

当ファンドの仕組みは次の通りです。

商品分類	追加型投信／国内／株式／特殊型（絶対収益追求型）	
信託期間	無期限（2005年12月16日設定）	
運用方針	主としてマザーファンドを通じて、無担保コール翌日物レート（指数化）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。 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。 マザーファンド受益証券の組入比率は、高位を維持することを基本とします。	
主要運用対象	ベビーファンド	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、当ファンドで直接投資することがあります。
	マザーファンド	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	ベビーファンド	株式への実質投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
	マザーファンド	株式への投資割合に制限を設けません。 外貨建資産への投資は行いません。
分配方針	経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額を分配対象額とし、分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して、委託会社が決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。	

※当ファンドは、課税上、株式投資信託として取り扱われます。

## 運用報告書（全体版）

# 日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）

第22期（決算日：2017年2月24日）

## 受益者のみなさまへ

平素は格別のご愛顧を賜り厚く御礼申し上げます。  
さて、お手持ちの「日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）」は、去る2月24日に第22期の決算を行いました。ここに謹んで運用状況をご報告申し上げます。  
今後とも引き続きお引き立て賜りますようお願い申し上げます。



三菱UFJ国際投信

東京都千代田区有楽町一丁目12番1号  
URL:<http://www.am.mufg.jp/>

本資料の記載内容に関するお問い合わせ先

お客さま専用フリーダイヤル TEL. 0120-151034  
(9:00~17:00、土・日・祝日・12月31日~1月3日を除く)  
お客さまのお取引内容につきましては、お取り扱いの販売会社にお尋ねください。

## 本資料の表記にあたって

- ・原則として、各表の数量、金額の単位未満は切捨て、比率は四捨五入で表記しておりますので、表中の個々の数字の合計が合計欄の値とは一致しないことがあります。ただし、単位未満の数値については小数を表記する場合があります。
- ・一印は組入れまたは売買がないことを示しています。

## ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額			無担保コール 翌日物レート(指数化)		株式 組入比率	信用取引 比率	株式 先物比率	純資産 総額
	(分配落)	税 分 配	み 金 騰 落 率	期 騰 落 率	期 騰 落 率				
	円	円	%		%	%	%	%	百万円
18期(2015年2月24日)	11,504	0	0.8	101.84	0.0	80.3	△80.2	—	1,300
19期(2015年8月24日)	11,816	0	2.7	101.88	0.0	69.1	△68.9	—	1,052
20期(2016年2月24日)	11,855	0	0.3	101.91	0.0	84.7	△84.7	—	2,393
21期(2016年8月24日)	11,478	0	△3.2	101.89	△0.0	80.1	△79.8	—	2,789
22期(2017年2月24日)	12,200	0	6.3	101.87	△0.0	86.5	△85.6	—	2,914

(注) 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。無担保コール翌日物レート(指数化)は無担保コール翌日物レートをもとに委託会社が計算したものです。

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

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年月日	基準価額		無担保コール 翌日物レート(指数化)		株式 組入比率	信用取引 比率	株式 先物比率
	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率	騰 落 率			
(期首)	円	%		%	%	%	%
2016年8月24日	11,478	—	101.89	—	80.1	△79.8	—
8月末	11,470	△0.1	101.89	△0.0	80.7	△80.5	—
9月末	11,625	1.3	101.89	△0.0	83.3	△81.7	—
10月末	11,768	2.5	101.89	△0.0	85.6	△84.9	—
11月末	11,930	3.9	101.88	△0.0	86.6	△85.7	—
12月末	12,069	5.1	101.88	△0.0	84.9	△84.9	—
2017年1月末	12,092	5.3	101.87	△0.0	81.9	△81.6	—
(期末)							
2017年2月24日	12,200	6.3	101.87	△0.0	86.5	△85.6	—

(注) 騰落率は期首比。

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

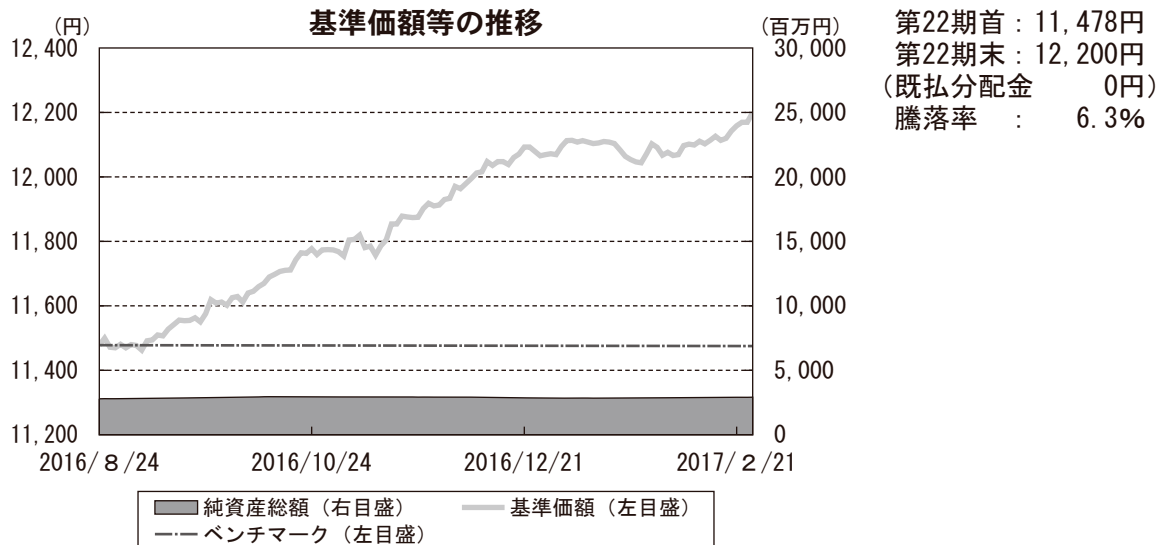
(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## 運用経過

### 当期中の基準価額等の推移について

（第22期：2016/8/25～2017/2/24）

基準価額の動き	基準価額は期首に比べ6.3%の上昇となりました。
ベンチマークとの差異	ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率（-0.0%）を6.3%上回りました。



