【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2020年11月20日提出
【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
【電話番号】	03-6250-4740
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	１兆円を上限とします。
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

第一部【証券情報】

（１）【ファンドの名称】

日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）（「ファンド」といいます。）

（２）【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。
信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。
ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後記の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関および当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第２条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、「振替機関等」といいます。）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ます（振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

（３）【発行（売出）価額の総額】

１兆円を上限とします。

（４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。
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/
（注）基準価額とは、信託財産の純資産総額を計算日における受益権総口数で除して得た額をいいます。
　　なお、便宜上１万口当たりに換算した価額で表示することがあります。

（５）【申込手数料】

ありません。

（６）【申込単位】

販売会社が定める単位
申込単位は販売会社にご確認ください。

（７）【申込期間】

2020年11月21日から2021年11月22日まで
※申込期間は、前記期間終了前に有価証券届出書を提出することによって更新される予定です。

（８）【申込取扱場所】

販売会社において申込みの取扱いを行います。
販売会社は、下記にてご確認いただけます。
　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）

（９）【払込期日】

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。
各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

（１０）【払込取扱場所】

申込みを受け付けた販売会社です。

（１１）【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

（１２）【その他】

当ファンドは、ラップ口座に係る契約※に基づいてラップ口座の資金を運用するためのファンドであり、当ファンドの取得申込者は、販売会社にラップ口座を開設のうえ申込みを行うものとします。
※同様の権利義務関係を規定する契約の名称は販売会社によって異なります。

第二部【ファンド情報】

第１【ファンドの状況】

１【ファンドの性格】

（１）【ファンドの目的及び基本的性格】

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
追加型	海外	債券	MRF	特殊型（絶対収益追求型）
	内外	不動産投信	ETF	
		その他資産（　　）		
		資産複合		

属性区分表

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

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

※上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

		社債	信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		クレジット属性	目論見書または信託約款において、信用力が高い債券に選別して投資する、あるいは投資適格債（ＢＢＢ格相当以上）を投資対象の範囲とする旨の記載があるものについて高格付債、ハイイールド債等（ＢＢ格相当以下）を主要投資対象とする旨の記載があるものについて低格付債を債券の属性として併記します。
	不動産投信		信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
	資産複合		信託約款において、複数資産を投資対象とする旨の記載があるものをいいます。
決算頻度	年１回		信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回		信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回		信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）		信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）		信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々		信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他		上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル		信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本		信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米		信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州		信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア		信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア		信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米		信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ		信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）		信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング		信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産（一部組み入れている場合等を除きます。）を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド		信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ		一般社団法人投資信託協会が定める「投資信託等の運用に関する規則」第２条に規定するファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり		信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。

	なし	信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経２２５	信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	ＴＯＰＩＸ	信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記以外の指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動もしくは逆連動（一定倍の連動もしくは逆連動を含みます。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	信託約款において、ロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨もしくは特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

※上記定義は一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」を基に委託会社が作成したものです。

［ファンドの目的・特色］

ファンドの目的

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

ファンドの特色

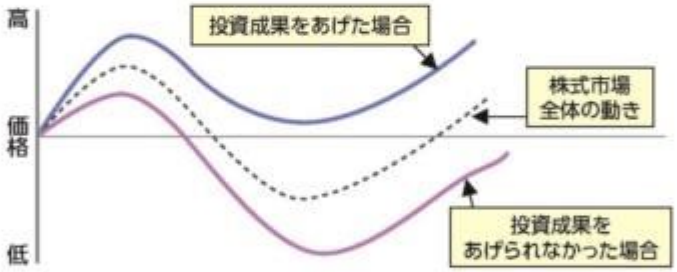
特色1 わが国の株式市場全体の上昇・下落に左右されない安定的な収益の確保をめざします。

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

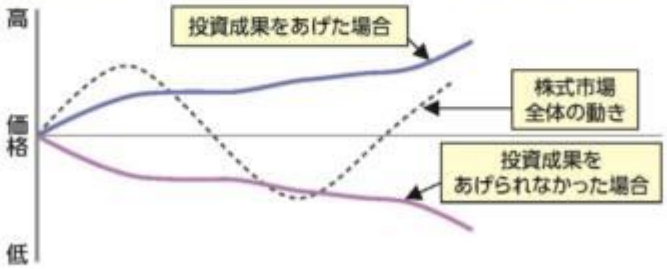
マーケットニュートラル戦略とは

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

一般的な株式アクティブファンドの価格の動き（イメージ）

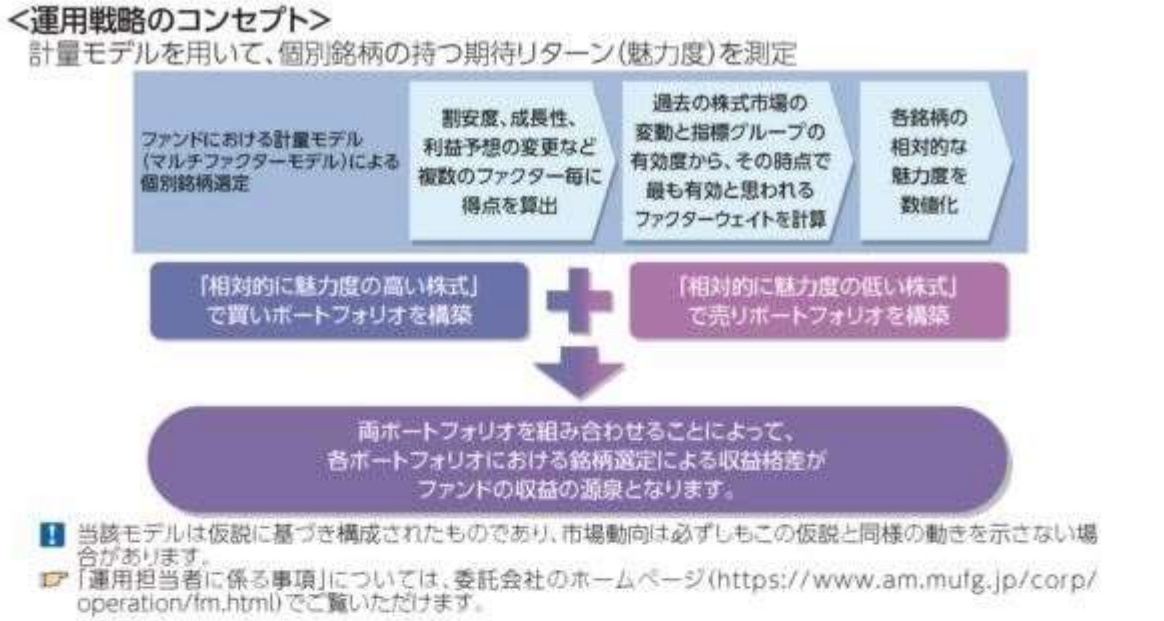


マーケットニュートラル戦略を行うファンドの価格の動き（イメージ）



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

特色2 わが国の株式を主要投資対象とし、割安度、成長性といった投資尺度の中から、計量モデルを用いて決定された最適と推測される投資尺度により株式への投資を行います。同時に株式の信用取引等を活用することにより、株式市場の価格変動リスクの低減を図りつつ、安定した収益の確保をめざして運用を行います。



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

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

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。
信用取引	信用取引の売付けに係る時価総額は信託財産の純資産総額の範囲内で行います。
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

投資家（受益者）

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

販売会社	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。

お申込金↓↑収益分配金、解約代金等

受託会社（受託者） 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）	委託会社（委託者） 三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
信託財産の保管・管理等を行います。	信託財産の運用の指図、受益権の発行等を行います。

投資↓↑損益

マザーファンド

投資↓↑損益

有価証券等

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8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

のをいいます。）

15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。16．において同じ。）で16．で定める以外のもの
16. 投資法人債券（金融商品取引法第２条第１項第11号で定めるものをいいます。以下16．において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第２条第１項第18号で定めるものをいいます。）
18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第２条第１項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）
19. 預託証書（金融商品取引法第２条第１項第20号で定めるものをいいます。）
20. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
22. 抵当証券（金融商品取引法第２条第１項第16号で定めるものをいいます。）
23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第１項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
24. 外国の者に対する権利で23．の有価証券の性質を有するもの

なお、１．の証券または証書ならびに13．および19．の証券または証書のうち１．の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、２．から６．までの証券ならびに16．の証券ならびに13．および19．の証券または証書のうち２．から６．までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14．および15．の証券を以下「投資信託証券」といいます。

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。

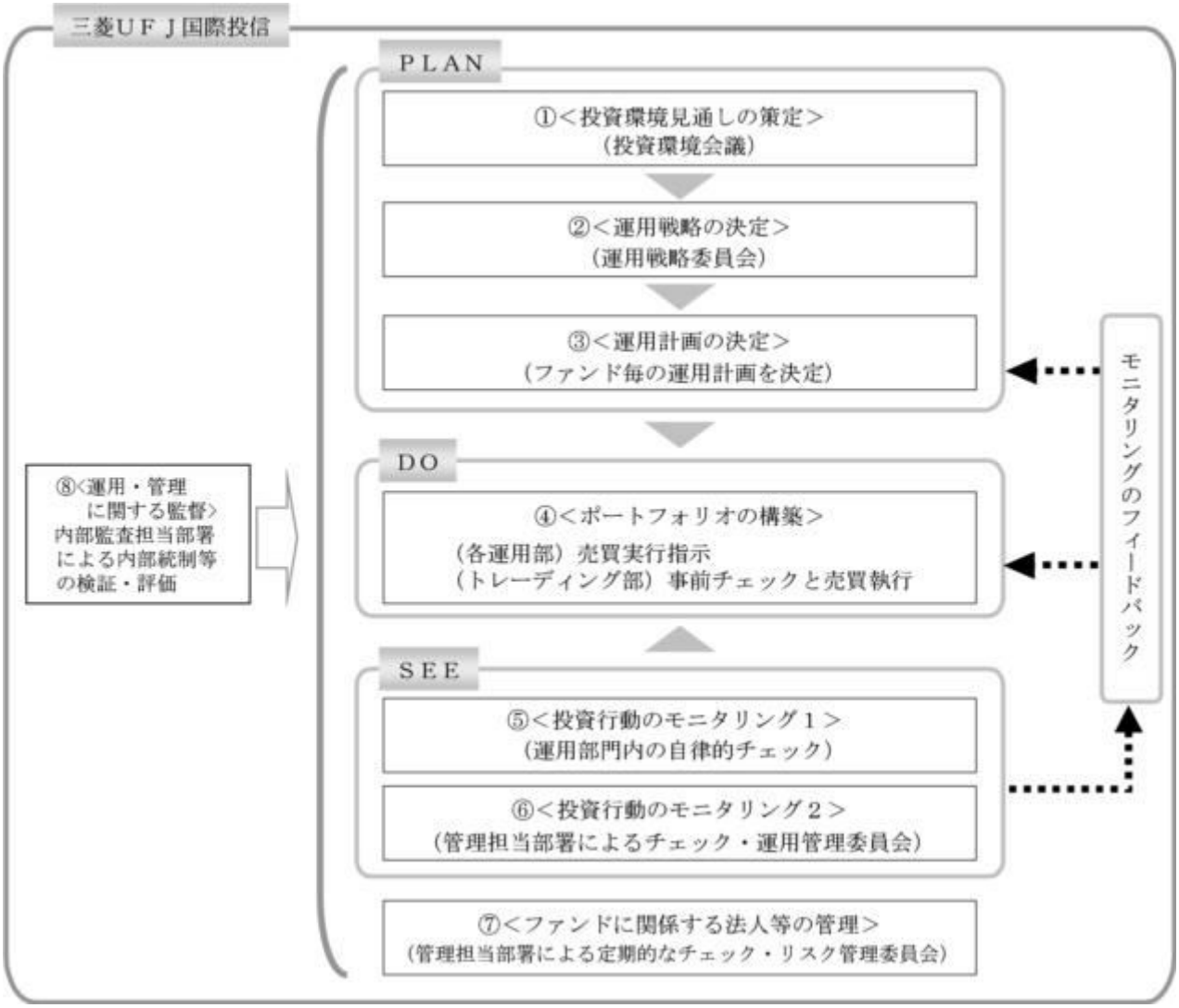
なお、市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

