

日本株マーケット・ニュートラル [愛称：ニュートロン (NEUTRON)]

追加型証券投資信託 / ファンド・オブ・ファンズ

投資信託説明書 (目論見書) 訂正事項分

2007.01

1. この投資信託説明書 (目論見書) により行う「日本株マーケット・ニュートラル」の募集について、委託会社は証券取引法 (昭和23年法第25号) 第5条の規定に基づく有価証券届出書を平成18年7月20日に関東財務局長に提出しており、平成18年7月21日にその届出の効力が生じております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成19年1月19日に関東財務局長に提出しております。
2. 「日本株マーケット・ニュートラル」の価額は、同ファンドに組み入れられる有価証券等の値動き、為替相場の変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属いたします。当ファンドは元本が保証されているものではありません。

ソシエテ ジェネラル アセット マネジメント

日本株マーケット・ニュートラル [愛称：ニュートロン (NEUTRON)]

追加型証券投資信託 / ファンド・オブ・ファンズ

投資信託説明書 (交付目論見書) 訂正事項分

2007.01

1. この投資信託説明書 (交付目論見書) により行う「日本株マーケット・ニュートラル」の募集については、委託会社は証券取引法 (昭和23年法第25号) 第5条の規定に基づく有価証券届出書を平成18年7月20日に関東財務局長に提出しており、平成18年7月21日にその届出の効力が生じております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成19年1月19日に関東財務局長に提出しております。
2. この投資信託説明書 (交付目論見書) は、証券取引法第13条の規定にもとづく目論見書のうち、同法第15条第2項の規定に基づき、投資家がファンドを取得する際にあらかじめまたは同時に交付される目論見書です。
3. 投資信託説明書 (請求目論見書) は、証券取引法第13条の規定にもとづく目論見書のうち、投資家の請求により交付される目論見書です。なお、請求目論見書をご請求された場合は、投資家の皆様ご自身でその旨を記録されるようお願いいたします。
4. 「日本株マーケット・ニュートラル」の価額は、同ファンドに組み入れられる有価証券等の値動き、為替相場の変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属いたします。当ファンドは元本が保証されているものではありません。

ソシエテ ジェネラル アセット マネジメント

・投資信託説明書 (交付目論見書) の訂正理由

平成19年1月19日に有価証券届出書の訂正届出書を提出したことに伴い、「日本株マーケット・ニュートラル」の投資信託説明書 (交付目論見書) 2006年7月 (以下「原交付目論見書」といいます。) の記載事項のうち、新たな情報に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するものです。

・訂正の内容

原交付目論見書の内容が訂正事項の内容に変更されます。

第二部 ファンド情報

第1 ファンドの状況

5 運用状況（原交付目論見書26～30ページ）

全文が以下の通り更新訂正されます。以下は訂正後の内容のみ記載しております。

(1) 投資状況

平成18年11月末日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド 投資証券	ケイマン	1,799,174,000	95.12
りそな・短期金融資産マザーファンド 受益証券	日本	30,065,018	1.59
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	62,171,794	3.29
合計（純資産総額）	-	1,891,410,812	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比率をいいます。

(参考)

ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド

平成18年11月末日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	1,200,910,758	66.75
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	598,323,445	33.25
合計（純資産総額）	-	1,799,234,203	100.00

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

りそな・短期金融資産マザーファンド

平成18年11月末日現在

資産の種類	国名	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	19,992,268	66.50
現金・預金・その他の資産（負債控除後）	-	10,073,299	33.50
合計（純資産総額）	-	30,065,567	100.00

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

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

平成18年11月末日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量 (口)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額(円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額(円)	投資 比率 (%)
1	ケイマン	投資証券	ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド	169,000	10,650	1,799,850,000	10,646	1,799,174,000	95.12
2	日本	親投資信託 受益証券	りそな・短期金融資産 マザーファンド	30,028,984	10,009	30,056,010	10,012	30,065,018	1.59

* 全2銘柄

* 投資比率とは、ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価比率をいいます。

* 投資証券、親投資信託受益証券の数量は、所有口数を表示しております。

* りそな・短期金融資産マザーファンドの単価は、1万口当たりの価額です。

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) ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンドの投資資産
投資有価証券の主要銘柄

