

当ファンドの仕組みは次の通りです。

| 商品分類 | 追加型投信／国内／株式／インデックス型 | |
|--------|---|--|
| 信託期間 | 無期限（1997年12月1日設定） | |
| 運用方針 | 日経225マザーファンド受益証券への投資を通じて、わが国の株式に実質的な投資を行い、配当込みの日経平均株価（日経225）の値動きを示す「日経平均トータルリターン・インデックス」に連動する投資成果をめざして運用を行います。マザーファンド受益証券の組入比率は高位を維持することを基本とします。対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。 | |
| 主要運用対象 | ベビーファンド | 日経225マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。なお、わが国の株式に直接投資することがあります。 |
| | マザーファンド | 日経平均トータルリターン・インデックスに採用されている銘柄を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | ベビーファンド | 株式への実質投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。 |
| | マザーファンド | 株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。 |
| 分配方針 | 経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して委託会社が決定します。原則として、配当等収益の水準を考慮して分配します。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。 | |

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

運用報告書（全体版）

夢楽章 日経平均オープン

第26期（決算日：2023年11月10日）

受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。
 さて、お手持ちの「夢楽章 日経平均オープン」は、去る11月10日に第26期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。
 今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJアセットマネジメント

東京都港区東新橋一丁目9番1号
 ホームページ <https://www.am.mufg.jp/>

当運用報告書に関するお問い合わせ先

お客様専用
フリーダイヤル **0120-151034**
 （受付時間：営業日の9:00～17:00、
土・日・祝日・12月31日～1月3日を除く）

お客様の取引内容につきましては、お取扱いの販売会社にお尋ねください。

本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | | 日経平均トータルリターン・インデックス | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産額 |
|------------------|--------|-------|-------|---------------------|-------|--------|--------|-------|
| | (分配落) | 税込分配金 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | 期中騰落率 | | | |
| | 円 | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 22期(2019年11月11日) | 16,376 | 100 | 6.4 | 37,762.13 | 7.0 | 98.3 | 1.6 | 5,200 |
| 23期(2020年11月10日) | 17,715 | 0 | 8.2 | 41,107.19 | 8.9 | 98.4 | 1.5 | 5,357 |
| 24期(2021年11月10日) | 20,890 | 0 | 17.9 | 48,835.37 | 18.8 | 98.5 | 1.5 | 5,639 |
| 25期(2022年11月10日) | 19,995 | 0 | △ 4.3 | 47,064.74 | △ 3.6 | 98.5 | 1.5 | 5,267 |
| 26期(2023年11月10日) | 23,948 | 150 | 20.5 | 57,037.48 | 21.2 | 99.1 | 1.5 | 5,739 |

(注) 基準価額の騰落率は分配金込み。

(注) 日経平均トータルリターン・インデックス（日経225（配当込み））とは、東京証券取引所プライム市場上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として日本経済新聞社により算出、公表される株価指数です。当指数は、増資・権利落ち等の市況とは無関係の株価変動要因を修正して連続性を持たせたものです。当指数に関する知的財産権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は、当指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。当指数は、日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、日本経済新聞社は、当指数自体および当指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「日経」および当指数を示す標準に関する商標権その他の知的財産権は、すべて日本経済新聞社に帰属しています。当ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。日本経済新聞社は、当指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。日本経済新聞社は、当指数の構成銘柄、計算方法、その他当指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 日 経 平 均 ト ー タ ル リ タ ー ン ・ イ ン デ ッ ク ス | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|----------------------|-------------|--------|--|--------|-----------|-----------|
| | | 騰 落 率 | | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年11月10日 | 円 19,995 | % — | 47,064.74 | % — | % 98.5 | % 1.5 |
| 11月末 | 20,373 | 1.9 | 47,968.16 | 1.9 | 98.5 | 1.5 |
| 12月末 | 19,030 | △ 4.8 | 44,827.29 | △ 4.8 | 97.6 | 2.4 |
| 2023年1月末 | 19,919 | △ 0.4 | 46,947.81 | △ 0.2 | 99.5 | 0.5 |
| 2月末 | 20,009 | 0.1 | 47,178.76 | 0.2 | 99.2 | 0.8 |
| 3月末 | 20,623 | 3.1 | 48,651.96 | 3.4 | 97.8 | 1.7 |
| 4月末 | 21,216 | 6.1 | 50,068.10 | 6.4 | 97.9 | 1.8 |
| 5月末 | 22,706 | 13.6 | 53,593.44 | 13.9 | 98.5 | 1.5 |
| 6月末 | 24,413 | 22.1 | 57,670.18 | 22.5 | 98.0 | 2.0 |
| 7月末 | 24,393 | 22.0 | 57,645.38 | 22.5 | 98.7 | 1.0 |
| 8月末 | 23,991 | 20.0 | 56,720.29 | 20.5 | 99.4 | 0.4 |
| 9月末 | 23,585 | 18.0 | 55,787.13 | 18.5 | 97.4 | 2.7 |
| 10月末 | 22,836 | 14.2 | 54,040.84 | 14.8 | 98.6 | 1.4 |
| (期 末) 2023年11月10日 | 24,098 | 20.5 | 57,037.48 | 21.2 | 99.1 | 1.5 |

(注) 期末基準価額は分配金込み、騰落率は期首比。

(注) 株式組入比率には、新株予約権証券を含めて表示しております。

(注) 当ファンドは親投資信託を組み入れますので、「株式組入比率」、「株式先物比率」は実質比率を記載しております。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第26期：2022年11月11日～2023年11月10日

▶ 当期中の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



| | |
|-------|-------------|
| 第26期首 | 19,995円 |
| 第26期末 | 23,948円 |
| 既払分配金 | 150円 |
| 騰落率 | 20.5% |
| | (分配金再投資ベース) |

※分配金再投資基準価額は、分配金が支払われた場合、収益分配金（税込み）を分配時に再投資したものとみなして計算したもので、ファンドの運用の実質的なパフォーマンスを示すものです。

※実際のファンドにおいては、分配金を再投資するかどうかについては、受益者のみなさまがご利用のコースにより異なります。また、ファンドの購入価額により課税条件も異なります。従って、各個人の受益者のみなさまの損益の状況を示すものではない点にご留意ください。

