

【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27年5月22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 金上 孝

【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 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）
信託受益証券に係るファンドの名称】

【届出の対象とした募集内国投資 継続募集額 上限1兆円
信託受益証券の金額】

【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26年11月21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】

[ファンドの目的・特色]

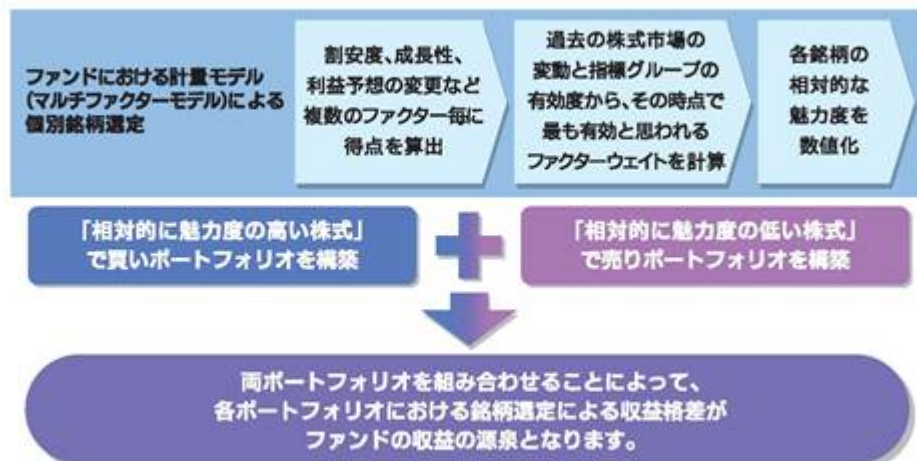
<更新後>

（略）

- 2** 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。

<運用戦略のコンセプト>

計量モデルを用いて、個別銘柄の持つ期待リターン(魅力度)を測定



! 当該モデルは仮説に基づき構成されたものであり、市場動向は必ずしもこの仮説と同様の動きを示さない場合があります。

📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<http://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)でご覧いただけます。

（略）

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社の概況

<更新後>

- ・資本金
2,000百万円(平成27年2月末現在)
(略)
- ・大株主の状況(平成27年2月末現在)
(略)

2 【投資方針】

(2) 【投資対象】

有価証券の指図範囲

<更新後>

- (略)
- 15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16. において同じ。)で16. で定める以外のもの
(略)

(5) 【投資制限】

<更新後>

(略)

デリバティブ取引等

デリバティブ取引等(金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。)については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

<その他法令等に定められた投資制限>

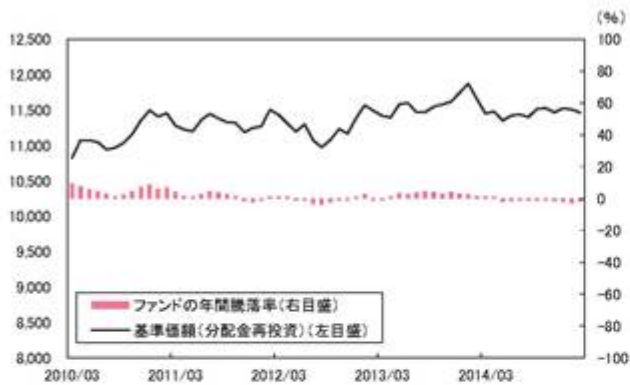
- ・同一の法人の発行する株式への投資制限
委託会社は、同一の法人の発行する株式を、(略)投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

3【投資リスク】

<追加>

(3) 代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

●ファンドの年間騰落率および基準価額(分配金再投資)の推移

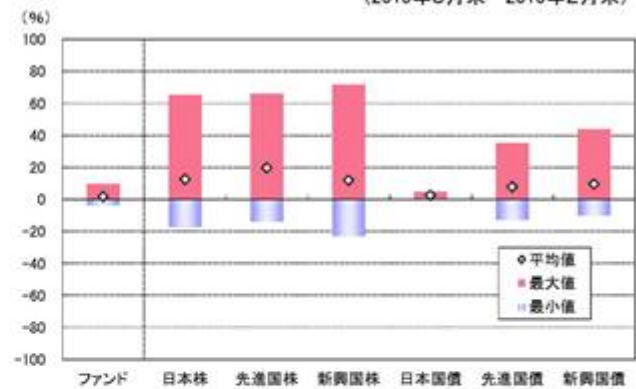


・ファンドの年間騰落率とは、当該各月末の基準価額(分配金再投資)から当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)を控除した額を当該各月末の1年前の基準価額(分配金再投資)で除して得た数に100を乗じて得た数をいいます。

・ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

●ファンドと他の代表的な資産クラスとの騰落率の比較

(2010年3月末～2015年2月末)



・グラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

ファンドと他の代表的な資産クラスの平均騰落率、年間最大・最小騰落率(%)

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値	+1.7	+12.5	+19.6	+11.8	+2.4	+7.8	+9.4
最大値	+9.5	+65.0	+65.7	+71.8	+4.5	+34.9	+43.7
最小値	-3.6	-17.0	-13.6	-22.8	+0.4	-12.7	-10.1

(注) 全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

・2010年3月～2015年2月の5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均・最大・最小を、ファンドおよび他の代表的な資産クラスについて表示したものです。

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	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(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCI エマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCI エマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPIとは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
先進国債	シティ世界国債インデックス(除く日本)	シティ世界国債インデックス(除く日本)は、Citigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

4【手数料等及び税金】

<更新後>

(略)

(4)【その他の手数料等】

(略)

費用または費用を対価とする役務の内容について

費用名	直接・間接	説明
申込手数料	直接	商品および投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等の対価
換金（解約）手数料	直接	商品の換金に関する事務手続等の対価
信託財産留保額	直接	信託期間の途中で換金する場合に、換金に必要な費用を賄うため換金代金から控除され、信託財産中に留保される額
信託報酬	間接	（委託会社（再委託先への報酬を含む場合があります。）） 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） 分配金・償還金・換金代金支払等の事務手続き、交付運用報告書等の送付、購入後の説明・情報提供等の対価 （受託会社） 投資信託財産の保管・管理、運用指図の実行等の対価
監査報酬	間接	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
売買委託手数料	間接	有価証券等を売買する際に発生する費用
保管費用 （カストディフィー）	間接	外国での資産の保管等に要する費用

上記は一般的な用語について説明したものです。

受益者が直接的に負担する費用か、間接的に負担する費用かの区別です。

(5)【課税上の取扱い】

(略)

上記は平成27年2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27年2月27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	1,261,505,393	99.76
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		3,080,381	0.24
純資産総額		1,264,585,774	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27年2月27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		957,790,140	1.3215 1.3171	1,265,719,671 1,261,505,393		99.76

(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27年2月27日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.76
合計	99.76

(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27年2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)
第15計算期間末日 (平成25年 8月26日)	533,985,269 (分配付) 533,985,269 (分配落)	11,494 (分配付) 11,494 (分配落)
第16計算期間末日 (平成26年 2月24日)	904,211,437 (分配付) 904,211,437 (分配落)	11,732 (分配付) 11,732 (分配落)
第17計算期間末日 (平成26年 8月25日)	1,161,429,254 (分配付) 1,161,429,254 (分配落)	11,415 (分配付) 11,415 (分配落)
第18計算期間末日 (平成27年 2月24日)	1,300,508,022 (分配付) 1,300,508,022 (分配落)	11,504 (分配付) 11,504 (分配落)
平成26年 2月末日	898,423,974	11,657
3月末日	969,976,045	11,452
4月末日	1,086,758,870	11,479
5月末日	1,101,857,166	11,351
6月末日	1,145,274,826	11,421
7月末日	1,145,109,416	11,438
8月末日	1,160,219,318	11,403
9月末日	1,156,495,671	11,519
10月末日	1,273,594,563	11,529
11月末日	1,063,359,190	11,464
12月末日	1,043,768,016	11,524
平成27年 1月末日	1,176,056,873	11,507
2月末日	1,264,585,774	11,465

