

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。	
	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。）	

※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32期（決算日：2022年2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2月24日に第32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	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
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
32期(2022年2月24日)	11,663	0	0.2	101.65	△0.0	77.3	△77.4	—	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8月24日	11,643	—	101.67	—	78.7	△78.9	—
8月末	11,705	0.5	101.66	△0.0	79.8	△79.4	—
9月末	11,707	0.5	101.66	△0.0	78.4	△78.1	—
10月末	11,681	0.3	101.66	△0.0	78.2	△77.9	—
11月末	11,727	0.7	101.66	△0.0	72.0	△71.3	—
12月末	11,770	1.1	101.65	△0.0	77.9	△77.4	—
2022年1月末	11,674	0.3	101.65	△0.0	73.2	△73.4	—
(期末)							
2022年2月24日	11,663	0.2	101.65	△0.0	77.3	△77.4	—

(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32期：2021年8月25日～2022年2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32期首	11,643円
第32期末	11,663円
既払分配金	0円
騰落率	0.2%

※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0.2%の上昇となりました。

ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.0%）を0.2%上回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

ストックバリューファクター（企業の資産価値に対し株価が割安な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

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）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

国内株式市況は下落しました。

期首から2021年9月中旬にかけては、菅首相の自民党総裁選不出馬報道や次期政権の経済対策への期待の高まりなどから上昇しました。その後、新型コロナウイルスの変異株の広まりから経済再開が遅れるとの懸念の高まりなどから下落に転

じました。期末にかけては、世界的にインフレ率が上昇していることを受けて米連邦準備制度理事会（FRB）の利上げや資産圧縮が早期に進むとの観測から米長期金利が急上昇し米国株式市況が下落に転じたことなどから国内株式市況は下値を探る展開となりました。

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、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）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の構築を行いました。期中は、短期グロースファクターやフローバリューファクターへの投資ウェイトを低下させて各ファクターに分散したポートフォリオ構築を行いました。その後、期末にかけては、再び短期グロースファクターやフローバリューファク

ター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70～80%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。

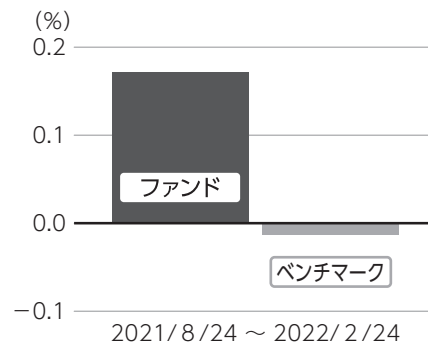
当投資信託のベンチマークとの差異について

▶ 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0.2%上回りました。マザーファンドの基準価額がベンチマークを0.8%上回ったことがプラス要因となりました。

ストックバリューファクターやクレジットファクターのファクター要因がプラスに寄与したことから基準価額は上昇し、ベンチマークを上回りました。

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32期
	2021年8月25日～2022年2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	3,536

(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8月25日～2022年2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	68	0.582	(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)	(58)	(0.499)	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)	(0.028)	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)	(0.055)	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	0.000	(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)	
(c) その他費用	100	0.853	(c) その他費用 = 期中のその他費用 ÷ 期中の平均受益権口数
(監 査 費 用)	(0)	(0.001)	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)	(100)	(0.851)	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	168	1.435	

期中の平均基準価額は、11,705円です。

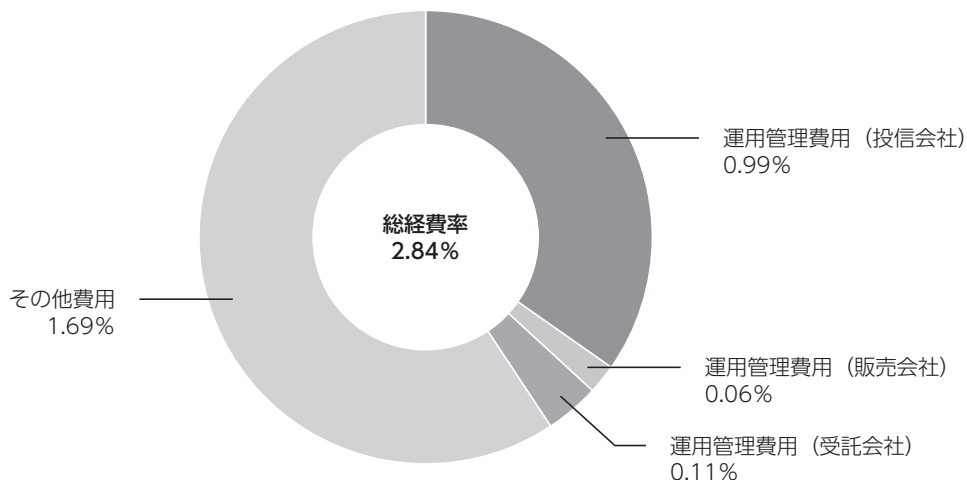
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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2.84%**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8月25日～2022年2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 699	千円 985	千口 444	千円 628

