

【表紙】

【提出書類】	訂正有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2019年5月24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。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2018年11月22日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について有価証券報告書の提出に伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書を提出します。

2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部__は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は原届出書の更新後の内容を示します。

なお、「第二部 ファンド情報 第1 ファンド状況 5 運用状況」、「第二部 ファンド情報 第3 ファンドの経理状況」は原届出書の更新後の内容を記載します。

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】

(3)【ファンドの仕組み】

<訂正前>

委託会社と関係法人との契約の概要

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

委託会社の概況（2018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%

<訂正後>

委託会社と関係法人との契約の概要

	概要
委託会社と受託会社との契約 「信託契約」	運用に関する事項、委託会社および受託会社としての業務に関する事項、受益者に関する事項等が定められています。 なお、信託契約は、「投資信託及び投資法人に関する法律」に基づきあらかじめ監督官庁に届け出られた信託約款の内容で締結されます。

委託会社と販売会社との契約 「投資信託受益権の取扱いに関する契約」	販売会社の募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱いに係る事務の内容等が定められています。
--------------------------------------	---------------------------------------------------------

委託会社の概況（2019年2月末現在）

- ・ 金融商品取引業者登録番号
金融商品取引業者 関東財務局長（金商）第404号
- ・ 設立年月日
1985年8月1日
- ・ 資本金
2,000百万円
- ・ 沿革
1997年5月 東京三菱投信投資顧問株式会社が証券投資信託委託業務を開始
2004年10月 東京三菱投信投資顧問株式会社と三菱信アセットマネジメント株式会社が合併、商号を三菱投信株式会社に変更
2005年10月 三菱投信株式会社とユーエフジェイパートナーズ投信株式会社が合併、商号を三菱UFJ投信株式会社に変更
2015年7月 三菱UFJ投信株式会社と国際投信投資顧問株式会社が合併、商号を三菱UFJ国際投信株式会社に変更
- ・ 大株主の状況

株主名	住所	所有株式数	所有比率
三菱UFJ信託銀行株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目4番5号	211,581株	100.0%

3【投資リスク】

<更新後>

(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。

（主なりスクであり、以下に限定されるものではありません。）

価格変動リスク

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

「マーケットニュートラル戦略について」

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

信用リスク

信用リスクとは、有価証券等の発行者や取引先等の経営・財務状況が悪化した場合またはそれが予想された場合もしくはこれらに関する外部評価の悪化があった場合等に、当該有価証

券等の価格が下落することやその価値がなくなること、または利払いや償還金の支払いが滞る等の債務が不履行となること等をいいます。当ファンドは、信用リスクを伴い、その影響を受けますので、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

流動性リスク

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

留意事項

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

(2) 投資リスクに対する管理体制

委託会社では、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲内で運用を行うとともに運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っています。また、定期的開催されるリスク管理に関する会議体等において、それらの状況の報告を行うほか、必要に応じて改善策を審議しています。この内容は運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

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。

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。

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。

内部監査担当部署

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

< 流動性リスクに対する管理体制 >

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

* 組織変更等により、前記の名称および内容は変更となる場合があります。

■代表的な資産クラスとの騰落率の比較等

下記のグラフは、ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。



- 基準価額(分配金再投資)は分配金(税引前)を分配時に再投資したものと計算しており、実際の基準価額とは異なる場合があります。
- 年間騰落率とは、各月末における直近1年間の騰落率をいいます。
- ファンドの年間騰落率は、税引前の分配金を再投資したものとみなして計算した年間騰落率が記載されており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

上記は、過去の実績であり、将来の投資成果を保証するものではありません。

代表的な資産クラスの指数について

資産クラス	指数名	注記等
日本株	TOPIX(配当込み)	TOPIX(配当込み)とは、東京証券取引所第一部に上場する内国普通株式全銘柄を対象として算出した指数(TOPIX)に、現金配当による権利落ちの修正を加えた株価指数です。TOPIX(配当込み)に関する知的財産権その他一切の権利は東京証券取引所に帰属します。東京証券取引所は、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の方法の変更、TOPIX(配当込み)の算出もしくは公表の停止またはTOPIX(配当込み)の商標の変更もしくは使用の停止を行う権利を有しています。
先進国株	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)	MSCIコクサイ・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、日本を除く世界の先進国で構成されています。また、MSCIコクサイ・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
新興国株	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)	MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み)とは、MSCI Inc.が開発した株価指数で、世界の新興国で構成されています。また、MSCIエマージング・マーケット・インデックスに対する著作権及びその他知的財産権はすべてMSCI Inc.に帰属します。
日本国債	NOMURA-BPI(国債)	NOMURA-BPI(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いません。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。
新興国債	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド	JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイドとは、J.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーが算出し公表している指数で、現地通貨建てのエマージング債市場の代表的なインデックスです。現地通貨建てのエマージング債のうち、投資規制の有無や、発行規模等を考慮して選ばれた銘柄により構成されています。当該指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジ等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】

(3)【信託報酬等】

<訂正前>

- ・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1.134%（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。

<訂正後>

- ・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1.134%（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。
消費税率が10%となった場合は、年1.155%（税抜1.05%）となります。

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。

(5)【課税上の取扱い】

<訂正前>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償

還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

原則として、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%）の税率で源泉徴収（申告不要）されます。なお、確定申告を行い、総合課税（配当控除は適用されません。）・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%）の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2018年8月末現在のもので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

<訂正後>

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

個人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の譲渡益については、次の通り課税されます。

1. 収益分配金の課税

普通分配金が配当所得として課税されます。元本払戻金(特別分配金)は課税されません。

原則として、20.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%、地方税5%)の税率で源泉徴収(申告不要)されます。なお、確定申告を行い、総合課税(配当控除は適用されません。)
・申告分離課税を選択することもできます。

2. 解約時および償還時の課税

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

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

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

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

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

法人の受益者に対する課税

受益者が支払いを受ける収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の個別元本超過額については、配当所得として15.315%(所得税15%、復興特別所得税0.315%)の税率で源泉徴収されます。地方税の源泉徴収はありません。なお、益金不算入制度の適用はありません。

買取りの取扱いについては、販売会社にお問い合わせください。

個別元本について

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

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

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

収益分配金について

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

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

上記は2019年2月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、上記の内容が変更になることがあります。

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

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】

平成31年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	228,208,898	99.75
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		572,543	0.25
純資産総額		228,781,441	100.00

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

（２）【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a 評価額上位30銘柄

平成31年 2月28日現在

国／地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 （円）	簿価 金額 （円）	評価 単価 （円）	評価 金額 （円）	投資 比率 （％）
日本	親投資信託受益証券	日本株マーケットニュートラル・マ ザーファンド	154,780,859	1.4761	228,472,026	1.4744	228,208,898	99.75

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

b 全銘柄の種類／業種別投資比率

平成31年 2月28日現在

種類	投資比率（％）
親投資信託受益証券	99.75
合計	99.75

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

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

（３）【運用実績】

【純資産の推移】

下記計算期間末日および平成31年2月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

（単位：円）

	純資産総額		基準価額 (1万口当たりの純資産価額)	
	(分配落)	(分配付)	(分配落)	(分配付)
第7計算期間末日 (平成21年 8月24日)	339,284,838	339,284,838	10,730	10,730
第8計算期間末日 (平成22年 2月24日)	320,060,928	320,060,928	10,631	10,631
第9計算期間末日 (平成22年 8月24日)	316,440,035	316,440,035	10,956	10,956
第10計算期間末日 (平成23年 2月24日)	216,544,993	216,544,993	11,523	11,523
第11計算期間末日 (平成23年 8月24日)	158,646,057	158,646,057	11,366	11,366
第12計算期間末日 (平成24年 2月24日)	97,056,812	97,056,812	11,470	11,470
第13計算期間末日 (平成24年 8月24日)	67,598,183	67,598,183	10,966	10,966
第14計算期間末日 (平成25年 2月25日)	50,499,625	50,499,625	11,507	11,507
第15計算期間末日 (平成25年 8月26日)	533,985,269	533,985,269	11,494	11,494
第16計算期間末日 (平成26年 2月24日)	904,211,437	904,211,437	11,732	11,732
第17計算期間末日 (平成26年 8月25日)	1,161,429,254	1,161,429,254	11,415	11,415
第18計算期間末日 (平成27年 2月24日)	1,300,508,022	1,300,508,022	11,504	11,504
第19計算期間末日 (平成27年 8月24日)	1,052,390,950	1,052,390,950	11,816	11,816
第20計算期間末日 (平成28年 2月24日)	2,393,560,606	2,393,560,606	11,855	11,855
第21計算期間末日 (平成28年 8月24日)	2,789,414,112	2,789,414,112	11,478	11,478
第22計算期間末日 (平成29年 2月24日)	2,914,372,319	2,914,372,319	12,200	12,200
第23計算期間末日 (平成29年 8月24日)	996,702,522	996,702,522	12,207	12,207
第24計算期間末日 (平成30年 2月26日)	1,040,713,788	1,040,713,788	12,396	12,396
第25計算期間末日 (平成30年 8月24日)	293,409,332	293,409,332	12,270	12,270
第26計算期間末日 (平成31年 2月25日)	230,192,204	230,192,204	12,406	12,406
平成30年 2月末日	1,037,775,436		12,348	
3月末日	1,060,670,256		12,275	
4月末日	505,381,293		12,321	
5月末日	374,145,231		12,373	
6月末日	322,104,846		12,340	
7月末日	316,351,668		12,391	
8月末日	281,580,396		12,233	
9月末日	248,723,650		12,199	
10月末日	245,983,380		12,151	
11月末日	245,464,164		12,126	
12月末日	241,917,364		12,109	
平成31年 1月末日	244,898,999		12,309	
2月末日	228,781,441		12,391	

【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
第7計算期間	0円
第8計算期間	0円
第9計算期間	0円
第10計算期間	0円
第11計算期間	0円
第12計算期間	0円
第13計算期間	0円
第14計算期間	0円
第15計算期間	0円
第16計算期間	0円
第17計算期間	0円
第18計算期間	0円
第19計算期間	0円
第20計算期間	0円
第21計算期間	0円
第22計算期間	0円
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

【収益率の推移】

	収益率（％）
第7計算期間	9.14
第8計算期間	0.92
第9計算期間	3.05
第10計算期間	5.17
第11計算期間	1.36
第12計算期間	0.91
第13計算期間	4.39
第14計算期間	4.93
第15計算期間	0.11
第16計算期間	2.07
第17計算期間	2.70
第18計算期間	0.77
第19計算期間	2.71
第20計算期間	0.33

第21計算期間	3.18
第22計算期間	6.29
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

（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7計算期間	105,011,219	56,430,581	316,215,525
第8計算期間	56,944,779	72,083,445	301,076,859
第9計算期間	15,058,155	27,298,131	288,836,883
第10計算期間	6,617,181	107,527,505	187,926,559
第11計算期間	36,086,244	84,439,182	139,573,621
第12計算期間	693,280	55,652,582	84,614,319
第13計算期間	890,000	23,862,803	61,641,516
第14計算期間	32,370,796	50,128,191	43,884,121
第15計算期間	434,451,663	13,749,453	464,586,331
第16計算期間	694,931,787	388,810,335	770,707,783
第17計算期間	351,519,150	104,777,761	1,017,449,172
第18計算期間	680,608,167	567,569,392	1,130,487,947
第19計算期間	601,429,705	841,262,648	890,655,004
第20計算期間	1,322,457,715	194,158,131	2,018,954,588
第21計算期間	687,026,995	275,786,436	2,430,195,147
第22計算期間	382,688,008	424,127,812	2,388,755,343
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