### 基準価額の主な変動要因

上昇要因	フローバリューファクター（企業収益に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）やストックバリューファクター（企業の資産価値に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）、リターンリバーサルファクター（過去株価が下落した銘柄の株価が、その後反転し上昇する傾向に着目した戦略）などがプラスに寄与し、基準価額の上昇要因となりました。
------	--

投資環境について

（第22期：2016/8/25～2017/2/24）

◎国内株式市況

- ・当期の国内株式市況は大きく上昇しました。期首から2016年10月にかけては、7月の日本銀行の金融政策決定会合において上場投資信託（ETF）の買い入れ増額を決定したことや国内企業業績の底打ち期待が高まったことなどが株価の下支え要因となりました。11月に入ると、トランプ候補が米国大統領選挙に勝利したことを受けて、トランプ氏が政策に掲げる積極的な財政出動や大型減税などが米国経済を押し上げるとの期待が高まったことや、国内企業業績の重しとなっていた外国為替市場における円高・ドル安傾向が反転し、円安傾向で推移したことなどが株価を大きく押し上げました。

当該投資信託のポートフォリオについて

<日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）>

- ・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した。マザーファンドの組入比率は高位を維持しました。

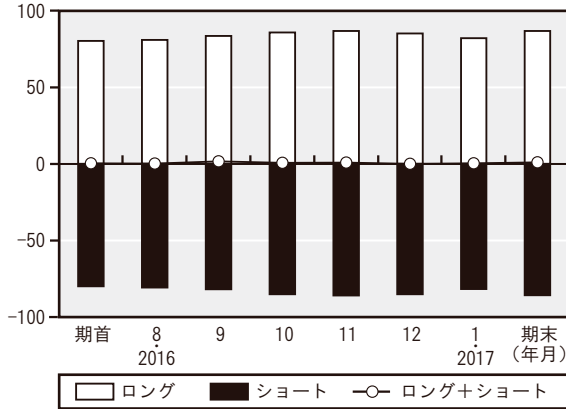
<日本株マーケットニュートラル・マザーファンド>

基準価額は期首に比べ6.9%の上昇となりました。

- ・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、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、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行いました。
- ・当期は、計量モデルによって導き出された結果が妥当と判断し、期を通じてフローバリュファクターやストックバリュファクター、リターンリバーサルファクターなどへの投資ウェイトを高めたポートフォリオの構築を行いました。
- ・組入比率は、期を通じてロングとショートそれぞれの組入比率を、純資産総額に対して概ね70～90%程度で推移させ、ロングとショートの間をほぼ同等とした結果、株式市況が上昇・下落することによる基準価額への影響をほぼ排除することができました。

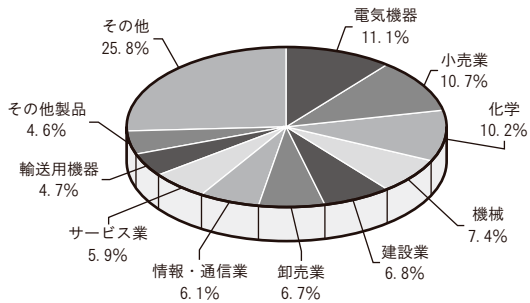
（ご参考）

組入比率の推移（月末ベース）

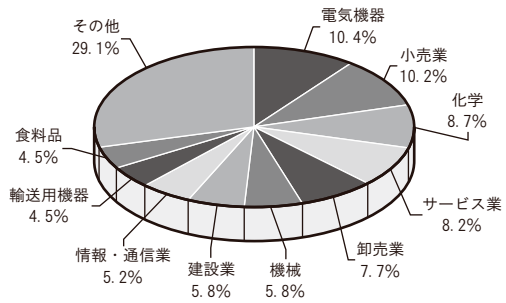


（ご参考）

組入上位10業種（ロングポジション）  
期首（2016年8月24日）



期末（2017年2月24日）



（注）比率は現物株式評価額に対する割合です。

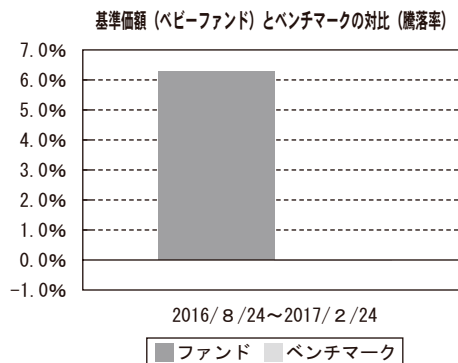
## 当該投資信託のベンチマークとの差異について

＜日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）＞

ファンドの騰落率は、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））の騰落率（-0.0%）を6.3%上回りました。マザーファンドの基準価額がベンチマークを6.9%上回りましたが、信託報酬等のコストがマイナス要因となりました。

＜日本株マーケットニュートラル・マザーファンド＞  
 ファンドの騰落率は、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））の騰落率（-0.0%）を6.9%上回りました。

- ・期を通じて、フローバリューファクターやストックバリューファクター、リターンリバーサルファクターがプラスに寄与するなどファクター戦略が有効に機能した結果、基準価額は上昇し、ベンチマークを上回りました。



## 分配金について

収益分配金につきましては、基準価額水準、市況動向、分配対象額の水準等を勘案し、次表の通りとさせていただきます。収益分配に充てなかった利益（留保益）につきましては、信託財産中に留保し、運用の基本方針に基づいて運用します。

【分配原資の内訳】 （単位：円、1万口当たり、税込み）

項目	第22期
	2016年8月25日～2017年2月24日
当期分配金	—
（対基準価額比率）	—%
当期の収益	—
当期の収益以外	—
翌期繰越分配対象額	2,851

（注）対基準価額比率は当期分配金（税込み）の期末基準価額（分配金込み）に対する比率であり、ファンドの収益率とは異なります。

（注）当期の収益、当期の収益以外は小数点以下切捨てで算出しているため合計が当期分配金と一致しない場合があります。

## 今後の運用方針

＜日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）＞

◎今後の運用方針

- ・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高位に組み入れて運用する方針です。

＜日本株マーケットニュートラル・マザーファンド＞

◎今後の運用方針

- ・信用取引等の活用により、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。

## ○ 1 万口当たりの費用明細

（2016年8月25日～2017年2月24日）

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 信 託 報 酬	68	0.573	(a) 信託報酬＝期中の平均基準価額×信託報酬率× (期中の日数÷年間日数)
（ 投 信 会 社 ）	( 58 )	( 0.491 )	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 ）	( 3 )	( 0.027 )	交付運用報告書等各種書類の送付、顧客口座の管理、購入後の情報提供等の対価
（ 受 託 会 社 ）	( 6 )	( 0.055 )	ファンドの財産の保管および管理、委託会社からの運用指図の実行等の対価
(b) 売 買 委 託 手 数 料	0	0.001	(b) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
（ 株 式 ）	( 0 )	( 0.001 )	
(c) そ の 他 費 用	111	0.942	(c) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数
（ 監 査 費 用 ）	( 0 )	( 0.001 )	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
（ 信 用 取 引 ）	( 111 )	( 0.940 )	株式信用取引に要する品賃料、配当調整金の支払い等
合 計	179	1.516	
期中の平均基準価額は、11,825円です。			

