

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／特殊型（絶対収益追求型）	
信託期間	無期限（2005年12月16日設定）	
運用方針	主としてマザーファンドを通じて、無担保コール翌日物レート（指数化）をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。 割安度、成長性といった投資尺度の中から、計量モデルを用いて決定された最適と推測される投資尺度により株式への投資を行います。同時に株式の信用取引等を活用することにより株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、安定した収益の確保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。	
主要運用対象	ベビーファンド	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の株式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。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。	
	<div style="border: 1px solid black; padding: 5px;">           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。）         </div>	

※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。

## 運用報告書（全体版）

# 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）

第31期（決算日：2021年8月24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「日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）」は、去る8月24日に第31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国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12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			無担保コール 翌日物レート(指数化)		株式 組入比率	信用取引 比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落 率	無 担 保 レ ー ト	中 期 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
27期(2019年8月26日)	12,273	0	△1.1	101.73	△0.0	79.6	△79.7	—	1,549
28期(2020年2月25日)	11,947	0	△2.7	101.71	△0.0	70.0	△69.3	—	602
29期(2020年8月24日)	12,456	0	4.3	101.69	△0.0	83.4	△81.9	—	746
30期(2021年2月24日)	11,834	0	△5.0	101.68	△0.0	80.0	△80.0	—	419
31期(2021年8月24日)	11,643	0	△1.6	101.67	△0.0	78.7	△78.9	—	32

(注) 無担保コール翌日物レートとは、金融機関同士が短期資金の貸借を行うコール市場において、翌日返済とした無担保取引の際の金利をいいます。無担保コール翌日物レート(指数化)は無担保コール翌日物レートをもとに委託会社が計算したものです。

(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」、「信用取引比率」、「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		無担保コール 翌日物レート(指数化)		株式 組入比率	信用取引 比率	株式 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	無 担 保 レ ー ト	中 期 騰 落 率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2021年2月24日	11,834	—	101.68	—	80.0	△80.0	—
2月末	11,855	0.2	101.68	△0.0	78.1	△77.9	—
3月末	11,935	0.9	101.68	△0.0	82.2	△81.3	—
4月末	11,943	0.9	101.67	△0.0	80.1	△80.2	—
5月末	11,969	1.1	101.67	△0.0	80.3	△79.8	—
6月末	11,901	0.6	101.67	△0.0	82.2	△82.0	—
7月末	11,833	△0.0	101.67	△0.0	79.1	△79.3	—
(期末) 2021年8月24日	11,643	△1.6	101.67	△0.0	78.7	△78.9	—

(注) 騰落率は期首比。

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

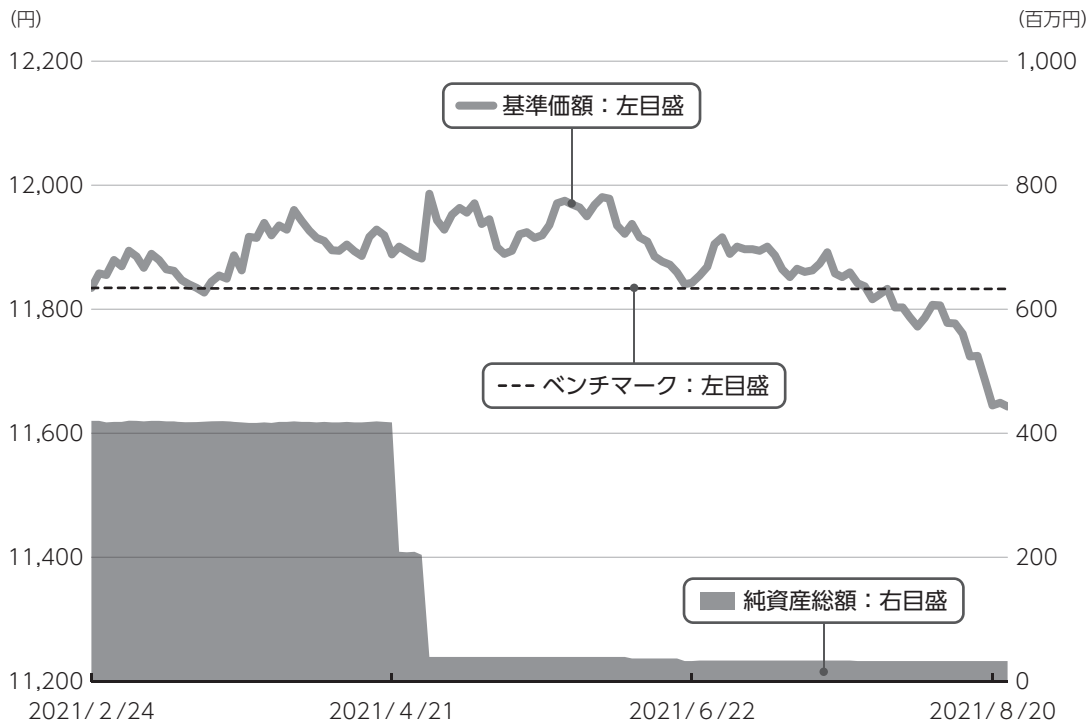
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

# 運用経過

第31期：2021年2月25日～2021年8月24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31期首	11,834円
第31期末	11,643円
既払分配金	0円
騰落率	-1.6%

※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

基準価額は期首に比べ1.6%の下落となりました。

### ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.0%）を1.6%下回りました。

## 基準価額の主な変動要因

### 上昇要因

リビジョンファクター（利益予想等の変化が相対的に高い銘柄に投資する戦略）やクレジットファクター（企業の財務健全性が高い銘柄に投資する戦略）、解約に伴う信託財産留保金の計上などがプラスに寄与し、基準価額の上昇要因となりました。

