

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	
信託期間	無期限（2020年8月31日設定）	
運用方針	日本株ESGアクティブマザーファンド受益証券への投資を通じて、主としてわが国の株式に投資を行います。 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。 株式以外の資産への実質投資割合（信託財産に属する株式以外の資産の時価総額と信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の総額に占める株式以外の資産の時価総額の割合を乗じて得た額との合計額が信託財産の総額に占める割合）は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。	
主要運用対象	ベビーフンド	日本株ESGアクティブマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。
	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。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。
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）

三菱UFJ DC日本株ESG アクティブファンド

愛称：そだてるみらい

第1期（決算日：2021年5月25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「三菱UFJ DC日本株ESGアクティブファンド」は、去る5月25日に第1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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額			(参考指数) 東証株価指数(TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込 分配	み 金 騰 落 率	(配当込み)	騰 落 率			
(設定日)	円	円	%		%	%	%	百万円
2020年8月31日	10,000	—	—	2,503.59	—	—	—	1
1期(2021年5月25日)	12,606	0	26.1	3,027.06	20.9	97.0	—	9

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 東証株価指数(TOPIX)(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。東証株価指数(TOPIX)(配当込み)(TOPIXといいますが)の指数値およびTOPIXの商標は、東京証券取引所の知的財産権であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利およびTOPIXの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		(参考指数) 東証株価指数(TOPIX)		株式組入比率	株式先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	(配当込み)	騰 落 率		
(設定日)	円	%		%	%	%
2020年8月31日	10,000	—	2,503.59	—	—	—
9月末	10,197	2.0	2,536.14	1.3	97.5	—
10月末	9,811	△ 1.9	2,464.21	△ 1.6	97.5	—
11月末	11,128	11.3	2,738.72	9.4	98.1	—
12月末	11,308	13.1	2,819.93	12.6	98.2	—
2021年1月末	11,460	14.6	2,826.50	12.9	98.6	—
2月末	11,614	16.1	2,914.58	16.4	98.3	—
3月末	12,392	23.9	3,080.87	23.1	97.5	—
4月末	12,253	22.5	2,993.46	19.6	97.7	—
(期末)						
2021年5月25日	12,606	26.1	3,027.06	20.9	97.0	—

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 騰落率は設定日比。

(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」、「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1期：2020年8月31日～2021年5月25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1期首	10,000円
第1期末	12,606円
既払分配金	0円
騰落率	26.1%

※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

基準価額は設定時に比べ26.1%の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因

上昇要因

世界的に大規模な経済対策や金融緩和が実施されていることなどを背景として国内株式市況が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

新型コロナウイルスの新規感染者数増加を受けて国内経済の先行き不透明感が高まったことなどから一時的に国内株式市況が下落したことが、一時的な基準価額の下落要因となりました。

銘柄要因

上位5銘柄・・・東芝、日立製作所、ディスコ、日本通運、ソニーグループ

下位5銘柄・・・第一三共、セコム、武田薬品工業、カゴメ、南都銀行

第1期：2020年8月31日～2021年5月25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。

設定時から2020年10月末にかけては、欧米における新型コロナウイルスの感染再拡大や米大統領選への警戒感などから上値の重い展開となりました。

11月から2021年3月末にかけては、世界的に大規模な経済対策や金融緩和が実施されていることや新型コロナウイルス

ワクチンの普及による経済正常化への期待などから国内株式市況は大幅に上昇しました。

4月から期末にかけては、新型コロナウイルスの新規感染者数増加や緊急事態宣言発出などを受けて国内経済の先行き不透明感が高まったことなどから、国内株式市況は下落しました。

当該投資信託のポートフォリオについて

▶ 三菱UFJ DC日本株ESGアクティブファンド

日本株ESGアクティブマザーファンド受益証券を通じて、わが国の株式に投資しています。

▶ 日本株ESGアクティブマザーファンド

株式組入比率は、運用の基本方針にしたがい、高位を維持しました。株式への投資にあたっては、ESGの取

り組みの改善が見込まれる企業の中から、企業収益の成長性、株価水準等を考慮して、銘柄選定を行いました。

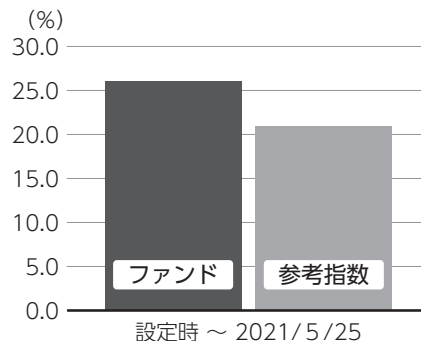
設定時に35銘柄へ投資を行っていましたが、その後、組入銘柄数は、概ね35～36銘柄程度で推移させました。取締役任期短縮や資本政策明確化などのガバナンス面での顕著な改善が図られた日本瓦斯を新規に組み入れました。全株売却銘柄はありません。

