

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2期（決算日：2022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2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)		株式組入比率	株式先物比率	純資産総額
	(分配落)	税込分配金	期中騰落率	東証株価指数(配当込み)	(TOPIX)期中騰落率			
(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
2期(2022年5月25日)	13,772	0	9.2	3,029.53	0.1	95.8	—	97

(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、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社(以下「JPX」という。)の知的財産であり、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・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPX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 組 入 比 率	株 先 物 比 率
	騰 落 率	騰 落 率	(配 当 込 み)	騰 落 率		
(期 首) 2021年 5 月25日	円	%		%	%	%
	12,606	—	3,027.06	—	97.0	—
5 月 末	12,666	0.5	3,034.76	0.3	97.6	—
6 月 末	13,001	3.1	3,070.81	1.4	97.3	—
7 月 末	12,546	△0.5	3,003.91	△0.8	97.6	—
8 月 末	12,931	2.6	3,099.08	2.4	101.4	—
9 月 末	13,617	8.0	3,234.08	6.8	97.1	—
10 月 末	13,487	7.0	3,188.28	5.3	96.7	—
11 月 末	13,054	3.6	3,073.26	1.5	100.1	—
12 月 末	13,697	8.7	3,179.28	5.0	97.4	—
2022年 1 月 末	12,939	2.6	3,025.69	△0.0	96.8	—
2 月 末	12,943	2.7	3,012.57	△0.5	99.4	—
3 月 末	13,585	7.8	3,142.06	3.8	96.2	—
4 月 末	13,515	7.2	3,066.68	1.3	96.5	—
(期 末) 2022年 5 月25日						
	13,772	9.2	3,029.53	0.1	95.8	—

(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」、「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2期：2021年5月26日～2022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2期首	12,606円
第2期末	13,772円
既払分配金	0円
騰落率	9.2%

※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9.2%の上昇となりました。

基準価額の主な変動要因**上昇要因**

米国金利の上昇などを受けて為替が円安・米ドル高に推移したことで国内株式市況が上昇したことや個別銘柄選択により組入銘柄の株価が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

下落要因

ロシア・ウクライナ情勢を巡る不透明感の広がりや金融引き締めを急速に進めていく米連邦準備制度理事会（FRB）の姿勢への警戒などから国内株式市況が一時的に下落したことが、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・・・第一三共、三菱商事、凸版印刷、東芝、日立製作所

下位5銘柄・・・シャープ、ヤマハ、NIPPON EXPRESSホールディングス、ニフコ、リクルートホールディングス

第2期：2021年5月26日～2022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。

期首から2021年9月中旬にかけては、菅氏が自民党総裁選に立候補しない旨を示したことで、新政権の誕生と経済対策への期待が広がったことや国内における新型コロナウイルスの新規感染者数が減少したことなどを好感し、国内株式市況は

上昇しました。

9月下旬から期末にかけては、インフレ圧力の強まりを受けてFRBが金融引き締めを進めていく姿勢を明確化したことやロシアのウクライナ侵攻による地政学リスクの高まり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。

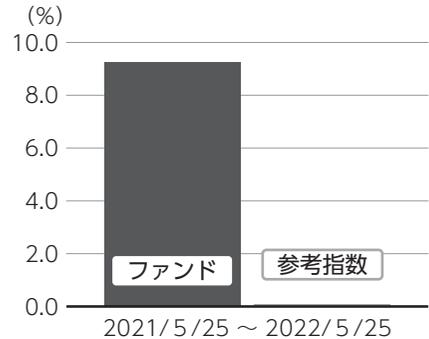
組入銘柄数は、概ね33～37銘柄程度で推移させました。資本効率を意識した経営への取り組みに進展の見られた北國フィナンシャルホールディングスなど4銘柄を新規に組み入れました。また、複数年の対話の中でガバナンス強化策に進展が見られなかったシャープなど5銘柄を全株売却しました。

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2期 2021年5月26日～2022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	3,771

(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。

2021年5月26日～2022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	111	0.836	(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)	(52)	(0.396)	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)	(52)	(0.396)	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)	(0.044)	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	8	0.061	(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)	(8)	(0.061)	
(c) その他費用	0	0.002	(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)	(0.002)	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	119	0.899	