（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（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、定期的に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して計算しており、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8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。

5【運用状況】

【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 8月31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	731,481,185	99.76
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	1,756,854	0.24
純資産総額		733,238,039	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 8月31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	494,979,825	1.5028	743,899,581	1.4778	731,481,185	99.76

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該銘柄の評価金額の比率です。

ｂ全銘柄の種類／業種別投資比率

令和 2年 8月31日現在

種類	投資比率（%）
親投資信託受益証券	99.76
合計	99.76

（注）投資比率は、ファンドの純資産総額に対する当該種類または業種の評価金額の比率です。

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8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
第29計算期間末日　（令和 2年 8月24日）	746,558,276	746,558,276	12,456	12,456
令和 1年 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	—
3月末日	574,671,486	—	12,137	—
4月末日	561,428,302	—	12,220	—
5月末日	568,213,757	—	12,276	—
6月末日	572,361,667	—	12,334	—
7月末日	571,513,212	—	12,645	—
8月末日	733,238,039	—	12,246	—

②【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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
第29計算期間	0円

③【収益率の推移】

	収益率（%）
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
第29計算期間	4.26

（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
第29計算期間	162,976,558	67,994,519	599,357,619

（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 8月31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	13,402,718,200	86.02
コール・ローン、その他資産（負債控除後）	―	2,178,419,942	13.98
純資産総額		15,581,138,142	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 8月31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	ソニー	電気機器	16,700	8,407.00	140,396,900	8,309.00	138,760,300	0.89
日本	株式	豊田通商	卸売業	44,700	3,015.00	134,770,500	3,090.00	138,123,000	0.89
日本	株式	三井物産	卸売業	68,500	1,785.00	122,272,500	1,914.00	131,109,000	0.84
日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	48,000	2,622.50	125,880,000	2,723.50	130,728,000	0.84
日本	株式	東ソー	化学	82,900	1,508.00	125,013,200	1,575.00	130,567,500	0.84
日本	株式	日清食品ホールディングス	食料品	12,000	10,920.00	131,040,000	10,600.00	127,200,000	0.82
日本	株式	小松製作所	機械	55,000	2,250.00	123,750,000	2,304.00	126,720,000	0.81
日本	株式	キーエンス	電気機器	2,900	43,560.00	126,324,000	43,680.00	126,672,000	0.81
日本	株式	大林組	建設業	120,000	1,002.00	120,240,000	1,037.00	124,440,000	0.80
日本	株式	リンナイ	金属製品	12,500	9,830.00	122,875,000	9,810.00	122,625,000	0.79
日本	株式	マキタ	機械	25,000	4,940.00	123,500,000	4,900.00	122,500,000	0.79
日本	株式	栗田工業	機械	36,300	3,270.00	118,701,000	3,320.00	120,516,000	0.77
日本	株式	朝日インテック	精密機器	38,100	3,175.00	120,967,500	3,145.00	119,824,500	0.77
日本	株式	ヤマトホールディングス	陸運業	40,000	2,779.00	111,160,000	2,772.00	110,880,000	0.71
日本	株式	東急	陸運業	77,600	1,349.00	104,682,400	1,418.00	110,036,800	0.71
日本	株式	信越化学工業	化学	8,500	12,818.37	108,956,150	12,885.00	109,522,500	0.70
日本	株式	三浦工業	機械	25,000	4,400.00	110,000,000	4,340.00	108,500,000	0.70
日本	株式	伊藤忠テクノソリューションズ	情報・通信業	27,000	4,115.00	111,105,000	3,840.00	103,680,000	0.67
日本	株式	山崎製パン	食料品	60,000	1,757.00	105,420,000	1,726.00	103,560,000	0.66
日本	株式	オービック	情報・通信業	5,500	19,240.00	105,820,000	18,790.00	103,345,000	0.66
日本	株式	京成電鉄	陸運業	33,000	2,967.00	97,911,000	3,120.00	102,960,000	0.66
日本	株式	カルビー	食料品	30,900	3,355.00	103,669,500	3,305.00	102,124,500	0.66
日本	株式	三菱瓦斯化学	化学	53,900	1,861.02	100,309,300	1,894.00	102,086,600	0.66
日本	株式	積水化学工業	化学	60,000	1,672.00	100,320,000	1,697.00	101,820,000	0.65
日本	株式	村田製作所	電気機器	16,000	6,414.36	102,629,800	6,280.00	100,480,000	0.64
日本	株式	ダイセル	化学	130,000	741.09	96,342,000	770.00	100,100,000	0.64
日本	株式	パン・パシフィック・インターナショナルホ	小売業	40,000	2,609.00	104,360,000	2,491.00	99,640,000	0.64
日本	株式	ツルハホールディングス	小売業	7,000	14,700.00	102,900,000	14,160.00	99,120,000	0.64
日本	株式	武田薬品工業	医薬品	25,000	4,095.90	102,397,500	3,959.00	98,975,000	0.64

日本	株式	住友重機械工業	機械	40,000	2,486.00	99,440,000	2,413.00	96,520,000	0.62

（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 8月31日現在

種類	業種	投資比率（%）
株式	鉱業	0.74
	建設業	3.93
	食料品	4.73
	繊維製品	0.30
	パルプ・紙	0.25
	化学	9.18
	医薬品	3.55
	ゴム製品	0.33
	ガラス・土石製品	1.53
	鉄鋼	1.62
	非鉄金属	1.06
	金属製品	2.24
	機械	7.99
	電気機器	7.35
	輸送用機器	2.08
	精密機器	1.88
	その他製品	2.66
	陸運業	4.35
	倉庫・運輸関連業	0.27
	情報・通信業	7.66
	卸売業	6.16
	小売業	8.47
	銀行業	0.51
	保険業	0.23
	不動産業	1.82
	サービス業	5.15
	小計	86.02
合計		86.02

（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

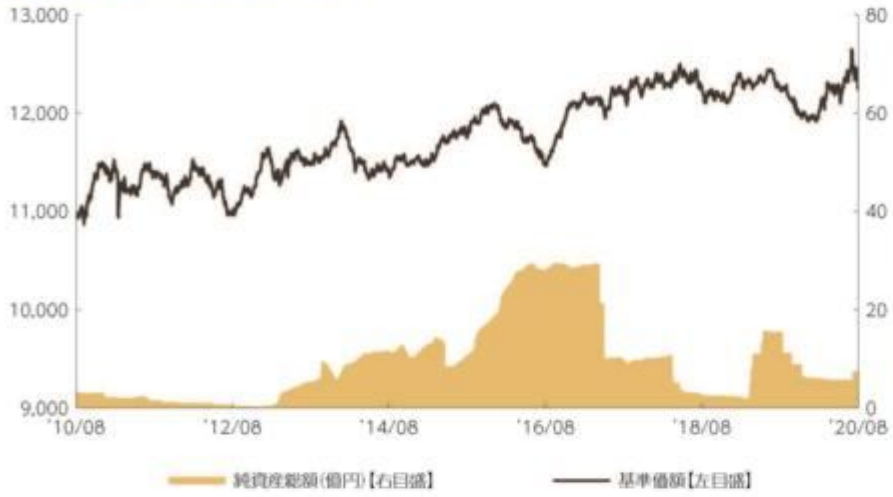
該当事項はありません。

≪参考情報≫

運用実績

2020年8月31日現在

■基準価額・純資産の推移　2010年8月31日～2020年8月31日



•基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

■基準価額・純資産

基準価額	12,246円
純資産総額	7.3億円

■分配の推移

2020 年 8月	0円
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
設定来累計	0円

•分配金は1万口当たり、税引前

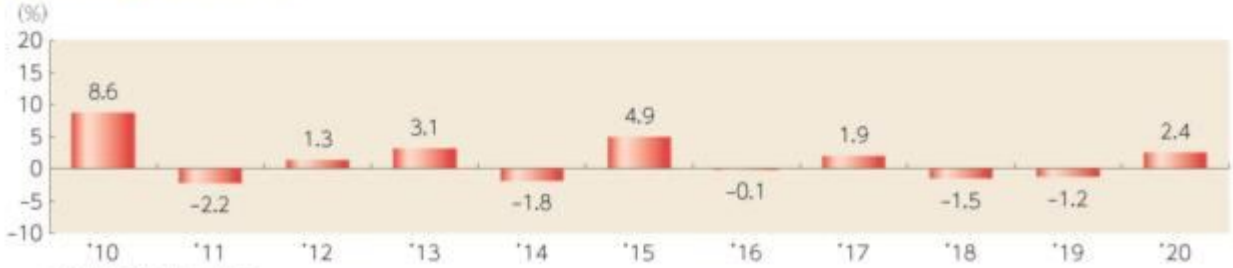
■主要な資産の状況

資産別構成	比率
国内株式現物	85.8%
国内株式信用売	−86.0%
株式(実質)	−0.2%

	組入上位銘柄	業種	比率
1	ソニー	電気機器	0.9%
2	豊田通商	卸売業	0.9%
3	三井物産	卸売業	0.8%
4	伊藤忠商事	卸売業	0.8%
5	東ソー	化学	0.8%
6	日清食品ホールディングス	食料品	0.8%
7	小松製作所	機械	0.8%
8	キーエンス	電気機器	0.8%
9	大林組	建設業	0.8%
10	リンナイ	金属製品	0.8%

•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8月31日までの収益率を表示

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

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いただけます。
また、下記においてもご照会いただけます。
三菱ＵＦＪ国際投信株式会社
お客様専用フリーダイヤル　0120-151034
（受付時間：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1万口当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。受託会社が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 2年 2月26日から令和 2年 8月24日まで）の財務諸表について、ＰｗＣあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

