

【表紙】	
【提出書類】	有価証券届出書の訂正届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成25年5月24日
【発行者名】	三菱UFJ投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 後藤 俊夫
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
【事務連絡者氏名】	井上 靖 連絡場所 東京都千代田区丸の内一丁目4番5号
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】	日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）
【届出の対象とした募集内国投資信託 受益証券の金額】	継続募集額 上限1兆円
【縦覧に供する場所】	該当ありません

【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

本日付で有価証券報告書を提出致しましたので、平成24年11月22日に届出済みの有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）の関係情報を更新するため、また、記載事項の一部に訂正事項がありますのでこれを訂正するため、提出するものです。

【訂正の内容】

<訂正前> および<訂正後> に記載している下線部 は訂正部分を示し、原届出書の更新後の内容を記載する場合は<更新後>とし、原届出書に追加される内容を記載する場合は<追加>とします。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<訂正前>

(略)

当ファンドは、社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

(略)

商品分類の定義

(略)

独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	<u>社団法人投資信託協会</u> が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	<u>社団法人投資信託協会</u> が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	(略)

(略)

上記定義は社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

(略)

投資形態	ファミリーファンド	(略)
	ファンド・オブ・ファンズ	<u>社団法人投資信託協会</u> が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。

(略)

上記定義は社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

(略)

<訂正後>

(略)

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

(略)

商品分類の定義

(略)

独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	<u>一般社団法人投資信託協会</u> が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	<u>一般社団法人投資信託協会</u> が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	(略)

(略)

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

(略)	投資形態	ファミリーファンド ファンド・オブ・ ファンズ	(略) 一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
-----	------	-------------------------------	-------------------------------------------------------------------

(略)

上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

(略)

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

< 訂正前 >

- ・資本金
2,000百万円(平成24年9月末現在)
(略)
- ・大株主の状況(平成24年9月末現在)
(略)

< 訂正後 >

- ・資本金
2,000百万円(平成25年3月末現在)
(略)
- ・大株主の状況(平成25年3月末現在)
(略)

2 【投資方針】

(3) 【運用体制】

< 訂正前 >

(略)

ファンドの運用体制等は平成24年11月23日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

< 訂正後 >

(略)

ファンドの運用体制等は平成25年5月25日現在のものであり、今後変更される可能性があります。

4 【手数料等及び税金】

(5) 【課税上の取扱い】

< 訂正前 >

(略)

個人の受益者に対する課税

(略)

1. 収益分配金の課税
(略)

原則として、10% (所得税7%および地方税3%) の税率で源泉徴収(申告不要)されます。なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除は適用されません。)、申告分離課税を選択することもできます。申告分離課税を選択した場合、10% (所得税7%および地方税3%) の税率一となります。

2. 解約時および償還時の課税
(略)

10% (所得税7%および地方税3%) 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、10% (所得税7%および地方税3%) の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。
(略)

平成24年12月31日までの税率です。平成25年12月31日までは軽減税率が適用されます。なお、復興特別所得税が付加されることにより、平成25年1月1日以降は10.147% (所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%)、軽減税率の適用終了後の平成26年1月1日以降は20.315% (所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%) の税率となる予定です。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として7%（所得税7%）の税率で源泉徴収されま

す。
(略)

平成24年12月31日までの税率です。平成25年12月31日までは軽減税率が適用されます。なお、復興特別所得税が付加されることにより、平成25年1月1日以降は7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）、軽減税率の適用終了後の平成26年1月1日以降は15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率となる予定です。

(略)

上記は平成24年9月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

<訂正後>

(略)

個人の受益者に対する課税

(略)

1. 収益分配金の課税

(略)

原則として、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

(略)

10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）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、10.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%、地方税3%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

(略)

平成26年1月1日以降の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）となる予定です。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として7.147%（所得税7%、復興特別所得税0.147%）

の税率で源泉徴収されます。

(略)

平成26年1月1日以降の税率は、15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）となる予定です。

(略)

上記は平成25年3月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

(略)

5【運用状況】

<更新後>

(1)【投資状況】

平成25年3月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	99,296,908	99.77
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		226,093	0.23
純資産総額		99,523,001	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成25年3月29日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	口数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
日本	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	親投資信託 受益証券		77,129,803	1.2893 1.2874	99,444,757 99,296,908		99.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類/業種別投資比率

平成25年3月29日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.77
合計	99.77

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(3)【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成25年3月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

(単位：円)

	純資産総額	基準価額 (1万口当たりの純資産価額)
第1計算期間末日 (平成18年 8月24日)	139,228,847 (分配付) 139,228,847 (分配落)	10,038 (分配付) 10,038 (分配落)
第2計算期間末日 (平成19年 2月26日)	821,000,277 (分配付) 821,000,277 (分配落)	10,002 (分配付) 10,002 (分配落)
第3計算期間末日 (平成19年 8月24日)	700,518,538 (分配付) 700,518,538 (分配落)	10,238 (分配付) 10,238 (分配落)
第4計算期間末日 (平成20年 2月25日)	605,542,981 (分配付) 605,542,981 (分配落)	10,125 (分配付) 10,125 (分配落)
第5計算期間末日 (平成20年 8月25日)	415,396,478 (分配付) 415,396,478 (分配落)	10,068 (分配付) 10,068 (分配落)
第6計算期間末日 (平成21年 2月24日)	263,099,909 (分配付) 263,099,909 (分配落)	9,831 (分配付) 9,831 (分配落)
第7計算期間末日 (平成21年 8月24日)	339,284,838 (分配付) 339,284,838 (分配落)	10,730 (分配付) 10,730 (分配落)
第8計算期間末日 (平成22年 2月24日)	320,060,928 (分配付) 320,060,928 (分配落)	10,631 (分配付) 10,631 (分配落)
第9計算期間末日 (平成22年 8月24日)	316,440,035 (分配付) 316,440,035 (分配落)	10,956 (分配付) 10,956 (分配落)

第10計算期間末日 (平成23年 2月24日)	216,544,993 (分配付) 216,544,993 (分配落)	11,523 (分配付) 11,523 (分配落)
第11計算期間末日 (平成23年 8月24日)	158,646,057 (分配付) 158,646,057 (分配落)	11,366 (分配付) 11,366 (分配落)
第12計算期間末日 (平成24年 2月24日)	97,056,812 (分配付) 97,056,812 (分配落)	11,470 (分配付) 11,470 (分配落)
第13計算期間末日 (平成24年 8月24日)	67,598,183 (分配付) 67,598,183 (分配落)	10,966 (分配付) 10,966 (分配落)
第14計算期間末日 (平成25年 2月25日)	50,499,625 (分配付) 50,499,625 (分配落)	11,507 (分配付) 11,507 (分配落)
平成24年 3月末日	96,735,314	11,432
4月末日	95,717,982	11,312
5月末日	94,722,787	11,195
6月末日	68,634,049	11,298
7月末日	68,245,053	11,071
8月末日	67,643,984	10,974
9月末日	33,722,996	11,078
10月末日	33,293,593	11,232
11月末日	34,087,835	11,167
12月末日	30,007,672	11,389
平成25年 1月末日	35,523,400	11,568
2月末日	50,425,109	11,491
3月末日	99,523,001	11,418

