

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年 5 月23日
【計算期間】	第22期（自 平成28年 8 月25日 至 平成29年 2 月24日）
【ファンド名】	日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当ありません

（注）この有価証券報告書は、金融商品取引法（昭和23年法律第25号）第7条第4項の規定により、平成28年11月22日付をもって提出した有価証券届出書の訂正届出書とみなされます。

有価証券報告書

第一部【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】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

信託金の限度額は、300億円です。

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。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券	MRF	
追加型	内外	不動産投信	ETF	特殊型 (絶対収益追求型)
		その他資産 ()		
		資産複合		

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	為替 ヘッジ	対象 インデックス	特殊型
株式	年1回	グローバル	ファミリー	あり	日経225	ブル・ベア型
一般	年2回	日本	ファンド	()		
大型株	年4回	北米	ファンド・	なし	TOPIX	条件付運用型
中小型株	年6回	欧州				
債券	(隔月)	アジア	オブ・		その他	絶対収益
一般	年12回	オセアニア	ファンズ		()	追求型
公債	(毎月)	中南米				
社債	日々	アフリカ				その他
その他債券	その他	中近東				()
クレジット	()	(中東)				
属性		エマージング				
()						
不動産投信						
その他資産						
(投資信託証券						
(株式 一般))						
資産複合						
()						

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「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）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

投資対象 資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（BBB格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（BB格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信	信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
資産複合	信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。		
決算頻度	年1回	信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回（毎月）	信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	

投資対象地域	グローバル	信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	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。
為替ヘッジ	あり	信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	TOPIX	信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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。

[ファンドの目的・特色]

ファンドの目的

わが国の株式を実質的な主要投資対象とし、合わせて株式の信用取引等を活用することにより、わが国の株式市場全体の上昇・下落に左右されない安定的な収益の確保をめざします。

ファンドの特色

特色
1

わが国の株式市場全体の上昇・下落に左右されない安定的な収益の確保をめざします。

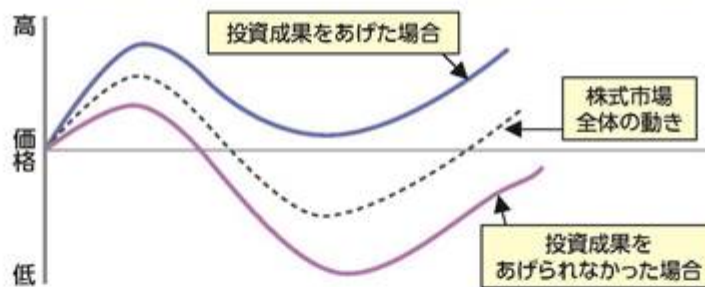
- 株式市場全体の上昇・下落の影響を抑えるためにマーケットニュートラル(市場中立)戦略が採られています。



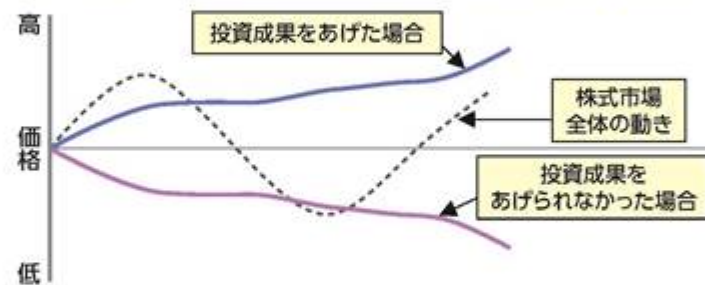
マーケットニュートラル戦略とは

株式の個別銘柄の「買付け」と「売建て」を組み合わせることにより、株式市場全体の騰落の影響を低減しながら、収益獲得をめざす運用手法です。

一般的な株式アクティブファンドの価格の動き(イメージ)



マーケットニュートラル戦略を行うファンドの価格の動き(イメージ)



❗ 上図は運用戦略の概念を表すイメージ図であり、将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

特色
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>)をご覧ください。

特色3

無担保コール翌日物レートをベンチマークとします。

- ❑ 無担保コール翌日物レートとは、金融機関同士が短期資金の貸借を行うコール市場において、翌日返済とした無担保取引の際の金利をいいます。
- ❑ ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

■ファンドの仕組み

運用は主に日本株マーケットニュートラル・マザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



■主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

■分配方針

- 年2回の決算時(2・8月の各24日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

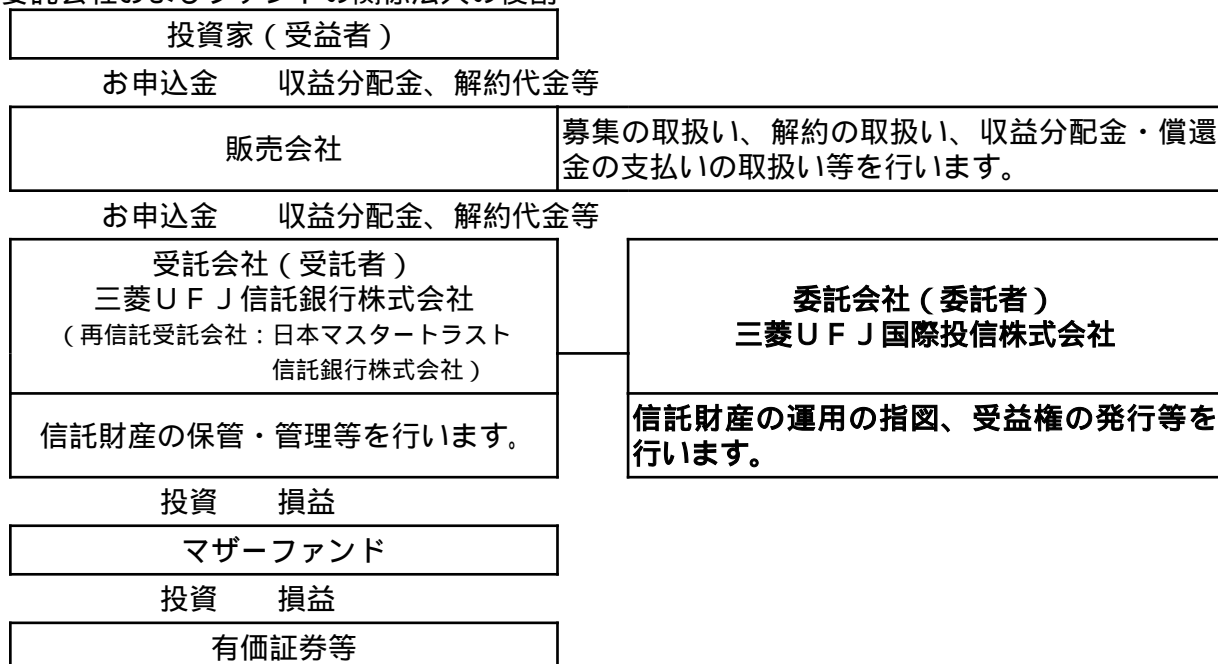
市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

平成17年12月16日 設定日、信託契約締結、運用開始

(3) 【ファンドの仕組み】

委託会社およびファンドの関係法人の役割



委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。
委託会社と販売会社との契約 「募集・販売の取扱い等に関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。

委託会社の概況

- ・資本金
2,000百万円（平成29年3月末現在）
- ・沿革
 - 平成9年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
 - 平成16年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
 - 平成17年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
 - 平成27年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・大株主の状況（平成29年3月末現在）

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	107,855株	51.0%
三菱UFJ証券ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内二丁目5番2号	71,969株	34.0%
株式会社三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区丸の内二丁目7番1号	31,757株	15.0%

2 【投資方針】

（１）【投資方針】

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、わが国の株式に直接投資することがあります。組入比率は高位を維持することを基本とします。無担保コール翌日物レートをベンチマークとします。
なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

- １．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第２条第１項で定めるものをいいます。以下同じ。）
 - イ．有価証券
 - ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第２条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）
 - ａ．有価証券先物取引等
 - ｂ．スワップ取引
 - ハ．約束手形
- 二．金銭債権
- ２．次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ．為替手形

有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする日本株マーケットニュートラル・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。なお、当該有価証券は本邦通貨表示のものに限ります。

- １．株券または新株引受権証書
- ２．国債証券
- ３．地方債証券
- ４．特別の法律により法人の発行する債券
- ５．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）
- ６．資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第２条第１項第４号で定めるものをいいます。）
- ７．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第２条第１項第６号で定めるものをいいます。）
- ８．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第２条第１項第７号で定めるものをいいます。）
- ９．資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第２条第１項第８号で定めるものをいいます。）
- １０．資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第13号で定めるものをいいます。）
- １１．コマーシャル・ペーパー
- １２．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券
- １３．外国または外国の者の発行する証券または証書で、１．から12．の証券または証書の性質を有するもの
- １４．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第10号で定めるものをいいます。）
- 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
- １６．投資法人債券（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。以下16．において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

17. 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
 18. オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。)
 19. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
 20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
 21. 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。)
 22. 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 24. 外国の者に対する権利で23.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書ならびに13.および19.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに16.の証券ならびに13.および19.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。)
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

<日本株マーケットニュートラル・マザーファンドの概要>

(基本方針)

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

(運用方法)

投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

投資態度

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な投資尺度により株式への投資を行います。同時に株式の信用取引等を活用することにより株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、安定した収益の確保をめざして運用を行います。

無担保コール翌日物レートをベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。

なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

(投資制限)