期中の平均基準価額は、13,246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。

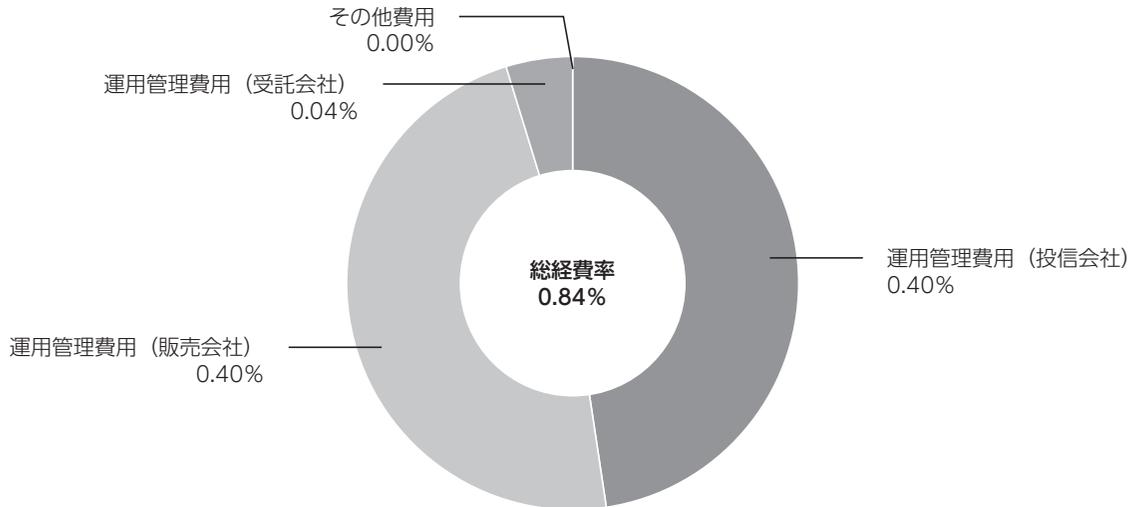
(注) 売買委託手数料およびその他費用は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものを含みます。

(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0.84%**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5月26日～2022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 71,767	千円 111,501	千口 16,726	千円 25,581

○株式売買比率

(2021年5月26日～2022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	790,948千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,205,523千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.65	

(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5月26日～2022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 582	百万円 101	% 17.4	百万円 208	百万円 12	% 5.8

平均保有割合 2.6%

※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)	17千円
うち利害関係人への支払額 (B)	3千円
(B) / (A)	20.7%

(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

(2021年5月26日～2022年5月25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 1	百万円 —	百万円 —	百万円 1	当初設定時における取得

○ 組入資産の明細

(2022年5月25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ESGアクティブマザーファンド	千口 6,180	千口 61,221	千円 97,728

○ 投資信託財産の構成

(2022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 97,728	% 99.6
コール・ローン等、その他	412	0.4
投資信託財産総額	98,140	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月25日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	98,140,903
コール・ローン等	412,846
日本株ESGアクティブマザーファンド(評価額)	97,728,057
(B) 負債	169,802
未払信託報酬	169,288
その他未払費用	514
(C) 純資産総額(A-B)	97,971,101
元本	71,137,940
次期繰越損益金	26,833,161
(D) 受益権総口数	71,137,940口
1万口当たり基準価額(C/D)	13,772円

<注記事項>

- ①期首元本額 7,173,713円
 期中追加設定元本額 88,019,757円
 期中一部解約元本額 24,055,530円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.3772円です。

②分配金の計算過程

項 目	2021年5月26日～ 2022年5月25日
費用控除後の配当等収益額	655,072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	1,564,619円
収益調整金額	24,558,438円
分配準備積立金額	55,032円
当ファンドの分配対象収益額	26,833,161円
1万口当たり収益分配対象額	3,771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、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5月26日～2022年5月25日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 1
支払利息	△ 1
(B) 有価証券売買損益	2,460,575
売買益	2,988,943
売買損	△ 528,368
(C) 信託報酬等	△ 240,883
(D) 当期損益金(A+B+C)	2,219,691
(E) 前期繰越損益金	55,032
(F) 追加信託差損益金	24,558,438
(配当等相当額)	(2,872,437)
(売買損益相当額)	(21,686,001)
(G) 計(D+E+F)	26,833,161
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	26,833,161
追加信託差損益金	24,558,438
(配当等相当額)	(3,097,625)
(売買損益相当額)	(21,460,813)
分配準備積立金	2,274,723

- (注) (B) 有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。
 (注) (C) 信託報酬等には信託報酬に対する消費税等相当額を含めて表示しています。
 (注) (F) 追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。

