

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33期（決算日：2022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33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	期 騰 落 率	期 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
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
33期(2022年8月24日)	11,634	0	△0.2	101.64	△0.0	82.3	△82.3	—	18

(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	株式 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首) 2022年2月24日	円	%		%	%	%	%
	11,663	—	101.65	—	77.3	△77.4	—
2月末	11,666	0.0	101.65	△0.0	79.1	△79.1	—
3月末	11,691	0.2	101.65	△0.0	78.7	△78.3	—
4月末	11,604	△0.5	101.65	△0.0	76.5	△76.6	—
5月末	11,647	△0.1	101.65	△0.0	81.9	△81.5	—
6月末	11,588	△0.6	101.65	△0.0	79.0	△79.2	—
7月末	11,562	△0.9	101.64	△0.0	81.3	△81.4	—
(期末) 2022年8月24日	11,634	△0.2	101.64	△0.0	82.3	△82.3	—

(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。

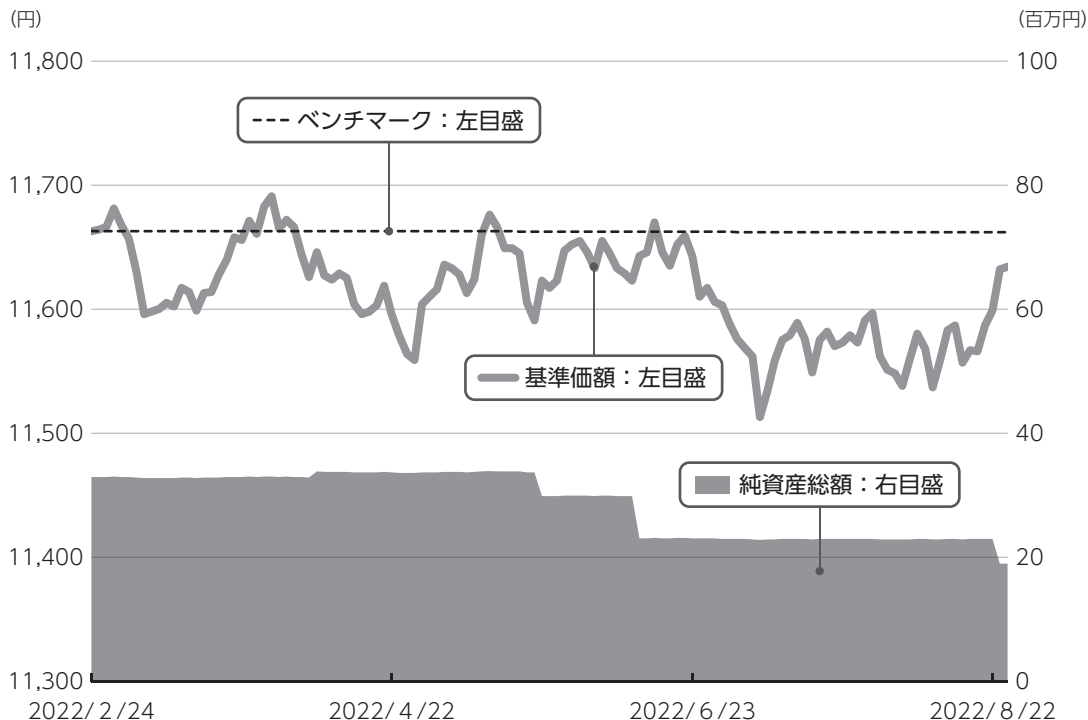
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

運用経過

第33期：2022年2月25日～2022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33期首	11,663円
第33期末	11,634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0.2%下回りました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

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）などファクター要因がプラスに寄与し、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

個別銘柄要因や信託報酬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33期：2022年2月25日～2022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2022年6月中旬にかけては、ロシアとウクライナの和平交渉進展期待や外国為替市場において円安・米ドル高が進んだことによる企業業績改善期待などから上昇する場面があった一方、米金融引き締め懸念や世界的に高止まりするイ

ンフレ率などが嫌気され下落するなど一進一退の展開となりました。

6月中旬から期末にかけては、米連邦公開市場委員会（FOMC）議事要旨の内容が一段の金融引き締めに積極的な内容でなかったことや上昇基調であった米長期金利が低下に転じたことなどが好感され上昇しました。

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、フローバリューファクター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）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、短期グロースファクターへの投資ウェイトを低下させた一方、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）やリターン・リバーサル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76～83%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。