（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

平成31年 2月28日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
-------	------	------	---------

株式	日本	5,527,895,700	87.21
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		810,671,287	12.79
純資産総額		6,338,566,987	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

平成31年 2月28日現在

国/ 地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	タムロン	精密機器	13,000	2,133.00	27,729,000	2,157.00	28,041,000	0.44
日本	株式	田辺三菱製薬	医薬品	17,000	1,541.48	26,205,200	1,606.00	27,302,000	0.43
日本	株式	コーセー	化学	1,500	18,260.00	27,390,000	18,020.00	27,030,000	0.43
日本	株式	日本電産	電気機器	2,000	14,115.00	28,230,000	13,475.00	26,950,000	0.43
日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	8,500	3,151.00	26,783,500	3,153.00	26,800,500	0.42
日本	株式	ソニー	電気機器	5,000	5,377.00	26,885,000	5,341.00	26,705,000	0.42
日本	株式	住友重機械工業	機械	7,000	3,920.00	27,440,000	3,810.00	26,670,000	0.42
日本	株式	日本空港ビルデング	不動産業	6,000	4,445.00	26,670,000	4,420.00	26,520,000	0.42
日本	株式	I H I	機械	9,000	2,972.00	26,748,000	2,936.00	26,424,000	0.42
日本	株式	鹿島建設	建設業	16,000	1,580.00	25,280,000	1,648.00	26,368,000	0.42
日本	株式	三菱ケミカルホールディングス	化学	32,000	828.00	26,496,000	821.90	26,300,800	0.41
日本	株式	富士通	電気機器	3,500	7,594.00	26,579,000	7,509.00	26,281,500	0.41
日本	株式	日本通運	陸運業	4,000	6,390.00	25,560,000	6,570.00	26,280,000	0.41
日本	株式	ジェイテクト	機械	19,000	1,397.00	26,543,000	1,380.00	26,220,000	0.41
日本	株式	国際石油開発帝石	鉱業	24,000	1,134.00	27,216,000	1,083.00	25,992,000	0.41
日本	株式	ダイセル	化学	22,000	1,154.00	25,388,000	1,172.00	25,784,000	0.41
日本	株式	アステラス製薬	医薬品	15,000	1,709.40	25,641,000	1,718.50	25,777,500	0.41
日本	株式	塩野義製薬	医薬品	3,600	7,121.00	25,635,600	7,116.00	25,617,600	0.40
日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	2,400	10,570.00	25,368,000	10,660.00	25,584,000	0.40
日本	株式	花王	化学	3,000	8,667.70	26,003,100	8,424.00	25,272,000	0.40
日本	株式	ジェイ エフ イー ホールディングス	鉄鋼	13,000	1,941.00	25,233,000	1,941.50	25,239,500	0.40
日本	株式	積水ハウス	建設業	15,000	1,654.90	24,823,600	1,673.50	25,102,500	0.40
日本	株式	日立製作所	電気機器	7,500	3,477.90	26,084,250	3,335.00	25,012,500	0.39
日本	株式	東武鉄道	陸運業	8,000	3,125.00	25,000,000	3,110.00	24,880,000	0.39
日本	株式	エア・ウォーター	化学	14,000	1,835.00	25,690,000	1,776.00	24,864,000	0.39
日本	株式	クリエイトSDホールディングス	小売業	8,500	2,842.00	24,157,000	2,923.00	24,845,500	0.39
日本	株式	パーソルホールディングス	サービス業	13,000	1,920.30	24,963,900	1,908.00	24,804,000	0.39
日本	株式	豊田通商	卸売業	7,000	3,571.57	25,001,000	3,535.00	24,745,000	0.39
日本	株式	日本航空電子工業	電気機器	17,000	1,485.00	25,245,000	1,449.00	24,633,000	0.39
日本	株式	日野自動車	輸送用機器	24,000	1,038.07	24,913,800	1,023.00	24,552,000	0.39

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

b 全銘柄の種類 / 業種別投資比率

平成31年 2月28日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.33
	鉱業	0.82
	建設業	5.26
	食料品	3.69
	繊維製品	0.54
	パルプ・紙	0.60
	化学	9.48
	医薬品	2.69
	ゴム製品	0.65
	ガラス・土石製品	1.36
	鉄鋼	1.99
	非鉄金属	0.86
	金属製品	2.12
	機械	7.23
	電気機器	9.35
	輸送用機器	4.16
	精密機器	1.34
	その他製品	2.08
	陸運業	3.31
	海運業	0.20
	空運業	0.19
	倉庫・運輸関連業	0.49
	情報・通信業	4.14
	卸売業	5.51
	小売業	8.95
	不動産業	2.49
サービス業	7.39	
	小計	87.21
合計		87.21

（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

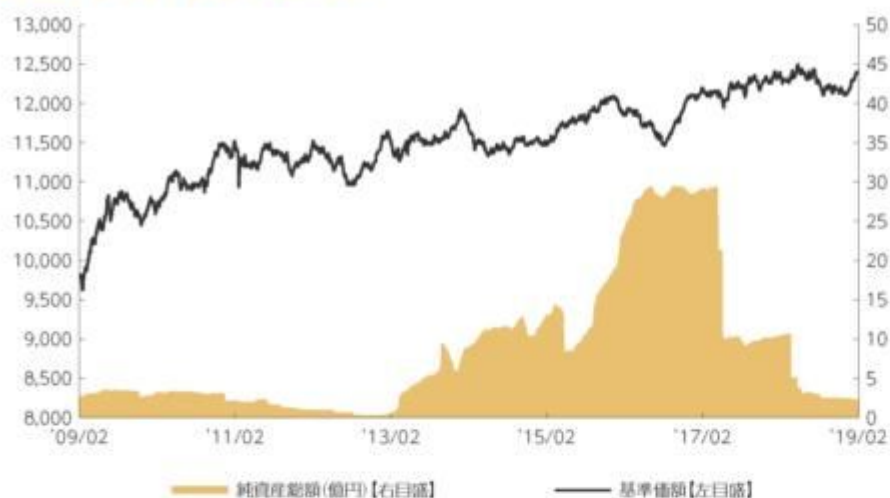


運用実績

2019年2月28日現在

■基準価額・純資産の推移

2009年2月27日～2019年2月28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	12,391円
純資産総額	2.2億円

■分配の推移

2019年 2月	0円
2018年 8月	0円
2018年 2月	0円
2017年 8月	0円
2017年 2月	0円
2016年 8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	組入上位銘柄	業種	比率
国内株式現物	87.0%	1 タムロン	精密機器	0.4%
国内株式信用売	-87.0%	2 田辺三菱製薬	医薬品	0.4%
		3 コーセー	化学	0.4%
		4 日本電産	電気機器	0.4%
		5 本田技研工業	輸送用機器	0.4%
		6 ソニー	電気機器	0.4%
		7 住友重機械工業	機械	0.4%
		8 日本空港ビルデング	不動産業	0.4%
		9 IHI	機械	0.4%
株式(実質)	-0.0%	10 鹿島建設	建設業	0.4%

●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

●2019年は年初から2月28日までの収益率を表示

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

第3【ファンドの経理状況】

1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。

なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。

2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期（平成30年8月25日から平成31年2月25日まで）の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)		
	第25期 [平成30年 8月24日現在]	第26期 [平成31年 2月25日現在]
資産の部		
流動資産		
コール・ローン	3,839,535	1,961,019
親投資信託受益証券	292,685,330	229,618,047
未収入金	-	527,467
流動資産合計	296,524,865	232,106,533
資産合計		
296,524,865		
負債の部		
流動負債		
未払解約金	-	494,106
未払受託者報酬	295,997	134,944
未払委託者報酬	2,811,898	1,281,839
未払利息	6	3
その他未払費用	7,632	3,437
流動負債合計	3,115,533	1,914,329
負債合計		
3,115,533		
純資産の部		
元本等		
元本	239,131,341	185,550,029
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	54,277,991	44,642,175
（分配準備積立金）	10,856,848	9,504,628
元本等合計	293,409,332	230,192,204
純資産合計		
293,409,332		
負債純資産合計		
296,524,865		

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)				
	第25期		第26期	
	自	平成30年	自	平成30年
	至	平成30年	至	平成31年
		8月24日		2月25日
営業収益				
受取利息		7		-
有価証券売買等損益		5,013,028		3,655,027

	第25期 自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8月24日	第26期 自 平成30年 8月25日 至 平成31年 2月25日
営業収益合計	5,013,021	3,655,027
営業費用		
支払利息	1,153	366
受託者報酬	295,997	134,944
委託者報酬	2,811,898	1,281,839
その他費用	7,632	3,450
営業費用合計	3,116,680	1,420,599
営業利益又は営業損失（ ）	8,129,701	2,234,428
経常利益又は経常損失（ ）	8,129,701	2,234,428
当期純利益又は当期純損失（ ）	8,129,701	2,234,428
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（ ）	4,361,167	187,709
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	201,188,511	54,277,991
剰余金増加額又は欠損金減少額	20,335,385	236,534
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	20,335,385	236,534
剰余金減少額又は欠損金増加額	163,477,371	12,294,487
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	163,477,371	12,294,487
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	54,277,991	44,642,175

(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、当計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年 8月25日から平成31年 2月25日までとなっております。

(貸借対照表に関する注記)

	第25期 [平成30年 8月24日現在]	第26期 [平成31年 2月25日現在]
1. 期首元本額	839,525,277円	239,131,341円
期中追加設定元本額	86,234,226円	1,079,377円
期中一部解約元本額	686,628,162円	54,660,689円
2. 受益権の総数	239,131,341口	185,550,029口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第25期 自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8月24日			第26期 自 平成30年 8月25日 至 平成31年 2月25日		
1. 分配金の計算過程			1. 分配金の計算過程		
項目			項目		
費用控除後の配当等収益額	A	1,580,680円	費用控除後の配当等収益額	A	1,013,576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	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	65,360,084円	収益調整金額	C	50,760,350円
分配準備積立金額	D	9,276,168円	分配準備積立金額	D	8,491,052円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	76,216,932円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	60,264,978円
当ファンドの期末残存口数	F	239,131,341口	当ファンドの期末残存口数	F	185,550,029口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,187円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,247円
1万口当たり分配金額	H	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	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25期 自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8月24日	第26期 自 平成30年 8月25日 至 平成31年 2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。	同左

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第25期 [平成30年 8月24日現在]	第26期 [平成31年 2月25日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありませぬ。	同左
2.時価の算定方法	(1)有価証券 売買目的有価証券は、(重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3)上記以外の金融商品 上記以外の金融商品(コールローン等)は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)上記以外の金融商品 同左
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つた場合、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25期 [平成30年 8月24日現在]	第26期 [平成31年 2月25日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	2,274,380	3,748,928
合計	2,274,380	3,748,928

(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25期 [平成30年 8月24日現在]	第26期 [平成31年 2月25日現在]
1口当たり純資産額	1.2270円	1.2406円
(1万口当たり純資産額)	(12,270円)	(12,406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	155,557,244	229,618,047	
合計		155,557,244	229,618,047	

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)

[平成31年 2月25日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	1,122,914,057
株式	5,423,857,200
信用取引預け金	5,233,724,801
未収配当金	10,081,720
流動資産合計	11,790,577,778
資産合計	11,790,577,778
負債の部	
流動負債	
信用売証券	5,404,470,600
未払解約金	26,028,125
未払利息	1,827
その他未払費用	12,966,607
流動負債合計	5,443,467,159
負債合計	5,443,467,159
純資産の部	
元本等	
元本	4,299,959,204
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,047,151,415
元本等合計	6,347,110,619
純資産合計	6,347,110,619
負債純資産合計	11,790,577,778

