

【表紙】

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年5月22日提出
【計算期間】	第28期(自 2019年8月27日至 2020年2月25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】	該当事項はありません。

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。

※委託会社は、受託会社と合意のうえ、信託金の限度額を変更することができます。

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 不動産投信	MR F	
追加型	内外	その他資産 ()	E T F	特殊型 (絶対収益追求型)
		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	T O P I X	条件付運用型
中小型株	年６回	欧州				
債券	年１２回 (隔月)	アジア	オブ・		その他 ()	絶対収益 追求型
一般	年１２回 (毎月)	オセアニア				
公債	日々	中南米	ファンズ			その他 ()
社債	その他 ()	アフリカ				
その他債券		中近東 (中東)				
クレジット		エマージング				
属性 ()						
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。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（<http://www.toushin.or.jp/>）でご覧いただけます。

※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す。

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の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。
	MR F（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MR F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	
投資対象地域	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。
	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。

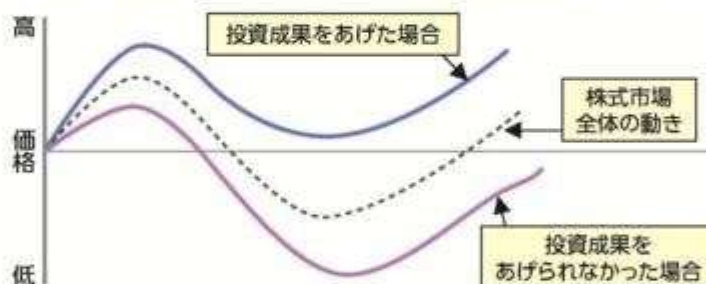
- 株式市場全体の上昇・下落の影響を抑えるためにマーケットニュートラル(市場中立)戦略が採られています。



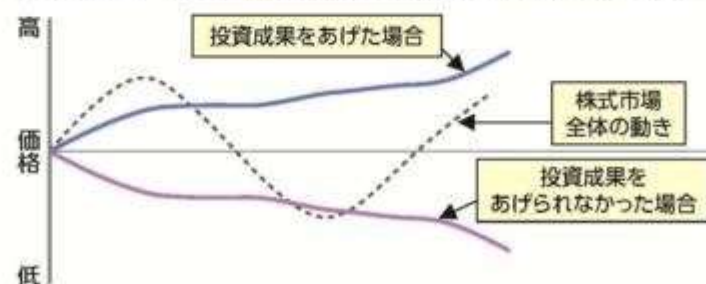
マーケットニュートラル戦略とは

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)



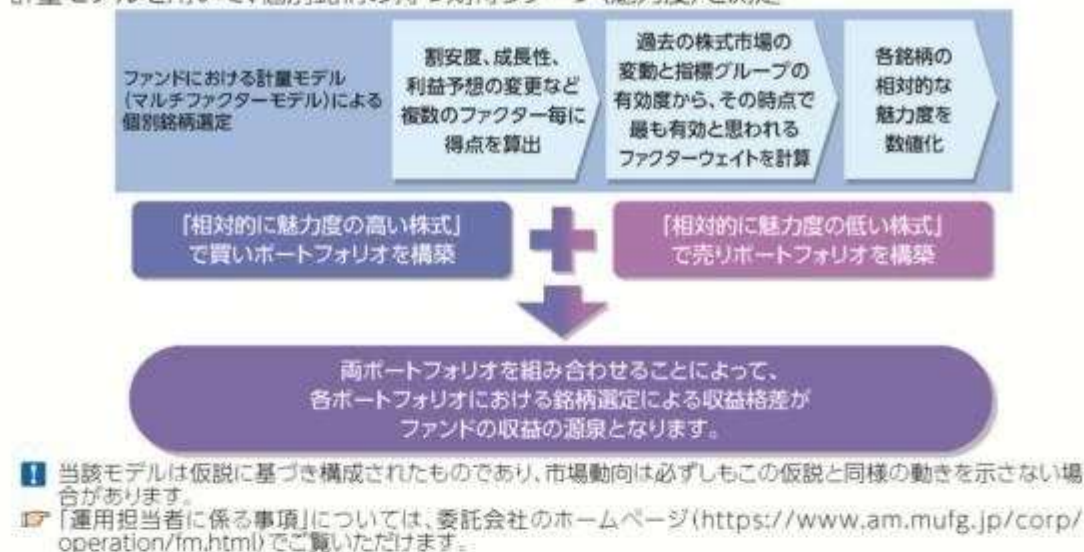
上図は運用戦略の概念を表すイメージ図であり、将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

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



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。

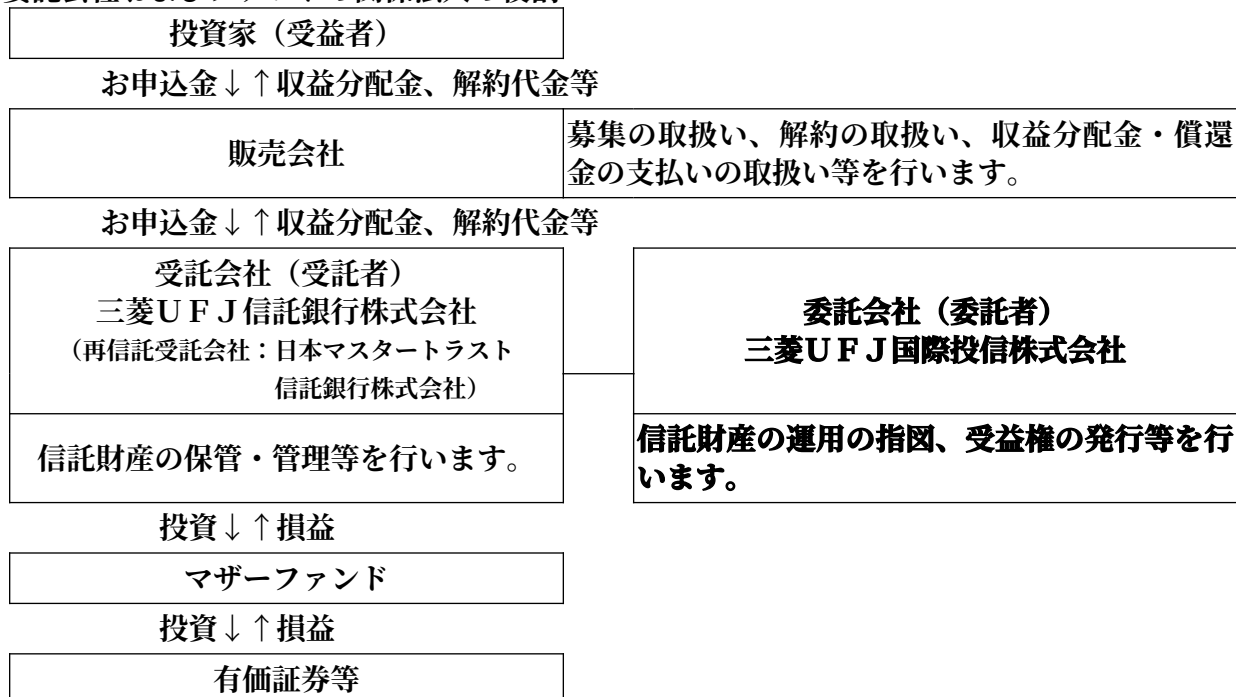
(2) 【ファンドの沿革】

2005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】

①委託会社およびファンドの関係法人の役割



②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 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	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。

③委託会社の概況（2020年2月末現在）

- 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- 設立年月日
1985年8月1日
- 資本金
2,000百万円
- 沿革

1997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
2004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
2005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
2015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

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	211,581株	100.0%

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】

①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
- ニ. 金銭債権
2. 次に掲げる特定資産以外の資産
 - イ. 為替手形

②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）

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。
 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。
 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。

③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）

①投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

②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）

①株式への投資割合に制限を設けません。

②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。

③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。

④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。

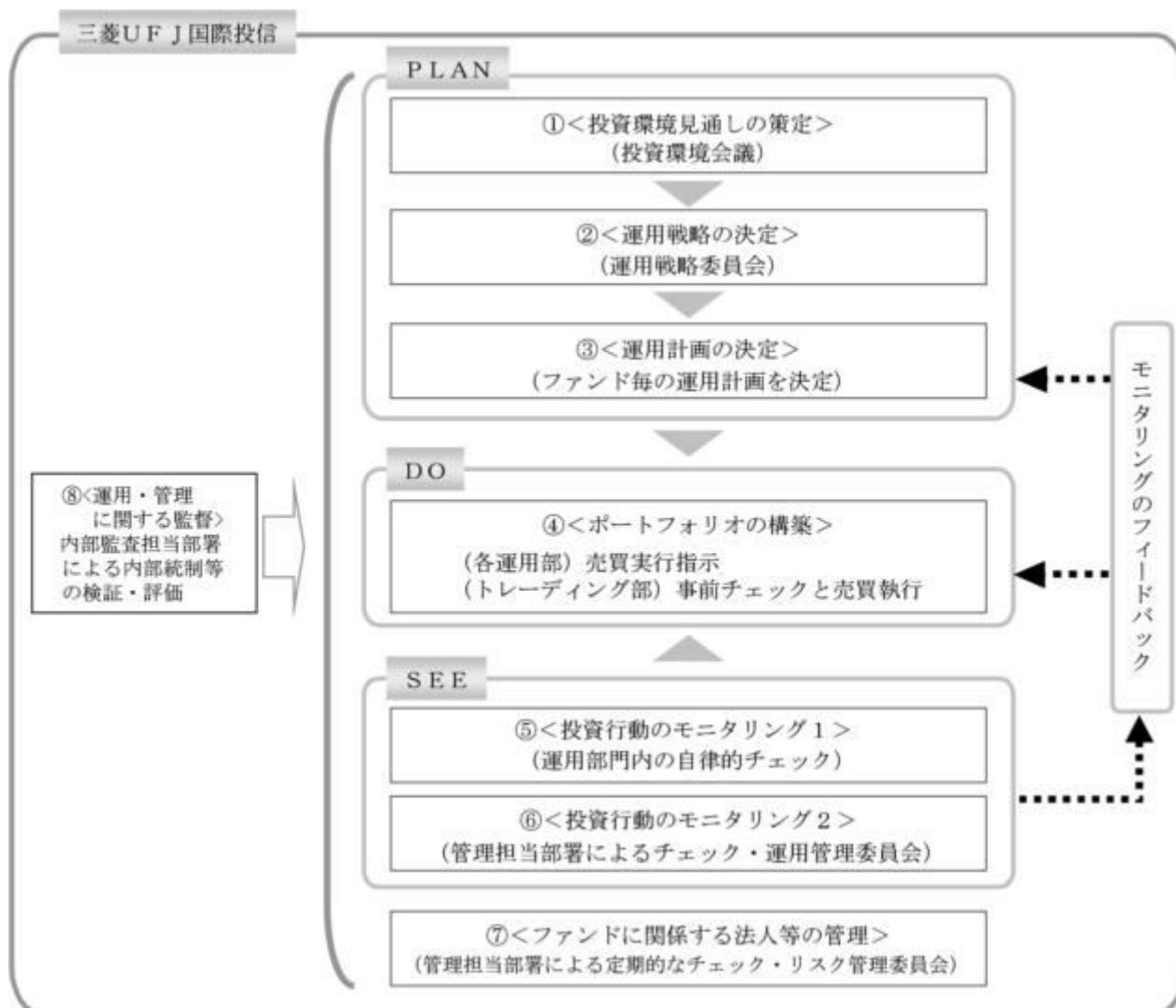
⑤同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

⑥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。

- ⑦外貨建資産への投資は行いません。
- ⑧有価証券先物取引等を行うことができます。
- ⑨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】



①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。

②運用戦略の決定

運用戦略委員会において、①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。

③運用計画の決定

②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。

④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。

⑤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。

⑥投資行動のモニタリング 2

運用部から独立した管理担当部署（40～60名程度）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。

⑦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。

⑧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。

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。

なお、委託会社に関する「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でご覧いただけます。

「運用担当者に係る事項」 <https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>

（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。

- ①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。
- ②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。
- ③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>

①外貨建資産

外貨建資産への投資は行いません。

②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。

③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。

④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。

⑤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。

⑥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ます。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たときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

⑦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。

⑧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たときは、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。

⑨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。

⑩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。

⑪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たときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

⑫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⑧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。

⑬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。

⑭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

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。

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。

（主なリスクであり、以下に限定されるものではありません。）

①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。

②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。

③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の方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

委託会社では、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とともに運用部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います。

また、定期的開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。この内容は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。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

①トレーディング担当部署

有価証券等の売買執行および発注に係る法令等の遵守および監視・牽制を行います。

②コンプライアンス担当部署

法令上の禁止行為、約款の投資制限等のモニタリングを通じ、法令等遵守状況を把握・管理し、必要に応じて改善の指導を行います。

③リスク管理担当部署

運用リスク全般の状況をモニタリング・管理するとともに、運用実績の分析および評価を行い、必要に応じて改善策等を提言します。また、事務・情報資産・その他のリスクの統括的管理を行っています。

④内部監査担当部署

委託会社のすべての業務から独立した立場より、リスク管理体制の適切性および有効性について評価を行い、改善策の提案等を通して、リスク管理機能の維持・向上をはかります。

＜流動性リスクに対する管理体制＞

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リスク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、この結果はリスク管理に関する会議体等に報告されます。

＊組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■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	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	東証株価指数 (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で、わが国の株式市場全体の値動きを表す株価指数です。TOPIX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の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIXの算出もしくは公表の停止またはTOPIX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 (国債) とは、野村證券株式会社が発表しているわが国の代表的な国債パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI (総合) のサブインデックスです。当該指数の知的財産権およびその他一切の権利は同社に帰属します。なお、同社は、当該指数の正確性、完全性、信頼性、有用性、市場性、商品性および適合性を保証するものではなく、当該指数を用いて運用されるファンドの運用成果等に関して一切責任を負いません。
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本)	FTSE世界国債インデックス (除く日本) は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、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。FTSE Fixed Income LLCは、本ファンドのスポンサーではなく、本ファンドの推奨、販売あるいは販売促進を行っておりません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
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。当該指数の著作権は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】