平成18年11月末日現在

順位	国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量 (株)	帳簿金額		時価評価額		投資 比率 (%)
						単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	日本	株式	東京電力	電気・ガス業	9,000	3,135.19	28,216,738	3,510	31,590,000	1.76
2	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	38	912,034.74	34,657,320	830,000	31,540,000	1.75
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	53	549,591.98	29,128,375	577,000	30,581,000	1.70
4	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	21,000	1,281.07	26,902,476	1,390	29,190,000	1.62
5	日本	株式	キヤノン	電気機器	4,250	5,206.39	22,127,145	5,980	25,415,000	1.41
6	日本	株式	大和証券グループ本社	証券・商品先物取引業	19,000	981.81	18,654,450	1,234	23,446,000	1.30
7	日本	株式	三菱商事	卸売業	10,600	2,429.91	25,757,017	2,065	21,889,000	1.22
8	日本	株式	新日本製鐵	鉄鋼	42,000	456.87	19,188,422	501	21,042,000	1.17
9	日本	株式	東洋水産	食料品	12,000	1,779.58	21,354,938	1,680	20,160,000	1.12
10	日本	株式	ジェイエフイーホールディングス	鉄鋼	3,900	4,160.52	16,226,032	5,140	20,046,000	1.11
11	日本	株式	商船三井	海運業	20,000	804.26	16,085,251	996	19,920,000	1.11
12	日本	株式	マツダ	輸送用機器	26,000	675.28	17,557,281	766	19,916,000	1.11
13	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	22,000	823.65	18,120,251	886	19,492,000	1.08
14	日本	株式	椿本チエイン	機械	30,000	674.77	20,243,160	639	19,170,000	1.07
15	日本	株式	KDDI	情報・通信業	23	589,847.43	13,566,491	783,000	18,009,000	1.00
16	日本	株式	リコー	電気機器	8,000	2,227.81	17,822,469	2,160	17,280,000	0.96
17	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	2,200	7,552.56	16,615,623	7,410	16,302,000	0.91
18	日本	株式	大日本インキ化学工業	化学	36,000	394.80	14,212,942	447	16,092,000	0.89
19	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	4,000	3,918.74	15,674,964	3,970	15,880,000	0.88
20	日本	株式	ユー・エス・エス	サービス業	2,150	7,594.92	16,329,088	7,230	15,544,500	0.86
21	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	19	646,244.74	12,278,650	805,000	15,295,000	0.85
22	日本	株式	大成建設	建設業	44,000	471.99	20,767,527	347	15,268,000	0.85
23	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	13	1,230,245.23	15,993,188	1,170,000	15,210,000	0.85
24	日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	29	448,486.07	13,006,096	509,000	14,761,000	0.82
25	日本	株式	スタンレー電気	電気機器	6,200	2,211.72	13,712,652	2,350	14,570,000	0.81
26	日本	株式	サンケン電気	電気機器	10,000	1,462.22	14,622,229	1,370	13,700,000	0.76
27	日本	株式	三菱マテリアル	非鉄金属	32,000	489.08	15,650,546	428	13,696,000	0.76
28	日本	株式	富士電機ホールディングス	電気機器	22,000	608.92	13,396,150	621	13,662,000	0.76
29	日本	株式	新日鉱ホールディングス	石油・石炭製品	17,000	933.45	15,868,600	790	13,430,000	0.75
30	日本	株式	大阪瓦斯	電気・ガス業	31,000	392.03	12,153,027	413	12,803,000	0.71

* 上位30銘柄

* 投資比率は、外国ファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価比率をいいます。

種類別及び業種別投資比率

	種類	地域	業種	投資比率 (%)		種類	地域	業種	投資比率 (%)
1	株式	日本	電気機器	9.08	16	株式	日本	医薬品	1.53
2	株式	日本	銀行業	7.72	17	株式	日本	その他金融業	1.47
3	株式	日本	卸売業	5.34	18	株式	日本	海運業	1.45
4	株式	日本	輸送用機器	4.94	19	株式	日本	繊維製品	1.17
5	株式	日本	機械	4.04	20	株式	日本	小売業	1.04
6	株式	日本	電気・ガス業	3.61	21	株式	日本	石油・石炭製品	1.00
7	株式	日本	情報・通信業	3.57	22	株式	日本	サービス業	0.96
8	株式	日本	鉄鋼	2.99	23	株式	日本	精密機器	0.58
9	株式	日本	建設業	2.55	24	株式	日本	その他製品	0.55
10	株式	日本	陸運業	2.49	25	株式	日本	ガラス・土石製品	0.28
11	株式	日本	化学	2.23	26	株式	日本	鉱業	0.26
12	株式	日本	非鉄金属	2.12	27	株式	日本	ゴム製品	0.26
13	株式	日本	食料品	1.82	28	株式	日本	倉庫・運輸関連業	0.23
14	株式	日本	証券・商品先物取引業	1.72	29	株式	日本	金属製品	0.17
15	株式	日本	不動産業	1.59	合計				66.75

* 投資比率は、外国ファンドの純資産総額に対する各業種の時価比率をいいます。

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) りそな・短期金融資産マザーファンドの投資資産

投資有価証券の主要銘柄

平成18年11月末日現在

順位	国/地域	種類	銘柄名	券面総額 (円)	帳簿価額 単価 (円)	帳簿価額 金額 (円)	評価額 単価 (円)	評価額 金額 (円)	利率 (%)	償還期限	投資比率 (%)
1	日本	国債証券	第410回政府短期証券	20,000,000	99.96	19,992,268	99.96	19,992,268	0	2007/1/11	66.50

* 全1銘柄

* 投資比率は、マネーファンドの純資産総額に対する各銘柄の時価評価額比率をいいます。

種類別投資比率

地域	種類	投資比率 (%)
日本	国債証券	66.50
合計		66.50

* 投資比率はマネーファンドの純資産総額に対する時価比率をいいます。

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

平成 18 年 11 月末日（直近日）現在、同日前 1 年以内における各月末およびファンド設定時からの各計算期間末におけるファンドの純資産総額および基準価額（1 万口当たりの純資産額）の推移は次の通りです。

	純資産総額（百万円）		基準価額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期末（平成14年10月21日）	14,053	14,053	10,006	10,006
第2期末（平成15年4月21日）	12,351	12,351	9,782	9,782
第3期末（平成15年10月20日）	9,219	9,219	9,705	9,705
第4期末（平成16年4月20日）	6,011	6,011	10,094	10,094
第5期末（平成16年10月20日）	3,544	3,544	10,315	10,315
第6期末（平成17年4月20日）	2,822	2,891	10,200	10,450
第7期末（平成17年10月20日）	2,535	2,598	10,148	10,398
第8期末（平成18年4月20日）	2,335	2,335	9,844	9,844
第9期末（平成18年10月20日）	1,952	1,952	9,646	9,646
平成17年11月末日	2,427	-	9,928	-
12月末日	2,364	-	9,955	-
平成18年1月末日	2,495	-	9,804	-
2月末日	2,431	-	9,840	-
3月末日	2,370	-	9,826	-
4月末日	2,305	-	9,880	-
5月末日	2,235	-	9,889	-
6月末日	2,186	-	9,843	-
7月末日	2,139	-	9,870	-
8月末日	2,101	-	9,813	-
9月末日	1,956	-	9,633	-
10月末日	1,927	-	9,642	-
11月末日（直近日）	1,891	-	9,636	-