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第1計算期間	0円
第2計算期間	0円
第3計算期間	0円
第4計算期間	0円
第5計算期間	0円
第6計算期間	0円
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円
第13計算期間	0円
第14計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率(%)
第1計算期間	0.38
第2計算期間	0.35
第3計算期間	2.35
第4計算期間	1.10
第5計算期間	0.56
第6計算期間	2.35
第7計算期間	9.14
第8計算期間	0.92
第9計算期間	3.05
第10計算期間	5.17
第11計算期間	1.36
第12計算期間	0.91
第13計算期間	4.39
第14計算期間	4.93

(注)「収益率」とは、計算期間末の基準価額(分配付の額)から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額(分配落ちの額、以下「前期末基準価額」)を控除した額を前期末基準価額で除して得

た数に100を乗じて得た数。

(4) 【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
第1計算期間	149,581,333	10,886,124	138,695,209
第2計算期間	717,201,050	35,038,542	820,857,717
第3計算期間	431,197,442	567,842,349	684,212,810
第4計算期間	265,784,731	351,943,620	598,053,921
第5計算期間	66,273,853	251,723,148	412,604,626
第6計算期間	109,388,491	254,358,230	267,634,887
第7計算期間	105,011,219	56,430,581	316,215,525
第8計算期間	56,944,779	72,083,445	301,076,859
第9計算期間	15,058,155	27,298,131	288,836,883
第10計算期間	6,617,181	107,527,505	187,926,559
第11計算期間	36,086,244	84,439,182	139,573,621
第12計算期間	693,280	55,652,582	84,614,319
第13計算期間	890,000	23,862,803	61,641,516
第14計算期間	32,370,796	50,128,191	43,884,121

<参考>

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」

(1) 投資状況

平成25年3月29日現在

(単位：円)

資産の種類	国/地域名	時価合計	投資比率(%)
株式	日本	162,824,020	81.83
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		36,144,900	18.17
純資産総額		198,968,920	100.00

(注) 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する当該資産の時価の比率をいいます。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

平成25年3月29日現在

国/地域	銘柄	種類	業種	株式数	上段：帳簿価額 下段：評価額		利率(%) 償還期限 (年/月/日)	投資 比率 (%)
					単価(円)	金額(円)		
					日本	ダイハツ工業	株式	輸送用機器
日本	富士重工業	株式	輸送用機器	1,000	1,402.00 1,461.00	1,402,000 1,461,000		0.73
日本	山崎製パン	株式	食料品	1,000	1,097.00 1,280.00	1,097,000 1,280,000		0.64
日本	東芝プラントシステム	株式	建設業	1,000	1,221.00 1,146.00	1,221,000 1,146,000		0.58
日本	カネカ	株式	化学	2,000	524.50 545.00	1,049,000 1,090,000		0.55
日本	三菱重工業	株式	機械	2,000	523.50 535.00	1,047,000 1,070,000		0.54
日本	アークス	株式	小売業	500	1,802.20 2,119.00	901,100 1,059,500		0.53
日本	乃村工藝社	株式	サービス業	2,000	437.00 515.00	874,000 1,030,000		0.52
日本	久光製薬	株式	医薬品	200	5,210.00 5,140.00	1,042,000 1,028,000		0.52
日本	マブチモーター	株式	電気機器	200	4,790.00 5,090.00	958,000 1,018,000		0.51
日本	中国塗料	株式	化学	2,000	493.00 498.00	986,000 996,000		0.50
日本	総合メディカル	株式	小売業	300	3,060.00 3,320.00	918,000 996,000		0.50
日本	ガリバーインターナショナル	株式	卸売業	180	4,147.00 5,520.00	746,460 993,600		0.50
日本	東海旅客鉄道	株式	陸運業	100	9,160.00 9,920.00	916,000 992,000		0.50
日本	WOWOW	株式	情報・通信業	4	202,675.00 247,400.00	810,700 989,600		0.50

日本	タケエイ	株式	サービス業	300	2,590.66 3,275.00	777,200 982,500		0.49
日本	三ツ星ベルト	株式	ゴム製品	2,000	488.00 491.00	976,000 982,000		0.49
日本	第一実業	株式	卸売業	2,000	466.00 487.00	932,000 974,000		0.49
日本	コロワイド	株式	小売業	1,000	1,016.50 973.00	1,016,500 973,000		0.49
日本	ハニーズ	株式	小売業	760	1,136.75 1,279.00	863,930 972,040		0.49
日本	鬼怒川ゴム工業	株式	輸送用機器	2,000	445.00 475.00	890,000 950,000		0.48
日本	三愛石油	株式	卸売業	2,000	408.00 475.00	816,000 950,000		0.48
日本	文化シャッター	株式	金属製品	2,000	471.50 474.00	943,000 948,000		0.48
日本	タカタ	株式	輸送用機器	500	1,677.80 1,887.00	838,900 943,500		0.47
日本	高島屋	株式	小売業	1,000	778.00 936.00	778,000 936,000		0.47
日本	安川電機	株式	電気機器	1,000	861.00 933.00	861,000 933,000		0.47
日本	東京エネシス	株式	建設業	2,000	457.00 465.00	914,000 930,000		0.47
日本	加藤製作所	株式	機械	3,000	299.00 310.00	897,000 930,000		0.47
日本	フジテック	株式	機械	1,000	794.00 920.00	794,000 920,000		0.46
日本	わらべや日洋	株式	食料品	600	1,496.66 1,533.00	898,000 919,800		0.46

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成25年3月29日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.35
	鉱業	0.38
	建設業	4.13
	食料品	3.34
	繊維製品	0.69
	パルプ・紙	0.36
	化学	5.85
	医薬品	1.47
	石油・石炭製品	0.70
	ゴム製品	0.79
	ガラス・土石製品	1.06
	鉄鋼	2.04
	非鉄金属	1.57
	金属製品	1.97
	機械	7.26
	電気機器	7.89
	輸送用機器	7.58
	精密機器	1.55
	その他製品	2.40
	陸運業	1.67
情報・通信業	4.84	
卸売業	6.54	
小売業	10.19	
不動産業	2.70	
サービス業	4.51	
合計		81.83

(注) 投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの
該当事項はありません。

[参考情報]

運用実績

1 基準価額・純資産の推移(設定日～2013年3月29日)



- ・基準価額、基準価額(分配金再投資)は10,000を起点として表示
- ・基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を再投資したもものとして計算