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

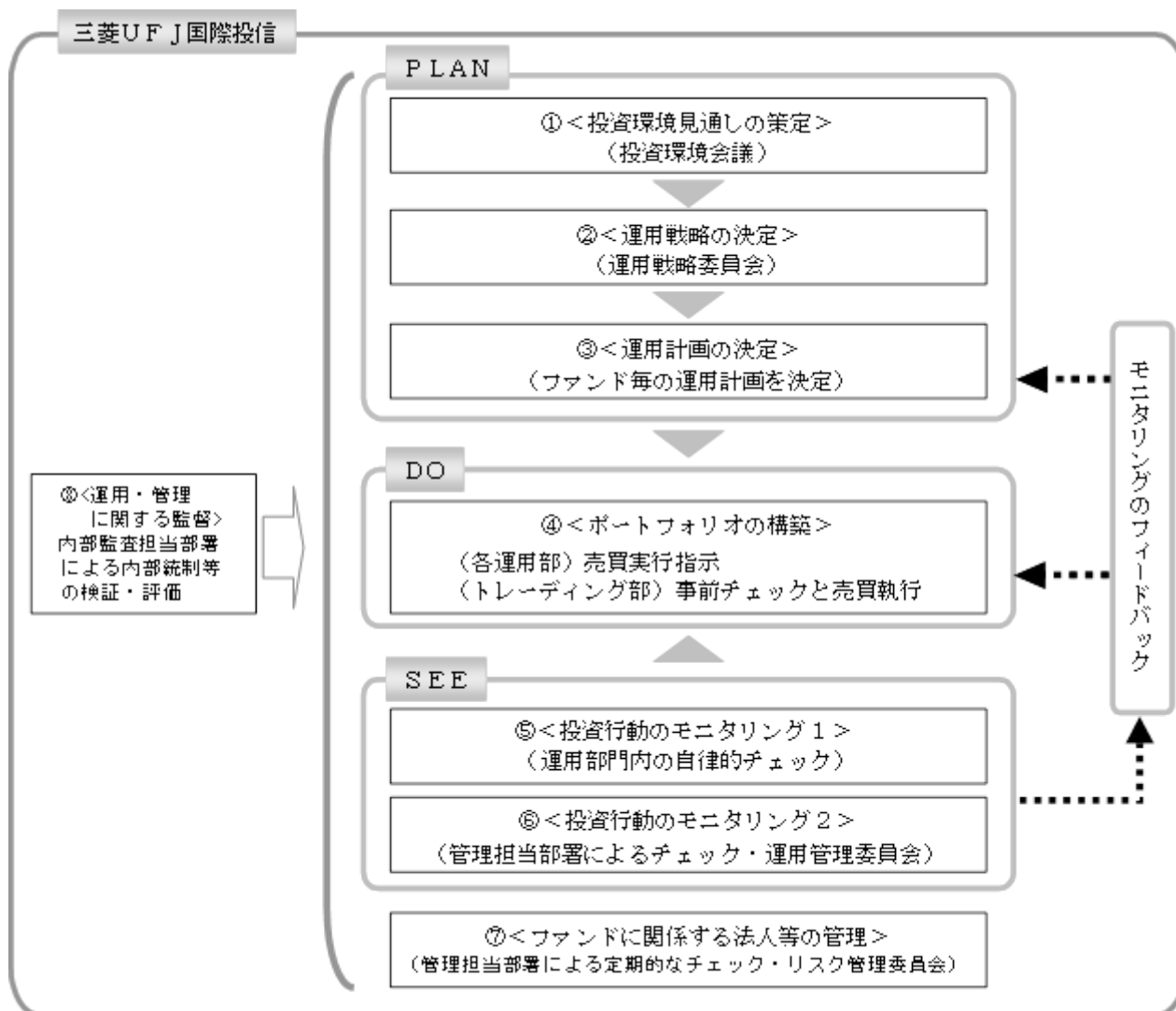
同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

外貨建資産への投資は行いません。

有価証券先物取引等を行うことができます。

スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

(3) 【運用体制】

**投資環境見通しの策定**

投資環境会議において、国内外の経済・金融情報および各国証券市場等の調査・分析に基づいた投資環境見通しを策定します。

運用戦略の決定

運用戦略委員会において、で策定された投資環境見通しに沿って運用戦略を決定します。

運用計画の決定

で決定された運用戦略に基づいて、各運用部はファンド毎の運用計画を決定します。

ポートフォリオの構築

各運用部の担当ファンドマネジャーは、運用部門から独立したトレーディング部に売買実行の指示をします。トレーディング部は、事前のチェックを行ったうえで、最良執行をめざして売買の執行を行います。

投資行動のモニタリング1

運用部門は、投資行動がファンドコンセプトおよびファンド毎に定めた運用計画に沿っているかどうかの自律的なチェックを行い、逸脱がある場合は速やかな是正を指示します。

投資行動のモニタリング2

運用部門から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。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、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

運用・管理に関する監督

内部監査担当部署(10名程度)は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

さらに、委託会社は、三菱UFJ信託銀行からの投資環境および全資産に関する助言を活用して、質の高い運用サービスの提供に努めています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

(4)【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

(5)【投資制限】

<信託約款に定められた投資制限>

外貨建資産

外貨建資産への投資は行いません。

新株引受権証券および新株予約権証券

a. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

投資信託証券

a. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の株式等

a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

b. a.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

c. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

d. c.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

同一銘柄の転換社債等

a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債(新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社

債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。)の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとし、ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内である場合においてできます。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により b. の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債

権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。

- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または の規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

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な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。

信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

<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、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、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】

(1) 投資リスク

当ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

当ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。このため、お申込みの際は、当ファンドのリスクを認識・検討し、慎重に投資のご判断を行っていただく必要があります。

価格変動リスク

一般に、株式の価格は個々の企業の活動や業績、市場・経済の状況等を反映して変動するため、当ファンドはその影響を受け株式の価格が下落した場合には基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

「マーケットニュートラル戦略について」

当ファンドは、実質的にわが国の株式に投資する（ロング・ポジション）とともに、信用取引を用いた株式の売建て（ショート・ポジション）を活用し株式市場全体の変動の影響を抑えることをめざすマーケットニュートラル戦略をとっていますので、株式市場全体の上昇が必ずしも収益の要因となるわけではありません。そのため、ロング・ポジションの利益がショート・ポジションの損失より小さい場合、あるいはロング・ポジションの損失がショート・ポジションの利益より大きい場合には損失が発生し、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。特に、ロング・ポジションの株価が下落する一方、ショート・ポジションの株価が上昇した場合には、基準価額が大幅に下落することがあります。

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

有価証券等を売却あるいは取得しようとする際に、市場に十分な需要や供給がない場合や取引規制等により十分な流動性の下での取引を行えない、または取引が不可能となるリスクのことを流動性リスクといい、当ファンドはそのリスクを伴います。例えば、組み入れている株式の売却を十分な流動性の下で行えないときは、市場実勢から期待される価格で売却できない可能性があります。この場合、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

留意事項

- ・当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリングオフ）の適用はありません。
- ・収益分配金の水準は、必ずしも計算期間における当ファンドの収益の水準を示すものではありません。収益分配は、計算期間に生じた収益を超えて行われる場合があります。投資者の購入価額によっては、収益分配金の一部または全部が、実質的な元本の一部払戻しに相当する場合があります。当ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- ・当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- ・当ファンドは、実質的にわが国の株式に投資するとともに、信用取引を用いて株式を売り建てることによりマーケットリスクを極力回避しますが、ロング・ポジションとショート・ポジションの価格変動の差異、逆日歩の発生その他の事情が生じた場合にはマーケットリスクを完全に回避できないことがあります。

（２）投資リスクに対する管理体制

「投資リスク」を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内で運用を行うこと、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うこと、を基本の考え方として、投資リスクの管理体制を構築しています。

また、定期的に関催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。

各投資リスクに関する管理体制は以下の通りです。

価格変動リスク

価格変動リスクは、運用部門において、資産構成比率に関する事項や、その他のファンドのリスク特性に関する事項を主な対象項目として常時把握し、ファンドコンセプトに沿ったリスクの範囲でコントロールしています。

また、価格変動リスクは、運用部門から独立した管理担当部署によってリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行う体制をとっており、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

信用リスク

信用リスクについては、運用部門においてリスクの把握、ファンド毎に定められたリスクの範囲での運用、を行っているほか、運用部門から独立した管理担当部署でモニタリングを行うなど、価格変動リスクと同様の管理体制をとっています。

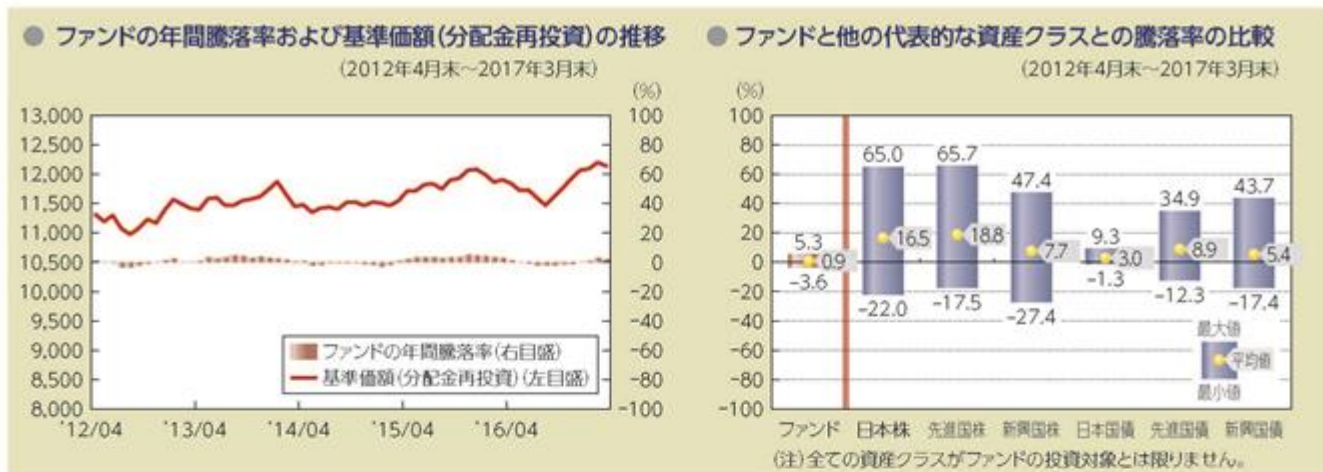
信用リスクは、財務・格付基準に関する事項や、分散投資に関する事項などを主な対象項目として管理していますが、格付等の外形的基準にとどまらず、発行体情報の収集と詳細な分析を行うよう努めています。

流動性リスク

流動性リスクは、運用部門で市場の流動性の把握に努め、投資対象・売買数量等を適切に選択することによりコントロールしています。また、運用部門から独立した管理担当部署においても流動性についての情報収集や分析・管理を行い、この結果は運用管理委員会等に報告されます。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、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。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- 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。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

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、野村証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)は野村証券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村証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】

(1)【申込手数料】

申込手数料はかかりません。

(2)【換金（解約）手数料】

解約手数料はかかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.2%）が差し引かれます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