### 下落要因

リターン・リバーサルファクター（過去株価が下落した銘柄の株価が、その後反転し上昇する傾向に着目した戦略）や短期グロースファクター（企業収益の実績値に対する予想値の伸び率が大きい銘柄に投資する戦略）、個別銘柄要因などがマイナスに影響し、基準価額の下落要因となりました。

第31期：2021年2月25日～2021年8月24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。

期首から2021年3月下旬にかけては、堅調な米国雇用統計や米国の追加経済対策に対する期待に加え、為替の円安・米ドル高傾向の持続などから上昇しました。その後、期末にかけては、米連邦準備制度理事会（FRB）議長の緩和的な金融

政策継続姿勢や、ナスダック総合指数など米国株式市況が過去最高値を更新したことを受けて国内株式市況も上昇する場面が見られたものの、中国景気の減速懸念の高まりや新型コロナウイルス感染者数の増加と緊急事態宣言の発令などが嫌気されて、国内株式市況は一進一退の展開となりました。

## 当該投資信託のポートフォリオについて

### 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド受益証券を主要投資対象としています。運用の基本方針にしたがい、マザーファンドの組入比率は高位を維持しました。

### 日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

わが国の株式を主要投資対象とし、割安度、成長性といった投資尺度の中から、計量モデルを用いて決定された最適と推測される投資尺度により株式への投資を行い、同時に株式の信用取引等を活用することにより株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、ベンチマーク（無担

保コール翌日物レート（指数化）を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行いました。

当期は、計量モデルによって導き出された結果が妥当と判断し、期首は、長期グロースファクター（企業収益等の過去の成長率が高い銘柄に投資する戦略）やクレジットファクターへの投資ウェイトを高めたポートフォリオの構築を行いました。その後、期末にかけて、長期グロースファクターやクレジットファクターへの投資ウェイトを低下させた一方、短期グロースファクターやフローバリューファクター（企業収益に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）への投資ウェイトを高めたポートフォリオ構築を行いました。

組入比率は、期を通じてロングとショートそれぞれの組入比率を、純資産総額に対して概ね75～85%程度で推移させ、ロングとショートの内容をほぼ同等とし

た結果、株式市況が上昇・下落することによる基準価額への影響をほぼ排除することができました。

## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

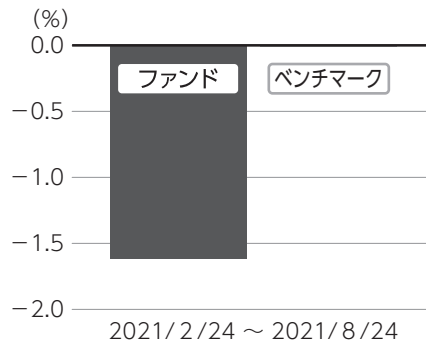
### ▶ 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.0%）を1.6%下回りました。

マザーファンドの基準価額がベンチマークを2.1%下回ったことがマイナス要因となりました。

リターン・リバーサルファクターや短期グロースファクター、個別銘柄要因などがマイナスに影響したことから基準価額は下落し、ベンチマークを下回りました。

### 基準価額（ベビーファンド）とベンチマークの対比（騰落率）



## 分配金について

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

### 分配原資の内訳

（単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第31期
	2021年2月25日～2021年8月24日
当期分配金（対基準価額比率）	-（-%）
当期の収益	-
当期の収益以外	-
翌期繰越分配対象額	3,511

（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。）

### ▶ 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド受益証券を高位に組み入れて運用する方針です。

### ▶ 日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

信用取引等の活用により、わが国の株式市場全体の上昇・下落に左右されない安定的な収益の確保をめざします。

2021年2月25日～2021年8月24日

## 1万口当たりの費用明細

項目	当期		項目の概要
	金額 (円)	比率 (%)	
(a) 信託報酬	66	0.557	(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）	( 57)	(0.477)	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）	( 3)	(0.027)	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）	( 6)	(0.053)	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) その他費用	218	1.832	(b) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
（監査費用）	( 0)	(0.001)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
（その他）	(218)	(1.831)	信託事務の処理等に要するその他諸費用（株式信用取引に要する品借料、配当調整金の支払い等）
合計	284	2.389	

期中の平均基準価額は、11,878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) 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。

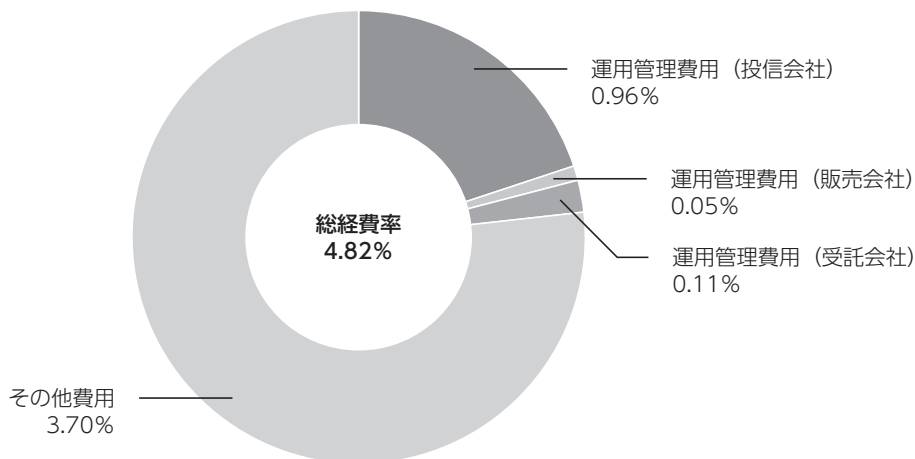
(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## （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4.82%**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