【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
第15計算期間	0円
第16計算期間	0円
第17計算期間	0円
第18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
第15計算期間	0.11
第16計算期間	2.07
第17計算期間	2.70
第18計算期間	0.77

（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
第15計算期間	434,451,663	13,749,453	464,586,331
第16計算期間	694,931,787	388,810,335	770,707,783
第17計算期間	351,519,150	104,777,761	1,017,449,172
第18計算期間	680,608,167	567,569,392	1,130,487,947

<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27年2月27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	1,276,583,500	82.93
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		262,834,391	17.07
純資産総額		1,539,417,891	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27年2月27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	フォスター電機	株式	電気機器
日本	三井不動産	株式	不動産業	2,000	3,347.00 3,286.50	6,694,000 6,573,000		0.43
日本	クオール	株式	小売業	6,000	1,000.00 1,084.00	6,000,000 6,504,000		0.42
日本	スズキ	株式	輸送用機器	1,700	3,773.50 3,780.00	6,414,950 6,426,000		0.42
日本	シスメックス	株式	電気機器	1,000	6,180.00 6,420.00	6,180,000 6,420,000		0.42
日本	ベガサスミシン製造	株式	機械	10,000	612.00 636.00	6,120,000 6,360,000		0.41
日本	サンエー	株式	小売業	1,500	4,100.00 4,175.00	6,150,000 6,262,500		0.41
日本	日本ペイントホールディングス	株式	化学	1,500	4,150.00 4,150.00	6,225,000 6,225,000		0.40
日本	パル	株式	小売業	1,900	3,125.00 3,250.00	5,937,500 6,175,000		0.40
日本	ドクターシーラボ	株式	化学	1,500	4,135.00 4,110.00	6,202,500 6,165,000		0.40
日本	キーエンス	株式	電気機器	100	60,420.00 61,100.00	6,042,000 6,110,000		0.40
日本	日精イー・エス・ビー機械	株式	機械	2,500	2,285.00 2,440.00	5,712,500 6,100,000		0.40
日本	エービーシー・マート	株式	小売業	900	6,200.00 6,720.00	5,580,000 6,048,000		0.39
日本	エイチ・アイ・エス	株式	サービス業	1,500	4,030.00 4,020.00	6,045,000 6,030,000		0.39
日本	大幸薬品	株式	医薬品	3,000	2,016.00 1,989.00	6,048,000 5,967,000		0.39
日本	住友商事	株式	卸売業	4,500	1,297.00 1,315.00	5,836,500 5,917,500		0.38
日本	村田製作所	株式	電気機器	400	13,780.00 14,745.00	5,512,000 5,898,000		0.38
日本	アダストリアホールディングス	株式	小売業	2,000	3,030.00 2,943.00	6,060,000 5,886,000		0.38
日本	トリドール	株式	小売業	3,500	1,656.00 1,679.00	5,796,000 5,876,500		0.38
日本	カルビー	株式	食料品	1,300	4,460.00 4,520.00	5,798,000 5,876,000		0.38
日本	ジャパนมテリアル	株式	サービス業	3,500	1,627.00 1,677.00	5,694,500 5,869,500		0.38
日本	日本空港ビルデング	株式	不動産業	1,000	5,780.00 5,860.00	5,780,000 5,860,000		0.38
日本	共立メンテナンス	株式	サービス業	900	6,540.00 6,490.00	5,886,000 5,841,000		0.38
日本	中外製薬	株式	医薬品	1,600	3,485.00 3,645.00	5,576,000 5,832,000		0.38
日本	川崎汽船	株式	海運業	16,000	344.00 364.00	5,504,000 5,824,000		0.38
日本	オムロン	株式	電気機器	1,100	5,070.00 5,280.00	5,577,000 5,808,000		0.38
日本	しまむら	株式	小売業	500	11,030.00 11,590.00	5,515,000 5,795,000		0.38
日本	オーエスジー	株式	機械	2,500	2,299.00 2,297.00	5,747,500 5,742,500		0.37
日本	デサント	株式	繊維製品	4,000	1,379.00 1,435.00	5,516,000 5,740,000		0.37
日本	ビー・エム・エル	株式	サービス業	1,700	3,350.00 3,365.00	5,695,000 5,720,500		0.37

(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27年2月27日現在

種類 / 業種別	投資比率 (%)
株式	
鉱業	0.68
建設業	2.32
食料品	3.68
繊維製品	0.72
パルプ・紙	0.65
化学	8.93
医薬品	3.07
石油・石炭製品	0.65
ゴム製品	0.31
ガラス・土石製品	2.44
鉄鋼	2.26
非鉄金属	1.52
金属製品	1.75
機械	6.65
電気機器	10.57
輸送用機器	4.18
精密機器	0.55
その他製品	1.05
陸運業	1.92
海運業	0.38
倉庫・運輸関連業	1.22
情報・通信業	3.50
卸売業	5.83
小売業	9.84
不動産業	3.85
サービス業	4.42
合計	82.93

（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。

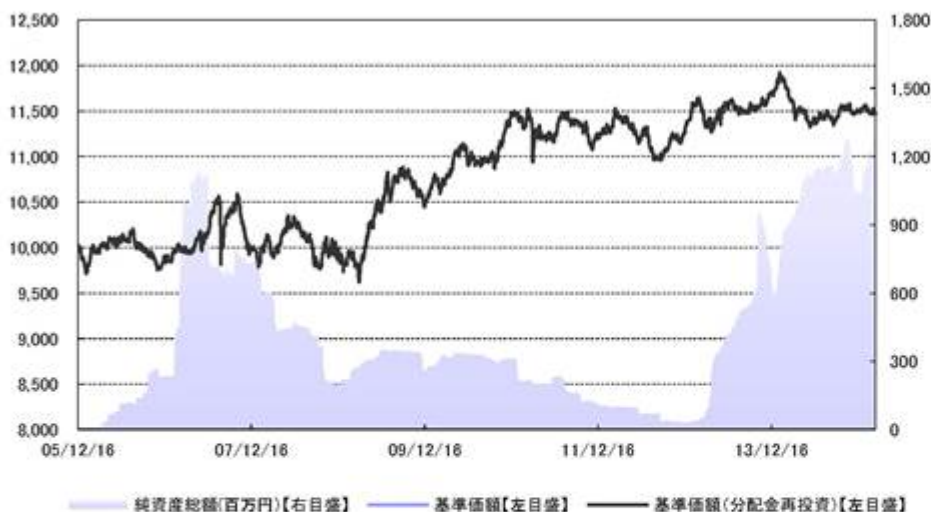
その他投資資産の主要なもの

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～2015年2月27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)を再投資したものと計算

2 分配の推移

2015年 2月	0円
2014年 8月	0円
2014年 2月	0円
2013年 8月	0円
2013年 2月	0円
2012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