注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。 信用売証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として金融商品取引所等における終値で評価しております。
2. 収益及び費用の計上基準	その他費用として、信用売り株式の借入に係る費用を、予め借入先と合意した料率と計算方法に基づき、原則として、借入実行日（信用売り受渡日）の翌営業日から日々計上しております。 また、信用売り株式の借入先に支払うべき配当金相当額を、株式の配当落ち日に計上しております。

(貸借対照表に関する注記)

	[平成31年 2月25日現在]
1. 期首	平成30年 8月25日
期首元本額	2,839,011,986円
期中追加設定元本額	1,642,198,384円
期中一部解約元本額	181,251,166円

	[平成31年 2月25日現在]
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）	155,557,244円
ヘッジファンドセレクション（ラップ向け）	1,407,618,969円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	104,971,343円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	223,619,357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）	2,408,192,291円
合計	4,299,959,204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	3,027,543,300円
3. 受益権の総数	4,299,959,204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 平成30年 8月25日 至 平成31年 2月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、信用売証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成31年 2月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	（1）有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 （2）デリバティブ取引

区分	[平成31年 2月25日現在]
3.金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>デリバティブ取引は、該当事項はありません。</p> <p>(3) 上記以外の金融商品</p> <p>上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。</p> <p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。</p>

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

種類	[平成31年 2月25日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	41,849,675
信用売証券	153,634,213
合計	195,483,888

(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）

	[平成31年 2月25日現在]
1口当たり純資産額	1.4761円
(1万口当たり純資産額)	(14,761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	
1332	日本水産	29,000	716.00	20,764,000	代用有価証券 25,000株
1515	日鉄鉱業	3,100	4,775.00	14,802,500	代用有価証券 2,400株
1605	国際石油開発帝石	24,000	1,134.00	27,216,000	代用有価証券 24,000株
1662	石油資源開発	5,000	2,365.00	11,825,000	代用有価証券 5,000株
1417	ミライト・ホールディングス	12,000	1,679.00	20,148,000	代用有価証券 10,000株
1719	安藤・間	24,000	769.00	18,456,000	代用有価証券 18,300株
1762	高松コンストラクショングループ	3,500	2,676.00	9,366,000	代用有価証券 3,500株
1812	鹿島建設	16,000	1,580.00	25,280,000	代用有価証券 15,000株
1821	三井住友建設	25,000	712.00	17,800,000	代用有価証券 19,600株
1822	大豊建設	7,000	3,190.00	22,330,000	
1835	東鉄工業	5,000	2,982.00	14,910,000	代用有価証券 4,000株
1861	熊谷組	4,600	3,410.00	15,686,000	代用有価証券 2,000株
1871	ピーエス三菱	15,000	630.00	9,450,000	
1873	日本ハウスホールディングス	25,000	445.00	11,125,000	代用有価証券 25,000株
1882	東亜道路工業	4,400	3,115.00	13,706,000	代用有価証券 2,000株
1890	東洋建設	49,000	444.00	21,756,000	代用有価証券 37,000株
1898	世紀東急工業	25,000	629.00	15,725,000	代用有価証券 25,000株
1899	福田組	3,000	4,430.00	13,290,000	代用有価証券 2,000株
1928	積水ハウス	13,000	1,654.00	21,502,000	代用有価証券 13,000株
1941	中電工	7,000	2,313.00	16,191,000	代用有価証券 7,000株
1949	住友電設	9,000	1,864.00	16,776,000	代用有価証券 8,000株
1959	九電工	5,000	3,855.00	19,275,000	代用有価証券 3,700株
1967	ヤマト	6,000	473.00	2,838,000	代用有価証券 6,000株
6379	新興プランテック	9,000	1,252.00	11,268,000	

2109	三井製糖	6,000	2,857.00	17,142,000	代用有価証券 4,500株
2206	江崎グリコ	3,500	5,590.00	19,565,000	代用有価証券 3,000株
2212	山崎製パン	12,000	1,908.00	22,896,000	
2222	寿スビリッツ	5,000	4,430.00	22,150,000	代用有価証券 1,300株
2267	ヤクルト本社	3,000	7,450.00	22,350,000	代用有価証券 3,000株
2281	プリマハム	8,000	2,101.00	16,808,000	代用有価証券 8,000株
2501	サッポロホールディングス	6,000	2,478.00	14,868,000	代用有価証券 6,000株
2502	アサヒグループホールディングス	5,000	4,878.00	24,390,000	代用有価証券 5,000株
2531	宝ホールディングス	12,400	1,248.00	15,475,200	代用有価証券 12,400株
2607	不二製油グループ本社	5,000	3,805.00	19,025,000	代用有価証券 5,000株
2915	ケンコーマヨネーズ	9,000	2,278.00	20,502,000	代用有価証券 6,000株
2918	わらべや日洋ホールディングス	11,000	1,926.00	21,186,000	代用有価証券 7,000株
3106	倉敷紡績	5,000	2,250.00	11,250,000	代用有価証券 5,000株
8011	三陽商会	9,000	1,793.00	16,137,000	
3863	日本製紙	10,000	2,182.00	21,820,000	
3946	トーモク	9,400	1,686.00	15,848,400	代用有価証券 7,900株
3405	クラレ	16,000	1,525.00	24,400,000	
3407	旭化成	20,000	1,223.00	24,460,000	代用有価証券 20,000株
4008	住友精化	3,000	4,455.00	13,365,000	
4021	日産化学	4,000	5,820.00	23,280,000	代用有価証券 3,500株
4028	石原産業	17,000	1,192.00	20,264,000	代用有価証券 12,000株
4041	日本曹達	6,700	2,941.00	19,704,700	代用有価証券 5,200株
4045	東亜合成	16,000	1,255.00	20,080,000	
4047	関東電化工業	23,000	900.00	20,700,000	代用有価証券 17,000株
4063	信越化学工業	2,500	9,560.00	23,900,000	代用有価証券 2,400株
4064	日本カーバイド工業	9,000	1,524.00	13,716,000	代用有価証券 8,500株
4088	エア・ウォーター	14,000	1,835.00	25,690,000	
4092	日本化学工業	6,000	2,403.00	14,418,000	代用有価証券 6,000株
4116	大日精化工業	4,000	3,120.00	12,480,000	代用有価証券 4,000株

4118	カネカ	5,500	4,380.00	24,090,000	4,500株 代用有価証券
4187	大阪有機化学工業	10,000	1,235.00	12,350,000	10,000株 代用有価証券
4202	ダイセル	22,000	1,154.00	25,388,000	14,600株 代用有価証券
4218	ニチバン	5,000	2,232.00	11,160,000	5,000株 代用有価証券
4220	リケンテクノス	25,000	467.00	11,675,000	15,000株 代用有価証券
4231	タイガースポリマー	2,000	627.00	1,254,000	2,000株 代用有価証券
4249	森六ホールディングス	6,000	2,591.00	15,546,000	
4272	日本化薬	10,000	1,330.00	13,300,000	10,000株 代用有価証券
4401	A D E K A	11,000	1,715.00	18,865,000	7,900株 代用有価証券
4619	日本特殊塗料	8,000	1,366.00	10,928,000	8,000株 代用有価証券
4631	D I C	5,000	3,595.00	17,975,000	5,000株 代用有価証券
4917	マンダム	5,500	2,823.00	15,526,500	5,500株 代用有価証券
4922	コーセー	1,500	18,260.00	27,390,000	900株 代用有価証券
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	7,000	3,205.00	22,435,000	
4928	ノエビアホールディングス	3,000	5,340.00	16,020,000	3,000株 代用有価証券
4971	メック	11,000	1,166.00	12,826,000	
4975	J C U	9,000	1,819.00	16,371,000	9,000株 代用有価証券
4997	日本農薬	19,000	483.00	9,177,000	
5208	有沢製作所	22,000	837.00	18,414,000	14,100株 代用有価証券
6988	日東電工	4,000	5,981.00	23,924,000	
7995	バルカー	6,500	2,306.00	14,989,000	
4507	塩野義製薬	3,600	7,121.00	25,635,600	3,600株 代用有価証券
4508	田辺三菱製薬	15,000	1,540.00	23,100,000	15,000株 代用有価証券
4521	科研製薬	3,500	5,200.00	18,200,000	2,200株 代用有価証券
4528	小野薬品工業	10,000	2,284.50	22,845,000	
4540	ツムラ	4,500	3,465.00	15,592,500	4,500株 代用有価証券
4555	沢井製薬	3,300	6,070.00	20,031,000	2,800株 代用有価証券
4577	ダイト	3,000	2,774.00	8,322,000	
4587	ペプチドリーム	3,500	5,110.00	17,885,000	3,500株 代用有価証券
5110	住友ゴム工業	17,000	1,407.00	23,919,000	

5192	三ツ星ベルト	8,000	2,194.00	17,552,000	代用有価証券 7,000株
5301	東海カーボン	11,000	1,606.00	17,666,000	代用有価証券 7,300株
5302	日本カーボン	3,200	5,310.00	16,992,000	代用有価証券 1,900株
5310	東洋炭素	8,000	2,227.00	17,816,000	
5357	ヨータイ	8,000	615.00	4,920,000	
5393	ニチアス	9,000	2,109.00	18,981,000	代用有価証券 7,000株
5410	合同製鐵	11,000	1,723.00	18,953,000	代用有価証券 8,000株
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	13,000	1,941.00	25,233,000	代用有価証券 7,600株
5480	日本冶金工業	90,000	249.00	22,410,000	
5481	山陽特殊製鋼	4,000	2,539.00	10,156,000	代用有価証券 4,000株
5482	愛知製鋼	3,000	3,550.00	10,650,000	
5486	日立金属	21,000	1,128.00	23,688,000	
5711	三菱マテリアル	8,000	3,115.00	24,920,000	代用有価証券 6,200株
5802	住友電気工業	14,000	1,567.00	21,938,000	代用有価証券 10,500株
5852	アーレスティ	12,000	696.00	8,352,000	代用有価証券 12,000株
3445	R S Technologies	6,000	3,245.00	19,470,000	代用有価証券 6,000株
5901	東洋製罐グループホールディングス	9,000	2,339.00	21,051,000	代用有価証券 8,000株
5930	文化シャッター	20,000	837.00	16,740,000	代用有価証券 8,000株
5933	アルインコ	13,800	995.00	13,731,000	代用有価証券 7,000株
5938	L I X I Lグループ	15,000	1,530.00	22,950,000	代用有価証券 15,000株
5943	ノーリツ	12,000	1,655.00	19,860,000	代用有価証券 12,000株
5959	岡部	15,000	980.00	14,700,000	代用有価証券 15,000株
6013	タクマ	12,000	1,533.00	18,396,000	
6101	ツガミ	31,000	788.00	24,428,000	代用有価証券 17,000株
6118	アイダエンジニアリング	28,000	834.00	23,352,000	
6134	F U J I	11,000	1,594.00	17,534,000	
6240	ヤマシンフィルタ	27,000	729.00	19,683,000	代用有価証券 16,000株
6247	日阪製作所	24,000	900.00	21,600,000	代用有価証券 15,000株
6250	やまびこ	13,000	1,069.00	13,897,000	
6262	ベガサスミシン製造	16,000	679.00	10,864,000	代用有価証券 16,000株