(注) 期中の費用（消費税等のかかるものは消費税等を含む）は、追加・解約により受益権口数に変動があるため、簡便法により算出した結果です。

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

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

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額（円未満の端数を含む）を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。



## ○売買及び取引の状況

(2016年8月25日～2017年2月24日)

## 親投資信託受益証券の設定、解約状況

銘柄	設定		解約	
	口数	金額	口数	金額
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	千口 153,925	千円 211,632	千口 201,578	千円 281,147

## ○株式売買比率

(2016年8月25日～2017年2月24日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項目	当期	
	日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	
(a) 期中の株式売買金額	17,893,280千円	
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,568,074千円	
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.01	

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。

## ○利害関係人との取引状況等

(2016年8月25日～2017年2月24日)

## 利害関係人との取引状況

&lt;日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）&gt;

該当事項はございません。

&lt;日本株マーケットニュートラル・マザーファンド&gt;

区分	買付額等 A	うち利害関係人との取引状況B		売付額等 C	うち利害関係人との取引状況D	
			$\frac{B}{A}$			$\frac{D}{C}$
株式	百万円 8,565	百万円 —	% —	百万円 9,327	百万円 12	% 0.1

平均保有割合 68.0%

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

### 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	20千円
うち利害関係人への支払額 (B)	6千円
(B) / (A)	32.8%

(注) 売買委託手数料総額は、このファンドが組み入れている親投資信託が支払った金額のうち、当ファンドに対応するものです。

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

### ○組入資産の明細

(2017年2月24日現在)

#### 親投資信託残高

銘 柄	期首(前期末)	当 期 末	
	口 数	口 数	評 価 額
	千口	千口	千円
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	2,079,828	2,032,175	2,906,010

マザーファンドの組入資産の明細につきましては、マザーファンド頁をご参照ください。

### ○投資信託財産の構成

(2017年2月24日現在)

項 目	当 期	末
	評 価 額	比 率
	千円	%
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド	2,906,010	98.9
コール・ローン等、その他	33,584	1.1
投資信託財産総額	2,939,594	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況（2017年2月24日現在）

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	2,939,594,379
コール・ローン等	28,396,055
日本株マーケットニュートラル・マザーファンド(評価額)	2,906,010,862
未収入金	5,187,462
(B) 負債	25,222,060
未払解約金	8,677,408
未払信託報酬	16,503,820
未払利息	29
その他未払費用	40,803
(C) 純資産総額(A-B)	2,914,372,319
元本	2,388,755,343
次期繰越損益金	525,616,976
(D) 受益権総口数	2,388,755,343口
1万口当たり基準価額(C/D)	12,200円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 2,430,195,147円  
 期中追加設定元本額 382,688,008円  
 期中一部解約元本額 424,127,812円  
 また、1口当たり純資産額は、期末1.2200円です。

## ○損益の状況（2016年8月25日～2017年2月24日）

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	△ 4,149
受取利息	148
支払利息	△ 4,297
(B) 有価証券売買損益	175,477,496
売買益	193,088,582
売買損	△ 17,611,086
(C) 信託報酬等	△ 16,544,623
(D) 当期損益金(A+B+C)	158,928,724
(E) 前期繰越損益金	△ 70,167,037
(F) 追加信託差損益金	436,855,289
(配当等相当額)	( 591,775,079)
(売買損益相当額)	(△154,919,790)
(G) 計(D+E+F)	525,616,976
(H) 収益分配金	0
次期繰越損益金(G+H)	525,616,976
追加信託差損益金	436,855,289
(配当等相当額)	( 592,429,566)
(売買損益相当額)	(△155,574,277)
分配準備積立金	88,761,687

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

## ②分配金の計算過程

項 目	2016年8月25日～ 2017年2月24日
費用控除後の配当等収益額	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	44,485,876円
収益調整金額	592,429,566円
分配準備積立金額	21,917,131円
当ファンドの分配対象収益額	681,191,253円
1万口当たり収益分配対象額	2,851円
1万口当たり分配金額	—円
収益分配金金額	—円

\*三菱UFJ国際投信では本資料のほかに当ファンドに関する情報等の開示を行っている場合があります。詳しくは、取り扱い販売会社にお問い合わせいただくか、当社ホームページ (<http://www.am.mufg.jp/>) をご覧ください。

【お 知 ら せ】

- ①信用リスクを適正に管理する方法を新たに定める（分散型に分類）ため、信用リスク集中回避のための投資制限の追加およびこれに伴う投資制限の記載の変更を行い、信託約款に所要の変更を行いました。  
(2016年11月23日)
- ②2014年1月1日から、2037年12月31日までの間、普通分配金並びに解約時又は償還時の差益に対し、所得税15%に2.1%の率を乗じた復興特別所得税が付加され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%（法人受益者は15.315%の源泉徴収が行われます。））の税率が適用されます。

## 日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

### 《第26期》決算日2017年2月24日

〔計算期間：2016年8月25日～2017年2月24日〕

「日本株マーケットニュートラル・マザーファンド」は、2月24日に第26期の決算を行いました。  
以下、法令・諸規則に基づき、当マザーファンドの第26期の運用状況をご報告申し上げます。

運用方針	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。無担保コール翌日物レート（指数化）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。
主要運用対象	わが国の株式を主要投資対象とします。
主な組入制限	株式への投資割合に制限を設けません。外貨建資産への投資は行いません。

