

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	2022年12月28日〔当初、無期限〕まで（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。

償還報告書（全体版）

〔繰上償還〕
日本株プライムニュートラル・
ファンド（ラップ向け）



信託終了日：2022年12月28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、「日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）」は、約款の規定に基づき、先般ご案内申し上げました予定通り、12月28日に繰り上げて償還させていただきました。ここに謹んで運用経過と償還内容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。



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	
お客さま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）
お客さまのお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 (分配落)	税込み 分配金	期中騰落率	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	純資産額
				翌日物レート	期中騰落率				
	円 銭	円	%		%	%	%	%	百万円
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
(償還時)	(償還価額)								
34期(2022年12月28日)	12,117.54	—	4.2	101.62	△0.0	—	—	—	1

(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」は買建比率ー売建比率。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基準価額	騰落率	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
			翌日物レート	騰落率			
(期首)	円 銭	%		%	%	%	%
2022年8月24日	11,634	—	101.64	—	82.3	△82.3	—
8月末	11,604	△0.3	101.64	△0.0	82.4	△82.5	—
9月末	11,574	△0.5	101.64	△0.0	78.9	△79.3	—
10月末	11,534	△0.9	101.63	△0.0	82.6	△82.3	—
11月末	12,122	4.2	101.63	△0.0	81.7	△81.3	—
(償還時)	(償還価額)						
2022年12月28日	12,117.54	4.2	101.62	△0.0	—	—	—

(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。

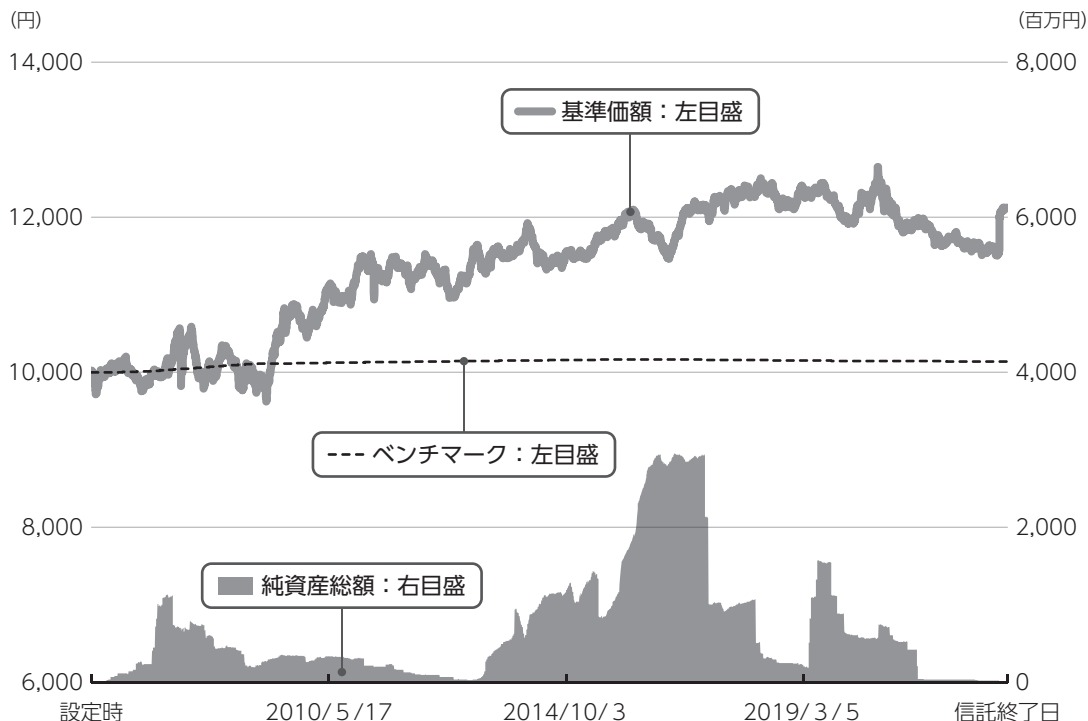
(注) 「株式先物比率」は買建比率ー売建比率。

運用経過

第1期～第34期：2005年12月16日～2022年12月28日

設定来の基準価額等の推移について

基準価額等の推移



第1期首	10,000円
第34期末	12,117.54円
既払分配金	0円
騰落率	21.2%

※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

償還価額は設定時に比べ21.2%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（1.4%）を19.8%上回りました。