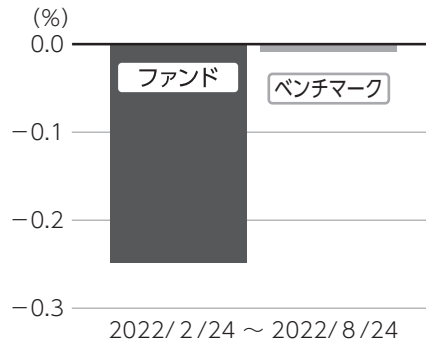
▶ 当該投資信託のベンチマークとの差異について

▶ 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0.2%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0.2%上回ったものの、信託報酬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フローバリューファクターなどファクター要因がプラスに寄与したものの、個別銘柄要因や信託報酬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33期
	2022年2月25日～2022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	3,608

(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。

2022年2月25日～2022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	67	0.573	(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)	(0.491)	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)	(0.055)	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	1	0.007	(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)	(1)	(0.007)	
(c) その他費用	169	1.453	(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)	(169)	(1.452)	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	237	2.033	

期中の平均基準価額は、11,613円です。

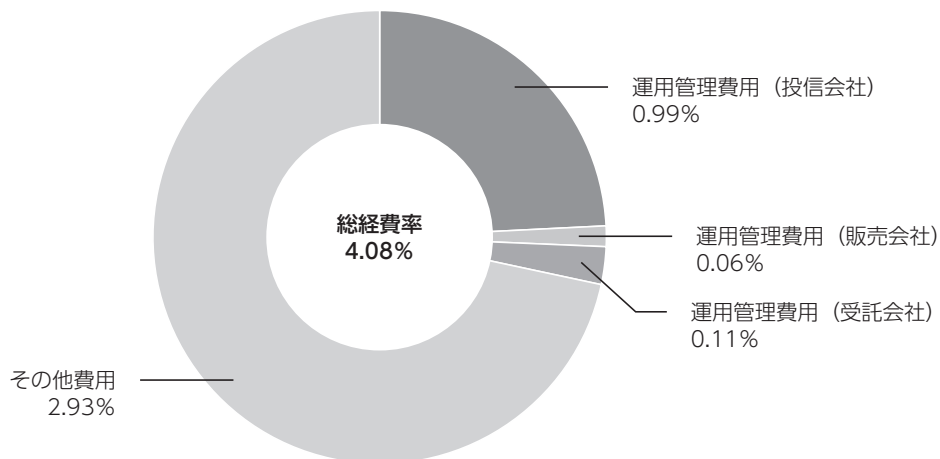
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (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4.08%**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2月25日～2022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 635	千円 897	千口 10,512	千円 14,858

○株式売買比率

(2022年2月25日～2022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	31,572,696千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,764,523千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.93	

(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2月25日～2022年8月24日)

利害関係人との取引状況

<日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）>

該当事項はございません。

<日本株マーケットニュートラル・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 15,137	百万円 67	% 0.4	百万円 16,435	百万円 183	% 1.1

平均保有割合 0.2%

※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 28

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	1千円
うち利害関係人への支払額 (B)	0.441千円
(B) / (A)	23.0%

(注) 売買委託手数料総額は、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です。

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

(2022年2月25日～2022年8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 0.85756	百万円 —	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 23,231	千口 13,354	千円 18,935

○ 投資信託財産の構成

(2022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 18,935	% 81.6
コール・ローン等、その他	4,258	18.4
投資信託財産総額	23,193	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2022年8月24日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	23,193,729
コール・ローン等	211,372
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド(評価額)	18,935,629
未収入金	4,046,728
(B) 負債	4,215,638
未払解約金	4,050,002
未払信託報酬	165,303
その他未払費用	333
(C) 純資産総額(A - B)	18,978,091
元本	16,312,845
次期繰越損益金	2,665,246
(D) 受益権総口数	16,312,845口
1万口当たり基準価額(C/D)	11,634円

<注記事項>

- ①期首元本額 28,251,058円
 期中追加設定元本額 774,659円
 期中一部解約元本額 12,712,872円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.1634円です。

②分配金の計算過程

項 目	2022年2月25日～ 2022年8月24日
費用控除後の配当等収益額	94,172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	5,347,772円
分配準備積立金額	444,454円
当ファンドの分配対象収益額	5,886,398円
1万口当たり収益分配対象額	3,608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（2022年2月25日～2022年8月24日）

