

**【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】	2021年5月21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 横川 直
【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】

2020年11月20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】

&lt; 訂正前 &gt;

## 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（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%

&lt; 訂正後 &gt;

## 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(2021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動向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】

### (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。

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

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2020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。

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

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2021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】

令和 3年 2月26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	416,376,091	99.75
コール・ローン、その他資産 (負債控除後)		1,038,645	0.25
純資産総額		417,414,736	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

令和 3年 2月26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	289,753,717	1.4344	415,622,732	1.4370	416,376,091	99.75

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

##### b 全銘柄の種類/業種別投資比率

令和 3年 2月26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令和3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
第30計算期間末日 (令和 3年 2月24日)	419,962,792	419,962,792	11,834	11,834
令和 2年 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
9月末日	714,094,553		12,276
10月末日	608,779,702		12,160
11月末日	537,921,365		12,123
12月末日	517,909,557		11,900
令和 3年 1月末日	522,682,359		11,814
2月末日	417,414,736		11,855

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
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
第30計算期間	0円

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
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
第30計算期間	4.99

（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
第30計算期間	20,007,012	264,491,005	354,873,626

（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 3年 2月26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	13,504,104,500	78.27
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		3,748,315,316	21.73
純資産総額		17,252,419,816	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 3年 2月26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	九州旅客鉄道	陸運業	60,000	2,671.00	160,260,000	2,772.00	166,320,000	0.96
日本	株式	出光興産	石油・石 炭製品	52,000	2,721.00	141,492,000	2,784.00	144,768,000	0.84
日本	株式	住友商事	卸売業	90,000	1,551.50	139,635,000	1,540.50	138,645,000	0.80
日本	株式	アイシン精機	輸送用機 器	38,000	3,705.00	140,790,000	3,625.00	137,750,000	0.80
日本	株式	リクルートホールディング ス	サービ ス業	26,000	5,497.00	142,922,000	5,281.00	137,306,000	0.80
日本	株式	小糸製作所	電気機器	18,500	7,290.00	134,865,000	7,100.00	131,350,000	0.76
日本	株式	東武鉄道	陸運業	43,000	3,100.00	133,300,000	3,030.00	130,290,000	0.76
日本	株式	京阪ホールディングス	陸運業	27,000	4,880.00	131,760,000	4,780.00	129,060,000	0.75
日本	株式	S M C	機械	2,000	64,490.00	128,980,000	62,900.00	125,800,000	0.73
日本	株式	名古屋鉄道	陸運業	46,000	2,770.00	127,420,000	2,704.00	124,384,000	0.72
日本	株式	大成建設	建設業	32,000	3,780.00	120,960,000	3,755.00	120,160,000	0.70
日本	株式	大和ハウス工業	建設業	40,000	3,128.00	125,120,000	3,003.00	120,120,000	0.70
日本	株式	東ソー	化学	60,000	1,986.00	119,160,000	1,950.00	117,000,000	0.68
日本	株式	ヒューリック	不動産業	95,000	1,228.00	116,660,000	1,188.00	112,860,000	0.65
日本	株式	三菱瓦斯化学	化学	45,000	2,525.00	113,625,000	2,479.00	111,555,000	0.65
日本	株式	三菱ケミカルホールディ ングス	化学	150,000	751.70	112,755,000	739.80	110,970,000	0.64
日本	株式	三井不動産	不動産業	46,000	2,501.00	115,046,000	2,400.00	110,400,000	0.64
日本	株式	エーザイ	医薬品	15,000	7,625.00	114,375,000	7,319.00	109,785,000	0.64
日本	株式	オービック	情報・通 信業	6,000	18,330.00	109,980,000	17,980.00	107,880,000	0.63
日本	株式	リンナイ	金属製品	10,000	10,790.00	107,900,000	10,780.00	107,800,000	0.62
日本	株式	A G C	ガラス・ 土石製品	27,000	3,985.00	107,595,000	3,900.00	105,300,000	0.61