基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ20.5%（分配金再投資ベース）の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（21.2%）を0.7%下回りました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

第26期：2022年11月11日～2023年11月10日

投資環境について

国内株式市況

国内株式市況は上昇しました。

経済再開による景気回復、企業の資本効

率改善への期待等から国内株式市況は上昇しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

夢楽章 日経平均オープン

資産のほぼ全額をマザーファンドに投資したことにより、基準価額はマザーファンドとほぼ同様の推移となりました。

日経225マザーファンド

資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
日経平均トータルリターン・インデックス採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

夢楽章 日経平均オープン

ベンチマークとの乖離は△0.7%程度となりました。

マザーファンド保有以外の要因

ファンドの管理コスト等による影響は△0.7%程度でした。

マザーファンド保有による要因

マザーファンド保有による影響は0.0%程度でした。

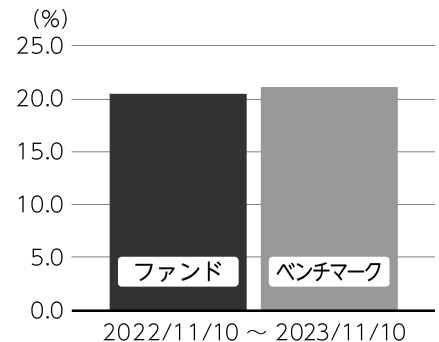
ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

主なプラス要因：その他の要因*によるものです。

*配当評価差異等が含まれます。

主なマイナス要因：組入要因によるものです。

基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



*ファンドの騰落率は分配金込みで計算しています。

▶ 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

分配原資の内訳

(単位：円、1万口当たり、税込み)

| 項目 | 第26期 |
|----------------|-------------------------|
| | 2022年11月11日～2023年11月10日 |
| 当期分配金（対基準価額比率） | 150 (0.622%) |
| 当期の収益 | 150 |
| 当期の収益以外 | - |
| 翌期繰越分配対象額 | 18,144 |

(注) 対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

(注) 当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

今後の運用方針 (作成対象期間末での見解です。)

▶ 夢楽章 日経平均オープン

マザーファンドの組入比率を高位に維持する方針です。

▶ 日経225マザーファンド

ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

2022年11月11日～2023年11月10日

1万口当たりの費用明細

| 項目 | 当期 | | 項目の概要 |
|-------------|--------|---------|---|
| | 金額 (円) | 比率 (%) | |
| (a) 信託報酬 | 120 | 0.549 | (a) 信託報酬 = 期中の平均基準価額 × 信託報酬率 × (期中の日数 ÷ 年間日数) |
| (投 信 会 社) | (54) | (0.247) | ファンドの運用・調査、受託会社への運用指図、基準価額の算出、目論見書等の作成等の対価 |
| (販 売 会 社) | (54) | (0.247) | 交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価 |
| (受 託 会 社) | (12) | (0.055) | ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価 |
| (b) 売買委託手数料 | 0 | 0.002 | (b) 売買委託手数料 = 期中の売買委託手数料 ÷ 期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (株 式) | (0) | (0.000) | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.002) | |
| (c) その他費用 | 1 | 0.003 | (c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数 |
| (監 査 費 用) | (1) | (0.003) | ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用 |
| 合 計 | 121 | 0.554 | |

期中の平均基準価額は、21,952円です。

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

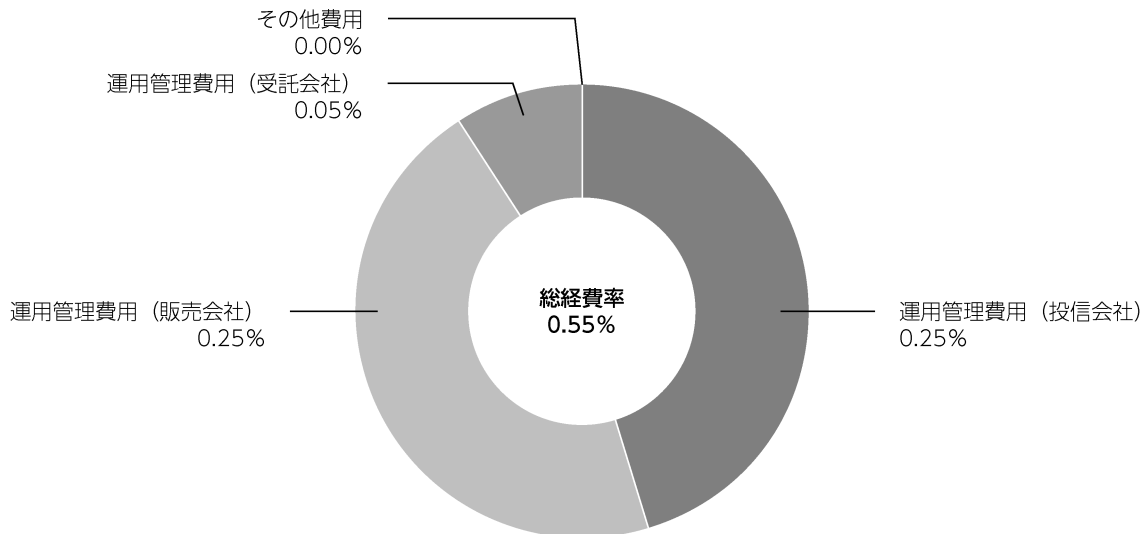
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.55%**です。



(注) 費用は、1万口当たりの費用明細において用いた簡便法により算出したものです。

(注) 各費用は、原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を含みません。

(注) 各比率は、年率換算した値です。

(注) 前記の前提条件で算出したものです。このため、これらの値はあくまでも参考であり、実際に発生した費用の比率とは異なります。

○売買及び取引の状況

(2022年11月11日～2023年11月10日)

親投資信託受益証券の設定、解約状況

| 銘柄 | 設定 | | 解約 | |
|--------------|-------------|--------------|---------------|---------------|
| | 口数 | 金額 | 口数 | 金額 |
| 日経225マザーファンド | 千口 4,171 | 千円 16,393 | 千口 137,190 | 千円 596,256 |