2 分配の推移

2013年 2月	0円
2012年 8月	0円
2012年 2月	0円
2011年 8月	0円
2011年 2月	0円
2010年 8月	0円
設定来累計	0円

・分配金は1万円当たり、税引前

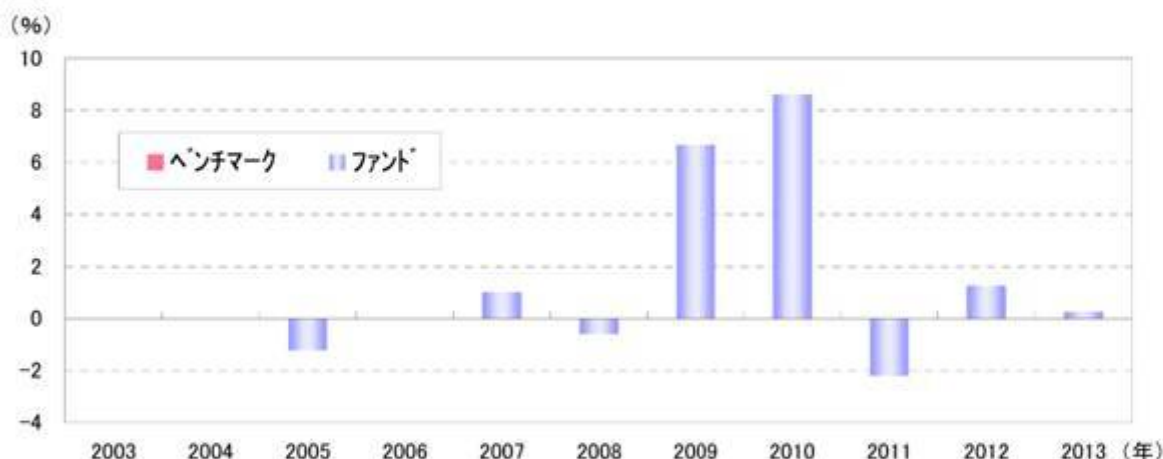
3 主要な資産の状況(2013年3月29日現在)

資産別構成	比率
国内株式現物	81.6%
国内株式信用売	-80.4%
株式(実質)	1.2%

	組入上位銘柄	業種	比率
1	ダイハツ工業	輸送用機器	1.0%
2	富士重工業	輸送用機器	0.7%
3	山崎製パン	食料品	0.6%
4	東芝プラントシステム	建設業	0.6%
5	カネカ	化学	0.5%
6	三菱重工業	機械	0.5%
7	アークス	小売業	0.5%
8	乃村工藝社	サービス業	0.5%
9	久光製薬	医薬品	0.5%
10	マブチモーター	電気機器	0.5%

・各比率はファンドの純資産総額に対する投資比率(小数点第二位四捨五入)

4 年間収益率の推移



- ・収益率は基準価額(分配金再投資)で計算
- ・2005年は設定日から年末までの、2013年は3月29日までの収益率を表示
- ・2004年以前はベンチマークの年間収益率を表示

- ・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。
- ・ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。
- ・ファンドの運用状況等は別途、委託会社のホームページで開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

<訂正前>

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数 (略) (注)「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および<u>社団法人</u>投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。 (略)</p>
-----------	---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(略)

<訂正後>

基準価額の算出方法	<p>基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数 (略) (注)「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および<u>一般社団法人</u>投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。 (略)</p>
-----------	-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(略)

第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドの計算期間は6ヵ月であるため、財務諸表は6ヵ月毎に作成しております。
- 3 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第14期計算期間（平成24年8月25日から平成25年2月25日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）

（1）【貸借対照表】

（単位：円）

	第 13 期 [平成24年8月24日現在]	第 14 期 [平成25年2月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	479,735	320,230
親投資信託受益証券	67,568,462	50,378,780
未収入金	10,189	-
未収利息	1	-
流動資産合計	68,058,387	50,699,010
資産合計	68,058,387	50,699,010
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬	43,727	18,953
未払委託者報酬	415,365	179,999
その他未払費用	1,112	433
流動負債合計	460,204	199,385
負債合計	460,204	199,385
純資産の部		
元本等		
元本	¹ 61,641,516	¹ 43,884,121
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	5,956,667	6,615,504
（分配準備積立金）	7,446,872	2,298,427
元本等合計	67,598,183	50,499,625
純資産合計	67,598,183	50,499,625
負債純資産合計	68,058,387	50,699,010

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 13 期 自 平成24年 2月25日 至 平成24年 8月24日	第 14 期 自 平成24年 8月25日 至 平成25年 2月25日
営業収益		
受取利息	39	43
有価証券売買等損益	3,382,788	1,456,287
営業収益合計	3,382,749	1,456,330
営業費用		
受託者報酬	43,727	18,953
委託者報酬	415,365	179,999
その他費用	1,112	433
営業費用合計	460,204	199,385
営業利益	3,842,953	1,256,945
経常利益	3,842,953	1,256,945
当期純利益	3,842,953	1,256,945
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	702,594	199,736
期首剰余金又は期首欠損金()	12,442,493	5,956,667
剰余金増加額又は欠損金減少額	110,894	4,431,023
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	110,894	4,431,023
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,456,361	4,829,395
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,456,361	4,829,395
分配金	1	1
期末剰余金又は期末欠損金()	5,956,667	6,615,504

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>(1) 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。</p> <p>(2) 親投資信託受益証券以外の有価証券 個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所等における最終相場で評価しております。 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値（平均値）等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認めた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認めた価額で評価しております。</p>
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月24日および8月24日を計算期間の末日としておりますが、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成24年8月25日から平成25年2月25日までとなっております。</p>

(貸借対照表に関する注記)

	第 13 期 [平成24年8月24日現在]	第 14 期 [平成25年2月25日現在]
1 期首元本額 期中追加設定元本額 期中一部解約元本額	84,614,319円 890,000円 23,862,803円	61,641,516円 32,370,796円 50,128,191円
2 受益権の総数	61,641,516口	43,884,121口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.0966円 (10,966円)	1.1507円 (11,507円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 13 期 (自 平成24年2月25日 至 平成24年8月24日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	415,324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	B	
収益調整金額	C	4,631,295円
分配準備積立金額	D	7,031,548円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	12,078,167円
当ファンドの期末残存口数	F	61,641,516口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	1,959円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

第 14 期 (自 平成24年8月25日 至 平成25年2月25日)

1 分配金の計算過程

費用控除後の配当等収益額	A	310,103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	B	
収益調整金額	C	6,777,572円
分配準備積立金額	D	1,988,324円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	9,075,999円
当ファンドの期末残存口数	F	43,884,121口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,068円
1万口当たり分配金額	H	
収益分配金金額	I=F*H/10,000	

（金融商品に関する注記）

1 金融商品の状況に関する事項

区分	第 13 期 （自平成24年 2月25日 至平成24年 8月24日）	第 14 期 （自平成24年 8月25日 至平成25年 2月25日）
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同 左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券を実質的な主要投資対象としております。投資する親投資信託受益証券の詳細は「（4）附属明細表」に記載しております。親投資信託受益証券は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同 左
3 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部門から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同 左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第 13 期 [平成24年8月24日現在]	第 14 期 [平成25年2月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同 左
2 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	同 左 同 左 同 左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同 左

（有価証券関係に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第 13 期 [平成24年8月24日現在]	第 14 期 [平成25年2月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	2,756,891	1,235,733
合計	2,756,891	1,235,733

（デリバティブ取引等関係に関する注記）

取引の時価等に関する事項

該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）

該当事項はありません。

（4）【附属明細表】

第 1 有価証券明細表

（1）株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

(単位：円)

種類	銘柄	口数	評価額	備考
親投資信託受益証券	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	38,848,535	50,378,780	
	親投資信託受益証券 小計	38,848,535	50,378,780	
合計		38,848,535	50,378,780	