当該投資信託のベンチマークとの差異について

当ファンドは運用の目標となるベンチマークを設けておりません。右記のグラフは当ファンドの基準価額と参考指数の騰落率との対比です。

参考指数は東証株価指数（TOPIX）（配当込み）です。

基準価額と参考指数の対比（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1期 2020年8月31日～2021年5月25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	2,605

(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。)

▶三菱UFJ DC日本株ESGアクティブファンド

日本株ESGアクティブマザーファンド
受益証券の組入比率は、引き続き高位を維持する方針です。国内株式の実質組入比率についても、概ね90%以上の水準を維持する方針です。

▶日本株ESGアクティブマザーファンド

今後も経営陣への取材や綿密な企業調査等を行い、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業に投資し、中長期的な値上がり益の獲得をめざす基本方針を継続します。

世界的なESG重視の動きが拡大しており、今後もその動きが継続するとみています。企業のESGへの取り組み状況に着目して銘柄選択を行ってまいります。

2020年8月31日～2021年5月25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	71	0.627	(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)	(34)	(0.296)	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)	(34)	(0.299)	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)	(0.032)	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	28	0.242	(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)	(28)	(0.242)	
(c) その他費用	0	0.000	(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)	(0.000)	ファンドの決算時等に監査法人から監査を受けるための費用
合 計	99	0.869	

期中の平均基準価額は、11,391円です。

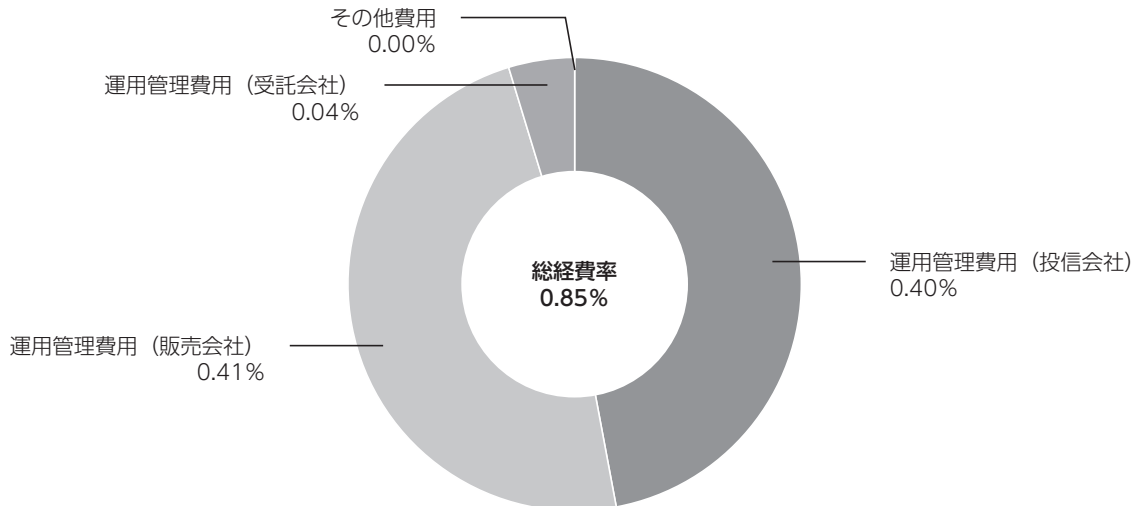
- (注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。
- (注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

- (注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。
- (注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

(参考情報)

■ 総経費率

当期中の運用・管理にかかった費用の総額（原則として、募集手数料、売買委託手数料及び有価証券取引税を除く。）を期中の平均受益権口数に期中の平均基準価額（1口当たり）を乗じた数で除した**総経費率（年率）は0.85%**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