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	96,074
売買益	50,605
売買損	45,469
(B) 信託報酬等	△ 165,636
(C) 当期繰越損益金(A + B)	△ 69,562
(D) 前期繰越損益金	△ 981,386
(E) 追加信託差損益金	3,716,194
(配当等相当額)	(5,347,602)
(売買損益相当額)	(△1,631,408)
(F) 計(C + D + E)	2,665,246
(G) 収益分配金	0
次期繰越損益金(F + G)	2,665,246
追加信託差損益金	3,716,194
(配当等相当額)	(5,347,772)
(売買損益相当額)	(△1,631,578)
分配準備積立金	538,626
繰越損益金	△1,589,574

- (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37期》決算日2022年8月24日

〔計算期間：2022年2月25日～2022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37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37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				
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
37期(2022年8月24日)	14,179	0.2	101.64	△0.0	82.5	△82.4	—	12,743

(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 ト	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) 2022年 2月24日	円	%	101.65	%	%	%	%	%
2月 末	14,151	—	101.65	—	77.5	△77.5	—	—
3月 末	14,156	0.0	101.65	△0.0	79.2	△79.2	—	—
4月 末	14,201	0.4	101.65	△0.0	78.8	△78.5	—	—
5月 末	14,107	△0.3	101.65	△0.0	76.7	△76.8	—	—
6月 末	14,171	0.1	101.65	△0.0	82.1	△81.7	—	—
7月 末	14,105	△0.3	101.65	△0.0	79.2	△79.3	—	—
8月 末	14,086	△0.5	101.64	△0.0	81.5	△81.6	—	—
(期 末) 2022年 8月24日	円	%	101.64	%	82.5	△82.4	%	%
	14,179	0.2	101.64	△0.0	82.5	△82.4	—	—

(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

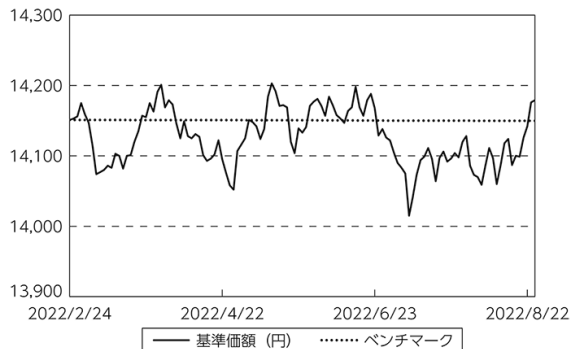
◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.2%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）などファクター要因がプラスに寄与し、基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

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2022年6月中旬にかけては、ロシアとウクライナの和平交渉進展期待や外国為替市場において円安・米ドル高が進んだことによる企業業績改善期待などから上昇する場面があった一方、米金融引き締め懸念や世界的に高止まりするインフレ率などが嫌気され下落するなど一進一退の展開となりました。

- ・ 6月中旬から期末にかけては、米連邦公開市場委員会（FOMC）議事要旨の内容が一段の金融引き締めに積極的な内容でなかったことや上昇基調であった米長期金利が低下に転じたことなどが好感され上昇しました。
 - 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、フローバリューファクター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）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、短期グロースファクターへの投資ウェイトを低下させた一方、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）やリターン・リバーサル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76～83%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フローバリューファクターなど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

(2022年2月25日～2022年8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 1 (1)	% 0.006 (0.006)	(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)	198 (198)	1.402 (1.402)	(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	199	1.408	
期中の平均基準価額は、14,125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2月25日～2022年8月24日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国内	上場	千株 8,269	千円 15,137,183	千株 8,832	千円 16,435,512

(注) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2022年2月25日～2022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	31,572,696千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,764,523千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.93

(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2月25日～2022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	$\frac{D}{C}$
株式	百万円 15,137	百万円 67	% 0.4	百万円 16,435	百万円 183	% 1.1

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 28

売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	841千円
うち利害関係人への支払額 (B)	193千円
(B) / (A)	23.0%

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
鉱業 (0.4%)				
日鉄鉱業	6	—	—	—
I N P E X	50	—	—	—
石油資源開発	—	11	43,010	
建設業 (4.6%)				
ミライト・ワン	16	16	25,872	
東急建設	52	—	—	—
高松コンストラクショングループ	15	15	29,145	
東建コーポレーション	3	—	—	—
大成建設	—	19	78,280	
鹿島建設	60	—	—	—
不動テトラ	—	6	9,480	
三井住友建設	78	78	35,802	
東鉄工業	7	—	—	—
熊谷組	12	12	32,532	
大東建託	4	—	—	—
新日本建設	—	17	12,410	
東亜道路工業	3.5	3.5	20,650	
日本国土開発	—	35	21,560	
若築建設	—	5.5	13,497	
東洋建設	35	—	—	—
大和ハウス工業	—	22	69,696	
日特建設	20	10	8,990	
関電工	—	25	21,175	
きんでん	18	—	—	—
住友電設	7	7	18,578	
日本電設工業	16.5	11.5	20,792	
九電工	9.5	9.5	27,113	
明星工業	38	15	11,160	
大気社	12	—	—	—
ダイダン	—	12	26,424	
食料品 (4.3%)				
日清製粉グループ本社	45	—	—	—
中部飼料	20	10	10,870	