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

<参考>

当ファンドは「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おり、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

(1) 貸借対照表

	[平成24年8月24日現在]	[平成25年2月25日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	30,108,627	41,957,469
株式 2	138,646,490	127,779,030
信用取引預け金	134,272,344	110,378,266
未収配当金	128,050	177,850
未収利息	68	96
その他未収収益	7,554	5,872
流動資産合計	303,163,133	280,298,583
資産合計	303,163,133	280,298,583
負債の部		
流動負債		
信用売証券	138,336,800	128,099,320
未払解約金	21,170	1,249,184
その他未払費用	278,226	213,186
流動負債合計	138,636,196	129,561,690
負債合計	138,636,196	129,561,690
純資産の部		
元本等		
元本 1	133,455,002	116,239,791
剰余金		
剰余金又は欠損金()	31,071,935	34,497,102
元本等合計	164,526,937	150,736,893
純資産合計	164,526,937	150,736,893
負債純資産合計	303,163,133	280,298,583

(注1) 親投資信託の計算期間は、原則として、毎年2月25日から8月24日まで、および8月25日から翌年2月24日までであります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>株式は移動平均法、株式以外の有価証券および信用売証券は個別法に基づき、以下の通り原則として時価で評価しております。</p> <p>(1) 金融商品取引所等に上場されている有価証券 金融商品取引所等に上場されている有価証券は、原則として金融商品取引所における最終相場で評価しております。</p> <p>(2) 金融商品取引所等に上場されていない有価証券 当該有価証券については、原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)等、および金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)または価格提供会社の提供する価額のいずれかから入手した価額で評価しております。</p> <p>(3) 時価が入手できなかった有価証券 適正な評価額を入手できなかった場合または入手した評価額が時価と認定できない事由が認められた場合は、委託会社が忠実義務に基づいて合理的事由をもって時価と認められた価額もしくは受託者と協議のうえ両者が合理的事由をもって時価と認められた価額で評価しております。</p>
2 収益及び費用の計上基準	<p>その他費用 信用取引に係る以下の費用を計上しております。</p>

	<p>(1) 借株料 信用売り株式の借入に係る費用として、予め借入先と合意した料率と計算方法に基づき、原則として、借入実行日（信用売り受渡日）の翌営業日から日々計上しております。</p> <p>(2) 支払配当金相当額 信用売り株式の借入先に支払うべき配当金相当額を、株式の配当落ち日に計上しております。</p>
--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

(貸借対照表に関する注記)

	[平成24年8月24日現在]	[平成25年2月25日現在]
1 期首		
期首元本額	平成24年2月25日 154,559,468円	平成24年8月25日 133,455,002円
期首からの追加設定元本額	790,911円	25,043,955円
期首からの一部解約元本額	21,895,377円	42,259,166円
元本の内訳*		
日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）	54,808,941円	38,848,535円
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）	78,646,061円	77,391,256円
（合計）	133,455,002円	116,239,791円
2 差入保証金代用有価証券 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れを行っております。 株式	79,156,420円	83,648,800円
3 受益権の総数	133,455,002口	116,239,791口
4 1口当たり純資産額 （1万口当たり純資産額）	1.2328円 (12,328円)	1.2968円 (12,968円)

* 当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1 金融商品の状況に関する事項

区分	(自平成24年2月25日 至平成24年8月24日)	(自平成24年8月25日 至平成25年2月25日)
1 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式および信用売証券を実質的な主要投資対象としております。株式および信用売証券の投資に係る価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3 金融商品に係るリスク管理体制	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成24年8月24日現在]	[平成25年2月25日現在]
1 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2 時価の算定方法	<p>(1) 有価証券 売買目的有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2) デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p>	同左
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	当ファンドに投資する証券投資信託の注記表（金融商品に関する注記）に記載しております。	同左

（有価証券関係に関する注記）
 売買目的有価証券

種類	[平成24年8月24日現在]	[平成25年2月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額(円)	当期間の損益に含まれた評価差額(円)
株式	6,425,590	13,742,122
信用売証券	3,640,376	17,171,210
合計	10,065,966	3,429,088

（注）当期間の開始日は、当該親投資信託の期首日であります。

（デリバティブ取引等関係に関する注記）
 取引の時価等に関する事項
 該当事項はありません。

（関連当事者との取引に関する注記）
 該当事項はありません。

（3）附属明細表

第1 有価証券明細表

（1）株式

（単位：円）

コード	銘柄 銘柄名	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1334	マルハニチロホールディングス	4,000	159	636,000	4,000株
1662	石油資源開発	200	3,485	697,000	100株
1719	間組	2,300	239	549,700	2,300株
1722	ミサワホーム	500	1,226	613,000	
1803	清水建設	2,000	296	592,000	
1819	太平工業	2,000	350	700,000	2,000株
1861	熊谷組	3,000	105	315,000	
1878	大東建託	100	8,230	823,000	100株
1879	新日本建設	1,300	237	308,100	
1945	東京エネシス	1,000	445	445,000	1,000株
1950	日本電設工業	1,000	940	940,000	1,000株
1951	協和エクシオ	700	1,002	701,400	300株
1968	太平電業	1,000	519	519,000	1,000株
1983	東芝プラントシステム	1,000	1,221	1,221,000	
2001	日本製粉	2,000	400	800,000	2,000株
2004	昭和産業	2,000	296	592,000	2,000株
2109	三井製糖	2,000	308	616,000	2,000株
2212	山崎製パン	1,000	1,097	1,097,000	1,000株
2264	森永乳業	2,000	285	570,000	2,000株
2270	雪印メグミルク	400	1,460	584,000	400株
2281	プリマハム	4,000	180	720,000	4,000株
2288	丸大食品	2,000	305	610,000	
2580	コカ・コーラ セントラル ジャパン	500	1,257	628,500	
2590	ダイドードリンコ	100	3,965	396,500	100株
2607	不二製油	500	1,354	677,000	
2918	わらべや日洋	400	1,486	594,400	400株
3106	倉敷紡績	4,000	158	632,000	4,000株
3569	セーレン	500	568	284,000	
8011	三陽商会	2,000	266	532,000	1,000株
3877	中越バルブ工業	4,000	149	596,000	3,000株
4043	トクヤマ	3,000	239	717,000	3,000株
4044	セントラル硝子	2,000	290	580,000	
4063	信越化学工業	100	5,840	584,000	100株
4078	堺化学工業	2,000	276	552,000	2,000株
4114	日本触媒	1,000	901	901,000	1,000株
4118	カネカ	1,000	507	507,000	1,000株
4186	東京応化工業	100	1,930	193,000	100株
4188	三菱ケミカルホールディングス	1,500	438	657,000	1,500株
4221	大倉工業	2,000	422	844,000	2,000株
4228	積水化成工業	3,000	223	669,000	3,000株
4617	中国塗料	1,000	501	501,000	
4901	富士フイルムホールディングス	300	1,802	540,600	300株
4924	ドクターシーラボ	2	267,000	534,000	2株
4928	ノエビアホールディングス	500	1,435	717,500	500株
7958	天馬	700	1,026	718,200	700株
4508	田辺三菱製薬	500	1,337	668,500	500株
4530	久光製薬	100	5,410	541,000	100株