分配の推移

計算期間	1万口当たり分配金（円）
第1期計算期間（H14.4.12～H14.10.21）	0
第2期計算期間（H14.10.22～H15.4.21）	0
第3期計算期間（H15.4.22～H15.10.20）	0
第4期計算期間（H15.10.21～H16.4.20）	0
第5期計算期間（H16.4.21～H16.10.20）	0
第6期計算期間（H16.10.21～H17.4.20）	250
第7期計算期間（H17.4.21～H17.10.20）	250
第8期計算期間（H17.10.21～H18.4.20）	0
第9期計算期間（H18.4.21～H18.10.20）	0

収益率の推移

計算期間	収益率 (%)
第1期計算期間 (H14.4.12 ~ H14.10.21)	0.1
第2期計算期間 (H14.10.22 ~ H15.4.21)	2.2
第3期計算期間 (H15.4.22 ~ H15.10.20)	0.8
第4期計算期間 (H15.10.21 ~ H16.4.20)	4.0
第5期計算期間 (H16.4.21 ~ H16.10.20)	2.2
第6期計算期間 (H16.10.21 ~ H17.4.20)	1.3
第7期計算期間 (H17.4.21 ~ H17.10.20)	1.9
第8期計算期間 (H17.10.21 ~ H18.4.20)	3.0
第9期計算期間 (H18.4.21 ~ H18.10.20)	2.0

(注) 収益率の算出方法:

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。以下「前期末基準価額」といいます。)を控除した額を、前期末基準価額で除して100を乗じた数値です。

第2 財務ハイライト情報(原交付目論見書36~39ページ)

全文が以下の通り更新訂正されます。以下は訂正後の内容のみ記載しております。

(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)(以下、「投資信託財産計算規則」という。)に基づいて作成しております。

なお、投資信託財産計算規則は、平成18年4月20日付内閣府令第49号により改正されておりますが、第8期計算期間(平成17年10月21日から平成18年4月20日まで)については改正前の投資信託財産計算規則に基づき作成しており、第9期計算期間(平成18年4月21日から平成18年10月20日まで)については改正後の投資信託財産計算規則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。

また、ここに表示する財務諸表(貸借対照表および損益および剰余金計算書)は、「第三部ファンドの詳細情報 第4ファンドの経理状況」(投資信託説明書(請求目論見書))から抜粋して記載しております。

(2) 当ファンドは、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第8期計算期間(平成17年10月21日から平成18年4月20日まで)及び第9期計算期間(平成18年4月21日から平成18年10月20日まで)の財務諸表について、新日本監査法人による監査を受けており、その証明にかかる監査報告書は当該財務諸表に添付されております。

日本株マーケット・ニュートラル

1 貸借対照表

(単位：円)

科 目	期 別	第8期 (平成18年4月20日現在)	第9期 (平成18年10月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		41,147,261	90,803,148
投資証券		2,274,720,000	1,842,450,000
親投資信託受益証券		50,029,987	30,056,010
未収利息		1	373
流動資産合計		2,365,897,249	1,963,309,531
資産合計		2,365,897,249	1,963,309,531
負債の部			
流動負債			
未払解約金		21,572,753	2,744,273
未払受託者報酬		633,595	566,594
未払委託者報酬		8,616,774	7,705,694
その他未払費用		63,295	56,594
流動負債合計		30,886,417	11,073,155
負債合計		30,886,417	11,073,155
純資産の部			
元本等			
元本			
元本		2,372,040,093	2,023,787,711
剰余金			
期末欠損金		37,029,261	71,551,335
(分配準備積立金)		(31,250,412)	(26,635,620)
純資産合計		2,335,010,832	1,952,236,376
負債・純資産合計		2,365,897,249	1,963,309,531

2 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

科 目	期 別	第8期	第9期
		自 平成17年10月21日 至 平成18年 4月20日	自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		300	21,930
有価証券売買等損益		64,301,001	32,271,977
営業収益合計		64,300,701	32,250,047
営業費用			
受託者報酬		633,595	566,594
委託者報酬		8,616,774	7,705,694
その他費用		63,295	56,594
営業費用合計		9,313,664	8,328,882
営業損失金額		73,614,365	40,578,929
経常損失金額		73,614,365	40,578,929
当期純損失金額		73,614,365	40,578,929
一部解約に伴う当期純損失金額分配額		8,668,243	637,666
期首剰余金又は期首欠損金()		37,001,768	37,029,261
剰余金増加額又は欠損金減少額		-	5,469,598
当期一部解約に伴う欠損金減少額		-	5,469,598
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,084,907	50,409
当期一部解約に伴う剰余金減少額		5,562,738	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額		3,522,169	-
当期追加信託に伴う欠損金増加額		-	50,409
分配金		-	-
期末欠損金		37,029,261	71,551,335

