95	4,545.80
LIBERTY ENERGY INC	543	22.76	12,358.68
MAGNOLIA OIL & GAS CORP - A	354	26.11	9,242.94
MARATHON OIL CORP	511	27.53	14,067.83
MARATHON PETROLEUM CORP	572	199.14	113,908.08
MATADOR RESOURCES CO	134	65.29	8,748.86
MURPHY OIL CORP	92	46.22	4,252.24
NABORS INDUSTRIES LTD	50	80.13	4,006.50
NOBLE CORP PLC	62	46.05	2,855.10
NORTHERN OIL AND GAS INC	152	42.97	6,531.44
NOV INC	425	18.83	8,002.75
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,001	67.33	67,397.33
ONEOK INC	883	80.95	71,478.85
OVINTIV INC	207	52.90	10,950.30
PATTERSON-UTI ENERGY INC	223	11.53	2,571.19
PBF ENERGY INC-CLASS A	61	57.18	3,487.98
PEABODY ENERGY CORP	160	23.46	3,753.60
PERMIAN RESOURCES CORP	901	17.26	15,551.26
PHILLIPS 66	563	157.79	88,835.77
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	303	275.52	83,482.56
RANGE RESOURCES CORP	707	37.77	26,703.39
SCHLUMBERGER LTD	1,792	49.11	88,005.12
SM ENERGY CO	98	50.01	4,900.98
SOUTHWESTERN ENERGY CO	520	7.59	3,946.80
TARGA RESOURCES CORP	320	116.90	37,408.00

TECHNIPFMC PLC	408	25.72	10,493.76
TEXAS PACIFIC LAND CORP	24	589.01	14,136.24
TRANSOCEAN LTD	444	5.78	2,566.32
VALARIS LTD	90	67.47	6,072.30
VALERO ENERGY CORP	408	167.00	68,136.00
WEATHERFORD INTERNATIONAL PL	38	125.01	4,750.38
WILLIAMS COS INC	1,740	39.25	68,295.00
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	274	234.68	64,302.32
ALBEMARLE CORP	152	115.27	17,521.04
ALCOA CORP	482	36.08	17,390.56
ALPHA METALLURGICAL RESOURCE	16	324.31	5,188.96
AMCOR PLC	1,128	9.06	10,219.68
APTARGROUP INC	28	140.01	3,920.28
ARCADIUM LITHIUM PLC	707	3.87	2,736.09
ASHLAND INC	75	96.03	7,202.25
ATI INC	76	49.22	3,740.72
AVERY DENNISON CORP	52	212.42	11,045.84
AVIENT CORP	318	43.26	13,756.68
AXALTA COATING SYSTEMS LTD	126	31.11	3,919.86
BALCHEM CORP	26	140.64	3,656.64
BALL CORP	398	65.19	25,945.62
BERRY GLOBAL GROUP INC	57	56.91	3,243.87
CABOT CORP	81	93.40	7,565.40
CARPENTER TECHNOLOGY	90	80.40	7,236.00
CELANESE CORP	233	155.43	36,215.19
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	362	79.25	28,688.50
CHEMOURS CO/THE	96	27.08	2,599.68
CLEVELAND-CLIFFS INC	900	18.32	16,488.00
COMMERCIAL METALS CO	58	53.70	3,114.60
CORTEVA INC	1,161	54.77	63,587.97
CROWN HOLDINGS INC	114	78.83	8,986.62
DOW INC	757	56.98	43,133.86
DUPONT DE NEMOURS INC	472	73.96	34,909.12
EAGLE MATERIALS INC	79	253.13	19,997.27
EASTMAN CHEMICAL CO	267	96.36	25,728.12
ECOLAB INC	307	220.78	67,779.46
ELEMENT SOLUTIONS INC	355	23.82	8,456.10
FMC CORP	264	58.40	15,417.60
FREEPORT-MCMORAN INC	2,019	48.24	97,396.56
GRAPHIC PACKAGING HOLDING CO	745	27.41	20,420.45
GREIF INC-CL A	50	62.35	3,117.50
H.B. FULLER CO.	78	75.06	5,854.68

HECLA MINING CO	2,970	5.24	15,562.80
HUNTSMAN CORP	118	23.99	2,830.82
INGEVITY CORP	116	48.23	5,594.68
INNOSPEC INC	42	122.04	5,125.68
INTERNATIONAL PAPER CO	483	34.43	16,629.69
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	341	85.14	29,032.74
LINDE PLC	642	444.32	285,253.44
LOUISIANA-PACIFIC CORP	86	75.19	6,466.34
LYONDELLBASELL INDU-CL A	374	100.78	37,691.72
MARTIN MARIETTA MATERIALS	101	591.82	59,773.82
MATERION CORP	59	118.46	6,989.14
MOSAIC CO/THE	292	30.49	8,903.08
NEWMONT CORP	1,352	38.60	52,187.20
NUCOR CORP	371	172.76	64,093.96
OLIN CORP	65	53.07	3,449.55
PACKAGING CORP OF AMERICA	177	173.92	30,783.84
PPG INDUSTRIES INC	250	130.52	32,630.00
QUAKER CHEMICAL CORPORATION	41	189.92	7,786.72
RELIANCE INC	80	313.56	25,084.80
ROYAL GOLD INC	38	120.93	4,595.34
RPM INTERNATIONAL INC	265	107.93	28,601.45
SEALED AIR CORP	92	31.72	2,918.24
SENSIENT TECHNOLOGIES CORP	207	70.03	14,496.21
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	316	303.73	95,978.68
SILGAN HOLDINGS INC	158	47.32	7,476.56
SONOCO PRODUCTS CO	109	56.61	6,170.49
STEEL DYNAMICS INC	208	129.92	27,023.36
STEPAN CO	45	84.89	3,820.05
SUMMIT MATERIALS INC -CL A	102	38.93	3,970.86
SUNCOKE ENERGY INC	388	10.38	4,027.44
TRIMAS CORP	668	26.28	17,555.04
TRONOX HOLDINGS PLC	327	17.61	5,758.47
UNITED STATES STEEL CORP	366	36.60	13,395.60
VULCAN MATERIALS CO	159	256.40	40,767.60
WESTLAKE CORP	52	149.90	7,794.80
WESTROCK CO	440	47.48	20,891.20
3M CO	845	92.02	77,756.90
AAON INC	98	89.67	8,787.66
AAR CORP	117	67.93	7,947.81
ACUITY BRANDS INC	39	253.09	9,870.51
ADVANCED DRAINAGE SYSTEMS IN	151	160.32	24,208.32
AECOM	199	94.01	18,707.99

AGCO CORP	30	118.69	3,560.70
AIR LEASE CORP	402	51.40	20,662.80
ALAMO GROUP INC	18	204.20	3,675.60
ALBANY INTL CORP-CL A	71	88.08	6,253.68
ALLEGION PLC	136	126.54	17,209.44
ALLISON TRANSMISSION HOLDING	50	80.03	4,001.50
AMETEK INC	243	178.22	43,307.46
API GROUP CORP	119	37.51	4,463.69
APPLIED INDUSTRIAL TECH INC	22	186.09	4,093.98
ARCOSA INC	133	76.86	10,222.38
ARMSTRONG WORLD INDUSTRIES	129	115.96	14,958.84
ARRAY TECHNOLOGIES INC	196	12.23	2,397.08
ATKORE INC	22	179.11	3,940.42
AXON ENTERPRISE INC	94	302.41	28,426.54
AZEK CO INC/THE	95	45.40	4,313.00
AZZ INC	72	82.43	5,934.96
BEACON ROOFING SUPPLY INC	129	97.21	12,540.09
BOEING CO/THE	815	164.33	133,928.95
BOISE CASCADE CO	57	137.22	7,821.54
BUILDERS FIRSTSOURCE INC	177	186.69	33,044.13
BWX TECHNOLOGIES INC	232	94.15	21,842.80
CARLISLE COS INC	80	375.30	30,024.00
CARRIER GLOBAL CORP	1,063	54.77	58,220.51
CATERPILLAR INC	698	363.52	253,736.96
CHARGEPOINT HOLDINGS INC	1,524	1.29	1,965.96
CHART INDUSTRIES INC	23	152.95	3,517.85
CNH INDUSTRIAL NV	1,348	11.40	15,367.20
COLUMBUS MCKINNON CORP/NY	220	41.76	9,187.20
COMFORT SYSTEMS USA INC	69	308.69	21,299.61
CORE & MAIN INC-CLASS A	308	56.16	17,297.28
CRANE CO	65	142.13	9,238.45
CSW INDUSTRIALS INC	17	238.05	4,046.85
CUMMINS INC	174	292.34	50,867.16
CURTISS-WRIGHT CORP	19	252.64	4,800.16
DEERE & CO	366	394.62	144,430.92
DONALDSON CO INC	120	72.48	8,697.60
DOVER CORP	169	171.44	28,973.36
EATON CORP PLC	565	318.79	180,116.35
EMCOR GROUP INC	40	338.89	13,555.60
EMERSON ELECTRIC CO	711	109.62	77,939.82
ENERSYS	74	90.38	6,688.12
ENPRO INC	80	151.03	12,082.40

ESAB CORP	45	107.45	4,835.25
ESCO TECHNOLOGIES INC	38	104.28	3,962.64
FASTENAL CO	628	67.74	42,540.72
FEDERAL SIGNAL CORP	57	83.33	4,749.81
FERGUSON PLC	253	209.19	52,925.07
FLOWSERVE CORP	79	46.73	3,691.67
FLUOR CORP	157	40.30	6,327.10
FORTIVE CORP	419	76.05	31,864.95
FORTUNE BRANDS INNOVATIONS I	127	73.53	9,338.31
FRANKLIN ELECTRIC CO INC	153	102.85	15,736.05
FTAI AVIATION LTD	159	73.45	11,678.55
GATX CORP	56	125.83	7,046.48
GE VERNOVA INC	317	146.18	46,339.06
GENERAC HOLDINGS INC	34	137.18	4,664.12
GENERAL DYNAMICS CORP	269	281.11	75,618.59
GENERAL ELECTRIC CO	1,388	159.19	220,955.72
GIBRALTAR INDUSTRIES INC	77	71.71	5,521.67
GMS INC	144	91.32	13,150.08
GRACO INC	119	89.35	10,632.65
GREENBRIER COMPANIES INC	83	53.49	4,439.67
GRIFFON CORP	107	67.81	7,255.67
HEICO CORP-CLASS A	226	165.07	37,305.82
HELIOS TECHNOLOGIES INC	88	45.76	4,026.88
HERC HOLDINGS INC	24	153.76	3,690.24
HEXCEL CORP	345	63.24	21,817.80
HILLENBRAND INC	274	48.95	13,412.30
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	876	194.79	170,636.04
HOWMET AEROSPACE INC	493	64.70	31,897.10
HUBBELL INC	75	398.55	29,891.25
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	72	275.84	19,860.48
IDEX CORP	100	224.64	22,464.00
ILLINOIS TOOL WORKS	345	251.76	86,857.20
INGERSOLL-RAND INC	471	92.50	43,567.50
ITT INC	140	130.48	18,267.20
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	726	64.61	46,906.86
KADANT INC	14	285.89	4,002.46
KENNAMETAL INC	289	24.49	7,077.61
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	264	207.71	54,835.44
LENNOX INTERNATIONAL INC	28	467.85	13,099.80
LEONARDO DRS INC	167	21.51	3,592.17
LINCOLN ELECTRIC HOLDINGS	48	237.61	11,405.28
LINDSAY CORP	24	116.37	2,792.88