日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	26,000	4,275.00	111,150,000	4,037.00	104,962,000	0.61
日本	株式	ヤマハ発動機	輸送用機器	45,000	2,435.00	109,575,000	2,319.00	104,355,000	0.60
日本	株式	アマダ	機械	80,000	1,287.00	102,960,000	1,291.00	103,280,000	0.60
日本	株式	キヤノン	電気機器	45,000	2,340.00	105,300,000	2,292.50	103,162,500	0.60
日本	株式	THK	機械	30,000	3,530.00	105,900,000	3,435.00	103,050,000	0.60
日本	株式	ペプチドリーム	医薬品	20,000	5,180.00	103,600,000	5,070.00	101,400,000	0.59
日本	株式	シマノ	輸送用機器	4,200	24,310.00	102,102,000	23,810.00	100,002,000	0.58
日本	株式	日野自動車	輸送用機器	100,000	1,021.00	102,100,000	1,000.00	100,000,000	0.58
日本	株式	セイコーエプソン	電気機器	57,000	1,749.00	99,693,000	1,744.00	99,408,000	0.58

(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 3年 2月26日現在

種類	業種	投資比率(%)
株式	水産・農林業	0.15
	鉱業	0.22
	建設業	4.50
	食料品	3.22
	繊維製品	0.63
	パルプ・紙	0.19
	化学	8.19
	医薬品	3.59
	石油・石炭製品	1.17
	ゴム製品	0.17
	ガラス・土石製品	1.91
	鉄鋼	1.83
	非鉄金属	0.58
	金属製品	1.11
	機械	7.70
	電気機器	6.87
	輸送用機器	4.80
	精密機器	2.02
	その他製品	2.86
	電気・ガス業	0.15
	陸運業	3.92
	倉庫・運輸関連業	0.13
	情報・通信業	4.17
卸売業	3.19	
小売業	7.00	
不動産業	1.46	
サービス業	6.54	

小計	78.27
合計	78.27

（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。

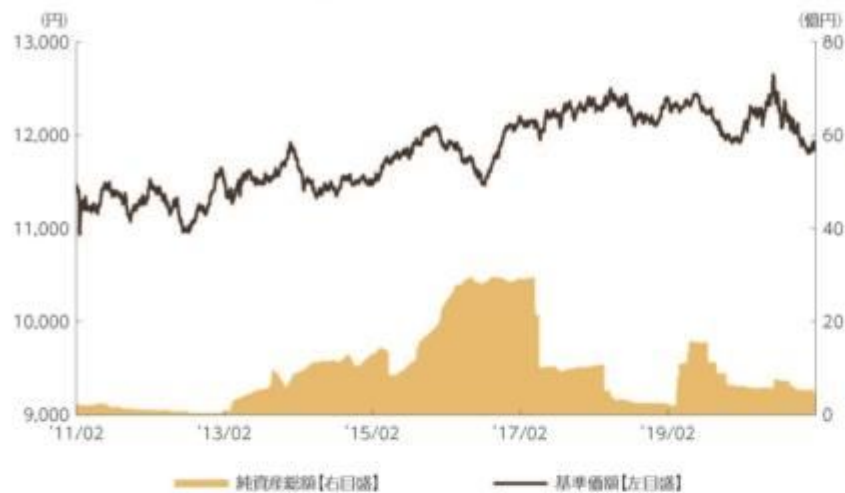
#### 参考情報



## 運用実績

2021年2月26日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2011年2月28日～2021年2月26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	11,855円
純資産総額	4.1億円