### ○最近5期の運用実績

決算期	基準価額		無担保コール翌日物レート（指数化）		株式組入比率	信用取引率	株式先物比率	純資産総額
	円	期中騰落率	期中騰落率	期中騰落率				
22期(2015年2月24日)	13,215	1.2	101.84	0.0	80.5	△80.4	—	1,576
23期(2015年8月24日)	13,625	3.1	101.88	0.0	69.3	△69.1	—	2,118
24期(2016年2月24日)	13,745	0.9	101.91	0.0	84.9	△84.9	—	3,790
25期(2016年8月24日)	13,379	△2.7	101.89	△0.0	80.3	△80.0	—	4,244
26期(2017年2月24日)	14,300	6.9	101.87	△0.0	86.8	△85.8	—	4,158

(注) 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。無担保コール翌日物レート（指数化）は無担保コール翌日物レートをもとに委託会社が計算したものです。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○当期中の基準価額と市況等の推移

年 月 日	基 準 価 額		無 担 保 日 物 レー	コ ー ル ト (指 数 化)		株 組 入 比 率	信 用 取 引 率 比	株 先 物 比 率
	円	騰 落 率		騰 落 率	騰 落 率			
(期 首) 2016年8月24日	13,379	—	101.89	—	80.3	△80.0	—	
8月末	13,372	△0.1	101.89	△0.0	80.9	△80.7	—	
9月末	13,566	1.4	101.89	△0.0	83.5	△81.9	—	
10月末	13,746	2.7	101.89	△0.0	85.8	△85.1	—	
11月末	13,948	4.3	101.88	△0.0	86.8	△85.9	—	
12月末	14,122	5.6	101.88	△0.0	85.1	△85.1	—	
2017年1月末	14,162	5.9	101.87	△0.0	82.1	△81.8	—	
(期 末) 2017年2月24日	14,300	6.9	101.87	△0.0	86.8	△85.8	—	

(注) 騰落率は期首比。

(注) 「株式先物比率」は買建比率－売建比率。

## ○運用経過

## ●当期中の基準価額等の推移について

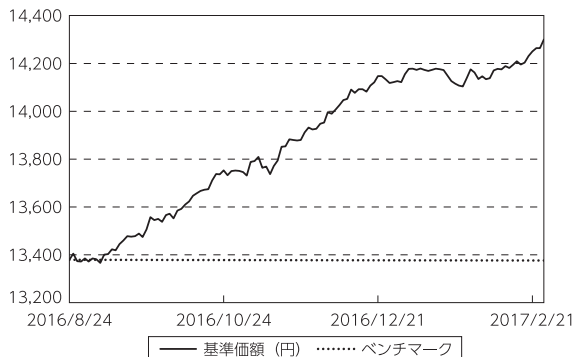
## ◎基準価額の動き

基準価額は期首に比べ6.9%の上昇となりました。

## ◎ベンチマークとの差異

ファンドの騰落率は、ベンチマークの騰落率(−0.0%)を6.9%上回りました。

基準価額の推移



(注) ベンチマークは期首の値をファンド基準価額と同一になるよう指数化しています。

## ●投資環境について

## ◎国内株式市況

・当期の国内株式市況は大きく上昇しました。期首から2016年10月にかけては、7月の日本銀行の金融政策決定会合において上場投資信託(ETF)の買い入れ増額を決定したことや国内企業業績の底打ち期待が高まったことなどが株価の下支え要因となりました。11月に入ると、トランプ候補が米国大統領選挙に勝利したことを受けて、トランプ氏が政策に掲げる積極的な財政出動や大型減税などが米国経済を押し上げるとの期待が高まったことや、国内企業業績の重しとなっていた外国為替市場における円高・ドル安傾向が反転し、円安傾向で推移したことなどが株価を大きく押し上げました。

## ●当該投資信託のポートフォリオについて

- ・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、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、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））を中長期的に上回る投資成果をめざして運用を行いました。
- ・当期は、計量モデルによって導き出された結果が妥当と判断し、期を通じてフローバリューファクター（企業収益に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）やストックバリューファクター（企業の資産価値に対して株価が割安な銘柄に投資する戦略）、リターンリバーサルファクター（過去株価が下落した銘柄の株価が、その後反転し上昇する傾向に着目した戦略）などへの投資ウェイトを高めたポートフォリオの構築を行いました。
- ・組入比率は、期を通じてロングとショートそれぞれの組入比率を、純資産総額に対して概ね70～90%程度で推移させ、ロングとショートの金額をほぼ同等とした結果、株式市況が上昇・下落することによる基準価額への影響をほぼ排除することができました。

## ●当該投資信託のベンチマークとの差異について

- ・ファンドの騰落率は、ベンチマーク（無担保コール翌日物レート（指数化））の騰落率（-0.0%）を6.9%上回りました。
- ・期を通じて、フローバリューファクターやストックバリューファクター、リターンリバーサルファクターがプラスに寄与するなどファクター戦略が有効に機能した結果、基準価額は上昇し、ベンチマークを上回りました。

## ○今後の運用方針

- ・信用取引等の活用により、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。

## ○1万口当たりの費用明細

(2016年8月25日～2017年2月24日)

項 目	当 期		項 目 の 概 要
	金 額	比 率	
(a) 売 買 委 託 手 数 料 ( 株 式 )	円 0 ( 0 )	% 0.001 (0.001)	(a) 売買委託手数料＝期中の売買委託手数料÷期中の平均受益権口数 有価証券等の売買時に取引した証券会社等に支払われる手数料
(b) そ の 他 費 用 ( 信 用 取 引 )	130 (130)	0.941 (0.941)	(b) その他費用＝期中のその他費用÷期中の平均受益権口数 株式信用取引に要する品質料、配当調整金の支払い等
合 計	130	0.942	
期中の平均基準価額は、13,819円です。			

(注) 各金額は項目ごとに円未満は四捨五入してあります。

(注) 各比率は1万口当たりのそれぞれの費用金額(円未満の端数を含む)を期中の平均基準価額で除して100を乗じたもので、項目ごとに小数第3位未満は四捨五入してあります。

## ○売買及び取引の状況

(2016年8月25日～2017年2月24日)

## 株式

		買 付		売 付	
		株 数	金 額	株 数	金 額
国 内	上場	千株 8,606 (△ 187)	千円 8,565,883 ( - )	千株 8,866	千円 9,327,396

(注) 金額は受渡代金。

(注) ( )内は株式分割・増資割当および合併等による増減分で、上段の数字には含まれておりません。

## ○株式売買比率

(2016年8月25日～2017年2月24日)