LOCKHEED MARTIN CORP	258	459.14	118,458.12
MASCO CORP	174	69.74	12,134.76
MASONITE INTERNATIONAL CORP	52	131.60	6,843.20
MASTEC INC	36	85.18	3,066.48
MDU RESOURCES GROUP INC	208	24.69	5,135.52
MIDDLEBY CORP	156	144.69	22,571.64
MOOG INC-CLASS A	67	158.38	10,611.46
MSC INDUSTRIAL DIRECT CO-A	43	93.42	4,017.06
MUELLER INDUSTRIES INC	128	57.96	7,418.88
MUELLER WATER PRODUCTS INC-A	255	16.28	4,151.40
NEXTRACKER INC-CL A	78	43.91	3,424.98
NORDSON CORP	41	260.06	10,662.46
NORTHROP GRUMMAN CORP	161	474.57	76,405.77
NVENT ELECTRIC PLC	160	73.72	11,795.20
OSHKOSH CORP	167	121.25	20,248.75
OTIS WORLDWIDE CORP	402	93.37	37,534.74
OWENS CORNING	71	165.22	11,730.62
PACCAR INC	703	113.74	79,959.22
PARKER HANNIFIN CORP	189	546.35	103,260.15
PENTAIR PLC	138	78.99	10,900.62
PLUG POWER INC	415	2.41	1,000.15
POWELL INDUSTRIES INC	40	149.23	5,969.20
PRIMORIS SERVICES CORP	135	45.01	6,076.35
QUANTA SERVICES INC	178	253.18	45,066.04
RBC BEARINGS INC	82	244.89	20,080.98
REGAL REXNORD CORP	113	164.23	18,557.99
ROCKET LAB USA INC	920	3.69	3,394.80
ROCKWELL AUTOMATION INC	196	275.56	54,009.76
RTX CORP	1,963	101.02	198,302.26
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	559	34.42	19,240.78
SHOALS TECHNOLOGIES GROUP -A	205	8.49	1,740.45
SIMPSON MANUFACTURING CO INC	56	169.62	9,498.72
SITEONE LANDSCAPE SUPPLY INC	52	163.76	8,515.52
SMITH (A.O.) CORP	193	87.00	16,791.00
SNAP-ON INC	42	273.59	11,490.78
SPX TECHNOLOGIES INC	40	119.88	4,795.20
STANDEX INTERNATIONAL CORP	22	171.37	3,770.14
STANLEY BLACK & DECKER INC	224	90.27	20,220.48
STERLING INFRASTRUCTURE INC	157	100.97	15,852.29
TENNANT CO	40	117.31	4,692.40
TEREX CORP	121	60.64	7,337.44
TEXTRON INC	266	94.01	25,006.66

TIMKEN CO	45	86.02	3,870.90
TORO CO	202	87.20	17,614.40
TRANE TECHNOLOGIES PLC	286	296.49	84,796.14
TRANSDIGM GROUP INC	79	1,241.62	98,087.98
TREX COMPANY INC	192	89.20	17,126.40
UFP INDUSTRIES INC	223	113.68	25,350.64
UNITED RENTALS INC	99	655.19	64,863.81
VALMONT INDUSTRIES	30	212.63	6,378.90
VERTIV HOLDINGS CO-A	547	84.57	46,259.79
WABTEC CORP	251	163.38	41,008.38
WATSCO INC	63	440.60	27,757.80
WATTS WATER TECHNOLOGIES-A	17	205.76	3,497.92
WESCO INTERNATIONAL INC	111	159.59	17,714.49
WILLSCOT MOBILE MINI HOLDING	373	38.19	14,244.87
WOODWARD INC	59	149.61	8,826.99
WW GRAINGER INC	52	958.32	49,832.64
XOMETRY INC-A	182	16.89	3,073.98
XYLEM INC	395	130.67	51,614.65
ZURN ELKAY WATER SOLUTIONS C	205	32.12	6,584.60
ASGN INC	38	102.11	3,880.18
AUTOMATIC DATA PROCESSING	561	246.61	138,348.21
BOOZ ALLEN HAMILTON HOLDINGS	180	144.39	25,990.20
BRINK'S CO/THE	74	89.13	6,595.62
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIO	125	195.08	24,385.00
CACI INTERNATIONAL INC -CL A	11	379.38	4,173.18
CASELLA WASTE SYSTEMS INC-A	272	94.99	25,837.28
CBIZ INC	144	78.33	11,279.52
CINTAS CORP	136	664.13	90,321.68
CLEAN HARBORS INC	48	196.00	9,408.00
CONCENTRIX CORP	80	56.73	4,538.40
COPART INC	1,345	54.93	73,880.85
CRA INTERNATIONAL INC	30	148.29	4,448.70
CSG SYSTEMS INTL INC	151	49.83	7,524.33
DAYFORCE INC	134	59.70	7,999.80
DRIVEN BRANDS HOLDINGS INC	620	14.25	8,835.00
DUN & BRADSTREET HOLDINGS IN	724	9.35	6,769.40
EQUIFAX INC	198	225.71	44,690.58
EXLSERVICE HOLDINGS INC	103	29.57	3,045.71
EXPONENT INC	67	80.60	5,400.20
FTI CONSULTING INC	18	213.74	3,847.32
ICF INTERNATIONAL INC	93	141.98	13,204.14
INSPERITY INC	54	109.52	5,914.08

JACOBS SOLUTIONS INC	161	143.98	23,180.78	
KBR INC	385	64.38	24,786.30	
LEIDOS HOLDINGS INC	221	128.90	28,486.90	
MANPOWERGROUP INC	74	77.10	5,705.40	
MATTHEWS INTL CORP-CLASS A	88	26.92	2,368.96	
MAXIMUS INC	41	80.82	3,313.62	
MSA SAFETY INC	23	190.72	4,386.56	
OPENLANE INC	327	17.50	5,722.50	
PAYCHEX INC	392	122.52	48,027.84	
PAYCOM SOFTWARE INC	152	187.91	28,562.32	
PAYLOCITY HOLDING CORP	93	156.16	14,522.88	
REPUBLIC SERVICES INC	232	191.99	44,541.68	
ROBERT HALF INC	51	71.50	3,646.50	
ROLLINS INC	440	42.87	18,862.80	
SCIENCE APPLICATIONS INTE	58	128.47	7,451.26	
SP PLUS CORP	95	51.10	4,854.50	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	179	61.54	11,015.66	
STERICYCLE INC	64	49.87	3,191.68	
TETRA TECH INC	117	189.29	22,146.93	
TRANSUNION	305	68.68	20,947.40	
TRINET GROUP INC	39	127.60	4,976.40	
UNIFIRST CORP/MA	22	165.30	3,636.60	
VERALTO CORP	308	92.40	28,459.20	
VERISK ANALYTICS INC	155	222.25	34,448.75	
VESTIS CORP	60	18.70	1,122.00	
WASTE CONNECTIONS INC	324	166.18	53,842.32	
WASTE MANAGEMENT INC	469	210.43	98,691.67	
ALASKA AIR GROUP INC	89	44.23	3,936.47	
AMERICAN AIRLINES GROUP INC	282	13.92	3,925.44	
AVIS BUDGET GROUP INC	25	103.30	2,582.50	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	129	70.94	9,151.26	
CSX CORP	2,709	33.67	91,212.03	
DELTA AIR LINES INC	102	47.94	4,889.88	
EXPEDITORS INTL WASH INC	145	112.87	16,366.15	
FEDEX CORP	287	266.07	76,362.09	
GXO LOGISTICS INC	407	49.10	19,983.70	
HUB GROUP INC-CL A	268	39.99	10,717.32	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	122	164.63	20,084.86	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	305	48.51	14,795.55	
LANDSTAR SYSTEM INC	20	171.10	3,422.00	
LYFT INC-A	476	16.34	7,777.84	
NORFOLK SOUTHERN CORP	282	236.22	66,614.04	

OLD DOMINION FREIGHT LINE	222	195.06	43,303.32	
RYDER SYSTEM INC	54	122.19	6,598.26	
SAIA INC	22	527.83	11,612.26	
SOUTHWEST AIRLINES CO	106	29.30	3,105.80	
U-HAUL HOLDING CO-NON VOTING	63	63.63	4,008.69	
UBER TECHNOLOGIES INC	2,571	69.36	178,324.56	
UNION PACIFIC CORP	811	231.98	188,135.78	
UNITED PARCEL SERVICE-CL B	944	146.62	138,409.28	
WERNER ENTERPRISES INC	308	35.39	10,900.12	
XPO INC	177	117.48	20,793.96	
ADIANT PLC	76	29.69	2,256.44	
APTIV PLC	408	71.40	29,131.20	
AUTOLIV INC	171	117.94	20,167.74	
BORGWARNER INC	205	33.65	6,898.25	
FORD MOTOR CO	6,070	12.95	78,606.50	
FOX FACTORY HOLDING CORP	29	39.88	1,156.52	
GENERAL MOTORS CO	1,715	45.08	77,312.20	
GENTEX CORP	458	35.16	16,103.28	
HARLEY-DAVIDSON INC	89	39.44	3,510.16	
LCI INDUSTRIES	52	109.42	5,689.84	
LEAR CORP	53	135.17	7,164.01	
LUCID GROUP INC	607	2.55	1,547.85	
RIVIAN AUTOMOTIVE INC-A	1,039	8.84	9,184.76	
TESLA INC	3,834	162.13	621,606.42	
THOR INDUSTRIES INC	31	103.66	3,213.46	
VISTEON CORP	43	111.14	4,779.02	
BRUNSWICK CORP	281	86.13	24,202.53	
CAPRI HOLDINGS LTD	75	35.40	2,655.00	
CENTURY COMMUNITIES INC	78	82.14	6,406.92	
COLUMBIA SPORTSWEAR CO	61	79.78	4,866.58	
CROCS INC	35	125.77	4,401.95	
DECKERS OUTDOOR CORP	36	851.71	30,661.56	
DR HORTON INC	372	146.12	54,356.64	
GARMIN LTD	228	142.79	32,556.12	
HANESBRANDS INC	673	4.86	3,270.78	
HASBRO INC	260	65.03	16,907.80	
INSTALLED BUILDING PRODUCTS	78	235.25	18,349.50	
IROBOT CORP	95	6.84	649.80	
KB HOME	218	64.79	14,124.22	
LA-Z-BOY INC	106	34.04	3,608.24	
LEGGETT & PLATT INC	331	18.20	6,024.20	
LENNAR CORP-A	369	154.12	56,870.28	

LULULEMON ATHLETICA INC	143	364.59	52,136.37
MATTEL INC	172	19.18	3,298.96
MERITAGE HOMES CORP	59	154.69	9,126.71
MOHAWK INDUSTRIES INC	209	111.40	23,282.60
NEWELL BRANDS INC	312	7.04	2,196.48
NIKE INC -CL B	1,670	94.64	158,048.80
NVR INC	4	7,798.28	31,193.12
OXFORD INDUSTRIES INC	39	107.25	4,182.75
POLARIS INC	233	85.21	19,853.93
PULTEGROUP INC	303	112.26	34,014.78
PVH CORP	40	112.87	4,514.80
RALPH LAUREN CORP	50	168.21	8,410.50
SKECHERS USA INC-CL A	74	59.15	4,377.10
SKYLINE CHAMPION CORP	79	75.49	5,963.71
TAPESTRY INC	590	40.03	23,617.70
TAYLOR MORRISON HOME CORP	72	56.35	4,057.20
TEMPUR SEALY INTERNATIONAL I	312	50.52	15,762.24
TOLL BROTHERS INC	114	118.70	13,531.80
TOPBUILD CORP	31	388.27	12,036.37
TOPGOLF CALLAWAY BRANDS CORP	497	16.18	8,041.46
TRI POINTE HOMES INC	109	36.17	3,942.53
VF CORP	212	12.99	2,753.88
WHIRLPOOL CORP	62	105.68	6,552.16
YETI HOLDINGS INC	63	35.67	2,247.21
ADT INC	718	6.38	4,580.84
AIRBNB INC-CLASS A	580	162.84	94,447.20
ARAMARK	121	32.55	3,938.55
BOOKING HOLDINGS INC	48	3,517.52	168,840.96
BOYD GAMING CORP	116	63.59	7,376.44
BRIGHT HORIZONS FAMILY SOLUT	65	106.83	6,943.95
CAESARS ENTERTAINMENT INC	707	38.48	27,205.36
CARNIVAL CORP	1,400	15.01	21,014.00
CHIPOTLE MEXICAN GRILL INC	36	2,926.76	105,363.36
CHOICE HOTELS INTL INC	50	119.06	5,953.00
CHURCHILL DOWNS INC	167	123.39	20,606.13
DARDEN RESTAURANTS INC	181	156.61	28,346.41
DOMINO'S PIZZA INC	28	487.71	13,655.88
DOORDASH INC - A	302	126.76	38,281.52
DRAFTKINGS INC-CL A	653	40.85	26,675.05
DUOLINGO	34	216.38	7,356.92
EXPEDIA GROUP INC	184	135.80	24,987.20
GRAND CANYON EDUCATION INC	29	128.88	3,737.52