> 基準価額の主な変動要因

上昇要因

フローバリューファクター（企業収益に対し株価が割安な銘柄に投資する戦略）や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）などのファクター要因がプラスに寄与しました。

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ました。

第1期～第34期：2005年12月16日～2022年12月28日

▶ 投資環境について

▶ 国内株式市況

国内株式市況は設定時に比べて上昇しました。

設定時から2012年後半にかけては、米サブプライムローン（信用力の低い個人向け住宅ローン）問題に端を発した資本市

場の混乱や欧州債務問題、円高・米ドル安の進行などから下落したものの、その後は日銀による大規模な金融緩和策や世界的な低金利環境、円安・米ドル高を背景に上昇しました。

▶ 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）

信託期間を通じて、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した。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。

第34期（2022年8月25日～信託終了日）は、上記の運用を維持し、繰上償還に向け2022年12月9日にマザーファンドの売却を行いました。

▶ 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。

組入比率は、信託期間を通じてロングとショートのそれぞれの組入比率を、純資産総額に対して概ね65～95%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）

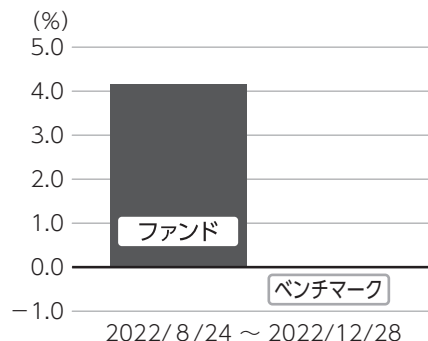
設定来のファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（1.4%）を19.8%上回りました。

マザーファンドの売却を行うまでの期間に実質的な運用を行っているマザーファンドの騰落率がベンチマークの騰落率を上回ったことがプラス要因となりました。

第34期（2022年8月25日～信託終了日）のファンドの騰落率はベンチマークの騰落率（-0.0%）を4.2%上回りました。

マザーファンドの売却を行うまでの期間に実質的な運用を行っているマザーファンドの騰落率がベンチマークの騰落率を上回ったことや信託財産留保額がプラス要因となりました。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）などがマイナスに影響したものの、フローバリューファクターやストックバリューファクターなどのファクター要因、個別銘柄要因、信託財産留保額など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

信託期間中の収益の分配はありません。

償還価額

▶ 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）

償還価額は、12,117円54銭となりました。

信託期間中はご愛顧を賜り、誠にありがとうございました。

2022年8月25日～2022年12月28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	47	0.399	(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)	(40)	(0.342)	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)	(2)	(0.019)	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)	(4)	(0.038)	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	141	1.197	(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)	(141)	(1.197)	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	188	1.596	

期中の平均基準価額は、11,804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。

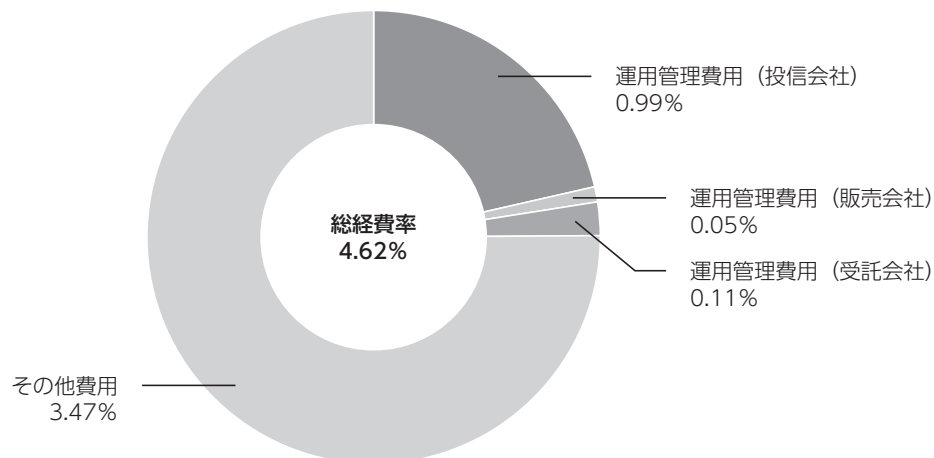
(注) その他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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4.62%**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8月25日～2022年12月28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 1	千円 1	千口 13,356	千円 18,897