(3)【信託報酬等】

委託会社および受託会社の信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、以下により計算されます。

信託財産の純資産総額 × 年1.134%（税抜 年1.05%）

1万口当たりの信託報酬：保有期間中の平均基準価額 × 信託報酬率 ×（保有日数 / 365）

上記の計算方法は簡便法であるため、算出された値は概算値になります。

委託会社は、信託報酬から、販売会社に対し、販売会社の行う業務に対する報酬を支払います。したがって、実質的な信託報酬の配分は、次の通りとなります。

委託会社	販売会社	受託会社
年0.972% (税抜 年0.9%)	年0.054% (税抜 年0.05%)	年0.108% (税抜 年0.1%)

信託報酬は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

消費税および地方消費税に相当する金額（「消費税等相当額」といいます。）を含みます。なお、消費税率に応じて変更となることがあります。

(4)【その他の手数料等】

信託財産に係る監査報酬および当該監査報酬に係る消費税等相当額は、毎計算期末または信託終了のときに信託財産から支払われます。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立て替えた立替金の利息、借入金の利息および借入れに係る品借料は、受益者の負担として信託財産から支払われます。

上記の信託事務の処理に要する諸費用には、有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等が含まれます。

(*)「その他の手数料等」については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

ご投資家のみなさまにご負担いただく手数料等の合計額については、お申込金額や保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。なお、当ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

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、交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、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】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個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譲渡益については、次の通り課税されます。

１．収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（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

解約価額および償還価額から取得費（申込手数料（税込）を含みます。）を控除した利益（譲渡益）が譲渡所得とみなされて課税されます。

20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます。

特定口座（源泉徴収選択口座）を利用する場合、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収され、原則として、申告は不要です。

解約時および償還時の損失（譲渡損）については、確定申告により収益分配金を含む上場株式等の配当所得（申告分離課税を選択した収益分配金・配当金に限ります。）との損益通算が可能となる仕組みがあります。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

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15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料（税込）は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

受益者が同一ファンドの受益権を複数回取得した場合、個別元本は、当該受益者が追加信託を行うつど当該受益者の受益権口数で加重平均することにより算出されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。

受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

収益分配金について

受益者が収益分配金を受け取る際、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本と同額の場合または当該受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となり、当該収益分配金落ち後の基準価額が当該受益者の個別元本を下回っている場合には、その下回る部分の額が元本払戻金（特別分配金）となり、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。

なお、受益者が元本払戻金（特別分配金）を受け取った場合、収益分配金発生時にその個別元本から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が、その後の当該受益者の個別元本となります。

上記は平成29年3月末現在のもので、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。

課税上の取扱いの詳細については、税務専門家等にご確認されることをお勧めします。

5【運用状況】

(1)【投資状況】

平成29年3月31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	2,909,979,292	99.75
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		7,282,905	0.25
純資産総額		2,917,262,197	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29年3月31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(%)	投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	償還期限 (年/月/日)	
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		2,042,807,506	1.4295 1.4245	2,920,375,860 2,909,979,292		99.75

(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29年3月31日現在

種類/業種別	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.75
合計	99.75

(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29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)
第19計算期間末日 (平成27年 8月24日)	1,052,390,950 (分配付) 1,052,390,950 (分配落)	11,816 (分配付) 11,816 (分配落)
第20計算期間末日 (平成28年 2月24日)	2,393,560,606 (分配付) 2,393,560,606 (分配落)	11,855 (分配付) 11,855 (分配落)
第21計算期間末日 (平成28年 8月24日)	2,789,414,112 (分配付) 2,789,414,112 (分配落)	11,478 (分配付) 11,478 (分配落)
第22計算期間末日 (平成29年 2月24日)	2,914,372,319 (分配付) 2,914,372,319 (分配落)	12,200 (分配付) 12,200 (分配落)
平成28年 3月末日	2,608,656,769	11,904
4月末日	2,777,398,099	11,843
5月末日	2,876,803,913	11,721
6月末日	2,928,127,941	11,732
7月末日	2,837,169,874	11,596
8月末日	2,811,384,045	11,470
9月末日	2,907,270,581	11,625
10月末日	2,931,574,538	11,768
11月末日	2,920,120,015	11,930
12月末日	2,841,033,948	12,069
平成29年 1月末日	2,869,084,534	12,092
2月末日	2,920,408,267	12,200
3月末日	2,917,262,197	12,141

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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
第19計算期間	0円
第20計算期間	0円
第21計算期間	0円
第22計算期間	0円

【収益率の推移】

	収益率（％）
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
第19計算期間	2.71
第20計算期間	0.33
第21計算期間	3.18
第22計算期間	6.29

（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（分配落の額）を控除した額を当該基準価額（分配落の額）で除して得た数に100を乗じて得た数をいう。

（４）【設定及び解約の実績】

	設定口数	解約口数	発行済口数
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
第19計算期間	601,429,705	841,262,648	890,655,004
第20計算期間	1,322,457,715	194,158,131	2,018,954,588
第21計算期間	687,026,995	275,786,436	2,430,195,147
第22計算期間	382,688,008	424,127,812	2,388,755,343

< 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29年3月31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	3,353,230,400	81.59
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		756,561,717	18.41
純資産総額		4,109,792,117	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29年3月31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	ウィルグループ	株式	サービス業
日本	ジェイエイシーリクルート メント	株式	サービス業	8,000	1,585.00 1,816.00	12,680,000 14,528,000		0.35
日本	ワールドホールディングス	株式	サービス業	6,000	2,040.00 2,330.00	12,240,000 13,980,000		0.34
日本	トラスト・テック	株式	サービス業	7,000	1,791.30 1,948.00	12,539,100 13,636,000		0.33
日本	富士通	株式	電気機器	20,000	655.80 680.90	13,116,000 13,618,000		0.33
日本	メディカルシステムネット ワーク	株式	小売業	25,000	450.00 540.00	11,250,000 13,500,000		0.33
日本	スカラ	株式	情報・通信業	15,000	844.00 888.00	12,660,000 13,320,000		0.32
日本	ラウンドワン	株式	サービス業	15,000	849.00 885.00	12,735,000 13,275,000		0.32
日本	トランザクション	株式	その他製品	12,000	1,014.00 1,106.00	12,168,000 13,272,000		0.32
日本	アウトソーシング	株式	サービス業	3,000	3,764.50 4,420.00	11,293,500 13,260,000		0.32
日本	G C A	株式	サービス業	14,000	970.00 946.00	13,580,000 13,244,000		0.32
日本	しまむら	株式	小売業	900	14,597.50 14,710.00	13,137,750 13,239,000		0.32
日本	シーズ・ホールディングス	株式	化学	4,000	3,250.00 3,305.00	13,000,000 13,220,000		0.32
日本	三洋貿易	株式	卸売業	7,500	1,798.00 1,757.00	13,485,000 13,177,500		0.32
日本	ゲンキー	株式	小売業	1,900	6,495.00 6,880.00	12,340,500 13,072,000		0.32
日本	J V C ケンウッド	株式	電気機器	45,000	288.20 290.00	12,969,000 13,050,000		0.32
日本	イオン	株式	小売業	8,000	1,666.00 1,625.00	13,328,000 13,000,000		0.32
日本	夢真ホールディングス	株式	サービス業	16,000	817.00 812.00	13,072,000 12,992,000		0.32
日本	三菱総合研究所	株式	情報・通信業	4,000	3,125.00 3,225.00	12,500,000 12,900,000		0.31
日本	文化シャッター	株式	金属製品	15,000	838.00 860.00	12,570,000 12,900,000		0.31
日本	ポーラ・オルビスホール ディングス	株式	化学	4,800	2,559.52 2,687.00	12,285,720 12,897,600		0.31
日本	L I T A L I C O	株式	サービス業	7,000	1,720.20 1,840.00	12,041,400 12,880,000		0.31
日本	住友電設	株式	建設業	10,000	1,268.00 1,280.00	12,680,000 12,800,000		0.31
日本	アイコム	株式	電気機器	5,000	2,579.40 2,559.00	12,897,000 12,795,000		0.31
日本	東鉄工業	株式	建設業	4,000	3,075.00 3,195.00	12,300,000 12,780,000		0.31
日本	スズケン	株式	卸売業	3,500	3,800.00 3,650.00	13,300,000 12,775,000		0.31
日本	ノジマ	株式	小売業	9,000	1,440.00 1,418.00	12,960,000 12,762,000		0.31

日本	ユニデンホールディングス	株式	電気機器	70,000	167.00 182.00	11,690,000 12,740,000		0.31
日本	巴工業	株式	機械	7,000	1,904.35 1,818.00	13,330,500 12,726,000		0.31
日本	東計電算	株式	情報・通信業	5,500	2,230.00 2,311.00	12,265,000 12,710,500		0.31

(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29年3月31日現在

種類 / 業種別		投資比率 (%)
株式	水産・農林業	0.56
	鉱業	1.14
	建設業	5.14
	食料品	3.74
	繊維製品	0.77
	パルプ・紙	0.28
	化学	7.84
	医薬品	2.31
	石油・石炭製品	0.29
	ガラス・土石製品	0.96
	鉄鋼	2.12
	非鉄金属	1.45
	金属製品	1.81
	機械	5.62
	電気機器	7.30
	輸送用機器	3.83
	精密機器	1.01
	その他製品	2.97
	陸運業	2.51
	倉庫・運輸関連業	0.56
	情報・通信業	4.37
	卸売業	6.62
	小売業	8.43
不動産業	2.67	
サービス業	7.30	
合計	81.59	

(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。

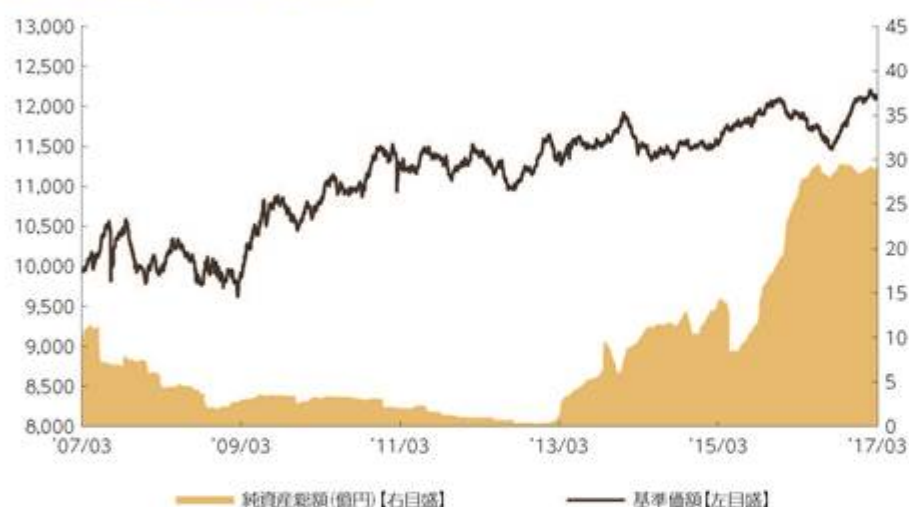
[参考情報]