日本株ESGアクティブマザーファンド

【第6期】決算日2022年5月25日

[計算期間：2021年11月26日～2022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6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6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。

○最近5期の運用実績

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
	期 騰 落	中 率	(配当込み) 期 騰 落	中 率			
	円	%		%	%	%	百万円
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
5期(2021年11月25日)	15,865	8.7	3,227.36	6.6	97.5	—	1,295
6期(2022年5月25日)	15,963	0.6	3,029.53	△ 6.1	96.1	—	1,539

(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、日本の株式市場を広範に網羅するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークで、浮動株ベースの時価総額加重方式により算出される株価指数です。TOPIXの指数値及びTOPIXに係る標章又は商標は、株式会社JPX総研又は株式会社JPX総研の関連会社 (以下「JPX」という。) の知的財産であり、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・ノウハウ及びTOPIXに係る標章又は商標に関するすべての権利はJPXが有します。

(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		(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		
(期 首) 2021年11月25日	円 15,865	% —	3,227.36	% —	% 97.5	% —
11月末	15,096	△4.8	3,073.26	△4.8	97.3	—
12月末	15,860	△0.0	3,179.28	△1.5	97.6	—
2022年1月末	14,977	△5.6	3,025.69	△6.2	97.0	—
2月末	14,983	△5.6	3,012.57	△6.7	96.8	—
3月末	15,721	△0.9	3,142.06	△2.6	96.4	—
4月末	15,649	△1.4	3,066.68	△5.0	96.7	—
(期 末) 2022年5月25日	15,963	0.6	3,029.53	△6.1	96.1	—

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

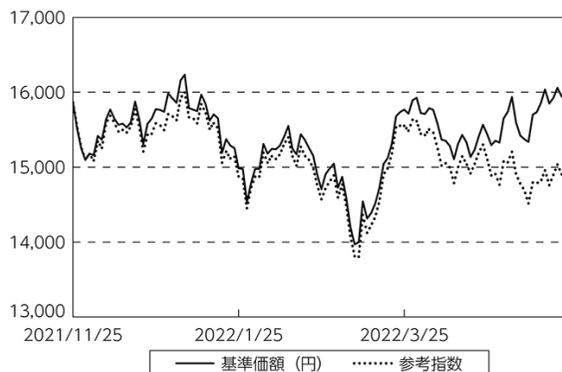
○運用経過

●当期中の基準価額等の推移について

◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ0.6%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)

米国金利の上昇などをを受けて為替が円安・米ドル高に推移したことで国内株式市況が一時的に上昇したことや個別銘柄選択により組入銘柄の株価が上昇したことが、基準価額の上昇要因となりました。

(下落要因)

ロシア・ウクライナ情勢を巡る不透明感の広がりや金融引き締めを急速に進めていく米連邦準備制度理事会 (FRB) の姿勢への警戒などから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…凸版印刷、東芝、カプコン、三菱商事、日本瓦斯

下位5銘柄…リクルートホールディングス、ソニーグループ、オムロン、ヤマハ、デサント

●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2022年3月上旬にかけては、米国の消費者物価指数が市場予想を上回る上昇となったことで金融引き締めへの懸念が強まったことやロシアのウクライナ侵攻による地政学リスクの高まりなどから国内株式市況は下落しました。
- ・3月中旬から期末にかけては、ロシア・ウクライナの和平交渉進展への期待や為替が円安・米ドル高に推移したことなどから国内株式市況は上昇したものの、足下のインフレ圧力の強まりを受けてFRBが金融引き締めを進めていく姿勢を明確化したことで一転下落するなど、値動きの荒い展開となりました。

●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・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。

- ・組入銘柄数は、概ね33～35銘柄程度で推移させました。資本効率を意識した経営への取り組みに進展の見られた北國フィナンシャルホールディングスなど3銘柄を新規に組み入れました。また、複数年の対話の中でガバナンス強化策に進展が見られなかったシャープなど3銘柄を全株売却しました。

○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

(2021年11月26日～2022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 3 (3)	% 0.022 (0.022)	(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	3	0.022	
期中の平均基準価額は、15,389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11月26日～2022年5月25日)

株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 93	千円 308,411	千株 39	千円 90,715

(注) 金額は受渡代金。

○株式売買比率

(2021年11月26日～2022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	399,126千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	1,273,510千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	0.31

(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11月26日～2022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	$\frac{D}{C}$
		百万円	%		百万円	%
株式	308	65	21.1	90	4	4.4

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)	286千円
うち利害関係人への支払額 (B)	53千円
(B) / (A)	18.8%