6277	ホソカワミクロン	5,000	4,920.00	24,600,000	3,500株 代用有価証券
6302	住友重機械工業	7,000	3,920.00	27,440,000	
6315	TOWA	20,000	700.00	14,000,000	
6371	椿本チエイン	5,000	4,125.00	20,625,000	3,500株 代用有価証券
6390	加藤製作所	7,500	2,732.00	20,490,000	5,500株 代用有価証券
6406	フジテック	15,000	1,267.00	19,005,000	
6420	福島工業	5,000	3,920.00	19,600,000	
6432	竹内製作所	10,000	2,054.00	20,540,000	6,000株 代用有価証券
6458	新晃工業	13,000	1,585.00	20,605,000	
6460	セガサミーホールディングス	9,000	1,320.00	11,880,000	
6463	T P R	9,000	2,434.00	21,906,000	8,000株 代用有価証券
6472	N T N	58,000	359.00	20,822,000	40,000株 代用有価証券
6473	ジェイテクト	19,000	1,397.00	26,543,000	11,700株 代用有価証券
6490	日本ピラー工業	11,000	1,415.00	15,565,000	
6586	マキタ	6,000	4,015.00	24,090,000	4,000株 代用有価証券
7718	スター精密	14,000	1,729.00	24,206,000	
3105	日清紡ホールディングス	20,000	977.00	19,540,000	15,000株 代用有価証券
6503	三菱電機	17,000	1,433.00	24,361,000	
6504	富士電機	6,500	3,590.00	23,335,000	5,500株 代用有価証券
6516	山洋電気	4,500	4,190.00	18,855,000	
6592	マブチモーター	6,000	3,900.00	23,400,000	5,000株 代用有価証券
6594	日本電産	2,000	14,115.00	28,230,000	
6616	トレックス・セミコンダクター	10,600	1,169.00	12,391,400	9,600株 代用有価証券
6622	ダイヘン	7,000	2,742.00	19,194,000	7,000株 代用有価証券
6630	ヤーマン	14,000	1,443.00	20,202,000	9,000株 代用有価証券
6652	I D E C	7,500	2,128.00	15,960,000	
6702	富士通	3,500	7,594.00	26,579,000	3,500株 代用有価証券
6703	沖電気工業	12,800	1,304.00	16,691,200	9,000株 代用有価証券
6724	セイコーエプソン	14,500	1,675.00	24,287,500	7,000株 代用有価証券
6727	ワコム	30,000	471.00	14,130,000	
6728	アルバック	6,000	3,345.00	20,070,000	
6742	京三製作所	30,000	406.00	12,180,000	18,000株 代用有価証券

6750	エレコム	6,000	3,385.00	20,310,000	
6752	パナソニック	22,000	1,053.50	23,177,000	
6758	ソニー	5,000	5,377.00	26,885,000	
6763	帝国通信工業	5,000	1,211.00	6,055,000	代用有価証券 5,000株
6807	日本航空電子工業	17,000	1,485.00	25,245,000	代用有価証券 6,000株
6814	古野電気	18,000	975.00	17,550,000	代用有価証券 18,000株
6815	ユニデンホールディングス	6,000	2,304.00	13,824,000	代用有価証券 6,000株
6820	アイコム	4,000	2,246.00	8,984,000	代用有価証券 3,000株
6844	新電元工業	5,000	4,465.00	22,325,000	代用有価証券 5,000株
6877	O B A R A G R O U P	5,500	3,935.00	21,642,500	代用有価証券 5,500株
6915	千代田インテグレ	3,000	2,169.00	6,507,000	代用有価証券 3,000株
6958	日本シイエムケイ	30,000	685.00	20,550,000	代用有価証券 30,000株
6961	エンプラス	5,000	3,040.00	15,200,000	
6965	浜松ホトニクス	6,000	4,050.00	24,300,000	代用有価証券 6,000株
7280	ミツバ	27,000	721.00	19,467,000	
7735	S C R E E Nホールディングス	2,000	4,755.00	9,510,000	
3116	トヨタ紡織	11,000	1,858.00	20,438,000	代用有価証券 11,000株
5949	ユニプレス	6,000	2,028.00	12,168,000	
6995	東海理化電機製作所	9,000	2,048.00	18,432,000	
7205	日野自動車	23,000	1,038.00	23,874,000	代用有価証券 10,000株
7236	ティラド	6,000	2,389.00	14,334,000	代用有価証券 2,200株
7239	タチエス	12,000	1,703.00	20,436,000	
7259	アイシン精機	5,500	4,390.00	24,145,000	代用有価証券 2,500株
7267	本田技研工業	8,500	3,151.00	26,783,500	
7272	ヤマハ発動機	10,000	2,323.00	23,230,000	
7278	エクセディ	7,000	2,659.00	18,613,000	
7291	日本プラスト	15,000	847.00	12,705,000	
7294	ヨロズ	10,000	1,627.00	16,270,000	代用有価証券 10,000株
7296	エフ・シー・シー	8,500	2,667.00	22,669,500	
7313	テイ・エス テック	6,500	3,270.00	21,255,000	
7715	長野計器	13,000	805.00	10,465,000	
7729	東京精密	5,000	2,938.00	14,690,000	
7730	マニー	4,000	4,965.00	19,860,000	代用有価証券 3,000株

7740	タムロン	13,000	2,133.00	27,729,000	代用有価証券 10,000株
7745	エー・アンド・デイ	15,000	747.00	11,205,000	
7816	スノーピーク	12,000	1,407.00	16,884,000	
7820	ニホンフラッシュ	7,900	2,028.00	16,021,200	代用有価証券 4,500株
7846	パイロットコーポレーション	3,500	5,150.00	18,025,000	
7911	凸版印刷	13,000	1,779.00	23,127,000	
7914	共同印刷	3,800	2,460.00	9,348,000	代用有価証券 2,700株
7915	N I S S H A	16,000	1,324.00	21,184,000	
7972	イトーキ	13,000	561.00	7,293,000	代用有価証券 13,000株
9001	東武鉄道	8,000	3,125.00	25,000,000	代用有価証券 7,000株
9005	東京急行電鉄	13,000	1,889.00	24,557,000	
9020	東日本旅客鉄道	2,400	10,570.00	25,368,000	代用有価証券 2,100株
9024	西武ホールディングス	12,000	1,973.00	23,676,000	
9044	南海電気鉄道	6,000	2,967.00	17,802,000	代用有価証券 5,000株
9062	日本通運	4,000	6,390.00	25,560,000	
9068	丸全昭和運輸	5,000	2,903.00	14,515,000	代用有価証券 5,000株
9069	センコーグループホールディングス	21,000	932.00	19,572,000	代用有価証券 9,000株
9076	セイノーホールディングス	12,000	1,553.00	18,636,000	代用有価証券 12,000株
9110	N S ユナイテッド海運	5,000	2,566.00	12,830,000	
9201	日本航空	3,000	4,105.00	12,315,000	
9058	トランコム	2,000	6,890.00	13,780,000	代用有価証券 1,000株
9303	住友倉庫	12,000	1,432.00	17,184,000	代用有価証券 11,000株
3636	三菱総合研究所	4,500	3,280.00	14,760,000	代用有価証券 4,000株
3659	ネクソン	9,000	1,665.00	14,985,000	代用有価証券 9,000株
3756	豆蔵ホールディングス	13,000	1,039.00	13,507,000	代用有価証券 13,000株
3817	S R Aホールディングス	5,000	2,651.00	13,255,000	代用有価証券 5,000株
3844	コムチュア	7,500	3,105.00	23,287,500	代用有価証券 3,000株
3902	メディカル・データ・ビジョン	17,000	1,155.00	19,635,000	代用有価証券 13,000株
3978	マクロミル	12,000	1,379.00	16,548,000	
4312	サイバネットシステム	20,000	610.00	12,200,000	代用有価証券 20,000株
4344	ソースネクスト	22,000	503.00	11,066,000	代用有価証券 22,000株

4689	ヤフー	50,000	308.00	15,400,000	代用有価証券 50,000株
4709	インフォメーション・ディベロプメント	8,000	1,400.00	11,200,000	代用有価証券 8,000株
4743	アイティフォー	18,700	849.00	15,876,300	代用有価証券 12,000株
8096	兼松エレクトロニクス	7,000	3,340.00	23,380,000	代用有価証券 7,000株
9413	テレビ東京ホールディングス	3,500	2,507.00	8,774,500	
9433	K D D I	5,000	2,712.50	13,562,500	
9682	D T S	5,000	4,175.00	20,875,000	代用有価証券 4,000株
9790	福井コンピュータホールディングス	8,000	1,901.00	15,208,000	代用有価証券 8,000株
2729	J A L U X	5,000	2,510.00	12,550,000	代用有価証券 5,000株
2733	あらた	4,000	4,375.00	17,500,000	代用有価証券 2,800株
3107	ダイワボウホールディングス	2,000	6,490.00	12,980,000	
3156	U K C ホールディングス	11,000	2,052.00	22,572,000	代用有価証券 7,000株
3360	シップヘルスケアホールディングス	5,000	4,355.00	21,775,000	代用有価証券 4,000株
7459	メディパルホールディングス	8,500	2,609.00	22,176,500	代用有価証券 8,500株
7537	丸文	13,000	738.00	9,594,000	
7575	日本ライフライン	11,000	1,810.00	19,910,000	代用有価証券 3,000株
7594	マルカキカイ	8,000	2,165.00	17,320,000	
7599	I D O M	30,000	378.00	11,340,000	
7609	ダイトロン	4,000	1,774.00	7,096,000	
8015	豊田通商	6,000	3,575.00	21,450,000	
8036	日立ハイテクノロジーズ	6,500	4,275.00	27,787,500	代用有価証券 2,600株
8037	カメイ	7,000	1,239.00	8,673,000	代用有価証券 5,000株
8059	第一実業	4,600	3,500.00	16,100,000	
8075	神鋼商事	4,300	2,596.00	11,162,800	
8084	菱電商事	9,200	1,479.00	13,606,800	代用有価証券 4,500株
8095	イワキ	20,000	412.00	8,240,000	
8137	サンワテクノス	10,500	1,004.00	10,542,000	代用有価証券 8,000株
8159	立花エレテック	8,900	1,681.00	14,960,900	代用有価証券 4,000株
9934	因幡電機産業	3,600	4,580.00	16,488,000	代用有価証券 3,600株
9991	ジェコス	13,500	1,043.00	14,080,500	代用有価証券 13,500株
2651	ローソン	3,500	6,820.00	23,870,000	

2681	ゲオホールディングス	10,000	1,630.00	16,300,000	代用有価証券 10,000株
2726	パルグループホールディングス	6,000	3,190.00	19,140,000	
2764	ひらまつ	22,300	351.00	7,827,300	代用有価証券 22,300株
2792	ハニーズホールディングス	13,000	987.00	12,831,000	
3034	クオールホールディングス	10,000	1,455.00	14,550,000	
3046	ジンス	3,500	5,500.00	19,250,000	代用有価証券 2,000株
3050	D C Mホールディングス	13,000	1,114.00	14,482,000	
3053	ベッパーフードサービス	3,200	2,694.00	8,620,800	代用有価証券 2,000株
3085	アークランドサービスホールディングス	4,600	2,021.00	9,296,600	代用有価証券 4,600株
3086	J . フロント リテイリング	13,000	1,247.00	16,211,000	代用有価証券 13,000株
3091	ブロンコビリー	3,500	2,713.00	9,495,500	代用有価証券 2,300株
3097	物語コーポレーション	1,200	9,980.00	11,976,000	代用有価証券 600株
3148	クリエイトSDホールディングス	8,500	2,842.00	24,157,000	代用有価証券 5,500株
3193	鳥貴族	4,900	1,802.00	8,829,800	代用有価証券 2,000株
3194	キリン堂ホールディングス	10,500	1,584.00	16,632,000	代用有価証券 7,500株
3197	すかいらくホールディングス	5,600	1,704.00	9,542,400	代用有価証券 3,500株
3221	ヨシックス	4,200	3,090.00	12,978,000	代用有価証券 3,700株
3341	日本調剤	2,500	3,985.00	9,962,500	代用有価証券 2,500株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	9,000	1,281.00	11,529,000	代用有価証券 4,600株
3397	トリドールホールディングス	4,900	2,294.00	11,240,600	代用有価証券 3,000株
4350	メディカルシステムネットワーク	9,000	443.00	3,987,000	
7419	ノジマ	9,000	1,992.00	17,928,000	
7453	良品計画	900	26,830.00	24,147,000	代用有価証券 700株
7475	アルビス	5,000	2,368.00	11,840,000	代用有価証券 2,500株
7516	コーナン商事	6,000	2,842.00	17,052,000	代用有価証券 6,000株
7520	エコス	8,000	1,694.00	13,552,000	代用有価証券 4,500株
7593	V Tホールディングス	15,000	415.00	6,225,000	代用有価証券 15,000株
7618	ピーシーデポコーポレーション	29,000	449.00	13,021,000	
7630	壱番屋	2,600	4,790.00	12,454,000	