運用実績

2017年3月31日現在

■基準価額・純資産の推移 2007年3月30日～2017年3月31日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	12,141円
純資産総額	29.1億円

■分配の推移

2017年 2月	0円
2016年 8月	0円
2016年 2月	0円
2015年 8月	0円
2015年 2月	0円
2014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

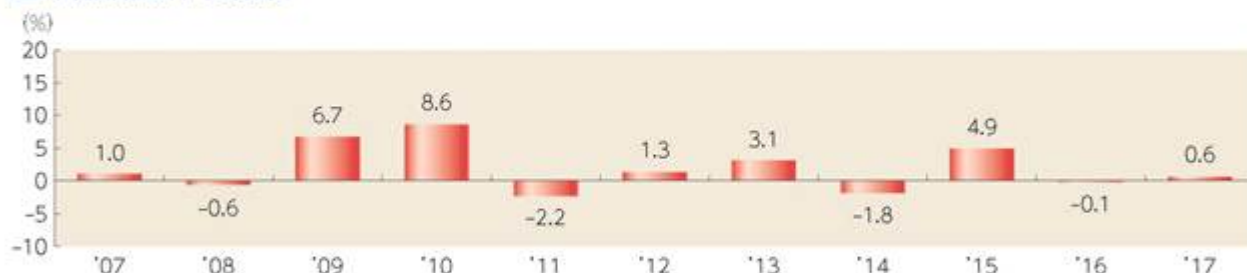
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位銘柄	業種	比率
国内株式現物	81.4%	1 ウィルグループ	サービス業	0.4%
国内株式信用売	-81.0%	2 ジェイエイシーリクルートメント	サービス業	0.4%
		3 ワールドホールディングス	サービス業	0.3%
		4 トラスト・テック	サービス業	0.3%
		5 富士通	電気機器	0.3%
		6 メディカルシステムネットワーク	小売業	0.3%
		7 スカラ	情報・通信業	0.3%
		8 ラウンドワン	サービス業	0.3%
		9 トランザクション	その他製品	0.3%
株式(実質)	0.4%	10 アウトソーシング	サービス業	0.3%

●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)

●国内株式の業種は、東京証券取引所の33業種分類によるもの

■年間収益率の推移



●収益率は基準価額で計算

●2017年は年初から3月31日までの収益率を表示

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。
運用状況等は、委託会社のホームページ等で開示している場合があります。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

申込みの受付	原則として、いつでも申込みができます。
申込単位	販売会社が定める単位
申込価額	申込受付日の翌営業日の基準価額
申込価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
申込単位・申込価額の照会方法	申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。 ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
申込手数料	ありません。
申込方法	取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。 取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。 なお、申込みには分配金受取りコース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があり、分配金再投資コース（累積投資コース）を選択する場合には、取得申込者と販売会社との間で別に定める累積投資契約（販売会社によっては別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約を使用する場合があります、この場合は当該別の名称に読み替えます。）を締結するものとします。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合がありますので、販売会社にご確認ください。 取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。
申込受付時間	原則、午後3時までに受け付けた取得申込み（当該申込みの受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを）を当日の申込みとします。当該時刻を過ぎての申込みは、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に取得申込みを締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みを取り消すことがあります。 1日1件当たり5億円を超える取得申込みを受け付けない場合があります。

2【換金（解約）手続等】

解約の受付	原則として、いつでも解約の請求ができます。
解約単位	販売会社が定める単位
解約価額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 - 信託財産留保額
信託財産留保額	解約請求受付日の翌営業日の基準価額 × 0.2%
解約価額の算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
解約価額の照会方法	解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/
支払開始日	原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

解約請求 受付時間	原則、午後3時までに受け付けた解約請求(当該解約請求の受付に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを)を当日の請求とします。当該時刻を過ぎての請求は、翌営業日に受け付けたものとして取り扱います。なお、販売会社によっては、上記より早い時刻に解約請求を締め切ることとしている場合があります。詳しくは販売会社にご確認ください。
その他	委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。 信託財産の資金管理を円滑に行うため、1日1件当たり5億円を超える解約請求を受け付けない場合があります。 委託会社は、信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口の解約請求に制限を設ける場合があります。 受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

換金の詳細については販売会社にご確認ください。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額の 算出方法	基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数 なお、当ファンドでは1万口当たりの価額で表示されます。 (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。)を法令および一般社団法人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。 (主な評価方法) マザーファンド：計算日における基準価額で評価します。 株式：原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場で評価します。 公社債等：原則として、日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)、第一種金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。
基準価額の 算出頻度	原則として、委託会社の毎営業日に計算されます。
基準価額の 照会方法	基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。 また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。 なお、下記においてもご照会いただけます。 三菱UFJ国際投信株式会社 お客様専用フリーダイヤル 0120-151034 (受付時間：毎営業日の9:00～17:00) ホームページアドレス http://www.am.mufg.jp/

(2)【保管】

受益証券の 保管	該当事項はありません。
-------------	-------------

(3)【信託期間】

信託期間	平成17年12月16日から無期限 ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。
------	--

(4) 【計算期間】

計算期間	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 上記にかかわらず、各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は、この該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとし、ただし、最終計算期間の終了日はファンドの信託期間終了日とします。
------	---

(5) 【その他】

ファンドの償還条件等	委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。（任意償還） ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合 ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。 委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。
信託約款の変更	委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。
ファンドの償還等に関する開示方法	委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。
異議申立ておよび反対者の買取請求権	受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間（1ヵ月以上）内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します（ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。）。
関係法人との契約の更改	委託会社と販売会社との間で締結された「募集・販売の取扱い等に関する契約」の期間は、契約締結日から1ヵ年とし、期間満了3ヵ月前までに相手方に対し、何らの意思表示のないときは、同一の条件で契約を更新するものとし、その後も同様とします。
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。
委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い	委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

受託会社の辞任および解任に伴う取扱い	受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。
信託事務処理の再信託	受託会社は、ファンドの信託事務の処理の一部について日本マスタートラスト信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託します。日本マスタートラスト信託銀行株式会社は、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。
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】

受益者の権利の主な内容は以下の通りです。

収益分配金に対する請求権	<p>受益者は、委託会社の決定した収益分配金を持分にに応じて請求する権利を有します。</p> <p>「分配金受取りコース（一般コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> ・収益分配金は、原則として決算日から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。 <p>「分配金再投資コース（累積投資コース）」</p> <ul style="list-style-type: none"> ・収益分配金は、課税後、原則として毎計算期間の終了日（決算日）の翌営業日に、累積投資契約に基づいて再投資されます。再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。詳しくは販売会社にご確認ください。
償還金に対する請求権	<p>受益者は、持分にに応じて償還金を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・償還金は、原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに支払いを開始します。 ・償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 ・受益者が、信託終了による償還金について支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失います。
換金（解約）請求権	<p>受益者は、自己に帰属する受益権につき、解約を請求する権利を有します。</p> <ul style="list-style-type: none"> ・解約代金の支払いは、販売会社の営業所等において行います。 <p>（「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。）</p>

第3【ファンドの経理状況】

- 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 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成28年8月25日から平成29年2月24日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任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 21 期 [平成28年8月24日現在]	第 22 期 [平成29年2月24日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	27,377,776	28,396,055
親投資信託受益証券	2,782,602,166	2,906,010,862
未収入金	2,882,260	5,187,462
流動資産合計	2,812,862,202	2,939,594,379
資産合計	2,812,862,202	2,939,594,379
負債の部		
流動負債		
未払解約金	7,820,665	8,677,408
未払受託者報酬	1,484,659	1,571,800
未払委託者報酬	14,104,187	14,932,020
未払利息	39	29
その他未払費用	38,540	40,803
流動負債合計	23,448,090	25,222,060
負債合計	23,448,090	25,222,060
純資産の部		
元本等		
元本	1 2,430,195,147	1 2,388,755,343
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	359,218,965	525,616,976
（分配準備積立金）	25,883,562	88,761,687
元本等合計	2,789,414,112	2,914,372,319
純資産合計	2,789,414,112	2,914,372,319
負債純資産合計	2,812,862,202	2,939,594,379

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第 21 期 自 平成28年 2月25日 至 平成28年 8月24日	第 22 期 自 平成28年 8月25日 至 平成29年 2月24日
営業収益		
受取利息	57	149
有価証券売買等損益	77,595,120	192,923,361
営業収益合計	77,595,063	192,923,510
営業費用		
支払利息	4,221	4,639
受託者報酬	1,484,659	1,571,800
委託者報酬	14,104,187	14,932,020
その他費用	38,554	40,803
営業費用合計	15,631,621	16,549,262
営業利益又は営業損失()	93,226,684	176,374,248
経常利益又は経常損失()	93,226,684	176,374,248
当期純利益又は当期純損失()	93,226,684	176,374,248
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()	3,853,477	17,445,524
期首剰余金又は期首欠損金()	374,606,018	359,218,965
剰余金増加額又は欠損金減少額	124,555,091	70,670,312
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	124,555,091	70,670,312
剰余金減少額又は欠損金増加額	50,568,937	63,201,025
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	50,568,937	63,201,025
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金()	359,218,965	525,616,976

(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。
-------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

	第 21 期 [平成28年8月24日現在]	第 22 期 [平成29年2月24日現在]
1 期首元本額	2,018,954,588円	2,430,195,147円
期中追加設定元本額	687,026,995円	382,688,008円
期中一部解約元本額	275,786,436円	424,127,812円
2 受益権の総数	2,430,195,147口	2,388,755,343口
3 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1478円 (11,478円)	1.2200円 (12,200円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第 21 期 (自 平成28年2月25日 至 平成28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	10,862,690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	598,244,877円
分配準備積立金額	D	15,020,872円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	624,128,439円
当ファンドの期末残存口数	F	2,430,195,147口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,568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 22 期 (自 平成28年8月25日 至 平成29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	22,358,680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	44,485,876円
収益調整金額	C	592,429,566円
分配準備積立金額	D	21,917,131円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	681,191,253円
当ファンドの期末残存口数	F	2,388,755,343口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	2,851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 21 期 (自 平成28年 2月25日 至 平成28年 8月24日)	第 22 期 (自 平成28年 8月25日 至 平成29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 21 期	第 22 期
	[平成28年8月24日現在]	[平成29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