(2021年2月25日～2021年8月24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
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	千口 2,706	千円 3,901	千口 271,763	千円 391,815

## ○株式売買比率

(2021年2月25日～2021年8月24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	
	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	45,126,219千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,957,386千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.48	

(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

(2021年2月25日～2021年8月24日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）&gt;

該当事項はございません。

&lt;日本株マーケットニュートラル・マザーファンド&gt;

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 21,547	百万円 14	% 0.1	百万円 23,578	百万円 —	% —

平均保有割合 0.9%

※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

<日本株マーケットニュートラル・マザーファンド>

種 類	買 付 額
株式	百万円 60

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、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

○組入資産の明細

(2021年8月24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
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	千口 292,034	千口 22,977	千円 32,269

○投資信託財産の構成

(2021年8月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	千円 32,269	% 97.0
コール・ローン等、その他	1,002	3.0
投資信託財産総額	33,271	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2021年8月24日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	33,271,148
コール・ローン等	1,002,049
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド(評価額)	32,269,099
(B) 負債	928,485
未払信託報酬	926,256
未払利息	1
その他未払費用	2,228
(C) 純資産総額(A－B)	32,342,663
元本	27,779,794
次期繰越損益金	4,562,869
(D) 受益権総口数	27,779,794口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,643円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 354,873,626円  
 期中追加設定元本額 3,657,603円  
 期中一部解約元本額 330,751,435円  
 また、1口当たり純資産額は、期末11,643円です。

## ②分配金の計算過程

項 目	2021年2月25日～ 2021年8月24日
費用控除後の配当等収益額	－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	－円
収益調整金額	9,066,308円
分配準備積立金額	688,162円
当ファンドの分配対象収益額	9,754,470円
1万口当たり収益分配対象額	3,511円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金金額	－円

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

## ○損益の状況（2021年2月25日～2021年8月24日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 26
支払利息	△ 26
(B) 有価証券売買損益	189,237
売買益	1,260,085
売買損	△1,070,848
(C) 信託報酬等	△ 928,484
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 739,273
(E) 前期繰越損益金	△1,130,429
(F) 追加信託差損益金	6,432,571
(配当等相当額)	( 9,045,941)
(売買損益相当額)	(△2,613,370)
(G) 計(D+E+F)	4,562,869
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	4,562,869
追加信託差損益金	6,432,571
(配当等相当額)	( 9,066,308)
(売買損益相当額)	(△2,633,737)
分配準備積立金	688,162
繰越損益金	△2,557,864

- (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。

# 日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

## 《第35期》決算日2021年8月24日

〔計算期間：2021年2月25日～2021年8月24日〕

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」は、8月24日に第35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35期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	割安度、成長性といった投資尺度の中から、計量モデルを用いて決定された最適と推測される投資尺度により株式への投資を行います。同時に株式の信用取引等を活用することにより株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、安定した収益の確保をめざして運用を行います。無担保コール翌日物レート（指数化）をベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。
主要運用対象	わが国の株式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		無担保コール翌日物レート（指数化）		株式組入比率	信用取引率	株式先物比率	純資産総額
	期騰落率	期中騰落率	期騰落率	期中騰落率				
	円	%		%	%	%	%	百万円
31期(2019年8月26日)	14,673	△0.6	101.73	△0.0	79.8	△79.9	—	12,772
32期(2020年2月25日)	14,335	△2.3	101.71	△0.0	70.2	△69.5	—	17,417
33期(2020年8月24日)	15,029	4.8	101.69	△0.0	83.6	△82.1	—	15,686
34期(2021年2月24日)	14,344	△4.6	101.68	△0.0	80.2	△80.2	—	17,161
35期(2021年8月24日)	14,044	△2.1	101.67	△0.0	78.9	△79.1	—	15,129

(注) 無担保コール翌日物レートとは、金融機関同士が短期資金の貸借を行うコール市場において、翌日返済とした無担保取引の際の金利をいいます。無担保コール翌日物レート（指数化）は無担保コール翌日物レートをもとに委託会社が計算したものです。

(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		無 担 保 日 物 レー	コ ー ル ト (指 数 化)	株 組 入 比 率	信 用 取 引 率 比	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率					
(期 首) 2021年2月24日	円	%	101.68	%	%	%	%
2月末	14,344	—	101.68	—	80.2	△80.2	—
3月末	14,370	0.2	101.68	△0.0	78.3	△78.1	—
4月末	14,482	1.0	101.68	△0.0	82.4	△81.5	—
5月末	14,359	0.1	101.67	△0.0	80.3	△80.4	—
6月末	14,404	0.4	101.67	△0.0	80.5	△80.0	—
7月末	14,332	△0.1	101.67	△0.0	82.4	△82.2	—
8月末	14,263	△0.6	101.67	△0.0	79.3	△79.5	—
(期 末) 2021年8月24日	円	%	101.67	%	%	%	%
	14,044	△2.1	101.67	△0.0	78.9	△79.1	—