１【財務諸表】

【日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）】

（１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第28期 ［ 令和 2年 2月25日現在 ］	第29期 ［ 令和 2年 8月24日現在 ］
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	6,430,704	4,988,797
親投資信託受益証券	601,072,134	744,961,735
未収入金	1,566,329	-
流動資産合計	609,069,167	749,950,532
資産合計	609,069,167	749,950,532
負債の部		
流動負債		
未払解約金	1,361,608	-
未払受託者報酬	487,186	322,283
未払委託者報酬	4,628,229	3,061,644
未払利息	2	6
その他未払費用	12,607	8,323
流動負債合計	6,489,632	3,392,256
負債合計	6,489,632	3,392,256
純資産の部		
元本等		
元本	504,375,580	599,357,619
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	98,203,955	147,200,657
（分配準備積立金）	5,259,649	10,332,654
元本等合計	602,579,535	746,558,276
純資産合計	602,579,535	746,558,276
負債純資産合計	609,069,167	749,950,532

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第28期 自　令和 1年 8月27日 至　令和 2年 2月25日	第29期 自　令和 2年 2月26日 至　令和 2年 8月24日
営業収益		
受取利息	18	16
有価証券売買等損益	△23,997,249	26,727,219
営業収益合計	△23,997,231	26,727,235
営業費用		
支払利息	874	572
受託者報酬	487,186	322,283
委託者報酬	4,628,229	3,061,644
その他費用	12,607	8,323
営業費用合計	5,128,896	3,392,822
営業利益又は営業損失（△）	△29,126,127	23,334,413
経常利益又は経常損失（△）	△29,126,127	23,334,413
当期純利益又は当期純損失（△）	△29,126,127	23,334,413
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（△）	△12,121,751	1,517,684
期首剰余金又は期首欠損金（△）	286,921,745	98,203,955
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,325,114	40,387,464
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	7,325,114	40,387,464
剰余金減少額又は欠損金増加額	179,038,528	13,207,491
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	179,038,528	13,207,491
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（△）	98,203,955	147,200,657

（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、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は令和 2年 2月26日から令和 2年 8月24日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

	第28期 [令和 2年 2月25日現在]	第29期 [令和 2年 8月24日現在]
１． 期首元本額	1,262,438,595円	504,375,580円
期中追加設定元本額	34,578,614円	162,976,558円
期中一部解約元本額	792,641,629円	67,994,519円
２． 受益権の総数	504,375,580口	599,357,619口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

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

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

第29期
自 令和 2年 2月26日
至 令和 2年 8月24日

１.分配金の計算過程

項目		
費用控除後の配当等収益額	A	5,723,308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	194,571,722円
分配準備積立金額	D	4,609,346円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	204,904,376円
当ファンドの期末残存口数	F	599,357,619口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,418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28期 自 令和 1年 8月27日 至 令和 2年 2月25日	第29期 自 令和 2年 2月26日 至 令和 2年 8月24日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
２.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
３.金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部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28期 ［令和 2年 2月25日現在］	第29期 ［令和 2年 8月24日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
２.時価の算定方法	（１）有価証券	（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。	同左
	（２）デリバティブ取引	（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。	同左
	（３）上記以外の金融商品	（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。	同左

区分	第28期 ［令和 2年 2月25日現在］	第29期 ［令和 2年 8月24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28期 ［令和 2年 2月25日現在］	第29期 ［令和 2年 8月24日現在］
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）	当計算期間の損益に含まれた評価差額 （円）
親投資信託受益証券	△13,585,448	25,166,022
合計	△13,585,448	25,166,022

（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28期 ［令和 2年 2月25日現在］	第29期 ［令和 2年 8月24日現在］
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.1947円 (11,947円)	1.2456円 (12,456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	495,682,837	744,961,735	
合計		495,682,837	744,961,735	

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 8月24日現在］
資産の部	
流動資産	
コール・ローン	3,155,245,091
株式	13,114,384,400
信用取引預け金	12,438,035,132
未収配当金	20,242,561
流動資産合計	28,727,907,184
資産合計	28,727,907,184
負債の部	
流動負債	
信用売証券	12,881,551,830
未払解約金	140,439,168
未払利息	4,094
その他未払費用	19,580,711
流動負債合計	13,041,575,803

	［令和 2年 8月24日現在］
負債合計	13,041,575,803
純資産の部	
元本等	
元本	10,437,683,252
剰余金	
剰余金又は欠損金（△）	5,248,648,129
元本等合計	15,686,331,381
純資産合計	15,686,331,381
負債純資産合計	28,727,907,184

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 8月24日現在]
１． 期首	令和 2年 2月26日
期首元本額	12,150,827,433円
期中追加設定元本額	694,212,874円
期中一部解約元本額	2,407,357,055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）	495,682,837円
ヘッジファンドセレクション（ラップ向け）	1,909,741,437円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定型）	141,188,879円
三菱ＵＦＪ　アドバンスト・バランス（安定成長型）	269,396,856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）	3,398,529,157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）	4,223,144,086円
合計	10,437,683,252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	8,141,274,700円

	[令和 2年 8月24日現在]
３． 受益権の総数	10,437,683,252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 2年 2月26日 至 令和 2年 8月24日
１.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第２条第４項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
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 8月24日現在］
１.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
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 8月24日現在］
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	525,914,060
信用売証券	△455,398,460
合計	70,515,600

(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 8月24日現在］
1口当たり純資産額	1.5029円
(1万口当たり純資産額)	(15,029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	
1515	日鉄鉱業	2,000	4,290.00	8,580,000	
1605	国際石油開発帝石	98,000	661.50	64,827,000	代用有価証券 98,000株
1662	石油資源開発	18,000	1,746.00	31,428,000	代用有価証券 15,000株
1719	安藤・間	43,000	699.00	30,057,000	代用有価証券 30,000株
1762	高松コンストラクショングループ	12,000	2,239.00	26,868,000	代用有価証券 12,000株

1802	大林組	120,000	1,002.00	120,240,000	代用有価証券 100,000株
1808	長谷工コーポレーション	25,000	1,438.00	35,950,000	代用有価証券 25,000株
1835	東鉄工業	8,000	2,612.00	20,896,000	代用有価証券 8,000株
1852	淺沼組	7,000	4,220.00	29,540,000	代用有価証券 7,000株
1883	前田道路	12,000	1,973.00	23,676,000	代用有価証券 12,000株
1890	東洋建設	50,000	396.00	19,800,000	代用有価証券 50,000株
1926	ライト工業	13,000	1,582.00	20,566,000	代用有価証券 13,000株
1929	日特建設	43,000	785.00	33,755,000	代用有価証券 35,000株
1941	中電工	10,000	2,266.00	22,660,000	代用有価証券 6,000株
1950	日本電設工業	10,000	2,101.00	21,010,000	
1959	九電工	10,000	2,975.00	29,750,000	代用有価証券 10,000株
1961	三機工業	18,000	1,140.00	20,520,000	代用有価証券 18,000株
1968	太平電業	9,000	2,223.00	20,007,000	
1976	明星工業	28,000	811.00	22,708,000	代用有価証券 28,000株
6379	レイズネクスト	15,000	1,264.00	18,960,000	
2053	中部飼料	18,500	1,582.00	29,267,000	代用有価証券 18,500株
2109	三井製糖	15,000	1,916.00	28,740,000	代用有価証券 5,000株
2201	森永製菓	7,000	3,915.00	27,405,000	代用有価証券 7,000株
2206	江崎グリコ	5,000	4,595.00	22,975,000	代用有価証券 5,000株
2212	山崎製パン	60,000	1,757.00	105,420,000	代用有価証券 50,000株
2222	寿スピリッツ	6,000	4,400.00	26,400,000	代用有価証券 6,000株
2229	カルビー	30,900	3,355.00	103,669,500	代用有価証券 30,900株
2267	ヤクルト本社	10,000	6,050.00	60,500,000	代用有価証券 10,000株
2270	雪印メグミルク	10,000	2,454.00	24,540,000	代用有価証券 10,000株
2809	キユーピー	10,000	1,987.00	19,870,000	代用有価証券 10,000株
2810	ハウス食品グループ本社	9,000	3,460.00	31,140,000	代用有価証券 9,000株
2815	アリアケジャパン	3,500	7,300.00	25,550,000	代用有価証券 3,500株

2875	東洋水産	12,000	6,280.00	75,360,000	代用有価証券 12,000株
2897	日清食品ホールディングス	12,000	10,920.00	131,040,000	代用有価証券 8,000株
2908	フジッコ	4,000	2,023.00	8,092,000	
2918	わらべや日洋ホールディングス	15,000	1,513.00	22,695,000	代用有価証券 15,000株
3106	倉敷紡績	13,000	1,963.00	25,519,000	代用有価証券 10,000株
3593	ホギメディカル	6,000	3,320.00	19,920,000	代用有価証券 6,000株
3865	北越コーポレーション	60,000	357.00	21,420,000	代用有価証券 30,000株
3950	ザ・パック	7,000	2,718.00	19,026,000	代用有価証券 7,000株
4027	テイカ	11,000	1,300.00	14,300,000	
4041	日本曹達	14,200	3,015.00	42,813,000	代用有価証券 14,000株
4042	東ソー	82,900	1,508.00	125,013,200	代用有価証券 75,400株
4045	東亜合成	34,900	1,041.00	36,330,900	代用有価証券 31,000株
4046	大阪ソーダ	10,500	2,465.00	25,882,500	代用有価証券 10,500株
4047	関東電化工業	37,000	746.00	27,602,000	代用有価証券 27,000株
4063	信越化学工業	7,800	12,790.00	99,762,000	代用有価証券 7,800株
4092	日本化学工業	8,000	2,206.00	17,648,000	代用有価証券 8,000株
4095	日本パーカライジング	20,000	1,007.00	20,140,000	代用有価証券 20,000株
4099	四国化成工業	15,000	1,087.00	16,305,000	代用有価証券 15,000株
4109	ステラ　ケミファ	10,000	2,630.00	26,300,000	代用有価証券 8,000株
4118	カネカ	10,000	2,675.00	26,750,000	代用有価証券 10,000株
4182	三菱瓦斯化学	38,900	1,847.00	71,848,300	代用有価証券 38,900株
4202	ダイセル	110,000	739.00	81,290,000	
4203	住友ベークライト	9,000	2,742.00	24,678,000	代用有価証券 9,000株
4204	積水化学工業	60,000	1,672.00	100,320,000	
4212	積水樹脂	12,000	2,157.00	25,884,000	代用有価証券 6,000株
4220	リケンテクノス	40,000	394.00	15,760,000	
4612	日本ペイントホールディングス	10,000	8,890.00	88,900,000	
4617	中国塗料	15,000	1,009.00	15,135,000	
4634	東洋インキＳＣホールディングス	13,000	1,922.00	24,986,000	