8227	しまむら	2,400	9,360.00	22,464,000	2,400株 代用有価証券
8233	高島屋	16,000	1,480.00	23,680,000	16,000株 代用有価証券
8242	エイチ・ツー・オー リテイリング	12,000	1,538.00	18,456,000	10,000株 代用有価証券
8255	アクシアル リテイリング	4,000	3,455.00	13,820,000	4,000株 代用有価証券
9842	アークランドサカモト	10,500	1,437.00	15,088,500	5,000株 代用有価証券
9948	アークス	9,000	2,542.00	22,878,000	6,000株 代用有価証券
9956	バローホールディングス	7,500	2,685.00	20,137,500	6,500株 代用有価証券
3228	三栄建築設計	6,000	1,676.00	10,056,000	6,000株 代用有価証券
3254	プレサンスコーポレーション	11,000	1,422.00	15,642,000	9,000株 代用有価証券
3258	ユニゾホールディングス	5,200	2,164.00	11,252,800	5,200株 代用有価証券
3284	フージャースホールディングス	15,700	683.00	10,723,100	12,000株 代用有価証券
3288	オープンハウス	5,000	4,005.00	20,025,000	2,000株 代用有価証券
8806	ダイビル	11,000	1,076.00	11,836,000	
8881	日神不動産	17,000	474.00	8,058,000	
8905	イオンモール	11,000	1,877.00	20,647,000	11,000株 代用有価証券
8934	サンフロンティア不動産	13,000	1,243.00	16,159,000	10,000株 代用有価証券
8935	エフ・ジェー・ネクスト	9,000	884.00	7,956,000	
9706	日本空港ビルデング	6,000	4,445.00	26,670,000	6,000株 代用有価証券
2124	ジェイエイシーリクルートメント	8,800	2,506.00	22,052,800	3,200株 代用有価証券
2154	トラスト・テック	5,500	3,605.00	19,827,500	3,400株 代用有価証券
2157	コシダカホールディングス	12,000	1,629.00	19,548,000	10,000株 代用有価証券
2174	G C A	21,000	921.00	19,341,000	14,000株 代用有価証券
2183	リニカル	9,800	1,720.00	16,856,000	9,800株 代用有価証券
2418	ツカダ・グローバルホールディング	10,900	610.00	6,649,000	10,900株 代用有価証券
2427	アウトソーシング	15,000	1,463.00	21,945,000	12,000株 代用有価証券
2433	博報堂D Yホールディングス	14,000	1,786.00	25,004,000	12,000株 代用有価証券
2453	ジャパンベストレスキューシステム	10,000	1,375.00	13,750,000	
2475	W D Bホールディングス	6,000	2,851.00	17,106,000	6,000株 代用有価証券

2492	インフォマート	18,000	1,280.00	23,040,000	代用有価証券 13,000株
4318	クイック	9,000	1,662.00	14,958,000	代用有価証券 9,000株
4324	電通	4,200	4,815.00	20,223,000	代用有価証券 4,200株
4345	シーティーエス	20,000	708.00	14,160,000	代用有価証券 15,000株
6080	M & Aキャピタルパートナーズ	4,000	5,300.00	21,200,000	
6089	ウィルグループ	14,000	1,340.00	18,760,000	代用有価証券 10,000株
6099	エラン	11,000	1,473.00	16,203,000	
6196	ストライク	6,000	2,165.00	12,990,000	
6200	インソース	7,000	2,414.00	16,898,000	代用有価証券 5,000株
6547	グリーンズ	10,500	1,440.00	15,120,000	代用有価証券 10,500株
8920	東祥	5,500	3,475.00	19,112,500	代用有価証券 5,500株
9678	カナモト	7,000	2,918.00	20,426,000	代用有価証券 7,000株
9699	西尾レントオール	4,000	3,450.00	13,800,000	代用有価証券 4,000株
9735	セコム	2,500	9,594.00	23,985,000	代用有価証券 2,500株
9743	丹青社	15,000	1,306.00	19,590,000	代用有価証券 12,000株
9755	応用地質	6,500	1,170.00	7,605,000	
	合計	3,341,700		5,423,857,200	

(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	
サカタのタネ	4,000	15,120,000	
ショーボンドホールディングス	2,200	17,380,000	
第一カッター興業	6,000	10,632,000	
東建コーポレーション	3,000	20,190,000	
ヤマウラ	13,000	12,844,000	
清水建設	27,000	25,893,000	
銭高組	2,300	12,489,000	

西松建設	7,000	17,906,000	
奥村組	5,600	19,376,000	
イチケン	3,000	5,880,000	
戸田建設	23,000	16,261,000	
北野建設	2,500	7,825,000	
大東建託	1,500	24,037,500	
日本道路	2,000	12,860,000	
五洋建設	30,000	16,470,000	
ライト工業	10,000	15,270,000	
ユアテック	18,000	15,984,000	
きんでん	11,000	19,668,000	
協和エクシオ	7,000	20,083,000	
新日本空調	2,500	4,715,000	
三機工業	10,000	11,840,000	
日揮	15,000	25,005,000	
高砂熱学工業	8,000	14,480,000	
東芝プラントシステム	8,600	17,802,000	
千代田化工建設	23,100	7,161,000	
フィード・ワン	38,000	6,840,000	
日新製糖	7,000	14,658,000	
名糖産業	5,500	7,628,500	
不二家	7,600	17,107,600	
亀田製菓	3,000	15,870,000	
丸大食品	6,000	11,490,000	
キリンホールディングス	9,000	22,648,500	
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールデ	7,000	21,000,000	
ダイドーグループホールディングス	3,000	16,620,000	
キーコーヒー	6,000	12,384,000	
J - オイルミルズ	2,500	10,062,500	
ハウス食品グループ本社	5,000	22,325,000	
カゴメ	6,000	17,406,000	
日清食品ホールディングス	3,000	23,160,000	
ゲンゼ	4,500	23,040,000	
東洋紡	9,000	14,094,000	
帝人	13,000	24,349,000	
アツギ	11,000	10,626,000	
セーレン	9,600	17,904,000	
T S Iホールディングス	25,000	17,625,000	
大王製紙	14,000	18,438,000	
クレハ	2,100	14,343,000	
トクヤマ	5,000	14,355,000	
デンカ	4,000	13,580,000	
日本パーカラライジング	9,000	13,095,000	

戸田工業	1,900	4,265,500	
保土谷化学工業	5,000	16,950,000	
三井化学	9,000	24,957,000	
東京応化工業	4,500	15,075,000	
住友ベークライト	4,500	19,552,500	
日立化成	12,000	24,324,000	
積水化成成品工業	14,000	13,426,000	
ダイキョーニシカワ	16,000	20,496,000	
日油	6,000	22,830,000	
第一工業製薬	6,000	18,480,000	
日本ペイントホールディングス	6,000	25,470,000	
関西ペイント	11,000	23,221,000	
中国塗料	16,000	16,048,000	
サカタインクス	15,000	18,060,000	
資生堂	3,300	24,192,300	
ファンケル	8,000	20,872,000	
エステー	6,000	11,742,000	
アグロ カネショウ	6,000	12,576,000	
クミアイ化学工業	20,000	14,320,000	
レック	8,000	13,264,000	
J S P	6,000	15,138,000	
エフピコ	3,000	20,250,000	
ニフコ	6,000	17,250,000	
ユニ・チャーム	7,000	25,242,000	
あすか製薬	16,000	20,112,000	
中外製薬	4,000	30,360,000	
エーザイ	2,800	25,236,400	
生化学工業	10,000	12,920,000	
栄研化学	6,600	17,061,000	
鳥居薬品	7,000	16,702,000	
東和薬品	2,500	21,950,000	
富士製薬工業	7,200	13,536,000	
ゼリア新薬工業	10,000	18,630,000	
第一三共	6,600	26,070,000	
出光興産	6,000	23,880,000	
J X T Gホールディングス	37,000	19,839,400	
横浜ゴム	10,500	23,971,500	
ブリヂストン	6,000	26,712,000	
オカモト	3,000	17,490,000	
住友理工	19,000	19,836,000	
日本電気硝子	9,000	27,585,000	
ノリタケカンパニーリミテド	3,500	19,355,000	
T O T O	5,500	23,705,000	

MARUWA	3,000	19,020,000	
東京製鐵	22,000	19,866,000	
大同特殊鋼	3,500	16,607,500	
新日本電工	50,000	11,800,000	
DOWAホールディングス	6,000	21,510,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	4,600	7,930,400	
古河電気工業	6,000	21,630,000	
リョービ	7,500	20,970,000	
アサヒホールディングス	6,000	13,158,000	
トーカロ	20,000	18,420,000	
川田テクノロジーズ	2,200	15,092,000	
長府製作所	7,000	15,568,000	
ジーテクト	8,000	13,616,000	
東プレ	5,000	12,075,000	
東京製綱	11,000	11,385,000	
パイオラックス	4,100	9,667,800	
日本発條	20,000	21,120,000	
オークマ	4,000	24,640,000	
東芝機械	10,000	23,010,000	
旭ダイヤモンド工業	20,000	16,480,000	
日進工具	7,000	17,276,000	
島精機製作所	5,000	19,425,000	
オプトラン	6,000	13,632,000	
ユニオンツール	2,000	6,190,000	
日精エー・エス・ピー機械	2,000	8,210,000	
小松製作所	9,000	25,659,000	
日立建機	9,000	26,262,000	
巴工業	7,800	18,275,400	
井関農機	8,500	13,957,000	
月島機械	8,500	11,823,500	
アイチ コーポレーション	10,000	7,120,000	
タダノ	15,000	17,715,000	
キトー	8,000	14,784,000	
アマノ	7,000	16,695,000	
ツバキ・ナカシマ	12,000	24,288,000	
キッツ	16,000	13,296,000	
IHI	8,000	23,960,000	
オリジン電気	6,000	13,860,000	
オムロン	4,000	19,760,000	
メルコホールディングス	6,300	24,570,000	
日本電気	6,200	23,374,000	
ルネサスエレクトロニクス	28,600	19,448,000	
アンリツ	9,000	19,863,000	