H&R BLOCK INC	75	47.93	3,594.75
HILTON GRAND VACATIONS INC	74	44.79	3,314.46
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	351	204.70	71,849.70
HYATT HOTELS CORP - CL A	70	151.83	10,628.10
LAS VEGAS SANDS CORP	493	45.84	22,599.12
LIGHT & WONDER INC	200	93.55	18,710.00
MARRIOTT INTERNATIONAL -CL A	345	244.06	84,200.70
MARRIOTT VACATIONS WORLD	32	103.17	3,301.44
MCDONALD'S CORP	901	276.75	249,351.75
MGM RESORTS INTERNATIONAL	245	42.71	10,463.95
NORWEGIAN CRUISE LINE HOLDIN	253	19.39	4,905.67
PENN ENTERTAINMENT INC	141	17.84	2,515.44
PERDOCEO EDUCATION CORP	194	18.42	3,573.48
PLANET FITNESS INC - CL A	56	61.09	3,421.04
RED ROCK RESORTS INC-CLASS A	167	59.85	9,994.95
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	274	136.73	37,464.02
SERVICE CORP INTERNATIONAL	264	71.50	18,876.00
SHAKE SHACK INC - CLASS A	152	99.54	15,130.08
STARBUCKS CORP	1,580	88.75	140,225.00
TEXAS ROADHOUSE INC	185	156.76	29,000.60
TRAVEL + LEISURE CO	203	46.24	9,386.72
VAIL RESORTS INC	63	201.38	12,686.94
WENDY'S CO/THE	213	19.82	4,221.66
WINGSTOP INC	17	362.74	6,166.58
WYNDHAM HOTELS & RESORTS INC	46	71.96	3,310.16
WYNN RESORTS LTD	173	97.06	16,791.38
YUM! BRANDS INC	316	141.81	44,811.96
ALPHABET INC-CL A	8,140	159.13	1,295,318.20
ALPHABET INC-CL C	6,498	161.10	1,046,827.80
ATLANTA BRAVES HOLDINGS IN-C	92	38.03	3,498.76
CABLE ONE INC	10	402.98	4,029.80
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	130	264.70	34,411.00
COMCAST CORP-CLASS A	5,139	40.21	206,639.19
ELECTRONIC ARTS INC	260	128.14	33,316.40
ENDEAVOR GROUP HOLD-CLASS A	388	26.44	10,258.72
FOX CORP - CLASS A	180	31.71	5,707.80
FOX CORP - CLASS B	181	29.31	5,305.11
IAC INC	55	49.17	2,704.35
INTERPUBLIC GROUP OF COS INC	304	31.40	9,545.60
LIBERTY BROADBAND-C	107	50.01	5,351.07
LIBERTY MEDIA CORP-LIB-NEW-C	338	69.15	23,372.70
LIBERTY MEDIA CORP-LIBER-NEW	298	25.20	7,509.60

LIVE NATION ENTERTAINMENT IN	142	89.65	12,730.30
MADISON SQUARE GARDEN SPORTS	65	186.15	12,099.75
MATCH GROUP INC	253	31.94	8,080.82
META PLATFORMS INC-CLASS A	2,939	493.50	1,450,396.50
NETFLIX INC	590	555.12	327,520.80
NEW YORK TIMES CO-A	77	43.30	3,334.10
NEWS CORP - CLASS A	816	24.56	20,040.96
NEXSTAR MEDIA GROUP INC	24	164.11	3,938.64
OMNICOM GROUP	250	95.98	23,995.00
PARAMOUNT GLOBAL-CLASS B	1,463	12.68	18,550.84
PINTEREST INC- CLASS A	755	32.85	24,801.75
ROBLOX CORP -CLASS A	478	34.97	16,715.66
ROKU INC	218	61.83	13,478.94
SIRIUS XM HOLDINGS INC	1,400	3.16	4,424.00
SNAP INC - A	1,388	11.08	15,379.04
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	307	142.83	43,848.81
TRADE DESK INC/THE -CLASS A	494	83.79	41,392.26
WALT DISNEY CO/THE	2,506	113.92	285,483.52
WARNER BROS DISCOVERY INC	4,943	8.38	41,422.34
YELP INC	134	40.39	5,412.26
ZIFF DAVIS INC	96	52.24	5,015.04
ZOOMINFO TECHNOLOGIES INC	188	15.89	2,987.32
ACADEMY SPORTS & OUTDOORS IN	116	59.06	6,850.96
ADVANCE AUTO PARTS INC	53	76.53	4,056.09
AMAZON.COM INC	12,285	176.59	2,169,408.15
AMERICAN EAGLE OUTFITTERS	617	22.63	13,962.71
ASBURY AUTOMOTIVE GROUP	25	221.54	5,538.50
AUTONATION INC	20	159.52	3,190.40
AUTOZONE INC	19	2,988.51	56,781.69
BATH & BODY WORKS INC	359	45.60	16,370.40
BEST BUY CO INC	381	74.43	28,357.83
BEYOND INC	188	22.35	4,201.80
BURLINGTON STORES INC	108	178.74	19,303.92
CARMAX INC	278	70.27	19,535.06
CARVANA CO	88	75.35	6,630.80
DICK'S SPORTING GOODS INC	121	205.48	24,863.08
EBAY INC	540	51.18	27,637.20
ETSY INC	225	66.87	15,045.75
FIVE BELOW	58	148.54	8,615.32
FLOOR & DECOR HOLDINGS INC-A	105	109.66	11,514.30
FOOT LOCKER INC	263	22.87	6,014.81
GAMESTOP CORP-CLASS A	306	10.93	3,344.58

GAP INC/THE	537	20.11	10,799.07
GENUINE PARTS CO	193	161.80	31,227.40
GROUP 1 AUTOMOTIVE INC	12	299.71	3,596.52
HOME DEPOT INC	1,326	333.01	441,571.26
LESLIE'S INC	868	4.25	3,689.00
LITHIA MOTORS INC	54	248.34	13,410.36
LKQ CORP	183	43.28	7,920.24
LOWE'S COS INC	779	230.29	179,395.91
MACY'S INC	607	18.73	11,369.11
MERCADOLIBRE INC	56	1,370.00	76,720.00
MURPHY USA INC	10	421.11	4,211.10
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	75	1,092.70	81,952.50
OLLIE'S BARGAIN OUTLET HOLDI	39	74.71	2,913.69
PENSKE AUTOMOTIVE GROUP INC	37	153.18	5,667.66
POOL CORP	76	377.39	28,681.64
RH	13	251.85	3,274.05
ROSS STORES INC	503	132.61	66,702.83
SIGNET JEWELERS LTD	125	98.59	12,323.75
TJX COMPANIES INC	1,539	95.28	146,635.92
TRACTOR SUPPLY COMPANY	124	258.13	32,008.12
ULTA BEAUTY INC	64	410.55	26,275.20
VALVOLINE INC	184	42.61	7,840.24
WARBY PARKER INC-CLASS A	285	13.08	3,727.80
WAYFAIR INC- CLASS A	47	52.92	2,487.24
WILLIAMS-SONOMA INC	124	285.51	35,403.24
WINMARK CORP	8	371.80	2,974.40
ALBERTSONS COS INC - CLASS A	217	20.06	4,353.02
BJ'S WHOLESALE CLUB HOLDINGS	249	75.78	18,869.22
CASEY'S GENERAL STORES INC	39	315.64	12,309.96
COSTCO WHOLESALE CORP	596	723.89	431,438.44
DOLLAR GENERAL CORP	234	143.16	33,499.44
DOLLAR TREE INC	314	122.39	38,430.46
KROGER CO	738	56.15	41,438.70
PERFORMANCE FOOD GROUP CO	221	69.39	15,335.19
PRICESMART INC	80	80.91	6,472.80
SPROUTS FARMERS MARKET INC	126	65.59	8,264.34
SYSCO CORP	558	77.29	43,127.82
TARGET CORP	658	165.34	108,793.72
UNITED NATURAL FOODS INC	341	8.82	3,007.62
US FOODS HOLDING CORP	383	50.77	19,444.91
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	1,158	17.81	20,623.98
WALMART INC	5,796	59.87	347,006.52

ALTRIA GROUP INC	2,187	42.92	93,866.04
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	795	61.56	48,940.20
BOSTON BEER COMPANY INC-A	15	293.30	4,399.50
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	370	49.01	18,133.70
BUNGE GLOBAL SA	245	105.79	25,918.55
CAMPBELL SOUP CO	551	45.54	25,092.54
CELSIUS HOLDINGS INC	280	72.00	20,160.00
COCA-COLA CO/THE	5,310	61.55	326,830.50
COCA-COLA CONSOLIDATED INC	6	842.49	5,054.94
CONAGRA BRANDS INC	784	31.57	24,750.88
CONSTELLATION BRANDS INC-A	241	261.55	63,033.55
DARLING INGREDIENTS INC	339	43.13	14,621.07
FLOWERS FOODS INC	146	25.03	3,654.38
FRESHPET INC	64	104.60	6,694.40
GENERAL MILLS INC	681	71.61	48,766.41
HERSHEY CO/THE	227	188.14	42,707.78
HORMEL FOODS CORP	296	35.60	10,537.60
INGREDION INC	30	115.10	3,453.00
J & J SNACK FOODS CORP	34	138.80	4,719.20
JM SMUCKER CO/THE	170	118.55	20,153.50
KELLANOVA	438	58.75	25,732.50
KEURIG DR PEPPER INC	1,555	32.34	50,288.70
KRAFT HEINZ CO/THE	1,007	38.57	38,839.99
LAMB WESTON HOLDINGS INC	113	84.52	9,550.76
LANCASTER COLONY CORP	22	188.80	4,153.60
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	346	75.85	26,244.10
MOLSON COORS BEVERAGE CO - B	187	63.70	11,911.90
MONDELEZ INTERNATIONAL INC-A	1,606	71.31	114,523.86
MONSTER BEVERAGE CORP	869	54.33	47,212.77
PEPSICO INC	1,804	177.41	320,047.64
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	2,021	99.02	200,119.42
POST HOLDINGS INC	183	106.14	19,423.62
SIMPLY GOOD FOODS CO/THE	87	34.34	2,987.58
TREEHOUSE FOODS INC	250	36.75	9,187.50
TYSON FOODS INC-CL A	396	61.32	24,282.72
UTZ BRANDS INC	219	18.74	4,104.06
WK KELLOGG CO	41	24.13	989.33
BELLRING BRANDS INC	78	55.62	4,338.36
CENTRAL GARDEN & PET CO	117	41.94	4,906.98
CENTRAL GARDEN AND PET CO-A	29	36.15	1,048.35
CHURCH & DWIGHT CO INC	250	107.35	26,837.50
CLOROX COMPANY	182	147.78	26,895.96