○株式売買比率

(2022年11月11日～2023年11月10日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項目 | 当期 | |
|---------------------|---------------|--|
| | 日経225マザーファンド | |
| (a) 期中の株式売買金額 | 227,172,366千円 | |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 359,226,436千円 | |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.63 | |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2022年11月11日～2023年11月10日)

利害関係人との取引状況

<夢楽章 日経平均オープン>

該当事項はございません。

<日経225マザーファンド>

| 区分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | $\frac{B}{A}$ | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | $\frac{D}{C}$ |
|----|----------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | | | | |
| 株式 | 百万円 121,860 | 百万円 11,451 | % 9.4 | 百万円 105,312 | 百万円 4,277 | % 4.1 |

平均保有割合 1.5%

※平均保有割合とは、親投資信託の残存口数の合計に対する当該ベビーファンドの親投資信託所有口数の割合。

利害関係人の発行する有価証券等

<日経225マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|------------|------------|-------------|
| 株式 | 百万円 131 | 百万円 116 | 百万円 515 |

利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

<日経225マザーファンド>

| 種 類 | 買 付 額 |
|-----|----------|
| 株式 | 百万円 3 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年11月10日現在)

親投資信託残高

| 銘 柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| | 口 数 | 口 数 | 評 価 額 |
| 日経225マザーファンド | 千口 1,395,355 | 千口 1,262,337 | 千円 5,774,182 |

○投資信託財産の構成

(2023年11月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-----------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 日経225マザーファンド | 千円 5,774,182 | % 99.6 |
| コール・ローン等、その他 | 24,218 | 0.4 |
| 投資信託財産総額 | 5,798,400 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年11月10日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-------------------|----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 5,798,400,973 |
| コール・ローン等 | 19,100,990 |
| 日経225マザーファンド(評価額) | 5,774,182,303 |
| 未収入金 | 5,117,680 |
| (B) 負債 | 59,233,799 |
| 未払収益分配金 | 35,947,064 |
| 未払解約金 | 7,014,547 |
| 未払信託報酬 | 16,188,060 |
| 未払利息 | 10 |
| その他未払費用 | 84,118 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 5,739,167,174 |
| 元本 | 2,396,470,936 |
| 次期繰越損益金 | 3,342,696,238 |
| (D) 受益権総口数 | 2,396,470,936口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 23,948円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 2,634,339,179円
 期中追加設定元本額 21,236,230円
 期中一部解約元本額 259,104,473円
 また、1口当たり純資産額は、期末2.3948円です。

②分配金の計算過程

| 項 目 | 2022年11月11日～ 2023年11月10日 |
|---------------------------|-----------------------------|
| 費用控除後の配当等収益額 | 102,934,725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 | 597,750,304円 |
| 収益調整金額 | 569,870,165円 |
| 分配準備積立金額 | 3,113,634,721円 |
| 当ファンドの分配対象収益額 | 4,384,189,915円 |
| 1万口当たり収益分配対象額 | 18,294円 |
| 1万口当たり分配金額 | 150円 |
| 収益分配金金額 | 35,947,064円 |

○損益の状況 (2022年11月11日～2023年11月10日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 296 |
| 受取利息 | 98 |
| その他収益金 | 3,400 |
| 支払利息 | △ 3,202 |
| (B) 有価証券売買損益 | 1,010,852,805 |
| 売買益 | 1,088,612,693 |
| 売買損 | △ 77,759,888 |
| (C) 信託報酬等 | △ 30,749,612 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 980,103,489 |
| (E) 前期繰越損益金 | 2,834,216,261 |
| (F) 追加信託差損益金 | △ 435,676,448 |
| (配当等相当額) | (569,813,409) |
| (売買損益相当額) | (△1,005,489,857) |
| (G) 計(D+E+F) | 3,378,643,302 |
| (H) 収益分配金 | △ 35,947,064 |
| 次期繰越損益金(G+H) | 3,342,696,238 |
| 追加信託差損益金 | △ 435,676,448 |
| (配当等相当額) | (569,870,165) |
| (売買損益相当額) | (△1,005,546,613) |
| 分配準備積立金 | 3,778,372,686 |

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C)信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

○分配金のお知らせ

| | |
|-----------------|------|
| 1 万円当たり分配金（税込み） | 150円 |
|-----------------|------|

◆分配金は決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆分配金を再投資される方のお手取分配金は、2023年11月10日現在の基準価額に基づいて、みなさまの口座に繰り入れて再投資いたしました。

◆課税上の取り扱い

- ・分配金は、分配後の基準価額と個々の受益者の個別元本との差により、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」に分かれます。
- ・分配後の基準価額が個別元本と同額または上回る場合は、全額が普通分配金となります。分配後の基準価額が個別元本を下回る場合には、下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、残りの額が普通分配金となります。
- ・元本払戻金（特別分配金）が発生した場合は、分配金発生時に個々の受益者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、その後の個々の受益者の個別元本となります。
- ・個人受益者が支払いを受ける収益分配金のうち普通分配金については配当所得として課税され、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。確定申告を行い、総合課税・申告分離課税を選択することもできます。
- ・分配時において、外国税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。

※法人受益者に対する課税は異なります。

※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。

※税法が改正された場合等には、上記内容が変更になることがあります。

※NISAおよびジュニアNISAをご利用の場合、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一定期間非課税となります。

*三菱UFJアセットマネジメントでは本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ（<https://www.am.mufg.jp/>）をご覧ください。

[お 知 ら せ]

委託会社の商号変更に対応するため、信託約款に所要の変更を行いました。

2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更しました。

(2023年10月1日)

日経225マザーファンド

《第22期》決算日2023年5月22日

[計算期間：2022年5月24日～2023年5月22日]