## 株式売買金額の平均組入株式時価総額に対する割合

項 目	当 期
(a) 期中の株式売買金額	17,893,280千円
(b) 期中の平均組入株式時価総額	3,568,074千円
(c) 売買高比率 (a) / (b)	5.01

(注) (b)は各月末現在の組入株式時価総額の平均。



## ○利害関係人との取引状況等

(2016年8月25日～2017年2月24日)

## 利害関係人との取引状況

区 分	買付額等 A	うち利害関係人 との取引状況B	$\frac{B}{A}$ %	売付額等 C	うち利害関係人 との取引状況D	$\frac{D}{C}$ %
株式	百万円 8,565	百万円 —	—	百万円 9,327	百万円 12	0.1

## 売買委託手数料総額に対する利害関係人への支払比率

項 目	当 期
売買委託手数料総額 (A)	29千円
うち利害関係人への支払額 (B)	9千円
(B) / (A)	32.6%

利害関係人とは、投資信託及び投資法人に関する法律第11条第1項に規定される利害関係人であり、当ファンドに係る利害関係人とは三菱UFJモルガン・スタンレー証券です。

## ○組入資産の明細

(2017年2月24日現在)

## 国内株式

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
<b>水産・農林業 (0.4%)</b>				
マルハニチロ	5	4	13,360	
<b>鉱業 (1.3%)</b>				
日鉄鉱業	35	2	11,560	
三井松島産業	—	8	12,432	
国際石油開発帝石	17	11	12,617	
石油資源開発	5	4.5	12,213	
<b>建設業 (5.8%)</b>				
ショーボンドホールディングス	—	2.5	12,237	
ミライト・ホールディングス	13	—	—	
ファーストコーポレーション	—	9	8,361	
東急建設	—	14	11,690	
ミサワホーム	18	—	—	
高松コンストラクショングループ	5	—	—	
大林組	—	12	12,720	
清水建設	15	—	—	
長谷工コーポレーション	9	—	—	
松井建設	6	—	—	
三井住友建設	140	100	12,500	
ナカノフドー建設	20	—	—	
東鉄工業	5	4	12,300	
青木あすなろ建設	10	—	—	
矢作建設工業	15	13	13,507	
大林道路	15	18	12,402	
世紀東急工業	—	24	12,312	
福田組	—	11	11,440	
日本基礎技術	36	—	—	
日成ビルド工業	30	25	14,000	
大和ハウス工業	—	2	6,268	
積水ハウス	9	3.5	6,352	
東京エネシス	—	13	12,545	
住友電設	5	10	12,680	
NDS	5	—	—	
日揮	9	6.6	13,398	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
明星工業	20	—	—	
ダイダマン	7	—	—	
東芝プラントシステム	8	7	11,053	
東洋エンジニアリング	—	45	12,195	
新興プランテック	16	—	—	
<b>食料品 (4.5%)</b>				
三井製糖	—	5	13,655	
不二家	30	—	—	
山崎製パン	—	5.7	12,585	
寿スピリッツ	5	4.5	11,893	
カルビー	3.5	—	—	
森永乳業	—	15	12,960	
六甲バター	3	—	—	
ヤクルト本社	3	—	—	
雪印メグミルク	—	4	12,320	
日本ハム	6	—	—	
S Foods	5	—	—	
オエノンホールディングス	—	40	10,200	
コカ・コーラウエスト	—	4	13,520	
日清オイリオグループ	30	—	—	
不二製油グループ本社	—	5	12,375	
J-オイルミルズ	—	3	12,540	
ハウス食品グループ本社	6	—	—	
エバラ食品工業	3	—	—	
東洋水産	—	3	12,285	
日本たばこ産業	—	3.5	13,317	
ケンコーマヨネーズ	—	4	10,960	
わらべや日洋ホールディングス	5	5	12,575	
<b>繊維製品 (1.0%)</b>				
日本毛織	9	11	9,845	
住江織物	—	45	13,050	
デサント	—	10	13,210	
<b>パルプ・紙 (1.1%)</b>				
王子ホールディングス	—	27	14,580	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本製紙	6.5	6	12,366	
レンゴー	20	18	11,646	
<b>化学 (8.7%)</b>				
クラレ	10	7.5	12,952	
昭和電工	12	—	—	
住友精化	—	2.5	11,962	
クレハ	—	2.5	12,025	
テイカ	15	—	—	
トクヤマ	35	—	—	
日本カーバイド工業	—	80	12,800	
堺化学工業	10	—	—	
日本化学工業	40	50	12,350	
戸田工業	10	—	—	
大日精化工業	27	18	12,834	
カネカ	19	14	12,460	
J S R	10	—	—	
大阪有機化学工業	15	—	—	
KHネオケム	—	9	12,204	
ダイセル	13	—	—	
宇部興産	—	50	14,200	
ニチバン	17	13	12,870	
リケンテクノス	—	20	10,720	
大倉工業	35	—	—	
積水化成工業	8	15	12,360	
タイガースポリマー	19	15	11,970	
ダイキョーニシカワ	10	—	—	
日本化薬	13	—	—	
ADEKA	—	8	12,560	
ハリマ化成グループ	20	16	12,944	
第一工業製薬	20	30	13,440	
三洋化成工業	—	2.5	11,700	
大日本塗料	30	50	11,600	
D I C	4.5	—	—	
富士フィルムホールディングス	4	—	—	
ライオン	9	—	—	
マンダム	—	2.5	13,150	
コーセー	1.6	—	—	
シーズ・ホールディングス	5	4	13,000	
荒川化学工業	9	—	—	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
J C U	3	—	—	
北興化学工業	30	—	—	
有沢製作所	26	16	12,880	
きもと	—	50	12,250	
藤森工業	6	4.3	12,882	
天馬	4	—	—	
ニフコ	—	2	11,520	
日本バルカー工業	—	7	13,314	
<b>医薬品 (3.2%)</b>				
アステラス製薬	—	8.5	13,013	
田辺三菱製薬	8	6	14,046	
科研製薬	—	2	12,020	
小野薬品工業	5	—	—	
久光製薬	3	—	—	
持田製薬	—	1.5	12,735	
参天製薬	—	8	12,968	
ツムラ	—	4	13,580	
日医工	6	—	—	
沢井製薬	1.8	2	12,180	
第一三共	—	5.2	13,543	
キョーリン製薬ホールディングス	7.5	4.5	10,669	
大塚ホールディングス	3.3	—	—	
ペプチドリーム	2	—	—	
<b>石油・石炭製品 (0.7%)</b>				
昭和シェル石油	—	12	13,752	
ニチレキ	18	—	—	
ビービー・カストロール	—	7	11,403	
<b>ゴム製品 (1.1%)</b>				
横浜ゴム	—	6	13,566	
ブリヂストン	4.4	—	—	
住友ゴム工業	9.5	7	12,985	
フコク	5	—	—	
ニッタ	2	4	12,280	
<b>ガラス・土石製品 (2.0%)</b>				
旭硝子	—	14	12,978	
日本板硝子	—	15	12,495	
日本電気硝子	—	17	11,849	
日本ヒューム	7	—	—	
アジアパイルホールディングス	20	22	13,662	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
日本特殊陶業	8.5	—	—	—
MARUWA	—	3.5	12,617	—
品川リフラクトリーズ	—	30	9,210	—
フジインコーポレーテッド	9	—	—	—
<b>鉄鋼 (1.7%)</b>				
神戸製鋼所	—	12	13,296	—
合同製鐵	—	6.5	12,161	—
丸一鋼管	4	—	—	—
モリ工業	—	5	12,465	—
愛知製鋼	—	2.5	12,212	—
新日本電工	40	—	—	—
三菱製鋼	60	—	—	—
日本精線	23	17	10,421	—
<b>非鉄金属 (2.0%)</b>				
三井金属鉱業	70	—	—	—
三菱マテリアル	55	3.5	13,020	—
DOWAホールディングス	—	13	11,843	—
東京特殊電線	—	5	8,895	—
タツタ電線	40	30	13,740	—
カナレ電気	7	6	13,302	—
アーレスティ	—	10	11,940	—
<b>金属製品 (2.0%)</b>				
トーカロ	4	—	—	—
アルファC o	—	10	13,840	—
東洋製罐グループホールディングス	7.5	6	12,294	—
文化シヤッター	—	15	12,570	—
三協立山	6	7	11,900	—
日東精工	40	30	12,750	—
ジーテクト	—	4	8,608	—
東プレ	6.5	—	—	—
日本発條	17	—	—	—
<b>機械 (5.8%)</b>				
タクマ	13	13	13,637	—
東芝機械	—	15	7,305	—
アマダホールディングス	14	—	—	—
アイダエン지니어リング	15	11	11,022	—
滝澤鉄工所	20	—	—	—
富士機械製造	6	8	12,024	—
OKK	—	50	6,350	—