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

種 類	第 21 期	第 22 期
	[平成28年8月24日現在]	[平成29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	74,170,385	182,692,570
合計	74,170,385	182,692,570

(デリバティブ取引に関する注記)

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	2,032,175,428	2,906,010,862	
	親投資信託受益証券 小計	2,032,175,428	2,906,010,862	
合計		2,032,175,428	2,906,010,862	

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。

「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28年8月24日現在]	[平成29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	885,604,827	867,171,191
株式 2	3,406,423,400	3,608,185,650
未収入金	731,906,342	
信用取引預け金	3,321,703,290	3,256,284,852
未収配当金	4,259,100	10,756,250
流動資産合計	8,349,896,959	7,742,397,943
資産合計	8,349,896,959	7,742,397,943
負債の部		
流動負債		
信用売証券	3,394,069,400	3,568,069,050
未払金	702,643,443	
未払解約金	2,931,571	6,821,429
未払利息	1,272	898
その他未払費用	5,518,472	9,131,728
流動負債合計	4,105,164,158	3,584,023,105
負債合計	4,105,164,158	3,584,023,105
純資産の部		
元本等		
元本 1	3,172,588,604	2,908,006,586
剰余金		
剰余金又は欠損金()	1,072,144,197	1,250,368,252
元本等合計	4,244,732,801	4,158,374,838
純資産合計	4,244,732,801	4,158,374,838
負債純資産合計	8,349,896,959	7,742,397,943

(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28年8月24日現在]	[平成29年2月24日現在]
1 期首	平成28年2月25日	平成28年8月25日
期首元本額	2,757,551,749円	3,172,588,604円
期首からの追加設定元本額	616,498,353円	153,925,974円
期首からの一部解約元本額	201,461,498円	418,507,992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)	2,079,828,213円	2,032,175,428円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	335,411,408円	266,534,182円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	684,578,257円	537,972,255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)	72,770,726円	71,324,721円
(合計)	3,172,588,604円	2,908,006,586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	2,091,767,900円	2,309,208,900円
3 受益権の総数	3,172,588,604口	2,908,006,586口
4 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3379円 (13,379円)	1.4300円 (14,300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28年 2月25日 至平成28年 8月24日）	（自平成28年 8月25日 至平成29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。	同 左
	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
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28年8月24日現在]	[平成29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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種 類	[平成28年8月24日現在]	[平成29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	100,666,278	251,132,500
信用売証券	118,524,717	305,822,006
合計	219,190,995	54,689,506

（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	
1333	マルハニチロ	4,000	3,340.00	13,360,000	
1515	日鉄鉱業	2,000	5,780.00	11,560,000	2,000株
1518	三井松島産業	8,000	1,554.00	12,432,000	8,000株
1605	国際石油開発帝石	11,000	1,147.00	12,617,000	7,000株
1662	石油資源開発	4,500	2,714.00	12,213,000	
1414	ショーボンドホールディングス	2,500	4,895.00	12,237,500	
1430	ファーストコーポレーション	9,000	929.00	8,361,000	
1720	東急建設	14,000	835.00	11,690,000	14,000株
1802	大林組	12,000	1,060.00	12,720,000	11,000株
1821	三井住友建設	100,000	125.00	12,500,000	100,000株
1835	東鉄工業	4,000	3,075.00	12,300,000	4,000株
1870	矢作建設工業	13,000	1,039.00	13,507,000	13,000株
1896	大林道路	18,000	689.00	12,402,000	18,000株
1898	世紀東急工業	24,000	513.00	12,312,000	24,000株
1899	福田組	11,000	1,040.00	11,440,000	

1916	日成ビルド工業	25,000	560.00	14,000,000	25,000株
1925	大和ハウス工業	2,000	3,134.00	6,268,000	
1928	積水ハウス	3,500	1,815.00	6,352,500	3,500株
1945	東京エネシス	13,000	965.00	12,545,000	13,000株
1949	住友電設	10,000	1,268.00	12,680,000	10,000株
1963	日揮	6,600	2,030.00	13,398,000	6,600株
1983	東芝プラントシステム	7,000	1,579.00	11,053,000	7,000株
6330	東洋エンジニアリング	45,000	271.00	12,195,000	40,000株
2109	三井製糖	5,000	2,731.00	13,655,000	5,000株
2212	山崎製パン	5,700	2,208.00	12,585,600	
2222	寿スピリッツ	4,500	2,643.00	11,893,500	4,500株
2264	森永乳業	15,000	864.00	12,960,000	15,000株
2270	雪印メグミルク	4,000	3,080.00	12,320,000	4,000株
2533	オエノンホールディングス	40,000	255.00	10,200,000	40,000株
2579	コカ・コーラウエスト	4,000	3,380.00	13,520,000	4,000株
2607	不二製油グループ本社	5,000	2,475.00	12,375,000	5,000株
2613	J-オイルミルズ	3,000	4,180.00	12,540,000	3,000株
2875	東洋水産	3,000	4,095.00	12,285,000	1,500株
2914	日本たばこ産業	3,500	3,805.00	13,317,500	3,500株
2915	ケンコーマヨネーズ	4,000	2,740.00	10,960,000	4,000株
2918	わらべや日洋ホールディングス	5,000	2,515.00	12,575,000	5,000株
3201	日本毛織	11,000	895.00	9,845,000	7,000株
3501	住江織物	45,000	290.00	13,050,000	45,000株
8114	デサント	10,000	1,321.00	13,210,000	
3861	王子ホールディングス	27,000	540.00	14,580,000	27,000株
3863	日本製紙	6,000	2,061.00	12,366,000	6,000株
3941	レンゴー	18,000	647.00	11,646,000	18,000株
3405	クラレ	7,500	1,727.00	12,952,500	7,500株
4008	住友精化	2,500	4,785.00	11,962,500	2,500株
4023	クレハ	2,500	4,810.00	12,025,000	
4064	日本カーバイド工業	80,000	160.00	12,800,000	80,000株
4092	日本化学工業	50,000	247.00	12,350,000	50,000株
4116	大日精化工業	18,000	713.00	12,834,000	18,000株
4118	カネカ	14,000	890.00	12,460,000	14,000株
4189	KHネオケム	9,000	1,356.00	12,204,000	
4208	宇部興産	50,000	284.00	14,200,000	50,000株
4218	ニチバン	13,000	990.00	12,870,000	
4220	リケンテクノス	20,000	536.00	10,720,000	20,000株
4228	積水化成成品工業	15,000	824.00	12,360,000	12,000株
4231	タイガースポリマー	15,000	798.00	11,970,000	15,000株
4401	ADEKA	8,000	1,570.00	12,560,000	
4410	ハリマ化成グループ	16,000	809.00	12,944,000	15,000株
4461	第一工業製薬	30,000	448.00	13,440,000	30,000株
4471	三洋化成工業	2,500	4,680.00	11,700,000	2,500株
4611	大日本塗料	50,000	232.00	11,600,000	50,000株
4917	マンダム	2,500	5,260.00	13,150,000	2,500株
4924	シーズ・ホールディングス	4,000	3,250.00	13,000,000	4,000株
5208	有沢製作所	16,000	805.00	12,880,000	16,000株
7908	きもと	50,000	245.00	12,250,000	50,000株
7917	藤森工業	4,300	2,996.00	12,882,800	4,300株
7988	ニフコ	2,000	5,760.00	11,520,000	
7995	日本バルカー工業	7,000	1,902.00	13,314,000	
4503	アステラス製薬	8,500	1,531.00	13,013,500	8,500株
4508	田辺三菱製薬	6,000	2,341.00	14,046,000	6,000株
4521	科研製薬	2,000	6,010.00	12,020,000	2,000株
4534	持田製薬	1,500	8,490.00	12,735,000	1,500株
4536	参天製薬	8,000	1,621.00	12,968,000	
4540	ツムラ	4,000	3,395.00	13,580,000	
4555	沢井製薬	2,000	6,090.00	12,180,000	2,000株
4568	第一三共	5,200	2,604.50	13,543,400	5,200株
4569	キョーリン製薬ホールディングス	4,500	2,371.00	10,669,500	4,500株
5002	昭和シェル石油	12,000	1,146.00	13,752,000	
5015	ビービー・カストロール	7,000	1,629.00	11,403,000	
5101	横浜ゴム	6,000	2,261.00	13,566,000	6,000株
5110	住友ゴム工業	7,000	1,855.00	12,985,000	7,000株
5186	ニッタ	4,000	3,070.00	12,280,000	
5201	旭硝子	14,000	927.00	12,978,000	
5202	日本板硝子	15,000	833.00	12,495,000	15,000株
5214	日本電気硝子	17,000	697.00	11,849,000	
5288	アジアパイルホールディングス	22,000	621.00	13,662,000	15,000株