○株式売買比率

(2021年8月25日～2022年2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	33,319,630千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,185,434千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.97	

(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8月25日～2022年2月24日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

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 42

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・スタンレー証券です。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2021年8月25日～2022年2月24日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	期末残高(元本)	取引の理由
百万円 —	百万円 0.85756	百万円 —	百万円 0.85756	商品性を適正に維持するための取得

○組入資産の明細

(2022年2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 22,977	千口 23,231	千円 32,875

○投資信託財産の構成

(2022年2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 32,875	% 99.2
コール・ローン等、その他	266	0.8
投資信託財産総額	33,141	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年2月24日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	33,141,827
コール・ローン等	266,408
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド(評価額)	32,875,419
(B) 負債	192,213
未払信託報酬	191,810
その他未払費用	403
(C) 純資産総額(A－B)	32,949,614
元本	28,251,058
次期繰越損益金	4,698,556
(D) 受益権総口数	28,251,058口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,663円

<注記事項>

- ①期首元本額 27,779,794円
 期中追加設定元本額 857,560円
 期中一部解約元本額 386,296円
 また、1口当たり純資産額は、期末11,663円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年8月25日～ 2022年2月24日
費用控除後の配当等収益額	69,680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	9,241,135円
分配準備積立金額	679,574円
当ファンドの分配対象収益額	9,990,389円
1万口当たり収益分配対象額	3,536円
1万口当たり分配金額	－円
収益分配金額	－円

*三菱UFJ国際投信では本資料のほか、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8月25日～2022年2月24日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	248,235
売買益	250,345
売買損	△ 2,110
(B) 信託報酬等	△ 192,213
(C) 当期繰越損益金(A+B)	56,022
(D) 前期繰越損益金	△1,843,787
(E) 追加信託差損益金	6,486,321
(配当等相当額)	(9,241,079)
(売買損益相当額)	(△2,754,758)
(F) 計(C+D+E)	4,698,556
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F+G)	4,698,556
追加信託差損益金	6,486,321
(配当等相当額)	(9,241,135)
(売買損益相当額)	(△2,754,814)
分配準備積立金	749,254
繰越損益金	△2,537,019

- (注) (A) 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) (B) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (E) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

《第36期》決算日2022年2月24日

〔計算期間：2021年8月25日～2022年2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、2月24日に第36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36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
	円	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
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
36期(2022年2月24日)	14,151	0.8	101.65	△0.0	77.5	△77.5	—	14,400

(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8月24日	円	%	101.67	%	%	%	%	
8 月 末	14,044	—	101.66	—	78.9	△79.1	—	
9 月 末	14,123	0.6	101.66	△0.0	79.9	△79.6	—	
10 月 末	14,138	0.7	101.66	△0.0	78.6	△78.3	—	
11 月 末	14,120	0.5	101.66	△0.0	78.3	△78.1	—	
12 月 末	14,190	1.0	101.66	△0.0	72.1	△71.4	—	
2022年1月末	14,256	1.5	101.65	△0.0	78.1	△77.6	—	
(期 末) 2022年2月24日	14,153	0.8	101.65	△0.0	73.4	△73.6	—	
	14,151	0.8	101.65	△0.0	77.5	△77.5	—	

(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

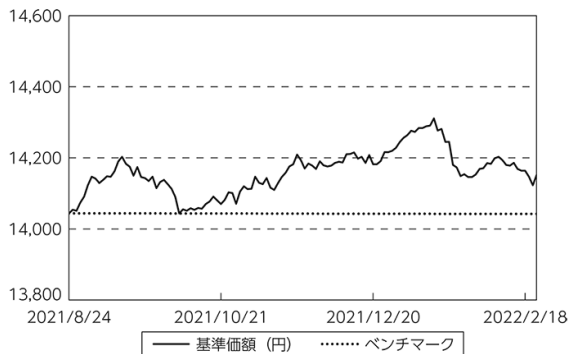
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.8%の上昇となりました。

◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.0%)を0.8%上回りました。

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)

ストックバリューファクター(企業の資産価値に対し株価が割安な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)

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)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

- ・国内株式市況は下落しました。
- ・期首から2021年9月中旬にかけては、菅首相の自民党総裁選不出馬報道や次期政権の経済対策への期待の高まりなどから上昇しました。その後、新型コロナウイルスの変異株の広まりから経済再開が遅れるとの懸念の高まりなどから下落に転じました。期末にかけては、世界的にインフレ率が上昇していることを受けて米連邦準

備制度理事会（FRB）の利上げや資産圧縮が早期に進むとの観測から米長期金利が急上昇し米国株式市況が下落に転じたことなどから国内株式市況は下値を探る展開となりました。

●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、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）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の構築を行いました。期中は、短期グロースファクターやフローバリューファクターへの投資ウェイトを低下させ

て各ファクターに分散したポートフォリオ構築を行いました。その後、期末にかけては、再び短期グロースファクターやフローバリューファクター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70～80%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

- ・ストックバリューファクターやクレジットファクターなどのファクター要因がプラスに寄与したことから基準価額は上昇し、ベンチマークを上回りました。

○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8月25日～2022年2月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 (株 式)	円 0 (0)	% 0.000 (0.000)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 (そ の 他)	121 (121)	0.853 (0.853)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 信託事務の処理等に要するその他諸費用（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	121	0.853	
期中の平均基準価額は、14,161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8月25日～2022年2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		8,310 (△ 34)	16,566,353 ()	8,103	16,753,276

(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8月25日～2022年2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	33,319,630千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	11,185,434千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.97

(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8月25日～2022年2月24日)

利害関係人との取引状況

該当事項はございません。

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 42

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・スタンレー証券です。

○組入資産の明細

(2022年2月24日現在)

国内株式

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
水産・農林業 (－%)						
サカタのタネ	9	—	—			
鉱業 (0.9%)						
日鉄鉱業	—	6	38,640			
INPEX	—	50	61,450			
建設業 (5.1%)						
ショーボンドホールディングス	7	—	—			
ミライト・ホールディングス	—	16	30,736			
安藤・間	40	—	—			
東急建設	—	52	36,452			
高松コンストラクショングループ	12	15	30,060			
東建コーポレーション	3	3	27,420			
大成建設	22	—	—			
飛鳥建設	18	—	—			
鹿島建設	—	60	91,320			
三井住友建設	70	78	34,398			
前田建設工業	29	—	—			
東鉄工業	—	7	17,675			
熊谷組	10	12	34,368			
大東建託	—	4	50,280			
東亜道路工業	—	3.5	17,570			
東亜建設工業	9	—	—			
東洋建設	—	35	20,720			
大和ハウス工業	29	—	—			
ライト工業	15	—	—			
日特建設	7	20	14,660			
ユアテック	25	—	—			
きんでん	—	18	29,358			
住友電設	12	7	15,603			
日本電設工業	—	16.5	25,740			
九電工	8.5	9.5	28,880			
太平電業	9	—	—			
明星工業	—	38	27,170			
大気社	—	12	37,020			

銘柄	期首(前期末)			当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円			
日比谷総合設備	12	—	—			
食料品 (5.1%)						
日清製粉グループ本社	—	45	72,135			
中部飼料	18.5	20	20,740			
DM三井製糖ホールディングス	16	—	—			
江崎グリコ	7	—	—			
寿スピリッツ	4.5	6	36,240			
カルビー	—	12	31,140			
明治ホールディングス	14	12	83,040			
雪印メグミルク	—	15	30,585			
丸大食品	10	11	16,830			
S Foods	9.5	6	19,350			
伊藤ハム米久ホールディングス	—	40	27,560			
アサヒグループホールディングス	17	—	—			
キリンホールディングス	40	—	—			
宝ホールディングス	19	28	31,416			
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	16	—	—			
ダイドーグループホールディングス	—	6	30,960			
アリアケジャパン	5	5.5	31,900			
フジッコ	—	11	21,714			
日本たばこ産業	40	35	76,702			
ケンコーマヨネーズ	4	—	—			
わらべや日洋ホールディングス	15	16	28,448			
ビックスコーポレーション	—	9	13,140			
繊維製品 (0.4%)						
帝人	20	—	—			
東レ	140	—	—			
ワールド	20	20	23,900			
デサント	—	6	17,214			
パルプ・紙 (0.4%)						
北越コーポレーション	60	—	—			
レンゴー	—	38	32,376			
ザ・バック	—	3.5	9,334			