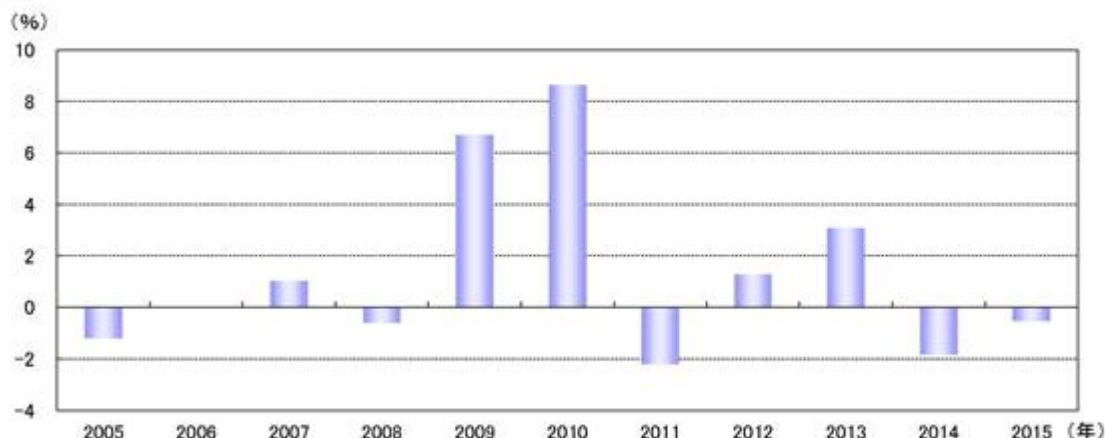
3 主要な資産の状況(2015年2月27日現在)

資産別構成	比率
国内株式現物	82.7%
国内株式信用売	-83.0%
株式(実質)	-0.3%

	組入上位銘柄	業種	比率
1	フォスター電機	電気機器	0.4%
2	三井不動産	不動産業	0.4%
3	クオール	小売業	0.4%
4	スズキ	輸送用機器	0.4%
5	シスメックス	電気機器	0.4%
6	ペガサスマシン製造	機械	0.4%
7	サンエー	小売業	0.4%
8	日本ペイントホールディングス	化学	0.4%
9	パル	小売業	0.4%
10	ドクターシーラボ	化学	0.4%

・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、2015年は2月27日までの収益率を表示

- ・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。
- ・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】****(5)【その他】**

<更新後>

(略)

交付運用報告書	委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。
---------	--

(略)

公告	委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。 http://www.am.mufg.jp/ なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。
----	--

4【受益者の権利等】

(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18期計算期間（平成26年8月26日から平成27年2月24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】

	第 17 期	第 18 期
	[平成26年8月25日現在]	[平成27年2月24日現在]
	金 額 (円)	金 額 (円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	15,556,095	12,113,004
親投資信託受益証券	1,158,635,275	1,297,407,611
未収入金		3,625,925
未収利息	22	19
流動資産合計	1,174,191,392	1,313,146,559
資産合計	1,174,191,392	1,313,146,559
負債の部		
流動負債		
未払解約金	6,716,798	6,069,618
未払受託者報酬	574,342	624,081
未払委託者報酬	5,456,124	5,928,676
その他未払費用	14,874	16,162
流動負債合計	12,762,138	12,638,537
負債合計	12,762,138	12,638,537
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,130,487,947
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金 ()	143,980,082	170,020,075
(分配準備積立金)	(11,509,305)	(9,811,818)
元本等合計	1,161,429,254	1,300,508,022
純資産合計	1,161,429,254	1,300,508,022
負債純資産合計	1,174,191,392	1,313,146,559

(2)【損益及び剰余金計算書】

	第 17 期	第 18 期
	自 平成26年 2月25日 至 平成26年 8月25日	自 平成26年 8月26日 至 平成27年 2月24日
	金 額 (円)	金 額 (円)
営業収益		
受取利息	1,878	3,237
有価証券売買等損益	20,612,289	13,566,026
営業収益合計	20,610,411	13,569,263
営業費用		
受託者報酬	574,342	624,081
委託者報酬	5,456,124	5,928,676
その他費用	14,874	16,162
営業費用合計	6,045,340	6,568,919
営業利益	26,655,751	7,000,344
経常利益	26,655,751	7,000,344
当期純利益	26,655,751	7,000,344
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額	2,582,913	2,713,626
期首剰余金又は期首欠損金 ()	133,503,654	143,980,082
剰余金増加額又は欠損金減少額	51,908,270	102,718,981
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	51,908,270	102,718,981
剰余金減少額又は欠損金増加額	17,359,004	80,965,706
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	17,359,004	80,965,706
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金 ()	143,980,082	170,020,075

(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	親投資信託受益証券は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、基準価額で評価しております。
2 その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	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、前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26年8月26日から平成27年2月24日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第 17 期 [平成26年8月25日現在]	第 18 期 [平成27年2月24日現在]
1 期首元本額	770,707,783円	1,017,449,172円
期中追加設定元本額	351,519,150円	680,608,167円
期中一部解約元本額	104,777,761円	567,569,392円
2 受益権の総数	1,017,449,172口	1,130,487,947口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1415円 (11,415円)	1.1504円 (11,504円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 17 期 (自 平成26年2月25日 至 平成26年8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	2,684,918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	221,447,162円
分配準備積立金額	D	8,824,387円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	232,956,467円
当ファンドの期末残存口数	F	1,017,449,172口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,289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 18 期 (自 平成26年8月26日 至 平成27年2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	2,922,565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	253,046,292円
分配準備積立金額	D	6,889,253円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	262,858,110円
当ファンドの期末残存口数	F	1,130,487,947口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,325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 17 期 (自 平成26年 2月25日 至 平成26年 8月25日)	第 18 期 (自 平成26年 8月26日 至 平成27年 2月24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に投資しております。当該投資対象は、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 17 期	第 18 期
	[平成26年8月25日現在]	[平成27年2月24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>売買目的有価証券は、（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>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>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>	<p>同 左</p> <p>同 左</p> <p>同 左</p>
3 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	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 17 期	第 18 期
	[平成26年8月25日現在]	[平成27年2月24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	19,680,645	10,653,080
合計	19,680,645	10,653,080

(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	981,768,908	1,297,407,611	
	親投資信託受益証券 小計	981,768,908	1,297,407,611	
合計		981,768,908	1,297,407,611	

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>

当ファンドは親投資信託受益証券を主要投資対象としております。
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の状況は以下の通りです。

[次へ](#)

「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26年8月25日現在]	[平成27年2月24日現在]
	金額(円)	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	307,770,044	553,590,961
株式 2	1,033,293,750	1,268,094,900
未収入金		81,229,481
信用取引預け金	949,127,600	1,168,478,527
未収配当金	691,540	1,137,680
未収利息	454	905
その他未収収益	42,330	47,404
流動資産合計	2,290,925,718	3,072,579,858
資産合計	2,290,925,718	3,072,579,858
負債の部		
流動負債		
信用売証券	1,032,257,700	1,267,475,000
未払金		222,525,912
未払解約金		3,625,925
その他未払費用	1,697,695	2,723,440
流動負債合計	1,033,955,395	1,496,350,277
負債合計	1,033,955,395	1,496,350,277
純資産の部		
元本等		
元本 1	962,938,929	1,192,795,322
剰余金		
剰余金又は欠損金()	294,031,394	383,434,259
元本等合計	1,256,970,323	1,576,229,581
純資産合計	1,256,970,323	1,576,229,581
負債純資産合計	2,290,925,718	3,072,579,858

(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	株式は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、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 信用売証券は個別法に基づき、時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2 収益及び費用の計上基準	その他費用として、信用売り株式の借入に係る費用を、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。 また、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。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成26年8月25日現在]	[平成27年2月24日現在]
1 期首		
期首元本額	平成26年2月25日 751,617,360円	平成26年8月26日 962,938,929円
期首からの追加設定元本額	239,125,124円	538,208,978円
期首からの一部解約元本額	27,803,555円	308,352,585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)	887,639,068円	981,768,908円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)		68,016,929円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)		68,016,929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)	75,299,861円	74,992,556円
(合計)	962,938,929円	1,192,795,322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	620,722,800円	646,392,650円
3 受益権の総数	962,938,929口	1,192,795,322口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3053円 (13,053円)	1.3215円 (13,215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26年 2月25日 至平成26年 8月25日）	（自平成26年 8月26日 至平成27年 2月24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、株式に投資しております。当該投資対象は、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。 当ファンドは、信用売証券に投資しております。当該投資対象は、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 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26年8月25日現在]	[平成27年2月24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	売買目的有価証券は、（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。 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 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	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26年8月25日現在]	[平成27年2月24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	60,392,992	65,598,050
信用売証券	83,462,022	84,483,275
合計	23,069,030	18,885,225