ありません。

※申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンド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です。

（２）【換金（解約）手数料】

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（解約）手数料の対価として提供する役務の内容は、商品の換金に関する事務手続等です。

（３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年1.155%（税抜 1.05%）の率を乗じて得た額とし、日々ファンドの基準価額に反映されます。

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。

- ・信託報酬は、毎計算期末または信託終了のとき信託財産中から支弁します。

- ・信託報酬の各支払先への配分（税抜）は、以下の通りです。

支払先	配分（税抜）	対価として提供する役務の内容
委託会社	0.9%	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
販売会社	0.05%	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
受託会社	0.1%	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

※上記信託報酬には、別途消費税等相当額がかかります。

（４）【その他の手数料等】

- ・信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、受託会社の立替えた立替金の利息、借入を行う場合の借入金の利息および借入れに関する品借料は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。
- ・信託財産に係る監査費用（消費税等相当額を含みます。）は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に一定率を乗じて得た額とし、信託財産中から支弁します。支弁時期は信託報酬と同様です。
- ・信託財産（投資している投資信託を含みます。）の組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料等（消費税等相当額を含みます。）、先物取引・オプション取引等に要する費用および外貨建資産の保管等に要する費用についても信託財産が負担するものとします。

※売買条件等により異なるため、あらかじめ金額または上限額等を記載することはできません。

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、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。

（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。

①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。

②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。

※分配時において、外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記と異なる場合があります。

◇個別元本について

①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。

②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。

③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、①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、②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2020年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

※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。

【日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）】

（１）【投資状況】

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	602,758,220	99.75
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	—	1,482,247	0.25
純資産総額		604,240,467	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】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位 30 銘柄

令和 2年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	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	418,407,761	1.4334	599,745,685	1.4406	602,758,220	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

令和 2年 2月28日現在

種類	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。

②【投資不動産物件】

該当事項はありません。

③【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】

①【純資産の推移】

下記計算期間末日および令和2年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第9計算期間末日（平成22年 8月24日）	316,440,035	316,440,035	10,956	10,956
第10計算期間末日（平成23年 2月24日）	216,544,993	216,544,993	11,523	11,523
第11計算期間末日（平成23年 8月24日）	158,646,057	158,646,057	11,366	11,366
第12計算期間末日（平成24年 2月24日）	97,056,812	97,056,812	11,470	11,470
第13計算期間末日（平成24年 8月24日）	67,598,183	67,598,183	10,966	10,966
第14計算期間末日（平成25年 2月25日）	50,499,625	50,499,625	11,507	11,507
第15計算期間末日（平成25年 8月26日）	533,985,269	533,985,269	11,494	11,494
第16計算期間末日（平成26年 2月24日）	904,211,437	904,211,437	11,732	11,732
第17計算期間末日（平成26年 8月25日）	1,161,429,254	1,161,429,254	11,415	11,415
第18計算期間末日（平成27年 2月24日）	1,300,508,022	1,300,508,022	11,504	11,504
第19計算期間末日（平成27年 8月24日）	1,052,390,950	1,052,390,950	11,816	11,816
第20計算期間末日（平成28年 2月24日）	2,393,560,606	2,393,560,606	11,855	11,855
第21計算期間末日（平成28年 8月24日）	2,789,414,112	2,789,414,112	11,478	11,478
第22計算期間末日（平成29年 2月24日）	2,914,372,319	2,914,372,319	12,200	12,200
第23計算期間末日（平成29年 8月24日）	996,702,522	996,702,522	12,207	12,207
第24計算期間末日（平成30年 2月26日）	1,040,713,788	1,040,713,788	12,396	12,396
第25計算期間末日（平成30年 8月24日）	293,409,332	293,409,332	12,270	12,270
第26計算期間末日（平成31年 2月25日）	230,192,204	230,192,204	12,406	12,406
第27計算期間末日（令和 1年 8月26日）	1,549,360,340	1,549,360,340	12,273	12,273
第28計算期間末日（令和 2年 2月25日）	602,579,535	602,579,535	11,947	11,947
平成31年 2月末日	228,781,441	—	12,391	—
3月末日	198,925,523	—	12,310	—
4月末日	1,090,895,985	—	12,258	—
令和 1年 5月末日	1,104,249,094	—	12,382	—
6月末日	1,560,654,041	—	12,381	—
7月末日	1,543,269,740	—	12,410	—
8月末日	1,550,617,052	—	12,259	—
9月末日	1,119,880,009	—	12,254	—
10月末日	887,076,945	—	12,134	—
11月末日	881,163,291	—	11,999	—
12月末日	625,933,559	—	11,958	—
令和 2年 1月末日	610,441,530	—	11,974	—
2月末日	604,240,467	—	12,005	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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
第23計算期間	0円
第24計算期間	0円
第25計算期間	0円
第26計算期間	0円
第27計算期間	0円
第28計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（％）
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
第23計算期間	0.05
第24計算期間	1.54
第25計算期間	△1.01
第26計算期間	1.10
第27計算期間	△1.07
第28計算期間	△2.65

（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
第23計算期間	260,384,006	1,832,617,305	816,522,044
第24計算期間	170,118,710	147,115,477	839,525,277
第25計算期間	86,234,226	686,628,162	239,131,341
第26計算期間	1,079,377	54,660,689	185,550,029
第27計算期間	1,201,999,439	125,110,873	1,262,438,595
第28計算期間	34,578,614	792,641,629	504,375,580

（参考）

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

投資状況

令和 2年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	12,093,580,900	69.23
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）	－	5,374,979,959	30.77
純資産総額		17,468,560,859	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。

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

a 評価額上位30銘柄

令和 2年 2月28日現在

国／ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	三菱商事	卸売業	42,600	2,798.50	119,216,100	2,690.00	114,594,000	0.66
日本	株式	三井物産	卸売業	63,700	1,869.00	119,055,300	1,783.50	113,608,950	0.65
日本	株式	東ソー	化学	75,400	1,578.00	118,981,200	1,481.00	111,667,400	0.64
日本	株式	富士通	電気機器	9,600	12,250.00	117,600,000	11,210.00	107,616,000	0.62
日本	株式	LIXILグループ	金属製品	65,000	1,775.78	115,426,100	1,620.00	105,300,000	0.60
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	35,000	3,248.00	113,680,000	2,979.50	104,282,500	0.60
日本	株式	SGホールディングス	陸運業	49,000	2,163.20	105,997,200	2,128.00	104,272,000	0.60
日本	株式	大成建設	建設業	28,000	3,844.28	107,640,000	3,695.00	103,460,000	0.59
日本	株式	第一三共	医薬品	15,400	7,270.00	111,958,000	6,590.00	101,486,000	0.58
日本	株式	京セラ	電気機器	14,700	7,179.00	105,531,300	6,796.00	99,901,200	0.57
日本	株式	信越化学工業	化学	8,000	13,495.00	107,960,000	12,145.00	97,160,000	0.56
日本	株式	ダイセル	化学	104,000	955.90	99,414,000	931.00	96,824,000	0.55
日本	株式	野村不動産ホールディングス	不動産業	41,500	2,616.00	108,564,000	2,328.00	96,612,000	0.55
日本	株式	明治ホールディングス	食料品	15,000	6,770.00	101,550,000	6,440.00	96,600,000	0.55
日本	株式	朝日インテック	精密機器	37,000	2,642.24	97,763,200	2,586.00	95,682,000	0.55
日本	株式	東洋製罐グループホールディングス	金属製品	55,000	1,808.88	99,488,500	1,730.00	95,150,000	0.54
日本	株式	セコム	サービス業	11,000	9,057.20	99,629,200	8,575.00	94,325,000	0.54
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	55,200	1,824.00	100,684,800	1,699.00	93,784,800	0.54
日本	株式	上組	倉庫・運輸関連業	45,000	2,175.72	97,907,500	2,073.00	93,285,000	0.53
日本	株式	名古屋鉄道	陸運業	33,000	2,946.67	97,240,400	2,819.00	93,027,000	0.53
日本	株式	西日本旅客鉄道	陸運業	12,200	8,309.00	101,369,800	7,618.00	92,939,600	0.53
日本	株式	日本電気	電気機器	23,000	4,558.23	104,839,400	4,040.00	92,920,000	0.53
日本	株式	エムスリー	サービス業	33,200	2,941.48	97,657,300	2,786.00	92,495,200	0.53
日本	株式	シマノ	輸送用機器	6,100	15,162.17	92,489,280	15,120.00	92,232,000	0.53
日本	株式	光通信	情報・通信業	4,500	22,008.34	99,037,550	20,490.00	92,205,000	0.53
日本	株式	日東電工	化学	17,000	5,710.00	97,070,000	5,420.00	92,140,000	0.53
日本	株式	小糸製作所	電気機器	21,600	4,450.50	96,130,800	4,260.00	92,016,000	0.53

日本	株式	京阪ホールディングス	陸運業	21,000	4,572.71	96,027,000	4,380.00	91,980,000	0.53
日本	株式	スタンレー電気	電気機器	34,800	2,774.65	96,558,000	2,636.00	91,732,800	0.53
日本	株式	SMC	機械	2,100	47,301.21	99,332,550	43,070.00	90,447,000	0.52

（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

令和 2年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.23
	鉱業	0.34
	建設業	4.08
	食料品	3.25
	繊維製品	0.30
	パルプ・紙	0.24
	化学	7.29
	医薬品	2.69
	石油・石炭製品	0.10
	ゴム製品	0.20
	ガラス・土石製品	1.18
	鉄鋼	0.80
	非鉄金属	0.95
	金属製品	1.52
	機械	5.66
	電気機器	8.55
	輸送用機器	3.53
	精密機器	2.19
	その他製品	1.80
	陸運業	3.31
	海運業	0.03
	倉庫・運輸関連業	0.53
	情報・通信業	4.76
	卸売業	4.33
	小売業	4.56
	不動産業	1.77
	サービス業	5.06
	小計	69.23
合計		69.23

（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。

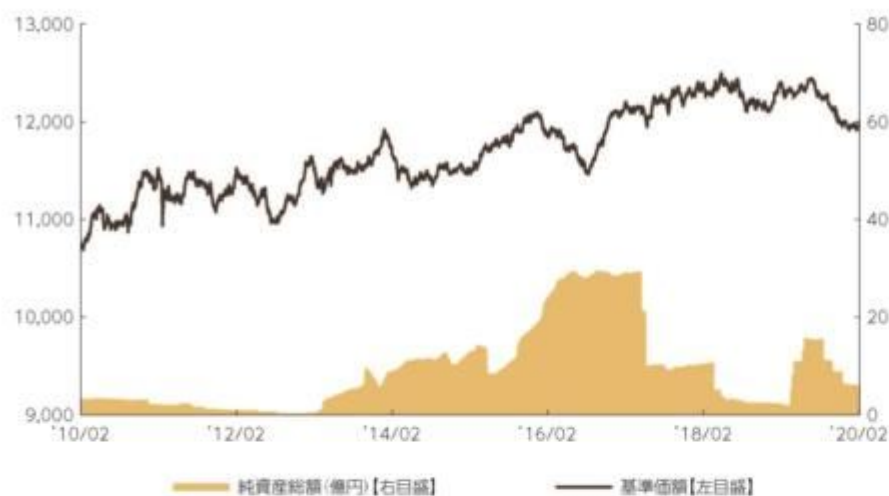
《参考情報》



運用実績

2020年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移 2010年2月26日～2020年2月28日



■基準価額・純資産

基準価額	12,005円
純資産総額	6.0億円

■分配の推移

2020年2月	0円
2019年8月	0円
2019年2月	0円
2018年8月	0円
2018年2月	0円
2017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

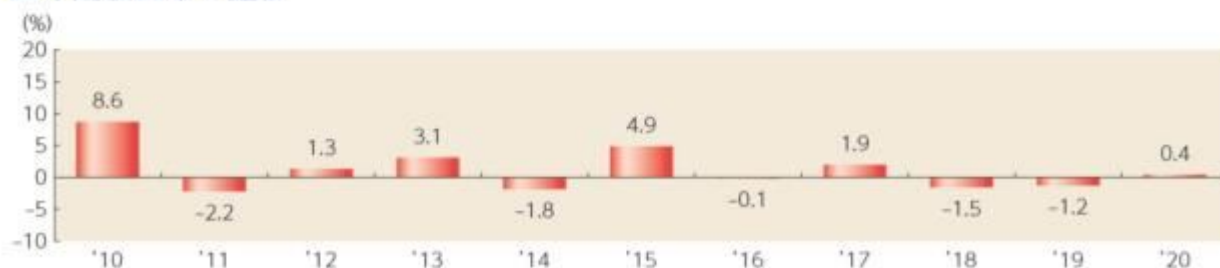
■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位銘柄	業種	比率
国内株式現物	69.1%	1 三菱商事	卸売業	0.7%
国内株式信用売	-68.1%	2 三井物産	卸売業	0.6%
		3 東ソー	化学	0.6%
		4 富士通	電気機器	0.6%
		5 LIXILグループ	金属製品	0.6%
		6 大和ハウス工業	建設業	0.6%
		7 SGホールディングス	陸運業	0.6%
		8 大成建設	建設業	0.6%
		9 第一三共	医薬品	0.6%
		10 京セラ	電気機器	0.6%
株式(実質)	1.0%			

●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

●2020年は年初から2月28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】

①申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

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。

②申込単位

販売会社が定める単位

③申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

④申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑤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ください。

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：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 <https://www.am.mufg.jp/>

⑥申込手数料

ありません。

⑦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）があります。申込みコースの取扱いには販売会社により異なる場合があります。

⑧申込受付時間

取得の申込みは、申込期間において、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。取得申込みが行われ、かつ当該取得申込みに係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての申込みに関しては販売会社にご確認ください。

⑨取得申込みの受付の中止および取消し

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の受付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。

※申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

2【換金（解約）手続等】

①解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

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。

②解約単位

販売会社が定める単位

③解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

④信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%をかけた額

⑤解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

⑥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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