4553	東和薬品	100	5,160	516,000	100株
4569	キョーリン製薬ホールディングス	300	2,092	627,600	300株
5017	AOCホールディングス	1,400	364	509,600	
5195	バンドー化学	2,000	290	580,000	2,000株
5214	日本電気硝子	1,000	459	459,000	1,000株
5218	オハラ	400	669	267,600	400株
5406	神戸製鋼所	4,000	129	516,000	
5410	合同製鐵	3,000	185	555,000	3,000株
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	100	2,105	210,500	100株
5413	日新製鋼ホールディングス	900	741	666,900	
5453	東洋鋼鋳	2,000	306	612,000	2,000株
5486	日立金属	1,000	891	891,000	
5703	日本軽金属ホールディングス	5,900	108	637,200	
5738	住友軽金属工業	7,000	90	630,000	6,000株
5741	古河スカイ	2,000	260	520,000	2,000株
5803	フジクラ	2,000	276	552,000	
3436	SUMCO	700	941	658,700	
5909	コロナ	600	1,109	665,400	600株
5930	文化シヤッター	1,000	474	474,000	
5951	ダイニチ工業	300	835	250,500	
5975	東プレ	700	847	592,900	
5988	パイオラックス	300	2,350	705,000	300株
8155	三益半導体工業	800	724	579,200	800株
6140	旭ダイヤモンド工業	800	872	697,600	700株
6247	日阪製作所	1,000	875	875,000	1,000株
6250	やまびこ	400	1,874	749,600	400株
6355	住友精密工業	2,000	414	828,000	
6361	荏原製作所	2,000	364	728,000	
6383	ダイフク	1,000	703	703,000	
6390	加藤製作所	2,000	303	606,000	2,000株
6419	マースエンジニアリング	400	1,931	772,400	300株
6480	日本トムソン	2,000	407	814,000	
6586	マキタ	100	4,080	408,000	100株
7011	三菱重工業	1,000	525	525,000	
6479	ミネベア	1,000	326	326,000	
6506	安川電機	1,000	861	861,000	
6517	デンヨー	600	1,166	699,600	600株
6592	マブチモーター	100	4,670	467,000	100株
6617	東光高岳ホールディングス	400	1,506	602,400	
6640	第一精工	500	1,493	746,500	500株
6645	オムロン	200	2,270	454,000	
6701	日本電気	2,000	236	472,000	
6728	アルバック	800	913	730,400	
6737	ナナオ	400	1,545	618,000	400株
6744	能美防災	1,000	663	663,000	1,000株
6804	ホシデン	1,300	563	731,900	700株
6839	船井電機	400	1,145	458,000	
6859	エスベック	900	732	658,800	900株
6935	日本デジタル研究所	600	1,070	642,000	600株
6958	日本シイエムケイ	1,800	353	635,400	1,500株
6963	ローム	200	3,470	694,000	100株
6966	三井ハイテック	1,000	618	618,000	1,000株
7276	小糸製作所	1,000	1,475	1,475,000	
5196	鬼怒川ゴム工業	1,000	449	449,000	
5949	ユニプレス	300	2,000	600,000	200株
7122	近畿車輛	2,000	298	596,000	1,000株
7212	エフテック	500	1,295	647,500	500株
7236	ティラド	3,000	241	723,000	2,000株
7239	タチエス	400	1,486	594,400	400株
7243	シロキ工業	3,000	223	669,000	3,000株
7248	カルソニックカンセイ	2,000	414	828,000	2,000株
7250	太平洋工業	1,300	535	695,500	1,300株
7262	ダイハツ工業	1,000	1,875	1,875,000	1,000株
7266	今仙電機製作所	600	1,129	677,400	600株
7270	富士重工業	1,000	1,402	1,402,000	1,000株
7278	エクセディ	300	1,916	574,800	
4543	テルモ	200	4,235	847,000	
7702	JMS	2,000	349	698,000	
7756	日本電産コパル	900	642	577,800	900株

7862	トッパン・フォームズ	700	817	571,900	
7944	ローランド	800	803	642,400	800株
7952	河合楽器製作所	4,000	170	680,000	4,000株
7955	クリナップ	1,000	629	629,000	1,000株
7972	イトーキ	1,400	505	707,000	500株
7994	岡村製作所	1,000	595	595,000	
9543	静岡瓦斯	1,000	607	607,000	
9014	新京成電鉄	2,000	367	734,000	2,000株
9021	西日本旅客鉄道	200	4,075	815,000	
9022	東海旅客鉄道	100	9,160	916,000	100株
9031	西日本鉄道	2,000	372	744,000	2,000株
9037	ハマキョウレックス	200	3,200	640,000	200株
9076	セイノーホールディングス	1,000	690	690,000	1,000株
3626	I Tホールディングス	600	1,195	717,000	300株
3632	グリー	400	1,173	469,200	400株
3774	インターネットイニシアティブ	100	2,555	255,500	
4722	フューチャーアーキテクト	17	37,950	645,150	
4725	シーエーシー	900	777	699,300	
4839	WOWOW	3	200,900	602,700	3株
8056	日本ユニシス	400	744	297,600	
8096	兼松エレクトロニクス	400	1,091	436,400	
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	15	45,900	688,500	15株
9413	テレビ東京ホールディングス	600	996	597,600	
9422	アイ・ティ・シーネットワーク	1,000	721	721,000	1,000株
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	2	284,900	569,800	
9742	アイネス	1,000	743	743,000	1,000株
9746	T K C	400	1,662	664,800	400株
7414	小野建	800	853	682,400	800株
7558	トーメンエレクトロニクス	600	1,161	696,600	600株
7631	マクニカ	300	1,739	521,700	300株
8008	F & A アクアホールディングス	600	1,028	616,800	600株
8014	蝶理	600	999	599,400	300株
8020	兼松	5,000	139	695,000	
8053	住友商事	500	1,165	582,500	
8060	キャノンマーケティングジャパン	500	1,295	647,500	
8075	神鋼商事	3,000	185	555,000	3,000株
8088	岩谷産業	2,000	359	718,000	2,000株
8097	三菱石油	2,000	408	816,000	2,000株
8150	三信電気	1,000	628	628,000	800株
8283	P a l t a c	300	1,137	341,100	300株
9869	加藤産業	400	1,701	680,400	
2678	アスクル	500	1,265	632,500	500株
2681	ゲオホールディングス	7	96,400	674,800	7株
2730	エディオン	1,600	405	648,000	
2792	ハニーズ	570	1,153	657,210	460株
3034	クオール	800	830	664,000	
3048	ビックカメラ	15	46,900	703,500	15株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	700	1,014	709,800	600株
3341	日本調剤	290	2,298	666,420	290株
3397	トリドール	700	946	662,200	500株
4775	総合メディカル	200	3,020	604,000	200株
7513	コジマ	1,900	310	589,000	1,900株
7522	ワタミ	400	1,715	686,000	300株
7550	ゼンショーホールディングス	600	1,210	726,000	600株
7581	サイゼリヤ	500	1,197	598,500	500株
7606	ユナイテッドアローズ	200	2,399	479,800	200株
7616	コロワイド	500	979	489,500	500株
8248	ニッセンホールディングス	2,000	335	670,000	
8263	ダイエー	3,150	203	639,450	
8279	ヤオコー	200	3,560	712,000	200株
9831	ヤマダ電機	150	3,460	519,000	130株
9843	ニトリホールディングス	50	6,830	341,500	50株
9887	松屋フーズ	400	1,665	666,000	
9948	アークス	400	1,790	716,000	300株
2353	日本駐車場開発	116	5,750	667,000	116株
3231	野村不動産ホールディングス	400	1,633	653,200	400株
8815	東急不動産	1,000	649	649,000	1,000株
8818	京阪神ビルディング	1,300	505	656,500	1,300株
8840	大京	3,000	225	675,000	3,000株