富士通ゼネラル	12,000	18,276,000	
タムラ製作所	28,000	16,772,000	
日本トリム	2,600	14,456,000	
ヨコオ	14,000	22,624,000	
ヒロセ電機	2,200	26,026,000	
スミダコーポレーション	13,000	19,344,000	
アズビル	7,000	17,297,000	
日本光電工業	5,300	17,675,500	
エスベック	8,500	17,756,500	
日置電機	5,000	22,075,000	
コーセル	18,500	22,052,000	
イリソ電子工業	5,100	25,551,000	
オブテックスグループ	7,000	14,329,000	
レーザーテック	5,900	24,308,000	
スタンレー電気	7,000	22,715,000	
ウシオ電機	16,000	20,800,000	
カシオ計算機	16,000	24,624,000	
ファナック	1,200	23,196,000	
太陽誘電	6,000	14,136,000	
村田製作所	1,000	17,920,000	
小糸製作所	3,500	23,415,000	
リコー	20,600	23,566,400	
モリタホールディングス	7,000	12,845,000	
名村造船所	33,500	14,003,000	
三菱ロジスネクスト	11,000	16,104,000	
近畿車輛	5,200	10,873,200	
三菱自動車工業	40,000	25,400,000	
武蔵精密工業	14,500	23,011,500	
日産車体	19,000	19,190,000	
新明和工業	13,100	18,130,400	
N O K	13,000	23,556,000	
フタバ産業	28,000	16,856,000	
太平洋工業	10,000	17,840,000	
ケーヒン	10,000	19,690,000	
ショーワ	14,000	22,358,000	
シマノ	1,300	22,841,000	
ジャムコ	4,000	10,140,000	
トプコン	12,000	18,492,000	
オリンパス	5,000	24,325,000	
H O Y A	4,000	27,552,000	
朝日インテック	4,200	23,604,000	
メニコン	6,000	17,412,000	
前田工織	7,900	22,041,000	

フランスベッドホールディングス	10,000	8,590,000	
フジシールインターナショナル	5,000	21,350,000	
図書印刷	10,000	9,610,000	
アシックス	16,000	23,440,000	
河合楽器製作所	5,000	16,700,000	
三菱鉛筆	8,000	17,944,000	
コクヨ	8,500	14,127,000	
オカムラ	10,300	13,544,500	
メタウォーター	6,000	18,720,000	
相鉄ホールディングス	4,000	13,360,000	
京浜急行電鉄	13,000	24,050,000	
小田急電鉄	9,000	23,139,000	
東海旅客鉄道	1,000	24,890,000	
ハマキョウレックス	4,000	18,280,000	
阪急阪神ホールディングス	6,000	24,450,000	
神戸電鉄	700	2,758,000	
トナミホールディングス	2,500	15,875,000	
福山通運	4,000	18,140,000	
日立物流	5,300	17,384,000	
S Gホールディングス	8,500	27,285,000	
A N Aホールディングス	3,000	12,390,000	
三菱倉庫	6,200	17,217,400	
キューソー流通システム	2,300	4,846,100	
コア	8,000	10,888,000	
T I S	4,000	21,120,000	
ファインデックス	13,000	10,166,000	
セック	3,300	12,721,500	
G M Oクラウド	2,900	10,019,500	
アドソル日進	7,000	12,418,000	
L I N E	3,000	12,180,000	
オービック	2,500	26,750,000	
ジャストシステム	6,000	16,926,000	
日本オラクル	2,800	23,212,000	
サイボウズ	15,300	9,654,300	
E Mシステムズ	15,000	19,095,000	
ネットワンシステムズ	11,000	28,666,000	
アルゴグラフィックス	3,000	14,775,000	
日本ユニシス	5,000	14,215,000	
テレビ朝日ホールディングス	7,000	14,238,000	
コネクシオ	9,000	13,014,000	
ソフトバンク	10,000	13,725,000	
ゼンリン	6,400	20,128,000	
シーイーシー	13,000	29,939,000	

J B C Cホールディングス	9,000	14,751,000	
ミロク情報サービス	5,500	16,049,000	
横浜冷凍	20,100	18,331,200	
あいホールディングス	7,500	14,610,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	15,000	23,565,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	10,000	10,950,000	
T O K A Iホールディングス	15,800	14,615,000	
ナガイレーベン	7,000	16,583,000	
松田産業	10,500	15,403,500	
アズワン	1,800	15,102,000	
スズデン	7,500	13,455,000	
小津産業	5,800	10,904,000	
日本エム・ディ・エム	10,000	11,080,000	
シークス	15,000	25,755,000	
住友商事	14,500	23,649,500	
三菱商事	8,000	25,600,000	
キャノンマーケティングジャパン	9,000	18,990,000	
正栄食品工業	4,000	12,480,000	
岩谷産業	4,000	14,560,000	
サンゲツ	8,900	18,609,900	
新光商事	7,000	13,265,000	
三信電気	8,000	14,752,000	
モスフードサービス	4,000	11,100,000	
P A L T A C	3,000	17,070,000	
トラスコ中山	6,200	19,375,000	
スズケン	4,000	23,720,000	
カワチ薬品	8,000	16,800,000	
アルペン	8,000	13,272,000	
ビックカメラ	12,000	15,228,000	
ドトール・日レスホールディングス	6,000	12,924,000	
ジョイフル本田	14,000	20,020,000	
綿半ホールディングス	5,300	12,402,000	
コスモス薬品	600	12,450,000	
薬王堂	4,900	12,813,500	
カップバ・クリエイト	8,900	12,664,700	
ライトオン	15,000	11,880,000	
ワタミ	9,600	15,974,400	
幸楽苑ホールディングス	6,600	15,602,400	
ユナイテッドアローズ	4,500	15,637,500	
スギホールディングス	2,600	12,454,000	
ヨンドシーホールディングス	10,000	21,720,000	
木曽路	5,000	12,965,000	
ケーヨー	31,500	17,230,500	

上新電機	6,000	13,740,000	
ロイヤルホールディングス	4,000	10,948,000	
いなげや	9,700	12,707,000	
チヨダ	7,900	15,183,800	
ライフコーポレーション	7,300	17,666,000	
青山商事	6,000	16,476,000	
近鉄百貨店	4,000	13,300,000	
イズミ	4,500	23,265,000	
ヤオコー	3,600	20,916,000	
ゼビオホールディングス	18,000	23,400,000	
アインホールディングス	2,000	14,600,000	
ヤマダ電機	38,500	20,751,500	
松屋フーズホールディングス	3,800	14,193,000	
サガミホールディングス	6,600	9,075,000	
ファーストリテイリング	400	20,580,000	
いちご	35,000	13,440,000	
ヒューリック	22,000	22,462,000	
スター・マイカ	5,300	7,250,400	
日本管理センター	17,000	13,260,000	
パーク24	9,200	24,573,200	
住友不動産	5,500	23,320,000	
テーオーシー	8,000	6,328,000	
スターツコーポレーション	5,000	12,205,000	
日本エスコン	15,800	12,229,200	
ファースト住建	12,000	14,880,000	
ランドビジネス	12,000	9,696,000	
日本工営	4,000	9,964,000	
エス・エム・エス	10,500	21,063,000	
ツクイ	17,700	12,832,500	
プレステージ・インターナショナル	15,000	20,010,000	
ケネディクス	21,000	11,424,000	
テイクアンドギヴ・ニーズ	7,000	12,285,000	
アルプス技研	10,000	19,950,000	
オリエンタルランド	2,300	28,002,500	
リゾートトラスト	8,000	12,616,000	
ユー・エス・エス	12,000	24,252,000	
サイバーエージェント	3,600	12,402,000	
楽天	22,000	18,392,000	
リクルートホールディングス	9,000	27,648,000	
ソラスト	14,500	17,023,000	
ナガワ	2,400	13,320,000	
トランス・コスモス	8,000	17,712,000	
藤田観光	3,000	7,917,000	

KNT-CTホールディングス	11,200	14,940,800	
セントラル警備保障	4,000	17,320,000	
船井総研ホールディングス	6,500	16,848,000	
ベネッセホールディングス	6,000	18,420,000	
イオンディライト	4,000	16,420,000	
合計	2,861,300	5,404,470,600	

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】

平成31年 2月28日現在

(単位:円)

資産総額	229,928,144
負債総額	1,146,703
純資産総額(-)	228,781,441
発行済口数	184,640,483口
1口当たり純資産価額(/)	1.2391
(10,000口当たり)	(12,391)

(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

平成31年 2月28日現在

(単位:円)

資産総額	12,439,481,424
負債総額	6,100,914,437
純資産総額(-)	6,338,566,987
発行済口数	4,299,182,819口
1口当たり純資産価額(/)	1.4744
(10,000口当たり)	(14,744)

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】

<更新後>

(1) 資本金の額等

2019年2月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

(2) 委託会社の機構

・会社の意思決定機構

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

・投資運用の意思決定機構

投資環境見通しの策定

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

運用戦略の決定

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

運用計画の決定

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

ポートフォリオの構築

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

投資行動のモニタリング1

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

投資行動のモニタリング2

運用部から独立した管理担当部署は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

ファンドに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。

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】

< 更新後 >

「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。

2019年2月28日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。（親投資信託を除きます。）

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	895	12,622,593
追加型公社債投資信託	16	1,162,998
単位型株式投資信託	54	269,122
単位型公社債投資信託	1	6,013
合計	966	14,060,726

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】

< 更新後 >

(1) 財務諸表及び中間財務諸表の作成方法について

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

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

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

(2) 監査証明について

当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第33期事業年度（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）の財務諸表について、有限責任監査法人トーマツによる監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第34期事業年度に係る中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）の中間財務諸表について、有限責任監査法人トーマツにより中間監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)		第33期 (平成30年3月31日現在)	
(資産の部)				
流動資産				
現金及び預金	2	69,212,680	2	54,140,307
有価証券		36,210		19,967
前払費用		337,699		362,886
未収入金		35,896		2,109
未収委託者報酬		10,076,022		9,770,529
未収収益	2	659,405	2	674,156
繰延税金資産		446,374		490,903
金銭の信託	2	30,000	2	30,000
その他		113,754		224,645
流動資産合計		80,948,042		65,715,506
固定資産				
有形固定資産				
建物	1	806,798	1	760,010
器具備品	1	759,446	1	724,852
土地		1,356,000		1,356,000
有形固定資産合計		2,922,245		2,840,863
無形固定資産				
電話加入権		15,822		15,822
ソフトウェア		1,844,549		2,654,296
ソフトウェア仮勘定		608,066		1,097,970
その他		10		
無形固定資産合計		2,468,448		3,768,090
投資その他の資産				
投資有価証券		24,327,081		26,361,327
関係会社株式		320,136		320,136
長期差入保証金		654,402		627,141
前払年金費用		463,105		434,700
繰延税金資産		711,230		747,085
その他		50,235		45,230
貸倒引当金		23,600		23,600
投資その他の資産合計		26,502,592		28,512,021
固定資産合計		31,893,286		35,120,975
資産合計		112,841,328		100,836,481

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)		第33期 (平成30年3月31日現在)	
--	------------------------	--	------------------------	--

(負債の部)**流動負債**

預り金		166,493		359,176
未払金				
未払収益分配金		108,024		174,333
未払償還金		547,707		456,159
未払手数料	2	4,225,009	2	3,905,670
その他未払金	2	2,355,815	2	4,330,584
未払費用	2	3,061,479	2	4,388,803
未払消費税等		351,670		99,010
未払法人税等		756,668		736,829
賞与引当金		843,729		906,167
役員賞与引当金		100,680		125,343
その他		711,633		842,194
流動負債合計		13,228,909		16,324,272
固定負債				
退職給付引当金		590,154		720,536
役員退職慰労引当金		166,458		187,562
時効後支払損引当金		253,070		254,851
固定負債合計		1,009,684		1,162,951
負債合計		14,238,594		17,487,223
(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		43,034,713		27,790,911
利益剰余金合計		50,375,303		35,131,500
株主資本合計		97,108,147		81,864,344