⑦支払開始日

解約代金は、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。

⑧解約請求受付時間

解約の請求は、原則として販売会社の営業日の午後3時までに、販売会社所定の方法で行われます。解約請求が行われ、かつ当該換金請求に係る販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の受付分とします。当該時刻を過ぎての請求に関しては販売会社にご確認ください。

⑨解約請求受付の中止および取消し

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。また、市況動向等により、これ以外にも大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

※換金（解約）手続等の詳細に関し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】****①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、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示することがあります。

「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。

（資産の評価方法）**・株式／上場投資信託証券／不動産投資信託証券**

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場（外国で取引されているものについては、原則として、金融商品取引所における計算時に知りうる直近の日の最終相場）で評価します。

・転換社債／転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、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（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、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。

・公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）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。

残存期間１年以内の公社債等については、一部償却原価法による評価を適用することができます。

・マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・投資信託証券（上場投資信託証券／不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・外貨建資産

原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値により円換算します。

・外国為替予約取引

原則として、わが国における計算日の対顧客先物売買相場の仲値により評価します。

・市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

②基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

③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。

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：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

（２）【保管】

該当事項はありません。

（３）【信託期間】

無期限（2005年12月16日設定）

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】

毎年２月25日から８月24日および８月25日から翌年２月24日まで
ただし、各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日の場合、各計算期間終了日は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ます。
なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

（５）【その他】

①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。

②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。

③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。

④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。）。

⑤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「投資信託受益権の取扱に関する契約」の契約期間は、契約締結日から１年とします。ただし双方から契約満了日の３ヵ月前までに別段の意思表示のないときは、さらに１年間延長するものとし、その後も同様とします。

⑥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、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

⑦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。

⑧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。

⑨信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、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。

⑩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。

<https://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】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

(1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

①分配金受取コース（一般コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、毎計算期間の終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、収益分配金について支払開始日から5年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

②分配金再投資コース（累積投資コース）

収益分配金は、税金を差引いた後、「累積投資契約」に基づいて、決算日の基準価額により自動的に無手数料で全額再投資されます。

(2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（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営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

ただし、受益者が、償還金について支払開始日から10年間その支払いの請求を行わない場合はその権利を失い、その金銭は委託会社に帰属します。

(3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

くわしくは「第2 管理及び運営 2 換金（解約）手続等」を参照してください。

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（令和1年8月27日から令和2年2月25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27期 [令和 1年 8月26日現在]	第28期 [令和 2年 2月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	9,759,005	6,430,704
親投資信託受益証券	1,545,484,977	601,072,134
未収入金	-	1,566,329
流動資産合計	1,555,243,982	609,069,167
資産合計	1,555,243,982	609,069,167
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	1,361,608
未払受託者報酬	558,970	487,186
未払委託者報酬	5,310,186	4,628,229
未払利息	15	2
その他未払費用	14,471	12,607
流動負債合計	5,883,642	6,489,632
負債合計	5,883,642	6,489,632
純資産の部		
元本等		
元本	1,262,438,595	504,375,580
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	286,921,745	98,203,955
（分配準備積立金）	6,591,714	5,259,649
元本等合計	1,549,360,340	602,579,535
純資産合計	1,549,360,340	602,579,535
負債純資産合計	1,555,243,982	609,069,167

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第27期 自 平成31年 2月26日 至 令和 1年 8月26日	第28期 自 令和 1年 8月27日 至 令和 2年 2月25日
営業収益		
受取利息	-	18
有価証券売買等損益	△1,258,930	△23,997,249
営業収益合計	△1,258,930	△23,997,231
営業費用		
支払利息	1,436	874
受託者報酬	558,970	487,186
委託者報酬	5,310,186	4,628,229
その他費用	14,485	12,607
営業費用合計	5,885,077	5,128,896
営業利益又は営業損失（△）	△7,144,007	△29,126,127
経常利益又は経常損失（△）	△7,144,007	△29,126,127
当期純利益又は当期純損失（△）	△7,144,007	△29,126,127
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（△）	△284,435	△12,121,751
期首剰余金又は期首欠損金（△）	44,642,175	286,921,745
剰余金増加額又は欠損金減少額	278,443,127	7,325,114
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	278,443,127	7,325,114
剰余金減少額又は欠損金増加額	29,303,985	179,038,528
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	29,303,985	179,038,528
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	286,921,745	98,203,955

（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。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月24日および8月24日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間および当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和 1年 8月27日から令和 2年 2月25日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第27期 [令和 1年 8月26日現在]	第28期 [令和 2年 2月25日現在]
1. 期首元本額	185,550,029円	1,262,438,595円
期中追加設定元本額	1,201,999,439円	34,578,614円
期中一部解約元本額	125,110,873円	792,641,629円
2. 受益権の総数	1,262,438,595口	504,375,580口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第27期 自 平成31年 2月26日 至 令和 1年 8月26日	第28期 自 令和 1年 8月27日 至 令和 2年 2月25日																																																												
1. 分配金の計算過程	1. 分配金の計算過程																																																												
<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>—円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>405,474,066円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>6,591,714円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>412,065,780円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>1,262,438,595口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>3,264円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	—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	—円	収益調整金額	C	405,474,066円	分配準備積立金額	D	6,591,714円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	412,065,780円	当ファンドの期末残存口数	F	1,262,438,595口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,264円	1万口当たり分配金額	H	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円	<table><tr><td>項目</td><td></td><td></td></tr><tr><td>費用控除後の配当等収益額</td><td>A</td><td>1,749,366円</td></tr><tr><td>費用控除後・繰越欠損金補填後の有価証券売買等損益額</td><td>B</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益調整金額</td><td>C</td><td>162,239,651円</td></tr><tr><td>分配準備積立金額</td><td>D</td><td>3,510,283円</td></tr><tr><td>当ファンドの分配対象収益額</td><td>E=A+B+C+D</td><td>167,499,300円</td></tr><tr><td>当ファンドの期末残存口数</td><td>F</td><td>504,375,580口</td></tr><tr><td>1万口当たり収益分配対象額</td><td>G=E/F*10,000</td><td>3,320円</td></tr><tr><td>1万口当たり分配金額</td><td>H</td><td>—円</td></tr><tr><td>収益分配金金額</td><td>I=F*H/10,000</td><td>—円</td></tr></table>	項目			費用控除後の配当等収益額	A	1,749,366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	—円	収益調整金額	C	162,239,651円	分配準備積立金額	D	3,510,283円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	167,499,300円	当ファンドの期末残存口数	F	504,375,580口	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,320円	1万口当たり分配金額	H	—円	収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	—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	—円																																																											
収益調整金額	C	405,474,066円																																																											
分配準備積立金額	D	6,591,714円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	412,065,780円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	1,262,438,595口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,264円																																																											
1万口当たり分配金額	H	—円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円																																																											
項目																																																													
費用控除後の配当等収益額	A	1,749,366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	—円																																																											
収益調整金額	C	162,239,651円																																																											
分配準備積立金額	D	3,510,283円																																																											
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	167,499,300円																																																											
当ファンドの期末残存口数	F	504,375,580口																																																											
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,320円																																																											
1万口当たり分配金額	H	—円																																																											
収益分配金金額	I=F*H/10,000	—円																																																											

（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27期 自 平成31年 2月26日 至 令和 1年 8月26日	第28期 自 令和 1年 8月27日 至 令和 2年 2月25日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券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27期 [令和 1年 8月26日現在]	第28期 [令和 2年 2月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	(1) 有価証券 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。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1) 有価証券 同左 (2) デリバティブ取引 同左 (3) 上記以外の金融商品 同左

区分	第27期 [令和 1年 8月26日現在]	第28期 [令和 2年 2月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	第27期 [令和 1年 8月26日現在]	第28期 [令和 2年 2月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	△944,972	△13,585,448
合計	△944,972	△13,585,448

（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。

（１口当たり情報）

	第27期 [令和 1年 8月26日現在]	第28期 [令和 2年 2月25日現在]
1口当たり純資産額	1.2273円	1.1947円
(1万口当たり純資産額)	(12,273円)	(11,947円)

（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	419,303,896	601,072,134	
合 計		419,303,896	601,072,134	

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)

当ファンドの主要投資対象の状況は以下の通りです。
なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド

貸借対照表

(単位：円)

[令和 2年 2月25日現在]	
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	4,622,830,036
株式	12,230,074,100
信用取引預け金	12,677,801,005
未収配当金	28,077,550
流動資産合計	29,558,782,691
資産合計	29,558,782,691
負債の部	
流動負債	
信用売証券	12,108,044,850
未払解約金	4,113,755
未払利息	1,537
その他未払費用	28,975,717
流動負債合計	12,141,135,859

[令和 2年 2月25日現在]

負債合計	12,141,135,859
純資産の部	
元本等	
元本	12,150,827,433
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,266,819,399
元本等合計	17,417,646,832
純資産合計	17,417,646,832
負債純資産合計	29,558,782,691

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）

	[令和 2年 2月25日現在]
1. 期首	令和 1年 8月27日
期首元本額	8,704,909,400円
期中追加設定元本額	5,541,646,953円
期中一部解約元本額	2,095,728,920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）	419,303,896円
ヘッジファンドセレクション（ラップ向け）	3,349,210,927円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	248,391,579円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	523,345,139円
MUKAM 日本株マーケットニュートラル・ファンド2019-11（適格機関投資家限定）	3,469,636,169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）	4,140,939,723円
合計	12,150,827,433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	6,720,737,500円

	[令和 2年 2月25日現在]
3. 受益権の総数	12,150,827,433口

※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 令和 1年 8月27日 至 令和 2年 2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、信用売証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
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。

2 金融商品の時価等に関する事項

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

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[令和 2年 2月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	△818,326,242
信用売証券	508,862,724
合計	△309,463,518

(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。

（１口当たり情報）

	[令和 2年 2月25日現在]
1口当たり純資産額	1.4335円
(1万口当たり純資産額)	(14,335円)

附属明細表

第1 有価証券明細表
(1)株式

（単位：円）

	銘 柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
1333	マルハニチロ	11,000	2,438.00	26,818,000	代用有価証券 8,000株
1379	ホクト	8,000	1,930.00	15,440,000	
1515	日鉄鉱業	3,500	4,110.00	14,385,000	代用有価証券 2,400株
1518	三井松島ホールディングス	18,000	1,081.00	19,458,000	代用有価証券 12,000株
1662	石油資源開発	12,000	2,605.00	31,260,000	代用有価証券 5,000株

1414	ショーボンドホールディングス	5,000	4,125.00	20,625,000	代用有価証券 5,000株
1417	ミライト・ホールディングス	18,000	1,481.00	26,658,000	
1719	安藤・間	30,000	836.00	25,080,000	代用有価証券 30,000株
1801	大成建設	23,000	3,850.00	88,550,000	代用有価証券 11,000株
1808	長谷工コーポレーション	15,000	1,347.00	20,205,000	
1815	鉄建建設	5,000	2,528.00	12,640,000	
1822	大豊建設	15,000	2,488.00	37,320,000	代用有価証券 14,000株
1833	奥村組	10,000	2,757.00	27,570,000	代用有価証券 10,000株
1835	東鉄工業	8,000	2,907.00	23,256,000	代用有価証券 8,000株
1861	熊谷組	13,000	3,085.00	40,105,000	代用有価証券 10,000株
1871	ピーエス三菱	25,000	627.00	15,675,000	代用有価証券 22,000株
1899	福田組	1,500	4,125.00	6,187,500	
1925	大和ハウス工業	35,000	3,248.00	113,680,000	代用有価証券 21,200株
1926	ライト工業	18,000	1,395.00	25,110,000	代用有価証券 13,000株
1929	日特建設	30,000	801.00	24,030,000	
1941	中電工	10,000	2,366.00	23,660,000	代用有価証券 6,000株
1950	日本電設工業	11,000	2,091.00	23,001,000	代用有価証券 7,000株
1961	三機工業	14,000	1,300.00	18,200,000	
1963	日揮ホールディングス	51,500	1,500.00	77,250,000	代用有価証券 43,500株
1968	太平電業	3,500	2,386.00	8,351,000	代用有価証券 3,500株
1976	明星工業	11,000	746.00	8,206,000	
5912	ＯＳＪＢホールディングス	100,000	253.00	25,300,000	代用有価証券 70,000株
2109	三井製糖	11,000	1,998.00	21,978,000	代用有価証券 5,000株
2201	森永製菓	5,000	4,440.00	22,200,000	
2222	寿スピリッツ	2,500	5,800.00	14,500,000	
2229	カルビー	22,000	2,923.00	64,306,000	代用有価証券 17,000株
2269	明治ホールディングス	15,000	6,770.00	101,550,000	
2288	丸大食品	12,000	1,891.00	22,692,000	代用有価証券 6,000株
2292	S Foods	11,000	2,498.00	27,478,000	代用有価証券 10,000株
2296	伊藤ハム米久ホールディングス	25,000	636.00	15,900,000	

2502	アサヒグループホールディングス	21,300	4,496.00	95,764,800	代用有価証券 14,700株
2590	ダイドーグループホールディングス	6,500	3,790.00	24,635,000	
2594	キーコーヒー	5,000	2,169.00	10,845,000	
2815	アリアケジャパン	5,500	7,420.00	40,810,000	代用有価証券 5,500株
2875	東洋水産	15,000	4,400.00	66,000,000	
2908	フジッコ	12,000	1,810.00	21,720,000	代用有価証券 7,000株
3106	倉敷紡績	4,000	2,138.00	8,552,000	
3593	ホギメディカル	8,000	3,205.00	25,640,000	
3865	北越コーポレーション	40,000	476.00	19,040,000	代用有価証券 30,000株
3950	ザ・バック	7,000	4,025.00	28,175,000	代用有価証券 7,000株
4004	昭和電工	31,900	2,572.00	82,046,800	代用有価証券 19,000株
4008	住友精化	7,900	3,005.00	23,739,500	代用有価証券 7,900株
4023	クレハ	4,000	5,750.00	23,000,000	
4027	テイカ	5,000	1,551.00	7,755,000	
4028	石原産業	32,000	773.00	24,736,000	代用有価証券 25,000株
4041	日本曹達	14,200	2,999.00	42,585,800	代用有価証券 14,000株
4042	東ソー	75,400	1,578.00	118,981,200	代用有価証券 75,400株
4044	セントラル硝子	12,000	2,183.00	26,196,000	
4045	東亜合成	34,900	1,161.00	40,518,900	代用有価証券 31,000株
4046	大阪ソーダ	7,000	2,645.00	18,515,000	代用有価証券 5,000株
4063	信越化学工業	8,000	13,495.00	107,960,000	代用有価証券 8,000株
4078	堺化学工業	5,000	2,076.00	10,380,000	
4092	日本化学工業	9,000	2,563.00	23,067,000	
4095	日本パーカライジング	36,400	1,053.00	38,329,200	代用有価証券 22,000株
4114	日本触媒	4,000	5,800.00	23,200,000	
4116	大日精化工業	7,000	2,455.00	17,185,000	
4202	ダイセル	94,000	956.00	89,864,000	代用有価証券 94,000株
4206	アイカ工業	9,000	3,290.00	29,610,000	代用有価証券 6,000株
4208	宇部興産	18,200	2,080.00	37,856,000	代用有価証券 14,000株
4212	積水樹脂	6,000	2,225.00	13,350,000	代用有価証券 6,000株
4218	ニチバン	10,000	1,648.00	16,480,000	