（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	
1605	国際石油開発帝石	3,400	1,356.00	4,610,400	3,400株
1662	石油資源開発	1,400	3,950.00	5,530,000	1,200株
1417	ミライト・ホールディングス	3,000	1,259.00	3,777,000	3,000株
1719	安藤・間	8,000	705.00	5,640,000	5,000株
1812	鹿島建設	10,000	544.00	5,440,000	
1813	不動テトラ	20,000	258.00	5,160,000	20,000株
1819	日鉄住金テックスエンジ	8,000	552.00	4,416,000	8,000株
1885	東亜建設工業	20,000	218.00	4,360,000	20,000株
1929	日特建設	6,000	552.00	3,312,000	
1949	住友電設	2,700	1,284.00	3,466,800	2,200株
2109	三井製糖	13,000	430.00	5,590,000	9,000株
2211	不二家	23,000	196.00	4,508,000	
2229	カルビー	1,300	4,460.00	5,798,000	1,100株

2288	丸大食品	13,000	412.00	5,356,000	11,000株
2290	米久	2,800	1,910.00	5,348,000	2,800株
2292	S Foods	2,400	2,078.00	4,987,200	2,000株
2590	ガイドードリンコ	1,100	4,850.00	5,335,000	
2607	不二製油	2,800	1,663.00	4,656,400	2,800株
2815	アリアケジャパン	1,500	3,120.00	4,680,000	
2875	東洋水産	1,300	4,190.00	5,447,000	1,000株
2918	わらべや日洋	2,500	2,030.00	5,075,000	2,200株
3302	帝国繊維	3,000	1,823.00	5,469,000	2,000株
8114	デサント	4,000	1,379.00	5,516,000	2,000株
3863	日本製紙	2,500	1,963.00	4,907,500	2,500株
3946	トーモク	16,000	290.00	4,640,000	16,000株
4027	テイカ	11,000	455.00	5,005,000	10,000株
4064	日本カーバイド工業	20,000	241.00	4,820,000	
4078	堺化学工業	12,000	400.00	4,800,000	11,000株
4116	大日精化学工業	8,000	661.00	5,288,000	
4182	三菱瓦斯化学	8,000	612.00	4,896,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	8,000	639.40	5,115,200	6,000株
4201	日本合成化学工業	7,000	738.00	5,166,000	6,000株
4203	住友ベークライト	10,000	514.00	5,140,000	10,000株
4206	アイカ工業	2,000	2,692.00	5,384,000	
4215	タキロン	9,000	525.00	4,725,000	
4220	リケンテクノス	10,000	457.00	4,570,000	9,000株
4221	大倉工業	12,000	357.00	4,284,000	
4272	日本化薬	3,000	1,553.00	4,659,000	
4401	A D E K A	3,500	1,508.00	5,278,000	
4461	第一工業製薬	13,000	415.00	5,395,000	11,000株
4612	日本ペイントホールディングス	1,500	4,150.00	6,225,000	
4620	藤倉化成	8,000	563.00	4,504,000	8,000株
4901	富士フイルムホールディングス	1,200	4,110.00	4,932,000	1,000株
4917	マンダム	1,300	3,995.00	5,193,500	1,000株
4919	ミルボン	1,500	3,435.00	5,152,500	
4924	ドクターシーラボ	1,500	4,135.00	6,202,500	1,000株
4955	アグロ カネショウ	5,000	957.00	4,785,000	4,000株
4968	荒川化学工業	4,000	1,339.00	5,356,000	3,700株
4977	新田ゼラチン	7,000	823.00	5,761,000	
4992	北興化学工業	12,000	412.00	4,944,000	
7917	藤森工業	1,300	3,720.00	4,836,000	1,300株
7970	信越ポリマー	8,500	573.00	4,870,500	6,000株
4508	田辺三菱製薬	2,800	2,012.00	5,633,600	
4514	あすか製薬	4,000	1,161.00	4,644,000	3,000株
4519	中外製薬	1,600	3,485.00	5,576,000	1,300株
4528	小野薬品工業	400	11,890.00	4,756,000	
4536	参天製薬	700	7,590.00	5,313,000	600株
4539	日本ケミファ	8,000	566.00	4,528,000	
4554	富士製薬工業	2,000	2,300.00	4,600,000	
4574	大幸薬品	3,000	2,016.00	6,048,000	
4581	大正製薬ホールディングス	700	8,060.00	5,642,000	300株
5011	ニチレキ	5,000	1,011.00	5,055,000	
5020	J Xホールディングス	10,000	475.10	4,751,000	
5185	フコク	4,000	1,191.00	4,764,000	3,000株
5201	旭硝子	6,000	762.00	4,572,000	
5202	日本板硝子	40,000	122.00	4,880,000	
5232	住友大阪セメント	12,000	369.00	4,428,000	12,000株
5288	ジャパンパイル	4,500	701.00	3,154,500	4,500株
5333	日本碍子	2,000	2,343.00	4,686,000	1,000株
5334	日本特殊陶業	1,500	3,385.00	5,077,500	
5344	M A R U W A	2,000	2,682.00	5,364,000	
5351	品川リフラクトリーズ	19,000	295.00	5,605,000	17,000株
5410	合同製鐵	25,000	193.00	4,825,000	25,000株
5444	大和工業	1,600	3,145.00	5,032,000	1,100株
5445	東京鐵鋼	8,000	559.00	4,472,000	7,000株
5463	丸一鋼管	1,600	2,837.00	4,539,200	1,600株
5602	栗本鐵工所	24,000	232.00	5,568,000	
5659	日本精線	8,000	669.00	5,352,000	
6319	シンニッタン	8,500	563.00	4,785,500	7,000株
5706	三井金属鉱業	16,000	274.00	4,384,000	16,000株
5801	古河電気工業	20,000	213.00	4,260,000	20,000株
5802	住友電気工業	3,100	1,552.00	4,811,200	
5809	タツタ電線	10,000	498.00	4,980,000	