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ベガサスミシン製造	12	—	—	—
三井海洋開発	8	—	—	—
オイレス工業	5	6	12,612	—
日精エー・エス・ビー機械	6	5	11,870	—
新東工業	10	6	6,144	—
アイチ コーポレーション	16	—	—	—
小森コーポレーション	10	9	13,500	—
酒井重工業	—	35	11,480	—
トーヨーカネツ	50	—	—	—
栗田工業	6	—	—	—
椿本チエイン	—	13	12,740	—
アネスト岩田	—	6	6,600	—
加藤製作所	—	4.5	12,906	—
タダノ	15	—	—	—
フジテック	—	9.5	12,340	—
竹内製作所	9	5	11,320	—
新晃工業	—	8	11,720	—
大和冷機工業	14	12	12,744	—
T P R	6	—	—	—
ツバキ・ナカシマ	9	—	—	—
ホシザキ	1.8	—	—	—
ジェイテクト	—	7	13,405	—
THK	7	—	—	—
マキタ	2.1	—	—	—
三菱重工業	—	25	11,092	—
<b>電気機器 (10.4%)</b>				
コニカミノルタ	—	11.5	12,535	—
ブラザー工業	—	6.5	13,773	—
日立製作所	—	20	12,660	—
富士電機	—	20	12,700	—
東洋電機製造	15	—	—	—
シンフォニアテクノロジー	80	—	—	—
デンヨー	9	—	—	—
マブチモーター	—	2	12,220	—
東光高岳	7	—	—	—
田淵電機	40	35	12,810	—
J V C ケンウッド	50	—	—	—
第一精工	10	—	—	—
オムロン	4	—	—	—

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
日東工業	9	—	—
MC J	—	11	13,574
サクサホールディングス	—	55	13,145
日本電気	55	45	12,645
富士通	—	20	13,116
沖電気工業	—	8	12,904
電気興業	8	—	—
ジャパンディスプレイ	70	40	11,120
日本信号	14	—	—
富士通ゼネラル	—	6	13,332
タムラ製作所	—	30	13,620
ローランド ディー. ジー.	6	—	—
フォスター電機	—	7	13,384
SMK	—	30	13,320
ヒロセ電機	1.1	—	—
日本航空電子工業	—	5	7,830
古野電気	—	17	12,971
ユニデンホールディングス	—	70	11,690
アルパイン	12	—	—
スミダコーポレーション	—	5	6,635
横河電機	—	7	12,474
新電元工業	30	30	14,340
堀場製作所	3	—	—
エスベック	—	10	13,630
パナソニック デバイスSUNX	20	—	—
キーエンス	0.2	—	—
日置電機	7	—	—
OBARA GROUP	3.5	—	—
オブテックスグループ	4	—	—
千代田インテグレ	4	5	12,425
スタンレー電気	6	4	12,520
日本デジタル研究所	7	—	—
カシオ計算機	9.5	—	—
エンプラス	—	3	10,290
浜松ホトニクス	4.5	—	—
新光電気工業	22	16	12,880
京セラ	3	—	—
双葉電子工業	8	—	—
小糸製作所	—	2.2	12,826