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
DM三井製糖ホールディングス	—	5.5	10,367	
寿スピリッツ	6	—	—	—
カルビー	12	—	—	—
明治ホールディングス	12	11	73,480	
雪印メグミルク	15	15	26,670	
丸大食品	11	11	17,369	
S F o o d s	6	9	27,315	
伊藤ハム米久ホールディングス	40	35	23,695	
アサヒグループホールディングス	—	15	71,850	
宝ホールディングス	28	30	32,430	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	—	18	26,262	
ダイドーグループホールディングス	6	—	—	—
J-オイルミルズ	—	10	16,080	
アリアケジャパン	5.5	5.5	26,702	
日清食品ホールディングス	—	7.5	75,825	
フジッコ	11	7.5	14,692	
日本たばこ産業	35	—	—	—
わらべや日洋ホールディングス	16	—	—	—
ビックスコーポレーション	9	—	—	—
繊維製品 (0.3%)				
ワールド	20	23	31,694	
デサント	6	—	—	—
パルプ・紙 (0.5%)				
王子ホールディングス	—	30	16,860	
レンゾー	38	38	31,274	
トーモク	—	4.5	6,889	
ザ・バック	3.5	—	—	—
化学 (12.8%)				
クラレ	—	70	75,600	
昭和電工	—	35	77,455	
住友化学	128	—	—	—
住友精化	11	5.5	17,380	
石原産業	30	—	—	—
東ソー	26	—	—	—

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
トクヤマ	18	—	—	—
東亜合成	33	—	—	—
大阪ソーダ	10	11	42,075	—
関東電化工業	—	34	34,204	—
デンカ	—	18	60,570	—
日本化学工業	7	—	—	—
ステラ ケミファ	8	12	32,352	—
保土谷化学工業	7.5	—	—	—
大日精化工業	13	—	—	—
カネカ	10.5	10.5	38,902	—
三菱瓦斯化学	37	41	85,444	—
東京応化工業	—	10	71,000	—
三菱ケミカルグループ	—	110	81,367	—
KHネオケム	13	—	—	—
住友ベークライト	—	6	26,700	—
日本ゼオン	—	55	75,185	—
UBE	18	—	—	—
旭有機材	—	16	37,328	—
森六ホールディングス	10	—	—	—
恵和	—	7	26,600	—
日本精化	8.5	—	—	—
扶桑化学工業	—	8	27,360	—
ADEKA	13	10	23,930	—
日油	7.5	—	—	—
花王	12	—	—	—
三洋化成工業	—	4.5	21,420	—
日本ペイントホールディングス	74	—	—	—
D I C	14	14	35,070	—
富士フイルムホールディングス	10	9	64,863	—
ライオン	42	—	—	—
高砂香料工業	—	4	11,644	—
マンダム	23	24	36,936	—
ポーラ・オルビスホールディングス	—	44	68,904	—
長谷川香料	15	8	24,120	—
小林製薬	—	6.8	54,672	—
メック	—	10	25,290	—
デクセリアルズ	11.5	7	27,335	—
クミアイ化学工業	—	25	26,675	—
日本農薬	50	—	—	—