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30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	1,494,586	1,484,913
評価・換算差額等合計	1,494,586	1,484,913
純資産合計	98,602,734	83,349,257
負債純資産合計	112,841,328	100,836,481

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業収益				
委託者報酬		81,709,776		75,423,596
投資顧問料		2,396,020		2,723,458
その他営業収益		25,763		48,215
営業収益合計		84,131,560		78,195,269
営業費用				
支払手数料	2	33,975,255	2	30,906,879
広告宣伝費		731,771		730,784
公告費		482		1,000
調査費				
調査費		1,713,892		1,723,057
委託調査費		13,961,993		13,467,029
事務委託費		984,749		864,916
営業雑経費				
通信費		158,915		178,652
印刷費		699,940		467,973
協会費		51,995		50,251
諸会費		9,887		15,328
事務機器関連費		1,611,608		1,635,079
その他営業雑経費		11,925		23,250
営業費用合計		53,912,419		50,064,204
一般管理費				
給料				
役員報酬		331,997		349,359
給料・手当		6,496,165		6,421,837
賞与引当金繰入		843,729		906,167
役員賞与引当金繰入		100,680		125,343
福利厚生費		1,196,210		1,231,033
交際費		14,843		13,012
旅費交通費		233,159		192,192
租税公課		422,030		410,229
不動産賃借料		706,571		678,182
退職給付費用		441,736		423,171
役員退職慰労引当金繰入		48,393		47,889
固定資産減価償却費		1,030,040		1,115,719
諸経費		474,521		450,299
一般管理費合計		12,340,079		12,364,437
営業利益		17,879,061		15,766,627

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		第33期 (自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
営業外収益				
受取配当金		243,048		349,402
有価証券利息		0		
受取利息	2	4,601	2	483
投資有価証券償還益		260,190		81,580
収益分配金等時効完成分		278,148		91,672
その他		4,383		9,989
営業外収益合計		790,372		533,128
営業外費用				
投資有価証券償還損		11,552		30,114
時効後支払損引当金繰入				43,182
事務過誤費		218		10,402
その他		4,357		3,829
営業外費用合計		16,128		87,529
経常利益		18,653,304		16,212,226
特別利益				
投資有価証券売却益		259,137		516,394
ゴルフ会員権売却益				7,495
特別利益合計		259,137		523,889
特別損失				
投資有価証券売却損		42,248		105,903
デリバティブ解約損		126,228		
投資有価証券評価損		157,482		102,096
固定資産除却損	1	13,540	1	54
減損損失	3	48,575		
特別損失合計		388,075		208,054
税引前当期純利益		18,524,367		16,528,061
法人税、住民税及び事業税	2	5,658,953	2	5,252,224
法人税等調整額		103,169		76,092
法人税等合計		5,762,122		5,176,132
当期純利益		12,762,244		11,351,928

(3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

(単位：千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	資本剰余金		利益剰余金	
				その他利益剰余金	

		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	別途 積立金	繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	57,079,782	64,420,372	111,153,216
当期変動額									
剰余金の配当							26,807,312	26,807,312	26,807,312
当期純利益							12,762,244	12,762,244	12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)									
当期変動額合計							14,045,068	14,045,068	14,045,068
当期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	43,034,713	50,375,303	97,108,147

	評価・換算差額等			純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	繰延ヘッジ 損益	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,446,576	6,546	1,453,123	112,606,339
当期変動額				
剰余金の配当				26,807,312
当期純利益				12,762,244
株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	48,009	6,546	41,462	41,462
当期変動額合計	48,009	6,546	41,462	14,003,605
当期末残高	1,494,586		1,494,586	98,602,734

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等合計	
当期首残高	1,494,586	1,494,586	98,602,734
当期変動額			
剰余金の配当			26,595,731
当期純利益			11,351,928

株主資本以外の 項目の当期変動額 (純額)	9,673	9,673	9,673
当期変動額合計	9,673	9,673	15,253,476
当期末残高	1,484,913	1,484,913	83,349,257

[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

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

(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。

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。

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。

(未適用の会計基準等)

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

(1)概要

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

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

平成34年3月期の期首から適用します。

(3)当該会計基準等の適用による影響

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

(貸借対照表関係)

1.有形固定資産の減価償却累計額

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
建物	539,649千円	604,123千円
器具備品	1,029,950千円	1,215,234千円

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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
--	------------------------	------------------------

預金	47,798,472千円	41,809,118千円
未収収益	46,963千円	40,621千円
金銭の信託	30,000千円	30,000千円
未払手数料	1,993,055千円	1,577,059千円
その他未払金	2,071,256千円	3,850,734千円
未払費用	456,748千円	430,491千円

(損益計算書関係)

1. 固定資産除却損の内訳

	第32期	第33期
	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
建物	2,392千円	
器具備品	7,791千円	54千円
ソフトウェア	3,356千円	
計	13,540千円	54千円

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32期	第33期
	(自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	(自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
支払手数料	13,862,465千円	11,380,244千円
受取利息	4,375千円	380千円
法人税、住民税及び事業税	4,204,969千円	3,851,536千円

3. 減損損失

当社は、以下の資産グループについて減損損失を計上しました。

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

場所	用途	種類	減損損失
東京都千代田区（本社）	自社利用ソフトウェア （遊休資産）	ソフトウェア 仮勘定	48,575千円

当社は資産運用業の単一セグメントであるため、事業用資産に区別はなく、全社を1つのグルーピングとしております。遊休資産については個別資産ごとにグルーピングを行っております。

当事業年度において、将来の使用見込みがなくなった自社利用ソフトウェアについて、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、当該減少額を減損損失として特別損失に計上しました。

なお、回収可能価額として使用価値を用いておりますが、将来の使用見込みがないため、使用価値は零としております。

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

該当事項はありません。

(株主資本等変動計算書関係)

第32期（自平成28年4月1日 至平成29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28年6月28日開催の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

配当金の総額	26,807,312千円
1株当たり配当額	126,700円
基準日	平成28年3月31日
効力発生日	平成28年6月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

配当金の総額	26,595,731千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	125,700円
基準日	平成29年3月31日
効力発生日	平成29年6月29日

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

2. 配当に関する事項

(1) 配当金支払額

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

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

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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

配当金の総額	11,363,380千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	53,707円
基準日	平成30年3月31日
効力発生日	平成30年6月28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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
1年内	678,116千円	678,116千円
1年超	2,030,029千円	1,351,912千円
合計	2,708,145千円	2,030,029千円

（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32期(平成29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	69,212,680	69,212,680	-
(2) 有価証券	36,210	36,210	-
(3) 未収委託者報酬	10,076,022	10,076,022	-
(4) 投資有価証券	24,189,921	24,189,921	-
資産計	103,514,834	103,514,834	-
(1) 未払手数料	4,225,009	4,225,009	-
負債計	4,225,009	4,225,009	-

第33期(平成30年3月31日現在)

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

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
非上場株式	137,160	137,160
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、記載していません。

(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32期(平成29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	69,212,680	-	-	-
未収委託者報酬	10,076,022	-	-	-
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	36,210	10,703,761	8,324,138	45,606
合計	79,324,912	10,703,761	8,324,138	45,606

第33期(平成30年3月31日現在)

(単位:千円)

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

(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、記載していません。

2. その他有価証券

第32期(平成29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	17,778,798	15,302,336	2,476,461
	小計	17,778,798	15,302,336	2,476,461

貸借対照表計上額 が取得原価を超え ないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	6,447,333	6,769,569	322,236
	小計	6,447,333	6,769,569	322,236
合計		24,226,131	22,071,906	2,154,225

第33期(平成30年3月31日現在)

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

3.売却したその他有価証券

第32期(自平成28年4月1日至平成29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	122,688	82,146	21,570
債券	-	-	-
その他	3,439,009	176,991	20,678
合計	3,561,698	259,137	42,248

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

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

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157,482千円（その他有価証券のその他157,482千円）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102,096千円（その他有価証券のその他102,096千円）減損処理を行っております。

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せん。

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32期		第33期	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
退職給付債務の期首残高	2,997,931	千円	3,649,089	千円
勤務費用	199,166		184,120	
利息費用	22,711		27,829	
数理計算上の差異の発生額	40,934		56,895	
退職給付の支払額	183,403		188,683	
過去勤務費用の発生額	653,618		-	
退職給付債務の期末残高	3,649,089		3,729,252	

(2)年金資産の期首残高と期末残高の調整表

	第32期		第33期	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
年金資産の期首残高	2,678,827	千円	2,698,738	千円
期待運用収益	47,553		48,080	
数理計算上の差異の発生額	7,066		47,759	
事業主からの拠出額	107,823		102,564	
退職給付の支払額	142,532		173,748	
年金資産の期末残高	2,698,738		2,723,393	

(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32期		第33期	
	(平成29年3月31日現在)		(平成30年3月31日現在)	
積立型制度の退職給付債務	3,471,120	千円	3,374,562	千円
年金資産	2,698,738		2,723,393	
	772,381		651,168	
非積立型制度の退職給付債務	177,969		354,690	
未積立退職給付債務	950,350		1,005,858	
未認識数理計算上の差異	207,810		169,893	
未認識過去勤務費用	615,490		550,128	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	127,049		285,836	
退職給付引当金	590,154		720,536	
前払年金費用	463,105		434,700	
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	127,049		285,836	

(4)退職給付費用及びその内訳項目の金額

	第32期		第33期	
	(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)		(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)	
勤務費用	199,166	千円	184,120	千円
利息費用	22,711		27,829	
期待運用収益	47,553		48,080	
数理計算上の差異の費用処理額	54,327		47,053	

過去勤務費用の費用処理額	38,127	65,361
その他	28,533	4,780
確定給付制度に係る退職給付費用	295,314	281,066

(注)「その他」は受入出向者に係る出向元への退職給付費用負担額等です。

(5)年金資産に関する事項

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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
債券	62.9 %	62.2 %
株式	33.3	34.7
その他	3.7	3.1
合計	100	100

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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
割引率	0.061～0.90%	0.069～0.67%
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146,421千円、当事業年度142,105千円であります。

(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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
繰延税金資産		
減損損失	455,165千円	445,379千円
投資有価証券評価損	242,551	223,512
ゴルフ会員権評価損	295	-
未払事業税	124,367	135,805
賞与引当金	260,374	277,468
役員賞与引当金	11,509	12,235
役員退職慰労引当金	50,969	57,431
退職給付引当金	180,726	220,628
減価償却超過額	19,277	13,690
委託者報酬	217,902	257,879
長期差入保証金	14,803	23,262
時効後支払損引当金	77,490	78,035
連結納税適用による時価評価	236,450	200,331
その他	68,614	82,168
繰延税金資産 小計	1,960,499	2,027,829

評価性引当額	-	-
繰延税金資産 合計	1,960,499	2,027,829
繰延税金負債		
前払年金費用	141,802	133,105
連結納税適用による時価評価	1,447	1,382
その他有価証券評価差額金	659,638	655,348
その他	3	4
繰延税金負債 合計	802,893	789,840
繰延税金資産の純額	1,157,605	1,237,989

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32期（平成29年3月31日現在）及び第33期（平成30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32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日至平成30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32期（自平成28年4月1日至平成29年3月31日）及び第33期（自平成29年4月1日至平成30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32期（自平成28年4月1日至平成29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	科目	期末残高
親会社	(株)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 役員の兼任	連結納税に伴う支払	4,204,969 千円	その他未払金	2,071,256 千円
親会社	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,983,874 千円	未払手数料	716,117 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	662,992 千円	未払費用	352,297 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	7,878,591 千円	未払手数料	1,276,937 千円