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
キヤノン電子	9	7	12,656
リコー	—	14	14,014
<b>輸送用機器 (4.5%)</b>			
トヨタ紡織	6	—	—
豊田自動織機	—	2.4	13,272
三井造船	90	70	13,020
川崎重工業	—	35	12,425
ニチユ三菱フォークリフト	—	17	12,053
日産自動車	—	7	7,784
いすゞ自動車	12	—	—
エフテック	—	9	12,375
日信工業	9	—	—
トビー工業	65	—	—
曙ブレーキ工業	—	40	11,680
タチエス	9	—	—
マツダ	10	4.5	7,206
今仙電機製作所	—	12	12,144
富士重工業	4	2	8,552
ヤマハ発動機	—	5.3	13,811
ショーワ	21	13	12,272
愛三工業	—	12	11,700
ヨロズ	10	8	14,488
シマノ	1	—	—
テイ・エス テック	4	—	—
<b>精密機器 (1.0%)</b>			
ナカニシ	—	3	13,275
ニコン	10	7.5	12,930
タムロン	8	—	—
HOYA	3.7	—	—
ノーリツ鋼機	18	12	11,580
<b>その他製品 (4.1%)</b>			
スノーピーク	3.5	—	—
パラマウントベッドホールディングス	3	3	12,795
トランザクシオン	7	12	12,168
ニホンフラッシュ	11	9	11,943
SHOE I	9	—	—
パイロットコーポレーション	3	—	—
廣済堂	34	32	12,352
大建工業	—	6	13,194

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
凸版印刷	16	11	12,408	
大日本印刷	14	10	12,180	
アシックス	—	6.3	12,562	
小松ウオール工業	6	—	—	
ヤマハ	—	4.3	12,581	
ビジョン	5	—	—	
リンテック	3	5	12,110	
グローブライド	6	6	10,446	
美津濃	—	22	13,112	
アデランス	10	—	—	
<b>陸運業 (3.1%)</b>				
相鉄ホールディングス	—	10	5,650	
東京急行電鉄	19	—	—	
京浜急行電鉄	15	—	—	
東日本旅客鉄道	—	1.2	12,240	
西日本旅客鉄道	2.5	1.7	12,685	
東海旅客鉄道	0.9	0.7	12,925	
西日本鉄道	15	15	7,440	
ハマキョウレックス	—	5	11,470	
阪急阪神ホールディングス	—	3.3	12,358	
日本通運	30	22	12,936	
センコー	—	15	11,190	
トナミホールディングス	10	—	—	
神奈川中央交通	14	—	—	
丸和運輸機関	5	5	12,680	
<b>海運業 (-%)</b>				
日本郵船	80	—	—	
<b>倉庫・運輸関連業 (1.0%)</b>				
三井倉庫ホールディングス	40	35	12,005	
上組	17	12	12,852	
郵船ロジスティクス	5	11	13,475	
<b>情報・通信業 (5.2%)</b>				
NECネットエスアイ	8	6	12,780	
ソフトクリエイトホールディングス	5	—	—	
三菱総合研究所	—	4	12,500	
ファインデックス	8	—	—	
ディー・エル・イー	10	—	—	
日本アジアグループ	—	15	6,315	
豆蔵ホールディングス	15	12	10,608	

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
SRAホールディングス	—	2	5,780	
コムチュア	4	3.5	12,897	
野村総合研究所	4.2	—	—	
ソースネクスト	20	20	12,640	
フジ・メディア・ホールディングス	7	8	12,408	
フューチャー	18	—	—	
CAC Holdings	17	7.5	8,422	
アイティフォー	15	—	—	
東計電算	6	5.5	12,265	
大塚商会	3.4	—	—	
スカラ	16	15	12,660	
ネットワンシステムズ	—	15	12,990	
アルゴグラフィックス	6.5	5	12,725	
エイベックス・グループ・ホールディングス	10	—	—	
兼松エレクトロニクス	4	—	—	
コネクシオ	—	8	13,088	
カドカワ	—	3	5,022	
エヌ・ティ・ティ・データ	—	2.4	12,792	
DTS	6	—	—	
アイネス	—	10	11,190	
<b>卸売業 (7.7%)</b>				
エレマテック	—	6	11,718	
あらた	5	—	—	
アルフレッサ ホールディングス	—	7	14,266	
アルコニクス	8	—	—	
ベッパーフードサービス	—	6	8,850	
あい ホールディングス	5	—	—	
ダイワボウホールディングス	—	30	9,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	8	—	—	
UKCホールディングス	6	6	13,386	
三洋貿易	8	7.5	13,485	
シップヘルスケアホールディングス	—	4	12,900	
伯東	8	—	—	
メディバルホールディングス	8.5	7.2	13,312	
アドヴァン	12	—	—	
丸文	20	16	11,936	
マルカキカイ	8	—	—	
I DOM	—	17	12,903	
伊藤忠商事	13	—	—	

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
兼松	80	70	13,580
カメイ	15	9	11,925
スターゼン	3	2.5	11,925
山善	10	—	—
神鋼商事	5	4	9,872
イワキ	—	16	5,024
稲畑産業	12	—	—
ワキタ	20	12	12,588
サンワテクノス	17	13	14,547
新光商事	—	9	11,871
ヤマタネ	40	7	11,480
日鉄住金物産	—	2.7	13,162
モリト	—	12	11,856
イノテック	—	20	14,800
因幡電機産業	4	—	—
スズケン	—	3.5	13,300
<b>小売業 (10.2%)</b>			
ローソン	—	1.5	11,700
アダストリア	5	4	11,216
キャンドゥ	—	7	12,747
バルグループホールディングス	5	4.5	12,127
エディオン	—	12	12,288
ひらまつ	9	14	9,366
大黒天物産	2	—	—
DCMホールディングス	15	12	11,748
アークランドサービスホールディングス	3	3	9,420
ブロンコピリー	3	3	8,394
物語コーポレーション	1.5	2	9,240
ココカラファイン	3.5	—	—
ウエルシアホールディングス	2	—	—
エー・ピーカンパニー	5	10	8,610
チムニー	2	—	—
ネクステージ	5	—	—
鳥貴族	3	4	9,560
すかいらーく	—	5	8,100
日本調剤	3.5	—	—
コスモス薬品	—	0.6	12,594
セブン&アイ・ホールディングス	3.3	2.8	12,280
クリエイト・レストランツ・ホールディング	6	8	7,872