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
日東電工	—	8.5	74,715	—
天馬	—	4	9,220	—
信越ポリマー	—	22	29,854	—
バルカー	13	—	—	—
医薬品 (3.0%)				
武田薬品工業	25	18	68,580	—
住友ファーマ	—	35	37,275	—
中外製薬	18	—	—	—
科研製薬	7	—	—	—
小野薬品工業	27	15	50,055	—
参天製薬	—	40	40,760	—
ツムラ	—	4.5	14,512	—
キッセイ薬品工業	13	13	31,538	—
生化学工業	14	28	24,836	—
鳥居薬品	6	6.5	19,487	—
東和薬品	11	—	—	—
ダイト	6	6	16,332	—
大正製薬ホールディングス	11	—	—	—
バプチドリーム	10	10	15,870	—
石油・石炭製品 (1.2%)				
日本コークス工業	—	120	12,360	—
富士石油	75	55	19,800	—
出光興産	27	—	—	—
コスモエネルギーホールディングス	—	22	91,630	—
ゴム製品 (0.7%)				
横浜ゴム	18	—	—	—
住友ゴム工業	—	55	66,055	—
住友理工	—	20	11,720	—
ガラス・土石製品 (0.6%)				
日東紡績	12	—	—	—
AGC	—	6	29,100	—
東海カーボン	25	20	20,720	—
ノリタケカンパニーリミテド	7.5	4	16,660	—
日本碍子	42	—	—	—
日本特殊陶業	15	—	—	—
MARUWA	2.5	—	—	—
ニチアス	13	—	—	—
ニチハ	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
鉄鋼 (2.0%)				
日本製鉄	40	—	—	—
神戸製鋼所	60	120	74,520	
中山製鋼所	70	—	—	
合同製鐵	23	—	—	
東京製鐵	27	—	—	
共英製鋼	—	21	31,017	
大和工業	—	8	39,720	
淀川製鋼所	—	8.5	20,748	
日本冶金工業	—	15	41,670	
愛知製鋼	7	—	—	
日本精線	6	—	—	
非鉄金属 (2.2%)				
大紀アルミニウム工業所	11	—	—	
住友金属鉱山	—	17	75,667	
大阪チタニウムテクノロジーズ	18	12	34,500	
古河電気工業	15	15	36,780	
フジクラ	—	40	38,840	
昭和電線ホールディングス	—	10	18,650	
リョービ	29	22	28,886	
金属製品 (2.1%)				
宮地エンジニアリンググループ	5	5	16,450	
トーカロ	33	—	—	
SUMCO	37	—	—	
RS Technologies	7	4	28,080	
文化シャッター	—	18	18,972	
LIXIL	28	30	75,930	
日東精工	11	—	—	
岡部	26	26	16,692	
ジーテクト	—	9	12,888	
東プレ	25	25	30,500	
バイオラックス	7	10	20,290	
中央発條	10	—	—	
機械 (9.1%)				
日本製鋼所	—	9	27,135	
ツガミ	34	15	18,900	
オークマ	9	5	26,700	
アイダエンジニアリング	—	20	17,740	
FUJI	15.5	15.5	31,728	

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
牧野フライス製作所	—	5	22,500	
オーエスジー	—	16.5	32,010	
DMG森精機	23	—	—	
日東工器	4	—	—	
オプトラン	—	18	40,392	
イワキポンプ	—	12	12,840	
ヤマシンフィルタ	90	—	—	
タツモ	16	—	—	
ナブテスコ	—	23	77,280	
三井海洋開発	23	—	—	
SMC	—	1.2	80,988	
ホソカワミクロン	9	12	31,680	
日精エー・エス・ピー機械	—	8	33,680	
サトーホールディングス	16	—	—	
住友重機械工業	16	25	73,600	
日立建機	—	20	58,860	
ローツェ	3	3.5	30,310	
荏原実業	8	—	—	
月島機械	—	25	22,825	
澁谷工業	—	11	27,698	
荏原製作所	—	13	70,980	
アネスト岩田	35	—	—	
ダイフク	9.5	—	—	
タダノ	40	26	25,688	
CKD	16	—	—	
フクシマガリレイ	—	2	7,310	
竹内製作所	12	12	30,876	
アマノ	13	—	—	
JUKI	30	—	—	
新晃工業	—	13	20,852	
リケン	8	8.2	20,032	
TPR	9	20	26,060	
ツバキ・ナカシマ	37	—	—	
大豊工業	26	—	—	
NTN	190	—	—	
日本トムソン	—	40	22,560	
THK	—	10	28,180	
日本ビラー工業	—	13	34,645	
キッツ	36	—	—	

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
三菱重工業	29	—	—
電気機器 (10.8%)			
イビデン	—	19	85,025
コニカミノルタ	65	35	16,590
三菱電機	—	55	77,797
シンフォニアテクノロジー	26	—	—
山洋電気	7	—	—
デンヨー	9	—	—
芝浦メカトロニクス	4.5	—	—
トレックス・セミコンダクター	14	12	35,472
東光高岳	—	10	19,660
ヤーマン	33	—	—
JVCケンウッド	—	120	24,600
I-PEX	21	—	—
大崎電気工業	18	—	—
オムロン	9	—	—
メルコホールディングス	2.5	—	—
日本電気	17	16	78,160
富士通	—	4.7	78,114
サンケン電気	—	6	29,730
アイホン	15	—	—
ルネサスエレクトロニクス	60	22	29,018
セイコーエプソン	45	—	—
ワコム	—	23	19,895
能美防災	16	—	—
エレコム	20	—	—
パナソニックホールディングス	—	61	68,747
ソニーグループ	7	—	—
タムラ製作所	57	—	—
アルプスアルパイン	—	18	22,662
ローランド ディー・ジー	12	12	40,080
マクセル	28	—	—
ユニデンホールディングス	2	—	—
スミダコーポレーション	32	32	32,128
アイコム	—	9	23,850
堀場製作所	7.5	—	—
エスベック	—	13	24,193
日置電機	5	5	32,700
日本マイクロニクス	—	14	19,936