(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

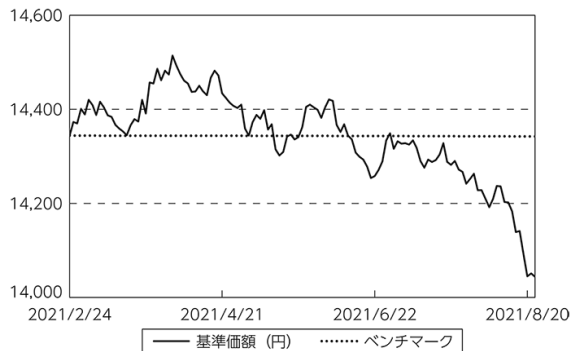
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ2.1%の下落となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.0%)を2.1%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)

リビジョンファクター（利益予想等の変化が相対的に高い銘柄に投資する戦略）やクレジットファクター（企業の財務健全性が高い銘柄に投資する戦略）などがプラスに寄与し、基準価額の上昇要因となりました。

## (下落要因)

リターン・リバーサルファクター（過去株価が下落した銘柄の株価が、その後反転し上昇する傾向に着目した戦略）や短期グロースファクター（企業収益の実績値に対する予想値の伸び率が大きい銘柄に投資する戦略）、個別銘柄要因などがマイナスに影響し、基準価額の下落要因となりました。

## ●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。
- ・期首から2021年3月下旬にかけては、堅調な米国雇用統計や米国の追加経済対策に対する期待に加え、為替の円安・米ドル高傾向の持続などから上昇しました。その後、期末にかけては、

米連邦準備制度理事会（FRB）議長の緩和的な金融政策継続姿勢や、ナスダック総合指数など米国株式市況が過去最高値を更新したことを受けて国内株式市況も上昇する場面が見られたものの、中国景気の減速懸念の高まりや新型コロナウイルス感染者数の増加と緊急事態宣言の発令などが嫌気されて、国内株式市況は一進一退の展開となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・わが国の株式を主要投資対象とし、割安度、成長性といった投資尺度の中から、計量モデルを用いて決定された最適と推測される投資尺度により株式への投資を行い、同時に株式の信用取引等を活用することにより株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行いました。
- ・当期は、計量モデルによって導き出された結果が妥当と判断し、期首は、長期グロースファクター（企業収益等の過去の成長率が高い銘柄に投資する戦略）やクレジットファクターへの投資ウェイトを高めたポートフォリオの構築を行いました。その後、期末にかけて、長期グロ-

スファクターやクレジットファクターへの投資ウェイトを低下させた一方、短期グロースファクターやフローバリューファクター（企業収益に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）への投資ウェイトを高めたポートフォリオ構築を行いました。

- ・組入比率は、期を通じてロングとショートそれぞれの組入比率を、純資産総額に対して概ね75～85%程度で推移させ、ロングとショートの金額をほぼ同等とした結果、株式市況が上昇・下落することによる基準価額への影響をほぼ排除することができました。

●当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・リターン・リバーサルファクターや短期グロースファクター、個別銘柄要因などがマイナスに影響したことから基準価額は下落し、ベンチマークを下回りました。

○今後の運用方針

- ・信用取引等の活用により、わが国の株式市場全体の上昇・下落に左右されない安定的な収益の確保をめざします。

## ○1万口当たりの費用明細

(2021年2月25日～2021年8月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) そ の 他 費 用 ( そ の 他 )	円 155 (155)	% 1.078 (1.078)	(a)その他費用=期中のその他費用÷期中の平均受益権口数  信託事務の処理等に要するその他諸費用(株式信用取引に要する品借料、配当調整金の支払い等)
合 計	155	1.078	
期中の平均基準価額は、14,342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

(2021年2月25日～2021年8月24日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国	上場	千株	千円	千株	千円
内		10,000 ( 61)	21,547,433 ( )	10,365	23,578,786

(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。

## ○株式売買比率

(2021年2月25日～2021年8月24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	45,126,219千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	12,957,386千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	3.48

(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

(2021年2月25日～2021年8月24日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %

## 利害関係人である金融商品取引業者が主幹事となって発行される有価証券

種 類	買 付 額
株式	百万円 60

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、モルガン・スタンレーMUF G証券です。

## ○組入資産の明細

(2021年8月24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
<b>水産・農林業 (0.3%)</b>				
サカタのタネ	7	9	32,625	
<b>鉱業 (—%)</b>				
石油資源開発	17	—	—	
<b>建設業 (4.8%)</b>				
ショーボンドホールディングス	—	7	34,545	
第一カッター興業	14	—	—	
安藤・間	40	40	32,800	
東急建設	50	—	—	
高松コンストラクショングループ	12	12	24,360	
東建コーポレーション	3	3	29,760	
大成建設	32	22	77,440	
飛鳥建設	25	18	19,530	
長谷工コーポレーション	25	—	—	
鹿島建設	70	—	—	
三井住友建設	60	70	32,690	
前田建設工業	—	29	23,229	
東鉄工業	8	—	—	
熊谷組	—	10	26,780	
東亜道路工業	3	—	—	
東亜建設工業	—	9	20,700	
住友林業	14	—	—	
大和ハウス工業	40	29	96,019	
ライト工業	15	15	28,350	
日特建設	29	7	5,054	
ユアテック	—	25	17,600	
関電工	25	—	—	
きんでん	15	—	—	
住友電設	12	12	25,560	
九電工	—	8.5	32,810	
太平電業	—	9	24,327	
大気社	10	—	—	
日比谷総合設備	6	12	22,848	