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

(2022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 (2.0%)				
積水ハウス	13.2	12.9	28,954	
食料品 (4.1%)				
味の素	—	12.4	39,841	
カゴメ	3.7	—	—	
フジッコ	—	10.6	20,193	
繊維製品 (0.5%)				
デサント	3.3	3.3	7,755	
パルプ・紙 (0.4%)				
日本製紙	6.6	6.5	6,097	
化学 (1.5%)				
ニフコ	6.6	7.7	22,422	
医薬品 (5.1%)				
武田薬品工業	1.9	1.9	7,195	
第一三共	17.3	19.6	68,110	
ゴム製品 (3.7%)				
ブリヂストン	10.3	11.1	55,322	
機械 (6.2%)				
ディスコ	1.4	1.4	47,040	
栗田工業	5.6	5.5	26,372	
キトー	10.7	7	18,466	
電気機器 (26.3%)				
日立製作所	10.4	11.3	74,862	
東芝	10.5	12.2	70,028	
オムロン	2.3	5.3	37,963	
富士通	2.5	3.2	61,744	
シャープ	10	—	—	
ソニーグループ	5.2	6	67,230	
京セラ	4.8	4.7	33,840	
リコー	35.7	42.9	43,629	

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
輸送用機器 (4.4%)				
トヨタ自動車	20.5	31.6	64,574	
精密機器 (3.0%)				
島津製作所	9.8	9.6	45,168	
その他製品 (12.3%)				
パンダイナムコホールディングス	4.9	7	66,535	
トッパン・フォームズ	4.1	—	—	
凸版印刷	29.4	30.2	71,060	
ヤマハ	7.3	8.6	43,946	
陸運業 (2.2%)				
日本通運	4.4	—	—	
NIPPON EXPRESSホールディン	—	4.3	31,992	
情報・通信業 (4.7%)				
カブコン	17.7	19.8	69,498	
卸売業 (4.2%)				
三菱商事	9.9	14	62,888	
小売業 (9.0%)				
セブン&アイ・ホールディングス	9.9	10.2	53,274	
日本瓦斯	24.1	23.2	43,012	
丸井グループ	15.7	15.4	36,682	
銀行業 (4.9%)				
北國フィナンシャルホールディングス	—	9.9	38,560	
南都銀行	13.2	17.5	33,302	
サービス業 (5.5%)				
オリエンタルランド	2.1	1.8	35,001	
リクルートホールディングス	7.3	8	35,656	
セコム	1.8	1.3	10,931	
合 計	株 数・金 額	344	397	1,479,150
	銘柄数<比率>	35	35	<96.1%>

(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

(2022年5月25日現在)

項 目	当 期 末	
	評 価 額	比 率
株式	千円 1,479,150	% 93.6
コール・ローン等、その他	100,941	6.4
投資信託財産総額	1,580,091	100.0

○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2022年5月25日現在)

項 目	当 期 末
(A) 資産	1,580,091,803 円
コール・ローン等	88,065,003
株式(評価額)	1,479,150,650
未収配当金	12,876,150
(B) 負債	40,611,252
未払金	40,271,125
未払解約金	340,088
未払利息	39
(C) 純資産総額(A-B)	1,539,480,551
元本	964,417,789
次期繰越損益金	575,062,762
(D) 受益権総口数	964,417,789口
1万口当たり基準価額(C/D)	15,963円

<注記事項>

- ①期首元本額 816,758,904円
 期中追加設定元本額 156,073,930円
 期中一部解約元本額 8,415,045円
 また、1口当たり純資産額は、期末1.5963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)	576,546,469円
日本株ESGアクティブファンド(適格機関投資家限定)	291,013,245円
三菱UFJDC日本株ESGアクティブファンド	61,221,611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	3,047,019円
合計	964,417,789円

○損益の状況 (2021年11月26日～2022年5月25日)

項 目	当 期
(A) 配当等収益	15,166,575 円
受取配当金	15,168,950
受取利息	35
その他収益金	170
支払利息	△ 2,580
(B) 有価証券売買損益	△ 1,721,336
売買益	95,966,293
売買損	△ 97,687,629
(C) 当期損益金(A+B)	13,445,239
(D) 前期繰越損益金	479,032,170
(E) 追加信託差損益金	87,186,192
(F) 解約差損益金	△ 4,600,839
(G) 計(C+D+E+F)	575,062,762
次期繰越損益金(G)	575,062,762

- (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。