8860	フジ住宅	1,300	496	644,800	1,300株
8864	空港施設	1,500	470	705,000	1,500株
8895	アーネストワン	200	1,547	309,400	200株
2120	ネクスト	600	1,071	642,600	
2151	タケエイ	200	2,590	518,000	
2305	スタジオアリス	500	1,251	625,500	400株
2322	NECフィールドディング	600	1,092	655,200	
2413	エムスリー	4	158,800	635,200	4株
2418	ベストブライダル	8	120,800	966,400	8株
2440	ぐるなび	700	940	658,000	700株
4321	ケネディクス	25	22,740	568,500	
4680	ラウンドワン	1,300	656	852,800	1,300株
4711	東急コミュニティー	200	3,520	704,000	200株
9716	乃村工芸社	2,000	437	874,000	
合 計		220,824		127,779,030	

(注)備考欄の数値は、差入保証金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

- (2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

(単位:円)

銘柄	信用取引		備考
	売建株数	評価額	
極洋	3,000	639,000	
サカタのタネ	600	715,800	
ショーボンドホールディングス	100	336,000	
ミライト・ホールディングス	400	364,400	
日鉄鉱業	1,000	459,000	
三井松島産業	2,000	366,000	
大林組	1,000	465,000	
不動テトラ	2,400	427,200	
奥村組	2,000	774,000	
日成ビルド工業	3,000	567,000	
ユアテック	2,000	594,000	
住友電設	500	591,500	
中外炉工業	3,000	732,000	
日本M&Aセンター	100	319,000	
エス・エム・エス	3	692,400	
クックパッド	200	654,000	
森永製菓	3,000	591,000	
亀田製菓	300	656,400	
カルビー	100	829,000	
伊藤ハム	2,000	910,000	
カカクコム	200	716,000	
宝ホールディングス	1,000	821,000	
サンエー	100	379,500	
キャンドゥ	6	748,800	
ハウス食品	500	741,000	
カゴメ	400	688,000	
横浜冷凍	1,000	700,000	
日清食品ホールディングス	200	734,000	
片倉工業	700	615,300	
ヒューリック	500	330,500	
日東紡績	2,000	750,000	
ウエルシアホールディングス	200	861,000	
クリエイトSDホールディングス	200	591,800	
ダイドーリミテッド	1,000	667,000	
三栄建築設計	700	631,400	
セブン&アイ・ホールディングス	200	558,600	
旭化成	1,000	569,000	
アツギ	2,000	222,000	
ドワンゴ	2	516,200	
三菱製紙	4,000	376,000	
北越紀州製紙	1,500	733,500	
大王製紙	1,000	630,000	
大陽日酸	1,000	649,000	
四国化成工業	1,000	638,000	
協和発酵キリン	1,000	964,000	
J S R	300	578,400	

シンプレクス・ホールディングス	22	653,620	
大日本住友製薬	500	678,000	
中外製薬	100	205,700	
日水製薬	700	685,300	
鳥居薬品	300	653,400	
富士製薬工業	400	712,000	
第一三共	400	675,600	
大日本塗料	4,000	700,000	
日本ペイント	1,000	878,000	
D I C	3,000	558,000	
ダスキン	400	732,400	
フジ・メディア・ホールディングス	4	603,200	
オービック	30	600,000	
オービックビジネスコンサルタント	150	760,500	
大塚商会	100	909,000	
ライオン	1,000	478,000	
マンダム	200	575,000	
エステー	300	299,400	
小林製薬	200	888,000	
アース製薬	200	595,000	
クミアイ化学工業	1,000	538,000	
東燃ゼネラル石油	1,000	897,000	
日本板硝子	6,000	696,000	
太平洋セメント	2,000	448,000	
東海カーボン	2,000	684,000	
東洋炭素	300	669,300	
ノリタケカンパニーリミテド	3,000	717,000	
T O T O	1,000	840,000	
黒崎播磨	2,000	444,000	
共英製鋼	300	509,100	
大和工業	200	530,800	
大同特殊鋼	1,000	481,000	
山陽特殊製鋼	2,000	706,000	
大平洋金属	1,000	507,000	
三菱製鋼	3,000	534,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	300	563,100	
アサヒホールディングス	400	697,600	
三和ホールディングス	2,000	946,000	
長府製作所	300	557,700	
岡部	800	561,600	
森精機製作所	600	609,600	
島精機製作所	400	770,800	
三井海洋開発	300	731,400	
ホソカワミクロン	1,000	796,000	
ユニオンツール	300	530,700	
井関農機	3,000	1,005,000	
クボタ	1,000	1,105,000	
東洋エンジニアリング	2,000	910,000	
トーヨーカネツ	3,000	870,000	
日機装	1,000	1,045,000	
タダノ	1,000	935,000	
T P R	500	613,000	
ホシザキ電機	200	543,600	
東芝	1,000	424,000	
シンフォニアテクノロジー	4,000	628,000	
明電舎	1,000	290,000	
日立工機	800	619,200	
日本電産	100	571,000	
ダイヘン	2,000	560,000	
I D E C	800	668,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,000	706,000	
サンケン電気	2,000	786,000	
セイコーエプソン	700	644,000	
富士通ゼネラル	1,000	761,000	
日立国際電気	1,000	792,000	
横河電機	500	498,000	
新電元工業	1,000	340,000	
アドバンテスト	500	653,000	
日置電機	400	555,600	