4912	ライオン	36,000	2,319.00	83,484,000	代用有価証券 36,000株
4958	長谷川香料	10,000	2,110.00	21,100,000	
4967	小林製薬	9,000	9,400.00	84,600,000	
4974	タカラバイオ	11,000	2,960.00	32,560,000	代用有価証券 11,000株
4985	アース製薬	5,000	7,690.00	38,450,000	
4997	日本農薬	30,000	510.00	15,300,000	
7958	天馬	13,000	1,890.00	24,570,000	代用有価証券 13,000株
7970	信越ポリマー	40,900	860.00	35,174,000	代用有価証券 40,900株
8113	ユニ・チャーム	15,500	4,676.00	72,478,000	代用有価証券 15,500株
4151	協和キリン	33,000	2,772.00	91,476,000	代用有価証券 28,000株
4516	日本新薬	11,000	9,160.00	100,760,000	代用有価証券 11,000株
4519	中外製薬	20,000	4,957.00	99,140,000	
4521	科研製薬	6,000	5,070.00	30,420,000	代用有価証券 6,000株
4549	栄研化学	13,000	1,932.00	25,116,000	代用有価証券 13,000株
4551	鳥居薬品	11,000	2,920.00	32,120,000	代用有価証券 11,000株
4552	ＪＣＲファーマ	4,000	11,830.00	47,320,000	代用有価証券 4,000株
4553	東和薬品	10,000	2,169.00	21,690,000	代用有価証券 10,000株
4555	沢井製薬	4,000	5,310.00	21,240,000	代用有価証券 4,000株
4574	大幸薬品	10,000	2,876.00	28,760,000	代用有価証券 10,000株
4587	ペプチドリーム	20,000	4,420.00	88,400,000	代用有価証券 20,000株
5122	オカモト	5,000	4,120.00	20,600,000	代用有価証券 5,000株
5192	三ツ星ベルト	18,000	1,641.00	29,538,000	代用有価証券 18,000株
5218	オハラ	18,000	1,040.00	18,720,000	
5302	日本カーボン	5,000	3,315.00	16,575,000	
5310	東洋炭素	20,900	1,646.00	34,401,400	代用有価証券 16,900株
5331	ノリタケカンパニーリミテド	4,000	3,260.00	13,040,000	
5351	品川リフラクトリーズ	5,500	2,169.00	11,929,500	
5384	フジミインコーポレーテッド	8,000	3,620.00	28,960,000	
5410	合同製鐵	15,000	1,918.00	28,770,000	代用有価証券 12,000株
5440	共英製鋼	18,000	1,271.00	22,878,000	代用有価証券 13,000株

5444	大和工業	14,000	2,569.00	35,966,000	代用有価証券 12,000株
5449	大阪製鐵	16,000	1,070.00	17,120,000	代用有価証券 16,000株
5463	丸一鋼管	30,300	2,828.00	85,688,400	代用有価証券 28,200株
5481	山陽特殊製鋼	35,000	886.00	31,010,000	代用有価証券 25,000株
5541	大平洋金属	15,000	1,664.00	24,960,000	代用有価証券 15,000株
5711	三菱マテリアル	32,000	2,215.00	70,880,000	代用有価証券 32,000株
5713	住友金属鉱山	20,000	3,262.00	65,240,000	
5821	平河ヒューテック	20,000	910.00	18,200,000	代用有価証券 20,000株
3433	トーカロ	25,000	1,070.00	26,750,000	代用有価証券 25,000株
3436	ＳＵＭＣＯ	58,000	1,442.00	83,636,000	代用有価証券 40,000株
5901	東洋製罐グループホールディングス	34,500	1,169.00	40,330,500	代用有価証券 24,500株
5946	長府製作所	4,000	2,086.00	8,344,000	
5947	リンナイ	12,500	9,830.00	122,875,000	
5975	東プレ	20,000	1,096.00	21,920,000	代用有価証券 20,000株
5988	パイオラックス	7,000	1,580.00	11,060,000	
8155	三益半導体工業	12,000	2,053.00	24,636,000	
6005	三浦工業	25,000	4,400.00	110,000,000	代用有価証券 20,000株
6104	芝浦機械	10,000	2,035.00	20,350,000	
6118	アイダエンジニアリング	34,000	688.00	23,392,000	代用有価証券 22,000株
6134	ＦＵＪＩ	23,000	1,880.00	43,240,000	代用有価証券 23,000株
6136	オーエスジー	10,000	1,480.00	14,800,000	
6140	旭ダイヤモンド工業	47,000	484.00	22,748,000	代用有価証券 44,000株
6146	ディスコ	3,500	25,370.00	88,795,000	
6151	日東工器	15,000	1,956.00	29,340,000	代用有価証券 15,000株
6157	日進工具	7,000	2,430.00	17,010,000	代用有価証券 7,000株
6235	オプトラン	11,000	2,276.00	25,036,000	代用有価証券 11,000株
6277	ホソカワミクロン	3,000	5,560.00	16,680,000	
6284	日精エー・エス・ビー機械	8,000	3,595.00	28,760,000	
6289	技研製作所	6,500	3,900.00	25,350,000	
6301	小松製作所	55,000	2,250.00	123,750,000	
6302	住友重機械工業	40,000	2,486.00	99,440,000	

6306	日工	27,000	655.00	17,685,000	
6332	月島機械	8,000	1,241.00	9,928,000	
6333	帝国電機製作所	13,000	1,103.00	14,339,000	
6368	オルガノ	6,000	5,450.00	32,700,000	代用有価証券 5,000株
6370	栗田工業	36,300	3,270.00	118,701,000	代用有価証券 36,300株
6381	アネスト岩田	11,000	795.00	8,745,000	
6383	ダイフク	10,000	9,400.00	94,000,000	
6420	フクシマガリレイ	5,000	3,425.00	17,125,000	
6454	マックス	15,000	1,586.00	23,790,000	
6457	グローリー	11,700	2,169.00	25,377,300	
6458	新晃工業	17,000	1,380.00	23,460,000	代用有価証券 17,000株
6459	大和冷機工業	10,000	916.00	9,160,000	
6464	ツバキ・ナカシマ	18,000	788.00	14,184,000	
6490	日本ピラー工業	13,000	1,416.00	18,408,000	
6586	マキタ	25,000	4,940.00	123,500,000	代用有価証券 25,000株
3105	日清紡ホールディングス	35,000	708.00	24,780,000	代用有価証券 35,000株
6448	ブラザー工業	45,000	1,704.00	76,680,000	代用有価証券 45,000株
6630	ヤーマン	33,000	1,341.00	44,253,000	
6640	Ｉ－ＰＥＸ	17,000	1,953.00	33,201,000	代用有価証券 14,000株
6641	日新電機	26,000	1,065.00	27,690,000	代用有価証券 21,000株
6651	日東工業	10,000	1,923.00	19,230,000	
6706	電気興業	7,000	2,389.00	16,723,000	
6744	能美防災	10,000	2,169.00	21,690,000	
6750	エレコム	5,000	5,190.00	25,950,000	代用有価証券 5,000株
6758	ソニー	16,700	8,407.00	140,396,900	代用有価証券 5,500株
6804	ホシデン	35,000	911.00	31,885,000	代用有価証券 25,000株
6817	スミダコーポレーション	12,000	628.00	7,536,000	代用有価証券 12,000株
6844	新電元工業	9,000	1,894.00	17,046,000	代用有価証券 6,500株
6857	アドバンテスト	11,000	5,120.00	56,320,000	
6861	キーエンス	2,900	43,560.00	126,324,000	代用有価証券 2,600株
6866	日置電機	10,000	3,385.00	33,850,000	代用有価証券 8,000株
6877	ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	6,000	3,575.00	21,450,000	

6905	コーセル	20,000	860.00	17,200,000	代用有価証券 20,000株
6923	スタンレー電気	23,000	2,998.00	68,954,000	
6947	図研	9,000	2,647.00	23,823,000	代用有価証券 9,000株
6961	エンプラス	13,000	2,153.00	27,989,000	代用有価証券 9,000株
6981	村田製作所	14,000	6,408.00	89,712,000	
6986	双葉電子工業	21,000	897.00	18,837,000	代用有価証券 14,000株
6999	ＫＯＡ	20,000	980.00	19,600,000	
7276	小糸製作所	12,800	4,985.00	63,808,000	代用有価証券 12,800株
6584	三櫻工業	25,000	638.00	15,950,000	
7203	トヨタ自動車	9,000	7,065.00	63,585,000	
7222	日産車体	15,000	835.00	12,525,000	
7224	新明和工業	18,000	943.00	16,974,000	
7250	太平洋工業	20,000	915.00	18,300,000	
7259	アイシン精機	38,000	3,605.00	136,990,000	
7270	ＳＵＢＡＲＵ	37,400	2,173.00	81,270,200	代用有価証券 25,100株
7296	エフ・シー・シー	15,000	1,855.00	27,825,000	代用有価証券 15,000株
7313	テイ・エス　テック	8,000	3,055.00	24,440,000	
7725	インターアクション	15,500	1,786.00	27,683,000	代用有価証券 15,500株
7740	タムロン	13,000	1,698.00	22,074,000	代用有価証券 13,000株
7744	ノーリツ鋼機	25,000	1,566.00	39,150,000	代用有価証券 25,000株
7747	朝日インテック	38,100	3,175.00	120,967,500	代用有価証券 38,100株
7762	シチズン時計	70,000	315.00	22,050,000	
7780	メニコン	7,000	6,080.00	42,560,000	代用有価証券 5,000株
7817	パラマウントベッドホールディングス	5,000	4,210.00	21,050,000	
7832	バンダイナムコホールディングス	11,600	6,612.00	76,699,200	代用有価証券 11,600株
7839	ＳＨＯＥＩ	9,000	3,125.00	28,125,000	代用有価証券 9,000株
7846	パイロットコーポレーション	8,000	3,050.00	24,400,000	代用有価証券 8,000株
7911	凸版印刷	49,500	1,700.00	84,150,000	代用有価証券 38,000株
7921	ＴＡＫＡＲＡ　＆　ＣＯＭＰＡＮＹ	10,000	2,274.00	22,740,000	
7974	任天堂	1,500	57,320.00	85,980,000	代用有価証券 1,500株
7976	三菱鉛筆	20,000	1,231.00	24,620,000	代用有価証券 11,500株