銘柄	期首(前期末)		
	株数	株数	評価額
	千株	千株	千円
OBARA GROUP	6	—	—
ウシオ電機	21	—	—
日本電子	6.5	—	—
日本シイエムケイ	—	50	23,550
大真空	—	30	28,710
ローム	8	—	—
浜松ホトニクス	13	—	—
太陽誘電	—	17	74,800
双葉電子工業	—	20	13,380
ニチコン	—	23	33,764
日本ケミコン	—	16	29,616
KOA	24	—	—
ミツバ	45	21	8,862
SCREENホールディングス	—	8	76,720
キャノン電子	11	6	9,972
リコー	—	70	77,000
東京エレクトロン	1.6	—	—
輸送用機器 (4.9%)			
トヨタ紡織	—	35	71,785
ユニプレス	37	—	—
豊田自動織機	8	9	70,200
モリタホールディングス	13	—	—
デンソー	10	—	—
日産自動車	—	70	36,960
いすゞ自動車	55	—	—
トヨタ自動車	38	20	42,000
トビー工業	—	12	16,692
フタバ産業	50	—	—
プレス工業	89	39	17,004
太平洋工業	28	29	32,335
アイシン	20	16	67,520
ヤマハ発動機	29	30	87,060
エクセディ	—	15	27,540
愛三工業	—	20	14,820
エフ・シー・シー	—	18	26,676
精密機器 (2.1%)			
日機装	40	40	40,560
日本エム・ディ・エム	5	—	—
島津製作所	—	11	47,520

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ブイ・テクノロジー	—	10	30,650
理研計器	—	8	35,080
タムロン	10	—	—
ノーリツ鋼機	15	12	29,964
A&Dホロンホールディングス	20	35	32,725
メニコン	6	—	—
その他製品 (1.9%)			
スノーピーク	10	11	25,025
パラマウントベッドホールディングス	16	—	—
SHOEI	8	6	32,400
大建工業	—	11	21,626
凸版印刷	39	11	24,530
TAKARA & COMPANY	12	12	24,204
アシックス	10	—	—
河合楽器製作所	5	7	19,607
三菱鉛筆	22	22	31,152
タカラスタンダード	—	15	19,815
コクヨ	19	—	—
グローブライド	8	—	—
電気・ガス業 (1.2%)			
東北電力	—	45	30,780
電源開発	—	14.5	30,754
イーレックス	—	10	27,510
大阪瓦斯	24	16	38,432
東邦瓦斯	8.5	—	—
陸運業 (4.1%)			
SBSホールディングス	—	10	28,460
京浜急行電鉄	—	42	59,388
京成電鉄	24	—	—
東海旅客鉄道	5.5	4.3	69,488
西武ホールディングス	—	47	65,330
西日本鉄道	—	11	31,207
ハマキョウレックス	5	9	28,710
阪急阪神ホールディングス	26	—	—
京阪ホールディングス	10	—	—
名古屋鉄道	17	29	61,625
ヤマトホールディングス	35	—	—
山九	8	—	—
丸全昭和運輸	5.5	6	19,560