OBARA GROUP	500	728,500
デンソー	200	750,000
コーセル	300	313,800
日本電子	2,000	700,000
カシオ計算機	400	291,600
太陽誘電	700	721,700
ユーシン	900	634,500
東海理化電機製作所	400	606,400
日立造船	4,500	639,000
川崎重工業	2,000	584,000
日産自動車	600	564,000
トヨタ自動車	100	479,500
日産車体	1,000	1,151,000
フタバ産業	1,600	614,400
カヤバ工業	2,000	766,000
大同メタル工業	1,000	749,000
プレス工業	1,000	464,000
ヤマハ発動機	500	548,500
エフ・シー・シー	300	616,800
テイ・エス テック	300	665,400
カップ・クリエイトホールディングス	300	613,800
三菱食品	200	529,600
松田産業	400	504,800
幸楽苑	500	640,000
ハイデイ日高	300	599,700
長野計器	1,000	684,000
スター精密	700	679,700
マニー	100	320,000
トプコン	800	753,600
大日本スクリーン製造	2,000	954,000
シチズンホールディングス	1,200	597,600
大研医器	300	641,700
ダンロップスポーツ	600	617,400
バンダイナムコホールディングス	200	306,400
パイロットコーポレーション	3	745,800
エイベックス・グループ・ホールディングス	300	757,800
フジシールインターナショナル	300	651,600
プロネクサス	1,300	694,200
大日本印刷	1,000	811,000
エフピコ	100	585,000
小松ウオール工業	200	350,600
ビジョン	100	522,000
リンテック	200	332,600
ニフコ	300	578,400
長瀬産業	600	624,000
三井物産	400	560,800
スターゼン	3,000	777,000
セイコーホールディングス	2,000	564,000
ユアサ商事	4,000	716,000
新光商事	800	725,600
モスフードサービス	400	716,800
木曽路	400	710,000
千趣会	1,000	675,000
ケーヨー	1,300	648,700
ベスト電器	2,500	402,500
ライフコーポレーション	500	635,000
リンガーハット	500	615,000
コメリ	200	512,000
しまむら	100	940,000
イズミヤ	1,000	497,000
東京建物	1,000	476,000
ダイビル	500	457,500
テーオーシー	1,200	728,400
東急リパブル	500	710,000
飯田産業	400	488,800
トーセイ	9	651,600
京浜急行電鉄	1,000	819,000
小田急電鉄	1,000	974,000
富士急行	1,000	570,000

近畿日本鉄道	1,000	390,000	
トランコム	300	720,300	
センコー	1,000	447,000	
日本梱包運輸倉庫	200	262,800	
福山通運	1,000	488,000	
東京放送ホールディングス	300	340,800	
テレビ朝日	400	670,800	
エヌ・ティ・ティ・ドコモ	4	574,800	
西部瓦斯	3,000	645,000	
よみうりランド	1,000	518,000	
東京都競馬	3,000	687,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	200	215,600	
トランス・コスモス	600	730,200	
S C S K	400	678,000	
藤田観光	2,000	596,000	
メイテック	300	701,400	
応用地質	600	663,600	
日鐵商事	2,000	578,000	
オートバックスセブン	200	782,000	
サガミチェーン	1,000	735,000	

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
該当事項はありません。

2【ファンドの現況】

<更新後>

【純資産額計算書】

平成25年3月29日現在

(単位:円)

資産総額	99,588,800
負債総額	65,799
純資産総額(-)	99,523,001
発行済口数	87,162,079 口
1口当たり純資産価額(/)	1.1418 (1万口当たり 11,418)

<参考>

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」の現況

純資産額計算書

平成25年3月29日現在

(単位:円)

資産総額	360,946,468
負債総額	161,977,548
純資産総額(-)	198,968,920
発行済口数	154,545,516 口
1口当たり純資産価額(/)	1.2874 (1万口当たり 12,874)

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1) 資本金の額等

<訂正前>

平成24年9月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

<訂正後>

平成25年3月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、124,098株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

<訂正前>

(略)

ファンドの運用体制等は平成24年9月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

<訂正後>

(略)

ファンドの運用体制等は平成25年3月末現在のものであり、今後変更される可能性があります。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成25年3月29日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数(本)	純資産総額(百万円)
追加型株式投資信託	406	6,690,065
追加型公社債投資信託	18	654,523
単位型株式投資信託	7	76,641
単位型公社債投資信託	3	83,199
合計	434	7,504,428

なお、純資産総額の金額については、百万円未満の端数を四捨五入して記載しておりますので、表中の個々の数字の合計と合計欄の数字とは一致しないことがあります。

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

委託会社である三菱UFJ投信株式会社（以下「当社」という。）の財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和38年大蔵省令第59号）」（以下「財務諸表等規則」という。）第2条の規定により、財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令（平成19年内閣府令第52号）」に基づき作成しております。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則（昭和52年大蔵省令第38号）」（以下「中間財務諸表等規則」という。）第38条及び第57条の規定により、中間財務諸表等規則及び「金融商品取引業等に関する内閣府令」に基づき作成しております。

なお、財務諸表及び中間財務諸表に掲載している金額については、千円未満の端数を切り捨てて表示しております。

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第27期事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第28期事業年度に係る中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（第27期事業年度の財務諸表は省略）

<追加>
 中間財務諸表
 (1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第28期中間会計期間
 (平成24年9月30日現在)

(資産の部)		
流動資産		
現金及び預金		16,996,643
有価証券		8,000,000
前払費用		336,791
未収入金		221,616
未収委託者報酬		3,698,009
未収収益		39,360
繰延税金資産		374,925
金銭の信託		30,000
その他		27,966
流動資産合計		29,725,313
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	269,044
器具備品	1	174,256
土地		1,205,031
有形固定資産合計		1,648,332
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		874,592
ソフトウェア仮勘定		414,462
その他		9
無形固定資産合計		1,304,887
投資その他の資産		
投資有価証券		13,875,312
関係会社株式		320,136
長期性預金		5,500,000
長期差入保証金		831,857
繰延税金資産		297,670
その他		15,035
投資その他の資産合計		20,840,011
固定資産合計		23,793,231
資産合計		53,518,545

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(平成24年9月30日現在)

(負債の部)	
流動負債	
預り金	66,078
未払金	
未払収益分配金	33,785
未払償還金	1,070,895
未払手数料	1,435,205
その他未払金	72,465
未払費用	1,101,885
未払消費税等	104,706
未払法人税等	1,639,933
賞与引当金	561,000
その他	314,314
流動負債合計	6,400,270
固定負債	
退職給付引当金	120,928
役員退職慰労引当金	53,934
時効後支払損引当金	197,702
固定負債合計	372,564
負債合計	6,772,834
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	222,096
資本剰余金合計	222,096
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	36,823,991
利益剰余金合計	44,164,581
株主資本合計	46,386,809
評価・換算差額等	
その他有価証券	358,901
評価差額金	
評価・換算差額等合計	358,901
純資産合計	46,745,710
負債純資産合計	53,518,545

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	22,860,446
投資顧問料	5,548
その他営業収益	64,404
営業収益合計	22,930,399
営業費用	
支払手数料	9,329,547
広告宣伝費	253,610
公告費	1,748
調査費	
調査費	465,037
委託調査費	4,927,785
事務委託費	118,017
営業雑経費	
通信費	44,970
印刷費	216,082
協会費	19,981
諸会費	3,788
事務機器関連費	479,500
その他営業雑経費	8,157
営業費用合計	15,868,227
一般管理費	
給料	
役員報酬	97,198
給料・手当	1,581,710
賞与引当金繰入	561,000
福利厚生費	296,584
交際費	11,132
旅費交通費	66,127
租税公課	57,963
不動産賃借料	349,740
退職給付費用	80,723
役員退職慰労引当金繰入	7,838
固定資産減価償却費	1 223,128
諸経費	135,324
一般管理費合計	3,468,471
営業利益	3,593,700

(単位：千円)

第28期中間会計期間
(自平成24年4月1日
至平成24年9月30日)