「日経225マザーファンド」は、5月22日に第22期の決算を行いました。
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第22期の運用状況をご報告申し上げます。

| | |
|--------|--|
| 運用方針 | 配当込みの日経平均株価（日経225）の値動きを示す「日経平均トータルリターン・インデックス」と連動する投資成果をめざして運用を行います。投資成果を日経平均トータルリターン・インデックスの動きにできるだけ連動させるため、株式の実質投資比率（組入現物株式の時価総額に株価指数先物取引等の買建て額を加算し、または株価指数先物取引等の売建て額を控除した額の信託財産の純資産総額に対する割合をいいます。）は、原則として高位を維持します。ただし、対象インデックスとの連動を維持するため、実質投資比率を引き下げる、あるいは実質投資比率を100%以上に引き上げる運用指図を行うことがあります。 |
| 主要運用対象 | わが国の金融商品取引所に上場されている株式のうち、日経平均トータルリターン・インデックスに採用されている銘柄を主要投資対象とします。 |
| 主な組入制限 | 株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。 |

○最近5期の運用実績

| 決算期 | 基準価額 | | 日経平均トータルリターン・インデックス | | 株式組入比率 | 株式先物比率 | 純資産総額 |
|-----------------|--------|-------|---------------------|-------|--------|--------|---------|
| | 期騰落 | 率 | 期騰落 | 率 | | | |
| | 円 | % | | % | % | % | 百万円 |
| 18期(2019年5月22日) | 27,382 | △ 5.3 | 34,084.44 | △ 5.4 | 97.4 | 2.6 | 120,251 |
| 19期(2020年5月22日) | 26,817 | △ 2.1 | 33,385.16 | △ 2.1 | 98.8 | 1.2 | 228,054 |
| 20期(2021年5月24日) | 37,904 | 41.3 | 47,183.69 | 41.3 | 98.2 | 1.8 | 271,039 |
| 21期(2022年5月23日) | 36,758 | △ 3.0 | 45,784.93 | △ 3.0 | 98.0 | 2.0 | 313,459 |
| 22期(2023年5月22日) | 43,271 | 17.7 | 53,937.98 | 17.8 | 98.0 | 1.7 | 359,285 |

(注) 日経平均トータルリターン・インデックス（日経225（配当込み））とは、東京証券取引所プライム市場上場銘柄のうち代表的な225銘柄を対象として日本経済新聞社により算出、公表される株価指数です。当指数は、増資・権利落ち等の市況とは無関係の株価変動要因を修正して連続性を持たせたものです。当指数に関する知的財産権その他一切の権利は日本経済新聞社に帰属します。日本経済新聞社は、当指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。当指数は、日本経済新聞社によって独自に開発された手法によって、算出される著作物であり、日本経済新聞社は、当指数自体および当指数を算定する手法に対して、著作権その他一切の知的財産権を有しています。「日経」および当指数を示す標章に関する商標権その他の知的財産権は、すべて日本経済新聞社に帰属しています。当ファンドは、委託会社等の責任のもとで運用されるものであり、日本経済新聞社は、その運用および当ファンドの取引に関して、一切の責任を負いません。日本経済新聞社は、当指数を継続的に公表する義務を負うものではなく、公表の誤謬、遅延または中断に関して、責任を負いません。日本経済新聞社は、当指数の構成銘柄、計算方法、その他当指数の内容を変える権利および公表を停止する権利を有しています。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

| 年 月 日 | 基 準 価 額 | | 日 経 平 均 ト ー タ ル リ タ ー ン ・ イ ン デ ッ ク ス | | 株 組 入 比 率 | 株 先 物 比 率 |
|---------------------|---------|-------|--|-------|-----------|-----------|
| | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | 騰 落 率 | | |
| (期 首) 2022年5月23日 | 円 | % | | % | % | % |
| | 36,758 | — | 45,784.93 | — | 98.0 | 2.0 |
| 5月末 | 37,135 | 1.0 | 46,256.80 | 1.0 | 98.4 | 1.6 |
| 6月末 | 35,976 | △ 2.1 | 44,843.60 | △ 2.1 | 97.8 | 2.2 |
| 7月末 | 37,897 | 3.1 | 47,240.59 | 3.2 | 99.1 | 0.9 |
| 8月末 | 38,313 | 4.2 | 47,760.69 | 4.3 | 99.3 | 0.7 |
| 9月末 | 35,669 | △ 3.0 | 44,470.99 | △ 2.9 | 95.4 | 5.0 |
| 10月末 | 37,935 | 3.2 | 47,302.96 | 3.3 | 98.5 | 1.4 |
| 11月末 | 38,468 | 4.7 | 47,968.16 | 4.8 | 98.5 | 1.5 |
| 12月末 | 35,948 | △ 2.2 | 44,827.29 | △ 2.1 | 97.6 | 2.4 |
| 2023年1月末 | 37,647 | 2.4 | 46,947.81 | 2.5 | 99.5 | 0.5 |
| 2月末 | 37,832 | 2.9 | 47,178.76 | 3.0 | 99.2 | 0.8 |
| 3月末 | 39,012 | 6.1 | 48,651.96 | 6.3 | 97.8 | 1.7 |
| 4月末 | 40,151 | 9.2 | 50,068.10 | 9.4 | 97.9 | 1.8 |
| (期 末) 2023年5月22日 | 43,271 | 17.7 | 53,937.98 | 17.8 | 98.0 | 1.7 |

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

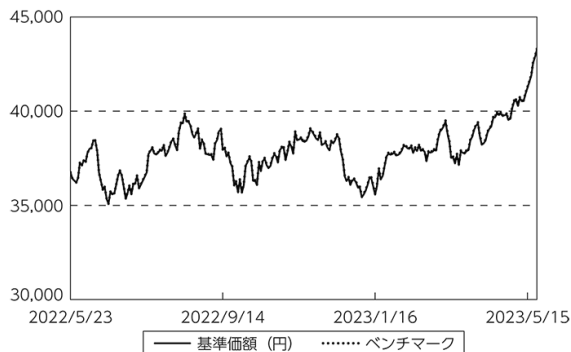
◎基準価額の動き

基準価額は期間の初めに比べ17.7%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(17.8%)を0.1%下回りました。

基準価額等の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

● 基準価額の主な変動要因

(上昇要因)