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
化学 (10.2%)			
クラレ	30	—	—
昭和電工	12	—	—
住友化学	135	128	70,912
住友精化	—	11	35,475
石原産業	—	30	30,510
東ソー	40	26	46,020
トクヤマ	—	18	31,482
東亜合成	20	33	35,541
大阪ソーダ	—	10	30,900
関東電化工業	31	—	—
堺化学工業	11	—	—
エア・ウォーター	18	—	—
日本化学工業	—	7	16,387
日本バーカライジング	20	—	—
ステラ ケミファ	—	8	18,616
保土谷化学工業	—	7.5	30,712
日本触媒	6.5	—	—
大日精化工業	—	13	28,756
カネカ	—	10.5	38,587
三菱瓦斯化学	—	37	71,743
大阪有機化学工業	7	—	—
KHネオケム	—	13	35,620
ダイセル	35	—	—
日本ゼオン	20	—	—
アイカ工業	7	—	—
宇部興産	—	18	37,944
積水樹脂	6	—	—
リケンテクノス	53	—	—
森六ホールディングス	—	10	18,640
日本精化	—	8.5	17,578
ADEKA	18	13	33,358
日油	—	7.5	36,637
花王	—	12	64,008
日本ペイントホールディングス	—	74	75,110
太陽ホールディングス	6	—	—
D I C	—	14	35,994
富士フィルムホールディングス	—	10	71,920
ライオン	50	42	61,152

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
マンダム	14	23	30,866
コーセー	7	—	—
長谷川香料	10	15	35,685
デクセリアルズ	14	11.5	34,063
クミアイ化学工業	35	—	—
日本農薬	50	50	26,950
J S P	6	—	—
信越ポリマー	30	—	—
パルカー	—	13	34,099
医薬品 (4.1%)			
武田薬品工業	25	25	86,400
アステラス製薬	48	—	—
大日本住友製薬	35	—	—
中外製薬	—	18	69,318
科研製薬	—	7	29,050
小野薬品工業	—	27	76,869
参天製薬	60	—	—
キッセイ薬品工業	—	13	31,395
生化学工業	29	14	12,334
鳥居薬品	13	6	17,376
J C R ファーマ	10	—	—
東和薬品	—	11	32,494
富士製薬工業	9	—	—
大幸薬品	28	—	—
ダイト	—	6	17,448
大正製薬ホールディングス	—	11	63,030
ペプチドリーム	18	10	18,380
石油・石炭製品 (0.9%)			
ニチレキ	19	—	—
富士石油	—	75	21,075
出光興産	35	27	83,295
コスモエネルギーホールディングス	13	—	—
ゴム製品 (0.3%)			
横浜ゴム	—	18	29,070
ニッタ	13	—	—
住友理工	22	—	—
ガラス・土石製品 (2.6%)			
日東紡績	—	12	36,360
日本板硝子	45	—	—

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
オハラ	17	—	—	—
東海カーボン	22	25	26,250	—
ノリタケカンパニーリミテド	7.5	7.5	33,037	—
日本碍子	50	42	73,374	—
日本特殊陶業	—	15	30,780	—
MARUWA	—	2.5	35,775	—
黒崎播磨	2	—	—	—
ニチアス	—	13	33,501	—
ニチハ	—	9	22,995	—
鉄鋼 (2.2%)				
日本製鉄	42	40	80,800	—
神戸製鋼所	44	60	35,700	—
中山製鋼所	—	70	31,570	—
合同製鐵	—	23	30,176	—
東京製鐵	27	27	29,781	—
共英製鋼	12	—	—	—
大阪製鐵	5	—	—	—
大同特殊鋼	6	—	—	—
愛知製鋼	11	7	18,305	—
日本精線	—	6	25,650	—
非鉄金属 (0.9%)				
大紀アルミニウム工業所	—	11	17,831	—
三井金属鉱業	8.5	—	—	—
三菱マテリアル	12	—	—	—
DOWAホールディングス	7.5	—	—	—
大阪チタニウムテクノロジーズ	—	18	18,792	—
東邦チタニウム	23	—	—	—
UACJ	13	—	—	—
古河電気工業	12	15	33,570	—
住友電気工業	60	—	—	—
フジクラ	62	—	—	—
タツタ電線	30	—	—	—
リョービ	—	29	31,059	—
金属製品 (2.7%)				
稲葉製作所	14	—	—	—
宮地エンジニアリンググループ	—	5	17,800	—
トーカロ	20	33	42,504	—
SUMCO	—	37	66,785	—
RS Technologies	—	7	34,825	—