5344	MARUWA	3,500	3,605.00	12,617,500	
5351	品川リフラクトリーズ	30,000	307.00	9,210,000	30,000株
5406	神戸製鋼所	12,000	1,108.00	13,296,000	11,000株
5410	合同製鐵	6,500	1,871.00	12,161,500	5,000株
5464	モリ工業	5,000	2,493.00	12,465,000	
5482	愛知製鋼	2,500	4,885.00	12,212,500	2,500株
5659	日本精線	17,000	613.00	10,421,000	14,000株
5711	三菱マテリアル	3,500	3,720.00	13,020,000	3,500株
5714	DOWAホールディングス	13,000	911.00	11,843,000	
5807	東京特殊電線	5,000	1,779.00	8,895,000	
5809	タツタ電線	30,000	458.00	13,740,000	30,000株
5819	カナレ電気	6,000	2,217.00	13,302,000	6,000株
5852	アーレスティ	10,000	1,194.00	11,940,000	10,000株
3434	アルファC o	10,000	1,384.00	13,840,000	10,000株
5901	東洋製罐グループホールディングス	6,000	2,049.00	12,294,000	6,000株
5930	文化シャッター	15,000	838.00	12,570,000	15,000株
5932	三協立山	7,000	1,700.00	11,900,000	6,000株
5957	日東精工	30,000	425.00	12,750,000	28,000株
5970	ジーテクト	4,000	2,152.00	8,608,000	4,000株
6013	タクマ	13,000	1,049.00	13,637,000	13,000株
6104	東芝機械	15,000	487.00	7,305,000	
6118	アイダエンジニアリング	11,000	1,002.00	11,022,000	11,000株
6134	富士機械製造	8,000	1,503.00	12,024,000	
6205	OKK	50,000	127.00	6,350,000	50,000株
6282	オイレス工業	6,000	2,102.00	12,612,000	6,000株
6284	日精エー・エス・ピー機械	5,000	2,374.00	11,870,000	5,000株
6339	新東工業	6,000	1,024.00	6,144,000	6,000株
6349	小森コーポレーション	9,000	1,500.00	13,500,000	9,000株
6358	酒井重工業	35,000	328.00	11,480,000	35,000株
6371	椿本チエイン	13,000	980.00	12,740,000	13,000株
6381	アネスト岩田	6,000	1,100.00	6,600,000	
6390	加藤製作所	4,500	2,868.00	12,906,000	4,500株
6406	フジテック	9,500	1,299.00	12,340,500	
6432	竹内製作所	5,000	2,264.00	11,320,000	5,000株
6458	新晃工業	8,000	1,465.00	11,720,000	
6459	大和冷機工業	12,000	1,062.00	12,744,000	12,000株
6473	ジェイテクト	7,000	1,915.00	13,405,000	7,000株
7011	三菱重工業	25,000	443.70	11,092,500	25,000株
4902	コニカミノルタ	11,500	1,090.00	12,535,000	10,500株
6448	ブラザー工業	6,500	2,119.00	13,773,500	6,500株
6501	日立製作所	20,000	633.00	12,660,000	20,000株
6504	富士電機	20,000	635.00	12,700,000	
6592	マブチモーター	2,000	6,110.00	12,220,000	2,000株
6624	田淵電機	35,000	366.00	12,810,000	
6670	MCJ	11,000	1,234.00	13,574,000	
6675	サクサホールディングス	55,000	239.00	13,145,000	55,000株
6701	日本電気	45,000	281.00	12,645,000	40,000株
6702	富士通	20,000	655.80	13,116,000	20,000株
6703	沖電気工業	8,000	1,613.00	12,904,000	8,000株
6740	ジャパンディスプレイ	40,000	278.00	11,120,000	40,000株
6755	富士通ゼネラル	6,000	2,222.00	13,332,000	5,000株
6768	タムラ製作所	30,000	454.00	13,620,000	30,000株
6794	フォスター電機	7,000	1,912.00	13,384,000	6,000株
6798	SMK	30,000	444.00	13,320,000	
6807	日本航空電子工業	5,000	1,566.00	7,830,000	
6814	古野電気	17,000	763.00	12,971,000	15,000株
6815	ユニデンホールディングス	70,000	167.00	11,690,000	70,000株
6817	スミダコーポレーション	5,000	1,327.00	6,635,000	5,000株
6841	横河電機	7,000	1,782.00	12,474,000	7,000株
6844	新電元工業	30,000	478.00	14,340,000	30,000株
6859	エスベック	10,000	1,363.00	13,630,000	10,000株
6915	千代田インテグレ	5,000	2,485.00	12,425,000	2,500株
6923	スタンレー電気	4,000	3,130.00	12,520,000	
6961	エンプラス	3,000	3,430.00	10,290,000	3,000株
6967	新光電気工業	16,000	805.00	12,880,000	16,000株
7276	小糸製作所	2,200	5,830.00	12,826,000	
7739	キヤノン電子	7,000	1,808.00	12,656,000	
7752	リコー	14,000	1,001.00	14,014,000	14,000株
6201	豊田自動織機	2,400	5,530.00	13,272,000	2,200株
7003	三井造船	70,000	186.00	13,020,000	70,000株

7012	川崎重工業	35,000	355.00	12,425,000	35,000株
7105	ニチユ三菱フォークリフト	17,000	709.00	12,053,000	17,000株
7201	日産自動車	7,000	1,112.00	7,784,000	7,000株
7212	エフテック	9,000	1,375.00	12,375,000	
7238	曙ブレーキ工業	40,000	292.00	11,680,000	40,000株
7261	マツダ	4,500	1,601.50	7,206,750	
7266	今仙電機製作所	12,000	1,012.00	12,144,000	10,000株
7270	富士重工業	2,000	4,276.00	8,552,000	
7272	ヤマハ発動機	5,300	2,606.00	13,811,800	5,300株
7274	ショーワ	13,000	944.00	12,272,000	13,000株
7283	愛三工業	12,000	975.00	11,700,000	12,000株
7294	ヨロズ	8,000	1,811.00	14,488,000	8,000株
7716	ナカニシ	3,000	4,425.00	13,275,000	
7731	ニコン	7,500	1,724.00	12,930,000	
7744	ノーリツ鋼機	12,000	965.00	11,580,000	
7817	パラマウントベッドホールディングス	3,000	4,265.00	12,795,000	
7818	トランザクション	12,000	1,014.00	12,168,000	
7820	ニホンフラッシュ	9,000	1,327.00	11,943,000	7,000株
7868	廣済堂	32,000	386.00	12,352,000	
7905	大建工業	6,000	2,199.00	13,194,000	6,000株
7911	凸版印刷	11,000	1,128.00	12,408,000	
7912	大日本印刷	10,000	1,218.00	12,180,000	10,000株
7936	アシックス	6,300	1,994.00	12,562,200	
7951	ヤマハ	4,300	2,926.00	12,581,800	
7966	リンテック	5,000	2,422.00	12,110,000	
7990	グロープライド	6,000	1,741.00	10,446,000	
8022	美津濃	22,000	596.00	13,112,000	
9003	相鉄ホールディングス	10,000	565.00	5,650,000	10,000株
9020	東日本旅客鉄道	1,200	10,200.00	12,240,000	1,200株
9021	西日本旅客鉄道	1,700	7,462.00	12,685,400	1,700株
9022	東海旅客鉄道	700	18,465.00	12,925,500	200株
9031	西日本鉄道	15,000	496.00	7,440,000	
9037	ハマキョウレックス	5,000	2,294.00	11,470,000	
9042	阪急阪神ホールディングス	3,300	3,745.00	12,358,500	
9062	日本通運	22,000	588.00	12,936,000	
9069	センコー	15,000	746.00	11,190,000	
9090	丸和運輸機関	5,000	2,536.00	12,680,000	
9302	三井倉庫ホールディングス	35,000	343.00	12,005,000	
9364	上組	12,000	1,071.00	12,852,000	
9370	郵船ロジスティクス	11,000	1,225.00	13,475,000	
1973	NECネットエスアイ	6,000	2,130.00	12,780,000	6,000株
3636	三菱総合研究所	4,000	3,125.00	12,500,000	4,000株
3751	日本アジアグループ	15,000	421.00	6,315,000	
3756	豆蔵ホールディングス	12,000	884.00	10,608,000	12,000株
3817	SRAホールディングス	2,000	2,890.00	5,780,000	2,000株
3844	コムチュア	3,500	3,685.00	12,897,500	3,500株
4344	ソースネクスト	20,000	632.00	12,640,000	
4676	フジ・メディア・ホールディングス	8,000	1,551.00	12,408,000	
4725	CAC Holdings	7,500	1,123.00	8,422,500	7,500株
4746	東計電算	5,500	2,230.00	12,265,000	5,000株
4845	スカラ	15,000	844.00	12,660,000	12,000株
7518	ネットワンシステムズ	15,000	866.00	12,990,000	15,000株
7595	アルゴグラフィックス	5,000	2,545.00	12,725,000	1,500株
9422	コネクシオ	8,000	1,636.00	13,088,000	
9468	カドカワ	3,000	1,674.00	5,022,000	
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	2,400	5,330.00	12,792,000	
9742	アイネス	10,000	1,119.00	11,190,000	
2715	エレマテック	6,000	1,953.00	11,718,000	6,000株
2784	アルフレッサホールディングス	7,000	2,038.00	14,266,000	7,000株
3053	ベッパーフードサービス	6,000	1,475.00	8,850,000	
3107	ダイワボウホールディングス	30,000	300.00	9,000,000	
3156	UKCホールディングス	6,000	2,231.00	13,386,000	5,000株
3176	三洋貿易	7,500	1,798.00	13,485,000	5,000株
3360	シップヘルスケアホールディングス	4,000	3,225.00	12,900,000	4,000株
7459	メディパルホールディングス	7,200	1,849.00	13,312,800	7,200株
7537	丸文	16,000	746.00	11,936,000	16,000株
7599	IDOM	17,000	759.00	12,903,000	17,000株
8020	兼松	70,000	194.00	13,580,000	70,000株
8037	カメイ	9,000	1,325.00	11,925,000	5,300株
8043	スターゼン	2,500	4,770.00	11,925,000	2,500株