COLGATE-PALMOLIVE CO	935	88.87	83,093.45
COTY INC-CL A	261	11.70	3,053.70
ELF BEAUTY INC	32	176.98	5,663.36
ENERGIZER HOLDINGS INC	207	28.73	5,947.11
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	287	147.36	42,292.32
KENVUE INC	2,704	19.13	51,727.52
KIMBERLY-CLARK CORP	431	137.78	59,383.18
PROCTER & GAMBLE CO/THE	3,116	162.60	506,661.60
ABBOTT LABORATORIES	2,168	106.89	231,737.52
ACADIA HEALTHCARE CO INC	181	71.19	12,885.39
ADDUS HOMECARE CORP	37	95.50	3,533.50
AGILON HEALTH INC	184	5.33	980.72
ALIGN TECHNOLOGY INC	88	313.78	27,612.64
AMEDISYS INC	50	91.05	4,552.50
AMN HEALTHCARE SERVICES INC	57	57.19	3,259.83
ATRICURE INC	192	23.05	4,425.60
BAXTER INTERNATIONAL INC	731	40.93	29,919.83
BECTON DICKINSON AND CO	384	233.83	89,790.72
BOSTON SCIENTIFIC CORP	1,730	72.91	126,134.30
CARDINAL HEALTH INC	279	103.54	28,887.66
CENCORA INC	197	237.95	46,876.15
CENTENE CORP	611	76.19	46,552.09
CHEMED CORP	7	617.95	4,325.65
CONMED CORP	29	70.01	2,030.29
COOPER COS INC/THE	328	90.20	29,585.60
CVS HEALTH CORP	1,802	67.77	122,121.54
DAVITA INC	31	132.74	4,114.94
DENTSPLY SIRONA INC	224	30.92	6,926.08
DEXCOM INC	581	137.87	80,102.47
EDWARDS LIFESCIENCES CORP	843	88.61	74,698.23
ELEVANCE HEALTH INC	322	533.73	171,861.06
ENCOMPASS HEALTH CORP	49	82.80	4,057.20
ENSIGN GROUP INC/THE	225	118.64	26,694.00
ENVISTA HOLDINGS CORP	931	20.28	18,880.68
GE HEALTHCARE TECHNOLOGY	488	86.72	42,319.36
GLAUKOS CORP	128	100.93	12,919.04
GLOBUS MEDICAL INC - A	63	51.44	3,240.72
HAEMONETICS CORP/MASS	61	86.22	5,259.42
HCA HEALTHCARE INC	248	319.02	79,116.96
HEALTH EQUITY INC	50	79.20	3,960.00
HENRY SCHEIN INC	114	73.21	8,345.94
HOLOGIC INC	298	76.71	22,859.58

HUMANA INC	161	315.98	50,872.78
ICU MEDICAL INC	24	96.72	2,321.28
IDEXX LABORATORIES INC	91	494.26	44,977.66
INARI MEDICAL INC	81	38.18	3,092.58
INSPIRE MEDICAL SYSTEMS INC	18	234.19	4,215.42
INSULET CORP	128	167.25	21,408.00
INTEGRA LIFESCIENCES HOLDING	75	29.38	2,203.50
INTUITIVE SURGICAL INC	493	375.01	184,879.93
LABORATORY CRP OF AMER HLDGS	113	207.94	23,497.22
LANTHEUS HOLDINGS INC	93	65.21	6,064.53
LEMAITRE VASCULAR INC	58	64.03	3,713.74
MASIMO CORP	29	135.92	3,941.68
MCKESSON CORP	198	535.42	106,013.16
MEDTRONIC PLC	1,823	80.38	146,532.74
MERIT MEDICAL SYSTEMS INC	46	74.03	3,405.38
MOLINA HEALTHCARE INC	78	367.41	28,657.98
NATIONAL HEALTHCARE CORP	174	91.13	15,856.62
NEOGEN CORP	148	12.37	1,830.76
NEVRO CORP	211	12.51	2,639.61
OPTION CARE HEALTH INC	102	29.93	3,052.86
PENUMBRA INC	78	206.15	16,079.70
PREMIER INC-CLASS A	311	21.12	6,568.32
PROGYNY INC	156	32.60	5,085.60
QUEST DIAGNOSTICS INC	223	137.55	30,673.65
QUIDELORTHO CORP	67	40.82	2,734.94
RESMED INC	193	183.78	35,469.54
SELECT MEDICAL HOLDINGS CORP	520	27.72	14,414.40
SHOCKWAVE MEDICAL INC	68	328.87	22,363.16
SOLVENTUM CORP	151	63.54	9,594.54
STERIS PLC	115	202.80	23,322.00
STRYKER CORP	470	336.85	158,319.50
TELADOC HEALTH INC	160	13.73	2,196.80
TELEFLEX INC	76	211.17	16,048.92
TENET HEALTHCARE CORP	52	98.26	5,109.52
THE CIGNA GROUP	373	352.28	131,400.44
U.S. PHYSICAL THERAPY INC	42	103.65	4,353.30
UFP TECHNOLOGIES INC	25	214.38	5,359.50
UNITEDHEALTH GROUP INC	1,239	487.30	603,764.70
UNIVERSAL HEALTH SERVICES-B	115	165.90	19,078.50
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	180	200.52	36,093.60
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	301	121.17	36,472.17
10X GENOMICS INC-CLASS A	124	27.52	3,412.48

ABBVIE INC	2,421	167.80	406,243.80
ACADIA PHARMACEUTICALS INC	491	16.59	8,145.69
AGILENT TECHNOLOGIES INC	386	137.49	53,071.14
ALKERMES PLC	115	24.65	2,834.75
ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC	166	143.80	23,870.80
AMGEN INC	694	273.01	189,468.94
AMICUS THERAPEUTICS INC	402	10.54	4,237.08
APELLIS PHARMACEUTICALS INC	97	49.93	4,843.21
ARROWHEAD PHARMACEUTICALS IN	210	23.29	4,890.90
AVANTOR INC	959	25.46	24,416.14
AZENTA INC	112	52.09	5,834.08
BIO-RAD LABORATORIES-A	50	278.21	13,910.50
BIO-TECHNE CORP	374	63.52	23,756.48
BIOGEN INC	306	201.99	61,808.94
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	280	91.20	25,536.00
BLUEPRINT MEDICINES CORP	58	92.26	5,351.08
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	2,930	48.86	143,159.80
BRUKER CORP	61	82.20	5,014.20
CATALENT INC	295	55.95	16,505.25
CEREVEL THERAPEUTICS HOLDING	211	41.90	8,840.90
CHARLES RIVER LABORATORIES	88	239.43	21,069.84
CRISPR THERAPEUTICS AG	76	55.65	4,229.40
CYTOKINETICS INC	89	66.82	5,946.98
DANAHER CORP	890	250.41	222,864.90
DENALI THERAPEUTICS INC	1,001	15.56	15,575.56
ELANCO ANIMAL HEALTH INC	322	13.31	4,285.82
ELI LILLY & CO	1,077	732.20	788,579.40
EXACT SCIENCES CORP	308	63.24	19,477.92
EXELIXIS INC	851	23.71	20,177.21
GERON CORP	1,441	3.58	5,158.78
GILEAD SCIENCES INC	1,838	67.08	123,293.04
HALOZYME THERAPEUTICS INC	85	39.12	3,325.20
ILLUMINA INC	192	122.87	23,591.04
INCYTE CORP	429	51.74	22,196.46
INSMED INC	127	25.81	3,277.87
INTELLIA THERAPEUTICS INC	88	21.17	1,862.96
INTRA-CELLULAR THERAPIES INC	106	73.12	7,750.72
IONIS PHARMACEUTICALS INC	401	42.45	17,022.45
IQVIA HOLDINGS INC	310	240.84	74,660.40
IRONWOOD PHARMACEUTICALS INC	1,043	8.10	8,448.30
JAZZ PHARMACEUTICALS PLC	60	108.32	6,499.20
JOHNSON & JOHNSON	2,924	148.53	434,301.72

MEDPACE HOLDINGS INC	14	397.56	5,565.84
MERCK & CO. INC.	3,431	127.00	435,737.00
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL	25	1,235.37	30,884.25
MODERNA INC	422	108.85	45,934.70
NATERA INC	230	91.50	21,045.00
NEUROCRINE BIOSCIENCES INC	180	138.97	25,014.60
NUVALENT INC-A	70	67.20	4,704.00
ORGANON & CO	161	18.71	3,012.31
PACIRA BIOSCIENCES INC	172	25.90	4,454.80
PERRIGO CO PLC	91	31.23	2,841.93
PFIZER INC	7,352	26.27	193,137.04
PRESTIGE CONSUMER HEALTHCARE	218	70.13	15,288.34
REGENERON PHARMACEUTICALS	142	906.54	128,728.68
REPLIGEN CORP	92	167.86	15,443.12
REVVITY INC	249	102.68	25,567.32
ROCKET PHARMACEUTICALS INC	224	23.63	5,293.12
ROYALTY PHARMA PLC- CL A	309	27.98	8,645.82
SAREPTA THERAPEUTICS INC	149	124.25	18,513.25
SUPERNUS PHARMACEUTICALS INC	202	30.26	6,112.52
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	528	577.39	304,861.92
ULTRAGENYX PHARMACEUTICAL IN	79	44.28	3,498.12
UNITED THERAPEUTICS CORP	72	237.00	17,064.00
VAXCYTE INC	62	60.30	3,738.60
VERACYTE INC	249	19.90	4,955.10
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	379	400.76	151,888.04
VIATRIS INC	969	11.55	11,191.95
WATERS CORP	83	310.25	25,750.75
WEST PHARMACEUTICAL SERVICES	99	385.73	38,187.27
XENCOR INC	369	19.02	7,018.38
XENON PHARMACEUTICALS INC	276	39.50	10,902.00
ZOETIS INC	666	150.88	100,486.08
AMERIS BANCORP	221	48.25	10,663.25
AXOS FINANCIAL INC	161	52.82	8,504.02
BANK OF AMERICA CORP	9,710	38.32	372,087.20
BERKSHIRE HILLS BANCORP INC	186	22.34	4,155.24
CITIGROUP INC	2,663	62.47	166,357.61
CITIZENS FINANCIAL GROUP	634	35.52	22,519.68
COLUMBIA BANKING SYSTEM INC	543	19.21	10,431.03
COMERICA INC	185	52.95	9,795.75
COMMERCE BANCSHARES INC	336	55.92	18,789.12
CULLEN/FROST BANKERS INC	60	116.84	7,010.40
CVB FINANCIAL CORP	198	17.09	3,383.82

EAST WEST BANCORP INC	286	77.20	22,079.20
FB FINANCIAL CORP	274	38.42	10,527.08
FIFTH THIRD BANCORP	937	37.23	34,884.51
FIRST BANCORP/NC	129	34.50	4,450.50
FIRST BUSEY CORP	408	23.12	9,432.96
FIRST CITIZENS BCSHS -CL A	16	1,639.63	26,234.08
FIRST HORIZON CORP	298	14.93	4,449.14
GLACIER BANCORP INC	194	37.94	7,360.36
HEARTLAND FINANCIAL USA INC	270	36.02	9,725.40
HOPE BANCORP INC	906	11.07	10,029.42
HUNTINGTON BANCSHARES INC	2,926	13.76	40,261.76
INDEPENDENT BANK GROUP INC	92	40.82	3,755.44
JPMORGAN CHASE & CO	3,835	193.08	740,461.80
KEYCORP	2,118	14.93	31,621.74
M & T BANK CORP	217	147.96	32,107.32
NATIONAL BANK HOLD-CL A	113	34.40	3,887.20
OCEANFIRST FINANCIAL CORP	512	15.47	7,920.64
OFG BANCORP	112	36.97	4,140.64
ORIGIN BANCORP INC	289	29.97	8,661.33
PACIFIC PREMIER BANCORP INC	401	22.74	9,118.74
PEOPLES BANCORP INC	848	30.04	25,473.92
PINNACLE FINANCIAL PARTNERS	174	82.96	14,435.04
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	522	158.06	82,507.32
POPULAR INC	211	88.36	18,643.96
PREFERRED BANK/LOS ANGELES	61	76.89	4,690.29
PROSPERITY BANCSHARES INC	196	65.08	12,755.68
REGIONS FINANCIAL CORP	842	19.77	16,646.34
S & T BANCORP INC	745	31.27	23,296.15
SANDY SPRING BANCORP INC	365	21.50	7,847.50
SEACOAST BANKING CORP/FL	143	23.92	3,420.56
SERVISFIRST BANCSHARES INC	62	63.04	3,908.48
SOUTHSIDE BANCSHARES INC	643	28.38	18,248.34
SOUTHSTATE CORP	230	80.14	18,432.20
STOCK YARDS BANCORP INC	77	48.11	3,704.47
TEXAS CAPITAL BANCSHARES INC	147	60.12	8,837.64
TOWNE BANK	313	27.75	8,685.75
TRICO BANCSHARES	109	34.80	3,793.20
TRUIST FINANCIAL CORP	1,565	38.79	60,706.35
TRUSTMARK CORP	326	29.36	9,571.36
US BANCORP	1,742	41.61	72,484.62
VERITEX HOLDINGS INC	425	20.79	8,835.75
WEBSTER FINANCIAL CORP	173	45.54	7,878.42