ベンチマークに連動する投資成果をめざして運用を行った結果、基準価額はベンチマークとほぼ同様の動きとなりました。

● 投資環境について**◎ 国内株式市況**

国内株式市況は上昇しました。

新型コロナウイルス対策の入国規制緩和によるインバウンド需要期待等から、国内株式市況は上昇しました。

● 当該投資信託のポートフォリオについて

- ・ 資産のほぼ全額を株式（先物を含む）に投資しました。
- ・ 日経平均トータルリターン・インデックス採用全銘柄に投資することで、指数を模倣しました。

● 当該投資信託のベンチマークとの差異について

ベンチマークは17.8%の上昇になったため、カイ離は $\Delta 0.1\%$ 程度となりました。

ベンチマークとの差異の主な要因は以下の通りです。

(主なプラス要因)

- ・ ありません。

(主なマイナス要因)

- ・ その他の要因[※]によるものです。

※配当評価差異等が含まれます。

○ 今後の運用方針

- ・ ベンチマークの動きに連動する投資成果をめざして運用を行います。

○1万口当たりの費用明細

(2022年5月24日～2023年5月22日)

| 項 目 | 当 期 | | 項 目 の 概 要 |
|-----------------------|-----|---------|---|
| | 金 額 | 比 率 | |
| (a) 売 買 委 託 手 数 料 | 円 | % | (a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料 |
| (株 式) | 1 | 0.002 | |
| (先物・オプション) | (0) | (0.000) | |
| 合 計 | (1) | (0.002) | |
| 期中の平均基準価額は、37,861円です。 | | | |

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

○売買及び取引の状況

(2022年5月24日～2023年5月22日)

株式

| | | 買 付 | | 売 付 | |
|-----|----|---------|------------|--------|-------------|
| | | 株 数 | 金 額 | 株 数 | 金 額 |
| 国 内 | 上場 | 千株 | 千円 | 千株 | 千円 |
| | | 21,844 | 93,131,370 | 23,942 | 100,460,057 |
| | | (6,885) | () | | |

(注) 金額は受渡代金。

(注) ()内は株式分割・増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

先物取引の種類別取引状況

| 種 類 別 | | 買 建 | | 売 建 | |
|-------|--------|---------|---------|-------|-------|
| | | 新規買付額 | 決 済 額 | 新規売付額 | 決 済 額 |
| 国 内 | 株式先物取引 | 百万円 | 百万円 | 百万円 | 百万円 |
| | | 173,685 | 174,449 | — | — |

○株式売買比率

(2022年5月24日～2023年5月22日)

株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

| 項 目 | 当 期 |
|---------------------|---------------|
| (a) 期中の株式売買金額 | 193,591,427千円 |
| (b) 期中の平均組入株式時価総額 | 326,244,638千円 |
| (c) 売買高比率 (a) / (b) | 0.59 |

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

○利害関係人との取引状況等

(2022年5月24日～2023年5月22日)

利害関係人との取引状況

| 区 分 | 買付額等 A | うち利害関係人 との取引状況B | | 売付額等 C | うち利害関係人 との取引状況D | |
|-----|---------------|--------------------|---------------|----------------|--------------------|---------------|
| | | | $\frac{B}{A}$ | | | $\frac{D}{C}$ |
| 株式 | 百万円 93,131 | 百万円 10,068 | % 10.8 | 百万円 100,460 | 百万円 8,936 | % 8.9 |

利害関係人の発行する有価証券等

| 種 類 | 買 付 額 | 売 付 額 | 当 期 末 保 有 額 |
|-----|-----------|-----------|-------------|
| 株式 | 百万円 82 | 百万円 99 | 百万円 354 |

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券、三菱UFJフィナンシャル・グループ、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2023年5月22日現在)