(2020年8月31日～2021年5月25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ESGアクティブマザーファンド	千口 6,931	千円 9,766	千口 750	千円 1,075

○株式売買比率

(2020年8月31日～2021年5月25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ESGアクティブマザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	769,116千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	377,455千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	2.03	

(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

(2020年8月31日～2021年5月25日)

利害関係人との取引状況

<三菱UFJ DC日本株ESGアクティブファンド>

該当事項はございません。

<日本株ESGアクティブマザーファンド>

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 681	百万円 294	% 43.2	百万円 88	百万円 6	% 6.8

平均保有割合 0.5%

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

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)	4千円
うち利害関係人への支払額 (B)	1千円
(B) / (A)	40.9%

(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、モルガン・スタンレーMUFJ証券です。

○ 自社による当ファンドの設定・解約状況

(2020年8月31日～2021年5月25日)

設定時残高(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	百万円	百万円	
1	—	—	1	当初設定時における取得

○ 組入資産の明細

(2021年5月25日現在)

親投資信託残高

銘 柄	当 期 末	
	口 数	評 価 額
日本株ESGアクティブマザーファンド	千口 6,180	千円 9,021

○ 投資信託財産の構成

(2021年5月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
日本株ESGアクティブマザーファンド	千円 9,021	% 99.6
コール・ローン等、その他	34	0.4
投資信託財産総額	9,055	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,055,299
コール・ローン等	33,336
日本株ESGアクティブマザーファンド(評価額)	9,021,605
未収入金	358
(B) 負債	12,135
未払信託報酬	12,126
その他未払費用	9
(C) 純資産総額(A-B)	9,043,164
元本	7,173,713
次期繰越損益金	1,869,451
(D) 受益権総口数	7,173,713口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,606円

<注記事項>

- ①設定元本額 1,000,000円
 期中追加設定元本額 7,037,551円
 期中一部解約元本額 863,838円
 また、1口当たり純資産額は、期末12,606円です。

②分配金の計算過程

項 目	2020年8月31日～ 2021年5月25日
費用控除後の配当等収益額	21,673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	270,660円
収益調整金額	1,577,118円
分配準備積立金額	－円
当ファンドの分配対象収益額	1,869,451円
1万口当たり収益分配対象額	2,605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 (2020年8月31日～2021年5月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 有価証券売買損益	304,468
売買益	331,860
売買損	△ 27,392
(B) 信託報酬等	△ 12,135
(C) 当期損益金(A+B)	292,333
(D) 追加信託差損益金	1,577,118
(売買損益相当額)	(1,577,118)
(E) 計(C+D)	1,869,451
(F) 収益分配金	0
次期繰越損益金(E+F)	1,869,451
追加信託差損益金	1,577,118
(配当等相当額)	(2,887)
(売買損益相当額)	(1,574,231)
分配準備積立金	292,333

- (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) (D)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ESGアクティブマザーファンド

《第4期》決算日2021年5月25日

[計算期間：2020年11月26日～2021年5月25日]

「日本株ESGアクティブマザーファンド」は、5月25日に第4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4期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	主としてわが国の株式に投資を行います。株式への投資にあたっては、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業の中から、企業収益の成長性、株価水準等を考慮して、銘柄選定を行います。株式の組入比率は高位を維持することを基本とします。株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。
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。

○設定以来の運用実績

決算期	基準価額		(参考指数) 東証株価指数 (TOPIX)		株組入比率	株先物比率	純資産額
	期騰落	期中率	(配当込み) 期騰落	期中率			
(設定日)	円	%		%	%	%	百万円
2019年5月15日	10,000	—	2,323.81	—	—	—	299
1期(2019年11月25日)	11,761	17.6	2,593.80	11.6	98.3	—	350
2期(2020年5月25日)	10,691	△9.1	2,320.89	△10.5	97.7	—	316
3期(2020年11月25日)	12,976	21.4	2,758.10	18.8	98.4	—	384
4期(2021年5月25日)	14,597	12.5	3,027.06	9.8	97.3	—	1,048

(注) 設定日の基準価額は、設定時の価額です。

(注) 基準価額動向の理解に資するため、参考指数を掲載しておりますが、当ファンドのベンチマークではありません。

(注) 東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。東証株価指数 (TOPIX) (配当込み) (TOPIXといひます) の指数値および TOPIX の商標は、東京証券取引所の知的財産権であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用など TOPIX に関するすべての権利および TOPIX の商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