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
LIXIL	—	28	70,896	—
日東精工	—	11	5,467	—
岡部	31	26	18,434	—
東プレ	20	25	29,825	—
パイオラックス	—	7	12,131	—
中央発條	15	10	7,790	—
機械 (7.9%)				
ツガミ	20	34	39,678	—
オークマ	6	9	40,500	—
FUJ I	—	15.5	34,906	—
DMG森精機	—	23	35,190	—
ディスコ	2.7	—	—	—
日東工器	—	4	6,300	—
オプトラン	13	—	—	—
ヤマシンフィルタ	45	90	31,050	—
マルマエ	13	—	—	—
タツモ	—	16	24,224	—
三井海洋開発	—	23	27,025	—
SMC	1.5	—	—	—
ホソカワミクロン	4.5	9	23,544	—
日精エー・エス・ビー機械	7	—	—	—
サトーホールディングス	—	16	32,032	—
技研製作所	7	—	—	—
日精樹脂工業	19	—	—	—
住友重機械工業	12	16	43,856	—
ローツェ	4	3	28,980	—
住原実業	—	8	17,400	—
新東工業	20	—	—	—
澁谷工業	10	—	—	—
ダイキン工業	3	—	—	—
アネスト岩田	24	35	28,490	—
ダイフク	—	9.5	77,045	—
タダノ	30	40	39,000	—
CKD	11	16	30,752	—
キトー	4	—	—	—
フクシマガリレイ	7	—	—	—
竹内製作所	12	12	30,192	—
アマノ	—	13	29,276	—
JUK I	—	30	19,170	—

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
リケン	15	8	19,712	
T P R	—	9	12,276	
ツバキ・ナカシマ	15	37	34,188	
ホシザキ	8	—	—	
大豊工業	20	26	18,304	
日本精工	100	—	—	
NTN	90	190	40,280	
日本トムソン	45	—	—	
日本ビラー工業	10	—	—	
キッツ	—	36	23,400	
三菱重工業	29	29	94,888	
スター精密	20	—	—	
電気機器 (12.0%)				
コニカミノルタ	—	65	30,875	
ミネベアミツミ	33	—	—	
シンフォニアテクノロジー	—	26	32,708	
山洋電気	4	7	34,020	
デンヨー	—	9	15,489	
芝浦メカトロニクス	—	4.5	32,400	
トレックス・セミコンダクター	—	14	31,864	
ヤーマン	20	33	29,469	
I - P E X	—	21	29,442	
大崎電気工業	30	18	8,604	
オムロン	—	9	68,130	
I D E C	16	—	—	
メルコホールディングス	—	2.5	9,237	
日本電気	—	17	82,025	
サンケン電気	7	—	—	
アイホン	6	15	31,290	
ルネサスエレクトロニクス	85	60	76,980	
セイコーエプソン	—	45	78,480	
アルバック	6	—	—	
能美防災	14	16	31,488	
エレコム	16	20	31,020	
パナソニック	70	—	—	
ソニーグループ	—	7	80,185	
タムラ製作所	—	57	33,060	
アルプスアルパイン	26	—	—	
ローランド ディー. ジー.	—	12	32,892	

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
ホシデン	25	—	—	
日本航空電子工業	16	—	—	
マクセル	—	28	32,340	
ユニデンホールディングス	—	2	6,870	
スミダコーポレーション	—	32	26,592	
リオン	5	—	—	
新電元工業	9	—	—	
堀場製作所	—	7.5	48,750	
アドバンテスト	6	—	—	
キーエンス	1.7	—	—	
日置電機	—	5	32,050	
シスメックス	8	—	—	
OBARA GROUP	8	6	18,600	
コーセル	14	—	—	
ウシオ電機	—	21	37,380	
日本電子	—	6.5	40,495	
ファナック	4	—	—	
エンプラス	5	—	—	
ローム	—	8	69,360	
浜松トニクス	—	13	70,850	
三井ハイテック	5.5	—	—	
新光電気工業	8	—	—	
太陽誘電	6	—	—	
日本ケミコン	14	—	—	
K O A	19	24	33,264	
市光工業	25	—	—	
ミツバ	—	45	16,245	
キャノン電子	—	11	17,336	
リコー	80	—	—	
東京エレクトロン	—	1.6	85,600	
輸送用機器 (5.3%)				
ユニプレス	—	37	28,046	
豊田自動織機	—	8	69,440	
モリタホールディングス	—	13	15,717	
三櫻工業	22	—	—	
デンソー	—	10	80,380	
東海理化電機製作所	16	—	—	
三菱ロジスネクスト	30	—	—	
いすゞ自動車	70	55	84,150	