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期 別 項 目	第8期 自 平成17年10月21日 至 平成18年 4月20日	第9期 自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日
<p>1. 運用資産の評価基準及び評価方法</p> <p>2. 費用・収益の計上基準</p> <p>3. 表示</p>	<p>投資証券、親投資信託受益証券基準価額で評価しております。</p> <p>有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>	<p>投資証券、親投資信託受益証券 同左</p> <p>有価証券売買等損益の計上基準 同左</p> <p>平成18年4月20日付内閣府令第49号による投資信託財産計算規則の改正により、表示方法が以下のとおり変更されております。</p> <p>(1) 貸借対照表 純資産の部は、従来の元本及び剰余金の区分から、元本等及び評価・換算差額等の区分となりました。ただし、評価・換算差額等の区分は記載すべき事項がないため、記載を省略しております。</p> <p>(2) 損益及び剰余金計算書 経常損益の部、営業損益の部の表示は廃止されました。また、営業損益、経常損益及び当期純損益は、当期から営業損益金額、経常損益金額及び当期純損益金額としております。</p>
<p>4. その他</p>	<p>当ファンドの計算期間は平成17年10月21日から平成18年4月20日までとなっております。</p>	<p>当ファンドの計算期間は平成18年4月21日から平成18年10月20日までとなっております。</p>

日本株マーケット・ニュートラル [愛称：ニュートロン (NEUTRON)]

追加型証券投資信託 / ファンド・オブ・ファンズ

投資信託説明書（請求目論見書）訂正事項分

2007.01

1. この投資信託説明書（請求目論見書）により行う「日本株マーケット・ニュートラル」の募集については、委託会社は証券取引法（昭和23年法第25号）第5条の規定に基づく有価証券届出書を平成18年7月20日に関東財務局長に提出しており、平成18年7月21日にその届出の効力が生じております。また、同法第7条の規定により有価証券届出書の訂正届出書を平成19年1月19日に関東財務局長に提出しております。
2. この投資信託説明書（請求目論見書）は、証券取引法第13条の規定にもとづく目論見書のうち、同法第15条第3項の規定に基づき、投資家の請求により交付される目論見書です。
3. 「日本株マーケット・ニュートラル」の価額は、同ファンドに組み入れられる有価証券等の値動き、為替相場の変動等による影響を受けますが、これらの運用による損益はすべて投資家の皆様に帰属いたします。当ファンドは元本が保証されているものではありません。

ソシエテ ジェネラル アセット マネジメント

投資信託説明書（請求目論見書）の訂正理由

平成19年1月19日に有価証券届出書の訂正届出書を提出したことに伴い、「日本株マーケット・ニュートラル」の投資信託説明書（請求目論見書）2006年7月（以下「原請求目論見書」といいます。）の記載事項のうち、新たな情報に訂正すべき事項がありますので、これを訂正するものです。

訂正の内容

原請求目論見書の内容が訂正事項の内容に変更されます。

第4 ファンドの経理状況（原請求目論見書11～29ページ）

全文が以下の通り更新訂正されます。訂正後の内容のみ記載しております。

- (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）（以下、「投資信託財産計算規則」という。）に基づいて作成しております。

なお、投資信託財産計算規則は、平成18年4月20日付内閣府令第49号により改正されておりますが、第8期計算期間（平成17年10月21日から平成18年4月20日まで）については改正前の投資信託財産計算規則に基づき作成しており、第9期計算期間（平成18年4月21日から平成18年10月20日まで）については改正後の投資信託財産計算規則に基づいて作成しております。

また、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、証券取引法第193条の2の規定に基づき、第8期計算期間（平成17年10月21日から平成18年4月20日まで）及び第9期計算期間（平成18年4月21日から平成18年10月20日まで）の財務諸表について、新日本監査法人による監査を受けております。

独立監査人の監査報告書

平成18年6月20日

ソシエテジェネラルアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本監査法人

代表社員
業務執行社員 公認会計士

水守 理智 

代表社員
業務執行社員 公認会計士

英 公一 

当監査法人は、証券取引法第193条の2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マーケット・ニュートラルの平成17年10月21日から平成18年4月20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、及び附属明細表について監査を行った。この財務諸表の作成責任は経営者にあり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、日本株マーケット・ニュートラルの平成18年4月20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。

ソシエテジェネラルアセットマネジメント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

独立監査人の監査報告書

平成18年12月19日

ソシエテジェネラルアセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

新日本監査法人

代表社員 公認会計士
業務執行社員

水守理智 

代表社員 公認会計士
業務執行社員

英 一 

当監査法人は、証券取引法第193条の2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マーケット・ニュートラルの平成18年4月21日から平成18年10月20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。この財務諸表の作成責任は経営者であり、当監査法人の責任は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の表示がないかどうかの合理的な保証を得ることを求めている。監査は、試査を基礎として行われ、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を含んでいる。当監査法人は、監査の結果として意見表明のための合理的な基礎を得たと判断している。

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、日本株マーケット・ニュートラルの平成18年10月20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。

ソシエテジェネラルアセットマネジメント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

1 財務諸表

日本株マーケット・ニュートラル

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科 目	期 別	第8期 (平成18年4月20日現在)	第9期 (平成18年10月20日現在)
		金 額	金 額
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		41,147,261	90,803,148
投資証券		2,274,720,000	1,842,450,000
親投資信託受益証券		50,029,987	30,056,010
未収利息		1	373
流動資産合計		2,365,897,249	1,963,309,531
資産合計		2,365,897,249	1,963,309,531
負債の部			
流動負債			
未払解約金		21,572,753	2,744,273
未払受託者報酬		633,595	566,594
未払委託者報酬		8,616,774	7,705,694
その他未払費用		63,295	56,594
流動負債合計		30,886,417	11,073,155
負債合計		30,886,417	11,073,155
純資産の部			
元本等			
元本			
元本		2,372,040,093	2,023,787,711
剰余金			
期末欠損金		37,029,261	71,551,335
(分配準備積立金)		(31,250,412)	(26,635,620)
純資産合計		2,335,010,832	1,952,236,376
負債・純資産合計		2,365,897,249	1,963,309,531