(注) 設定日の純資産総額は、設定元本を表示しております。

○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		(参 考 指 数) 東証株価指数 (TOPIX) (配 当 込 み)		株 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率		
(期 首) 2020年11月25日	円	%		%	%	%
	12,976	—	2,758.10	—	98.4	—
11月末	12,972	△ 0.0	2,738.72	△ 0.7	98.4	—
12月末	13,192	1.7	2,819.93	2.2	98.5	—
2021年1月末	13,379	3.1	2,826.50	2.5	98.8	—
2月末	13,568	4.6	2,914.58	5.7	98.6	—
3月末	14,490	11.7	3,080.87	11.7	97.7	—
4月末	14,313	10.3	2,993.46	8.5	97.9	—
(期 末) 2021年5月25日						
	14,597	12.5	3,027.06	9.8	97.3	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

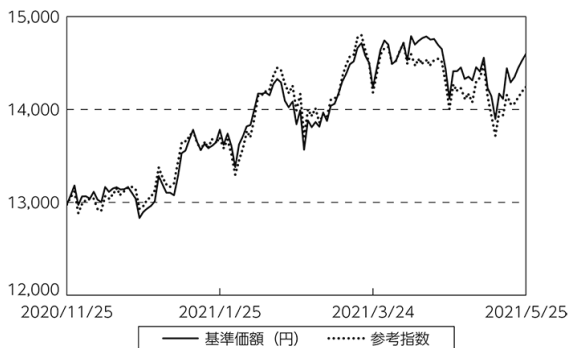
○運用経過

●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12.5%の上昇となりました。

基準価額等の推移



(注) 参考指数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)

世界的に大規模な経済対策や金融緩和が実施されていることなどを背景として国内株式市況が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

新型コロナウイルスの新規感染者数増加を受けて国内経済の先行き不透明感が高まったことなどから一時的に国内株式市況が下落したことが、一時的な基準価額の下落要因となりました。

(銘柄要因)

上位5銘柄…東芝、富士通、日立製作所、リコー、栗田工業

下位5銘柄…第一三共、バンダイナムコホールディングス、オリエンタルランド、カゴメ、セコム

●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月末にかけては、世界的に大規模な経済対策や金融緩和が実施されていることや新型コロナウイルスワクチンの普及による経済正常化への期待などから国内株式市況は大幅に上昇しました。
- ・4月から期末にかけては、新型コロナウイルスの新規感染者数増加や緊急事態宣言発出などを受けて国内経済の先行き不透明感が高まったことなどから、国内株式市況は下落しました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・株式組入比率は、運用の基本方針にしたがい、高位を維持しました。
- ・株式への投資にあたっては、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業の中から、企業収益の成長性、株価水準等を考慮して、銘柄選定を行いました。
- ・期首に35銘柄へ投資を行っていましたが、その後、組入銘柄数は、概ね35~36銘柄程度で推移させました。取締役任期短縮や資本政策明確化などのガバナンス面での顕著な改善が図られた日本瓦斯を新規に組み入れました。全株売却銘柄はありません。

○今後の運用方針

- ・今後も経営陣への取材や綿密な企業調査等を行い、ESGの取り組みの改善が見込まれる企業に投資し、中長期的な値上がり益の獲得をめざす基本方針を継続します。
- ・世界的なESG重視の動きが拡大しており、今後もその動きが継続するとみています。企業のESGへの取り組み状況に着目して銘柄選択を行ってまいります。

○1万口当たりの費用明細

(2020年11月26日～2021年5月25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 18 (18)	% 0.131 (0.131)	(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
合 計	18	0.131	
期中の平均基準価額は、13,927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

(2020年11月26日～2021年5月25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		182	668,632	23	77,865
		(7)	(-)		

(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

(2020年11月26日～2021年5月25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	746,497千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	397,341千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	1.87

(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

(2020年11月26日～2021年5月25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 668	百万円 293	43.9	百万円 77	百万円 6	7.8

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)	577千円
うち利害関係人への支払額 (B)	230千円
(B) / (A)	39.9%