国内株式

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|---------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 水産・農林業 (0.1%) | | | | |
| ニッスイ | 400 | 384 | | 247,296 |
| マルハニチロ | 40 | — | | — |
| 鉱業 (0.1%) | | | | |
| I N P E X | 160 | 153.6 | | 230,553 |
| 建設業 (1.7%) | | | | |
| コムシスホールディングス | 400 | 384 | 1,093,248 | |
| 大成建設 | 80 | 76.8 | 359,424 | |
| 大林組 | 400 | 384 | 443,520 | |
| 清水建設 | 400 | 384 | 338,304 | |
| 長谷工コーポレーション | 80 | 76.8 | 128,716 | |
| 鹿島建設 | 200 | 192 | 408,768 | |
| 大和ハウス工業 | 400 | 384 | 1,377,792 | |
| 積水ハウス | 400 | 384 | 1,128,192 | |
| 日揮ホールディングス | 400 | 384 | 642,816 | |
| 食料品 (3.6%) | | | | |
| 日清製粉グループ本社 | 400 | 384 | 695,808 | |
| 明治ホールディングス | 80 | 153.6 | 507,648 | |
| 日本ハム | 200 | 192 | 744,960 | |
| サッポロホールディングス | 80 | 76.8 | 304,896 | |
| アサヒグループホールディングス | 400 | 384 | 2,140,032 | |
| キリンホールディングス | 400 | 384 | 838,656 | |
| 宝ホールディングス | 400 | 384 | 418,176 | |
| キッコーマン | 400 | 384 | 3,225,600 | |
| 味の素 | 400 | 384 | 2,030,208 | |
| ニチレイ | 200 | 192 | 599,040 | |
| 日本たばこ産業 | 400 | 384 | 1,191,552 | |
| 繊維製品 (0.1%) | | | | |
| 東洋紡 | 40 | — | — | |
| ユニチカ | 40 | — | — | |
| 帝人 | 80 | 76.8 | 110,899 | |
| 東レ | 400 | 384 | 290,726 | |
| パルプ・紙 (0.1%) | | | | |
| 王子ホールディングス | 400 | 384 | 208,896 | |
| 日本製紙 | 40 | 38.4 | 42,508 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | | 当 期 末 | |
|-----------------------|---------|-------|-----------|-------|
| | 株 数 | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千株 | 千円 |
| 化学 (7.0%) | | | | |
| クラレ | 400 | 384 | 509,952 | |
| 旭化成 | 400 | 384 | 370,790 | |
| レゾナック・ホールディングス | 40 | 38.4 | 81,523 | |
| 住友化学 | 400 | 384 | 164,352 | |
| 日産化学 | 400 | 384 | 2,388,480 | |
| 東ソー | 200 | 192 | 328,320 | |
| トクヤマ | 80 | 76.8 | 169,728 | |
| デンカ | 80 | 76.8 | 207,590 | |
| 信越化学工業 | 400 | 1,920 | 8,194,560 | |
| 三井化学 | 80 | 76.8 | 275,328 | |
| 三菱ケミカルグループ | 200 | 192 | 156,134 | |
| UBE | 40 | 38.4 | 87,091 | |
| 花王 | 400 | 384 | 2,028,672 | |
| D I C | 40 | 38.4 | 98,035 | |
| 富士フィルムホールディングス | 400 | 384 | 3,184,896 | |
| 資生堂 | 400 | 384 | 2,661,888 | |
| 日東電工 | 400 | 384 | 3,878,400 | |
| 医薬品 (7.1%) | | | | |
| 協和キリン | 400 | 384 | 1,056,768 | |
| 武田薬品工業 | 400 | 384 | 1,748,352 | |
| アステラス製薬 | 2,000 | 1,920 | 4,433,280 | |
| 住友ファーマ | 400 | 384 | 267,648 | |
| 塩野義製薬 | 400 | 384 | 2,439,168 | |
| 中外製薬 | 1,200 | 1,152 | 4,263,552 | |
| エーザイ | 400 | 384 | 3,242,880 | |
| 第一三共 | 1,200 | 1,152 | 5,616,000 | |
| 大塚ホールディングス | 400 | 384 | 1,953,792 | |
| 石油・石炭製品 (0.2%) | | | | |
| 出光興産 | 160 | 153.6 | 431,462 | |
| ENEOSホールディングス | 400 | 384 | 181,900 | |
| ゴム製品 (0.8%) | | | | |
| 横浜ゴム | 200 | 192 | 594,240 | |
| ブリヂストン | 400 | 384 | 2,200,320 | |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| ガラス・土石製品 (0.8%) | | | |
| AGC | 80 | 76.8 | 387,072 |
| 日本板硝子 | 40 | 38.4 | 24,307 |
| 日本電気硝子 | 120 | 115.2 | 292,032 |
| 住友大阪セメント | 40 | 38.4 | 134,592 |
| 太平洋セメント | 40 | 38.4 | 94,118 |
| 東海カーボン | 400 | 384 | 475,776 |
| TOTO | 200 | 192 | 883,200 |
| 日本碍子 | 400 | 384 | 675,840 |
| 鉄鋼 (0.1%) | | | |
| 日本製鉄 | 40 | 38.4 | 110,016 |
| 神戸製鋼所 | 40 | 38.4 | 42,278 |
| JFEホールディングス | 40 | 38.4 | 69,004 |
| 大太平洋金属 | 40 | 38.4 | 63,283 |
| 非鉄金属 (0.7%) | | | |
| 日本軽金属ホールディングス | 40 | — | — |
| 三井金属鉱業 | 40 | 38.4 | 121,344 |
| 東邦亜鉛 | 40 | — | — |
| 三菱マテリアル | 40 | 38.4 | 90,931 |
| 住友金属鉱山 | 200 | 192 | 845,952 |
| DOWAホールディングス | 80 | 76.8 | 336,000 |
| 古河電気工業 | 40 | 38.4 | 94,041 |
| 住友電気工業 | 400 | 384 | 661,248 |
| フジクラ | 400 | 384 | 397,824 |
| 金属製品 (0.0%) | | | |
| SUMCO | 40 | 38.4 | 74,688 |
| 機械 (5.8%) | | | |
| 日本製鋼所 | 80 | 76.8 | 211,200 |
| オークマ | 80 | 76.8 | 492,288 |
| アマダ | 400 | 384 | 526,464 |
| SMC | — | 38.4 | 2,876,928 |
| 小松製作所 | 400 | 384 | 1,342,464 |
| 住友重機械工業 | 80 | 76.8 | 248,064 |
| 日立建機 | 400 | 384 | 1,317,120 |
| クボタ | 400 | 384 | 781,632 |
| 荏原製作所 | 80 | 76.8 | 479,232 |
| ダイキン工業 | 400 | 384 | 10,705,920 |
| 日本精工 | 400 | 384 | 331,392 |
| NTN | 400 | 384 | 116,352 |
| ジェイテクト | 400 | 384 | 460,032 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|---------------------|---------|-------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三井E&S | 40 | 38.4 | 19,507 |
| 日立造船 | 80 | 76.8 | 64,281 |
| 三菱重工業 | 40 | 38.4 | 219,417 |
| IHI | 40 | 38.4 | 131,328 |
| 電気機器 (24.5%) | | | |
| コニカミノルタ | 400 | 384 | 184,320 |
| ミネベアミツミ | 400 | 384 | 1,012,224 |
| 日立製作所 | 80 | 76.8 | 634,214 |
| 三菱電機 | 400 | 384 | 694,080 |
| 富士電機 | 80 | 76.8 | 473,856 |
| 安川電機 | 400 | 384 | 2,242,560 |
| ニデック | — | 307.2 | 2,280,652 |
| オムロン | 400 | 384 | 3,270,528 |
| ジーエス・ユアサ コーポレーション | 80 | 76.8 | 190,617 |
| 日本電気 | 40 | 38.4 | 243,456 |
| 富士通 | 40 | 38.4 | 706,176 |
| 神電気工業 | 40 | — | — |
| ルネサスエレクトロニクス | — | 384 | 799,872 |
| セイコーエプソン | 800 | 768 | 1,654,272 |
| パナソニック ホールディングス | 400 | 384 | 566,208 |
| シャープ | 400 | 384 | 331,776 |
| ソニーグループ | 400 | 384 | 5,226,240 |
| TDK | 1,200 | 1,152 | 6,059,520 |
| アルプスアルパイン | 400 | 384 | 491,136 |
| 横河電機 | 400 | 384 | 995,328 |
| アドバンテスト | 800 | 768 | 11,005,440 |
| キーエンス | 40 | 38.4 | 2,683,008 |
| カシオ計算機 | 400 | 384 | 465,792 |
| ファナック | 400 | 1,920 | 9,169,920 |
| 京セラ | 800 | 768 | 5,842,944 |
| 太陽誘電 | 400 | 384 | 1,591,680 |
| 村田製作所 | 320 | 307.2 | 2,498,150 |
| SCREENホールディングス | 80 | 76.8 | 1,012,224 |
| キヤノン | 600 | 576 | 1,982,016 |
| リコー | 400 | 384 | 447,744 |
| 東京エレクトロン | 400 | 1,152 | 21,496,320 |
| 輸送用機器 (4.3%) | | | |
| デンソー | 400 | 384 | 3,323,904 |
| 川崎重工業 | 40 | 38.4 | 112,588 |
| 日産自動車 | 400 | 384 | 200,563 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|----------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| いすゞ自動車 | 200 | 192 | 333,120 |
| トヨタ自動車 | 2,000 | 1,920 | 3,744,000 |
| 日野自動車 | 400 | 384 | 221,952 |
| 三菱自動車工業 | 40 | 38.4 | 17,894 |
| マツダ | 80 | 76.8 | 92,774 |
| 本田技研工業 | 800 | 768 | 3,042,816 |
| スズキ | 400 | 384 | 1,820,160 |
| SUBARU | 400 | 384 | 900,864 |
| ヤマハ発動機 | 400 | 384 | 1,330,560 |
| 精密機器 (4.0%) | | | |
| テルモ | 1,600 | 1,536 | 6,511,104 |
| ニコン | 400 | 384 | 600,576 |
| オリンパス | 1,600 | 1,536 | 3,533,568 |
| HOYA | — | 192 | 3,120,000 |
| シチズン時計 | 400 | 384 | 311,808 |
| その他製品 (2.8%) | | | |
| バンダイナムコホールディングス | 400 | 1,152 | 3,916,800 |
| 凸版印刷 | 200 | 192 | 577,920 |
| 大日本印刷 | 200 | 192 | 782,400 |
| ヤマハ | 400 | 384 | 2,181,120 |
| 任天堂 | 40 | 384 | 2,327,040 |
| 電気・ガス業 (0.2%) | | | |
| 東京電力ホールディングス | 40 | 38.4 | 18,316 |
| 中部電力 | 40 | 38.4 | 62,745 |
| 関西電力 | 40 | 38.4 | 58,675 |
| 東京瓦斯 | 80 | 76.8 | 230,016 |
| 大阪瓦斯 | 80 | 76.8 | 175,488 |
| 陸運業 (1.4%) | | | |
| 東武鉄道 | 80 | 76.8 | 290,688 |
| 東急 | 200 | 192 | 377,856 |
| 小田急電鉄 | 200 | 192 | 417,216 |
| 京王電鉄 | 80 | 76.8 | 407,040 |
| 京成電鉄 | 200 | 192 | 1,042,560 |
| 東日本旅客鉄道 | 40 | 38.4 | 313,728 |
| 西日本旅客鉄道 | 40 | 38.4 | 238,924 |
| 東海旅客鉄道 | 40 | 38.4 | 665,472 |
| ヤマトホールディングス | 400 | 384 | 995,328 |
| NIPPON EXPRESSホールディン | 40 | 38.4 | 320,640 |
| 海運業 (0.3%) | | | |
| 日本郵船 | 40 | 115.2 | 349,286 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|------------------------|---------|-------|------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 商船三井 | 120 | 115.2 | 365,184 |
| 川崎汽船 | 40 | 115.2 | 386,496 |
| 空運業 (0.3%) | | | |
| 日本航空 | — | 384 | 1,062,912 |
| ANAホールディングス | 40 | 38.4 | 121,344 |
| 倉庫・運輸関連業 (0.2%) | | | |
| 三菱倉庫 | 200 | 192 | 684,480 |
| 情報・通信業 (10.1%) | | | |
| ネクソン | 800 | 768 | 2,327,040 |
| Zホールディングス | 160 | 153.6 | 55,188 |
| トレンドマイクロ | 400 | 384 | 2,480,640 |
| 日本電信電話 | 160 | 153.6 | 645,734 |
| KDDI | 2,400 | 2,304 | 10,342,656 |
| ソフトバンク | 400 | 384 | 581,952 |
| 東宝 | 40 | 38.4 | 219,264 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 2,000 | 1,920 | 3,807,360 |
| コナミグループ | 400 | 384 | 2,949,120 |
| ソフトバンクグループ | 2,400 | 2,304 | 12,022,272 |
| 卸売業 (2.8%) | | | |
| 双日 | 40 | 38.4 | 108,940 |
| 伊藤忠商事 | 400 | 384 | 1,860,480 |
| 丸紅 | 400 | 384 | 764,544 |
| 豊田通商 | 400 | 384 | 2,396,160 |
| 三井物産 | 400 | 384 | 1,699,584 |
| 住友商事 | 400 | 384 | 1,026,816 |
| 三菱商事 | 400 | 384 | 2,160,768 |
| 小売業 (12.8%) | | | |
| J・フロント リテイリング | 200 | 192 | 283,200 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 400 | 384 | 580,992 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 400 | 384 | 2,476,800 |
| 高島屋 | 200 | 192 | 386,112 |
| 丸井グループ | 400 | 384 | 943,104 |
| イオン | 400 | 384 | 1,112,256 |
| ファーストリテイリング | 400 | 1,152 | 39,248,640 |
| 銀行業 (0.6%) | | | |
| しずおかフィナンシャルグループ | — | 384 | 390,912 |
| コンコルディア・フィナンシャルグループ | 400 | 384 | 206,208 |
| あおぞら銀行 | 40 | 38.4 | 97,420 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 400 | 384 | 354,624 |
| りそなホールディングス | 40 | 38.4 | 24,890 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | |
|--------------------------|---------|-------|-----------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 |
| | 千株 | 千株 | 千円 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 40 | 38.4 | 198,950 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 40 | 38.4 | 216,960 |
| 千葉銀行 | 400 | 384 | 338,688 |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 80 | 76.8 | 202,214 |
| 静岡銀行 | 400 | — | — |
| みずほフィナンシャルグループ | 40 | 38.4 | 79,161 |
| 証券、商品先物取引業 (0.2%) | | | |
| 大和証券グループ本社 | 400 | 384 | 245,760 |
| 野村ホールディングス | 400 | 384 | 192,691 |
| 松井証券 | 400 | 384 | 301,056 |
| 保険業 (0.8%) | | | |
| SOMPOホールディングス | 80 | 76.8 | 461,875 |
| MS&ADインシュアランスグループホール | 120 | 115.2 | 552,268 |
| 第一生命ホールディングス | 40 | 38.4 | 97,171 |
| 東京海上ホールディングス | 200 | 576 | 1,741,824 |
| T&Dホールディングス | 80 | 76.8 | 149,068 |
| その他金融業 (0.7%) | | | |
| クレディセゾン | 400 | 384 | 740,736 |
| オリックス | 400 | 384 | 914,880 |
| 日本取引所グループ | 400 | 384 | 896,448 |