5819	カナレ電気	2,000	2,503.00	5,006,000	
3421	稲葉製作所	3,300	1,331.00	4,392,300	2,500株
3433	トーカロ	1,800	2,337.00	4,206,600	1,800株
5911	横河ブリッジホールディングス	3,200	1,284.00	4,108,800	3,200株
5947	リンナイ	500	8,430.00	4,215,000	
5957	日東精工	13,000	366.00	4,758,000	13,000株
5991	日本発條	4,000	1,219.00	4,876,000	
6113	アマダ	4,000	1,107.00	4,428,000	4,000株
6121	滝澤鉄工所	22,000	226.00	4,972,000	18,000株
6134	富士機械製造	4,100	1,337.00	5,481,700	4,100株
6136	オーエスジー	2,500	2,299.00	5,747,500	2,000株
6141	D M G 森精機	3,300	1,721.00	5,679,300	
6165	パンチ工業	3,500	1,397.00	4,889,500	2,500株
6222	島精機製作所	2,500	2,065.00	5,162,500	
6262	ベガサスミシン製造	10,000	612.00	6,120,000	
6284	日精エー・エス・ビー機械	2,500	2,285.00	5,712,500	
6302	住友重機械工業	7,000	724.00	5,068,000	
6333	帝国電機製作所	4,000	1,193.00	4,772,000	
6369	トーヨーカネツ	22,000	236.00	5,192,000	
6370	栗田工業	1,700	2,970.00	5,049,000	1,500株
6378	木村化工機	10,000	501.00	5,010,000	7,000株
6390	加藤製作所	6,000	781.00	4,686,000	4,000株
6459	大和冷機工業	5,000	727.00	3,635,000	
6463	T P R	1,700	2,938.00	4,994,600	1,400株
6480	日本トムソン	8,000	607.00	4,856,000	
6490	日本ビラー工業	5,000	941.00	4,705,000	
6586	マキタ	900	5,560.00	5,004,000	300株
6503	三菱電機	4,000	1,363.50	5,454,000	
6505	東洋電機製造	11,000	431.00	4,741,000	11,000株
6513	オリジン電気	10,000	535.00	5,350,000	8,000株
6517	デンヨー	2,700	1,924.00	5,194,800	2,200株
6588	東芝テック	6,000	723.00	4,338,000	6,000株
6592	マブチモーター	900	5,900.00	5,310,000	800株
6641	日新電機	6,000	678.00	4,068,000	
6645	オムロン	1,100	5,070.00	5,577,000	
6701	日本電気	15,000	361.00	5,415,000	
6706	電気興業	9,000	527.00	4,743,000	
6740	ジャパンディスプレイ	10,000	501.00	5,010,000	
6755	富士通ゼネラル	3,000	1,300.00	3,900,000	3,000株
6768	タムラ製作所	12,000	430.00	5,160,000	
6779	日本電波工業	5,000	962.00	4,810,000	
6794	フォスター電機	2,300	2,850.00	6,555,000	2,300株
6817	スミダコーポレーション	7,000	656.00	4,592,000	5,000株
6839	船井電機	4,000	1,382.00	5,528,000	
6841	横河電機	4,000	1,320.00	5,280,000	
6844	新電元工業	8,000	642.00	5,136,000	
6861	キーエンス	100	60,420.00	6,042,000	100株
6869	シスメックス	1,000	6,180.00	6,180,000	900株
6911	新日本無線	7,000	469.00	3,283,000	
6915	千代田インテグレ	2,300	2,255.00	5,186,500	
6935	日本デジタル研究所	3,000	1,636.00	4,908,000	2,500株
6951	日本電子	9,000	572.00	5,148,000	
6958	日本シイエムケイ	15,000	316.00	4,740,000	11,000株
6963	ローム	700	7,630.00	5,341,000	500株
6965	浜松ホトニクス	600	6,750.00	4,050,000	
6981	村田製作所	400	13,780.00	5,512,000	300株
6997	日本ケミコン	13,000	386.00	5,018,000	13,000株
7244	市光工業	22,000	236.00	5,192,000	17,000株
7751	キヤノン	1,300	3,868.50	5,029,050	1,000株
5949	ユニプレス	2,400	2,236.00	5,366,400	
6584	三櫻工業	6,000	779.00	4,674,000	
7201	日産自動車	4,500	1,223.50	5,505,750	
7212	エフテック	4,000	1,225.00	4,900,000	4,000株
7256	河西工業	5,600	1,015.00	5,684,000	2,000株
7269	スズキ	1,700	3,773.50	6,414,950	
7277	T B K	7,000	656.00	4,592,000	7,000株
7278	エクセディ	1,800	2,782.00	5,007,600	1,500株
7283	愛三工業	5,000	1,087.00	5,435,000	5,000株
7294	ヨロズ	2,300	2,354.00	5,414,200	1,900株
7309	シマノ	300	16,890.00	5,067,000	200株

7313	テイ・エス テック	1,700	3,220.00	5,474,000	
7717	ブイ・テクノロジー	2,000	2,412.00	4,824,000	
7762	シチズンホールディングス	4,000	926.00	3,704,000	
7846	パイロットコーポレーション	800	6,870.00	5,496,000	
7856	萩原工業	2,500	1,988.00	4,970,000	2,500株
7951	ヤマハ	2,800	2,042.00	5,717,600	
9008	京王電鉄	5,000	998.00	4,990,000	5,000株
9021	西日本旅客鉄道	800	6,866.00	5,492,800	
9037	ハマキョウレックス	1,200	4,130.00	4,956,000	
9044	南海電気鉄道	9,000	502.00	4,518,000	
9045	京阪電気鉄道	7,000	732.00	5,124,000	7,000株
9064	ヤマトホールディングス	1,500	2,774.50	4,161,750	1,300株
9107	川崎汽船	16,000	344.00	5,504,000	
9066	日新	15,000	319.00	4,785,000	15,000株
9302	三井倉庫ホールディングス	11,000	410.00	4,510,000	11,000株
9364	上組	4,000	1,162.00	4,648,000	3,000株
9370	郵船ロジスティクス	3,200	1,507.00	4,822,400	3,200株
3636	三菱総合研究所	1,800	2,763.00	4,973,400	1,500株
3817	S R Aホールディングス	3,000	1,610.00	4,830,000	3,000株
4283	パナソニック インフォメーションシステムズ	1,500	3,575.00	5,362,500	
4725	C A C Holdings	4,000	1,068.00	4,272,000	3,000株
4743	アイティフォー	9,500	470.00	4,465,000	8,000株
4839	WOWOW	900	6,230.00	5,607,000	
8096	兼松エレクトロニクス	3,000	1,782.00	5,346,000	
9405	朝日放送	5,000	967.00	4,835,000	5,000株
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	1,100	4,775.00	5,252,500	
9692	シーイーシー	4,500	1,006.00	4,527,000	4,000株
9746	T K C	1,800	2,254.00	4,057,200	1,800株
2874	横浜冷凍	6,000	838.00	5,028,000	5,000株
3107	ダイワボウホールディングス	24,000	198.00	4,752,000	19,000株
3156	U K Cホールディングス	2,500	2,006.00	5,015,000	2,500株
3176	三洋貿易	3,500	1,405.00	4,917,500	2,500株
7438	コンドーテック	5,000	795.00	3,975,000	3,500株
7537	丸文	6,000	799.00	4,794,000	
7594	マルカキカイ	3,300	1,696.00	5,596,800	
8020	兼松	27,000	179.00	4,833,000	24,000株
8036	日立ハイテクノロジーズ	1,400	3,665.00	5,131,000	
8053	住友商事	4,500	1,297.00	5,836,500	
8057	内田洋行	12,000	370.00	4,440,000	12,000株
8075	神鋼商事	19,000	274.00	5,206,000	
8098	稲畑産業	4,500	1,142.00	5,139,000	4,500株
8130	サンゲツ	1,600	3,480.00	5,568,000	
8137	サンワテクノス	4,000	1,221.00	4,884,000	
8142	トーホー	11,000	461.00	5,071,000	
8150	三信電気	4,800	992.00	4,761,600	4,800株
9869	加藤産業	2,000	2,380.00	4,760,000	2,000株
2659	サンエー	1,500	4,100.00	6,150,000	1,200株
2664	カワチ薬品	2,500	2,014.00	5,035,000	
2670	エービーシー・マート	900	6,200.00	5,580,000	700株
2685	アダストリアホールディングス	2,000	3,030.00	6,060,000	
2695	くらコーポレーション	1,200	3,970.00	4,764,000	1,000株
2726	パル	1,900	3,125.00	5,937,500	1,400株
2764	ひらまつ	7,000	643.00	4,501,000	4,500株
2772	ゲンキー	500	10,340.00	5,170,000	
3034	クオール	6,000	1,000.00	6,000,000	6,000株
3085	アークランドサービス	1,200	4,425.00	5,310,000	1,100株
3091	ブロンコビリー	1,400	3,885.00	5,439,000	1,400株
3141	ウエルシアホールディングス	1,100	4,600.00	5,060,000	
3175	エー・ピーカンパニー	2,500	2,020.00	5,050,000	2,500株
3191	ジョイフル本田	1,100	4,150.00	4,565,000	
3341	日本調剤	1,000	4,135.00	4,135,000	1,000株
3387	クリエイティブ・レストランツ・ホールディングス	2,500	1,537.00	3,842,500	2,500株
3397	トリドール	3,500	1,656.00	5,796,000	2,500株
7494	コナカ	7,000	705.00	4,935,000	
7513	コジマ	14,000	346.00	4,844,000	10,000株
7516	コーナン商事	3,500	1,407.00	4,924,500	3,500株
7630	壱番屋	1,000	5,240.00	5,240,000	
8227	しまむら	500	11,030.00	5,515,000	400株