(2) 損益及び剰余金計算書

(単位：円)

科 目	期 別	第8期	第9期
		自 平成17年10月21日 至 平成18年 4月20日	自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日
		金 額	金 額
営業収益			
受取利息		300	21,930
有価証券売買等損益		64,301,001	32,271,977
営業収益合計		64,300,701	32,250,047
営業費用			
受託者報酬		633,595	566,594
委託者報酬		8,616,774	7,705,694
その他費用		63,295	56,594
営業費用合計		9,313,664	8,328,882
営業損失金額		73,614,365	40,578,929
経常損失金額		73,614,365	40,578,929
当期純損失金額		73,614,365	40,578,929
一部解約に伴う当期純損失金額分配額		8,668,243	637,666
期首剰余金又は期首欠損金()		37,001,768	37,029,261
剰余金増加額又は欠損金減少額		-	5,469,598
当期一部解約に伴う欠損金減少額		-	5,469,598
剰余金減少額又は欠損金増加額		9,084,907	50,409
当期一部解約に伴う剰余金減少額		5,562,738	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額		3,522,169	-
当期追加信託に伴う欠損金増加額		-	50,409
分配金		-	-
期末欠損金		37,029,261	71,551,335

(3) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期 別	第8期 自 平成17年10月21日 至 平成18年 4月20日	第9期 自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日
項 目		
1. 運用資産の評価基準及び評価方法	投資証券、親投資信託受益証券 基準価額で評価しております。	投資証券、親投資信託受益証券 同左
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。	有価証券売買等損益の計上基準 同左
3. 表示		平成18年4月20日付内閣府令第49号による 投資信託財産計算規則の改正により、表示 方法が以下のとおり変更されております。 (1) 貸借対照表 純資産の部は、従来の元本及び剰余金の 区分から、元本等及び評価・換算差額等 の区分となりました。ただし、評価・換 算差額等の区分は記載すべき事項がない ため、記載を省略しております。 (2) 損益及び剰余金計算書 経常損益の部、営業損益の部の表示は廃 止されました。また、営業損益、経常損 益及び当期純損益は、当期から営業損益 金額、経常損益金額及び当期純損益金額 としております。
4. その他	当ファンドの計算期間は平成17年10月 21日から平成18年4月20日までとなってお ります。	当ファンドの計算期間は平成18年4月21 日から平成18年10月20日までとなってお ります。

(貸借対照表に関する注記)

第8期 (平成18年 4月20日現在)	第9期 (平成18年10月20日現在)
1. 投資信託財産計算規則第41条の2に規定する額	1. 計算期間の末日における受益権の総数 2,023,787,711口
元本の欠損 37,029,261円	2. 投資信託財産計算規則第55条の6第1項第10 号に規定する額 元本の欠損 71,551,335円
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の 額	3. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の 額
1口当たり純資産額 0.9844円 (10,000口当たり純資産額 9,844円)	1口当たり純資産額 0.9646円 (10,000口当たり純資産額 9,646円)

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第8期 自 平成17年10月21日 至 平成18年 4月20日	第9期 自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日
1. 受託会社との取引高 営業取引 (受託者報酬) 633,595円	1. 受託会社との取引高 営業取引 (受託者報酬) 566,594円
2. 分配金の計算過程 該当事項はありません。	2. 分配金の計算過程 該当事項はありません。

(重要な後発事象に関する注記)

第8期 (自 平成17年10月21日 至 平成18年4月20日)

該当事項はありません。

第9期 (自 平成18年4月21日 至 平成18年10月20日)

該当事項はありません。

(その他の注記)

1. 元本の移動

第8期 自 平成17年10月21日 至 平成18年 4月20日	第9期 自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日
期首元本額 2,498,633,825円	期首元本額 2,372,040,093円
期中追加設定元本額 287,032,746円	期中追加設定元本額 2,134,494円
期中一部解約元本額 413,626,478円	期中一部解約元本額 350,386,876円

2. 売買目的有価証券の貸借対照表計上額等

種 類	第8期 自 平成17年10月21日 至 平成18年 4月20日		第9期 自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日	
	貸借対照表計上額 (円)	損益に含まれた 評価差額 (円)	貸借対照表計上額 (円)	損益に含まれた 評価差額 (円)
投資証券	2,274,720,000	58,965,900	1,842,450,000	31,486,000
親投資信託受益証券	50,029,987	1	30,056,010	24,023
合 計	2,324,749,987	58,965,901	1,872,506,010	31,461,977

3. デリバティブ取引関係

第8期 (自 平成17年10月21日 至 平成18年4月20日)

該当事項はありません。

第9期 (自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日)

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

(平成18年10月20日現在)

種類	銘柄	口数(口)	評価額(円)	備考
投資証券	ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド	173,000	1,842,450,000	
小計	銘柄数:1		1,842,450,000	
	組入時価比率:94.4%		98.4%	
親投資信託 受益証券	りそな・短期金融資産マザーファンド	30,028,984	30,056,010	
小計	銘柄数:1		30,056,010	
	組入時価比率:1.5%		1.6%	
合計			1,872,506,010	

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 有価証券先物取引等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

ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド

当ファンドはソシエテジェネラルアセットマネジメントオルタナティブインベストメンツ社の設定、運用する投資証券「ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド」を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された投資証券はすべてこの投資証券であります。尚、同投資証券の状況は次の通りです。