| 銘柄 | 期首(前期末) | 当 期 末 | | |
|---------------------|---------|--------|-----------|-------------|
| | 株 数 | 株 数 | 評 価 額 | |
| | 千株 | 千株 | 千円 | |
| 不動産業 (1.0%) | | | | |
| 東急不動産ホールディングス | 400 | 384 | 289,536 | |
| 三井不動産 | 400 | 384 | 1,050,048 | |
| 三菱地所 | 400 | 384 | 634,560 | |
| 東京建物 | 200 | 192 | 341,952 | |
| 住友不動産 | 400 | 384 | 1,247,616 | |
| サービス業 (4.8%) | | | | |
| エムスリー | 960 | 921.6 | 2,993,356 | |
| ディー・エヌ・エー | 120 | 115.2 | 225,792 | |
| 電通グループ | 400 | 384 | 1,800,960 | |
| オリエンタルランド | — | 384 | 2,103,168 | |
| サイバーエージェント | 320 | 307.2 | 339,456 | |
| 楽天グループ | 400 | 384 | 235,392 | |
| リクルートホールディングス | 1,200 | 1,152 | 5,084,928 | |
| 日本郵政 | 400 | 384 | 397,440 | |
| セコム | 400 | 384 | 3,626,496 | |
| 合 計 | 株 数・金 額 | 75,200 | 79,987 | 352,254,850 |
| | 銘柄数<比率> | 225 | 225 | <98.0%> |