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
トヨタ自動車	—	38	—	79,458
日産車体	8	—	—	—
トピー工業	19	—	—	—
ティラド	10	—	—	—
NOK	19	—	—	—
フタバ産業	—	50	—	19,200
プレス工業	—	89	—	32,841
太平洋工業	—	28	—	28,112
アイシン	22	20	—	83,600
マツダ	70	—	—	—
SUBARU	27.4	—	—	—
ヤマハ発動機	31	29	—	73,370
豊田合成	12	—	—	—
エフ・シー・シー	19	—	—	—
テイ・エス テック	19	—	—	—
精密機器 (1.1%)				
日機装	—	40	—	30,760
日本エム・ディ・エム	—	5	—	7,610
長野計器	16	—	—	—
東京精密	6	—	—	—
ニコン	30	—	—	—
オリンパス	45	—	—	—
理研計器	5	—	—	—
タムロン	—	10	—	23,100
ノーリツ鋼機	11	15	—	32,100
エー・アンド・デイ	20	20	—	17,080
シチズン時計	95	—	—	—
メニコン	—	6	—	17,400
その他製品 (2.9%)				
スノーピーク	—	10	—	26,340
パラマウントベッドホールディングス	—	16	—	31,872
SHOEI	—	8	—	35,960
フランスベッドホールディングス	18	—	—	—
パイロットコーポレーション	8	—	—	—
大建工業	9	—	—	—
凸版印刷	—	39	—	86,190
NISSHA	20	—	—	—
TAKARA & COMPANY	12	12	—	21,876
アシックス	—	10	—	22,680

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
河合楽器製作所	—	5	—	15,000
三菱鉛筆	—	22	—	27,280
コクヨ	19	19	—	30,571
グローブライド	4	8	—	22,328
電気・ガス業 (0.7%)				
大阪瓦斯	—	24	—	51,336
東邦瓦斯	—	8.5	—	25,398
陸運業 (4.8%)				
SBSホールディングス	10	—	—	—
小田急電鉄	33	—	—	—
京成電鉄	—	24	—	76,560
東海旅客鉄道	6.5	5.5	—	83,077
ハマキョウレックス	10	5	—	14,380
阪急阪神ホールディングス	26	26	—	88,400
南海電気鉄道	9	—	—	—
京阪ホールディングス	10	10	—	30,050
名古屋鉄道	17	17	—	35,309
山陽電気鉄道	4.5	—	—	—
日本通運	12	—	—	—
ヤマトホールディングス	—	35	—	75,915
山九	—	8	—	31,840
丸全昭和運輸	8.5	5.5	—	17,132
センコーグループホールディングス	25	—	—	—
トナミホールディングス	—	6	—	21,600
ニッコンホールディングス	10	15	—	32,100
セイノーホールディングス	25	25	—	29,425
海運業 (0.3%)				
日本郵船	12	—	—	—
商船三井	7	—	—	—
川崎汽船	7	—	—	—
N.Sユナイテッド海運	—	8.5	—	34,042
倉庫・運輸関連業 (0.4%)				
トランコム	—	3.5	—	24,955
住友倉庫	15	—	—	—
内外トランスライン	—	10	—	18,370
情報・通信業 (6.2%)				
三菱総合研究所	—	5	—	18,800
ブレインパッド	7	—	—	—
システム情報	15	—	—	—