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MUFJ証券です。

○組入資産の明細

(2021年5月25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
建設業 (2.4%)				
積水ハウス	4.4	10.8	24,888	
食料品 (1.4%)				
カゴメ	2.2	4.6	13,892	
繊維製品 (0.8%)				
デサント	1.8	4.2	7,980	
バルブ・紙 (1.1%)				
日本製紙	2.8	6.6	8,844	
三菱製紙	3.1	6.6	2,402	
化学 (2.5%)				
ニフコ	3.8	6.6	25,344	
医薬品 (4.6%)				
武田薬品工業	2.5	5	18,715	
第一三共	5.1	8.5	21,819	
大正製薬ホールディングス	0.5	1	6,310	
ゴム製品 (2.5%)				
ブリヂストン	2.2	5.3	25,413	
機械 (8.4%)				
ディスコ	0.6	1.2	39,060	
栗田工業	2.8	5.6	28,224	
キトー	4.4	10.7	18,896	
電気機器 (26.8%)				
日立製作所	2.1	9.8	55,291	
東芝	3.7	11.7	54,171	
オムロン	1.5	2.3	19,136	
富士通	1.2	3.1	56,606	
シャープ	4.7	10	20,010	
ソニーグループ	2	3.7	39,793	
京セラ	0.8	1.8	12,160	

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
リコー	7.1	12.8	16,204	
輸送用機器 (5.5%)				
トヨタ自動車	1.5	6.3	55,925	
精密機器 (3.1%)				
島津製作所	3.9	8.2	31,570	
その他製品 (14.3%)				
パンダイナムコホールディングス	2.3	4.9	38,700	
トッパン・フォームズ	13.3	18.4	20,460	
凸版印刷	6.2	20.4	38,821	
ヤマハ	2.5	7.3	47,377	
陸運業 (3.9%)				
日本通運	1.9	4.4	39,336	
情報・通信業 (3.4%)				
カブコン	2.8	10.7	35,203	
卸売業 (1.9%)				
三菱商事	2.7	6.4	18,937	
小売業 (5.9%)				
日本瓦斯	—	19	34,010	
丸井グループ	4.1	13.3	26,440	
銀行業 (2.4%)				
南都銀行	5.5	13.2	24,644	
サービス業 (9.1%)				
オリエンタルランド	0.9	2.1	32,298	
リクルートホールディングス	2.8	8.2	45,223	
セコム	0.9	1.8	15,395	
合 計	株 数・金 額	110	276	1,019,505
	銘柄数<比率>	35	36	<97.3%>

(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。

○投資信託財産の構成

(2021年5月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 1,019,505	% 95.5
コール・ローン等、その他	47,888	4.5
投資信託財産総額	1,067,393	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2021年5月25日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,067,393,226 円
コール・ローン等	44,049,476
株式(評価額)	1,019,505,000
未収配当金	3,838,750
(B) 負債	19,100,815
未払金	18,784,355
未払解約金	316,448
未払利息	12
(C) 純資産総額(A-B)	1,048,292,411
元本	718,134,467
次期繰越損益金	330,157,944
(D) 受益権総口数	718,134,467口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,597円

<注記事項>

- ①期首元本額 296,011,785円
 期中追加設定元本額 424,412,897円
 期中一部解約元本額 2,290,215円
 また、1口当たり純資産額は、期末14,597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)

国内株式セレクション(ラップ向け)	385,033,175円
日本株ESGアクティブファンド(適格機関投資家限定)	293,661,246円
三菱UFJアドバンスト・バランス(安定成長型)	27,630,181円
三菱UFJDC日本株ESGアクティブファンド	6,180,452円
三菱UFJアドバンスト・バランス(安定型)	4,959,264円
三菱UFJDC世界ESGバランスファンド	670,149円
合計	718,134,467円

[お知らせ]

より投資家が理解しやすい表現へ改めるため、投資態度の記載変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。
 (2020年8月31日)

○損益の状況 (2020年11月26日～2021年5月25日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	4,185,910 円
受取配当金	4,186,450
受取利息	3
その他収益金	77
支払利息	△ 620
(B) 有価証券売買損益	50,979,529
売買益	69,579,318
売買損	△ 18,599,789
(C) 当期損益金(A+B)	55,165,439
(D) 前期繰越損益金	88,082,572
(E) 追加信託差損益金	187,849,757
(F) 解約差損益金	△ 939,824
(G) 計(C+D+E+F)	330,157,944
次期繰越損益金(G)	330,157,944

- (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) (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。
 (注) (F)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。