- 1 「ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド」の状況
以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科 目	対象年月日	(平成18年10月18日現在)
		金 額
資 産		
株式簿価金額		1,163,435,712
未実現評価損益		32,721,269
現金		1,642,904,521
未収入金		19,263,506
未収利息		11,741
未収配当金		3,518,161
資 産 合 計		2,861,831,428
負 債		
未払金		28,108,262
株式空売証券		983,468,495
未払投資顧問報酬		4,127,102
未払監査費用		1,148,423
未払管理事務代行報酬		422,172
未払保管報酬		1,269,486
その他未払費用		913,035
負 債 合 計		1,019,456,975
元 本		1,730,000,000
純資産合計		1,842,374,453
負債・純資産合計		2,861,831,428

注) 未実現評価損益には保有する株式の評価損益のほか、株式空売証券、先物取引の評価損益を含んでおります。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期 別	自 平成18年 4月19日 至 平成18年10月18日
項 目	
1. 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 株式 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、市場価額のある有価証券についてはその最終相場（計算日に最終相場のない場合には、直近の日の最終相場）で評価しております。 (2) 先物取引 国内先物の評価においては、取引所の発表する計算日の清算値段又は証拠金算定基準値段を用いております。
2. 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は、原則として株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額、未だ確定していない場合は予想配当金額の93%を計上し、残額については入金時に計上しております。 (2) 有価証券売買等損益、派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。 (3) その他 貸借対照表は資産の管理会社であるダイワ・セキュリティーズ・トラスト・アンド・バンキング（ヨーロッパ）ピーエルシーが作成する財務諸表に基づいて作成しております。

(その他の注記)

(平成18年10月18日現在)	
1. 期首	平成18年4月19日
期首元本額	2,100,000,000円
期首より平成18年10月18日までの期中追加設定元本額	- 円
期首より平成18年10月18日までの期中一部解約元本額	370,000,000円
期末元本額	1,730,000,000円
期末元本額の内訳	
日本株マーケット・ニュートラル	1,730,000,000円
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	10,650円