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
SHIFT	—	1.5	—	30,030
eBASE	—	32	—	19,456
コムチュア	11	—	—	—
テラスカイ	—	22	—	32,384
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	—	13	—	15,769
ラクス	—	13	—	22,100
ダブルスタンダード	6.5	14	—	24,780
Ubicomホールディングス	—	14	—	27,692
チェンジ	9	—	—	—
オロ	5.5	13	—	30,589
ユーザーローカル	—	10	—	13,920
インタージホールディングス	12	—	—	—
ソースネクスト	—	160	—	23,200
インフォコム	11	17	—	32,895
オービック	4	—	—	—
ジャストシステム	5	6	—	31,920
伊藤忠テクノソリューションズ	26	—	—	—
アイティフォー	—	22	—	17,116
サイボウズ	10	—	—	—
ネットワンシステムズ	8	—	—	—
兼松エレクトロニクス	8	8	—	31,200
TBSホールディングス	15	18	—	33,282
日本テレビホールディングス	—	23	—	30,268
光通信	4	6	—	84,780
ファイバーゲート	16	—	—	—
シーイーシー	16	31	—	33,883
SCSK	—	37	—	70,189
アイネス	20	22	—	33,264
TKC	5	—	—	—
福井コンピュータホールディングス	—	10	—	30,300
卸売業 (6.3%)				
あらた	—	5	—	19,400
トーマンデバイス	—	5.5	—	33,165
双日	70	—	—	—
アルコニックス	—	27	—	37,368
あい ホールディングス	14.5	18	—	30,258
マクニカ・富士エレホールディングス	—	13	—	33,228
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30	—	—	—
ウイン・パートナーズ	11	—	—	—

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
コメダホールディングス	13	13	—	27,027
松田産業	—	15	—	34,425
ドウシシャ	17	21	—	32,130
高速	10	—	—	—
丸文	—	30	—	20,280
日本ライフライン	21	30	—	30,930
進和	7.5	8	—	16,264
白銅	7.5	9.5	—	24,158
長瀬産業	14	—	—	—
豊田通商	—	17	—	79,645
兼松	—	30	—	41,220
カメイ	11	—	—	—
スターゼン	—	7.5	—	15,690
住友商事	60	—	—	—
第一実業	4	6	—	25,440
ユアサ商事	6	10	—	29,030
三菱石油	—	35	—	32,935
東邦ホールディングス	—	18	—	33,192
サンゲツ	—	14	—	21,896
サンワテクノス	—	18	—	23,094
新光商事	—	12	—	11,064
加賀電子	—	11	—	32,252
西本Wismettacホールディングス	—	6	—	17,706
ミスミグループ本社	22	—	—	—
小売業 (6.4%)				
サンユー	7.5	7.5	—	31,537
エービーシー・マート	15	—	—	—
くら寿司	4	4	—	15,180
パルグループホールディングス	16	—	—	—
エディオン	25	—	—	—
ハローズ	8	—	—	—
大黒天物産	—	4	—	18,540
クオールホールディングス	18	11	—	13,838
ジーンズホールディングス	—	3.5	—	22,750
DCMホールディングス	25	—	—	—
アークランドサービスホールディングス	13.6	13.6	—	29,838
J・フロント リテイリング	30	30	—	29,370
マツキヨココカラ&カンパニー	8	8.5	—	37,740
物語コーポレーション	6	4.5	—	28,575

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ウエルシアホールディングス	25	—	—
ネクステージ	18	—	—
ヨシックスホールディングス	4.5	—	—
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	—	13	14,053
日本調剤	—	6.5	8,827
セブン&アイ・ホールディングス	20	15.5	88,024
ツルハホールディングス	—	6	55,920
トリドールホールディングス	15	10	24,100
TOKYO BASE	—	25	10,275
JMホールディングス	—	13	23,140
クスリのアオキホールディングス	—	3	20,610
FOOD & LIFE COMPANIE	8	7	26,110
ノジマ	—	12	29,688
良品計画	—	28	48,132
G-7ホールディングス	—	12	19,716
コーナン商事	—	8	28,360
バン・パシフィック・インターナショナルホ	40	—	—
ゼンショーホールディングス	—	6	16,038
VTホールディングス	50	—	—
ユナイテッドアローズ	12	—	—
薬王堂ホールディングス	—	5	11,810
リテールパートナーズ	—	9	10,512
上新電機	—	7	14,287
AOKIホールディングス	35	—	—
コメリ	—	10	27,760
青山商事	35	—	—
高島屋	25	—	—
松屋	—	19	13,072
イズミ	8.5	—	—
平和堂	14	—	—
ゼビオホールディングス	24	—	—
アインホールディングス	4.5	—	—
アークランドサカモト	21	—	—
パローホールディングス	10	—	—
ファーストリテイリング	1	—	—
不動産業 (2.1%)			
ヒューリック	—	50	50,600
ディア・ライフ	—	27	13,554
飯田グループホールディングス	38	34.5	72,450