○株式売買比率

(2022年8月25日～2022年12月28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	14,646,480千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	10,092,719千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.45

(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8月25日～2022年12月28日)

該当事項はございません。

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す。

○自社による当ファンドの設定・解約状況

(2022年8月25日～2022年12月28日)

期首残高(元本)	当期設定元本	当期解約元本	償還時残高(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12月28日現在)

信託終了日現在、有価証券等の組入れはございません。

親投資信託残高

銘	柄	期首(前期末)	
		口	数
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド			千口 13,354

○投資信託財産の構成

(2022年12月28日現在)

項	目	償 還 時	
		評 価 額	比 率
		千円	%
	コール・ローン等、その他	1,083	100.0
	投資信託財産総額	1,083	100.0

○資産、負債、元本及び償還価額の状況 (2022年12月28日現在)

項	目	償 還 時
		円
(A)	資産	1,083,974
	コール・ローン等	1,083,974
(B)	負債	44,822
	未払信託報酬	44,739
	未払利息	1
	その他未払費用	82
(C)	純資産総額(A－B)	1,039,152
	元本	857,560
	償還差益金	181,592
(D)	受益権総口数	857,560口
	1万口当たり償還価額(C／D)	12,117円54銭

<注記事項>

期首元本額 16,312,845円
 期中追加設定元本額 0円
 期中一部解約元本額 15,455,285円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.211754円です。

○損益の状況

(2022年8月25日～2022年12月28日)

項	目	当 期
		円
(A)	配当等収益	△ 29
	支払利息	△ 29
(B)	有価証券売買損益	50,883
	売買益	63,559
	売買損	△ 12,676
(C)	信託報酬等	△ 44,821
(D)	当期損益金(A＋B＋C)	6,033
(E)	前期繰越損益金	△ 19,661
(F)	追加信託差損益金	195,220
	(配当等相当額)	(280,931)
	(売買損益相当額)	(△ 85,711)
	償還差益金(D＋E＋F)	181,592

(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。

○投資信託財産運用総括表

信託期間	投資信託契約締結日	2005年12月16日		投資信託契約終了時の状況	
	投資信託契約終了日	2022年12月28日		資産総額	1,083,974円
区分	投資信託契約締結当初	投資信託契約終了時	差引増減または追加信託	負債総額	44,822円
				純資産総額	1,039,152円
受益権口数	10,000,000口	857,560口	△9,142,440口	受益権口数	857,560口
元本額	10,000,000円	857,560円	△9,142,440円	1万口当たり償還金	12,117円54銭
毎計算期末の状況					
計算期	元本額	純資産総額	基準価額	1万口当たり分配金	
				金額	分配率
第14期	43,884,121円	50,499,625円	11,507円	0円	0%
第15期	464,586,331	533,985,269	11,494	0	0
第16期	770,707,783	904,211,437	11,732	0	0
第17期	1,017,449,172	1,161,429,254	11,415	0	0
第18期	1,130,487,947	1,300,508,022	11,504	0	0
第19期	890,655,004	1,052,390,950	11,816	0	0
第20期	2,018,954,588	2,393,560,606	11,855	0	0
第21期	2,430,195,147	2,789,414,112	11,478	0	0
第22期	2,388,755,343	2,914,372,319	12,200	0	0
第23期	816,522,044	996,702,522	12,207	0	0
第24期	839,525,277	1,040,713,788	12,396	0	0
第25期	239,131,341	293,409,332	12,270	0	0
第26期	185,550,029	230,192,204	12,406	0	0
第27期	1,262,438,595	1,549,360,340	12,273	0	0
第28期	504,375,580	602,579,535	11,947	0	0
第29期	599,357,619	746,558,276	12,456	0	0
第30期	354,873,626	419,962,792	11,834	0	0
第31期	27,779,794	32,342,663	11,643	0	0
第32期	28,251,058	32,949,614	11,663	0	0
第33期	16,312,845	18,978,091	11,634	0	0