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(平成18年10月18日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	国際石油開発帝石ホールディングス	5	935,000	4,675,000	
	大成建設	44,000	423	18,612,000	
	積水ハウス	1,000	1,862	1,862,000	
	関電工	4,000	786	3,144,000	
	協和エクシオ	12,000	1,173	14,076,000	
	森永製菓	12,000	282	3,384,000	
	NECフィールディング	1,000	1,705	1,705,000	
	味の素	3,000	1,325	3,975,000	
	東洋水産	12,000	1,705	20,460,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	東洋紡績	12,000	310	3,720,000	
	日清紡績	3,000	1,228	3,684,000	
	J F E 商事ホールディングス	2,000	468	936,000	
	帝人	7,000	641	4,487,000	
	住友化学	5,000	876	4,380,000	
	石原産業	2,000	171	342,000	
	東ソー	3,000	498	1,494,000	
	協和醗酵工業	2,000	880	1,760,000	
	三井化学	5,000	840	4,200,000	
	ダイセル化学工業	18,000	792	14,256,000	
	旭電化工業	200	1,185	237,000	
	アステラス製薬	4,900	5,180	25,382,000	
	みらかホールディングス	900	2,710	2,439,000	
	大日本インキ化学工業	36,000	441	15,876,000	
	ユー・エス・エス	2,150	7,670	16,490,500	
	東京個別指導学院	200	294	58,800	
	新日本石油	2,000	858	1,716,000	
	昭和シェル石油	2,300	1,312	3,017,600	
	新日鉱ホールディングス	15,000	857	12,855,000	
	日本板硝子	2,000	528	1,056,000	
	日本特殊陶業	2,000	2,575	5,150,000	
	新日本製鐵	52,000	493	25,636,000	
	ジェイ エフ イー ホールディングス	3,700	4,570	16,909,000	
	東京製鐵	3,100	1,904	5,902,400	
	大和工業	1,000	2,535	2,535,000	
	日本金属工業	6,000	317	1,902,000	
	大平洋金属	3,000	1,021	3,063,000	
	日本軽金属	5,000	289	1,445,000	
	三井金属鉱業	9,000	608	5,472,000	
	東邦亜鉛	4,000	940	3,760,000	
	三菱マテリアル	35,000	477	16,695,000	
	住友金属鉱山	2,000	1,573	3,146,000	
	同和鉱業	6,000	1,030	6,180,000	
	住友軽金属工業	2,000	244	488,000	
	住友電気工業	3,100	1,702	5,276,200	
	日本フィルコン	500	1,323	661,500	
	東京製綱	12,000	226	2,712,000	
	森精機製作所	1,300	2,460	3,198,000	
	東洋機械金属	4,500	960	4,320,000	
	小松製作所	2,800	2,200	6,160,000	
	日立建機	4,600	2,880	13,248,000	
	クボタ	7,000	1,074	7,518,000	
	新東工業	2,000	1,299	2,598,000	
	アイチ コーポレーション	200	1,282	256,400	
	椿本チエイン	18,000	629	11,322,000	
	シーケーディ	200	1,391	278,200	
	SANKYO	500	5,920	2,960,000	
	ブラザー工業	3,000	1,526	4,578,000	
	セガサミーホールディングス	300	3,050	915,000	
	日本精工	3,000	1,014	3,042,000	
	NTN	1,000	976	976,000	
	ジェイテクト	1,500	2,500	3,750,000	
	ミネベア	6,000	682	4,092,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	THK	1,200	2,975	3,570,000	
	東芝	8,000	763	6,104,000	
	三菱電機	7,000	1,023	7,161,000	
	富士電機ホールディングス	17,000	610	10,370,000	
	デンヨー	800	1,309	1,047,200	
	ダイヘン	8,000	574	4,592,000	
	オムロン	1,300	2,990	3,887,000	
	日本電気	5,000	681	3,405,000	
	サンケン電気	7,000	1,454	10,178,000	
	エプソントヨコム	5,000	880	4,400,000	
	TDK	600	9,490	5,694,000	
	アルプス電気	10,900	1,296	14,126,400	
	フォスター電機	3,300	1,610	5,313,000	
	ホシデン	900	1,390	1,251,000	
	アルパイン	2,900	1,758	5,098,200	
	日本光電工業	1,900	2,030	3,857,000	
	エスペック	3,000	1,462	4,386,000	
	スタンレー電気	6,200	2,425	15,035,000	
	カシオ計算機	3,100	2,495	7,734,500	
	日本シイエムケイ	200	1,176	235,200	
	松下電工	2,000	1,307	2,614,000	
	KOA	2,000	1,587	3,174,000	
	日産自動車	21,000	1,367	28,707,000	
	いすゞ自動車	5,000	403	2,015,000	
	日産ディーゼル工業	2,000	383	766,000	
	関東自動車工業	200	1,424	284,800	
	日信工業	900	2,640	2,376,000	
	アイシン精機	800	3,510	2,808,000	
	マツダ	24,000	765	18,360,000	
	本田技研工業	3,000	4,070	12,210,000	
	ヤマハ発動機	4,700	3,260	15,322,000	
	豊田合成	1,700	2,780	4,726,000	
	コジマ	200	1,325	265,000	
	エクセル	300	2,275	682,500	
	東京精密	2,000	6,310	12,620,000	
	キヤノン	4,250	6,440	27,370,000	
	リコー	7,000	2,445	17,115,000	
	凸版印刷	4,000	1,293	5,172,000	
	大日本印刷	3,000	1,813	5,439,000	
	信越ポリマー	1,500	1,606	2,409,000	
	伊藤忠商事	22,000	923	20,306,000	
	丸紅	3,000	584	1,752,000	
	三陽商会	7,000	855	5,985,000	
	長瀬産業	3,000	1,449	4,347,000	
	豊田通商	3,000	3,250	9,750,000	
	兼松	1,000	180	180,000	
	三井物産	6,000	1,568	9,408,000	
	住友商事	5,200	1,475	7,670,000	
	三菱商事	10,600	2,210	23,426,000	
	キヤノンマーケティングジャパン	2,000	2,890	5,780,000	
	阪和興業	3,000	422	1,266,000	
	稲畑産業	200	875	175,000	
	伊藤忠エネクス	200	688	137,600	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	青山商事	800	3,520	2,816,000	
	オーエムシーカード	4,314	1,444	6,229,416	
	イオン	3,000	2,785	8,355,000	
	ユニー	2,000	1,454	2,908,000	
	平和堂	200	2,000	400,000	
	新生銀行	8,000	695	5,560,000	
	りそなホールディングス	20	345,000	6,900,000	
	三井トラスト・ホールディングス	4,000	1,369	5,476,000	
	三井住友フィナンシャルグループ	13	1,260,000	16,380,000	
	第四銀行	5,000	498	2,490,000	
	札幌北洋ホールディングス	4	1,200,000	4,800,000	
	群馬銀行	5,000	847	4,235,000	
	東邦銀行	5,000	509	2,545,000	
	十六銀行	4,000	660	2,640,000	
	八十二銀行	6,000	847	5,082,000	
	山梨中央銀行	4,000	819	3,276,000	
	大垣共立銀行	7,000	521	3,647,000	
	百五銀行	6,000	744	4,464,000	
	京都銀行	1,000	1,187	1,187,000	
	三重銀行	4,000	602	2,408,000	
	伊予銀行	4,000	1,219	4,876,000	
	阿波銀行	6,000	666	3,996,000	
	鹿児島銀行	5,000	853	4,265,000	
	大分銀行	4,000	835	3,340,000	
	肥後銀行	1,000	814	814,000	
	十八銀行	6,000	595	3,570,000	
	みずほフィナンシャルグループ	38	906,000	34,428,000	
	センチュリー・リーシング・システム	100	1,550	155,000	
	SBIホールディングス	420	44,900	18,858,000	
	東日本銀行	7,000	482	3,374,000	
	愛媛銀行	9,000	481	4,329,000	
	京葉銀行	5,000	676	3,380,000	
	三洋信販	40	4,500	180,000	
	東京リース	100	1,596	159,600	
	オリエントコーポレーション	1,000	282	282,000	
	日立キャピタル	2,700	2,270	6,129,000	
	オリックス	340	34,300	11,662,000	
	大和証券グループ本社	19,000	1,408	26,752,000	
	東洋証券	6,000	540	3,240,000	
	東海東京証券	9,000	575	5,175,000	
	レオパレス21	500	4,550	2,275,000	
	アーバンコーポレイション	4,500	1,694	7,623,000	
	明和地所	2,000	1,833	3,666,000	
	ゴールドクレスト	470	6,510	3,059,700	
	東栄住宅	500	2,390	1,195,000	
	日本エスリード	700	3,430	2,401,000	
	飯田産業	1,200	1,979	2,374,800	
	ゼファー	10	302,000	3,020,000	
	フージャースコーポレーション	15	166,000	2,490,000	
	東日本旅客鉄道	19	822,000	15,618,000	
	西日本旅客鉄道	32	505,000	16,160,000	
	西日本鉄道	7,000	427	2,989,000	
	日本通運	6,000	635	3,810,000	