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
<b>食料品 (5.3%)</b>				
中部飼料	18.5	18.5	20,775	
DM三井製糖ホールディングス	13	16	31,504	
江崎グリコ	—	7	29,680	
名糖産業	6	—	—	
不二家	10	—	—	
寿スピリッツ	—	4.5	29,880	
カルビー	28	—	—	
明治ホールディングス	—	14	94,920	
雪印メグミルク	12	—	—	
丸大食品	15	10	17,610	
S Foods	9.5	9.5	31,065	
アサヒグループホールディングス	—	17	88,111	
キリンホールディングス	40	40	80,020	
宝ホールディングス	—	19	25,840	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	—	16	24,608	
伊藤園	15	—	—	
アリアケジャパン	4	5	31,450	
東洋水産	20	—	—	
日本たばこ産業	—	40	85,420	
ケンコーマヨネーズ	4	4	6,172	
わらべや日洋ホールディングス	—	15	33,285	
理研ビタミン	13	—	—	
<b>繊維製品 (1.4%)</b>				
東洋紡	20	—	—	
帝人	—	20	31,500	
東レ	—	140	102,494	
ワールド	20	20	27,060	
ゴールドウイン	3	—	—	
デサント	18	—	—	
<b>パルプ・紙 (0.3%)</b>				
北越コーポレーション	—	60	35,280	
レンゴー	26	—	—	
ザ・バック	4	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
<b>化学 (8.2%)</b>			
クラレ	—	30	30,660
昭和電工	14	12	30,072
住友化学	—	135	73,980
石原産業	40	—	—
日本曹達	10.2	—	—
東ソー	60	40	78,600
トクヤマ	15	—	—
セントラル硝子	15	—	—
東亜合成	—	20	24,860
大阪ソーダ	12	—	—
関東電化工業	—	31	31,589
堺化学工業	—	11	22,583
第一稀元素化学工業	35	—	—
エア・ウォーター	—	18	32,310
日本パーカライジング	33	20	22,860
四国化成工業	15	—	—
日本触媒	—	6.5	36,725
三菱瓦斯化学	45	—	—
J S R	28	—	—
大阪有機化学工業	—	7	25,585
三菱ケミカルホールディングス	150	—	—
KHネオケム	13	—	—
ダイセル	—	35	30,415
日本ゼオン	—	20	29,060
アイカ工業	7	7	25,900
宇部興産	20	—	—
積水樹脂	—	6	12,864
リケンテクノス	43	53	30,316
積水化成工業	21	—	—
ダイキョーニシカワ	22	—	—
ADEKA	18	18	41,148
日本ペイントホールディングス	10	—	—
太陽ホールディングス	—	6	35,700
D I C	12	—	—
ライオン	—	50	93,950
マンダム	19	14	23,044
コーセー	5.5	7	95,130

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ポーラ・オルビスホールディングス	40	—	—
長谷川香料	13	10	27,660
デクセリアルズ	—	14	29,554
クミアイ化学工業	—	35	31,815
日本農薬	30	50	26,950
日東電工	9	—	—
J S P	—	6	9,606
信越ポリマー	20.9	30	28,740
バルカー	15.5	—	—
<b>医薬品 (4.6%)</b>			
武田薬品工業	—	25	93,100
アステラス製薬	—	48	89,328
大日本住友製薬	—	35	66,990
塩野義製薬	16	—	—
日本新薬	11	—	—
科研製薬	8	—	—
エーザイ	15	—	—
小野薬品工業	25	—	—
参天製薬	30	60	98,340
キッセイ薬品工業	12	—	—
生化学工業	15	29	32,654
鳥居薬品	3	13	37,141
J C R ファーマ	—	10	30,200
富士製薬工業	—	9	10,179
沢井製薬	4.5	—	—
大幸薬品	17	28	25,200
ペプチドリーム	20	18	71,100
<b>石油・石炭製品 (1.2%)</b>			
ニチレキ	16	19	23,902
出光興産	52	35	91,035
コスモエネルギーホールディングス	13	13	28,262
<b>ゴム製品 (0.4%)</b>			
ニッタ	13	13	34,970
住友理工	—	22	15,246
<b>ガラス・土石製品 (1.7%)</b>			
A G C	27	—	—
日本板硝子	—	45	24,795
オハラ	18	17	22,287

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
東海カーボン	14	22	31,768	
日本カーボン	7	—	—	
ノリタケカンパニーリミテド	5	7.5	30,450	
日本碍子	47	50	88,700	
品川リフラクトリーズ	5	—	—	
黒崎播磨	—	2	9,500	
ニチハ	7	—	—	
<b>鉄鋼 (1.9%)</b>				
日本製鉄	55	42	82,845	
神戸製鋼所	—	44	28,380	
ジェイ エフ イー ホールディングス	80	—	—	
東京製鐵	40	27	29,322	
共英製鋼	20	12	16,512	
大阪製鐵	13	5	5,730	
大同特殊鋼	—	6	28,920	
山陽特殊製鋼	20	—	—	
愛知製鋼	11	11	29,645	
<b>非鉄金属 (2.6%)</b>				
三井金属鉱業	—	8.5	27,412	
三菱マテリアル	18	12	25,644	
DOWAホールディングス	5	7.5	33,562	
東邦チタニウム	—	23	24,817	
UACJ	—	13	33,189	
古河電気工業	12	12	27,312	
住友電気工業	—	60	85,950	
フジクラ	—	62	38,936	
タツタ電線	—	30	15,390	
<b>金属製品 (0.9%)</b>				
稲葉製作所	—	14	19,922	
トーカロ	20	20	26,180	
横河ブリッジホールディングス	15	—	—	
リンナイ	10	—	—	
岡部	—	31	20,274	
東プレ	—	20	26,480	
高周波熱錬	20	—	—	
バイオラックス	12	—	—	
中央発條	—	15	16,230	
<b>機械 (10.1%)</b>				
ツガミ	—	20	31,340	