営業外収益	
受取配当金	104,164
有価証券利息	3,543
受取利息	12,662
収益分配金等時効完成分	328,544
その他	1,102
営業外収益合計	450,017
営業外費用	
投資有価証券償還損	8,428
時効後支払損引当金繰入	6,591
その他	46
営業外費用合計	15,067
経常利益	4,028,650
特別利益	
投資有価証券売却益	141,172
特別利益合計	141,172
特別損失	
投資有価証券売却損	32,155
特別損失合計	32,155
税引前中間純利益	4,137,667
法人税、住民税及び事業税	1,626,136
法人税等調整額	30,367
法人税等合計	1,595,768
中間純利益	2,541,898

(3)中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

第28期中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日)	
株主資本	
資本金	
当期首残高	2,000,131
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
資本剰余金合計	
当期首残高	222,096
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	222,096
利益剰余金	
利益準備金	
当期首残高	342,589
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	
当期首残高	6,998,000
当中間期変動額	
当中間期変動額合計	
当中間期末残高	6,998,000
繰越利益剰余金	
当期首残高	36,863,331
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	36,823,991
利益剰余金合計	
当期首残高	44,203,921
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	44,164,581
株主資本合計	
当期首残高	46,426,148
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
当中間期変動額合計	39,339
当中間期末残高	46,386,809
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	
当期首残高	723,054
当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	364,152
当中間期変動額合計	364,152
当中間期末残高	358,901
評価・換算差額等合計	
当期首残高	723,054

当中間期変動額	
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	364,152
当中間期変動額合計	364,152
当中間期末残高	358,901
純資産合計	
当期首残高	47,149,203
当中間期変動額	
剰余金の配当	2,581,238
中間純利益	2,541,898
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	364,152
当中間期変動額合計	403,492
当中間期末残高	46,745,710

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

中間決算日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定)を採用しております。

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産

定率法を採用しております。

なお、主な耐用年数は、建物38年であります。

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法を採用しております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を計上しております。

数理計算上の差異は、その発生年度の従業員の平均支払期間以内の一定の年数(8年)による定額法により、翌事業年度より費用処理することとしております。

(3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支給に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。

(4) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

外貨建金銭債権債務は、中間決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。

[会計方針の変更]

第28期中間会計期間

(自 平成24年4月1日

至 平成24年9月30日)

(減価償却方法の変更)

当社は、法人税法の改正に伴い、当中間会計期間より、平成24年4月1日以後に取得した有形固定資産について、改正後の法人税法に基づく減価償却方法に変更しております。

なお、この変更による当中間会計期間の損益に与える影響は軽微であります。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

1 有形固定資産の減価償却累計額

	第28期中間会計期間 (平成24年9月30日現在)
建物	221,331千円
器具備品	322,980千円

2 消費税等の取扱い

仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、「未払消費税等」として表示しております。

(中間損益計算書関係)

1 減価償却実施額

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
有形固定資産	41,040千円
無形固定資産	182,088千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第28期中間会計期間(自平成24年4月1日至平成24年9月30日)

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数(株)	当中間会計期間 増加株式数(株)	当中間会計期間 減少株式数(株)	当中間会計期間末 株式数(株)
発行済株式				
普通株式	124,098	-	-	124,098
合計	124,098	-	-	124,098

2. 配当に関する事項

平成24年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	2,581,238千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	20,800円
基準日	平成24年3月31日
効力発生日	平成24年6月27日

(金融商品関係)

第28期中間会計期間(平成24年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは、次表には含まれておりません(注2)参照)。

	中間貸借対照表計 上額(千円)	時価(千円)	差額(千円)
(1) 現金及び預金	16,996,643	16,996,643	-
(2) 有価証券	8,000,000	8,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	3,698,009	3,698,009	-
(4) 長期性預金	5,500,000	5,506,492	6,492
(5) 投資有価証券	13,875,312	13,875,312	-
資産計	48,069,965	48,076,457	6,492
(1) 未払手数料	1,435,205	1,435,205	-
(2) 未払法人税等	1,639,933	1,639,933	-
負債計	3,075,139	3,075,139	-

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資産

(1)現金及び預金、(2)有価証券、(3)未収委託者報酬

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。なお、有価証券はすべて短期決済される譲渡性預金であります。

(4)長期性預金

契約期間に基づく区分ごとに、新規に預金を行った場合に想定される預金金利で割り引いた現在価値を算定しております。

(5)投資有価証券

上記の表中における投資有価証券はすべて投資信託であり、基準価額によっております。

負債

(1)未払手数料、(2)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(5)投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

（有価証券関係）

第28期中間会計期間（平成24年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（中間貸借対照表計上額 関係会社株式320,136千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,899,973	6,184,088	715,884
	小計	6,899,973	6,184,088	715,884
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,936,438	7,202,827	266,389
	小計	6,936,438	7,202,827	266,389
合計		13,836,412	13,386,916	449,495

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額38,900千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（デリバティブ取引関係）

重要な取引はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第28期中間会計期間（自平成24年4月1日至平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

単一の製品・サービスの区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

2. 地域ごとの情報

(1)営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2)有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 (平成24年9月30日現在)
1株当たり純資産額 (算定上の基礎)	376,683.83円
純資産の部の合計額(千円)	46,745,710
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	46,745,710
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	124,098

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第28期中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	20,482.99円
中間純利益金額(千円)	2,541,898
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	2,541,898
普通株式の期中平均株式数(株)	124,098

(注)潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため、記載しておりません。

第2【その他の関係法人の概況】**1【名称、資本金の額及び事業の内容】****(1) 受託会社**

< 訂正前 >

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成24年3月末現在)

(略)

< 訂正後 >

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成24年9月末現在)

(略)

(2) 販売会社

< 更新後 >

名称	資本金の額 (平成24年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

3【資本関係】

< 訂正前 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成24年9月末現在)

(略)

< 訂正後 >

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(平成25年3月末現在)

(略)

独立監査人の監査報告書

平成25年4月3日

三菱UFJ投信株式会社
取締役会御中

あらた監査法人

指定社員 公認会計士 柴 毅 印
業務執行社員

指定社員 公認会計士 鶴田光夫 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）の平成24年8月25日から平成25年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）の平成25年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三菱UFJ投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年12月6日

三菱UFJ投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	長島 拓也	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	山田 信之	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ投信株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第28期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して中間財務諸表を作成し有用な情報を表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない中間財務諸表を作成し有用な情報を表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した中間監査に基づいて、独立の立場から中間財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準は、当監査法人に中間財務諸表には全体として中間財務諸表の有用な情報の表示に関して投資者の判断を損なうような重要な虚偽表示がないかどうかの合理的な保証を得るために、中間監査に係る監査計画を策定し、これに基づき中間監査を実施することを求めている。

中間監査においては、中間財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するために年度監査と比べて監査手続の一部を省略した中間監査手続が実施される。中間監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて、分析的手続等を中心とした監査手続に必要な応じて追加の監査手続が選択及び適用される。中間監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な中間監査手続を立案するために、中間財務諸表の作成と有用な情報の表示に関連する内部統制を検討する。また、中間監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め中間財務諸表の表示を検討することが含まれる。

当監査法人は、中間監査の意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ投信株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。