8251	パルコ	4,500	1,035.00	4,657,500	3,500株
8273	イズミ	1,100	4,400.00	4,840,000	
8279	ヤオコー	700	8,010.00	5,607,000	
9831	ヤマダ電機	10,000	497.00	4,970,000	
9946	ミニストップ	3,000	1,639.00	4,917,000	2,500株
9948	アークス	1,900	2,464.00	4,681,600	1,900株
9990	サックスパー ホールディングス	3,000	1,845.00	5,535,000	2,200株
2353	日本駐車場開発	30,000	131.00	3,930,000	30,000株
3228	三栄建築設計	5,000	913.00	4,565,000	4,500株
3231	野村不動産ホールディングス	2,500	2,142.00	5,355,000	
3276	日本管理センター	3,800	1,308.00	4,970,400	3,800株
3288	オープンハウス	2,000	2,683.00	5,366,000	
3291	飯田グループホールディングス	2,600	1,684.00	4,378,400	2,600株
8801	三井不動産	2,000	3,347.00	6,694,000	
8806	ダイビル	4,000	1,141.00	4,564,000	
8840	大京	25,000	179.00	4,475,000	
8871	ゴールドクレスト	2,000	2,127.00	4,254,000	
8905	イオンモール	2,200	2,317.00	5,097,400	
9706	日本空港ビルデング	1,000	5,780.00	5,780,000	
2168	パソナグループ	8,000	699.00	5,592,000	8,000株
2413	エムスリー	2,000	2,585.00	5,170,000	2,000株
2475	WDBホールディングス	5,000	819.00	4,095,000	
2485	ティア	8,000	606.00	4,848,000	7,000株
4694	ピー・エム・エル	1,700	3,350.00	5,695,000	
4732	ユー・エス・エス	2,500	2,085.00	5,212,500	2,000株
6055	ジャパンマテリアル	3,500	1,627.00	5,694,500	
6059	ウチヤマホールディングス	9,000	574.00	5,166,000	
9603	エイチ・アイ・エス	1,500	4,030.00	6,045,000	1,300株
9616	共立メンテナンス	900	6,540.00	5,886,000	
9622	スペース	4,000	1,206.00	4,824,000	4,000株
9743	丹青社	5,000	826.00	4,130,000	
9783	ベネッセホールディングス	1,400	3,810.00	5,334,000	
	合計	1,495,800		1,268,094,900	

(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。

備考欄以外に下記の通り、約定未受渡にかかる有価証券を差入保証金代用有価証券として担保に差し入れております。

銘柄		株式数
コード	銘柄名	
2222	寿スピリッツ	1,600
2579	コカ・コーラウエスト	3,000
4202	ダイセル	3,000
5481	山陽特殊製鋼	8,000
6104	東芝機械	8,000
7250	太平洋工業	4,700
9629	ピー・シー・イー	2,600
9843	ニトリホールディングス	500

(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	17,000	4,998,000	
ホクト	2,200	5,288,800	
ショーボンドホールディングス	1,000	5,050,000	
日本海洋掘削	900	3,757,500	
コムシスホールディングス	2,600	3,731,000	
ミサワホーム	5,000	5,205,000	
清水建設	6,000	5,148,000	
鉄建建設	8,000	3,672,000	
奥村組	8,000	4,624,000	
大東建託	400	5,328,000	
前田道路	3,000	5,460,000	
ヤマダ・エスバイエルホーム	36,000	3,384,000	
大和ハウス工業	2,000	4,708,000	
中電工	2,200	4,364,800	
関電工	5,000	3,400,000	

三機工業	5,400	4,530,600
NECネットエスアイ	2,000	4,692,000
大気社	2,000	5,438,000
日比谷総合設備	2,800	4,813,200
東芝プラントシステム	2,500	4,417,500
エス・エム・エス	4,000	5,396,000
森永製菓	15,000	5,505,000
江崎グリコ	1,000	5,210,000
山崎製パン	3,000	5,832,000
亀田製菓	1,100	5,131,500
六甲バター	4,000	4,652,000
ヤクルト本社	800	5,784,000
明治ホールディングス	400	5,380,000
伊藤ハム	8,000	5,264,000
学情	5,100	5,151,000
シミックホールディングス	2,500	4,960,000
アウトソーシング	2,500	4,630,000
博報堂DYホールディングス	3,500	4,606,000
宝ホールディングス	7,000	5,719,000
サントリー食品インターナショナル	1,300	5,596,500
日清オイリオグループ	12,000	5,184,000
エレマテック	1,800	4,971,600
アルフレッサホールディングス	3,200	5,299,200
ハニーズ	5,000	4,860,000
キュービー	2,000	5,612,000
ハウス食品グループ本社	2,200	5,374,600
片倉工業	4,000	4,752,000
ヒューリック	4,500	5,971,500
J.フロントリテイリング	2,500	4,112,500
マツモトキヨシホールディングス	1,300	5,161,000
ココカラファイン	1,500	5,062,500
日東紡績	10,000	4,970,000
TOKAIホールディングス	8,000	4,520,000
すかいらーく	3,500	4,921,000
あさひ	4,000	4,664,000
セブン&アイ・ホールディングス	1,200	5,452,200
東レ	6,000	5,988,000
SUMCO	2,600	5,995,600
住江織物	15,000	4,650,000
ホギメディカル	800	4,880,000
電算システム	3,000	4,704,000
豆蔵ホールディングス	7,000	4,473,000
パイブドピッツ	2,500	4,797,500
王子ホールディングス	12,000	5,892,000
レンゴー	10,000	5,240,000
日産化学工業	2,100	4,750,200
関東電化工業	6,000	4,986,000
エア・ウォーター	3,000	6,129,000
日本パーカライジング	1,600	4,588,800
日本触媒	3,000	4,809,000
東京応化工業	1,400	5,775,000
群栄化学工業	12,000	4,164,000
EPSホールディングス	3,000	4,203,000
日油	6,000	5,100,000
武田薬品工業	900	5,522,400
エーザイ	900	5,632,200
生化学工業	2,500	5,197,500
鳥居薬品	1,700	5,695,000
東和薬品	800	5,184,000
ゼリア新薬工業	3,000	5,733,000
第一三共	3,100	5,809,400
大塚ホールディングス	1,600	5,922,400
中国塗料	4,000	4,016,000
太陽ホールディングス	1,100	4,653,000
オリエンタルランド	200	5,972,000
ダスキン	2,800	5,538,400
オービック	1,400	6,132,000
オービックビジネスコンサルタント	1,300	5,369,000
大塚商会	1,100	5,247,000
サイボウズ	11,000	3,685,000