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
オークマ	6	6	30,660	
アマダ	80	—	—	
F U J I	27	—	—	
牧野フライス製作所	7	—	—	
ディスコ	—	2.7	84,915	
日進工具	10	—	—	
オプトラン	14	13	28,626	
ヤマシンフィルタ	28	45	26,775	
マルマエ	21	13	25,766	
三井海洋開発	16	—	—	
レオン自動機	16	—	—	
SMC	2	1.5	104,100	
ホソカワミクロン	—	4.5	29,295	
日精エー・エス・ビー機械	5	7	28,700	
技研製作所	—	7	32,305	
日精樹脂工業	—	19	21,261	
小松製作所	30	—	—	
住友重機械工業	18	12	34,764	
ローツェ	—	4	31,560	
月島機械	16	—	—	
新東工業	29	20	15,500	
澁谷工業	—	10	29,640	
ダイキン工業	—	3	80,130	
椿本チエイン	10	—	—	
アネスト岩田	26	24	24,336	
タダノ	—	30	34,950	
CKD	—	11	24,651	
キトー	—	4	6,832	
フクシマガリレイ	5	7	33,250	
竹内製作所	14	12	31,368	
アマノ	12	—	—	
新晃工業	17	—	—	
リケン	15	15	37,785	
T P R	20	—	—	
ツバキ・ナカシマ	—	15	21,345	
ホシザキ	—	8	82,160	
大豊工業	—	20	16,740	
日本精工	90	100	76,800	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
NTN	—	90	22,140
ジェイテクト	36	—	—
日本トムソン	—	45	25,065
THK	30	—	—
日本ビラー工業	—	10	24,310
マキタ	21	—	—
三菱重工業	—	29	83,723
スター精密	20	20	30,640
<b>電気機器 (11.1%)</b>			
ミネベアミツミ	—	33	93,291
三菱電機	50	—	—
安川電機	18	—	—
山洋電気	—	4	27,360
ヤママン	16	20	20,920
大崎電気工業	30	30	16,590
日東工業	12	—	—
I D E C	16	16	34,288
サンケン電気	—	7	36,400
アイホン	—	6	12,060
ルネサスエレクトロニクス	70	85	98,345
セイコーエプソン	57	—	—
アルバック	—	6	34,500
能美防災	12	14	29,302
エレコム	6	16	27,408
パナソニック	—	70	87,780
タムラ製作所	40	—	—
アルプスアルパイン	21	26	28,704
ローランド ディー. ジー.	10	—	—
ホシデン	35	25	22,575
日本航空電子工業	20	16	25,664
スミダコーポレーション	25	—	—
リオン	—	5	12,685
新電元工業	12	9	36,990
アドバンテスト	11	6	54,300
キーエンス	—	1.7	111,792
日置電機	4	—	—
シスメックス	7.5	8	97,880
OBARA GROUP	—	8	29,960

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
コーセル	—	14	14,196
ウシオ電機	20	—	—
ファナック	—	4	94,140
日本シイエムケイ	63	—	—
エンプラス	—	5	15,800
三井ハイテック	—	5.5	35,255
新光電気工業	—	8	27,840
太陽誘電	—	6	34,800
日本ケミコン	—	14	30,688
KO A	—	19	29,393
市光工業	—	25	15,725
小糸製作所	18.5	—	—
キヤノン	45	—	—
リコー	—	80	87,840
<b>輸送用機器 (5.2%)</b>			
トヨタ紡織	10	—	—
ユニプレス	31	—	—
三櫻工業	35	22	24,156
東海理化電機製作所	10	16	25,424
三菱ロジスネクスト	—	30	26,910
いすゞ自動車	—	70	93,730
トヨタ自動車	7.5	—	—
日野自動車	100	—	—
武蔵精密工業	20	—	—
日産車体	25	8	5,784
トビー工業	17	19	21,489
ティラド	—	10	30,150
タチエス	20	—	—
NOK	—	19	25,194
プレス工業	85	—	—
アイシン	38	22	89,210
マツダ	—	70	64,610
今仙電機製作所	25	—	—
SUBARU	27.4	27.4	55,306
ヤマハ発動機	45	31	79,515
豊田合成	—	12	27,684
エフ・シー・シー	19	19	28,025
シマノ	4.2	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ティ・エス テック	—	19	27,911
<b>精密機器 (2.4%)</b>			
日本エム・ディ・エム	13.5	—	—
島津製作所	22	—	—
長野計器	—	16	16,928
ブイ・テクノロジー	5	—	—
東京精密	—	6	28,140
ニコン	40	30	33,660
オリンパス	—	45	102,645
理研計器	8	5	13,625
ノーリツ鋼機	—	11	26,829
エー・アンド・デイ	30	20	21,060
朝日インテック	27.1	—	—
シチズン時計	95	95	44,935
<b>その他製品 (1.7%)</b>			
バンダイナムコホールディングス	11.6	—	—
フランスベッドホールディングス	—	18	16,704
パイロットコーポレーション	10	8	34,040
大建工業	—	9	21,051
N I S S H A	22	20	34,420
TAKARA & COMPANY	12	12	20,772
ヤマハ	13	—	—
ビジョン	22	—	—
任天堂	1.5	—	—
コクヨ	20	19	37,202
グローブライド	7	4	32,960
<b>電気・ガス業 (—%)</b>			
レノバ	8	—	—
<b>陸運業 (5.4%)</b>			
SBSホールディングス	—	10	38,250
東武鉄道	43	—	—
相鉄ホールディングス	10	—	—
小田急電鉄	—	33	86,526
東海旅客鉄道	—	6.5	105,365
ハマキョウウレックス	—	10	32,650
阪急阪神ホールディングス	—	26	86,840
南海電気鉄道	—	9	21,438
京阪ホールディングス	27	10	30,100