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
トナミホールディングス	6	3	11,175
ニッコンホールディングス	15	—	—
セイノーホールディングス	25	—	—
SGホールディングス	—	24	55,488
海運業 (0.6%)			
商船三井	—	18	67,050
Nユナイテッド海運	8.5	—	—
倉庫・運輸関連業 (0.4%)			
トランコム	3.5	—	—
三井倉庫ホールディングス	—	10	34,000
内外トランスライン	10	3	6,384
情報・通信業 (5.9%)			
三菱総合研究所	5	7	28,805
ネクソン	—	9	24,534
SHIFT	1.5	—	—
さくらインターネット	—	16	9,264
eBASE	32	—	—
アステリア	—	16	13,040
テラスカイ	22	—	—
デジタル・インフォメーション・テクノロジー	13	13	18,564
ラクス	13	—	—
ダブルスタンダード	14	15	36,195
Ubicomホールディングス	14	—	—
マクロミル	—	26	28,756
オロ	13	10	15,480
ユーザーローカル	10	—	—
プロトコーポレーション	—	23	26,749
ソースネクスト	160	—	—
インフォコム	17	—	—
ジャストシステム	6	—	—
Zホールディングス	—	75	31,717
アイティフォー	22	22	17,336
アルゴグラフィックス	—	5	18,650
兼松エレクトロニクス	8	8	33,400
都築電気	—	18	24,660
TBSホールディングス	18	—	—
日本テレビホールディングス	23	25	30,500
KDDI	—	15	63,540
光通信	6	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ファイバークート	—	18	18,684
学研ホールディングス	—	20	19,200
ビジネスブレイン太田昭和	—	11	16,698
シーイーシー	31	31	40,455
S C S K	37	—	—
アイネス	22	19	30,818
コナミグループ	—	3.5	25,375
福井コンピュータホールディングス	10	6	21,840
ミロク情報サービス	—	15.5	23,374
卸売業 (7.5%)			
エレマテック	—	16	21,920
あらた	5	7	30,100
トーマンデバイス	5.5	—	—
横浜冷凍	—	16	14,928
アルコニクス	27	10	14,150
あい ホールディングス	18	18	35,208
ダイワボウホールディングス	—	18	34,794
マクニカホールディングス	13	—	—
コマダホールディングス	13	13	30,121
松田産業	15	—	—
ドウシシャ	21	21	32,466
丸文	30	—	—
日本ライフライン	30	30	31,020
進和	8	3	6,807
シークス	—	25	26,350
白銅	9.5	—	—
豊田通商	17	—	—
兼松	30	20	30,320
三井物産	—	21.5	69,294
スターゼン	7.5	7.5	16,140
住友商事	—	18.5	36,028
内田洋行	—	5.2	25,714
三菱商事	—	12	53,436
第一実業	6	—	—
ユアサ商事	10	—	—
神鋼商事	—	2.5	10,562
阪和興業	—	9	30,690
菱電商事	—	8.5	13,914
三愛オブリ	35	35	38,990

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
東邦ホールディングス	18	18	33,714
サンゲツ	14	16	26,736
サンワテクノス	18	—	—
新光商事	12	25	24,100
加賀電子	11	—	—
立花エレテック	—	10	16,620
西本Wismettacホールディングス	6	4	15,840
泉州電業	—	4	22,000
トラスコ中山	—	10	19,610
J Kホールディングス	—	16	16,736
東テク	—	4	14,400
小売業 (8.1%)			
ローソン	—	17	81,855
サンエー	7.5	—	—
くら寿司	4	4	13,180
大黒天物産	4	—	—
クオールホールディングス	11	24	29,856
ジンズホールディングス	3.5	5	21,850
アークランドサービスホールディングス	13.6	13.6	28,424
J. フロント リテイリング	30	—	—
マツキヨココカラ&カンパニー	8.5	—	—
物語コーポレーション	4.5	4.5	30,780
三越伊勢丹ホールディングス	—	60	64,080
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	13	—	—
日本調剤	6.5	13	17,810
セブン&アイ・ホールディングス	15.5	—	—
ツルハホールディングス	6	10	78,500
トリドールホールディングス	10	10	29,180
TOKYO BASE	25	—	—
JMホールディングス	13	15	23,700
クスリのアオキホールディングス	3	5.5	34,375
FOOD & LIFE COMPANIE	7	7	16,842
ノジマ	12	12	34,368
良品計画	28	22	29,414
G-7ホールディングス	12	—	—
コーナン商事	8	—	—
ゼンショーホールディングス	6	6	21,420
ユナイテッドアローズ	—	15	28,095
薬王堂ホールディングス	5	—	—