ファンケル	2,600	4,747,600
コーセー	900	5,175,000
星光PMC	5,100	4,855,200
小林製薬	700	5,600,000
JCU	1,100	6,325,000
イハラケミカル工業	3,000	4,047,000
クミアイ化学工業	5,000	4,430,000
東燃ゼネラル石油	5,000	5,525,000
MORESCO	2,300	5,016,300
ニッタ	1,700	5,253,000
三ツ星ベルト	5,000	4,785,000
太平洋セメント	15,000	5,895,000
日本コンクリート工業	7,000	3,346,000
東京製鐵	5,000	4,430,000
大同特殊鋼	11,000	5,907,000
日本冶金工業	15,900	3,927,300
新日本電工	16,000	5,120,000
三菱マテリアル	14,000	5,642,000
古河機械金属	24,000	4,992,000
沖電線	12,000	4,056,000
東洋製罐グループホールディングス	3,500	5,750,500
三和ホールディングス	5,200	4,373,200
ノーリツ	2,200	4,391,200
東京製綱	25,000	5,175,000
三浦工業	4,000	5,648,000
ツガミ	8,000	5,760,000
牧野フライス製作所	5,000	5,140,000
ディスコ	400	4,160,000
ナブテスコ	1,900	6,137,000
三井海洋開発	2,500	5,027,500
新川	6,500	4,673,500
ユニオンツール	1,700	5,831,000
サトーホールディングス	2,100	5,226,900
千代田化工建設	5,000	4,860,000
日機装	5,000	5,065,000
アネスト岩田	6,000	4,620,000
ダイフク	3,600	5,302,800
CKD	4,500	4,837,500
サンデン	8,000	4,880,000
マックス	4,000	5,452,000
日本ピストンリング	18,000	4,734,000
ホシザキ電機	700	4,718,000
日本精工	3,000	4,959,000
NTN	9,000	5,202,000
不二越	8,000	5,440,000
ミネベア	3,000	5,508,000
ユーシン精機	2,500	5,430,000
キッツ	6,000	3,684,000
日立製作所	6,000	4,969,200
東芝	10,000	4,987,000
安川電機	3,800	6,186,400
シンフォニアテクノロジー	24,000	5,112,000
明電舎	13,000	5,096,000
山洋電気	6,000	4,884,000
日立工機	4,500	4,117,500
日本電産	600	4,911,600
富士通	8,000	5,814,400
サンケン電気	4,000	3,384,000
セイコーエプソン	900	3,969,000
ワコム	9,000	5,760,000
シャープ	20,000	4,960,000
アンリツ	7,000	5,971,000
ソニー	1,500	4,914,000
TDK	700	5,663,000
日立マクセル	2,800	5,843,600
アズビル	1,700	5,304,000
堀場製作所	1,300	5,700,500
メガチップス	3,000	4,155,000
コーセル	4,000	5,308,000
レーザーテック	3,000	4,371,000

古河電池	5,000	4,910,000
カシオ計算機	2,700	5,643,000
ファナック	200	4,589,000
双葉電子工業	2,600	5,054,400
日東電工	700	5,257,700
北陸電気工業	25,000	4,975,000
ニチコン	4,700	5,010,200
川崎重工業	10,000	5,680,000
日野自動車	3,000	5,211,000
ファルテック	3,000	4,926,000
武蔵精密工業	2,100	5,262,600
日産車体	3,500	5,512,500
極東開発工業	3,000	3,936,000
曙ブレーキ工業	11,000	4,961,000
NOK	1,800	5,994,000
シロキ工業	14,000	4,536,000
カルソニックカンセイ	8,000	5,656,000
アイシン精機	1,300	5,726,500
マツダ	2,300	5,862,700
ダイハツ工業	3,500	6,079,500
ショーワ	4,000	5,036,000
豊田合成	2,000	5,224,000
ライトオン	6,800	5,263,200
ナガイレーベン	2,500	5,557,500
メディカルホールディングス	3,500	5,222,000
ユナイテッドアローズ	1,300	4,758,000
シークス	1,900	4,934,300
スギホールディングス	1,000	5,730,000
トプコン	1,700	4,284,000
SCREENホールディングス	6,000	4,794,000
フジシールインターナショナル	1,500	5,340,000
図書印刷	13,000	4,251,000
アシックス	1,500	4,491,000
JSP	2,200	5,280,000
ニチハ	3,500	4,795,000
エフピコ	1,400	5,747,000
クリナップ	5,300	4,913,100
ビジョン	600	4,770,000
コクヨ	6,000	6,228,000
伊藤忠商事	4,200	5,523,000
長瀬産業	3,200	4,899,200
蝶理	2,500	4,760,000
豊田通商	1,800	5,796,000
オンワードホールディングス	6,000	4,890,000
美津濃	9,000	5,364,000
ユアサ商事	2,000	4,952,000
岩谷産業	6,000	4,866,000
リョーサン	1,800	4,991,400
東陽テクニカ	4,600	5,639,600
木曽路	2,500	5,352,500
サトレストランシステムズ	4,500	4,977,000
ケーヨー	7,300	4,197,500
ロイヤルホールディングス	2,700	4,968,000
島忠	1,500	4,620,000
チヨダ	2,000	5,350,000
コメリ	2,000	5,578,000
高島屋	5,000	5,390,000
アクシアル リテイリング	1,800	5,670,000
ユニーグループ・ホールディングス	7,000	4,907,000
フジ	2,500	5,465,000
ケースホールディングス	1,500	5,220,000
Paltac	3,000	5,025,000
平和不動産	2,500	4,237,500
京阪神ビルディング	6,000	4,440,000
住友不動産	1,000	4,186,500
タカラレーベン	10,000	5,990,000
東祥	2,000	5,400,000
エヌ・ティ・ティ都市開発	4,000	4,912,000
京浜急行電鉄	6,000	5,874,000
富士急行	3,000	3,696,000

近畿日本鉄道	12,000	5,604,000	
トランコム	900	4,590,000	
福山通運	7,000	4,522,000	
飯野海運	8,000	5,024,000	
住友倉庫	7,000	4,774,000	
近鉄エクスプレス	1,000	4,890,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	6,500	4,803,500	
東宝	2,000	5,820,000	
アインファーマシーズ	1,300	5,466,500	
カナモト	1,700	5,355,000	
D T S	2,000	4,420,000	
乃村工藝社	4,500	5,382,000	
S C S K	1,600	5,048,000	
藤田観光	12,000	6,204,000	
K N T - C Tホールディングス	26,000	4,238,000	
アサツー ディ・ケイ	1,400	4,648,000	
ナック	5,000	5,310,000	
ニチイ学館	4,900	5,546,800	
トラスコ中山	1,400	4,781,000	
オートバックスセブン	2,500	4,682,500	
グルメ杵屋	5,000	4,995,000	
吉野家ホールディングス	3,300	4,375,800	
サガミチェーン	4,000	4,756,000	
パロー	2,000	4,846,000	
大庄	3,500	5,141,500	
ジェコス	2,400	3,122,400	

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27年2月27日現在

(単位:円)

資産総額	1,298,039,640
負債総額	33,453,866
純資産総額(-)	1,264,585,774
発行済口数	1,102,973,302 口
1口当たり純資産価額(/)	1.1465 (1万口当たり 11,465)

<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27年2月27日現在

(単位:円)

資産総額	2,855,689,573
負債総額	1,316,271,682
純資産総額(-)	1,539,417,891
発行済口数	1,168,816,554 口
1口当たり純資産価額(/)	1.3171 (1万口当たり 13,171)

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

<更新後>

平成27年2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【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27年2月27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	529	7,330,036
追加型公社債投資信託	18	895,139
単位型株式投資信託	27	437,472
単位型公社債投資信託	5	187,401
合計	579	8,850,048

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29期事業年度（自平成25年4月1日至平成26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30期事業年度に係る中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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29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30期中間会計期間 (平成26年9月30日現在)	
(資産の部)			
流動資産			
現金及び預金			31,370,051
有価証券			3,000,000
前払費用			258,701
未収入金			15,796
未収委託者報酬			7,923,271
未収収益			225,606
繰延税金資産			392,212
金銭の信託			30,000
その他			54,398
流動資産合計			43,270,038
固定資産			
有形固定資産			
建物	1		250,210
器具備品	1		186,996
土地			1,205,031
有形固定資産合計			1,642,238
無形固定資産			
電話加入権			15,822
ソフトウェア			1,092,868
ソフトウェア仮勘定			169,950
無形固定資産合計			1,278,641
投資その他の資産			
投資有価証券			21,524,909
関係会社株式			320,136
長期差入保証金			807,645
その他			15,035
投資その他の資産合計			22,667,726
固定資産合計			25,588,606
資産合計			68,858,645