8075	神鋼商事	4,000	2,468.00	9,872,000	
8095	イワキ	16,000	314.00	5,024,000	
8125	ワキタ	12,000	1,049.00	12,588,000	
8137	サンワテクノス	13,000	1,119.00	14,547,000	12,000株
8141	新光商事	9,000	1,319.00	11,871,000	
9305	ヤマタネ	7,000	1,640.00	11,480,000	
9810	日鉄住金物産	2,700	4,875.00	13,162,500	
9837	モリト	12,000	988.00	11,856,000	
9880	イノテック	20,000	740.00	14,800,000	
9987	スズケン	3,500	3,800.00	13,300,000	
2651	ローソン	1,500	7,800.00	11,700,000	
2685	アダストリア	4,000	2,804.00	11,216,000	4,000株
2698	キャンドウ	7,000	1,821.00	12,747,000	7,000株
2726	バルグループホールディングス	4,500	2,695.00	12,127,500	4,000株
2730	エディオン	12,000	1,024.00	12,288,000	
2764	ひらまつ	14,000	669.00	9,366,000	8,000株
3050	DCMホールディングス	12,000	979.00	11,748,000	12,000株
3085	アークランドサービスホールディングス	3,000	3,140.00	9,420,000	3,000株
3091	ブロンコビリー	3,000	2,798.00	8,394,000	2,000株
3097	物語コーポレーション	2,000	4,620.00	9,240,000	1,000株
3175	エー・ピーカンパニー	10,000	861.00	8,610,000	4,000株
3193	烏貴族	4,000	2,390.00	9,560,000	4,000株
3197	すかいらく	5,000	1,620.00	8,100,000	
3349	コスモス薬品	600	20,990.00	12,594,000	
3382	セブン&アイ・ホールディングス	2,800	4,386.00	12,280,800	2,500株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,000	984.00	7,872,000	6,000株
3395	サンマルクホールディングス	2,500	3,425.00	8,562,500	
3397	トリドールホールディングス	3,800	2,317.00	8,804,600	3,100株
4350	メディカルシステムネットワーク	30,000	450.00	13,500,000	27,000株
7419	ノジマ	9,000	1,440.00	12,960,000	9,000株
7516	コーナン商事	6,000	2,114.00	12,684,000	6,000株
7520	エコス	7,000	1,204.00	8,428,000	5,000株
7611	ハイデイ日高	4,200	2,351.00	9,874,200	
8233	高島屋	12,000	1,017.00	12,204,000	12,000株
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	6,500	1,919.00	12,473,500	6,500株
8251	バルコ	11,000	1,191.00	13,101,000	11,000株
8267	イオン	8,000	1,666.00	13,328,000	8,000株
9831	ヤマダ電機	21,500	569.00	12,233,500	
9842	アークランドサカモト	9,000	1,446.00	13,014,000	9,000株
9946	ミニストップ	6,000	2,109.00	12,654,000	2,500株
9948	アークス	5,000	2,541.00	12,705,000	
9956	パローホールディングス	4,000	2,770.00	11,080,000	4,000株
9997	ペルーナ	15,000	860.00	12,900,000	11,000株
3228	三栄建築設計	7,000	1,550.00	10,850,000	7,000株
3231	野村不動産ホールディングス	7,000	1,942.00	13,594,000	7,000株
3288	オープンハウス	4,500	2,716.00	12,222,000	4,500株
3289	東急不動産ホールディングス	18,000	650.00	11,700,000	6,000株
3291	飯田グループホールディングス	6,500	1,893.00	12,304,500	5,500株
3299	ムゲンエステート	10,000	743.00	7,430,000	
8818	京阪神ビルディング	10,000	653.00	6,530,000	
8890	レーサム	10,000	967.00	9,670,000	
8905	イオンモール	7,500	1,713.00	12,847,500	7,500株
8923	トーセイ	10,000	770.00	7,700,000	
8934	サンフロンティア不動産	8,000	1,020.00	8,160,000	8,000株
8935	エフ・ジェー・ネクスト	10,000	788.00	7,880,000	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	9,000	1,585.00	14,265,000	9,000株
2127	日本M&Aセンター	3,000	3,460.00	10,380,000	3,000株
2174	G C A	14,000	970.00	13,580,000	14,000株
2362	夢真ホールディングス	16,000	817.00	13,072,000	
2374	セントケア・ホールディング	7,500	1,696.00	12,720,000	6,000株
2429	ワールドホールディングス	6,000	2,040.00	12,240,000	6,000株
2433	博報堂D Yホールディングス	9,000	1,360.00	12,240,000	8,500株
2445	エスアールジータカミヤ	20,000	575.00	11,500,000	20,000株
4301	アミューズ	2,000	2,071.00	4,142,000	
4343	イオンファンタジー	4,000	3,040.00	12,160,000	4,000株
4544	みらかホールディングス	2,300	5,270.00	12,121,000	2,300株
4668	明光ネットワークジャパン	10,000	1,228.00	12,280,000	10,000株
4671	ファルコホールディングス	4,000	1,494.00	5,976,000	4,000株
4680	ラウンドワン	15,000	849.00	12,735,000	15,000株

4694	ビー・エム・エル	5,000	2,477.00	12,385,000	5,000株
4708	りらいあコミュニケーションズ	11,000	1,104.00	12,144,000	
4767	テー・オー・ダブリュー	6,000	689.00	4,134,000	
6089	ウィルグループ	17,000	744.00	12,648,000	17,000株
6097	日本ビューホテル	5,000	1,367.00	6,835,000	
6183	ベルシステム24ホールディングス	13,000	962.00	12,506,000	13,000株
8920	東祥	2,500	4,910.00	12,275,000	
9603	エイチ・アイ・エス	4,000	2,988.00	11,952,000	
9715	トランス・コスモス	5,000	2,620.00	13,100,000	
9735	セコム	1,500	8,212.00	12,318,000	
9755	応用地質	9,000	1,436.00	12,924,000	5,000株
9769	学究社	8,000	1,645.00	13,160,000	
	合 計	3,732,200		3,608,185,650	

(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	
サカタのタネ	4,000	12,880,000	
日本海洋掘削	4,000	10,112,000	
K&Oエナジーグループ	3,000	5,409,000	
コムシスホールディングス	6,000	11,964,000	
ビーアールホールディングス	30,000	10,350,000	
大成建設	13,000	10,283,000	
不動テトラ	60,000	12,060,000	
西松建設	20,000	11,660,000	
前田建設工業	12,000	11,760,000	
奥村組	20,000	14,060,000	
戸田建設	20,000	13,880,000	
NIPPO	6,000	13,086,000	
住友林業	8,000	13,216,000	
中電工	5,000	11,920,000	
きんでん	9,000	13,320,000	
中外炉工業	60,000	14,580,000	
高砂熱学工業	8,000	13,104,000	
日本甜菜製糖	5,000	12,345,000	
日新製糖	7,000	13,531,000	
エス・エム・エス	5,000	12,405,000	
テンプホールディングス	7,000	13,755,000	
森永製菓	2,500	12,200,000	
モロゾフ	24,000	12,288,000	
カルビー	1,300	4,959,500	
ヤクルト本社	2,500	15,550,000	
明治ホールディングス	1,800	16,110,000	
新日鉄住金ソリューションズ	5,000	11,355,000	
いちご	18,000	6,570,000	
コア	11,000	14,916,000	
エムスリー	5,000	14,190,000	
宝ホールディングス	11,000	12,595,000	
キーコーヒー	6,000	13,158,000	
かどや製油	2,500	12,450,000	
カワチ薬品	5,000	14,965,000	
ハードオフコーポレーション	10,000	11,760,000	
キッコマン	3,000	10,230,000	
カゴメ	5,000	14,535,000	
日清食品ホールディングス	2,700	16,821,000	
ロック・フィールド	5,000	8,660,000	
ビックカメラ	6,000	6,528,000	
ドトール・日レスホールディングス	2,000	4,306,000	
ジョイフル本田	4,000	13,960,000	
プレサンスコーポレーション	6,000	8,268,000	
SUMCO	9,000	15,453,000	
川田テクノロジーズ	1,600	12,256,000	
クスリのアオキホールディングス	2,500	11,737,500	
セーレン	9,000	13,626,000	
ホギメディカル	1,800	12,006,000	

T S Iホールディングス	18,000	14,112,000
A G S	4,000	8,112,000
ブロードリーフ	20,000	12,980,000
ディー・エル・イー	10,000	6,290,000
特種東海製紙	3,000	12,735,000
ベリサーブ	4,000	11,860,000
GMOクラウド	6,500	12,129,000
メディカル・データ・ビジョン	4,000	11,176,000
住友化学	22,000	14,124,000
関東電化工業	12,000	13,380,000
デンカ	20,000	11,860,000
大陽日酸	9,000	12,681,000
日本パーカライジング	9,000	12,276,000
保土谷化学工業	3,800	13,946,000
協和発酵キリン	8,000	13,480,000
三菱瓦斯化学	7,000	16,422,000
三菱ケミカルホールディングス	8,000	7,013,600
アイカ工業	1,000	2,877,000
日立化成	4,000	12,800,000
ケネディクス	20,000	8,860,000
扶桑化学工業	4,500	14,310,000
日油	9,000	11,106,000
あすか製薬	7,000	12,278,000
日本新薬	2,000	12,340,000
中外製薬	2,600	9,737,000
エーザイ	2,400	15,134,400
ロート製薬	6,000	13,020,000
小野薬品工業	5,800	14,566,700
栄研化学	5,000	15,300,000
J C Rファーマ	4,000	11,292,000
富士製薬工業	4,000	12,640,000
日本ペイントホールディングス	4,000	14,360,000
日本特殊塗料	5,000	8,830,000
サカタインクス	9,000	14,292,000
オリエンタルランド	2,500	15,895,000
パーク24	4,000	12,540,000
リゾートトラスト	4,000	8,312,000
トレンドマイクロ	3,000	14,835,000
リゾー教育	25,000	15,625,000
日本オラクル	900	5,778,000
オービックビジネスコンサルタント	2,500	13,775,000
東京個別指導学院	10,000	10,230,000
クリーク・アンド・リバー社	11,000	11,803,000
総合メディカル	3,000	11,895,000
サイボウズ	28,000	12,180,000
フルキャストホールディングス	12,000	13,320,000
資生堂	5,000	14,772,500
ライオン	3,000	5,781,000
高砂香料工業	3,000	11,115,000
長谷川香料	6,000	11,670,000
星光P M C	4,200	4,678,800
タカラバイオ	8,000	12,624,000
クミアイ化学工業	22,000	15,048,000
出光興産	4,500	16,155,000
アキレス	4,000	7,288,000
東海カーボン	25,000	11,300,000
T O T O	3,000	12,540,000
フジインコーポレーテッド	5,000	12,580,000
エーアンドエーマテリアル	100,000	13,300,000
ジェイ エフ イー ホールディングス	5,000	10,780,000
東京製鐵	15,000	14,610,000
大和工業	4,000	12,940,000
淀川製鋼所	4,000	13,220,000
東洋鋼鈑	25,000	11,625,000
大同特殊鋼	22,000	12,210,000
日本高周波鋼業	120,000	10,440,000
大平洋金属	10,000	4,000,000
新日本電工	45,000	14,535,000
古河機械金属	60,000	14,040,000
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,000	7,544,000