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
名古屋鉄道	46	17	32,283
山陽電気鉄道	—	4.5	8,869
日本通運	—	12	89,520
丸全昭和運輸	4	8.5	28,730
センコーグループホールディングス	—	25	24,800
ニッコンホールディングス	15	10	23,550
セイノーホールディングス	20	25	35,175
丸和運輸機関	15	—	—
九州旅客鉄道	60	—	—
<b>海運業 (1.5%)</b>			
日本郵船	—	12	93,840
商船三井	—	7	50,050
川崎汽船	—	7	34,510
<b>倉庫・運輸関連業 (0.2%)</b>			
日新	17	—	—
住友倉庫	—	15	26,295
<b>情報・通信業 (5.8%)</b>			
ソフトクリエイティブホールディングス	9	—	—
ブレインパッド	7	7	33,810
システム情報	—	15	13,890
S H I F T	2.7	—	—
コムチュア	—	11	29,645
メディカル・データ・ビジョン	12	—	—
テラスカイ	9	—	—
ネオジャパン	10	—	—
ダブルスタンダード	6.5	6.5	47,710
U b i c o mホールディングス	7	—	—
チェンジ	8	9	20,367
オロ	—	5.5	18,397
ユーザーローカル	6	—	—
インテージホールディングス	—	12	17,124
ソースネクスト	70	—	—
インフォコム	9	11	25,762
オービック	6	4	85,280
ジャストシステム	4	5	30,900
伊藤忠テクノソリューションズ	—	26	88,010
アイティフォー	18	—	—
サイボウズ	—	10	23,550

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
ネットワンシステムズ	—	8	—	27,800
兼松エレクトロニクス	8	8	—	29,320
TBSホールディングス	—	15	—	24,300
日本テレビホールディングス	31	—	—	—
光通信	—	4	—	75,720
ファイバーゲート	—	16	—	26,640
東宝	11	—	—	—
シーイーシー	18	16	—	25,392
アイネス	20	20	—	29,560
TKC	—	5	—	18,275
ソフトバンクグループ	9	—	—	—
<b>卸売業 (4.1%)</b>				
双日	100	70	—	22,540
神戸物産	17	—	—	—
あい ホールディングス	12	14.5	—	31,943
バイタルケーエスケー・ホールディングス	—	30	—	23,820
三洋貿易	19	—	—	—
ウイン・パートナーズ	—	11	—	11,011
コマダホールディングス	13	13	—	26,234
萩原電気ホールディングス	1.7	—	—	—
ドウシシャ	13	17	—	29,036
高速	10	10	—	16,160
日本ライフライン	21	21	—	28,035
IDOM	45	—	—	—
進和	10	7.5	—	17,167
白銅	—	7.5	—	18,030
長瀬産業	—	14	—	25,004
兼松	23	—	—	—
カメイ	—	11	—	12,749
スターゼン	4.5	—	—	—
住友商事	90	60	—	91,740
第一実業	—	4	—	18,800
ユアサ商事	—	6	—	17,874
菱電商事	5	—	—	—
東邦ホールディングス	11	—	—	—
加賀電子	13	—	—	—
加藤産業	6	—	—	—
日伝	10	—	—	—

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
ミスミグループ本社	—	22	—	95,810
<b>小売業 (9.9%)</b>				
サンエー	7.5	7.5	—	30,787
エービーシー・マート	16	15	—	88,800
アダストリア	15	—	—	—
くら寿司	—	4	—	16,560
バルグループホールディングス	20	16	—	24,704
エディオン	20	25	—	26,000
ハローズ	—	8	—	23,792
クオールホールディングス	18	18	—	28,296
DCMホールディングス	20	25	—	27,175
MonotaRO	16	—	—	—
アークランドサービスホールディングス	13.6	13.6	—	29,865
J. フロント リテイリング	22	30	—	28,230
マツモトキヨシホールディングス	—	8	—	40,960
ブロンコビリー	10	—	—	—
物語コーポレーション	3	6	—	36,780
ココカラファイン	5	—	—	—
ウエルシアホールディングス	—	25	—	102,000
オイシックス・ラ・大地	8	—	—	—
ネクステージ	14	18	—	41,004
ヨシックスホールディングス	7.5	4.5	—	9,423
セブン&アイ・ホールディングス	26	20	—	100,660
クリエイト・レストランツ・ホールディング	22	—	—	—
ツルハホールディングス	6.5	—	—	—
トリドールホールディングス	—	15	—	33,225
TOKYO BASE	50	—	—	—
JMホールディングス	13	—	—	—
バロックジャパンリミテッド	13	—	—	—
FOOD & LIFE COMPANIE	12	8	—	35,440
エコス	9	—	—	—
バン・パシフィック・インターナショナルホ	—	40	—	87,280
VTホールディングス	—	50	—	26,800
ユナイテッドアローズ	15	12	—	20,772
ハイデイ日高	12	—	—	—
ピーシーデポコーポレーション	35	—	—	—
壱番屋	5	—	—	—
スクロール	18	—	—	—