4228	積水化成品工業	22,000	653.00	14,366,000	
4246	ダイキョーニシカワ	22,000	675.00	14,850,000	代用有価証券 20,000株
4401	A D E K A	19,000	1,491.00	28,329,000	代用有価証券 19,000株
4612	日本ペイントホールディングス	18,000	4,950.00	89,100,000	
4634	東洋インキＳＣホールディングス	12,000	2,274.00	27,288,000	
4911	資生堂	10,500	6,828.00	71,694,000	
4914	高砂香料工業	10,000	2,202.00	22,020,000	代用有価証券 6,000株
4928	ノエビアホールディングス	5,000	5,000.00	25,000,000	
4974	タカラバイオ	11,000	2,184.00	24,024,000	
4996	クミアイ化学工業	32,000	790.00	25,280,000	
5208	有沢製作所	14,000	883.00	12,362,000	
6988	日東電工	17,000	5,710.00	97,070,000	代用有価証券 13,000株
7917	藤森工業	6,500	3,155.00	20,507,500	
7970	信越ポリマー	40,900	933.00	38,159,700	代用有価証券 40,900株
4503	アステラス製薬	55,200	1,824.00	100,684,800	代用有価証券 55,200株
4519	中外製薬	11,000	11,995.00	131,945,000	代用有価証券 11,000株
4540	ツムラ	10,000	2,656.00	26,560,000	代用有価証券 10,000株
4541	日医工	17,000	1,277.00	21,709,000	代用有価証券 17,000株
4551	鳥居薬品	11,000	3,525.00	38,775,000	代用有価証券 11,000株
4552	J C Rファーマ	4,000	10,610.00	42,440,000	代用有価証券 4,000株
4553	東和薬品	10,000	2,305.00	23,050,000	
4568	第一三共	15,400	7,270.00	111,958,000	代用有価証券 15,400株
5021	コスモエネルギーホールディングス	10,000	1,951.00	19,510,000	
5186	ニッタ	3,000	2,656.00	7,968,000	
5214	日本電気硝子	16,800	1,984.00	33,331,200	代用有価証券 16,800株
5302	日本カーボン	7,800	3,955.00	30,849,000	代用有価証券 6,000株
5310	東洋炭素	16,900	1,877.00	31,721,300	代用有価証券 16,900株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	3,500	4,000.00	14,000,000	
5344	M A R U W A	4,000	7,360.00	29,440,000	代用有価証券 4,000株
5351	品川リフラクトリーズ	6,000	2,770.00	16,620,000	代用有価証券 4,000株
5384	フジミインコーポレーテッド	13,000	2,936.00	38,168,000	代用有価証券 11,000株

7943	ニチハ	12,000	2,430.00	29,160,000	代用有価証券 11,000株
5440	共英製鋼	13,000	1,748.00	22,724,000	
5444	大和工業	14,000	2,395.00	33,530,000	代用有価証券 12,000株
5451	淀川製鋼所	5,500	1,935.00	10,642,500	
5463	丸一鋼管	25,200	2,753.00	69,375,600	代用有価証券 20,200株
5632	三菱製鋼	3,000	918.00	2,754,000	
5703	日本軽金属ホールディングス	140,000	205.00	28,700,000	
5707	東邦亜鉛	16,000	1,708.00	27,328,000	
5713	住友金属鉱山	25,000	2,922.50	73,062,500	
5803	フジクラ	80,000	369.00	29,520,000	代用有価証券 80,000株
5851	リョービ	14,000	1,551.00	21,714,000	
5901	東洋製罐グループホールディングス	50,000	1,812.00	90,600,000	
5930	文化シヤッター	20,000	815.00	16,300,000	代用有価証券 20,000株
5938	L I X I Lグループ	62,000	1,777.00	110,174,000	代用有価証券 62,000株
5959	岡部	15,000	817.00	12,255,000	
5970	ジーテクト	12,000	1,400.00	16,800,000	代用有価証券 10,000株
5988	パイオラックス	10,000	1,685.00	16,850,000	
5631	日本製鋼所	10,000	1,670.00	16,700,000	
6013	タクマ	26,000	1,227.00	31,902,000	代用有価証券 24,000株
6113	アマダホールディングス	80,000	1,039.00	83,120,000	
6118	アイダエンジニアリング	27,000	843.00	22,761,000	代用有価証券 22,000株
6134	F U J I	33,000	1,810.00	59,730,000	代用有価証券 26,000株
6136	オーエスジー	19,000	1,698.00	32,262,000	代用有価証券 19,000株
6140	旭ダイヤモンド工業	47,000	555.00	26,085,000	代用有価証券 44,000株
6146	ディスコ	2,500	23,660.00	59,150,000	代用有価証券 1,500株
6235	オプトラン	10,000	3,225.00	32,250,000	代用有価証券 10,000株
6269	三井海洋開発	10,500	1,883.00	19,771,500	
6272	レオン自動機	14,000	1,252.00	17,528,000	
6273	SMC	2,000	47,390.00	94,780,000	
6282	オイレス工業	16,000	1,465.00	23,440,000	代用有価証券 9,000株
6302	住友重機械工業	33,600	2,500.00	84,000,000	代用有価証券 33,600株
6339	新東工業	20,000	833.00	16,660,000	代用有価証券 18,000株

6340	澁谷工業	6,000	2,603.00	15,618,000	代用有価証券 4,000株
6345	アイチ コーポレーション	25,000	650.00	16,250,000	
6367	ダイキン工業	3,000	15,300.00	45,900,000	
6369	トーヨーカネツ	4,500	2,375.00	10,687,500	
6370	栗田工業	18,000	3,055.00	54,990,000	
6371	椿本チエイン	8,000	3,070.00	24,560,000	代用有価証券 4,000株
6436	アマノ	11,900	2,760.00	32,844,000	代用有価証券 7,000株
6440	J U K I	35,000	777.00	27,195,000	代用有価証券 31,000株
6458	新晃工業	14,000	1,590.00	22,260,000	
6463	T P R	10,000	1,579.00	15,790,000	
6465	ホシザキ	8,500	9,990.00	84,915,000	代用有価証券 8,500株
6490	日本ビラー工業	14,000	1,397.00	19,558,000	
7718	スター精密	23,000	1,282.00	29,486,000	代用有価証券 23,000株
6590	芝浦メカトロニクス	5,000	3,095.00	15,475,000	
6592	マブチモーター	9,000	3,995.00	35,955,000	代用有価証券 9,000株
6616	トレックス・セミコンダクター	13,000	1,420.00	18,460,000	代用有価証券 13,000株
6641	日新電機	26,000	1,066.00	27,716,000	代用有価証券 21,000株
6651	日東工業	10,000	2,025.00	20,250,000	
6701	日本電気	16,000	4,630.00	74,080,000	代用有価証券 14,000株
6702	富士通	9,600	12,250.00	117,600,000	代用有価証券 9,600株
6745	ホーチキ	11,000	1,305.00	14,355,000	
6750	エレコム	8,500	3,675.00	31,237,500	代用有価証券 8,500株
6755	富士通ゼネラル	17,000	2,346.00	39,882,000	代用有価証券 17,000株
6758	ソニー	10,500	7,269.00	76,324,500	代用有価証券 5,500株
6788	日本トリム	4,500	3,590.00	16,155,000	代用有価証券 4,500株
6789	ローランド ディー. ジー.	14,000	1,771.00	24,794,000	代用有価証券 8,000株
6794	フォスター電機	15,000	1,543.00	23,145,000	
6800	ヨコオ	10,000	2,780.00	27,800,000	代用有価証券 8,000株
6804	ホシデン	25,000	1,031.00	25,775,000	代用有価証券 25,000株
6820	アイコム	6,000	2,466.00	14,796,000	代用有価証券 3,000株

6844	新電元工業	9,000	3,230.00	29,070,000	代用有価証券 6,500株
6857	アドバンテスト	9,500	5,300.00	50,350,000	
6861	キーエンス	2,500	37,280.00	93,200,000	
6866	日置電機	3,000	3,415.00	10,245,000	
6923	スタンレー電気	30,800	2,784.00	85,747,200	
6925	ウシオ電機	15,000	1,411.00	21,165,000	
6929	日本セラミック	7,000	2,429.00	17,003,000	
6947	図研	8,000	2,279.00	18,232,000	
6952	カシオ計算機	43,000	2,032.00	87,376,000	
6954	ファナック	4,100	19,505.00	79,970,500	
6961	エンプラス	9,000	2,852.00	25,668,000	代用有価証券 9,000株
6963	ローム	12,200	7,900.00	96,380,000	代用有価証券 10,200株
6971	京セラ	14,700	7,179.00	105,531,300	代用有価証券 11,200株
6986	双葉電子工業	16,000	1,088.00	17,408,000	代用有価証券 14,000株
6996	ニチコン	20,000	843.00	16,860,000	
6999	K O A	15,000	1,148.00	17,220,000	
7244	市光工業	30,000	699.00	20,970,000	
7276	小糸製作所	19,600	4,445.00	87,122,000	代用有価証券 6,000株
7739	キャノン電子	14,000	1,937.00	27,118,000	代用有価証券 14,000株
5949	ユニプレス	19,000	1,222.00	23,218,000	代用有価証券 16,000株
6201	豊田自動織機	15,000	6,020.00	90,300,000	代用有価証券 14,000株
6455	モリタホールディングス	16,000	1,781.00	28,496,000	代用有価証券 16,000株
6902	デンソー	20,000	4,328.00	86,560,000	
6995	東海理化電機製作所	12,000	1,717.00	20,604,000	
7014	名村造船所	54,000	228.00	12,312,000	代用有価証券 34,000株
7202	いすゞ自動車	87,000	1,084.00	94,308,000	代用有価証券 87,000株
7226	極東開発工業	7,000	1,312.00	9,184,000	
7231	トピー工業	7,000	1,632.00	11,424,000	
7246	プレス工業	40,000	338.00	13,520,000	代用有価証券 29,000株
7256	河西工業	26,000	707.00	18,382,000	
7270	S U B A R U	25,100	2,845.00	71,409,500	
7283	愛三工業	28,000	663.00	18,564,000	
7309	シマノ	4,900	15,150.00	74,235,000	
7313	テイ・エス テック	9,000	3,000.00	27,000,000	代用有価証券 9,000株

4543	テルモ	20,000	3,631.00	72,620,000	
7600	日本エム・ディ・エム	10,000	1,810.00	18,100,000	
7717	ブイ・テクノロジー	4,000	4,290.00	17,160,000	
7725	インターアクション	10,000	2,637.00	26,370,000	
7731	ニコン	52,200	1,157.00	60,395,400	
7740	タムロン	9,000	2,595.00	23,355,000	
7744	ノーリツ銅機	18,000	1,435.00	25,830,000	代用有価証券 13,000株
7747	朝日インテック	35,000	2,640.00	92,400,000	代用有価証券 35,000株
7780	メニコン	7,000	4,775.00	33,425,000	代用有価証券 5,000株
7820	ニホンフラッシュ	7,000	2,414.00	16,898,000	代用有価証券 4,000株
7823	アートネイチャー	13,000	709.00	9,217,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	11,600	5,765.00	66,874,000	代用有価証券 11,600株
7911	凸版印刷	30,000	1,961.00	58,830,000	
7912	大日本印刷	20,000	2,773.00	55,460,000	
7974	任天堂	1,500	39,230.00	58,845,000	
7976	三菱鉛筆	11,500	1,540.00	17,710,000	代用有価証券 11,500株
8022	美津濃	8,000	2,373.00	18,984,000	代用有価証券 7,000株
9009	京成電鉄	23,200	3,635.00	84,332,000	代用有価証券 23,200株
9021	西日本旅客鉄道	12,200	8,309.00	101,369,800	代用有価証券 12,200株
9037	ハマキョウレックス	9,500	3,000.00	28,500,000	代用有価証券 9,500株
9044	南海電気鉄道	13,000	2,566.00	33,358,000	代用有価証券 13,000株
9045	京阪ホールディングス	15,000	4,590.00	68,850,000	
9048	名古屋鉄道	29,000	2,952.00	85,608,000	代用有価証券 29,000株
9068	丸全昭和運輸	3,000	2,611.00	7,833,000	
9072	ニッコンホールディングス	11,000	2,251.00	24,761,000	
9090	丸和運輸機関	12,000	1,858.00	22,296,000	代用有価証券 12,000株
9143	S Gホールディングス	37,000	2,154.00	79,698,000	代用有価証券 25,000株
9110	N Sユナイテッド海運	3,000	1,764.00	5,292,000	
9364	上組	40,000	2,182.00	87,280,000	代用有価証券 10,000株
3649	ファインデックス	20,000	822.00	16,440,000	
3655	ブレインパッド	4,000	4,900.00	19,600,000	
3677	システム情報	30,000	809.00	24,270,000	代用有価証券 30,000株