第33期（自平成29年4月1日至平成30年3月31日）

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
親会社	(株)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	3,851,587 千円	その他未払金	3,850,734 千円
親	三菱UFJ信託銀行(株)	東京都千代田区	324,279 百万円	信託業、銀行業	被所有 直接 51.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,528,131 千円	未払手数料	665,262 千円

会社						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	664,152 千円	未払費用	348,142 千円
主要株主	(株)三菱東京UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	被所有 直接 15.0%	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	5,852,112 千円	未払手数料	921,796 千円

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

連結納税については、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。

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。

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。

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32期(自平成28年4月1日至平成29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	科目	期末残高
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJ モルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払	6,532,238 千円	未払手数料	933,908 千円

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

種類	会社等の名称	所在地	資本金	事業の内容	議決権等の所有(被所有)割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額	科目	期末残高
----	--------	-----	-----	-------	----------------	-----------	-------	------	----	------

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	6,263,571 千円	未払手数料	907,290 千円
-------------	--------------------------------	-----------------	---------------	-----	----	-----------------------------------------------	-------------------------------	-----------------	-------	---------------

(注) 取引条件及び取引条件の決定方針等

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。

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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
1株当たり純資産額	466,028.30円	393,935.45円
1株当たり当期純利益金額	60,318.47円	53,652.87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32期 (自平成28年4月1日 至平成29年3月31日)	第33期 (自平成29年4月1日 至平成30年3月31日)
当期純利益金額（千円）	12,762,244	11,351,928
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）	12,762,244	11,351,928
普通株式の期中平均株式数（株）	211,581	211,581

中間財務諸表

(1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第34期中間会計期間
(平成30年9月30日現在)

(資産の部)

流動資産

現金及び預金	46,097,117
有価証券	3,465,878

前払費用		508,670
未収入金		114,195
未収委託者報酬		10,467,520
未収収益		631,208
金銭の信託		30,000
その他		160,228
流動資産合計		61,474,819
固定資産		
有形固定資産		
建物	1	639,152
器具備品	1	656,022
土地		628,433
有形固定資産合計		1,923,608
無形固定資産		
電話加入権		15,822
ソフトウェア		2,634,028
ソフトウェア仮勘定		1,536,952
無形固定資産合計		4,186,802
投資その他の資産		
投資有価証券		21,198,707
関係会社株式		320,136
投資不動産	1	826,671
長期差入保証金		613,037
前払年金費用		424,967
繰延税金資産		1,265,831
その他		45,230
貸倒引当金		23,600
投資その他の資産合計		24,670,982
固定資産合計		30,781,393
資産合計		92,256,213

(単位：千円)

第34期中間会計期間
(平成30年9月30日現在)

(負債の部)

流動負債

預り金		224,194
未払金		
未払収益分配金		155,174
未払償還金		454,125
未払手数料		4,195,495
その他未払金		2,309,988
未払費用		3,556,319
未払消費税等	2	333,072
未払法人税等		723,164
賞与引当金		881,975

役員賞与引当金	70,050
その他	931,859
流動負債合計	13,835,420
固定負債	
長期未払金	43,200
退職給付引当金	787,034
役員退職慰労引当金	118,643
時効後支払損引当金	250,090
固定負債合計	1,198,968
負債合計	15,034,389
(純資産の部)	
株主資本	
資本金	2,000,131
資本剰余金	
資本準備金	3,572,096
その他資本剰余金	41,160,616
資本剰余金合計	44,732,712
利益剰余金	
利益準備金	342,589
その他利益剰余金	
別途積立金	6,998,000
繰越利益剰余金	21,681,136
利益剰余金合計	29,021,726
株主資本合計	75,754,570

(単位：千円)

第34期中間会計期間
(平成30年9月30日現在)

評価・換算差額等	
その他有価証券	1,467,253
評価差額金	
評価・換算差額等合計	1,467,253
純資産合計	77,221,823
負債純資産合計	92,256,213

(2) 中間損益計算書

(単位：千円)

第34期中間会計期間
(自平成30年4月1日
至平成30年9月30日)

営業収益	
委託者報酬	36,137,201
投資顧問料	1,348,173
その他営業収益	10,117
営業収益合計	37,495,493

営業費用		
支払手数料		14,727,452
広告宣伝費		341,268
公告費		250
調査費		
調査費		894,565
委託調査費		6,331,927
事務委託費		477,661
営業雑経費		
通信費		88,950
印刷費		221,937
協会費		24,807
諸会費		8,174
事務機器関連費		861,234
営業費用合計		23,978,229
一般管理費		
給料		
役員報酬		172,324
給料・手当		2,826,697
賞与引当金繰入		881,975
役員賞与引当金繰入		70,050
福利厚生費		614,206
交際費		6,039
旅費交通費		98,159
租税公課		208,364
不動産賃借料		330,556
退職給付費用		215,629
役員退職慰労引当金繰入		25,499
固定資産減価償却費	1	595,226
諸経費		232,738
一般管理費合計		6,277,466
営業利益		7,239,797

(単位：千円)

第34期中間会計期間

(自 平成30年4月1日

至 平成30年9月30日)

営業外収益		
受取配当金		135,921
受取利息		205
投資有価証券償還益		8,893
収益分配金等時効完成分		39,613
受取賃貸料		5,484
その他		10,239
営業外収益合計		200,357
営業外費用		
投資有価証券償還損		16,309
賃貸関連費用	1	25,983

その他	528
営業外費用合計	42,820
経常利益	7,397,334
特別利益	
投資有価証券売却益	420,066
特別利益合計	420,066
特別損失	
投資有価証券売却損	80,356
投資有価証券評価損	62,310
固定資産除却損	3,345
商標使用料	90,000
特別損失合計	236,012
税引前中間純利益	7,581,388
法人税、住民税及び事業税	2,347,830
法人税等調整額	20,048
法人税等合計	2,327,781
中間純利益	5,253,606

(3) 中間株主資本等変動計算書

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

(単位：千円)

	株主資本								株主資本合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		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
当中間期変動額									
剰余金の配当							11,363,380	11,363,380	11,363,380
中間純利益							5,253,606	5,253,606	5,253,606
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)									
当中間期変動額合計							6,109,774	6,109,774	6,109,774
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	21,681,136	29,021,726	75,754,570

	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
当中間期変動額			
剰余金の配当			11,363,380
中間純利益			5,253,606
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	17,659	17,659	17,659
当中間期変動額合計	17,659	17,659	6,127,434
当中間期末残高	1,467,253	1,467,253	77,221,823

[重要な会計方針]

1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式

移動平均法による原価法を採用しております。

(2) その他有価証券

時価のあるもの

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

時価のないもの

移動平均法による原価法を採用しております。

2. 固定資産の減価償却の方法

(1) 有形固定資産及び投資不動産

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

なお、主な耐用年数は以下のとおりであります。

建物 5年～50年

器具備品 2年～20年

投資不動産 3年～47年

(2) 無形固定資産

定額法を採用しております。

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

3. 引当金の計上基準

(1) 貸倒引当金

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

(2) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(3) 役員賞与引当金

役員賞与の支給に充てるため、支給見込額に基づき計上しております。

(4) 退職給付引当金

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

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。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

(5) 役員退職慰労引当金

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

(6) 時効後支払損引当金

時効成立のため利益計上した収益分配金及び償還金について、受益者からの今後の支払請求に

備えるため、過去の支払実績に基づく将来の支払見込額を計上しております。

4. 外貨建の資産及び負債の本邦通貨への換算基準

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

5. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項

(1) 消費税等の会計処理

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

(2) 連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

[表示方法の変更]

（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用）

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

[注記事項]

（中間貸借対照表関係）

1 減価償却累計額

	第34期中間会計期間 (平成30年9月30日現在)
建物	524,318千円
器具備品	1,274,989千円
投資不動産	133,640千円

2 消費税等の取扱い

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

（中間損益計算書関係）

1 減価償却実施額

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
有形固定資産	111,368千円
無形固定資産	483,858千円
投資不動産	724千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第34期中間会計期間（自平成30年4月1日至平成30年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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

合計	211,581	-	-	211,581
----	---------	---	---	---------

2. 配当に関する事項

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。

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

（リース取引関係）

第34期中間会計期間(平成30年9月30日現在)

借主側

オペレーティング・リース取引

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

1年内	677,036千円
1年超	1,013,934千円
合 計	1,690,971千円

（金融商品関係）

第34期中間会計期間(平成30年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

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

	中間貸借対照表 計上額（千円）	時価（千円）	差額（千円）
(1) 現金及び預金	46,097,117	46,097,117	-
(2) 有価証券	3,465,878	3,465,878	-
(3) 未収委託者報酬	10,467,520	10,467,520	-
(4) 投資有価証券	21,061,547	21,061,547	-
資産計	81,092,063	81,092,063	-
(1) 未払手数料	4,195,495	4,195,495	-
負債計	4,195,495	4,195,495	-

（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

これらの時価について、投資信託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

非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4) 投資有価証券」には含めておりません。

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

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

（有価証券関係）

第34期中間会計期間（平成30年9月30日現在）

1. 子会社株式及び関連会社株式

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

2. その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額（千円）	取得原価 （千円）	差額（千円）
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えるもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	17,134,450	14,614,710	2,519,740
	小計	17,134,450	14,614,710	2,519,740
中間貸借対照表計 上額が取得原価を 超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	7,392,975	7,797,908	404,933
	小計	7,392,975	7,797,908	404,933
合計		24,527,425	22,412,618	2,114,807

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額137,160千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

当社は、資産運用業の単一セグメントであるため、記載を省略しております。

[関連情報]

第34期中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

[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]

該当事項はありません。

[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]

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (平成30年9月30日現在)
1株当たり純資産額	364,975.22円
(算定上の基礎)	
純資産の部の合計額(千円)	77,221,823
普通株式に係る中間期末の純資産額(千円)	77,221,823
1株当たり純資産額の算定に用いられた 中間期末の普通株式の数(株)	211,581

1株当たり中間純利益金額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第34期中間会計期間 (自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)
1株当たり中間純利益金額	24,830.23円
(算定上の基礎)	
中間純利益金額(千円)	5,253,606
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	5,253,606
普通株式の期中平均株式数(株)	211,581

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

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】

<更新後>

(1) 受託会社

名称：三菱UFJ信託銀行株式会社

(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)

資本金の額：324,279百万円(2018年9月末現在)

事業の内容：銀行業務および信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額 (2018年9月末現在)	事業の内容
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279 百万円	銀行業務および信託業務を営んでいます。
三菱UFJモルガン・スタンレー証券株式会社	40,500 百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。

3【資本関係】

<訂正前>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(2018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。

<訂正後>

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(2019年2月末現在)

三菱UFJ信託銀行株式会社は委託会社の株式の100.0%(211,581株)を所有しています。

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

独立監査人の監査報告書

平成31年4月3日

三菱UFJ国際投信株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 大畑 茂 印

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 和田 渉 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）の平成30年8月25日から平成31年2月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）の平成31年2月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

三菱UFJ国際投信株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

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

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成30年6月27日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人 トーマツ

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	弥永 めぐみ	印
--------------------	-------	--------	---

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	青木 裕晃	印
--------------------	-------	-------	---

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

独立監査人の中間監査報告書

平成30年12月3日

三菱UFJ国際投信株式会社

取締役会 御中

有限責任監査法人トーマツ

指定有限責任社員
公認会計士 青木 裕 晃 印

業務執行社員

指定有限責任社員
公認会計士 伊藤 鉄 也 印

業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている三菱UFJ国際投信株式会社の平成30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間（平成30年4月1日から平成30年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

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

利害関係

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

以上

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