○償還金のお知らせ

1 万口当たり 償還金（税込み）	12,117円54銭
------------------	------------

◆償還金は償還日から起算して5営業日までにお支払いを開始しております。

◆課税上の取り扱い

- ・個人受益者の場合、償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得等として課税され、原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。
- ・特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

※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。

【お 知 ら せ】

全残存口数に対して受益者からの解約請求があり、約款第52条第1項に規定する「やむを得ない事情が発生」した場合に該当し、また、約款第52条第6項に規定する「真にやむを得ない事情が生じている場合」に該当するため、信託約款の規定に基づき、信託を終了しました。
(2022年12月28日)

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 比 率	株 式 先 物 比 率	純 資 産 総 額
	円	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 コ ー ル 翌 日 物 レ ー 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	%		%	%	%	%
	14,151	—	101.65	—	77.5	△77.5	—
2 月 末	14,156	0.0	101.65	△0.0	79.2	△79.2	—
3 月 末	14,201	0.4	101.65	△0.0	78.8	△78.5	—
4 月 末	14,107	△0.3	101.65	△0.0	76.7	△76.8	—
5 月 末	14,171	0.1	101.65	△0.0	82.1	△81.7	—
6 月 末	14,105	△0.3	101.65	△0.0	79.2	△79.3	—
7 月 末	14,086	△0.5	101.64	△0.0	81.5	△81.6	—
(期 末) 2022年 8 月 24 日							
	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

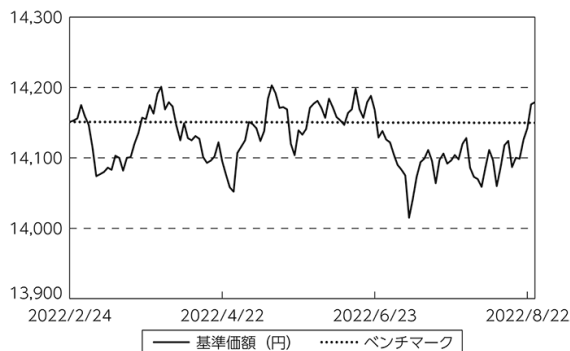
◎基準価額の動き

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	$\frac{D}{C}$
	百万円	百万円	%	百万円	百万円	%
株式	15,137	67	0.4	16,435	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	評 価 額
	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	評 価 額
	千株	千株	千円
DM三井製糖ホールディングス	—	5.5	10,367
寿スビリッツ	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	—	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	—	—
ビックル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
レンゴー	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	評 価 額	
	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	—	—	
住友バークライト	—	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	評 価 額
	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	—	—
ペプチドリーム	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	—	—
A G C	—	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	評 価 額	
	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	—	—	
R S T e c h n o l o g i e s	7	4	28,080	
文化シャッター	—	18	18,972	
L I X I L	28	30	75,930	
日東精工	11	—	—	
岡部	26	26	16,692	
ジーテクト	—	9	12,888	
東ブレ	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	
F U J I	15.5	15.5	31,728	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末		
	株 数	株 数	評 価 額	
	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・ビー機械	—	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	—	—	
J U K I	30	—	—	
新晃工業	—	13	20,852	
リケン	8	8.2	20,032	
T P R	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)	当 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
IPEX	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)	当 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	—	—
ノーリツ銅機	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ANDARD	—	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
NS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
ファイバーゲート	—	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
アルコニックス	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	—	—
コメ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	—	—
立花エレクトック	—	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	—	—
J M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	評 価 額
	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	評 価 額
	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
メドビア	9	11	19,338
エアトリ	7	—	—
ストライク	6	—	—
ペイカレント・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
イオンディライト	7.5	—	—
ダイセキ	—	6	24,870
合 計	株 数 ・ 金 額	6,422	5,859
	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
	千円	%
株式	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。