3738	ティーガイア	12,000	2,217.00	26,604,000	代用有価証券 12,000株
3741	セック	4,000	3,495.00	13,980,000	
3844	コムチュア	12,000	2,152.00	25,824,000	代用有価証券 12,000株
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジ	15,000	1,581.00	23,715,000	代用有価証券 15,000株
3925	ダブルスタンダード	5,000	3,875.00	19,375,000	代用有価証券 4,000株
3983	オロ	6,000	3,080.00	18,480,000	代用有価証券 6,000株
4333	東邦システムサイエンス	4,000	875.00	3,500,000	
4686	ジャストシステム	5,000	5,330.00	26,650,000	
4689	Zホールディングス	120,000	434.00	52,080,000	
4722	フューチャー	15,000	1,739.00	26,085,000	代用有価証券 10,000株
4725	CAC Holdings	14,000	1,211.00	16,954,000	代用有価証券 14,000株
4733	オービックビジネスコンサルタント	7,000	3,975.00	27,825,000	代用有価証券 7,000株
4743	アイティフォー	28,000	717.00	20,076,000	代用有価証券 20,000株
4779	ソフトブレイン	33,000	480.00	15,840,000	代用有価証券 33,000株
4820	EMシステムズ	20,000	885.00	17,700,000	
8096	兼松エレクトロニクス	3,000	3,260.00	9,780,000	
9404	日本テレビホールディングス	16,000	1,405.00	22,480,000	代用有価証券 15,000株
9412	スカパーJ S A Tホールディングス	50,000	466.00	23,300,000	代用有価証券 50,000株
9433	KDDI	29,300	3,394.00	99,444,200	代用有価証券 7,000株
9435	光通信	4,000	22,070.00	88,280,000	代用有価証券 2,600株
9601	松竹	2,000	13,220.00	26,440,000	代用有価証券 2,000株
9602	東宝	15,000	3,645.00	54,675,000	代用有価証券 13,000株
9605	東映	2,000	13,110.00	26,220,000	代用有価証券 2,000株
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	53,000	1,401.00	74,253,000	
9682	D T S	15,000	2,120.00	31,800,000	代用有価証券 13,000株
9739	日本システムウエア	10,000	2,150.00	21,500,000	
9742	アイネス	14,000	1,657.00	23,198,000	
2729	J A L U X	3,500	2,107.00	7,374,500	代用有価証券 3,500株
2768	双日	120,000	331.00	39,720,000	代用有価証券 120,000株

2784	アルフレッサ ホールディングス	26,000	2,036.00	52,936,000	代用有価証券 22,000株
2874	横浜冷凍	25,000	899.00	22,475,000	代用有価証券 17,000株
3076	あい ホールディングス	16,000	1,630.00	26,080,000	代用有価証券 13,000株
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	10,000	1,030.00	10,300,000	
3360	シップヘルスケアホールディングス	5,500	4,515.00	24,832,500	代用有価証券 5,500株
3543	コメダホールディングス	13,000	2,107.00	27,391,000	代用有価証券 13,000株
7483	ドウシシャ	10,000	1,492.00	14,920,000	代用有価証券 10,000株
7575	日本ライフライン	22,000	1,378.00	30,316,000	代用有価証券 13,000株
7599	I D O M	80,000	587.00	46,960,000	代用有価証券 80,000株
8020	兼松	25,000	1,268.00	31,700,000	代用有価証券 25,000株
8031	三井物産	63,700	1,869.00	119,055,300	代用有価証券 37,000株
8051	山善	20,500	952.00	19,516,000	代用有価証券 17,500株
8058	三菱商事	42,600	2,798.50	119,216,100	
8068	菱洋エレクトロ	10,000	1,851.00	18,510,000	
8074	ユアサ商事	6,000	3,170.00	19,020,000	代用有価証券 6,000株
8129	東邦ホールディングス	11,000	2,193.00	24,123,000	代用有価証券 8,000株
8140	リョーサン	9,000	2,332.00	20,988,000	代用有価証券 9,000株
8141	新光商事	19,000	759.00	14,421,000	
8151	東陽テクニカ	24,000	992.00	23,808,000	
8283	P A L T A C	5,500	4,665.00	25,657,500	
2651	ローソン	15,400	6,070.00	93,478,000	代用有価証券 15,400株
2685	アダストリア	10,000	1,986.00	19,860,000	代用有価証券 10,000株
2730	エディオン	20,000	976.00	19,520,000	代用有価証券 20,000株
3073	D Dホールディングス	11,000	1,560.00	17,160,000	代用有価証券 11,000株
3085	アークランドサービスホールディングス	13,600	1,907.00	25,935,200	代用有価証券 10,600株
3091	ブロンコビリー	8,000	2,391.00	19,128,000	代用有価証券 8,000株
3097	物語コーポレーション	3,200	8,050.00	25,760,000	代用有価証券 3,200株
3148	クリエイト S Dホールディングス	10,000	2,570.00	25,700,000	

3186	ネクステージ	31,000	955.00	29,605,000	代用有価証券 26,000株
3193	鳥貴族	8,400	2,522.00	21,184,800	代用有価証券 4,900株
3194	キリン堂ホールディングス	12,000	1,632.00	19,584,000	代用有価証券 10,000株
3221	ヨシックス	5,000	2,521.00	12,605,000	代用有価証券 3,700株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	11,000	2,072.00	22,792,000	
3415	TOKYO BASE	38,000	431.00	16,378,000	代用有価証券 38,000株
3539	JMホールディングス	7,000	2,124.00	14,868,000	
3563	スシローグローバルホールディングス	1,800	8,640.00	15,552,000	代用有価証券 1,800株
7419	ノジマ	14,000	2,040.00	28,560,000	代用有価証券 14,000株
7508	G-7ホールディングス	8,000	2,405.00	19,240,000	
7516	コーナン商事	13,000	2,335.00	30,355,000	代用有価証券 13,000株
7611	ハイデイ日高	9,000	1,850.00	16,650,000	代用有価証券 9,000株
7630	壺番屋	4,000	5,230.00	20,920,000	代用有価証券 4,000株
8028	ファミリーマート	25,000	2,417.00	60,425,000	
8174	日本瓦斯	3,000	3,745.00	11,235,000	
8219	青山商事	18,000	1,253.00	22,554,000	代用有価証券 18,000株
8252	丸井グループ	30,000	2,257.00	67,710,000	
8273	イズミ	8,000	3,150.00	25,200,000	
9842	アークランドサカモト	14,500	1,145.00	16,602,500	代用有価証券 14,500株
9843	ニトリホールディングス	3,500	16,110.00	56,385,000	
9948	アークス	15,000	1,850.00	27,750,000	代用有価証券 12,000株
9956	バローホールディングス	18,000	1,724.00	31,032,000	代用有価証券 18,000株
3231	野村不動産ホールディングス	41,500	2,616.00	108,564,000	代用有価証券 28,600株
3245	ディア・ライフ	28,000	556.00	15,568,000	代用有価証券 28,000株
3276	日本管理センター	12,000	1,288.00	15,456,000	
3288	オープンハウス	9,000	3,105.00	27,945,000	代用有価証券 9,000株
3289	東急不動産ホールディングス	130,000	750.00	97,500,000	
3457	ハウスドゥ	10,000	1,112.00	11,120,000	代用有価証券 10,000株
8804	東京建物	17,000	1,637.00	27,829,000	
8871	ゴールドクレスト	14,000	1,797.00	25,158,000	代用有価証券 14,000株

8934	サンフロンティア不動産	14,000	1,207.00	16,898,000	代用有価証券 14,000株
2124	ジェイエイシーリクルートメント	14,300	1,535.00	21,950,500	代用有価証券 8,800株
2130	メンバーズ	12,000	1,515.00	18,180,000	代用有価証券 10,000株
2309	シミックホールディングス	13,000	1,523.00	19,799,000	代用有価証券 9,000株
2412	ベネフィット・ワン	10,000	1,781.00	17,810,000	代用有価証券 10,000株
2413	エムスリー	30,200	2,945.00	88,939,000	代用有価証券 20,200株
2475	WDBホールディングス	8,000	2,455.00	19,640,000	代用有価証券 7,000株
2492	インフォマート	30,000	697.00	20,910,000	代用有価証券 30,000株
4544	みらかホールディングス	9,000	2,724.00	24,516,000	
4661	オリエンタルランド	5,000	12,920.00	64,600,000	
4694	ビー・エム・エル	8,000	3,170.00	25,360,000	
4714	リソー教育	45,000	365.00	16,425,000	
4763	クリーク・アンド・リバー社	19,000	970.00	18,430,000	代用有価証券 13,000株
4849	エン・ジャパン	6,000	3,350.00	20,100,000	代用有価証券 6,000株
6062	チャーム・ケア・コーポレーション	30,000	893.00	26,790,000	代用有価証券 30,000株
6080	M&Aキャピタルパートナーズ	8,000	3,575.00	28,600,000	代用有価証券 8,000株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	13,000	1,564.00	20,332,000	代用有価証券 13,000株
6191	エアトリ	10,000	1,276.00	12,760,000	
6196	ストライク	4,000	4,510.00	18,040,000	代用有価証券 4,000株
6539	MS－Japan	17,000	1,188.00	20,196,000	代用有価証券 14,000株
6541	グレイステクノロジー	11,000	2,993.00	32,923,000	代用有価証券 9,000株
6544	ジャパンエレベーターサービスホールディング	10,000	2,147.00	21,470,000	代用有価証券 10,000株
9612	ラックランド	4,000	2,077.00	8,308,000	
9671	よみうりランド	1,800	3,910.00	7,038,000	代用有価証券 1,800株
9672	東京都競馬	9,000	3,465.00	31,185,000	代用有価証券 9,000株
9678	カナモト	14,000	2,551.00	35,714,000	代用有価証券 12,000株
9681	東京ドーム	20,000	889.00	17,780,000	
9699	西尾レントオール	10,000	2,798.00	27,980,000	代用有価証券 10,000株
9715	トランス・コスモス	7,500	2,525.00	18,937,500	

9716	乃村工藝社	25,000	1,096.00	27,400,000	代用有価証券 25,000株
9728	日本管財	4,000	1,875.00	7,500,000	
9735	セコム	9,000	9,094.00	81,846,000	代用有価証券 3,000株
9743	丹青社	26,000	1,088.00	28,288,000	代用有価証券 18,000株
9755	応用地質	17,000	1,345.00	22,865,000	代用有価証券 10,000株
9787	イオンディライト	7,000	3,540.00	24,780,000	
合 計		6,269,900		12,230,074,100	

(注1)備考欄の数値は、差入保証金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

(2)株式以外の有価証券

該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表

(単位：円)

銘柄	信用取引		備考
	売建株数	評価額	
極洋	2,500	6,797,500	
サカタのタネ	9,000	28,800,000	
タマホーム	13,000	17,823,000	
東急建設	40,000	28,840,000	
大林組	75,000	87,525,000	
不動テトラ	18,000	27,792,000	
西松建設	12,000	27,864,000	
前田建設工業	30,000	30,300,000	
浅沼組	5,000	23,975,000	
戸田建設	40,000	27,120,000	
大東建託	8,500	101,107,500	
N I P P O	13,000	33,657,000	
東亜建設工業	16,000	26,944,000	
五洋建設	40,000	24,920,000	
住友林業	15,000	25,500,000	
関電工	25,000	24,150,000	
大気社	6,000	19,590,000	
日本製粉	17,000	27,302,000	
中部飼料	5,000	7,545,000	
江崎グリコ	7,000	31,745,000	
山崎製パン	41,000	79,622,000	
亀田製菓	4,500	20,520,000	

サッポロホールディングス	14,000	32,494,000	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	30,000	82,860,000	
伊藤園	7,000	36,050,000	
不二製油グループ本社	13,000	33,852,000	
味の素	48,000	91,416,000	
カゴメ	13,000	32,305,000	
ニチレイ	14,000	39,004,000	
日清食品ホールディングス	9,000	77,760,000	
東洋紡	28,000	40,628,000	
富士紡ホールディングス	7,500	24,000,000	
日本毛織	16,000	15,216,000	
帝国繊維	8,000	16,312,000	
東レ	130,000	88,608,000	
セーレン	18,000	27,144,000	
ワコールホールディングス	12,000	31,716,000	
ワールド	12,000	25,932,000	
オンワードホールディングス	55,000	31,955,000	
デサント	18,000	28,242,000	
レンゴー	40,000	31,720,000	
大陽日酸	43,000	87,849,000	
ステラ ケミファ	13,000	39,585,000	
保土谷化学工業	10,400	42,588,000	
三井化学	42,000	102,900,000	
東京応化工業	7,000	29,680,000	
大阪有機化学工業	13,000	21,723,000	
三菱ケミカルホールディングス	140,000	108,290,000	
KHネオケム	10,000	23,870,000	
積水化学工業	60,000	103,920,000	
タキロンシーアイ	10,000	6,300,000	
扶桑化学工業	11,000	35,695,000	
第一工業製薬	10,000	40,200,000	
中国塗料	29,500	26,786,000	
太陽ホールディングス	8,000	36,520,000	
ミルボン	6,000	33,660,000	
ファンケル	8,000	23,672,000	
コーセー	5,000	69,300,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	37,000	79,402,000	
長谷川香料	10,000	20,750,000	
星光PMC	12,000	9,768,000	
メック	10,000	14,470,000	
JCU	12,000	33,684,000	
アース製薬	4,500	25,830,000	