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
ケイアイスター不動産	6	5	23,800
グッドコムアセット	—	11	11,979
イオンモール	20	20	32,100
カチタス	10	5	16,950
サンフロンティア不動産	—	14	14,630
サービス業 (7.8%)			
ジェイエイシーリクルートメント	10	15	26,760
日本M&Aセンターホールディングス	30	—	—
メンバーズ	8	14	38,878
UTグループ	10	9	30,420
夢真ビーネックスグループ	20	—	—
パソナグループ	10	10	24,330
リンクアンドモチベーション	—	65	26,585
総合警備保障	—	10	41,600
エムスリー	11	—	—
アウトソーシング	21	17	23,409
博報堂DYホールディングス	50	44	65,120
クイック	—	8	12,496
イオンファンタジー	11	—	—
H. U. グループホールディングス	10	—	—
オリエンタルランド	—	3.5	72,082
ラウンドワン	—	15	18,945
ビー・エム・エル	—	7	22,015
りらいあコミュニケーションズ	—	31	31,868
リソー教育	70	—	—
東京個別指導学院	25	—	—
エン・ジャパン	6	—	—
アイ・アールジャパンホールディングス	1.8	5	18,150
Keeper 技研	8	8	15,392
ジャパンマテリアル	—	22	36,674
M&Aキャピタルパートナーズ	5	5	25,200
シグマクス・ホールディングス	12	—	—
メドピア	6	9	25,830
エラン	17	—	—
エアトリ	10	7	18,809
ストライク	7	6	25,440
ペイカレント・コンサルティング	1.1	0.6	25,290
グレイステクノロジー	18	—	—
日総工産	15	29	24,476

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
共立メンテナンス	—	6.5	—	26,942
建設技術研究所	—	8	—	17,760
トーカイ	—	9	—	16,731
セコム	—	10	—	84,580
丹青社	—	30	—	21,630
応用地質	9	—	—	—

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
ベネッセホールディングス	—	12	—	27,888
イオンディライト	—	7.5	—	22,357
ダイセキ	6	—	—	—
合 計	株 数 ・ 金 額	6,249	6,422	11,159,348
	銘柄数<比率>	316	328	<77.5%>

(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

(2022年2月24日現在)

銘柄	信用取引売建残高	
	当 期 末	
	株 数	評 価 額
	千株	千円
信用取引売建	6,457	11,164,458

○投資信託財産の構成

(2022年2月24日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
	千円	%
株式	11,159,348	42.0
コール・ローン等、その他	15,417,558	58.0
投資信託財産総額	26,576,906	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年2月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	33,641,437,114
コール・ローン等	2,615,249,440
株式(評価額)	11,159,348,400
信用取引預け金	11,663,873,275
未収入金	1,109,807,499
未収配当金	28,627,500
差入保証金	7,064,531,000
(B) 負債	19,240,818,089
信用売証券	11,164,458,500
未払金	980,733,346
未払解約金	960,000
未払利息	1,043
差入保証金代用有価証券	7,064,531,000
その他未払費用	30,134,200
(C) 純資産総額(A-B)	14,400,619,025
元本	10,176,276,249
次期繰越損益金	4,224,342,776
(D) 受益権総口数	10,176,276,249口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,151円

<注記事項>

- ①期首元本額 10,772,731,703円
期中追加設定元本額 123,212,727円
期中一部解約元本額 719,668,181円
また、1口当たり純資産額は、期末1.4151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)	4,885,760,068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)	3,410,757,592円
ヘッジファンドセレクション(ラップ向け)	1,666,111,287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	28,333,499円
日本株プライムニュートラル・ファンド(ラップ向け)	23,231,870円
合計	10,176,276,249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 6,567,254,900円

○損益の状況 (2021年8月25日～2022年2月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	115,911,767
受取配当金	116,268,500
受取利息	6,507
その他収益金	1,116
支払利息	△ 364,356
(B) 有価証券売買損益	126,705,296
売買益	2,710,726,278
売買損	△2,584,020,982
(C) 保管費用等	△ 123,901,939
(D) 当期損益金(A+B+C)	118,715,124
(E) 前期繰越損益金	4,356,436,251
(F) 追加信託差損益金	50,650,724
(G) 解約差損益金	△ 301,459,323
(H) 計(D+E+F+G)	4,224,342,776
次期繰越損益金(H)	4,224,342,776

- (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。