(注) 銘柄欄の()内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。
(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。

先物取引の銘柄別期末残高

| 銘柄 | 別 | 当 期 末 | |
|----|--------|--------------|----------|
| | | 買 建 額 | 売 建 額 |
| 国内 | 株式先物取引 | 日経225 | |
| | | 百万円 6,112 | 百万円 — |

○投資信託財産の構成

(2023年5月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 | |
|--------------|-------------------|-----------|
| | 評 価 額 | 比 率 |
| 株式 | 千円 352,254,850 | % 96.5 |
| コール・ローン等、その他 | 12,915,288 | 3.5 |
| 投資信託財産総額 | 365,170,138 | 100.0 |

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2023年5月22日現在)

| 項 目 | 当 期 末 |
|-----------------|-----------------|
| | 円 |
| (A) 資産 | 364,958,518,029 |
| コール・ローン等 | 4,504,401,312 |
| 株式(評価額) | 352,254,850,560 |
| 未収入金 | 4,795,512,341 |
| 未収配当金 | 3,354,013,816 |
| 差入委託証拠金 | 49,740,000 |
| (B) 負債 | 5,672,851,540 |
| 未払解約金 | 5,672,845,600 |
| 未払利息 | 5,940 |
| (C) 純資産総額(A-B) | 359,285,666,489 |
| 元本 | 83,032,268,817 |
| 次期繰越損益金 | 276,253,397,672 |
| (D) 受益権総口数 | 83,032,268,817口 |
| 1万口当たり基準価額(C/D) | 43,271円 |

<注記事項>

- ①期首元本額 85,275,786,435円
 期中追加設定元本額 37,579,849,738円
 期中一部解約元本額 39,823,367,356円
 また、1口当たり純資産額は、期末4.3271円です。

②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

| | |
|-----------------------------|-----------------|
| 三菱UFJ インデックス225オープン | 28,599,064,630円 |
| インデックスファンド225 | 16,470,943,949円 |
| つみたて日本株式(日経平均) | 14,823,926,231円 |
| eMAXIS 日経225インデックス | 8,888,750,296円 |
| eMAXIS Slim 国内株式(日経平均) | 6,333,024,192円 |
| 三菱UFJ インデックス225オープン(確定拠出年金) | 3,739,344,524円 |
| <DC>インデックスファンド225 | 1,360,762,362円 |
| 夢楽章 日経平均オープン | 1,348,897,319円 |
| インデックス・タイプ(ミリオン) | 742,668,731円 |
| インデックスファンド225VA | 695,850,929円 |
| インデックスファンド225VA2(適格機関投資家限定) | 29,035,654円 |
| 合計 | 83,032,268,817円 |

【お知らせ】

三菱UFJ国際投信株式会社は、2023年10月1日より商号を三菱UFJアセットマネジメント株式会社に変更します。

○損益の状況 (2022年5月24日～2023年5月22日)

| 項 目 | 当 期 |
|------------------|------------------|
| | 円 |
| (A) 配当等収益 | 7,322,123,054 |
| 受取配当金 | 7,324,670,826 |
| 受取利息 | 39,098 |
| その他収益金 | 182,154 |
| 支払利息 | △ 2,769,024 |
| (B) 有価証券売買損益 | 52,252,225,855 |
| 売買益 | 60,814,438,526 |
| 売買損 | △ 8,562,212,671 |
| (C) 先物取引等取引損益 | 736,520,430 |
| 取引益 | 2,926,831,440 |
| 取引損 | △ 2,190,311,010 |
| (D) 当期損益金(A+B+C) | 60,310,869,339 |
| (E) 前期繰越損益金 | 228,183,926,297 |
| (F) 追加信託差損益金 | 101,867,734,764 |
| (G) 解約差損益金 | △114,109,132,728 |
| (H) 計(D+E+F+G) | 276,253,397,672 |
| 次期繰越損益金(H) | 276,253,397,672 |

(注) (B)有価証券売買損益および(C)先物取引等取引損益は期末の評価換えによるものを含まず。

(注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

(注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。