通貨	銘柄	株式数	評価額(円)		備考
			単価	金額	
日本円	日本梱包運輸倉庫	2,000	1,493	2,986,000	
	日本郵船	12,000	725	8,700,000	
	商船三井	20,000	918	18,360,000	
	郵船航空サービス	600	2,835	1,701,000	
	近鉄エクスプレス	1,000	2,720	2,720,000	
	NECモバイリング	400	2,190	876,000	
	日本電信電話	53	616,000	32,648,000	
	KDDI	23	776,000	17,848,000	
	エヌ・ティ・ティ・ドコモ	46	189,000	8,694,000	
	インボイス	20	4,060	81,200	
	東京電力	9,000	3,470	31,230,000	
	関西電力	3,500	2,850	9,975,000	
	東北電力	900	2,645	2,380,500	
	北海道電力	300	2,920	876,000	
	電源開発	980	4,510	4,419,800	
	東京瓦斯	5,000	620	3,100,000	
	大阪瓦斯	39,000	429	16,731,000	
	CSKホールディングス	400	5,130	2,052,000	
	日立情報システムズ	1,800	2,355	4,239,000	
	富士ソフトABC	100	3,300	330,000	
	ダイセキ	24	2,675	64,200	
合計				1,205,943,216	

(2) 株式以外の有価証券
該当事項はありません。

第2 有価証券先物取引等及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
株式関連

区分	種類	(平成18年10月18日現在)				
		契約額等(円)	うち1年超		時価(円)	評価損益(円)
市場取引	株価指数先物取引 売 建	197,520,000	-	197,280,000	240,000	
	合 計	197,520,000	-	197,280,000	240,000	

(注) 時価の算定方法

- 国内先物取引の残高表示は、契約額によっております。想定元本ベースではありません。
- 先物取引の評価においては、当該取引所の発表する計算日の清算値段又は証拠金算定基準値段を用いています。

参考

りそな・短期金融資産マザーファンド

当ファンドは「りそな・短期金融資産マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された親投資信託受益証券は、すべて同親投資信託の受益証券です。尚、同親投資信託の状況は次の通りです。

1「りそな・短期金融資産マザーファンド」の状況

以下に記載した状況は監査の対象外となっております。

(1) 貸借対照表

(単位：円)

科 目	対象年月日	(平成18年10月20日現在)
		金 額
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		10,071,576
国債証券		19,984,765
未収利息		41
流動資産合計		30,056,382
資産合計		30,056,382
負債の部		
流動負債		
流動負債合計		-
負債合計		-
純資産の部		
元本等		
元本		
元本		30,028,984
剰余金		
剰余金		27,398
純資産合計		30,056,382
負債・純資産合計		30,056,382

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

期 別 項 目	自 平成18年 4月21日 至 平成18年10月20日
1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券 原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他	貸借対照表は、ファンドの計算期間末の平成18年10月20日現在であります。 なお、当親投資信託の計算期間は平成17年10月21日から平成18年10月20日までとなっております。

(その他の注記)

(平成18年10月20日現在)	
1. 期首	平成18年4月21日
期首元本額	50,024,985円
期首より平成18年10月20日までの期中追加設定元本額	円
期首より平成18年10月20日までの期中一部解約元本額	19,996,001円
期末元本額	30,028,984円
期末元本額の内訳	
日本株マーケット・ニュートラル	30,028,984円
2. 計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0009円
(10,000口当たり純資産額)	10,009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

(3) 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

(平成18年10月20日現在)

種類	銘柄	券面総額(円)	評価額(円)	備考
国債証券	第410回 政府短期証券	20,000,000	19,984,765	
小 計	銘柄数: 1		19,984,765	
	組入時価比率: 66.5%		100%	
合 計			19,984,765	

(注) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、及び小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 有価証券先物取引等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18年11月末日現在

資産総額	1,893,853,129 円
負債総額	2,442,317 円
純資産総額 (-)	1,891,410,812 円
発行済口数	1,962,942,167 口
1口当たり純資産額 (/)	0.9636 円
(1万口当たりの純資産額)	9,636 円

(参考)

ジャパニーズ エクイティ マーケット ニュートラル マザーファンド

純資産額計算書

平成18年11月末日現在

資産総額	2,847,951,918 円
負債総額	1,048,717,715 円
純資産総額 (-)	1,799,234,203 円
発行済口数	169,000 口
1口当たり純資産額 (/)	10,646 円

りそな・短期金融資産マザーファンド

純資産額計算書

平成18年11月末日現在

資産総額	30,065,567 円
負債総額	- 円
純資産総額 (-)	30,065,567 円
発行済口数	30,028,984 口
1口当たり純資産額 (/)	1.0012 円
(1万口当たりの純資産額)	10,012 円

第5 設定及び解約の実績 (原請求目論見書 29 ページ)

全文が以下の通り更新訂正されます。訂正後の内容のみ記載しております。

計算期間	設定数量 (口)	解約数量 (口)
第1期計算期間 (H14.4.12 ~ H14.10.21)	14,944,501,735	899,031,684
第2期計算期間 (H14.10.22 ~ H15.4.21)	2,854,607,640	4,273,189,996
第3期計算期間 (H15.4.22 ~ H15.10.20)	110,784,995	3,237,499,355
第4期計算期間 (H15.10.21 ~ H16.4.20)	480,594,051	4,025,199,138
第5期計算期間 (H16.4.21 ~ H16.10.20)	63,996,164	2,583,520,539
第6期計算期間 (H16.10.21 ~ H17.4.20)	20,298,250	689,580,706
第7期計算期間 (H17.4.21 ~ H17.10.20)	266,454,366	534,581,958
第8期計算期間 (H17.10.21 ~ H18.4.20)	287,032,746	413,626,478
第9期計算期間 (H18.4.21 ~ H18.10.20)	2,134,494	350,386,876