WELLS FARGO & CO	4,900	60.60	296,940.00
WESBANCO INC	134	28.28	3,789.52
WESTAMERICA BANCORPORATION	73	47.86	3,493.78
WESTERN ALLIANCE BANCORP	125	59.37	7,421.25
ZIONS BANCORP NA	106	42.17	4,470.02
AFFILIATED MANAGERS GROUP	25	162.07	4,051.75
AFFIRM HOLDINGS INC	223	32.08	7,153.84
AGNC INVESTMENT CORP	348	9.36	3,257.28
ALLY FINANCIAL INC	699	39.76	27,792.24
AMERICAN EXPRESS CO	741	239.12	177,187.92
AMERIPRISE FINANCIAL INC	153	412.86	63,167.58
ANNALY CAPITAL MANAGEMENT IN	1,169	18.58	21,720.02
APOLLO COMMERCIAL REAL ESTAT	298	10.84	3,230.32
APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC	483	112.72	54,443.76
ARBOR REALTY TRUST INC	195	13.02	2,538.90
ARES MANAGEMENT CORP - A	302	135.95	41,056.90
ARTISAN PARTNERS ASSET MA -A	121	42.20	5,106.20
AVIDXCHANGE HOLDINGS INC	611	11.87	7,252.57
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	871	57.95	50,474.45
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	1,707	405.95	692,956.65
BLACKROCK INC	195	762.80	148,746.00
BLACKSTONE INC	1,077	123.78	133,311.06
BLACKSTONE MORTGAGE TRU-CL A	366	18.25	6,679.50
BLOCK INC	815	74.03	60,334.45
BLUE OWL CAPITAL INC	1,408	18.78	26,442.24
CANNAE HOLDINGS INC	369	20.04	7,394.76
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	491	148.87	73,095.17
CARLYLE GROUP INC/THE	594	46.12	27,395.28
CBOE GLOBAL MARKETS INC	147	179.39	26,370.33
CME GROUP INC	517	212.59	109,909.03
COHEN & STEERS INC	181	70.79	12,812.99
COINBASE GLOBAL INC -CLASS A	246	224.37	55,195.02
CORPAY INC	87	307.42	26,745.54
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	346	129.02	44,640.92
EQUITABLE HOLDINGS INC	329	38.07	12,525.03
ESSENT GROUP LTD	160	54.17	8,667.20
EURONET WORLDWIDE INC	70	105.67	7,396.90
EVERCORE INC - A	27	186.59	5,037.93
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	57	422.83	24,101.31
FEDERAL AGRIC MTG CORP-CL C	45	190.33	8,564.85
FIDELITY NATIONAL INFO SERV	717	70.81	50,770.77
FISERV INC	726	152.25	110,533.50

FLYWIRE CORP-VOTING	409	21.13	8,642.17
FRANKLIN RESOURCES INC	580	25.35	14,703.00
GLOBAL PAYMENTS INC	305	127.47	38,878.35
GOLDMAN SACHS GROUP INC	429	423.04	181,484.16
HAMILTON LANE INC-CLASS A	110	113.34	12,467.40
HOULIHAN LOKEY INC	191	128.00	24,448.00
INTERACTIVE BROKERS GRO-CL A	104	115.64	12,026.56
INTERCONTINENTAL EXCHANGE IN	832	132.57	110,298.24
INVESCO LTD	1,121	14.52	16,276.92
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	101	165.20	16,685.20
JANUS HENDERSON GROUP PLC	383	31.62	12,110.46
JEFFERIES FINANCIAL GROUP IN	395	44.60	17,617.00
KKR & CO INC	842	96.77	81,480.34
LADDER CAPITAL CORP-REIT	674	10.50	7,077.00
LPL FINANCIAL HOLDINGS INC	94	264.54	24,866.76
MARKETAXESS HOLDINGS INC	56	204.22	11,436.32
MASTERCARD INC - A	1,098	462.50	507,825.00
MOELIS & CO - CLASS A	72	53.99	3,887.28
MOODY'S CORP	201	381.21	76,623.21
MORNINGSTAR INC	15	302.36	4,535.40
MSCI INC	100	464.65	46,465.00
NASDAQ INC	439	61.50	26,998.50
NORTHERN TRUST CORP	383	84.30	32,286.90
ONEMAIN HOLDINGS INC	81	51.31	4,156.11
P10 INC-A	2,677	7.59	20,318.43
PAYPAL HOLDINGS INC	1,288	64.84	83,513.92
PENNYMAC FINANCIAL SERVICES	88	92.07	8,102.16
PIPER SANDLER COS	21	195.48	4,105.08
PJT PARTNERS INC - A	162	95.94	15,542.28
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	237	127.54	30,226.98
REMITLY GLOBAL INC	188	18.43	3,464.84
RITHM CAPITAL CORP	1,065	11.13	11,853.45
ROBINHOOD MARKETS INC - A	274	17.31	4,742.94
S&P GLOBAL INC	423	413.28	174,817.44
SCHWAB (CHARLES) CORP	2,119	75.19	159,327.61
SEI INVESTMENTS COMPANY	53	66.60	3,529.80
SOFI TECHNOLOGIES INC	1,850	7.60	14,060.00
STARWOOD PROPERTY TRUST INC	363	19.40	7,042.20
STATE STREET CORP	393	74.29	29,195.97
STIFEL FINANCIAL CORP	277	78.28	21,683.56
SYNCHRONY FINANCIAL	1,048	45.02	47,180.96
T ROWE PRICE GROUP INC	258	111.06	28,653.48

TOAST INC-CLASS A	179	23.07	4,129.53
TPG INC	206	43.79	9,020.74
TRADEWEB MARKETS INC-CLASS A	167	102.96	17,194.32
TWO HARBORS INVESTMENT CORP	217	12.47	2,705.99
VIRTUS INVESTMENT PARTNERS	39	234.70	9,153.30
VISA INC-CLASS A SHARES	2,087	275.02	573,966.74
VOYA FINANCIAL INC	48	69.59	3,340.32
WALKER & DUNLOP INC	42	94.04	3,949.68
WESTERN UNION CO	429	13.59	5,830.11
WEX INC	101	233.31	23,564.31
AFLAC INC	560	84.28	47,196.80
ALLSTATE CORP	334	172.27	57,538.18
AMERICAN EQUITY INVT LIFE HL	74	55.99	4,143.26
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	118	129.72	15,306.96
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	1,054	74.97	79,018.38
AMERISAFE INC	325	50.92	16,549.00
AON PLC-CLASS A	275	308.83	84,928.25
ARCH CAPITAL GROUP LTD	459	93.19	42,774.21
ARTHUR J GALLAGHER & CO	319	236.81	75,542.39
ASSURANT INC	85	177.05	15,049.25
ASSURED GUARANTY LTD	71	78.48	5,572.08
AXIS CAPITAL HOLDINGS LTD	98	62.58	6,132.84
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	145	50.50	7,322.50
BROWN & BROWN INC	332	82.13	27,267.16
CHUBB LTD	474	243.01	115,186.74
CINCINNATI FINANCIAL CORP	200	119.92	23,984.00
EMPLOYERS HOLDINGS INC	82	44.90	3,681.80
ERIE INDEMNITY COMPANY-CL A	12	382.66	4,591.92
EVEREST GROUP LTD	59	365.74	21,578.66
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	320	50.64	16,204.80
FIRST AMERICAN FINANCIAL	395	57.78	22,823.10
GLOBE LIFE INC	637	78.60	50,068.20
HANOVER INSURANCE GROUP INC/	28	132.62	3,713.36
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	427	99.86	42,640.22
HORACE MANN EDUCATORS	249	37.22	9,267.78
KINSALE CAPITAL GROUP INC	40	458.59	18,343.60
LINCOLN NATIONAL CORP	143	28.65	4,096.95
LOEWS CORP	131	76.81	10,062.11
MARKEL GROUP INC	17	1,462.36	24,860.12
MARSH & MCLENNAN COS	579	200.95	116,350.05
METLIFE INC	681	72.72	49,522.32
OLD REPUBLIC INTL CORP	135	30.30	4,090.50

PRIMERICA INC	70	221.88	15,531.60
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	419	82.16	34,425.04
PROASSURANCE CORP	164	13.97	2,291.08
PROGRESSIVE CORP	805	212.20	170,821.00
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	568	112.76	64,047.68
REINSURANCE GROUP OF AMERICA	59	191.01	11,269.59
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	81	219.80	17,803.80
RLI CORP	23	147.71	3,397.33
RYAN SPECIALTY HOLDINGS INC	60	50.78	3,046.80
SAFETY INSURANCE GROUP INC	112	81.69	9,149.28
SELECTIVE INSURANCE GROUP	63	103.14	6,497.82
TRAVELERS COS INC/THE	234	213.43	49,942.62
UNUM GROUP	161	51.97	8,367.17
WHITE MOUNTAINS INSURANCE GP	9	1,766.95	15,902.55
WILLIS TOWERS WATSON PLC	121	264.48	32,002.08
WR BERKLEY CORP	315	77.85	24,522.75
ACCENTURE PLC-CL A	860	313.54	269,644.40
ADOBE INC	620	477.12	295,814.40
AKAMAI TECHNOLOGIES INC	198	102.19	20,233.62
ALARM.COM HOLDINGS INC	133	65.79	8,750.07
ALTAIR ENGINEERING INC - A	102	83.45	8,511.90
ANSYS INC	135	328.57	44,356.95
APPLOVIN CORP-CLASS A	334	69.70	23,279.80
ASPEN TECHNOLOGY INC	16	197.11	3,153.76
ATLASSIAN CORP-CL A	177	199.01	35,224.77
AUTODESK INC	276	215.00	59,340.00
BENTLEY SYSTEMS INC-CLASS B	511	54.44	27,818.84
BILL HOLDINGS INC	140	61.41	8,597.40
BLACKLINE INC	103	59.93	6,172.79
CADENCE DESIGN SYS INC	400	277.66	111,064.00
CLOUDFLARE INC - CLASS A	400	87.68	35,072.00
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	529	67.52	35,718.08
CONFLUENT INC-CLASS A	99	28.88	2,859.12
CROWDSTRIKE HOLDINGS INC - A	322	297.62	95,833.64
DATADOG INC - CLASS A	463	127.07	58,833.41
DIGITALOCEAN HOLDINGS INC	212	33.02	7,000.24
DOCUSIGN INC	340	57.29	19,478.60
DOLBY LABORATORIES INC-CL A	80	79.58	6,366.40
DOUBLEVERIFY HOLDINGS INC	187	30.79	5,757.73
DROPBOX INC-CLASS A	241	24.02	5,788.82
DXC TECHNOLOGY CO	165	21.03	3,469.95
DYNATRACE INC	233	46.74	10,890.42