東邦チタニウム	10,000	9,740,000
古河電気工業	3,300	13,414,500
住友電気工業	6,000	11,196,000
フジクラ	5,000	4,220,000
LIXILグループ	4,500	12,586,500
ノーリツ	2,000	4,308,000
長府製作所	5,000	13,645,000
東京製綱	7,000	12,586,000
日本発條	10,000	12,880,000
テクノプロ・ホールディングス	4,000	15,860,000
M&Aキャピタルパートナーズ	2,000	8,110,000
リクルートホールディングス	3,000	16,260,000
牧野フライス製作所	12,000	12,792,000
DMG森精機	8,000	14,208,000
ディスコ	700	11,977,000
ソラスト	8,000	11,984,000
レオン自動機	11,000	11,495,000
新川	15,000	11,865,000
ユニオンツール	2,000	7,320,000
住友重機械工業	16,000	12,704,000
井関農機	50,000	12,900,000
TOWA	7,000	14,063,000
ローツェ	6,000	15,258,000
澁谷工業	4,500	12,991,500
栗田工業	5,000	13,450,000
日機装	10,000	12,320,000
ダイフク	5,000	13,130,000
CKD	5,000	7,360,000
キトー	10,000	12,520,000
理想科学工業	6,000	12,354,000
日本精工	9,000	14,490,000
NTN	25,000	14,225,000
不二越	22,000	13,662,000
ミネベアミツミ	9,000	12,474,000
日本トムソン	15,000	8,205,000
THK	4,000	11,816,000
ユーシン精機	1,500	4,459,500
日本ビラー工業	8,000	12,400,000
ダイヘン	17,000	12,444,000
ミマキエンジニアリング	8,500	6,562,000
ジーエス・ユアサ コーポレーション	25,000	12,875,000
メルコホールディングス	3,500	11,742,500
セイコーエプソン	5,300	13,599,800
ワコム	35,000	14,840,000
アルパック	2,500	12,525,000
パナソニック	10,000	12,585,000
アンリツ	15,000	12,600,000
アルプス電気	4,000	13,460,000
ヨコオ	10,000	13,050,000
船井電機	13,000	12,363,000
アドバンテスト	7,000	14,091,000
キーエンス	300	13,095,000
シスメックス	1,100	7,172,000
メガチップス	5,000	12,960,000
OBARA GROUP	2,500	12,312,500
コーセル	11,000	15,730,000
イリソ電子工業	2,000	14,160,000
新日本無線	30,000	13,140,000
オプテックスグループ	4,000	11,700,000
日本セラミック	5,000	12,035,000
ファナック	500	11,080,000
ローム	1,300	9,815,000
浜松ホトニクス	3,500	11,690,000
双葉電子工業	7,000	14,371,000
日東電工	1,300	12,382,500
日本ケミコン	46,000	15,364,000
名村造船所	15,000	11,460,000
日本車輛製造	35,000	10,745,000
日野自動車	6,000	7,866,000
日産車体	6,000	6,510,000

新明和工業	11,000	12,617,000
極東開発工業	7,000	12,285,000
日信工業	6,000	12,036,000
フタバ産業	19,000	14,877,000
KYB	20,000	12,120,000
市光工業	30,000	16,080,000
河西工業	10,000	14,830,000
アイシン精機	2,500	14,075,000
本田技研工業	2,000	7,106,000
スズキ	3,500	15,648,500
ミツバ	6,000	13,134,000
シマノ	800	13,520,000
ジャムコ	5,000	12,465,000
カップ・クリエイト	10,000	12,900,000
ナガイレーベン	4,500	11,002,500
三菱食品	4,000	13,980,000
アズワン	2,500	12,462,500
システムソフト	85,000	13,345,000
西松屋チェーン	9,000	11,448,000
ハークスレイ	7,000	7,952,000
日本エム・ディ・エム	7,000	5,446,000
シークス	3,500	15,137,500
スギホールディングス	2,600	13,416,000
島津製作所	7,000	12,845,000
東京計器	50,000	11,700,000
トプコン	7,500	14,767,500
オリンパス	3,500	13,912,500
H O Y A	2,500	12,687,500
メニコン	4,000	14,140,000
アートネイチャー	21,000	15,918,000
S H O E I	5,000	13,125,000
フジシールインターナショナル	5,500	12,276,000
図書印刷	26,000	12,506,000
ビジョン	4,000	12,880,000
イトーキ	18,000	12,960,000
コクヨ	9,000	13,059,000
長瀬産業	8,000	13,144,000
豊田通商	4,000	13,420,000
オンワードホールディングス	15,000	12,675,000
東京エレクトロン	1,100	12,391,500
O U Gホールディングス	27,000	7,047,000
セイコーホールディングス	30,000	14,520,000
第一実業	18,000	13,842,000
菱洋エレクトロ	8,000	13,016,000
ユアサ商事	4,000	12,840,000
阪和興業	16,000	12,976,000
昭光通商	50,000	4,950,000
ユニ・チャーム	5,000	12,420,000
サンゲツ	7,000	13,566,000
サンリオ	5,500	12,210,000
リョーサン	3,000	10,905,000
三信電気	10,000	13,690,000
東陽テクニカ	13,000	13,052,000
モスフードサービス	3,000	10,110,000
木曽路	5,000	12,310,000
千趣会	15,000	11,895,000
ケーヨー	23,000	12,926,000
ベスト電器	90,000	12,690,000
ロイヤルホールディングス	4,000	8,044,000
いなげや	9,000	14,013,000
チヨダ	5,000	13,625,000
ライフコーポレーション	4,000	13,260,000
青山商事	3,000	12,795,000
近鉄百貨店	35,000	12,215,000
丸井グループ	4,000	6,268,000
フジ	6,000	14,490,000
P A L T A C	4,000	12,480,000
三井不動産	4,000	10,436,000
三菱地所	6,000	13,497,000
東京楽天地	10,000	5,280,000

レオパレス21	21,000	12,600,000
スターツコーポレーション	4,000	9,684,000
日本エスコン	24,000	9,600,000
タカラレーベン	6,000	3,588,000
京浜急行電鉄	12,000	14,748,000
小田急電鉄	6,000	13,320,000
近鉄グループホールディングス	32,000	13,312,000
京阪ホールディングス	12,000	8,544,000
神戸電鉄	20,000	7,680,000
山陽電気鉄道	10,000	6,090,000
トランコム	2,000	11,340,000
ヤマトホールディングス	5,500	13,714,250
山九	15,000	10,800,000
福山通運	21,000	14,175,000
日本郵船	35,000	8,645,000
商船三井	45,000	16,785,000
三菱倉庫	9,000	14,562,000
キューソー流通システム	5,000	14,115,000
東京放送ホールディングス	6,000	12,396,000
スカパーJ S A Tホールディングス	15,000	7,605,000
ゼンリン	5,000	10,930,000
メタウォーター	4,500	12,843,000
アインホールディングス	1,500	12,120,000
スバル興業	24,000	12,624,000
東京ドーム	10,000	11,170,000
日本空港ビルデング	3,600	14,364,000
乃村工務社	6,000	11,202,000
KNT-CTホールディングス	90,000	12,240,000
日本システムウエア	7,000	10,920,000
船井総研ホールディングス	4,000	7,996,000
ベネッセホールディングス	4,500	15,255,000
ニチイ学館	15,000	13,050,000
オートバックスセブン	8,000	14,320,000
ニトリホールディングス	1,000	12,880,000
グルメ杵屋	9,000	9,549,000
吉野家ホールディングス	5,000	8,165,000
イエローハット	4,500	12,919,500
松屋フーズ	2,000	8,470,000
関西スーパーマーケット	5,000	7,735,000
ミロク情報サービス	6,000	10,188,000
大庄	8,000	12,176,000

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】
【純資産額計算書】

平成29年3月31日現在
(単位:円)

資産総額	2,922,830,994
負債総額	5,568,797
純資産総額(-)	2,917,262,197
発行済口数	2,402,815,096 口
1口当たり純資産価額(/)	1.2141 (1万口当たり 12,141)

<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29年3月31日現在
(単位:円)

資産総額	7,493,972,545
負債総額	3,384,180,428
純資産総額(-)	4,109,792,117
発行済口数	2,885,175,621 口
1口当たり純資産価額(/)	1.4245 (1万口当たり 14,245)

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

（1）名義書換

委託会社は、この信託の受益権を取り扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

したがって、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

（2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

（3）譲渡制限の内容

譲渡制限はありません。

（4）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとします。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

（5）受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

（6）受益権の再分割

委託会社は、受託会社と合意のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できます。

（7）質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第二部【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】

報告書代替書面における「委託会社等の概況」の記載のとおりです。

報告書代替書面については、（<http://www.am.mufg.jp/corp/profile/accounting.html>）でもご覧いただけます。

2【事業の内容及び営業の概況】

報告書代替書面における「事業の内容及び営業の概況」の記載のとおりです。

3【委託会社等の経理状況】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の「冒頭書面」の記載のとおりです。

（1）【貸借対照表】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（1）「貸借対照表」の記載のとおりです。

（2）【損益計算書】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（2）「損益計算書」の記載のとおりです。

（3）【株主資本等変動計算書】

報告書代替書面における「委託会社等の経理状況」の（3）「株主資本等変動計算書」の記載のとおりです。

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の実行の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)または子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

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**

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円（平成28年9月末現在）

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (平成28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。

2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

3【資本関係】

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29年3月末現在）

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の51.0%（107,855株）を所有しています。

(注) 関係法人が所有する委託会社の株式または委託会社が所有する関係法人の株式のうち、持株比率が3%以上のものを記載しています。

第3【参考情報】

1 当計算期間において、次の書類を関東財務局長に提出しております。

平成28年11月22日 有価証券報告書、有価証券届出書

2 その他

- (1) 目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、またファンドの形態、申込みに係る事項などを記載することがあります。
- (2) 投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。
- (3) 目論見書に以下の内容を記載することがあります。
- ・当ファンドの受益権の価額は、株式等の有価証券市場の相場変動、組入有価証券の発行者の信用状況の変化等の影響により変動し、下落する場合があります。したがって、投資家のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により、損失を被ることがあります。
 - ・当ファンドは、一定の運用成果を保証するものではありません。
 - ・運用により信託財産に生じた損益はすべて投資家のみなさまに帰属します。
 - ・投資信託は、預金等や保険契約とは異なり、預金保険機構、貯金保険機構、保険契約者保護機構の保護の対象ではありません。
 - ・金融商品取引業者以外の金融機関は、投資者保護基金に加入しておりません。
 - ・当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。
- (4) 目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。
- (5) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (6) 目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。
- (7) 目論見書に委託会社のホームページアドレスのほか、モバイルサイトのアドレス（当該アドレスをコード化した図形等を含みます。）等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成29年3月29日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 柴 毅 印指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 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、「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28年8月25日から平成29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29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国際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。