銘柄	期首(前期末)	当 期 末	
	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千円
ツルハホールディングス	1.4	—	—
サンマルクホールディングス	3	2.5	8,562
トリドールホールディングス	3.8	3.8	8,804
メディカルシステムネットワーク	27	30	13,500
ノジマ	9	9	12,960
良品計画	0.7	—	—
コーナン商事	—	6	12,684
エコス	5	7	8,428
ハイデイ日高	3	4.2	9,874
上新電機	15	—	—
しまむら	1.1	—	—
高島屋	—	12	12,204
エイチ・ツー・オー リテイリング	—	6.5	12,473
パルコ	14	11	13,101
イオン	—	8	13,328
ケーズホールディングス	7	—	—
ヤマダ電機	30	21.5	12,233
アークランドサカモト	11	9	13,014
ミニストップ	6	6	12,654
アークス	—	5	12,705
パローホールディングス	5	4	11,080
サンドラッグ	1.8	—	—
ペルーナ	21	15	12,900
<b>不動産業 (3.3%)</b>			
三栄建築設計	10	7	10,850
野村不動産ホールディングス	—	7	13,594
フージャースホールディングス	15	—	—
オープンハウス	—	4.5	12,222
東急不動産ホールディングス	25	18	11,700
飯田グループホールディングス	8.2	6.5	12,304
ムゲンエステート	—	10	7,430
三井不動産	6	—	—
東京建物	11	—	—
京阪神ビルディング	—	10	6,530
大京	50	—	—
住友不動産販売	4.5	—	—
レーサム	—	10	9,670
イオンモール	—	7.5	12,847
トーセイ	—	10	7,700

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
サンフロンティア不動産	10	8	8	160
エフ・ジェー・ネクスト	—	10	10	7,880
<b>サービス業 (8.2%)</b>				
日本工営	20	—	—	—
ジェイエイシーリクルートメント	11	9	9	14,265
日本M&Aセンター	2	3	3	10,380
タケエイ	15	—	—	—
G C A	—	14	14	13,580
総合警備保障	3	—	—	—
夢真ホールディングス	—	16	16	13,072
セントケア・ホールディング	—	7.5	7.5	12,720
エムスリー	5	—	—	—
ワールドホールディングス	10	6	6	12,240
博報堂D Yホールディングス	—	9	9	12,240
エスアールジータカミヤ	—	20	20	11,500
E P Sホールディングス	10	—	—	—
アミューズ	—	2	2	4,142
クイック	10	—	—	—
イオンファンタジー	—	4	4	12,160
みらかホールディングス	—	2.3	2.3	12,121
明光ネットワークジャパン	—	10	10	12,280
ファルコホールディングス	8	4	4	5,976

銘柄	期首(前期末)		当 期 末	
	株 数	株 数	株 数	評 価 額
	千株	千株	千株	千円
ラウンドワン	—	15	15	12,735
ビー・エム・エル	—	5	5	12,385
りらいあコミュニケーションズ	—	11	11	12,144
テー・オー・ダブリュー	—	6	6	4,134
M&Aキャピタルパートナーズ	3	—	—	—
ウィルグループ	—	17	17	12,648
エスクロー・エージェント・ジャパン	4	—	—	—
日本ビューホテル	—	5	5	6,835
ベルシステム24ホールディングス	—	13	13	12,506
東洋	—	2.5	2.5	12,275
エイチ・アイ・エス	4.5	4	4	11,952
東京都競馬	40	—	—	—
トランス・コスモス	—	5	5	13,100
KNT-CTホールディングス	80	—	—	—
セコム	—	1.5	1.5	12,318
応用地質	10	9	9	12,924
学究社	—	8	8	13,160
イオンディライト	4	—	—	—
ダイセキ	7	—	—	—
合 計	株 数・金 額	4,179	3,732	3,608,185
	銘柄数<比率>	303	306	<86.8%>

(注) 銘柄欄の( )内は、国内株式の評価総額に対する各業種の比率。

(注) 評価額欄の< >内は、純資産総額に対する評価額の比率。



## ○信用取引の状況

(2017年2月24日現在)

銘柄	信用取引売建残高	
	当期末	
	株数	評価額
信用取引売建	千株 3,430	千円 3,568,069

## ○投資信託財産の構成

(2017年2月24日現在)

項目	当期末	
	評価額	比率
株式	千円 3,608,185	% 46.6
コール・ローン等、その他	4,134,212	53.4
投資信託財産総額	7,742,397	100.0

## ○資産、負債、元本及び基準価額の状況 (2017年2月24日現在)

項 目	当 期 末
	円
(A) 資産	9,908,171,393
コール・ローン等	867,171,191
株式(評価額)	3,608,185,650
信用取引預け金	3,256,284,852
未収配当金	10,756,250
差入保証金	2,165,773,450
(B) 負債	5,749,796,555
信用売証券	3,568,069,050
未払解約金	6,821,429
未払利息	898
差入保証金代用有価証券	2,165,773,450
その他未払費用	9,131,728
(C) 純資産総額(A-B)	4,158,374,838
元本	2,908,006,586
次期繰越損益金	1,250,368,252
(D) 受益権総口数	2,908,006,586口
1万口当たり基準価額(C/D)	14,300円

## &lt;注記事項&gt;

- ①期首元本額 3,172,588,604円  
 期中追加設定元本額 153,925,974円  
 期中一部解約元本額 418,507,992円  
 また、1口当たり純資産額は、期末14,300円です。

## ②期末における元本の内訳(当親投資信託を投資対象とする投資信託ごとの元本額)

日本株プライムニュートラル・ファンド(ラップ向け)	2,032,175,428円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定型)	266,534,182円
三菱UFJ アドバンスト・バランス(安定成長型)	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)	71,324,721円
合計	2,908,006,586円

## ③担保資産

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を行っております。  
 株式 2,309,208,900円

## ○損益の状況 (2016年8月25日～2017年2月24日)

項 目	当 期
	円
(A) 配当等収益	37,041,007
受取配当金	37,247,300
受取利息	5,968
その他収益金	1,401
支払利息	△ 213,662
(B) 有価証券売買損益	286,933,380
売買益	1,199,590,830
売買損	△ 912,657,450
(C) 保管費用等	△ 40,018,058
(D) 当期損益金(A+B+C)	283,956,329
(E) 前期繰越損益金	1,072,144,197
(F) 追加信託差損益金	57,706,553
(G) 解約差損益金	△ 163,438,827
(H) 計(D+E+F+G)	1,250,368,252
次期繰越損益金(H)	1,250,368,252

- (注) (B)有価証券売買損益は期末の評価換えによるものを含みます。  
 (注) (F)追加信託差損益金とあるのは、信託の追加設定の際、追加設定をした価額から元本を差し引いた差額分をいいます。  
 (注) (G)解約差損益金とあるのは、中途解約の際、元本から解約価額を差し引いた差額分をいいます。