ELASTIC NV	155	103.71	16,075.05
ENVESTNET INC	135	62.29	8,409.15
EPAM SYSTEMS INC	46	245.00	11,270.00
FAIR ISAAC CORP	34	1,193.03	40,563.02
FIVE9 INC	45	60.28	2,712.60
FORTINET INC	740	65.45	48,433.00
GARTNER INC	123	451.06	55,480.38
GEN DIGITAL INC	501	20.83	10,435.83
GITLAB INC-CL A	104	56.38	5,863.52
GODADDY INC - CLASS A	275	123.83	34,053.25
GUIDEWIRE SOFTWARE INC	98	113.51	11,123.98
HUBSPOT INC	55	651.74	35,845.70
INTL BUSINESS MACHINES CORP	1,251	184.10	230,309.10
INTUIT INC	364	635.49	231,318.36
KYNDRYL HOLDINGS INC	281	20.23	5,684.63
MANHATTAN ASSOCIATES INC	97	206.32	20,013.04
MICROSOFT CORP	9,313	409.06	3,809,575.78
MICROSTRATEGY INC-CL A	14	1,265.67	17,719.38
MONGODB INC	129	369.29	47,638.41
NUTANIX INC - A	346	60.89	21,067.94
OKTA INC	148	93.76	13,876.48
ORACLE CORP	2,228	115.34	256,977.52
PALANTIR TECHNOLOGIES INC-A	2,553	21.59	55,119.27
PALO ALTO NETWORKS INC	467	293.82	137,213.94
PROCORE TECHNOLOGIES INC	55	71.11	3,911.05
PROGRESS SOFTWARE CORP	72	51.63	3,717.36
PTC INC	147	180.50	26,533.50
Q2 HOLDINGS INC	283	53.78	15,219.74
QUALYS INC	82	172.11	14,113.02
ROPER TECHNOLOGIES INC	155	538.01	83,391.55
SALESFORCE INC	1,324	276.19	365,675.56
SENTINELONE INC -CLASS A	375	21.57	8,088.75
SERVICENOW INC	271	746.29	202,244.59
SMARTSHEET INC-CLASS A	75	38.36	2,877.00
SNOWFLAKE INC-CLASS A	357	154.99	55,331.43
SPS COMMERCE INC	110	171.12	18,823.20
SYNOPSYS INC	188	527.52	99,173.76
TENABLE HOLDINGS INC	67	46.42	3,110.14
TERADATA CORP	140	37.15	5,201.00
TWILIO INC - A	268	60.98	16,342.64
TYLER TECHNOLOGIES INC	59	419.00	24,721.00
UIPATH INC - CLASS A	685	19.70	13,494.50

UNITY SOFTWARE INC	406	23.57	9,569.42
VARONIS SYSTEMS INC	186	44.87	8,345.82
VERINT SYSTEMS INC	122	31.04	3,786.88
VERISIGN INC	116	185.55	21,523.80
WORKDAY INC-CLASS A	264	255.74	67,515.36
WORKIVA INC	30	80.06	2,401.80
ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A	365	61.65	22,502.25
ZSCALER INC	123	177.46	21,827.58
ADVANCED ENERGY INDUSTRIES	72	92.84	6,684.48
AMPHENOL CORP-CL A	776	116.31	90,256.56
APPLE INC	19,355	169.02	3,271,382.10
ARISTA NETWORKS INC	355	254.77	90,443.35
ARROW ELECTRONICS INC	27	127.58	3,444.66
AVNET INC	281	49.24	13,836.44
BADGER METER INC	20	183.14	3,662.80
BELDEN INC	61	83.25	5,078.25
CDW CORP/DE	189	240.69	45,490.41
CIENA CORP	85	45.04	3,828.40
CISCO SYSTEMS INC	5,370	48.35	259,639.50
COGNEX CORP	357	39.53	14,112.21
COHERENT CORP	95	52.10	4,949.50
CORNING INC	1,416	31.52	44,632.32
DELL TECHNOLOGIES -C	352	120.20	42,310.40
EPLUS INC	58	79.03	4,583.74
F5 INC	48	182.35	8,752.80
FABRINET	25	169.93	4,248.25
FLEX LTD	451	28.50	12,853.50
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	1,331	16.93	22,533.83
HP INC	1,331	28.10	37,401.10
INSIGHT ENTERPRISES INC	36	184.36	6,636.96
IPG PHOTONICS CORP	49	88.05	4,314.45
ITRON INC	97	94.42	9,158.74
JABIL INC	182	120.24	21,883.68
JUNIPER NETWORKS INC	813	35.36	28,747.68
KEYSIGHT TECHNOLOGIES IN	213	146.60	31,225.80
KNOWLES CORP	256	16.14	4,131.84
LITTELFUSE INC	111	233.60	25,929.60
LUMENTUM HOLDINGS INC	114	42.06	4,794.84
METHODE ELECTRONICS INC	322	12.29	3,957.38
MOTOROLA SOLUTIONS INC	227	345.11	78,339.97
NETAPP INC	267	100.06	26,716.02
NETSCOUT SYSTEMS INC	116	19.97	2,316.52

NOVANTA INC	24	157.81	3,787.44
PAR TECHNOLOGY CORP/DEL	115	42.00	4,830.00
PLEXUS CORP	108	95.67	10,332.36
PURE STORAGE INC - CLASS A	412	50.65	20,867.80
SANMINA CORP	197	61.66	12,147.02
SEAGATE TECHNOLOGY HOLDINGS	228	87.11	19,861.08
SUPER MICRO COMPUTER INC	66	754.72	49,811.52
TD SYNEX CORP	57	117.24	6,682.68
TE CONNECTIVITY LTD	459	140.00	64,260.00
TELEDYNE TECHNOLOGIES INC	58	362.50	21,025.00
TRIMBLE INC	395	59.51	23,506.45
VIAVI SOLUTIONS INC	363	7.99	2,900.37
VONTIER CORP	99	40.31	3,990.69
WESTERN DIGITAL CORP	440	69.55	30,602.00
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	101	277.53	28,030.53
AT&T INC	9,703	16.81	163,107.43
COGENT COMMUNICATIONS HOLDIN	133	64.96	8,639.68
FRONTIER COMMUNICATIONS PARE	356	22.86	8,138.16
IRIDIUM COMMUNICATIONS INC	742	29.28	21,725.76
LIBERTY GLOBAL LTD-C	425	16.76	7,123.00
T-MOBILE US INC	639	164.18	104,911.02
VERIZON COMMUNICATIONS INC	5,682	39.49	224,382.18
AES CORP	562	17.37	9,761.94
ALLETE INC	54	59.96	3,237.84
ALLIANT ENERGY CORP	190	50.37	9,570.30
AMEREN CORPORATION	269	74.71	20,096.99
AMERICAN ELECTRIC POWER	744	86.37	64,259.28
AMERICAN STATES WATER CO	309	70.76	21,864.84
AMERICAN WATER WORKS CO INC	228	121.36	27,670.08
ATMOS ENERGY CORP	116	118.66	13,764.56
AVISTA CORP	88	35.79	3,149.52
BLACK HILLS CORP	456	54.54	24,870.24
CALIFORNIA WATER SERVICE GRP	142	46.57	6,612.94
CENTERPOINT ENERGY INC	725	29.07	21,075.75
CHESAPEAKE UTILITIES CORP	242	106.89	25,867.38
CLEARWAY ENERGY INC-A	198	21.76	4,308.48
CMS ENERGY CORP	518	60.28	31,225.04
CONSOLIDATED EDISON INC	441	93.43	41,202.63
CONSTELLATION ENERGY	430	186.16	80,048.80
DOMINION ENERGY INC	993	51.23	50,871.39
DTE ENERGY COMPANY	241	111.55	26,883.55
DUKE ENERGY CORP	854	98.96	84,511.84

EDISON INTERNATIONAL	409	70.82	28,965.38	
ENTERGY CORP	274	106.46	29,170.04	
ESSENTIAL UTILITIES INC	228	36.54	8,331.12	
EVERGY INC	313	52.48	16,426.24	
EVERSOURCE ENERGY	455	60.84	27,682.20	
EXELON CORP	1,105	37.77	41,735.85	
FIRSTENERGY CORP	650	38.30	24,895.00	
HAWAIIAN ELECTRIC INDS	226	10.88	2,458.88	
IDACORP INC	64	94.32	6,036.48	
MGE ENERGY INC	96	78.97	7,581.12	
MIDDLESEX WATER CO	328	49.08	16,098.24	
NATIONAL FUEL GAS CO	124	55.27	6,853.48	
NEW JERSEY RESOURCES CORP	75	43.70	3,277.50	
NEXTERA ENERGY INC	2,789	66.56	185,635.84	
NEXTERA ENERGY PARTNERS LP	70	29.63	2,074.10	
NISOURCE INC	632	28.18	17,809.76	
NORTHWEST NATURAL HOLDING CO	180	38.58	6,944.40	
NRG ENERGY INC	314	72.61	22,799.54	
OGE ENERGY CORP	207	34.32	7,104.24	
ONE GAS INC	41	64.93	2,662.13	
ORMAT TECHNOLOGIES INC	76	64.99	4,939.24	
P G & E CORP	2,043	17.00	34,731.00	
PINNACLE WEST CAPITAL	49	74.54	3,652.46	
PORTLAND GENERAL ELECTRIC CO	281	43.69	12,276.89	
PPL CORP	543	27.37	14,861.91	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	631	67.23	42,422.13	
SEMPRA	631	72.04	45,457.24	
SJW GROUP	352	55.13	19,405.76	
SOUTHERN CO/THE	1,238	73.91	91,500.58	
SOUTHWEST GAS HOLDINGS INC	180	75.25	13,545.00	
SPIRE INC	51	62.05	3,164.55	
UGI CORP	949	26.00	24,674.00	
VISTRA CORP	522	70.46	36,780.12	
WEC ENERGY GROUP INC	338	82.63	27,928.94	
XCEL ENERGY INC	888	55.33	49,133.04	
ADVANCED MICRO DEVICES	2,205	151.74	334,586.70	
ANALOG DEVICES INC	698	196.50	137,157.00	
APPLIED MATERIALS INC	1,142	196.06	223,900.52	
AXCELIS TECHNOLOGIES INC	21	98.68	2,072.28	
BROADCOM INC	593	1,256.82	745,294.26	
CIRRUS LOGIC INC	59	86.29	5,091.11	
COHU INC	105	30.36	3,187.80	

DIODES INC	160	70.90	11,344.00	
ENPHASE ENERGY INC	183	107.17	19,612.11	
ENTEGRIS INC	213	127.84	27,229.92	
FIRST SOLAR INC	133	177.48	23,604.84	
INTEL CORP	5,296	34.50	182,712.00	
KLA CORP	160	656.54	105,046.40	
KULICKE & SOFFA INDUSTRIES	207	46.73	9,673.11	
LAM RESEARCH CORP	182	884.89	161,049.98	
LATTICE SEMICONDUCTOR CORP	114	71.58	8,160.12	
MACOM TECHNOLOGY SOLUTIONS H	71	100.72	7,151.12	
MARVELL TECHNOLOGY INC	1,098	64.85	71,205.30	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	678	90.68	61,481.04	
MICRON TECHNOLOGY INC	1,524	111.78	170,352.72	
MKS INSTRUMENTS INC	191	113.78	21,731.98	
MONOLITHIC POWER SYSTEMS INC	51	642.21	32,752.71	
NVIDIA CORP	3,263	796.77	2,599,860.51	
NXP SEMICONDUCTORS NV	383	235.04	90,020.32	
ON SEMICONDUCTOR	633	65.53	41,480.49	
ONTO INNOVATION INC	32	176.76	5,656.32	
PDF SOLUTIONS INC	137	30.08	4,120.96	
POWER INTEGRATIONS INC	44	66.95	2,945.80	
QORVO INC	141	112.15	15,813.15	
QUALCOMM INC	1,391	163.63	227,609.33	
RAMBUS INC	65	56.52	3,673.80	
SILICON LABORATORIES INC	49	114.26	5,598.74	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	129	101.12	13,044.48	
SMART GLOBAL HOLDINGS INC	1,003	17.76	17,813.28	
SOLAREEDGE TECHNOLOGIES INC	28	57.86	1,620.08	
SYNAPTICS INC	74	86.04	6,366.96	
TERADYNE INC	225	100.70	22,657.50	
TEXAS INSTRUMENTS INC	1,214	174.81	212,219.34	
UNIVERSAL DISPLAY CORP	24	156.44	3,754.56	
VEECO INSTRUMENTS INC	370	33.89	12,539.30	
WOLFSPEED INC	76	24.48	1,860.48	
CBRE GROUP INC - A	370	86.77	32,104.90	
COSTAR GROUP INC	463	91.95	42,572.85	
DIGITALBRIDGE GROUP INC	319	17.16	5,474.04	
JONES LANG LASALLE INC	84	181.86	15,276.24	
ST JOE CO/THE	125	56.86	7,107.50	
ZILLOW GROUP INC - C	269	43.43	11,682.67	
アメリカドル 小計	568,273		62,623,336.54 (9,739,807,532)	