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
日本瓦斯	2	—	—	—
AOKIホールディングス	—	35	21,525	—
青山商事	—	35	22,505	—
高島屋	—	25	27,725	—
イズミ	—	8.5	30,600	—
平和堂	—	14	31,416	—
ヤオコー	4	—	—	—
ゼビオホールディングス	—	24	25,608	—
Genky DrugStores	7.5	—	—	—
アインホールディングス	—	4.5	33,255	—
アークランドサカモト	21	21	31,731	—
ニトリホールディングス	2	—	—	—
パローホールディングス	—	10	24,730	—
ベルク	5	—	—	—
ファーストリテイリング	—	1	73,460	—
ベルーナ	20	—	—	—
<b>不動産業 (1.7%)</b>				
ヒューリック	95	—	—	—
飯田グループホールディングス	—	38	101,194	—
ケイアイスター不動産	—	6	30,780	—
三井不動産	46	—	—	—
イオンモール	—	20	33,060	—
カチタス	10	10	36,550	—
<b>サービス業 (7.3%)</b>				
ジェイエイシーリクルートメント	—	10	17,840	—
日本M&Aセンター	15	30	99,900	—
メンバーズ	—	8	25,360	—
UTグループ	10	10	28,980	—
夢真ビーネックスグループ	—	20	23,040	—
バソナグループ	—	10	25,230	—
GCA	25	—	—	—
パーソルホールディングス	30	—	—	—
スタジオアリス	5	—	—	—
セントケア・ホールディング	30	—	—	—
エムスリー	8	11	81,367	—
アウトソーシング	21	21	37,002	—

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
博報堂DYホールディングス	—	50	88,850	—
WDBホールディングス	5	—	—	—
E P Sホールディングス	20	—	—	—
クイック	6	—	—	—
電通グループ	18	—	—	—
イオンファンタジー	—	11	19,899	—
H. U. グループホールディングス	10	10	33,100	—
ダスキン	7	—	—	—
リソー教育	—	70	27,580	—
ユー・エス・エス	41	—	—	—
東京個別指導学院	—	25	14,850	—
フルキャストホールディングス	17	—	—	—
エン・ジャパン	12	6	21,300	—
アイ・アールジャパンホールディングス	1.5	1.8	21,690	—
Ke e P e r 技研	12	8	28,360	—
M&Aキャピタルパートナーズ	4	5	25,200	—
ライドオンエクスプレスホールディングス	13	—	—	—
シグマシス	15	12	26,784	—
メドピア	5	6	23,220	—
リクルートホールディングス	26	—	—	—
エラン	—	17	19,329	—
エアトリ	—	10	25,100	—
ストライク	6	7	26,705	—
インソース	14	—	—	—
ペイカレント・コンサルティング	2	1.1	55,220	—
グレイステクノロジー	—	18	18,396	—
ジャパンエレベーターサービスホールディン	13	—	—	—
日総工産	—	15	11,055	—
プロレド・パートナーズ	7.5	—	—	—
スバル興業	1.5	—	—	—
東京都競馬	6	—	—	—
応用地質	—	9	11,556	—
ダイセキ	—	6	32,100	—
合 計	株 数 ・ 金 額	6,553	6,249	11,937,054
	銘柄数<比率>	320	316	<78.9%>

(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。



## ○信用取引の状況

(2021年8月24日現在)

銘柄	信用取引売建残高	
	当期末	
	株数	評価額
信用取引売建	千株 5,855	千円 11,964,176

## ○投資信託財産の構成

(2021年8月24日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 11,937,054	% 42.6
コール・ローン等、その他	16,062,166	57.4
投資信託財産総額	27,999,220	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年8月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	35,252,356,532
コール・ローン等	3,714,321,517
株式(評価額)	11,937,054,500
信用取引預け金	11,563,470,288
未収入金	768,647,927
未収配当金	15,726,250
差入保証金	7,253,136,050
(B) 負債	20,123,188,578
信用売証券	11,964,176,100
未払金	878,303,106
未払利息	3,787
差入保証金代用有価証券	7,253,136,050
その他未払費用	27,569,535
(C) 純資産総額(A-B)	15,129,167,954
元本	10,772,731,703
次期繰越損益金	4,356,436,251
(D) 受益権総口数	10,772,731,703口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,044円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 11,963,677,212円  
 期中追加設定元本額 838,995,691円  
 期中一部解約元本額 2,029,941,200円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.4044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)

MUAM 日本株マーケットニュートラル・ファンド(適格機関投資家限定)	5,595,637,167円
MUKAM 日本株マーケットニュートラル・ファンド2019-11(適格機関投資家限定)	3,417,730,404円
ヘッジファンドセレクション(ラップ向け)	1,544,217,504円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	109,870,474円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	52,211,459円
百戦錬磨の名人ファンド	30,087,552円
日本株プライムニュートラル・ファンド(ラップ向け)	22,977,143円
合計	10,772,731,703円

## ③担保資産

信用取引に係る差入保証金代用有価証券として以下の通り差入を行っております。  
 株式 7,244,543,250円

## ○損益の状況 (2021年2月25日～2021年8月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	147,751,231
受取配当金	148,060,250
受取利息	2,568
その他収益金	3,359
支払利息	△ 314,946
(B) 有価証券売買損益	△ 290,811,853
売買益	2,755,305,885
売買損	△3,046,117,738
(C) 保管費用等	△ 171,569,556
(D) 当期損益金(A+B+C)	△ 314,630,178
(E) 前期繰越損益金	5,197,391,317
(F) 追加信託差損益金	363,772,593
(G) 解約差損益金	△ 890,097,481
(H) 計(D+E+F+G)	4,356,436,251
次期繰越損益金(H)	4,356,436,251

- (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) (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。