レック	21,000	22,932,000	
J S P	10,000	17,240,000	
エフピコ	6,000	40,560,000	
ニフコ	10,500	29,211,000	
大日本住友製薬	49,000	80,409,000	
あすか製薬	12,000	12,852,000	
小野薬品工業	40,000	98,280,000	
久光製薬	20,000	104,600,000	
栄研化学	17,000	38,182,000	
富士製薬工業	6,000	7,080,000	
沢井製薬	4,000	26,960,000	
ゼリア新薬工業	15,000	28,005,000	
大幸薬品	8,500	44,795,000	
大正製薬ホールディングス	12,000	83,160,000	
富士石油	40,000	8,880,000	
出光興産	46,000	131,146,000	
住友ゴム工業	75,000	90,600,000	
日東紡績	8,000	38,400,000	
A G C	25,000	83,125,000	
アジアパイルホールディングス	14,000	7,056,000	
T O T O	25,400	110,998,000	
日本碍子	64,000	116,864,000	
黒崎播磨	3,500	21,805,000	
クニミネ工業	9,000	10,314,000	
ニチアス	15,000	36,855,000	
合同製鐵	12,000	31,680,000	
ジェイ エフ イー ホールディングス	40,000	42,000,000	
山陽特殊製鋼	17,000	22,746,000	
日立金属	60,000	99,120,000	
新日本電工	130,000	21,320,000	
三井金属鉱業	10,000	28,730,000	
D O W Aホールディングス	7,000	26,145,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	20,700	25,502,400	
東邦チタニウム	32,500	26,455,000	
U A C J	13,000	26,000,000	
住友電気工業	60,000	83,370,000	
昭和電線ホールディングス	27,100	33,360,100	
アサヒホールディングス	15,000	40,155,000	
トーカロ	30,000	31,470,000	
川田テクノロジーズ	3,000	17,760,000	
横河ブリッジホールディングス	10,000	20,610,000	
三協立山	15,000	18,465,000	

アルインコ	10,000	10,340,000	
ノーリツ	10,000	12,210,000	
長府製作所	6,000	12,660,000	
日本発條	25,000	21,475,000	
三益半導体工業	11,000	23,430,000	
三浦工業	11,000	40,425,000	
ツガミ	30,000	28,200,000	
日精エー・エス・ビー機械	9,000	34,740,000	
技研製作所	8,000	32,320,000	
日立建機	31,000	89,063,000	
日工	30,000	21,900,000	
オルガノ	3,500	23,590,000	
ダイフク	16,000	107,520,000	
C K D	29,000	53,070,000	
キトー	8,000	12,200,000	
サンデンホールディングス	32,000	18,880,000	
ツバキ・ナカシマ	16,000	18,384,000	
日本精工	101,000	87,870,000	
N T N	100,000	28,100,000	
不二越	6,000	22,740,000	
日本トムソン	40,000	16,440,000	
キッツ	22,000	14,696,000	
日立造船	70,000	28,630,000	
I H I	41,800	107,217,000	
イビデン	12,000	31,440,000	
コニカミノルタ	60,000	37,500,000	
ミネベアミツミ	52,900	112,677,000	
富士電機	30,000	96,000,000	
安川電機	18,000	65,070,000	
明電舎	10,000	18,810,000	
山洋電気	4,000	18,740,000	
日本電産	6,000	81,150,000	
ダイヘン	6,000	18,240,000	
第一精工	14,000	31,738,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	12,000	24,372,000	
沖電気工業	20,000	25,520,000	
電気興業	6,000	18,510,000	
サンケン電気	10,000	28,210,000	
ルネサスエレクトロニクス	140,000	103,040,000	
京三製作所	44,000	22,308,000	
パナソニック	60,000	68,250,000	
シャープ	69,800	97,650,200	

アンリツ	10,000	19,360,000	
タムラ製作所	45,000	24,075,000	
マクセルホールディングス	20,000	27,600,000	
スミダコーポレーション	15,000	16,110,000	
日本光電工業	8,000	27,600,000	
シスメックス	12,000	87,756,000	
日本マイクロニクス	20,000	20,520,000	
メガチップス	13,000	21,502,000	
コーセル	10,000	10,680,000	
イリソ電子工業	7,000	27,685,000	
オブテックスグループ	15,000	20,745,000	
古河電池	10,000	6,670,000	
山一電機	15,000	26,460,000	
日本電子	10,000	31,050,000	
大真空	10,000	17,810,000	
三井ハイテック	11,000	17,061,000	
新光電気工業	15,000	19,935,000	
太陽誘電	5,000	17,125,000	
日本ケミコン	16,000	27,712,000	
キャノン	26,100	71,096,400	
リコー	70,100	74,376,100	
象印マホービン	15,000	27,705,000	
トヨタ紡織	15,000	23,325,000	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	25,000	20,825,000	
川崎重工業	50,000	104,850,000	
日本車輛製造	7,000	19,026,000	
三菱ロジスネクスト	15,000	24,255,000	
日産自動車	120,000	57,768,000	
武蔵精密工業	18,000	23,184,000	
フタバ産業	35,000	20,860,000	
K Y B	9,000	23,436,000	
大同メタル工業	35,000	22,400,000	
アイシン精機	27,000	100,575,000	
日機装	25,000	26,275,000	
島津製作所	36,300	101,240,700	
長野計器	28,000	25,312,000	
トプコン	14,000	16,380,000	
シード	2,000	1,780,000	
エー・アンド・デイ	23,000	20,930,000	
大研医器	33,000	21,021,000	
セイコーホールディングス	15,000	31,875,000	
前田工繊	17,000	35,156,000	

SHOE I	3,500	18,725,000	
フジシールインターナショナル	10,000	20,370,000	
河合楽器製作所	4,500	12,798,000	
ピジョン	25,000	95,500,000	
西部瓦斯	3,500	7,913,500	
メタウォーター	5,000	19,850,000	
SBSホールディングス	11,000	19,019,000	
東武鉄道	26,100	88,870,500	
小田急電鉄	29,300	64,137,700	
東海旅客鉄道	5,300	102,740,500	
西日本鉄道	15,000	37,500,000	
阪急阪神ホールディングス	20,000	76,600,000	
日本通運	14,500	80,910,000	
ヤマトホールディングス	50,000	93,700,000	
日立物流	10,000	30,300,000	
日本郵船	50,000	82,500,000	
川崎汽船	13,000	17,758,000	
三井倉庫ホールディングス	13,000	21,554,000	
住友倉庫	20,000	27,580,000	
近鉄エクスプレス	14,000	24,990,000	
NEC ネットエスアイ	6,000	24,840,000	
ネクソン	36,000	66,132,000	
ブイキューブ	35,000	32,060,000	
フィックスターズ	22,000	28,248,000	
テクマトリックス	11,000	30,437,000	
GMO ペイメントゲートウェイ	7,000	51,100,000	
さくらインターネット	30,000	17,460,000	
ヴィンクス	10,000	9,190,000	
アドソル日進	10,000	25,100,000	
マクロミル	25,000	23,975,000	
プロトコーポレーション	21,000	26,523,000	
サイボウズ	22,000	46,552,000	
電通国際情報サービス	7,500	36,525,000	
アルゴグラフィックス	5,000	17,475,000	
日本ユニシス	6,500	23,790,000	
テレビ朝日ホールディングス	17,000	32,946,000	
コネクション	15,000	22,320,000	
NTT ドコモ	32,800	101,483,200	
SCSK	3,000	18,300,000	
富士ソフト	6,000	23,250,000	
コナミホールディングス	14,800	61,642,000	
JBC Cホールディングス	17,000	31,637,000	

ダイワボウホールディングス	7,000	42,490,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	17,000	27,540,000	
TOKAIホールディングス	35,800	34,224,800	
三菱食品	8,000	22,360,000	
伊藤忠商事	47,900	123,510,150	
内田洋行	5,000	27,950,000	
阪和興業	10,000	24,250,000	
正栄食品工業	6,000	21,510,000	
岩谷産業	7,000	25,445,000	
イワキ	25,000	12,475,000	
ミツウロコグループホールディングス	13,000	13,819,000	
サンリオ	17,000	30,685,000	
モスフードサービス	11,000	31,922,000	
トラスコ中山	12,000	27,180,000	
オートバックスセブン	20,000	29,620,000	
因幡電機産業	11,000	27,643,000	
東テク	3,000	6,900,000	
ミスミグループ本社	33,000	82,599,000	
カワチ薬品	13,000	26,351,000	
ゲオホールディングス	27,000	32,157,000	
ハニーズホールディングス	16,000	20,288,000	
ジーンズホールディングス	3,500	25,165,000	
ビックカメラ	22,000	22,792,000	
J. フロント リテイリング	70,000	86,450,000	
ドトール・日レスホールディングス	13,000	26,078,000	
あさひ	25,000	30,025,000	
コスモス薬品	1,400	33,054,000	
セブン&アイ・ホールディングス	23,200	90,224,800	
ツルハホールディングス	5,300	65,455,000	
LIXILビバ	17,000	38,607,000	
カッパ・クリエイト	16,000	22,528,000	
良品計画	50,000	82,150,000	
アドヴァン	13,000	14,872,000	
コジマ	40,000	18,520,000	
ワタミ	16,000	17,520,000	
西松屋チェーン	15,000	12,855,000	
幸楽苑ホールディングス	10,600	18,454,600	
ピーシーデポコーポレーション	22,000	12,254,000	
木曽路	9,000	24,840,000	
ロイヤルホールディングス	10,000	20,090,000	
いなげや	5,000	6,535,000	
島忠	10,000	28,700,000	

ライフコーポレーション	4,500	11,434,500	
オークワ	7,000	9,947,000	
しまむら	11,000	82,280,000	
高島屋	20,000	21,400,000	
松屋	21,000	15,855,000	
ヤオコー	5,000	29,050,000	
ケーズホールディングス	23,000	28,888,000	
アインホールディングス	5,500	36,795,000	
吉野家ホールディングス	9,000	22,050,000	
松屋フーズホールディングス	4,100	17,466,000	
プレナス	11,000	20,493,000	
ベルク	2,000	10,420,000	
ベルーナ	15,000	8,715,000	
セブン銀行	280,000	85,960,000	
いちご	55,000	20,515,000	
フージャースホールディングス	20,000	13,320,000	
ムゲンエステート	10,000	5,680,000	
パーク２４	35,000	85,085,000	
三菱地所	46,400	96,883,200	
日本エスコン	20,000	16,760,000	
タカラレーベン	35,000	16,555,000	
日本工営	7,000	22,085,000	
タケエイ	27,000	26,028,000	
リンクアンドモチベーション	50,000	25,750,000	
パーソルホールディングス	43,000	70,219,000	
学情	10,000	18,960,000	
スタジオアリス	3,500	6,244,000	
ツクイ	50,000	29,050,000	
ワールドホールディングス	11,000	20,009,000	
ライク	7,500	13,147,500	
E P Sホールディングス	16,000	19,328,000	
プレステージ・インターナショナル	30,000	27,810,000	
電通グループ	26,000	79,560,000	
アルプス技研	16,000	28,864,000	
リゾートトラスト	20,000	31,080,000	
ユー・エス・エス	50,000	89,600,000	
テクノプロ・ホールディングス	4,000	29,200,000	
ジャパンマテリアル	14,000	19,712,000	
ウィルグループ	20,000	18,840,000	
リクルートホールディングス	17,000	72,879,000	
ベルシステム２４ホールディングス	20,000	28,480,000	
スプリックス	15,000	13,905,000	

リログループ	9,000	23,274,000	
東祥	14,000	25,214,000	
建設技術研究所	13,000	26,156,000	
KNT－CTホールディングス	12,000	13,020,000	
船井総研ホールディングス	8,000	22,504,000	
ニチイ学館	20,000	24,460,000	
合計	7,289,600	12,108,044,850	

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】

【日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）】

【純資産額計算書】

令和 2年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	606,870,610
II 負債総額	2,630,143
III 純資産総額（I－II）	604,240,467
IV 発行済口数	503,322,998口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.2005
（10,000口当たり）	（12,005）

(参考)

日本株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

令和 2年 2月28日現在

(単位：円)

I 資産総額	30,331,224,676
II 負債総額	12,862,663,817
III 純資産総額（I－II）	17,468,560,859
IV 発行済口数	12,125,534,253口
V 1口当たり純資産価額（III／IV）	1.4406
（10,000口当たり）	（14,406）

第４【内国投資信託受益証券事務の概要】

（１）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取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。なお、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、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

該当事項はありません。

（４）受益権の譲渡

- ①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。
- ②上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
- ③上記①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た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）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、信託約款の規定のほか、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】

（1）資本金の額等

2020年2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

（2）委託会社の機構

・会社の意思決定機構

業務執行の基本方針を決定し、取締役の職務の執行を監督する機関として、取締役会を設置します。取締役の選任は、総株主の議決権の3分の1以上を有する株主が出席する株主総会にてその議決権の過半数をもって行い、累積投票によらないものとします。また、取締役会で決定した基本方針に基づき、経営管理全般に関する執行方針その他重要な事項を協議・決定する機関として、経営会議を設置します。

・投資運用の意思決定機構

①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。

②運用戦略の決定

運用戦略委員会において、①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。

③運用計画の決定

②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。

④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。

⑤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。

⑥投資行動のモニタリング2

運用部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。

⑦ファンドに関係する法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に関係する法人については、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。

⑧運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、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。

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。

2【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信

託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）等を行っています。また「金融商品取引法」に定める第二種金融商品取引業および投資助言業務を行っています。

2020年 2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本 数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	890	13,659,102
追加型公社債投資信託	16	1,318,207
単位型株式投資信託	66	318,052
単位型公社債投資信託	13	71,887
合 計	985	15,367,247

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

3【委託会社等の経理状況】

（1）財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

（2）監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第35期事業年度に係る中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

（1）【貸借対照表】

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
(資産の部)		

流動資産				
現金及び預金	※2	54,140,307	※2	53,969,686
有価証券		19,967		1,403,513
前払費用		362,886		514,587
未収入金		2,109		2,284
未収委託者報酬		9,770,529		9,995,458
未収収益	※2	674,156	※2	560,483
金銭の信託	※2	30,000	※2	100,000
その他		224,645		153,256
流動資産合計		65,224,602		66,699,271
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	760,010	※1	617,032
器具備品	※1	724,852	※1	665,247
土地		1,356,000		628,433
有形固定資産合計		2,840,863		1,910,713
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		2,654,296		3,670,753
ソフトウェア仮勘定		1,097,970		536,345
無形固定資産合計		3,768,090		4,222,921
投資その他の資産				
投資有価証券		26,361,327		21,408,781
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産		-	※1	824,268
長期差入保証金		627,141		593,536
前払年金費用		434,700		415,234
繰延税金資産		1,237,989		1,496,180
その他		45,230		45,230
貸倒引当金		△23,600		△23,600
投資その他の資産合計		29,002,925		25,079,767
固定資産合計		35,611,879		31,213,401
資産合計		100,836,481		97,912,673