合 計	568,273		9,739,807,532 (9,739,807,532)	
-----	---------	--	----------------------------------	--

(注1)通貨の種類ごとの小計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

通貨	種 類	銘 柄	口数	評価額	備考
アメリカ ドル	投資証券	ACADIA REALTY TRUST	228	3,980.88	
		ALEXANDER & BALDWIN INC	1,423	22,768.00	
		ALEXANDER'S INC	18	3,867.30	
		ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUIT	250	29,912.50	
		AMERICAN ASSETS TRUST INC	169	3,598.01	
		AMERICAN HOMES 4 RENT- A	441	15,686.37	
		AMERICAN TOWER CORP	563	97,596.05	
		AMERICOLD REALTY TRUST INC	482	10,854.64	
		ARMADA HOFFLER PROPERTIES IN	833	8,779.82	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	148	28,318.32	
		BOSTON PROPERTIES INC	434	27,315.96	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	166	16,410.76	
		CENTERSPACE	125	8,112.50	
		COMMUNITY HEALTHCARE TRUST I	251	6,488.35	
		COUSINS PROPERTIES INC	142	3,283.04	
		CROWN CASTLE INC	606	57,836.64	
		CUBESMART	333	14,025.96	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	385	54,134.85	
		DOUGLAS EMMETT INC	251	3,406.07	
		EASTERLY GOVERNMENT PROPERTI	654	7,762.98	
		EASTGROUP PROPERTIES INC	20	3,159.80	
		ELME COMMUNITIES	536	8,066.80	
		EQUINIX INC	133	100,659.72	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES	185	11,344.20	
		EQUITY RESIDENTIAL	385	24,874.85	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	45	11,148.30	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	352	47,393.28	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	140	14,504.00	
		FIRST INDUSTRIAL REALTY TR	133	6,121.99	
		GAMING AND LEISURE PROPERTIE	194	8,429.30	
		GLOBAL NET LEASE INC	2,880	20,044.80	
		HEALTHCARE REALTY TRUST INC	447	6,427.86	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	950	17,698.50	
		HIGHWOODS PROPERTIES INC	313	8,106.70	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	896	17,319.68	

INVENTRUST PROPERTIES CORP	130	3,305.90	
INVITATION HOMES INC	757	25,972.67	
IRON MOUNTAIN INC	390	30,494.10	
JBG SMITH PROPERTIES	489	7,476.81	
KILROY REALTY CORP	87	2,932.77	
KIMCO REALTY CORP	1,679	31,111.87	
KITE REALTY GROUP TRUST	142	3,084.24	
LAMAR ADVERTISING CO-A	155	17,679.30	
MACERICH CO/THE	711	11,120.04	
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	2,443	11,164.51	
MID-AMERICA APARTMENT COMM	243	31,201.20	
NETSTREIT CORP	439	7,533.24	
NEXPOINT RESIDENTIAL	667	22,211.10	
OMEGA HEALTHCARE INVESTORS	93	2,853.24	
OUTFRONT MEDIA INC	296	4,573.20	
PARAMOUNT GROUP INC	604	2,832.76	
PARK HOTELS & RESORTS INC	697	11,702.63	
PIEDMONT OFFICE REALTY TRU-A	1,292	8,901.88	
PLYMOUTH INDUSTRIAL REIT INC	348	7,252.32	
POTLATCHDELTIC CORP	234	9,689.94	
PROLOGIS INC	1,137	117,315.66	
PUBLIC STORAGE	210	55,055.70	
RAYONIER INC	260	7,872.80	
REALTY INCOME CORP	1,044	56,031.48	
REGENCY CENTERS CORP	48	2,861.28	
REXFORD INDUSTRIAL REALTY IN	166	7,061.64	
RYMAN HOSPITALITY PROPERTIES	70	7,552.30	
SABRA HEALTH CARE REIT INC	426	5,836.20	
SBA COMMUNICATIONS CORP	124	24,676.00	
SIMON PROPERTY GROUP INC	404	57,695.24	
SL GREEN REALTY CORP	252	13,144.32	
STAG INDUSTRIAL INC	84	2,919.00	
SUN COMMUNITIES INC	172	20,691.60	
SUNSTONE HOTEL INVESTORS INC	425	4,475.25	
TANGER INC	167	4,784.55	
TERRENO REALTY CORP	204	11,283.24	
UDR INC	440	16,671.60	
UMH PROPERTIES INC	612	9,602.28	
UNITI GROUP INC	825	4,710.75	
VENTAS INC	563	24,552.43	
VICI PROPERTIES INC	1,398	39,745.14	
VORNADO REALTY TRUST	127	3,402.33	

	WELLTOWER INC	724	67,838.80	
	WEYERHAEUSER CO	1,296	40,875.84	
	WP CAREY INC	154	8,694.84	
アメリカドル合計		38,739	1,597,882.77 (248,518,707)	
合計			248,518,707 (248,518,707)	

(注1)通貨の種類ごとの小計／合計欄の()内は、邦貨換算額であります。

(注2)合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係るもので、内書であります。

外貨建有価証券の内訳

種類	銘柄数	組入株式 時価比率	組入投資証券 時価比率	有価証券の 合計金額に 対する比率
アメリカドル	株式 1186銘柄	97.51%	—	97.51%
	投資証券 80銘柄	—	2.49%	2.49%

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

（デリバティブ取引に関する注記）に記載しております。

【中間財務諸表】

- 1 当ファンドの中間財務諸表は、「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）ならびに同規則第284条、第307条の規定により、「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、当中間計算期間より中間財務諸表を作成しているため、中間損益及び剰余金計算書に係る比較情報は記載しておりません。
- 3 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4月26日から2024年10月25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。

【eMAXIS Slim 全米株式】

(1) 【中間貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 [2024年 4月25日現在]	第2期中間計算期間末 [2024年10月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,638,576	40,017,016
親投資信託受益証券	10,420,297,321	14,536,757,456
未収入金	-	41,812,865
未収利息	53	235
流動資産合計	10,450,935,950	14,618,587,572
資産合計	10,450,935,950	14,618,587,572
負債の部		
流動負債		
未払解約金	25,389,495	74,752,588
未払受託者報酬	901,085	1,253,805
未払委託者報酬	3,363,959	4,680,830
その他未払費用	155,108	215,877
流動負債合計	29,809,647	80,903,100
負債合計	29,809,647	80,903,100
純資産の部		
元本等		
元本	8,648,297,652	10,760,322,159
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（△）	1,772,828,651	3,777,362,313
（分配準備積立金）	1,226,455,392	1,021,037,316
元本等合計	10,421,126,303	14,537,684,472
純資産合計	10,421,126,303	14,537,684,472
負債純資産合計	10,450,935,950	14,618,587,572

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第2期中間計算期間 自 2024年 4月26日 至 2024年10月25日
営業収益	
受取利息	19,146
有価証券売買等損益	1,391,963,995
営業収益合計	1,391,983,141
営業費用	
受託者報酬	1,253,805
委託者報酬	4,680,830
その他費用	215,877
営業費用合計	6,150,512
営業利益又は営業損失（△）	1,385,832,629
経常利益又は経常損失（△）	1,385,832,629
中間純利益又は中間純損失（△）	1,385,832,629
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（△）	57,702,283
期首剰余金又は期首欠損金（△）	1,772,828,651
剰余金増加額又は欠損金減少額	1,076,170,580
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	1,076,170,580
剰余金減少額又は欠損金増加額	399,767,264
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	399,767,264
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金（△）	3,777,362,313

(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1期 [2024年 4月25日現在]	第2期中間計算期間末 [2024年10月25日現在]
1. 期首元本額	2,000,000,000円	8,648,297,652円
期中追加設定元本額	10,585,480,819円	3,933,782,606円
期中一部解約元本額	3,937,183,167円	1,821,758,099円
2. 受益権の総数	8,648,297,652口	10,760,322,159口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

第2期中間計算期間 自 2024年 4月26日 至 2024年10月25日
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1期 [2024年 4月25日現在]	第2期中間計算期間末 [2024年10月25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。 (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。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (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1期 [2024年 4月25日現在]	第2期中間計算期間末 [2024年10月25日現在]
1口当たり純資産額	1.2050円	1.3510円
(1万口当たり純資産額)	(12,050円)	(13,510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。

貸借対照表

(単位：円)

[2024年10月25日現在]

資産の部	
流動資産	
預金	55,098,416
コール・ローン	45,236,159
株式	13,904,340,521
投資証券	370,904,155
派生商品評価勘定	2,316,926
未収配当金	7,104,296
未収利息	265
差入委託証拠金	194,234,445
流動資産合計	14,579,235,183
資産合計	14,579,235,183
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	438,379
未払解約金	41,812,865
流動負債合計	42,251,244
負債合計	42,251,244
純資産の部	
元本等	
元本	10,748,064,663
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	3,788,919,276
元本等合計	14,536,983,939
純資産合計	14,536,983,939
負債純資産合計	14,579,235,183

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。 為替予約取引は原則としてわが国における対顧客先物相場の仲値で評価しております。
3. その他財務諸表作成のための基礎となる事項	外貨建資産等の会計処理 「投資信託財産の計算に関する規則」第60条および第61条にしたがって処理しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[2024年10月25日現在]
1. 期首	2024年 4月26日
期首元本額	8,642,529,088円
期中追加設定元本額	2,636,112,998円
期中一部解約元本額	530,577,423円
元本の内訳※ eMAXIS Slim 全米株式	10,748,064,663円
合計	10,748,064,663円
2. 受益権の総数	10,748,064,663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10月25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

区分	〔2024年10月25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	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。 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10月25日現在〕

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	229,526,703	—	231,395,798	1,869,095
合計		229,526,703	—	231,395,798	1,869,095

（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。

通貨関連

〔2024年10月25日現在〕

区分	種類	契約額等（円）		時価（円）	評価損益（円）
			うち1年超		
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建 アメリカドル	30,273,692	—	30,264,240	9,452
合計		30,273,692	—	30,264,240	9,452

（注）時価の算定方法

- 1 対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
①為替予約の受渡日（以下「当該日」といいます。）の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は、当該対顧客先物相場の仲値で評価しております。
②当該日の対顧客先物相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
（イ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物相場の仲値をもとに計算したレートを用いております。
（ロ）当該日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
- 2 対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

※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10月25日現在〕
1口当たり純資産額	1.3525円
(1万口当たり純資産額)	(13,525円)

２【ファンドの現況】

【eMAXIS Slim 全米株式】

【純資産額計算書】

2024年10月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	14,717,811,749
II 負債総額	72,131,822
III 純資産総額（I－II）	14,645,679,927
IV 発行済口数	10,721,526,391口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.3660
（10,000口当たり）	（13,660）

(参考)

全米株式インデックスマザーファンド

純資産額計算書

2024年10月31日現在

(単位：円)

I 資産総額	14,672,851,399
II 負債総額	27,922,709
III 純資産総額（I－II）	14,644,928,690
IV 発行済口数	10,709,284,015口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.3675
（10,000口当たり）	（13,675）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（２）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（３）譲渡制限の内容