7981	タカラスタンダード	12,000	1,350.00	16,200,000	
2384	ＳＢＳホールディングス	9,000	2,064.00	18,576,000	代用有価証券 9,000株
9005	東急	77,600	1,349.00	104,682,400	代用有価証券 55,600株
9009	京成電鉄	33,000	2,967.00	97,911,000	
9025	鴻池運輸	15,000	1,088.00	16,320,000	
9045	京阪ホールディングス	21,000	4,505.00	94,605,000	代用有価証券 17,000株
9052	山陽電気鉄道	7,000	2,104.00	14,728,000	
9064	ヤマトホールディングス	40,000	2,779.00	111,160,000	
9065	山九	9,000	4,190.00	37,710,000	代用有価証券 7,000株
9068	丸全昭和運輸	6,500	3,335.00	21,677,500	代用有価証券 6,500株
9072	ニッコンホールディングス	11,000	2,132.00	23,452,000	代用有価証券 11,000株
9090	丸和運輸機関	8,000	4,285.00	34,280,000	
9142	九州旅客鉄道	40,000	2,280.00	91,200,000	代用有価証券 30,000株
9058	トランコム	4,000	7,130.00	28,520,000	代用有価証券 4,000株
9324	安田倉庫	17,000	891.00	15,147,000	
3626	ＴＩＳ	45,000	2,228.00	100,260,000	代用有価証券 25,000株
3649	ファインデックス	18,000	1,210.00	21,780,000	代用有価証券 18,000株
3687	フィックスターズ	12,000	1,101.00	13,212,000	代用有価証券 12,000株
3697	ＳＨＩＦＴ	2,700	12,890.00	34,803,000	代用有価証券 2,700株
3741	セック	7,000	2,925.00	20,475,000	代用有価証券 7,000株
3835	ｅＢＡＳＥ	15,000	1,291.00	19,365,000	
3844	コムチュア	10,000	2,312.00	23,120,000	代用有価証券 10,000株
3902	メディカル・データ・ビジョン	20,000	1,770.00	35,400,000	代用有価証券 20,000株
3915	テラスカイ	9,000	4,610.00	41,490,000	代用有価証券 9,000株
3916	デジタル・インフォメーション・テクノロジ	15,000	1,264.00	18,960,000	代用有価証券 15,000株
3925	ダブルスタンダード	6,500	4,985.00	32,402,500	代用有価証券 6,500株
3962	チェンジ	2,000	13,860.00	27,720,000	
3983	オロ	10,000	3,170.00	31,700,000	代用有価証券 6,000株
4312	サイバネットシステム	22,000	769.00	16,918,000	
4348	インフォコム	8,000	3,655.00	29,240,000	

4384	ラクスル	6,500	2,925.00	19,012,500	
4674	クレスコ	12,000	1,302.00	15,624,000	
4684	オービック	5,500	19,240.00	105,820,000	
4686	ジャストシステム	3,000	7,970.00	23,910,000	代用有価証券 3,000株
4704	トレンドマイクロ	10,000	6,690.00	66,900,000	
4722	フューチャー	15,000	1,948.00	29,220,000	代用有価証券 10,000株
4733	オービックビジネスコンサルタント	5,000	6,650.00	33,250,000	代用有価証券 5,000株
4739	伊藤忠テクノソリューションズ	27,000	4,115.00	111,105,000	
7595	アルゴグラフィックス	8,000	3,605.00	28,840,000	代用有価証券 8,000株
8096	兼松エレクトロニクス	8,000	4,060.00	32,480,000	代用有価証券 8,000株
9404	日本テレビホールディングス	31,000	1,236.00	38,316,000	代用有価証券 15,000株
9433	ＫＤＤＩ	29,300	3,334.00	97,686,200	代用有価証券 29,300株
9629	ピー・シー・エー	3,500	5,030.00	17,605,000	
9682	ＤＴＳ	10,000	2,255.00	22,550,000	代用有価証券 10,000株
9692	シーイーシー	17,000	1,702.00	28,934,000	代用有価証券 10,000株
9742	アイネス	20,000	1,401.00	28,020,000	代用有価証券 20,000株
9790	福井コンピュータホールディングス	9,000	2,699.00	24,291,000	代用有価証券 9,000株
2768	双日	150,000	233.00	34,950,000	代用有価証券 150,000株
3038	神戸物産	14,000	7,120.00	99,680,000	代用有価証券 6,000株
3076	あい　ホールディングス	21,000	1,650.00	34,650,000	代用有価証券 13,000株
3176	三洋貿易	34,000	978.00	33,252,000	代用有価証券 34,000株
3543	コメダホールディングス	13,000	1,762.00	22,906,000	代用有価証券 13,000株
7467	萩原電気ホールディングス	5,000	1,893.00	9,465,000	
7483	ドウシシャ	17,000	2,019.00	34,323,000	代用有価証券 10,000株
7575	日本ライフライン	14,000	1,415.00	19,810,000	
7599	ＩＤＯＭ	50,000	528.00	26,400,000	代用有価証券 50,000株
7613	シークス	20,000	851.00	17,020,000	
8001	伊藤忠商事	48,000	2,622.50	125,880,000	
8015	豊田通商	44,700	3,015.00	134,770,500	代用有価証券 10,000株
8031	三井物産	68,500	1,785.00	122,272,500	代用有価証券 63,700株

8043	スターゼン	4,000	4,020.00	16,080,000	
8084	菱電商事	20,000	1,416.00	28,320,000	代用有価証券 20,000株
8125	ワキタ	21,000	936.00	19,656,000	
8140	リョーサン	10,000	1,967.00	19,670,000	代用有価証券 9,000株
8151	東陽テクニカ	22,000	954.00	20,988,000	
8154	加賀電子	15,000	2,152.00	32,280,000	代用有価証券 15,000株
8159	立花エレテック	9,000	1,661.00	14,949,000	
8283	ＰＡＬＴＡＣ	3,500	6,090.00	21,315,000	代用有価証券 3,500株
9830	トラスコ中山	10,000	2,437.00	24,370,000	
9869	加藤産業	6,000	3,590.00	21,540,000	代用有価証券 5,000株
9934	因幡電機産業	7,000	2,591.00	18,137,000	
2659	サンエー	6,500	4,310.00	28,015,000	代用有価証券 6,500株
2664	カワチ薬品	6,000	3,135.00	18,810,000	代用有価証券 6,000株
2698	キャンドゥ	10,000	2,239.00	22,390,000	代用有価証券 10,000株
2792	ハニーズホールディングス	22,000	1,073.00	23,606,000	代用有価証券 22,000株
3046	ジンズホールディングス	4,000	7,400.00	29,600,000	代用有価証券 4,000株
3064	ＭｏｎｏｔａＲＯ	20,000	4,410.00	88,200,000	代用有価証券 20,000株
3085	アークランドサービスホールディングス	13,600	1,965.00	26,724,000	代用有価証券 10,600株
3091	ブロンコビリー	10,000	2,171.00	21,710,000	代用有価証券 8,000株
3097	物語コーポレーション	4,200	8,610.00	36,162,000	代用有価証券 3,200株
3098	ココカラファイン	5,000	5,920.00	29,600,000	代用有価証券 5,000株
3141	ウエルシアホールディングス	10,000	9,530.00	95,300,000	
3148	クリエイトＳＤホールディングス	10,000	3,840.00	38,400,000	代用有価証券 10,000株
3191	ジョイフル本田	12,000	1,569.00	18,828,000	代用有価証券 12,000株
3221	ヨシックス	10,000	1,693.00	16,930,000	代用有価証券 3,700株
3333	あさひ	17,000	1,965.00	33,405,000	代用有価証券 17,000株
3382	セブン＆アイ・ホールディングス	14,000	3,450.00	48,300,000	代用有価証券 14,000株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	22,000	685.00	15,070,000	代用有価証券 22,000株
3391	ツルハホールディングス	7,000	14,700.00	102,900,000	代用有価証券 7,000株

3415	ＴＯＫＹＯ　ＢＡＳＥ	50,000	345.00	17,250,000	
3539	ＪＭホールディングス	9,000	3,665.00	32,985,000	代用有価証券 9,000株
3563	スシローグローバルホールディングス	12,000	2,516.00	30,192,000	代用有価証券 12,000株
7508	Ｇ－７ホールディングス	10,000	3,015.00	30,150,000	代用有価証券 10,000株
7532	パン・パシフィック・インターナショナルホ	40,000	2,609.00	104,360,000	代用有価証券 40,000株
7545	西松屋チェーン	30,000	1,355.00	40,650,000	代用有価証券 30,000株
7611	ハイデイ日高	12,000	1,725.00	20,700,000	代用有価証券 9,000株
7618	ピーシーデポコーポレーション	30,000	668.00	20,040,000	代用有価証券 30,000株
7630	壱番屋	5,000	5,130.00	25,650,000	代用有価証券 4,000株
8167	リテールパートナーズ	11,000	1,960.00	21,560,000	
8174	日本瓦斯	3,000	4,345.00	13,035,000	
8184	島忠	11,000	3,150.00	34,650,000	代用有価証券 11,000株
8217	オークワ	18,000	1,465.00	26,370,000	
8282	ケーズホールディングス	17,000	1,579.00	26,843,000	
9842	アークランドサカモト	21,000	2,247.00	47,187,000	代用有価証券 14,500株
9843	ニトリホールディングス	4,000	22,975.00	91,900,000	代用有価証券 4,000株
9948	アークス	15,000	2,758.00	41,370,000	代用有価証券 12,000株
8410	セブン銀行	300,000	267.00	80,100,000	代用有価証券 300,000株
8715	アニコム　ホールディングス	8,000	4,395.00	35,160,000	代用有価証券 8,000株
3003	ヒューリック	95,000	957.00	90,915,000	代用有価証券 95,000株
3245	ディア・ライフ	28,000	560.00	15,680,000	代用有価証券 28,000株
3276	日本管理センター	12,000	1,182.00	14,184,000	
3288	オープンハウス	9,000	3,635.00	32,715,000	代用有価証券 9,000株
8801	三井不動産	46,000	1,843.50	84,801,000	
8804	東京建物	17,000	1,248.00	21,216,000	代用有価証券 17,000株
8919	カチタス	15,000	2,663.00	39,945,000	
8934	サンフロンティア不動産	14,000	797.00	11,158,000	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	18,300	1,260.00	23,058,000	代用有価証券 18,300株
2301	学情	17,000	999.00	16,983,000	代用有価証券 17,000株

2331	綜合警備保障	13,000	5,080.00	66,040,000	代用有価証券 13,000株
2413	エムスリー	14,000	6,440.00	90,160,000	代用有価証券 14,000株
2471	エスプール	28,000	730.00	20,440,000	
4318	クイック	12,000	1,264.00	15,168,000	
4661	オリエンタルランド	4,500	13,700.00	61,650,000	
4694	ビー・エム・エル	8,000	2,779.00	22,232,000	代用有価証券 8,000株
4714	リソー教育	50,000	302.00	15,100,000	
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	2,500	13,160.00	32,900,000	代用有価証券 2,500株
6036	ＫｅｅＰｅｒ技研	12,000	2,332.00	27,984,000	代用有価証券 12,000株
6080	Ｍ＆Ａキャピタルパートナーズ	7,000	4,170.00	29,190,000	代用有価証券 7,000株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	13,000	2,784.00	36,192,000	代用有価証券 13,000株
6088	シグマクシス	15,000	1,408.00	21,120,000	
6099	エラン	23,000	2,461.00	56,603,000	代用有価証券 23,000株
6196	ストライク	7,000	5,100.00	35,700,000	代用有価証券 4,000株
6539	ＭＳ－Ｊａｐａｎ	25,000	877.00	21,925,000	代用有価証券 14,000株
6541	グレイステクノロジー	7,000	4,385.00	30,695,000	代用有価証券 7,000株
7034	プロレド・パートナーズ	4,500	5,380.00	24,210,000	代用有価証券 4,500株
8920	東祥	12,000	1,311.00	15,732,000	
9621	建設技術研究所	7,000	1,885.00	13,195,000	
9632	スバル興業	3,000	7,300.00	21,900,000	代用有価証券 3,000株
9672	東京都競馬	9,000	4,990.00	44,910,000	代用有価証券 9,000株
9678	カナモト	10,000	2,289.00	22,890,000	
9716	乃村工藝社	25,000	739.00	18,475,000	代用有価証券 25,000株
9743	丹青社	28,000	662.00	18,536,000	代用有価証券 18,000株
9755	応用地質	17,000	1,227.00	20,859,000	代用有価証券 10,000株
9787	イオンディライト	10,000	3,085.00	30,850,000	代用有価証券 10,000株
9793	ダイセキ	10,000	2,470.00	24,700,000	
合　計		6,451,100		13,114,384,400	