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
(負債の部)		
流動負債		
預り金	359,176	293,258
未払金		
未払収益分配金	174,333	170,281
未払償還金	456,159	448,695
未払手数料	※2 3,905,670	※2 3,990,054
その他未払金	※2 4,330,584	※2 3,961,765
未払費用	※2 4,388,803	※2 3,803,995
未払消費税等	99,010	194,852
未払法人税等	736,829	573,657
賞与引当金	906,167	901,135

役員賞与引当金	125,343	140,100
その他	842,194	868,992
流動負債合計	16,324,272	15,346,788
固定負債		
長期未払金	-	43,200
退職給付引当金	720,536	860,851
役員退職慰労引当金	187,562	144,303
時効後支払損引当金	254,851	247,767
固定負債合計	1,162,951	1,296,122
負債合計	17,487,223	16,642,910
(純資産の部)		
株主資本		
資本金	2,000,131	2,000,131
資本剰余金		
資本準備金	3,572,096	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712	44,732,712
利益剰余金		
利益準備金	342,589	342,589
その他利益剰余金		
別途積立金	6,998,000	6,998,000
繰越利益剰余金	27,790,911	26,069,594
利益剰余金合計	35,131,500	33,410,184
株主資本合計	81,864,344	80,143,028

(単位：千円)

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	1,484,913	1,126,733
評価・換算差額等合計	1,484,913	1,126,733
純資産合計	83,349,257	81,269,762
負債純資産合計	100,836,481	97,912,673

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	75,423,596	70,375,414
投資顧問料	2,723,458	2,505,299
その他営業収益	48,215	18,844
営業収益合計	78,195,269	72,899,557
営業費用		
支払手数料	※2 30,906,879	※2 28,533,952
広告宣伝費	730,784	739,643

公告費	1,000	500
調査費		
調査費	1,723,057	1,794,755
委託調査費	13,467,029	12,194,996
事務委託費	864,916	1,016,816
営業雑経費		
通信費	178,652	170,794
印刷費	467,973	427,442
協会費	50,251	48,375
諸会費	15,328	16,175
事務機器関連費	1,635,079	1,841,631
その他営業雑経費	23,250	-
営業費用合計	50,064,204	46,785,083
一般管理費		
給料		
役員報酬	349,359	349,083
給料・手当	6,421,837	6,453,717
賞与引当金繰入	906,167	901,135
役員賞与引当金繰入	125,343	140,100
福利厚生費	1,231,033	1,234,293
交際費	13,012	13,011
旅費交通費	192,192	200,426
租税公課	410,229	373,201
不動産賃借料	678,182	654,886
退職給付費用	423,171	428,912
役員退職慰労引当金繰入	47,889	51,159
固定資産減価償却費	1,115,719	1,252,321
諸経費	450,299	523,213
一般管理費合計	12,364,437	12,575,461
営業利益	15,766,627	13,539,012

(単位：千円)

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
営業外収益		
受取配当金	349,402	181,073
受取利息	※2 483	※2 1,913
投資有価証券償還益	81,580	416,706
収益分配金等時効完成分	91,672	44,392
受取賃貸料	-	※2 38,388
その他	9,989	11,871
営業外収益合計	533,128	694,346
営業外費用		
投資有価証券償還損	30,114	118,173
時効後支払損引当金繰入	43,182	1,166
事務過誤費	10,402	420
賃貸関連費用	-	35,994
その他	3,829	1,481
営業外費用合計	87,529	157,235

経常利益		16,212,226		14,076,123
特別利益				
投資有価証券売却益		516,394		501,778
ゴルフ会員権売却益		7,495		-
特別利益合計		523,889		501,778
特別損失				
投資有価証券売却損		105,903		135,399
投資有価証券評価損		102,096		62,310
固定資産除却損	※1	54	※1	4,848
固定資産売却損		-		225
システム関連費		-		322,986
商標使用料		-		90,000
特別損失合計		208,054		615,770
税引前当期純利益		16,528,061		13,962,130
法人税、住民税及び事業税	※2	5,252,224	※2	4,420,179
法人税等調整額		△76,092		△100,112
法人税等合計		5,176,132		4,320,066
当期純利益		11,351,928		9,642,064

(3) 【株主資本等変動計算書】

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本								
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147
当期変動額									
剰余金の配当							△26,595,731	△26,595,731	△26,595,731
当期純利益							11,351,928	11,351,928	11,351,928
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	△15,243,802	△15,243,802	△15,243,802
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当期変動額			
剰余金の配当			△26,595,731
当期純利益			11,351,928
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△9,673	△9,673	△9,673
当期変動額合計	△9,673	△9,673	△15,253,476
当期末残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本					
		資本剰余金			利益剰余金	
					その他利益剰余金	

	資本金	資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	株主資本合計
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	27,790,911	35,131,500	81,864,344
当期変動額									
剰余金の配当							△11,363,380	△11,363,380	△11,363,380
当期純利益							9,642,064	9,642,064	9,642,064
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計	—	—	—	—	—	—	△1,721,316	△1,721,316	△1,721,316
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257
当期変動額			
剰余金の配当			△11,363,380
当期純利益			9,642,064
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	△358,179	△358,179	△358,179
当期変動額合計	△358,179	△358,179	△2,079,495
当期末残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762

[注記事項]

（重要な会計方針）

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物	5年～50年
器具備品	2年～20年
投資不動産	3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

4. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3)役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4)退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき計上しております。

①退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

②数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5)役員退職慰労引当金

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

(6)時効後支払損引当金

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

5.その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1)消費税等の会計処理

税抜方式を採用しており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2)連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(表示方法の変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」490,903千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」1,237,989千円に含めて表示しております。

(未適用の会計基準等)

- ・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日 企業会計基準委員会）

(1)概要

国際会計基準審議会（IASB）及び米国財務会計基準審議会（FASB）は、共同して収益認識に関する包括的な会計基準の開発を行い、平成26年5月に「顧客との契約から生じる収益」（IASBにおいてはIFRS第15号、FASBにおいてはTopic606）を公表しており、IFRS第15号は平成30年1月1日以後開始する事業年度から、Topic606は平成29年12月15日より後に開始する事業年度から適用される状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、収益認識に関する包括的な会計基準が開発され、適用指針と合わせて公表されたものです。

企業会計基準委員会の収益認識に関する会計基準の開発にあたっての基本的な方針として、IFRS第15号と整合性を図る便益の1つである財務諸表間の比較可能性の観点から、IFRS第15号の基本的な原則を取り入れることを出発点とし、会計基準を定めることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮すべき項目がある場合には、比較可能性を損なわせない範囲で代替的な取扱いを追加することとされております。

(2)適用予定日

令和4年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

「収益認識に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で評価

中であります。

（貸借対照表関係）

※1.有形固定資産及び投資不動産の減価償却累計額

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
建物	604,123千円	551,025千円
器具備品	1,215,234千円	1,350,407千円
投資不動産	—	138,024千円

※2.関係会社に対する主な資産・負債

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
預金	41,809,118千円	240,211千円
未収収益	40,621千円	25,307千円
金銭の信託	30,000千円	100,000千円
未払手数料	1,577,059千円	671,568千円
その他未払金	3,850,734千円	3,217,341千円
未払費用	430,491千円	444,754千円

（損益計算書関係）

※1.固定資産除却損の内訳

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
建物	—	2,547千円
器具備品	54千円	2,301千円
計	54千円	4,848千円

※2.関係会社に対する主な取引

区分掲記した以外で各科目に含まれるものは次の通りであります。

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
支払手数料	11,380,244千円	5,298,064千円
受取利息	380千円	3千円
受取賃貸料	—	38,388千円
法人税、住民税及び事業税	3,851,536千円	3,216,517千円

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

平成29年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	26,595,731千円
②	1株当たり配当額	125,700円
③	基準日	平成29年3月31日
④	効力発生日	平成29年6月29日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	11,363,380千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	53,707円
④	基準日	平成30年3月31日
⑤	効力発生日	平成30年6月28日

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1.発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当事業年度増加 株式数（株）	当事業年度減少 株式数（株）	当事業年度末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2.配当に関する事項

(1)配当金支払額

平成30年6月27日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	11,363,380千円
②	1株当たり配当額	53,707円
③	基準日	平成30年3月31日
④	効力発生日	平成30年6月28日

(2)基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	9,675,175千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	45,728円
④	基準日	平成31年3月31日
⑤	効力発生日	令和 元年6月27日

(リース取引関係)

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
1年内	678,116千円	675,956千円
1年超	1,351,912千円	675,956千円
合計	2,030,029千円	1,351,912千円

(金融商品関係)

1.金融商品の状況に関する事項

(1)金融商品に対する取組方針

資金運用については銀行預金、譲渡性預金または投資信託に限定しており、金融機関からの資金調達は行っておりません。

(2)金融商品の内容及びそのリスク

投資有価証券は主として投資信託であり、価格変動リスクに晒されております。

(3)金融商品に係るリスク管理体制

内部管理規程に従って月次でリスク資本を認識し、経営会議に報告しております。

(4)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

2.金融商品の時価等に関する事項

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

第33期(平成30年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	54,140,307	54,140,307	—
(2) 有価証券	19,967	19,967	—
(3) 未収委託者報酬	9,770,529	9,770,529	—
(4) 投資有価証券	26,224,167	26,224,167	—
資産計	90,154,972	90,154,972	—
(1) 未払手数料	3,905,670	3,905,670	—
負債計	3,905,670	3,905,670	—

第34期(平成31年3月31日現在)

	貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	53,969,686	53,969,686	—
(2) 有価証券	1,403,513	1,403,513	—
(3) 未収委託者報酬	9,995,458	9,995,458	—
(4) 投資有価証券	21,353,421	21,353,421	—
資産計	86,722,080	86,722,080	—
(1) 未払手数料	3,990,054	3,990,054	—
負債計	3,990,054	3,990,054	—

(注1) 金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

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

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

(単位：千円)

区分	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
非上場株式	137,160	55,360
子会社株式	160,600	160,600
関連会社株式	159,536	159,536

非上場株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

また、子会社株式及び関連会社株式は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

(注3) 金銭債権及び満期のある有価証券の決算日後の償還予定額

第33期(平成30年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	54,140,307	—	—	—
未収委託者報酬	9,770,529	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	19,967	13,110,758	8,593,680	68,714
合計	63,930,804	13,110,758	8,593,680	68,714

第34期(平成31年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
現金及び預金	53,969,686	—	—	—
未収委託者報酬	9,995,458	—	—	—
有価証券及び投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの				
投資信託	1,403,513	9,358,708	5,874,634	90,573
合計	65,368,659	9,358,708	5,874,634	90,573

(有価証券関係)

1. 子会社株式及び関連会社株式

子会社株式及び関連会社株式（当事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円、前事業年度の貸借対照表計上額は子会社株式160,600千円、関連会社株式159,536千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、記載しておりません。

2. その他有価証券

第33期(平成30年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額（千円）
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	18,599,111	16,040,884	2,558,227
	小計	18,599,111	16,040,884	2,558,227
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	7,645,023	8,062,990	△417,966
	小計	7,645,023	8,062,990	△417,966
合計		26,244,135	24,103,874	2,140,260

第34期(平成31年3月31日現在)

	種類	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額（千円）
貸借対照表計上額 が取得原価を超え るもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	14,744,545	12,559,380	2,185,164
	小計	14,744,545	12,559,380	2,185,164
貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	8,012,389	8,573,551	△561,161
	小計	8,012,389	8,573,551	△561,161
合計		22,756,935	21,132,932	1,624,002

3.売却したその他有価証券

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	—	—	—
債券	—	—	—
その他	8,169,769	516,394	105,903
合計	8,169,769	516,394	105,903

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

種類	売却額（千円）	売却益の合計額（千円）	売却損の合計額（千円）
株式	140,240	58,440	—
債券	—	—	—
その他	5,222,594	443,338	135,399
合計	5,362,834	501,778	135,399

4.減損処理を行った有価証券

前事業年度において、有価証券について102,096千円（その他有価証券のその他102,096千円）減損処理を行っております。

当事業年度において、有価証券について62,310千円（その他有価証券のその他62,310千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

(退職給付関係)

1.採用している退職給付制度の概要

当社は、確定給付型の制度として、確定給付企業年金制度（積立型制度）及び退職一時金制度（非積立型制度）を設けております。また確定拠出型の制度として、確定拠出年金制度を設けております。

2.確定給付制度

(1)退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
退職給付債務の期首残高	3,649,089 千円	3,729,252 千円
勤務費用	184,120	193,531
利息費用	27,829	24,351
数理計算上の差異の発生額	56,895	△15,898
退職給付の支払額	△188,683	△218,947
過去勤務費用の発生額	—	—
退職給付債務の期末残高	3,729,252	3,712,289

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
年金資産の期首残高	2,698,738 千円	2,723,393 千円
期待運用収益	48,080	48,664
数理計算上の差異の発生額	47,759	△4,606
事業主からの拠出額	102,564	102,564
退職給付の支払額	△173,748	△203,077
年金資産の期末残高	2,723,393	2,666,937

(3)退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,374,562 千円	3,125,760 千円
年金資産	△2,723,393	△2,666,937
非積立型制度の退職給付債務	651,168	458,822
未積立退職給付債務	354,690	586,529
未積立退職給付債務	1,005,858	1,045,351
未認識数理計算上の差異	△ 169,893	△ 114,968
未認識過去勤務費用	△ 550,128	△ 484,766
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	285,836	445,616
退職給付引当金	720,536	860,851
前払年金費用	△434,700	△415,234
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	285,836	445,616

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
勤務費用	184,120 千円	193,531 千円
利息費用	27,829	24,351
期待運用収益	△48,080	△48,664
数理計算上の差異の費用処理額	47,053	43,633
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	4,780	5,986
確定給付制度に係る退職給付費用	281,066	284,199

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

①年金資産の主な内訳

年金資産合計に対する主な分類ごとの比率は、次のとおりであります。

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
債券	62.2 %	63.9 %
株式	34.7	33.2
その他	3.1	2.9
合計	100	100