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

- ①受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、
- ②上記①の申請のある場合には、上記①の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記①の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。
- ③上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（５）受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（６）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

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】

（1）資本金の額等

2024年10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ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、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】

「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10月31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	817	38,739,443
追加型公社債投資信託	16	1,502,634
単位型株式投資信託	87	388,919
単位型公社債投資信託	46	113,971
合 計	966	40,744,968

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】

（1）財務諸表及び中間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。

また、当社の中間財務諸表は、財務諸表等規則第282条及び第306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、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、従来、千円未満の端数を切り捨てて表示しておりましたが、当中間会計期間より百万円未満の端数を切り捨てて表示することに変更しました。

（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。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第40期事業年度に係る中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間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

固定資産合計		24,252,782		29,337,461
--------	--	------------	--	------------

資産合計

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		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	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、記載していません。
- (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的主要原因別の内訳

	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	(株)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(株)	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)	5,006,309 千円	未払手数料	886,173 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	463,831 千円	未払費用	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	(株)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(株)	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	(株)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(株)	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、記載していません。

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

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：百万円)

第40期中間会計期間
(2024年9月30日現在)

(資産の部)
流動資産

現金及び預金		28,443
有価証券		7
前払費用		812
未収入金		145
未収委託者報酬		23,384
未収収益		1,003
金銭の信託		1,999
その他		324
流動資産合計		56,120
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	2,853
器具備品	※1	1,306
土地		628
建設仮勘定		193
有形固定資産合計		4,981
無形固定資産		
ソフトウェア		3,983
ソフトウェア仮勘定		1,356
無形固定資産合計		5,340
投資その他の資産		
投資有価証券		12,099
関係会社株式		159
投資不動産	※1	1,750
長期差入保証金		690
前払年金費用		14
繰延税金資産		1,692
その他		45
貸倒引当金		△23
投資その他の資産合計		16,428
固定資産合計		26,750
資産合計		82,871

(単位：百万円)

第40期中間会計期間
(2024年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		943
未払金		
未払収益分配金		114
未払償還金		151
未払手数料		8,340
その他未払金		679
未払費用		8,675
未払消費税等	※2	845
未払法人税等		2,907
賞与引当金		1,176
役員賞与引当金		115
その他		9
流動負債合計		23,958
固定負債		
退職給付引当金		1,644

役員退職慰労引当金	25
時効後支払損引当金	249
資産除去債務	1,436
その他	29
固定負債合計	3,384
負債合計	27,343

(純資産の部)

株主資本	
資本金	2,000
資本剰余金	
資本準備金	3,572
その他資本剰余金	41,160
資本剰余金合計	44,732
利益剰余金	
利益準備金	342
その他利益剰余金	
繰越利益剰余金	6,910
利益剰余金合計	7,253
株主資本合計	53,986

(単位：百万円)

第40期中間会計期間
(2024年9月30日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,542
評価・換算差額等合計	1,542
純資産合計	55,528
負債純資産合計	82,871

(2)中間損益計算書

(単位：百万円)

第40期中間会計期間
(自 2024年4月1日
至 2024年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	56,145
投資顧問料	1,713
その他営業収益	2
営業収益合計	57,862
営業費用	
支払手数料	19,522
広告宣伝費	203
公告費	0
調査費	
調査費	2,206
委託調査費	15,946
事務委託費	1,042
営業雑経費	
通信費	80
印刷費	215
協会費	41
諸会費	11
事務機器関連費	1,405
営業費用合計	40,676

一般管理費		
給料		
役員報酬		232
給料・手当		3,459
賞与引当金繰入		1,089
役員賞与引当金繰入		115
福利厚生費		725
交際費		4
旅費交通費		60
租税公課		281
不動産賃借料		325
退職給付費用		189
固定資産減価償却費	※1	1,218
諸経費		524
一般管理費合計		8,224
営業利益		8,960

(単位：百万円)

第40期中間会計期間

(自 2024年4月1日

至 2024年9月30日)

営業外収益		
受取配当金		49
受取利息		4
投資有価証券償還益		22
収益分配金等時効完成分		3
受取賃貸料		112
その他		3
営業外収益合計		195
営業外費用		
投資有価証券償却損		6
時効後支払損引当金繰入		19
事務過誤費		7
賃貸関連費用	※1	94
その他		10
営業外費用合計		137
経常利益		9,017
特別利益		
投資有価証券売却益		497
特別利益合計		497
特別損失		
投資有価証券売却損		58
固定資産除却損		18
固定資産売却損		3
減損損失	※2	1,306
事業譲渡関連損失		285
特別損失合計		1,672
税引前中間純利益		7,842
法人税、住民税及び事業税		2,847
法人税等調整額		△428
法人税等合計		2,418
中間純利益		5,423

(3)中間株主資本等変動計算書

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）

（単位：百万円）

	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	3,572	41,160	44,732
当中間期変動額				
剰余金の配当				
中間純利益				
別途積立金の取崩				
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)				
当中間期変動額合計	—	—	—	—
当中間期末残高	2,000	3,572	41,160	44,732

	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	6,998	40,236	47,577	94,310
当中間期変動額					
剰余金の配当			△45,747	△45,747	△45,747
中間純利益			5,423	5,423	5,423
別途積立金の取崩		△6,998	6,998	—	—
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)					
当中間期変動額合計	—	△6,998	△33,326	△40,324	△40,324
当中間期末残高	342	—	6,910	7,253	53,986

	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	1,937	1,937	96,247
当中間期変動額			
剰余金の配当			△45,747
中間純利益			5,423
別途積立金の取崩			—
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)	△395	△395	△395
当中間期変動額合計	△395	△395	△40,719
当中間期末残高	1,542	1,542	55,528

[重要な会計方針]

- 有価証券の評価基準及び評価方法
 - 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

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(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 3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. 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、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

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、内規に基づく中間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。

5. 収益および費用の計上基準

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。

6. 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、中間決算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。

7. その他中間財務諸表作成のための重要な事項

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。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	第40期中間会計期間 (2024年9月30日現在)
建物	590百万円
器具備品	1,894百万円
投資不動産	249百万円

※2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
有形固定資産	331百万円
無形固定資産	886百万円
投資不動産	38百万円

※2 減損損失

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
東京都港区（本社）	インターネット直販サービス	ソフトウェア	1,306百万円

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つのグループニングとしております。

現行のソフトウェア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おりません。

(中間株主資本等変動計算書関係)

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30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）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 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

2024年6月26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	45,747百万円
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）

第40期中間会計期間(2024年9月30日現在)

〈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

1年内	681百万円
1年超	510百万円
合 計	1,192百万円

（金融商品関係）

第40期中間会計期間(2024年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2024年9月30日における中間貸借対照表計上額、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）。

	中間貸借対照表 計上額（百万円）	時価（百万円）	差額（百万円）
(1) 有価証券	7	7	—
(2) 金銭の信託	1,999	1,999	—
(3) 投資有価証券	12,099	12,099	—
資産計	14,106	14,106	—

（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（中間貸借対照表計上額 159百万円）は、市場価格がないため、記載していません。

（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。

2. 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。

時価をもって中間貸借対照表計上額とする金融資産

区分	時価（百万円）			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
有価証券	—	7	—	7
金銭の信託	—	1,999	—	1,999
投資有価証券	2,686	9,412	—	12,099
資産計	2,686	11,419	—	14,106

（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）

第40期中間会計期間（2024年9月30日現在）

1. 子会社及び関連会社株式

関連会社株式（中間貸借対照表計上額 159百万円）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

	種類	中間貸借対照表 計上額（百万円）	取得原価 （百万円）	差額（百万円）
中間貸借対照表 計上額が取得原価を 超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	10,113	7,534	2,578
	小 計	10,113	7,534	2,578
中間貸借対照表 計上額が取得原価を 超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	3,993	4,349	△355
	小 計	3,993	4,349	△355
合 計		14,106	11,883	2,222

（注）「その他」には、中間貸借対照表の「金銭の信託」（中間貸借対照表計上額1,999百万円、取得価額2,000百万円）を含めております。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当該資産除去債務の総額の増減

第40期中間会計期間 （自 2024年4月1日 至 2024年9月30日）	
期首残高	1,428百万円
有形固定資産の取得に伴う増加	—
時の経過による調整額	7百万円
中間期末残高	1,436百万円

（収益認識関係）

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。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30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40期中間会計期間（自 2024年4月1日 至 2024年9月30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中間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。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第40期中間会計期間 (2024年9月30日現在)
1株当たり純資産額	262,445.12円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額（百万円）	55,528
普通株式に係る中間期末の純資産額（百万円）	55,528
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数（株）	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第40期中間会計期間 (自 2024年4月1日 至 2024年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	25,633.62円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額（百万円）	5,423
普通株主に帰属しない金額（百万円）	—
普通株式に係る中間純利益金額（百万円）	5,423
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載していません。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

- ①自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

- ②運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。
 ③通常の取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下④⑤において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。
 ④委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。
 ⑤上記③④に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

- ①定款の変更等
 定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。
 ②訴訟事件その他重要事項
 該当事項はありません。

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】

（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
株式会社三菱UFJ銀行	1,711,958 百万円	銀行業務を営んでいます。
auカブコム証券株式会社	7,196 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBI証券	54,323 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社SBIネオトレード証券	3,600 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
楽天証券株式会社	19,495 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
moomoo証券株式会社	8,625 百万円 (2024年4月30日現在)	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
マネックス証券株式会社	13,195 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
松井証券株式会社	11,945 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社スマートプラス	100 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
三菱UFJアセットマネジメント株式会社*	2,000 百万円	金融商品取引法に定める第二種金融商品取引業を営んでいます。

*株式会社スマートプラスと共同で投資信託取引サービスを提供しております。

2【関係業務の概要】

- （１）受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。
- （２）販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

３【資本関係】

該当ありません。（2024年10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。

第３【その他】

- （１）目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレス、ファンドの管理番号などを記載することがあります。
- （２）投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
 - ・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
 - ・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
 - ・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
 - ・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
 - ・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
 - ・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
 - ・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。
- （３）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- （４）目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- （５）投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- （６）目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- （７）目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

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。

独立監査人の監査報告書

2024年7月3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 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員**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eMAXIS Slim 全米株式の2023年9月15日から2024年4月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表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、eMAXIS Slim 全米株式の2024年4月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、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、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、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、有価証券報告書及び有価証券届出書（訂正有価証券届出書を含む）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。経営者の責任は、その他の記載内容を作成し開示することにある。

当監査法人の財務諸表に対する監査意見の対象にはその他の記載内容は含まれておらず、当監査法人はその他の記載内容に対して意見を表明するものではない。

財務諸表監査における当監査法人の責任は、その他の記載内容を通読し、通読の過程において、その他の記載内容と財務諸表又は当監査法人が監査の過程で得た知識との間に重要な相違があるかどうか検討すること、また、そのような重要な相違以外にその他の記載内容に重要な誤りの兆候があるかどうか注意を払うことにある。

当監査法人は、実施した作業に基づき、その他の記載内容に重要な誤りがあると判断した場合には、その事実を報告することが求められている。

その他の記載内容に関して、当監査法人が報告すべき事項はない。

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。

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、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。
- ・ 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、経営者に対して、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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月3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 鶴 見 将 史

指定有限責任社員 業務執行社員 公認会計士 田 嶋 大 士

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、「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2024年4月1日から2025年3月31日までの第40期事業年度の中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間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、三菱UFJアセットマネジメント株式会社の2024年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2024年4月1日から2024年9月30日まで）の経営成績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、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、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。

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。

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な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、企業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、監査役及び監査役会に対して、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。

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。

独立監査人の中間監査報告書

2024年12月18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 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 西郷 篤
業務執行社員

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eMAXIS Slim 全米株式の2024年4月26日から2024年10月25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、eMAXIS Slim 全米株式の2024年10月25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4月26日から2024年10月25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。