(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	
マルハニチロ	11,000	24,508,000	
サカタのタネ	7,000	24,045,000	
ミライト・ホールディングス	20,000	30,000,000	
飛島建設	11,000	11,902,000	
西松建設	14,000	28,014,000	
三井住友建設	60,000	25,620,000	
奥村組	14,000	35,756,000	
戸田建設	40,000	27,480,000	
大東建託	9,500	85,177,000	
東亜道路工業	4,000	13,460,000	
五洋建設	56,000	36,232,000	
住友林業	20,000	33,800,000	
大和ハウス工業	41,000	114,554,000	
トーエネック	2,500	8,775,000	
新日本空調	3,000	6,048,000	
日本製粉	10,000	16,870,000	
日清製粉グループ本社	50,000	86,900,000	
昭和産業	6,000	21,270,000	
不二家	6,700	14,552,400	
日本ハム	31,000	152,675,000	
サッポロホールディングス	16,000	29,808,000	
アサヒグループホールディングス	30,000	108,330,000	
宝ホールディングス	26,000	26,156,000	
コカ・コーラ　ボトラーズジャパンホールデ	56,100	97,109,100	
ダイドーグループホールディングス	5,000	24,375,000	
キーコーヒー	8,000	16,928,000	
不二製油グループ本社	15,000	45,375,000	
Ｊ－オイルミルズ	2,500	9,362,500	
カゴメ	15,000	49,125,000	
東洋紡	20,000	29,140,000	
ユニチカ	105,000	38,850,000	
富士紡ホールディングス	7,500	25,537,500	
東レ	213,500	103,590,200	
ＴＳＩホールディングス	70,000	22,330,000	
ワールド	24,000	39,312,000	

オンワードホールディングス	55,000	15,620,000	
デサント	26,000	46,800,000	
王子ホールディングス	250,000	115,000,000	
日本製紙	20,000	26,740,000	
多木化学	3,000	17,670,000	
石原産業	23,000	16,399,000	
セントラル硝子	12,000	24,192,000	
保土谷化学工業	8,000	42,960,000	
三井化学	50,000	122,950,000	
ＪＳＲ	50,000	115,350,000	
大阪有機化学工業	12,000	30,972,000	
ＫＨネオケム	16,000	36,560,000	
アイカ工業	7,000	25,550,000	
宇部興産	21,000	39,081,000	
タキロンシーアイ	17,000	11,934,000	
日本化薬	20,000	20,880,000	
第一工業製薬	7,000	29,995,000	
富士フイルムホールディングス	18,000	89,208,000	
資生堂	20,000	116,040,000	
ミルボン	7,500	42,900,000	
ファンケル	12,000	38,280,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	35,000	66,990,000	
ＪＣＵ	9,000	31,905,000	
デクセリアルズ	25,000	24,875,000	
アキレス	14,000	25,466,000	
レック	16,000	26,960,000	
藤森工業	5,000	18,925,000	
ニフコ	12,000	31,752,000	
塩野義製薬	16,000	98,656,000	
持田製薬	8,000	31,840,000	
ツムラ	8,000	23,904,000	
ゼリア新薬工業	19,000	37,069,000	
第一三共	10,000	95,990,000	
大正製薬ホールディングス	16,000	105,760,000	
出光興産	49,600	113,931,200	
ＥＮＥＯＳホールディングス	299,500	121,417,300	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	27,000	45,603,000	
住友ゴム工業	110,000	106,480,000	
ＡＧＣ	35,000	104,650,000	
日本板硝子	60,000	24,720,000	
住友大阪セメント	7,000	23,800,000	
東海カーボン	35,000	32,970,000	

神戸製鋼所	60,000	23,580,000	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	140,000	111,160,000	
大同特殊鋼	7,000	23,520,000	
新日本電工	70,000	13,300,000	
三井金属鉱業	10,000	24,950,000	
東邦亜鉛	11,500	19,975,500	
古河機械金属	24,000	24,984,000	
ＵＡＣＪ	13,000	24,583,000	
古河電気工業	10,000	24,350,000	
フジクラ	70,000	21,070,000	
昭和電線ホールディングス	27,100	30,243,600	
リョービ	25,000	28,125,000	
アサヒホールディングス	11,000	38,885,000	
川田テクノロジーズ	6,000	26,850,000	
ＲＳ　Ｔｅｃｈｎｏｌｏｇｉｅｓ	5,000	17,100,000	
三和ホールディングス	30,000	29,400,000	
三協立山	25,000	22,150,000	
アルインコ	18,000	16,452,000	
ＬＩＸＩＬグループ	70,000	122,850,000	
ノーリツ	16,000	20,352,000	
エイチワン	27,000	13,554,000	
タクマ	16,000	27,760,000	
オークマ	5,000	23,875,000	
牧野フライス製作所	7,000	24,325,000	
ＤＭＧ森精機	15,000	19,050,000	
島精機製作所	17,000	24,820,000	
やまびこ	24,000	25,800,000	
タツモ	10,000	14,190,000	
レオン自動機	5,000	5,435,000	
日立建機	29,600	105,524,000	
ローツェ	3,300	16,995,000	
新東工業	13,000	9,269,000	
澁谷工業	9,500	28,006,000	
荏原製作所	10,000	27,200,000	
ダイキン工業	4,000	79,560,000	
タダノ	30,000	26,340,000	
フジテック	13,000	27,586,000	
ＣＫＤ	20,000	30,020,000	
キトー	10,000	10,820,000	
セガサミーホールディングス	50,000	61,850,000	
リケン	4,000	10,568,000	
日本精工	130,000	101,920,000	

ＮＴＮ	170,000	33,320,000	
ジェイテクト	120,000	97,680,000	
不二越	9,000	28,710,000	
イーグル工業	16,000	11,760,000	
キッツ	33,000	20,493,000	
日立造船	80,000	31,440,000	
三菱重工業	40,000	104,840,000	
イビデン	12,000	42,840,000	
安川電機	24,700	91,143,000	
明電舎	17,000	27,948,000	
山洋電気	5,000	23,950,000	
東芝テック	6,500	28,437,500	
オムロン	12,000	92,400,000	
ルネサスエレクトロニクス	149,800	102,912,600	
京三製作所	50,000	23,450,000	
パナソニック	107,800	101,989,580	
シャープ	88,200	107,074,800	
アンリツ	10,000	23,790,000	
ＴＤＫ	9,500	106,305,000	
タムラ製作所	42,000	19,950,000	
アルプスアルパイン	25,000	38,750,000	
ローランド　ディー．ジー．	12,000	14,472,000	
マクセルホールディングス	22,000	22,044,000	
古野電気	22,000	20,944,000	
イリソ電子工業	8,000	29,640,000	
ウシオ電機	15,000	19,695,000	
日本セラミック	10,000	24,520,000	
古河電池	22,000	24,728,000	
日本電子	9,500	29,212,500	
三井ハイテック	21,000	35,301,000	
新光電気工業	20,000	32,880,000	
太陽誘電	10,000	29,710,000	
日本ケミコン	16,000	26,080,000	
リコー	130,500	98,788,500	
モリタホールディングス	5,500	10,450,000	
東海理化電機製作所	15,000	22,125,000	
日本車輌製造	7,000	17,381,000	
三菱ロジスネクスト	28,000	26,600,000	
日産自動車	269,500	112,516,250	
日野自動車	90,000	61,200,000	
武蔵精密工業	22,000	21,648,000	
タチエス	15,000	12,780,000	

大同メタル工業	40,000	20,080,000	
プレス工業	80,000	24,240,000	
河西工業	43,000	16,985,000	
マツダ	80,000	51,760,000	
豊田合成	55,000	123,585,000	
ジャムコ	32,000	21,856,000	
日機装	25,000	26,125,000	
日本エム・ディ・エム	10,000	19,670,000	
島津製作所	39,100	125,120,000	
東京計器	10,000	9,030,000	
マニー	10,000	27,460,000	
トプコン	25,000	20,525,000	
オリンパス	30,000	64,440,000	
セイコーホールディングス	18,000	26,874,000	
ニプロ	28,000	33,124,000	
大建工業	3,000	4,770,000	
アシックス	30,000	45,510,000	
ヤマハ	16,000	78,800,000	
河合楽器製作所	5,000	13,075,000	
西部瓦斯	3,500	8,704,500	
小田急電鉄	42,000	106,554,000	
京王電鉄	18,000	113,220,000	
富士急行	8,000	24,920,000	
東日本旅客鉄道	15,100	101,034,100	
西日本鉄道	10,000	29,520,000	
近鉄グループホールディングス	25,000	113,250,000	
福山通運	9,000	43,650,000	
セイノーホールディングス	23,000	36,501,000	
日立物流	13,000	47,190,000	
ＳＧホールディングス	21,000	105,210,000	
日本郵船	86,300	138,511,500	
川崎汽船	18,000	19,674,000	
三井倉庫ホールディングス	23,000	38,893,000	
ＮＥＣネッツエスアイ	10,000	20,950,000	
システナ	15,000	27,225,000	
日鉄ソリューションズ	8,500	26,435,000	
ソリトンシステムズ	20,000	37,620,000	
電算システム	5,000	19,100,000	
ネクソン	36,000	93,312,000	
ブロードリーフ	50,000	26,300,000	
オプティム	8,000	26,640,000	
テクマトリックス	13,000	30,173,000	