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
リテールパートナーズ	9	—	—	—
上新電機	7	14	27,188	—
ライフコーポレーション	—	8	21,536	—
コメリ	10	12	32,124	—
しまむら	—	2.4	30,480	—
松屋	19	—	—	—
ヤオコー	—	4	26,360	—
ゼビオホールディングス	—	22	21,978	—
Genky Drug Stores	—	10	36,600	—
アークランドサカモト	—	15	23,565	—
アークス	—	10	21,030	—
パローホールディングス	—	13	24,115	—
保険業 (0.4%)				
第一生命ホールディングス	—	16	38,208	—
不動産業 (2.3%)				
ヒューリック	50	—	—	—
野村不動産ホールディングス	—	20	67,000	—
サムディ	—	8	17,344	—
ディア・ライフ	27	—	—	—
飯田グループホールディングス	34.5	—	—	—
ケイアイスター不動産	5	7	35,210	—
グッドコムアセット	11	11	14,773	—
住友不動産	—	18	61,902	—
エスリード	—	8	13,920	—
日神グループホールディングス	—	20	8,640	—
日本エスコン	—	18	14,436	—
タカラレーベン	—	35	13,195	—
イオンモール	20	—	—	—
カチタス	5	—	—	—
サンフロンティア不動産	14	—	—	—
サービス業 (6.0%)				
日本工営	—	8	28,960	—
ジェイエイシーリクルートメント	15	14	27,972	—
メンバーズ	14	—	—	—
UTグループ	9	—	—	—
パソナグループ	10	15	31,110	—

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
リンクアンドモチベーション	65	65	40,950	—
総合警備保障	10	9	33,210	—
アウトソーシング	17	25	29,450	—
博報堂DYホールディングス	44	—	—	—
クイック	8	8	13,592	—
オリエンタルランド	3.5	—	—	—
ラウンドワン	15	—	—	—
ビー・エム・エル	7	7	25,515	—
りらいあコミュニケーションズ	31	—	—	—
楽天グループ	—	43	29,584	—
テクノプロ・ホールディングス	—	16	52,240	—
アイ・アールジャパンホールディングス	5	—	—	—
Keepers 技研	8	—	—	—
ジャパンマテリアル	22	22	43,010	—
M&Aキャピタルパートナーズ	5	6	20,520	—
ウィルグループ	—	14	18,928	—
メドピア	9	11	19,338	—
エアトリ	7	—	—	—
ストライク	6	—	—	—
ベイカレント・コンサルティング	0.6	0.8	33,840	—
日総工産	29	29	16,530	—
共立メンテナンス	6.5	—	—	—
建設技術研究所	8	8	21,128	—
カナモト	—	18	38,448	—
西尾レントオール	—	9	25,830	—
トーカイ	9	9	16,722	—
セコム	10	—	—	—
セントラル警備保障	—	5	12,895	—
丹青社	30	—	—	—
ベネッセホールディングス	12	12	26,232	—
イオンデイライト	7.5	—	—	—
ダイセキ	—	6	24,870	—
合 計	株数・金額	6,422	5,859	10,512,878
	銘柄数<比率>	328	319	<82.5%>

(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 5,631	千円 10,505,805

○投資信託財産の構成

(2022年8月24日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 10,512,878	% 43.9
コール・ローン等、その他	13,454,755	56.1
投資信託財産総額	23,967,633	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年8月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	30,295,533,334
コール・ローン等	2,650,144,803
株式(評価額)	10,512,878,350
信用取引預け金	10,071,850,080
未収入金	708,493,451
未収配当金	24,266,500
差入保証金	6,327,900,150
(B) 負債	17,551,844,346
信用売証券	10,505,805,600
未払金	689,013,927
未払解約金	6,524,857
未払利息	2,555
差入保証金代用有価証券	6,327,900,150
その他未払費用	22,597,257
(C) 純資産総額(A-B)	12,743,688,988
元本	8,987,852,826
次期繰越損益金	3,755,836,162
(D) 受益権総口数	8,987,852,826口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,179円

<注記事項>

- ①期首元本額 10,176,276,249円
期中追加設定元本額 48,524,402円
期中一部解約元本額 1,236,947,825円
また、1口当たり純資産額は、期末14,179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)	4,873,301,665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)	3,402,121,587円
ヘッジファンドセレクション(ラップ向け)	618,119,329円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	37,037,777円
百戦錬磨の名人ファンド	28,476,215円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	15,441,553円
日本株プライムニュートラル・ファンド(ラップ向け)	13,354,700円
合計	8,987,852,826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 6,440,395,850円

○損益の状況 (2022年2月25日～2022年8月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	171,659,027
受取配当金	171,857,280
受取利息	2,228
その他収益金	1,515
支払利息	△ 201,996
(B) 有価証券売買損益	37,649,907
売買益	2,061,929,027
売買損	△2,024,279,120
(C) 保管費用等	△ 187,750,981
(D) 当期損益金(A+B+C)	21,557,953
(E) 前期繰越損益金	4,224,342,776
(F) 追加信託差損益金	20,294,882
(G) 解約差損益金	△ 510,359,449
(H) 計(D+E+F+G)	3,755,836,162
次期繰越損益金(H)	3,755,836,162

- (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。