②長期期待運用収益率の設定方法

年金資産の長期期待運用収益率を決定するため、現在及び予想される年金資産の配分と年金資産を構成する多様な資産からの現在及び将来期待される長期の収益率を考慮しております。

(6)数理計算上の計算基礎に関する事項

主要な数理計算上の計算基礎

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
割引率	0.069～0.67%	0.035～0.49%
長期期待運用収益率	1.5～1.8%	1.5～1.8%

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、前事業年度142,105千円、当事業年度144,712千円であります。

（税効果会計関係）

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 の主な原因別の内訳

	第33期 (平成30年3月31日現在)	第34期 (平成31年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	445,379千円	436,050千円
投資有価証券評価損	223,512	223,821
未払事業税	135,805	109,109
賞与引当金	277,468	275,927
役員賞与引当金	12,235	19,428
役員退職慰労引当金	57,431	44,185
退職給付引当金	220,628	263,592
減価償却超過額	13,690	157,741
委託者報酬	257,879	264,398
長期差入保証金	23,262	31,721
時効後支払損引当金	78,035	75,866
連結納税適用による時価評価	200,331	148,858
その他	82,168	71,320
繰延税金資産 小計	2,027,829	2,122,023
評価性引当額	—	—
繰延税金資産 合計	2,027,829	2,122,023
繰延税金負債		
前払年金費用	△133,105	△127,144
連結納税適用による時価評価	△1,382	△1,320
その他有価証券評価差額金	△655,348	△497,269
その他	△4	△108
繰延税金負債 合計	△789,840	△625,842
繰延税金資産の純額	1,237,989	1,496,180

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第33期（平成30年3月31日現在）及び第34期（平成31年3月31日現在）

法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）及び第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）及び第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2.地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3.主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとののれんの償却額及び未償却残高に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

(関連当事者情報)

1.関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主等

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,851,587 千円	その他未払金	3,850,734 千円
親会社	三菱UFJ 信託銀行㈱	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,528,131 千円	未払手数料	665,262 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料 (注3)	664,152 千円	未払費用	348,142 千円
主要株主	㈱三菱東京 UFJ銀行 (注5)	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,852,112 千円	未払手数料	921,796 千円

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有 (被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
親会社	㈱三菱UFJ フィナンシャル・ グループ	東京都 千代田 区	2,141,513 百万円	銀行持株 会社業	被所有 間接 100.0%	連結納税	連結納税に 伴う支払 (注1)	3,216,517 千円	その他未払金	3,217,341 千円

親会社	三菱UFJ 信託銀行(株)	東京都 千代田 区	324,279 百万円	信託業、 銀行業	被所有 直接 100.0%	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	5,298,064 千円	未払手数料	671,568 千円
						投資の助言	投資助言料 (注3)	695,834 千円	未払費用	365,510 千円
						役員の兼任				

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. 連結納税制度に基づく連結法人税の支払予定額であります。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 投資助言料については、市場実勢を勘案して決定しております。
4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。
5. (株)三菱東京UFJ銀行は、平成30年4月1日付で、(株)三菱UFJ銀行に行名を変更しております。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高 (注4)
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券(株)	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	6,263,571 千円	未払手数料	907,290 千円

第34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）

種類	会社等の 名称	所在地	資本金	事業の 内容	議決権等 の所有 (被所有) 割合	関連当事者 との関係	取引の内容	取引金額 (注4)	科目	期末残高（注 4）
同一の親会社を持つ会社	(株)三菱UFJ 銀行	東京都 千代田 区	1,711,958 百万円	銀行業	なし (注1)	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	4,629,670 千円	未払手数料	734,633 千円
						取引銀行	コーラブル預 金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び 預金	20,000,000 千円
							コーラブル預 金に係る受取 利息 (注3)	1,578 千円	未収収益	1,578 千円

同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・ スタンレー 証券(株)	東京都 千代田 区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の 募集の取扱及び 投資信託に係る 事務代行の委託 等	投資信託に 係る事務代 行手数料の 支払 (注2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円
-------------	----------------------------------	-----------------	---------------	-----	----	---	---------------------------------------	-----------------	-------	---------------

取引条件及び取引条件の決定方針等

- (注) 1. (株)三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを(株)三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、(株)三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。
- なお、(株)三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行(株)に対して承継させております。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。
3. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

2.親会社に関する注記

株式会社三菱UFJフィナンシャル・グループ（東京証券取引所、名古屋証券取引所及びニューヨーク証券取引所に上場）

三菱UFJ信託銀行株式会社（非上場）

（1株当たり情報）

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
1株当たり純資産額	393,935.45円	384,107.08円
1株当たり当期純利益金額	53,652.87円	45,571.50円

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

2. 1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	第34期 (自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日)
当期純利益金額（千円）	11,351,928	9,642,064
普通株主に帰属しない金額（千円）	—	—
普通株式に係る当期純利益金額（千円）	11,351,928	9,642,064
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表

(1)中間貸借対照表

(単位：千円)

第35期中間会計期間
(令和元年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

現金及び預金

46,350,665

有価証券		3,906,355
前払費用		620,446
未収入金		8,561
未収委託者報酬		10,170,592
未収収益		585,312
金銭の信託		100,000
その他		134,705
流動資産合計		61,876,640
固定資産		
有形固定資産		
建物	※1	603,277
器具備品	※1	794,065
土地		628,433
有形固定資産合計		2,025,776
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		3,390,287
ソフトウェア仮勘定		1,024,221
無形固定資産合計		4,430,330
投資その他の資産		
投資有価証券		18,792,024
関係会社株式		320,136
投資不動産	※1	822,988
長期差入保証金		579,291
前払年金費用		420,773
繰延税金資産		1,420,372
その他		45,230
貸倒引当金		△23,600
投資その他の資産合計		22,377,216
固定資産合計		28,833,324
資産合計		90,709,964

(単位：千円)

第35期中間会計期間
(令和元年9月30日現在)

(負債の部)		
流動負債		
預り金		290,587
未払金		
未払収益分配金		131,632
未払償還金		424,093
未払手数料		4,009,808
その他未払金		2,100,383
未払費用		3,020,441
未払消費税等	※2	381,045
未払法人税等		651,051
賞与引当金		924,061
役員賞与引当金		62,295
その他		900,753
流動負債合計		12,896,152
固定負債		
長期未払金		32,400
退職給付引当金		940,446
役員退職慰労引当金		107,709

時効後支払損引当金	243,873
固定負債合計	1,324,430
負債合計	14,220,582
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	21,264,872
利益剰余金合計	28,605,462
株主資本合計	75,338,306

(単位：千円)

第35期中間会計期間 (令和元年9月30日現在)	
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,151,075
評価・換算差額等合計	1,151,075
純資産合計	76,489,381
負債純資産合計	90,709,964

(2)中間損益計算書

(単位：千円)

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	34,073,281
投資顧問料	1,143,410
その他営業収益	8,361
営業収益合計	35,225,053
営業費用	
支払手数料	13,714,724
広告宣伝費	252,678
公告費	250
調査費	
調査費	911,961
委託調査費	5,769,907
事務委託費	351,511
営業雑経費	
通信費	78,084
印刷費	218,610
協会費	25,207
諸会費	8,034
事務機器関連費	931,984
営業費用合計	22,262,956
一般管理費	
給料	

役員報酬		177,096
給料・手当		2,873,051
賞与引当金繰入		924,061
役員賞与引当金繰入		62,295
福利厚生費		635,789
交際費		4,597
旅費交通費		97,388
租税公課		193,484
不動産賃借料		327,917
退職給付費用		212,710
役員退職慰労引当金繰入		25,108
固定資産減価償却費	※1	647,817
諸経費		177,080
一般管理費合計		6,358,399
営業利益		6,603,697

(単位：千円)

第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)		
営業外収益		
受取配当金		34,517
受取利息		2,101
投資有価証券償還益		327,868
収益分配金等時効完成成分		73,834
受取賃貸料		32,904
その他		15,364
営業外収益合計		486,590
営業外費用		
投資有価証券償還損		46,457
賃貸関連費用	※1	12,337
その他		175
営業外費用合計		58,970
経常利益		7,031,318
特別利益		
投資有価証券売却益		53,850
特別利益合計		53,850
特別損失		
投資有価証券売却損		36,721
投資有価証券評価損		17,395
固定資産除却損		37
固定資産売却損		435
特別損失合計		54,589
税引前中間純利益		7,030,579
法人税、住民税及び事業税		2,095,061
法人税等調整額		65,064
法人税等合計		2,160,126
中間純利益		4,870,453

(3)中間株主資本等変動計算書

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本
--	------

	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	26,069,594	33,410,184	80,143,028
当中間期変動額									
剰余金の配当							△9,675,175	△9,675,175	△9,675,175
中間純利益							4,870,453	4,870,453	4,870,453
株主資本以外 の項目の当中 間 期 変 動 額 (純額)									
当中間期変動額合 計	—	—	—	—	—	—	△4,804,722	△4,804,722	△4,804,722
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	21,264,872	28,605,462	75,338,306

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当中間期変動額			
剰余金の配当			△9,675,175
中間純利益			4,870,453
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	24,341	24,341	24,341
当中間期変動額合計	24,341	24,341	△4,780,380
当中間期末残高	1,151,075	1,151,075	76,489,381

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

定率法を採用しております。ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）並びに平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備及び構築物については、定額法を採用しております。

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

貸付金等の貸倒れによる損失に備えるため、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等特定の債権については個別に回収可能性を勘案し、回収不能見込額を計上しております。

す。

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

① 退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については、給付算定式基準によっております。

② 数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理することとしております。

数理計算上の差異は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（主として10年）による定額法により、発生した事業年度の翌期から費用処理することとしております。

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

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

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当事業年度の費用として処理しております。

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[注記事項]

(中間貸借対照表関係)

※1 減価償却累計額

	第35期中間会計期間 (令和元年9月30日現在)
建物	575,110千円
器具備品	1,377,937千円
投資不動産	141,659千円

※2 消費税等の取扱い

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

(中間損益計算書関係)

※1 減価償却実施額

	第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)
有形固定資産	85,187千円
無形固定資産	562,630千円
投資不動産	3,634千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

	当事業年度期首 株式数（株）	当中間会計期間 増加株式数（株）	当中間会計期間 減少株式数（株）	当中間会計期間末 株式数（株）
発行済株式				
普通株式	211,581	—	—	211,581
合計	211,581	—	—	211,581

2. 配当に関する事項

令和元年6月26日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

①	配当金の総額	9,675,175千円
②	配当の原資	利益剰余金
③	1株当たり配当額	45,728円
④	基準日	平成31年3月31日
⑤	効力発生日	令和元年6月27日

（リース取引関係）

第35期中間会計期間（令和元年9月30日現在）

〈借主側〉

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	675,956千円
1年超	337,978千円
合 計	1,013,934千円

（金融商品関係）

第35期中間会計期間（令和元年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

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

	中間貸借対照表計 上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	46,350,665	46,350,665	—
(2) 有価証券	3,906,355	3,906,355	—
(3) 未収委託者報酬	10,170,592	10,170,592	—
(4) 投資有価証券	18,736,664	18,736,664	—
資産計	79,164,277	79,164,277	—
(1) 未払手数料	4,009,808	4,009,808	—
負債計	4,009,808	4,009,808	—

（注1）金融商品の時価の算定方法及び有価証券に関する事項

資 産

(1)現金及び預金、(3)未収委託者報酬

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

(2)有価証券、(4)投資有価証券

これらはすべて投資信託であり、時価は基準価額によっております。

負 債

(1)未払手数料

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

っております。

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

非上場株式（中間貸借対照表計上額55,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（有価証券関係）

第35期中間会計期間（令和元年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	16,466,321	14,354,198	2,112,123
	小 計	16,466,321	14,354,198	2,112,123
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	—	—	—
	債券	—	—	—
	その他	6,176,697	6,629,733	△453,035
	小 計	6,176,697	6,629,733	△453,035
合 計		22,643,019	20,983,931	1,659,087

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額55,360千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

3. 減損処理を行った有価証券

当中間会計期間において、有価証券について17,395千円（その他有価証券のその他17,395千円）減損処理を行っております。

なお、減損処理にあたっては、中間期末における時価が取得原価に比べ50%以上下落した場合、及び30%以上50%未満下落し、回復可能性等の合理的反証がない場合に行っております。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第35期中間会計期間（自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(1 株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (令和元年9月30日現在)
1株当たり純資産額	361,513.47円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額（千円）	76,489,381
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	76,489,381
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数（株）	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第35期中間会計期間 (自 平成31年4月1日 至 令和元年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	23,019.33円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額（千円）	4,870,453
普通株主に帰属しない金額（千円）	—
普通株式に係る中間純利益金額（千円）	4,870,453
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581

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

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。

- ①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。)
- ②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。)
- ③通常の取引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④⑤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。
- ④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。
- ⑤上記③④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】

①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。

②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

①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）

②資本金の額：324,279百万円（2019年9月末現在）

③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

①名称	②資本金の額 (2019年9月末現在)	③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。（2020年2月末現在）

三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%（211,581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】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2019年11月25日	有価証券届出書
2019年11月25日	有価証券報告書

独立監査人の監査報告書

令和元年6月26日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御 中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青	木	裕	晃	印
--------------------	-------	---	---	---	---	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	伊	藤	鉄	也	印
--------------------	-------	---	---	---	---	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

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、三菱UFJ国際投信株式会社の平成31年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績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

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

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の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。

独立監査人の監査報告書

令和2年4月1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 公認会計士 大畑 茂 印
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）の令和1年8月27日から令和2年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

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

利害関係

三菱UFJ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。

独立監査人の中間監査報告書

令和元年12月3日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

青木 裕晃 印

指定有限責任社員
業務執行社員

公認会計士

伊藤 鉄也 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成31年4月1日から令和2年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（平成31年4月1日から令和元年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の令和元年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成31年4月1日から令和元年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以 上

（注）上記は、委託会社が、独立監査人の中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は委託会社が別途保管しております。なお、XBRLデータは中間監査の対象に含まれていません。