GMOペイメントゲートウェイ	7,000	83,860,000	
さくらインターネット	30,000	18,060,000	
ヴィンクス	15,000	17,145,000	
Ｕｂｉｃｏｍホールディングス	11,000	21,329,000	
マクロミル	40,000	32,120,000	
フジ・メディア・ホールディングス	25,000	25,925,000	
ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	7,000	9,261,000	
サイボウズ	12,000	39,780,000	
ネットワンシステムズ	8,000	34,240,000	
日本ユニシス	7,500	23,100,000	
東京放送ホールディングス	10,000	17,630,000	
光通信	4,000	103,360,000	
ＮＴＴドコモ	32,800	101,483,200	
ファイバーゲート	12,000	22,560,000	
ゼンリン	20,000	22,600,000	
松竹	2,500	34,925,000	
東宝	33,000	123,090,000	
富士ソフト	6,000	29,040,000	
ＪＢＣＣホールディングス	17,000	29,053,000	
ミロク情報サービス	9,000	19,170,000	
東京エレクトロン　デバイス	7,000	21,420,000	
アルフレッサ　ホールディングス	44,000	93,588,000	
横浜冷凍	28,000	24,864,000	
レスターホールディングス	15,000	28,680,000	
ＴＯＫＡＩホールディングス	20,000	20,320,000	
アズワン	3,000	39,900,000	
丸紅	230,000	132,687,000	
長瀬産業	15,000	20,010,000	
山善	25,000	24,425,000	
菱洋エレクトロ	11,500	34,672,500	
阪和興業	14,000	28,826,000	
サンゲツ	16,000	24,880,000	
シナネンホールディングス	7,000	20,622,000	
モスフードサービス	12,000	34,428,000	
日鉄物産	8,000	25,160,000	
東テク	8,000	17,336,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	47,000	33,511,000	
ドトール・日レスホールディングス	15,000	23,595,000	
マツモトキヨシホールディングス	9,000	33,525,000	
ネクステージ	25,000	25,950,000	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホール	20,000	26,540,000	
日本調剤	7,000	11,137,000	

クスリのアオキホールディングス	5,000	49,350,000	
ノジマ	12,000	36,300,000	
カッパ・クリエイト	16,000	22,560,000	
コーナン商事	10,000	42,100,000	
ワタミ	20,000	18,620,000	
幸楽苑ホールディングス	13,600	22,453,600	
ユナイテッドアローズ	12,000	19,272,000	
コロワイド	15,000	22,935,000	
木曽路	12,000	27,396,000	
ＳＲＳホールディングス	14,000	12,712,000	
ケーヨー	20,000	17,760,000	
上新電機	10,000	23,380,000	
ロイヤルホールディングス	10,000	17,400,000	
ライフコーポレーション	6,000	31,140,000	
松屋	21,000	13,230,000	
イオン	53,000	143,232,500	
イズミ	8,000	35,320,000	
アインホールディングス	3,300	22,440,000	
プレナス	16,000	28,080,000	
バローホールディングス	10,000	27,000,000	
いちご	55,000	15,345,000	
サムティ	18,000	23,472,000	
フージャースホールディングス	20,000	11,820,000	
ケイアイスター不動産	12,000	24,348,000	
パーク２４	58,900	102,250,400	
三菱地所	51,400	84,475,900	
平和不動産	8,000	21,584,000	
タカラレーベン	60,000	20,580,000	
イオンモール	86,800	119,263,200	
トーセイ	20,000	18,840,000	
日本空港ビルデング	30,000	134,250,000	
日本工営	9,000	25,128,000	
ＵＴグループ	8,000	24,200,000	
タケエイ	32,000	30,784,000	
コシダカホールディングス	50,000	21,450,000	
パソナグループ	20,000	28,440,000	
リンクアンドモチベーション	80,000	25,840,000	
ＧＣＡ	38,000	23,522,000	
パーソルホールディングス	70,000	116,200,000	
シミックホールディングス	10,000	13,610,000	
ルネサンス	26,000	23,166,000	
ベネフィット・ワン	8,000	20,952,000	

アウトソーシング	45,000	36,630,000	
ワールドホールディングス	15,000	25,710,000	
ジャパンベストレスキューシステム	25,000	23,025,000	
電通グループ	44,200	121,417,400	
イオンファンタジー	16,000	25,728,000	
Ｈ．Ｕ．グループホールディングス	8,500	20,570,000	
ダスキン	10,000	26,770,000	
ラウンドワン	38,000	29,526,000	
リゾートトラスト	20,000	27,080,000	
エン・ジャパン	12,000	36,360,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	30,000	28,530,000	
ウィルグループ	28,000	20,636,000	
リクルートホールディングス	30,000	112,500,000	
ベルシステム２４ホールディングス	20,000	36,460,000	
ソラスト	20,000	23,800,000	
日総工産	35,000	25,165,000	
キュービーネットホールディングス	13,000	25,545,000	
リログループ	13,000	28,197,000	
エイチ・アイ・エス	12,000	21,000,000	
ラックランド	10,000	22,110,000	
西尾レントオール	10,000	22,410,000	
藤田観光	16,000	22,640,000	
ＫＮＴ－ＣＴホールディングス	12,000	10,200,000	
ベネッセホールディングス	36,000	93,960,000	
合計	8,930,900	12,881,551,830	

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 8月31日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	733,401,969
Ⅱ　負債総額	163,930
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	733,238,039
Ⅳ　発行済口数	598,763,345口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2246
（10,000口当たり）	（12,246）

（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 8月31日現在
（単位：円）

Ⅰ　資産総額	29,040,593,982
Ⅱ　負債総額	13,459,455,840
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	15,581,138,142
Ⅳ　発行済口数	10,543,694,067口
Ⅴ　1口当たり純資産価額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4778
（10,000口当たり）	（14,778）

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、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

（１）資本金の額等

2020年8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 8月31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	868	14,374,966
追加型公社債投資信託	16	1,375,722
単位型株式投資信託	69	349,152
単位型公社債投資信託	24	124,345
合　計	977	16,224,184

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。

なお、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35期事業年度（自 平成31年4月1日 至 令和2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。

（１）【貸借対照表】

（単位：千円）

	第34期 （平成31年3月31日現在）		第35期 （令和2年3月31日現在）	
（資産の部）				
流動資産				
現金及び預金	※2	53,969,686	※2	56,398,457
有価証券		1,403,513		1,960,318
前払費用		514,587		575,904
未収入金		2,284		14,559
未収委託者報酬		9,995,458		10,296,453
未収収益	※2	560,483	※2	638,994
金銭の信託	※2	100,000	※2	100,000

その他		153,256		254,330
流動資産合計		66,699,271		70,239,017
固定資産				
有形固定資産				
建物	※1	617,032	※1	584,048
器具備品	※1	665,247	※1	871,893
土地		628,433		628,433
有形固定資産合計		1,910,713		2,084,375
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		3,670,753		3,369,611
ソフトウェア仮勘定		536,345		1,374,932
無形固定資産合計		4,222,921		4,760,365
投資その他の資産				
投資有価証券		21,408,781		16,704,756
関係会社株式		320,136		320,136
投資不動産	※1	824,268	※1	819,255
長期差入保証金		593,536		565,358
前払年金費用		415,234		375,031
繰延税金資産		1,496,180		1,912,824
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		25,079,767		20,718,993
固定資産合計		31,213,401		27,563,734
資産合計		97,912,673		97,802,752

（単位：千円）

	第34期 （平成31年3月31日現在）		第35期 （令和2年3月31日現在）	
（負債の部）				
流動負債				
預り金		293,258		687,565
未払金				
未払収益分配金		170,281		131,478
未払償還金		448,695		395,400
未払手数料	※2	3,990,054	※2	4,026,078
その他未払金	※2	3,961,765	※2	3,818,195
未払費用	※2	3,803,995	※2	4,402,578
未払消費税等		194,852		629,469
未払法人税等		573,657		617,341
賞与引当金		901,135		933,517
役員賞与引当金		140,100		124,590
その他		868,992		701,285
流動負債合計		15,346,788		16,467,499
固定負債				
長期未払金		43,200		32,400
退職給付引当金		860,851		1,010,401
役員退職慰労引当金		144,303		130,784

時効後支払損引当金	247,767	238,811
固定負債合計	1,296,122	1,412,398
負債合計	16,642,910	17,879,897
(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	26,069,594	25,847,605
利益剰余金合計	33,410,184	33,188,194
株主資本合計	80,143,028	79,921,039

(単位：千円)

	第34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2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	1,126,733	1,815
評価・換算差額等合計	1,126,733	1,815
純資産合計	81,269,762	79,922,854
負債純資産合計	97,912,673	97,802,752

（２）【損益計算書】

(単位：千円)

		第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）		第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
営業収益				
委託者報酬		70,375,414		67,967,489
投資顧問料		2,505,299		2,385,084
その他営業収益		18,844		16,085
営業収益合計		72,899,557		70,368,658
営業費用				
支払手数料	※2	28,533,952	※2	27,106,451
広告宣伝費		739,643		696,418
公告費		500		1,000
調査費				
調査費		1,794,755		1,857,271
委託調査費		12,194,996		11,579,175
事務委託費		1,016,816		847,769
営業雑経費				

通信費	170,794	153,731
印刷費	427,442	427,118
協会費	48,375	52,053
諸会費	16,175	15,990
事務機器関連費	1,841,631	1,953,926
営業費用合計	46,785,083	44,690,907
一般管理費		
給料		
役員報酬	349,083	331,987
給料・手当	6,453,717	6,611,427
賞与引当金繰入	901,135	933,517
役員賞与引当金繰入	140,100	124,590
福利厚生費	1,234,293	1,276,950
交際費	13,011	11,871
旅費交通費	200,426	165,891
租税公課	373,201	360,165
不動産賃借料	654,886	647,402
退職給付費用	428,912	422,919
役員退職慰労引当金繰入	51,159	48,183
固定資産減価償却費	1,252,321	1,307,555
諸経費	523,213	427,212
一般管理費合計	12,575,461	12,669,674
営業利益	13,539,012	13,008,076

（単位：千円）

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）		第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）	
営業外収益				
受取配当金		181,073		90,965
受取利息	※2	1,913	※2	4,169
投資有価証券償還益		416,706		585,179
収益分配金等時効完成分		44,392		101,734
受取賃貸料	※2	38,388	※2	65,808
その他		11,871		19,987
営業外収益合計		694,346		867,845
営業外費用				
投資有価証券償還損		118,173		96,379
時効後支払損引当金繰入		1,166		-
事務過誤費		420		3,483
賃貸関連費用		35,994		20,339
その他		1,481		1,920
営業外費用合計		157,235		122,122
経常利益		14,076,123		13,753,799
特別利益				
投資有価証券売却益		501,778		174,842
特別利益合計		501,778		174,842
特別損失				
投資有価証券売却損		135,399		75,963
投資有価証券評価損		62,310		163,865
固定資産除却損	※1	4,848	※1	8,832

固定資産売却損		225		435
システム関連費		322,986		-
商標使用料		90,000		-
特別損失合計		615,770		249,096
税引前当期純利益		13,962,130		13,679,545
法人税、住民税及び事業税	※2	4,420,179	※2	4,146,534
法人税等調整額		△100,112		79,824
法人税等合計		4,320,066		4,226,359
当期純利益		9,642,064		9,453,186

（３）【株主資本等変動計算書】

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	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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31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
当期変動額									
剰余金の配当							△9,675,175	△9,675,175	△9,675,175
当期純利益							9,453,186	9,453,186	9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額(純額)									
当期変動額合計	―	―	―	―	―	―	△221,989	△221,989	△221,989
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	25,847,605	33,188,194	79,921,039

	評価・換算差額等	

	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	純資産合計
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
剰余金の配当			△9,675,175
当期純利益			9,453,186
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）	△1,124,917	△1,124,917	△1,124,917
当期変動額合計	△1,124,917	△1,124,917	△1,346,907
当期末残高	1,815	1,815	79,922,854