(単位：千円)

第30期中間会計期間
(平成26年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		70,972
未払金		
未払収益分配金		87,713
未払償還金		902,004
未払手数料		3,402,471
その他未払金		157,192
未払費用		3,862,968
未払消費税等	2	491,404
未払法人税等		2,031,120
賞与引当金		569,627
その他		431,272
流動負債合計		12,006,746
固定負債		
退職給付引当金		164,100
役員退職慰労引当金		42,648
時効後支払損引当金		180,936
繰延税金負債		573,410
固定負債合計		961,095
負債合計		12,967,842
(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		44,080,146
利益剰余金合計		51,420,736
株主資本合計		53,642,963

(単位：千円)

第30期中間会計期間
(平成26年9月30日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券	2,247,838
評価差額金	
評価・換算差額等合計	2,247,838
純資産合計	55,890,802
負債純資産合計	68,858,645

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第30期中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	27,998,542
投資顧問料	344,009
その他営業収益	35,954
営業収益合計	28,378,506
営業費用	
支払手数料	11,811,245
広告宣伝費	252,822
公告費	159
調査費	
調査費	508,246
委託調査費	5,680,687
事務委託費	180,803
営業雑経費	
通信費	47,982
印刷費	249,444
協会費	18,745
諸会費	3,937
事務機器関連費	557,009
その他営業雑経費	13,783
営業費用合計	19,324,870
一般管理費	
給料	
役員報酬	106,776
給料・手当	1,651,106
賞与引当金繰入	569,627
福利厚生費	307,409
交際費	11,742
旅費交通費	73,065
租税公課	69,920
不動産賃借料	340,014
退職給付費用	65,265
役員退職慰労引当金繰入	15,609
固定資産減価償却費	1 247,581
諸経費	150,294
一般管理費合計	3,608,412
営業利益	5,445,223

(単位：千円)

第30期中間会計期間	
(自平成26年4月1日	
至平成26年9月30日)	
営業外収益	
受取配当金	175,572
有価証券利息	443
受取利息	7,838
投資有価証券償還益	8,854
収益分配金等時効完成分	39,308
時効後支払損引当金戻入益	35,205
その他	3,581
営業外収益合計	270,804
営業外費用	
事務過誤費	11,794
その他	917
営業外費用合計	12,712
経常利益	5,703,315
特別利益	
投資有価証券売却益	114,871
特別利益合計	114,871
特別損失	
投資有価証券売却損	11,429
特別損失合計	11,429
税引前中間純利益	5,806,758
法人税、住民税及び事業税	2,036,037
法人税等調整額	18,471
法人税等合計	2,054,508
中間純利益	3,752,249

(3)中間株主資本等変動計算書

第30期中間会計期間（自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日 ）

（単位：千円）

	株主資本							
	資本金	資本剰余金		利益 準備金	利益剰余金		利益剰余金 合計	株主資本合計
		資本 準備金	資本 剰余金 合計		その他利益剰余金			
					別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	43,710,993	51,051,583	53,273,811
会計方針の変更による累積的影響額						7,631	7,631	7,631
会計方針の変更を反映した当期首残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	43,703,362	51,043,952	53,266,179
当中間期変動額								
剰余金の配当						3,375,465	3,375,465	3,375,465
中間純利益						3,752,249	3,752,249	3,752,249
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）								
当中間期変動額合計						376,783	376,783	376,783
当中間期末残高	2,000,131	222,096	222,096	342,589	6,998,000	44,080,146	51,420,736	53,642,963

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,669,167	1,669,167	54,942,978
会計方針の変更による累積的影響額			7,631
会計方針の変更を反映した当期首残高	1,669,167	1,669,167	54,935,347
当中間期変動額			
剰余金の配当			3,375,465
中間純利益			3,752,249
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	578,670	578,670	578,670
当中間期変動額合計	578,670	578,670	955,454
当中間期末残高	2,247,838	2,247,838	55,890,802

[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。
退職給付見込額の期間帰属方法
退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。
数理計算上の差異の費用処理方法
数理計算上の差異は、その発生年度の翌事業年度より一括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、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

[会計方針の変更]

(退職給付に関する会計基準等の適用)

「退職給付に関する会計基準」（企業会計基準第26号 平成24年5月17日。以下「退職給付会計基準」という。）及び「退職給付に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第25号 平成24年5月17日。以下「退職給付適用指針」という。）を、退職給付会計基準第35項本文及び退職給付適用指針第67項本文に掲げた定めについて当中間会計期間より適用し、退職給付債務及び勤務費用の計算方法を見直し、退職給付見込額の期間帰属方法を期間定額基準から給付算定式基準へ変更するとともに、割引率の決定方法を退職給付の支払見込期間及び支払見込期間ごとの金額を反映した単一の加重平均割引率を使用する方法へ変更しております。

退職給付会計基準等の適用については、退職給付会計基準第37項に定める経過的な取扱いに従って、当中間会計期間の期首において、退職給付債務及び勤務費用の計算方法の変更に伴う影響額を繰越利益剰余金に加減しております。

この結果、当中間会計期間の期首の繰延税金資産は4,225千円増加し、退職給付引当金は11,857千円増加し、繰越利益剰余金は7,631千円減少しております。また、当中間会計期間の営業利益、経常利益及び税引前中間純利益はそれぞれ1,853千円増加しております。

なお、当中間会計期間の1株当たり純資産額は51.88円減少し、1株当たり中間純利益金額は、9.61円増加しております。

[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30期中間会計期間 (平成26年9月30日現在)
建物	269,353千円
器具備品	401,909千円

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30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
有形固定資産	38,738千円
無形固定資産	208,843千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

第30期中間会計期間(自平成26年4月1日至平成26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26年6月27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	3,375,465千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	27,200円
基準日	平成26年3月31日
効力発生日	平成26年6月30日

(金融商品関係)

第30期中間会計期間(平成26年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

平成26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	31,370,051	31,370,051	-
(2) 有価証券	3,000,000	3,000,000	-
(3) 未収委託者報酬	7,923,271	7,923,271	-
(4) 投資有価証券	21,486,009	21,486,009	-
資産計	63,779,332	63,779,332	-
(1) 未払手数料	3,402,471	3,402,471	-
(2) 未払法人税等	2,031,120	2,031,120	-
負債計	5,433,591	5,433,591	-

(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、(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。

(2) 有価証券

譲渡性預金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、投資信託は基準価額によっております。

(4) 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、「(4) 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30期中間会計期間（平成26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	18,500,144	15,274,309	3,225,835
	小計	18,500,144	15,274,309	3,225,835
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	2,985,864	3,020,230	34,365
	小計	2,985,864	3,020,230	34,365
合計		21,486,009	18,294,539	3,191,469

（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30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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30期中間会計期間（自平成26年4月1日至平成26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30期中間会計期間 (平成26年9月30日現在)
1株当たり純資産額	450,376.33円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	55,890,802
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	55,890,802
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30期中間会計期間 (自平成26年4月1日 至平成26年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	30,236.17円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	3,752,249
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)	3,752,249
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**

<更新後>

(略)

資本金の額：324,279百万円(平成26年9月末現在)

(略)

(2) 販売会社

<更新後>

名称	資本金の額 (平成26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】

<更新後>

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27年2月末現在)

(略)

独立監査人の監査報告書

平成27年4月1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 和田 渉 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26年8月26日から平成27年2月24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27年2月24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、XBRLデータは監査の対象に含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成26年12月9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	樋口 誠之	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26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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26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26年4月1日から平成26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。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。