[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。

(3)「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」の適用

令和2年度税制改正において従来の連結納税制度が見直され、グループ通算制度に移行する税制改正法（「所得税法等の一部を改正する法律」（令和2年法律第8号））が令和2年3月27日に成立しておりますが、繰延税金資産の額について、実務対応報告第39号「連結納税制度からグループ通算制度への移行に係る税効果会計の適用に関する取扱い」により企業会計基準適用指針第28号「税効果会計に係る会計基準の適用指針」第44項の定めを適用せず、改正前の税法の規定に基づいて算定しております。

（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 令和2年3月31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 令和2年3月31日 企業会計基準委員会）
・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31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。

・「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「金融商品に関する会計基準」（企業会計基準第10号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「時価の算定に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第31号 令和元年7月4日 企業会計基準委員会）
・「金融商品の時価等の開示に関する適用指針」（企業会計基準適用指針第19号 令和2年3月31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）が、公正価値測定についてほぼ同じ内容の詳細なガイダンス（国際財務報告基準（IFRS）においてはIFRS第13号「公正価値測定」、米国会計基準においてはAccounting Standards CodificationのTopic 820「公正価値測定」）を定めている状況を踏まえ、企業会計基準委員会において、主に金融商品の時価に関するガイダンス及び開示に関して、日本基準を国際的な会計基準との整合性を図る取組みが行われ、「時価の算定に関する会計基準」等が公表されたものです。

企業会計基準委員会の時価の算定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、統一的な算定方法を用いることにより、国内外の企業間における財務諸表の比較可能性を向上させる観点から、IFRS第13号の定めを基本的にすべて取り入れることとされ、また、これまで我が国で行われてきた実務等に配慮し、財務諸表間の比較可能性を大きく損なわせない範囲で、個別項目に対するその他の取扱いを定め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

「時価の算定に関する会計基準」等の適用による財務諸表に与える影響額については、現時点で未定であります。

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
建物	551,025千円	599,542千円
器具備品	1,350,407千円	1,408,613千円
投資不動産	138,024千円	145,391千円

※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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
預金	240,211千円	314,247千円
未収収益	25,307千円	15,773千円
金銭の信託	100,000千円	100,000千円
未払手数料	671,568千円	712,210千円
その他未払金	3,217,341千円	3,029,426千円
未払費用	444,754千円	432,019千円

（損益計算書関係）

※1.固定資産除却損の内訳

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
建物	2,547千円	―
器具備品	2,301千円	8,832千円
計	4,848千円	8,832千円

※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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
支払手数料	5,298,064千円	5,234,629千円
受取利息	3千円	2千円
受取賃貸料	38,388千円	65,808千円

法人税、住民税及び事業税　3,216,517千円　3,030,180千円

（株主資本等変動計算書関係）

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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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

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 １株当たり配当額　45,728円
③ 基準日　平成31年3月31日
④ 効力発生日　令和 元年6月27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2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　9,457,670千円
② 配当の原資　利益剰余金
③ １株当たり配当額　44,700円
④ 基準日　令和2年3月31日
⑤ 効力発生日　令和2年6月29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34期 （平成31年3月31日現在）	第35期 （令和2年3月31日現在）
1年内	675,956千円	675,956千円
1年超	675,956千円	―
合計	1,351,912千円	675,956千円

（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	―

第35期(令和2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	56,398,457	56,398,457	―
(2)　有価証券	1,960,318	1,960,318	―
(3)　未収委託者報酬	10,296,453	10,296,453	―
(4)　投資有価証券	16,673,396	16,673,396	―
資産計	85,328,625	85,328,625	―
(1)　未払手数料	4,026,078	4,026,078	―
負債計	4,026,078	4,026,078	―

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
非上場株式	55,360	31,360
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

第35期(令和2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	56,398,457	―	―	―
未収委託者報酬	10,296,453	―	―	―
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	1,960,318	5,652,257	4,813,929	27,375
合計	68,655,228	5,652,257	4,813,929	27,375

（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	株式	―	―	―

上額が取得原価を超えないもの	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

第35期(令和2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	9,859,345	8,694,010	1,165,334
	小計	9,859,345	8,694,010	1,165,334
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	8,774,369	9,937,087	△1,162,718
	小計	8,774,369	9,937,087	△1,162,718
合計		18,633,714	18,631,098	2,616

3.売却したその他有価証券

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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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	8,940	―	15,060
債券	―	―	―
その他	2,035,469	174,842	60,903
合計	2,044,409	174,842	75,963

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。

当事業年度において、有価証券について163,865千円（その他有価証券のその他163,865千円）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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
退職給付債務の期首残高	3,729,252 千円	3,712,289 千円

勤務費用	193,531	204,225
利息費用	24,351	17,557
数理計算上の差異の発生額	△15,898	△52,430
退職給付の支払額	△218,947	△162,904
過去勤務費用の発生額	―	―
退職給付債務の期末残高	3,712,289	3,718,736

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
年金資産の期首残高	2,723,393 千円	2,666,937 千円
期待運用収益	48,664	47,757
数理計算上の差異の発生額	△4,606	△164,633
事業主からの拠出額	102,564	51,282
退職給付の支払額	△203,077	△140,518
年金資産の期末残高	2,666,937	2,460,824

(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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
積立型制度の退職給付債務	3,125,760 千円	2,969,807 千円
年金資産	△2,666,937	△2,460,824
	458,822	508,982
非積立型制度の退職給付債務	586,529	748,929
未積立退職給付債務	1,045,351	1,257,911
未認識数理計算上の差異	△ 114,968	△203,136
未認識過去勤務費用	△ 484,766	△419,405
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370
退職給付引当金	860,851	1,010,401
前払年金費用	△415,234	△375,031
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	445,616	635,370

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
勤務費用	193,531 千円	204,225 千円
利息費用	24,351	17,557
期待運用収益	△48,664	△47,757
数理計算上の差異の費用処理額	43,633	24,035
過去勤務費用の費用処理額	65,361	65,361
その他	5,986	6,427
確定給付制度に係る退職給付費用	284,199	269,848

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
債券	63.9　%	64.7　%
株式	33.2	32.3
その他	2.9	3.0
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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
割引率	0.035～0.49%	0.095～0.52%
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144,712千円、当事業年度153,070千円であります。

（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34期 (平成31年3月31日現在)	第35期 (令和2年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	436,050千円	427,046千円
投資有価証券評価損	223,821	226,322
未払事業税	109,109	117,461
賞与引当金	275,927	285,842
役員賞与引当金	19,428	19,703
役員退職慰労引当金	44,185	40,046
退職給付引当金	263,592	309,384
減価償却超過額	157,741	96,767
委託者報酬	264,398	213,044
長期差入保証金	31,721	40,180
時効後支払損引当金	75,866	73,124
連結納税適用による時価評価	148,858	57,656
その他	71,320	123,248
繰延税金資産　小計	2,122,023	2,029,829
評価性引当額	―	―
繰延税金資産　合計	2,122,023	2,029,829
繰延税金負債		
前払年金費用	△127,144	△114,834
連結納税適用による時価評価	△1,320	△1,260
その他有価証券評価差額金	△497,269	△801
その他	△108	△109
繰延税金負債　合計	△625,842	△117,005
繰延税金資産の純額	1,496,180	1,912,824

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34期（平成31年3月31日現在）及び第35期（令和2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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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34期（自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）及び第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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㈱	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 役員の兼任	投資助言料（注3）	695,834千円	未払費用	365,510千円

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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）	3,030,180千円	その他未払金	3,029,426千円
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 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）	5,234,629千円	未払手数料	712,210千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料（注3）	583,270千円	未払費用	302,681千円

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。

(2)財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等

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	㈱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㈱	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

第35期（自 平成31年4月1日 至 令和2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銀行	東京都千代田区	1,711,958百万円	銀行業	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 取引銀行	投資信託に係る事務代行手数料の支払（注2）	4,073,855千円	未払手数料	697,109千円
							コーラブル預金の払戻（注3）	20,000,000千円		
							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）	4,126千円	未収収益	997千円
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㈱	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）	5,714,501千円	未払手数料	944,351千円

取引条件及び取引条件の決定方針等

（注）１．㈱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㈱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、㈱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、㈱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㈱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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
１株当たり純資産額	384,107.08円	377,741.17円
１株当たり当期純利益金額	45,571.50円	44,678.80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34期 （自 平成30年4月1日 至 平成31年3月31日）	第35期 （自 平成31年4月1日 至 令和2年3月31日）
当期純利益金額　（千円）	9,642,064	9,453,186

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）	9,642,064	9,453,186
普通株式の期中平均株式数　（株）	211,581	211,581

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（2020年３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（2020年３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8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【その他】

（１）目論見書の表紙にロゴマーク、図案およびキャッチ・コピーを採用すること、また使用開始日、ファンドの形態、申込みに係る事項、ファンド専用サイトのアドレスなどを記載することがあります。

（２）投資信託説明書（交付目論見書）に、以下の趣旨の文言の全部または一部および有価証券届出書の主要内容を記載することがあります。
・ファンドに関する投資信託説明書（請求目論見書）を含む詳細な情報は、委託会社のホームページで閲覧、ダウンロードできます。
・本書には、約款の主な内容が含まれていますが、約款の全文は請求目論見書に掲載されています。
・ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。
・ファンドの商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律に基づき事前に受益者の意向を確認します。
・ファンドの財産は、信託法に基づき受託会社において分別管理されています。
・請求目論見書は、販売会社にご請求いただければ当該販売会社を通じて交付いたします。（請求目論見書をご請求された場合は、その旨をご自身で記録しておくようお願いいたします。）
・有価証券届出書の効力の発生の有無については、委託会社のホームページにて確認いただけます。効力が発生するまでに、本書の記載内容が訂正される場合があります。

（３）投資信託説明書（請求目論見書）に信託約款を掲載します。

（４）目論見書は電磁的方法により提供されるほか、インターネット、電子媒体等に掲載されることがあります。

（５）投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。

（６）目論見書は「投資信託説明書」を別称として使用します。

（７）目論見書に委託会社のホームページアドレス等を掲載し、当該アドレスにアクセスすることにより基準価額等の情報を入手できる旨のご案内を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

令和2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
東　京　事　務　所

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

監査意見

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。

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令和2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、全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。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

財務諸表に対する経営者並びに監査役及び監査役会の責任

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査役及び監査役会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。

・　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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。

・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。

・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

監査人は、監査役及び監査役会に対して、独立性についての我が国における職業倫理に関する規定を遵守したこと、並びに監査人の独立性に影響を与えると合理的に考えられる事項、及び阻害要因を除去又は軽減するためにセーフガードを講じている場合はその内容について報告を行う。

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９月30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
東京事務所

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　鶴田　光夫　印

指定有限責任社員
業務執行社員　公認会計士　和田　渉　印

監査意見

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２年２月26日から令和２年８月24日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

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８月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、三菱ＵＦＪ国際投信株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

・　不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
・　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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
・　経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
・　経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。

・　財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

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。