●純資産総額は表示桁未満切捨て

### ■分配の推移

2021年2月	0円
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
設定来累計	0円

●分配金は1万口当たり、税引前

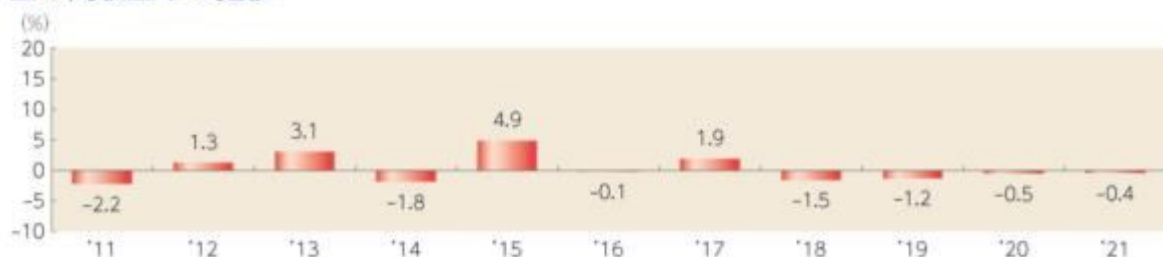
### ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位銘柄	業種	比率
国内株式現物	78.1%	1 九州旅客鉄道	陸運業	1.0%
国内株式信用売	-77.9%	2 出光興産	石油・石炭製品	0.8%
		3 住友商事	卸売業	0.8%
		4 アイシン精機	輸送用機器	0.8%
		5 リクルートホールディングス	サービス業	0.8%
		6 小糸製作所	電気機器	0.8%
		7 東武鉄道	陸運業	0.8%
		8 京阪ホールディングス	陸運業	0.7%
		9 SMC	機械	0.7%
株式(実質)	0.2%	10 名古屋鉄道	陸運業	0.7%

●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

●2021年は年初から2月26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（令和2年8月25日から令和3年2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29期 [ 令和 2年 8月24日現在 ]	第30期 [ 令和 3年 2月24日現在 ]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	4,988,797	4,709,515
親投資信託受益証券	744,961,735	418,894,359
未収入金	-	101,808,655
流動資産合計	749,950,532	525,412,529
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	-	101,981,083
未払受託者報酬	322,283	329,545
未払委託者報酬	3,061,644	3,130,608
未払利息	6	1
その他未払費用	8,323	8,500
流動負債合計	3,392,256	105,449,737
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	599,357,619	354,873,626
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	147,200,657	65,089,166
（分配準備積立金）	10,332,654	6,246,348
元本等合計	746,558,276	419,962,792
純資産合計	746,558,276	419,962,792
負債純資産合計	749,950,532	525,412,529

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)		
	第29期 自 令和 2年 2月26日 至 令和 2年 8月24日	第30期 自 令和 2年 8月25日 至 令和 3年 2月24日
<b>営業収益</b>		
受取利息	16	2
有価証券売買等損益	26,727,219	29,300,989

	第29期		第30期	
	自	令和 2年 2月26日 至 令和 2年 8月24日	自	令和 2年 8月25日 至 令和 3年 2月24日
営業収益合計		26,727,235		29,300,987
営業費用				
支払利息		572		286
受託者報酬		322,283		329,545
委託者報酬		3,061,644		3,130,608
その他費用		8,323		8,500
営業費用合計		3,392,822		3,468,939
営業利益又は営業損失（ ）		23,334,413		32,769,926
経常利益又は経常損失（ ）		23,334,413		32,769,926
当期純利益又は当期純損失（ ）		23,334,413		32,769,926
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（ ）		1,517,684		11,006,433
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		98,203,955		147,200,657
剰余金増加額又は欠損金減少額		40,387,464		4,035,162
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		40,387,464		4,035,162
剰余金減少額又は欠損金増加額		13,207,491		64,383,160
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		13,207,491		64,383,160
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		147,200,657		65,089,166

## ( 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。
--------------------	---

( 貸借対照表に関する注記 )

	第29期 [令和 2年 8月24日現在]	第30期 [令和 3年 2月24日現在]
1. 期首元本額	504,375,580円	599,357,619円
期中追加設定元本額	162,976,558円	20,007,012円
期中一部解約元本額	67,994,519円	264,491,005円
2. 受益権の総数	599,357,619口	354,873,626口

( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第29期 自 令和 2年 2月26日 至 令和 2年 8月24日			第30期 自 令和 2年 8月25日 至 令和 3年 2月24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	5,723,308円	費用控除後の配当等収益額	A	円

第29期 自 令和 2年 2月26日 至 令和 2年 8月24日			第30期 自 令和 2年 8月25日 至 令和 3年 2月24日		
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	194,571,722円	収益調整金額	C	115,471,301円
分配準備積立金額	D	4,609,346円	分配準備積立金額	D	6,246,348円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	204,904,376円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	121,717,649円
当ファンドの期末残存口数	F	599,357,619口	当ファンドの期末残存口数	F	354,873,626口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,418円	1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,429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29期 自 令和 2年 2月26日 至 令和 2年 8月24日	第30期 自 令和 2年 8月25日 至 令和 3年 2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	<p>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。</p> <p>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。</p>	同左

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	第29期 [ 令和 2年 8月24日現在 ]	第30期 [ 令和 3年 2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ぬ。
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29期 [ 令和 2年 8月24日現在 ]	第30期 [ 令和 3年 2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	25,166,022	19,454,285
合計	25,166,022	19,454,285

## （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29期 [ 令和 2年 8月24日現在 ]	第30期 [ 令和 3年 2月24日現在 ]
1口当たり純資産額	1.2456円	1.1834円
(1万口当たり純資産額)	(12,456円)	(11,834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	292,034,551	418,894,359	
合計		292,034,551	418,894,359	

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3年2月24日現在]

<b>資産の部</b>	
流動資産	
コール・ローン	4,503,719,609
株式	13,759,228,800
未収入金	1,252,739,326
信用取引預け金	12,580,528,311
未収配当金	22,326,200
流動資産合計	32,118,542,246
<b>資産合計</b>	<b>32,118,542,246</b>
<b>負債の部</b>	
流動負債	
信用売証券	13,760,076,800
未払金	1,060,698,664
未払解約金	102,466,655
未払利息	1,114
その他未払費用	34,230,484
流動負債合計	14,957,473,717
<b>負債合計</b>	<b>14,957,473,717</b>
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	11,963,677,212
剰余金	
剰余金又は欠損金( )	5,197,391,317
元本等合計	17,161,068,529
<b>純資産合計</b>	<b>17,161,068,529</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>32,118,542,246</b>

## 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3年2月24日現在]
1. 期首	令和2年8月25日
期首元本額	10,437,683,252円
期中追加設定元本額	1,778,578,901円
期中一部解約元本額	252,584,941円
元本の内訳	

	[令和 3年 2月24日現在]
日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）	292,034,551円
ヘッジファンドセレクション（ラップ向け）	2,559,690,363円
百戦錬磨の名人ファンド	30,451,773円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	128,706,592円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	269,814,842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）	3,424,780,651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）	5,258,198,440円
合計	11,963,677,212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	9,050,160,000円
3. 受益権の総数	11,963,677,212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 8月25日 至 令和 3年 2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 3年 2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

区分	[ 令和 3年 2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	<p>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。</p> <p>（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。</p> <p>（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。</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	[ 令和 3年 2月24日現在 ]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）
株式	698,917,630
信用売証券	1,054,049,203
合計	355,131,573

(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 3年 2月24日現在 ]
1口当たり純資産額	1.4344円
(1万口当たり純資産額)	(14,344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	
1377	サカタのタネ	7,000	3,780.00	26,460,000	
1662	石油資源開発	17,000	2,253.00	38,301,000	代用有価証券 15,000株
1716	第一カッター興業	14,000	1,323.00	18,522,000	
1719	安藤・間	40,000	776.00	31,040,000	代用有価証券 30,000株
1720	東急建設	50,000	540.00	27,000,000	代用有価証券 50,000株
1762	高松コンストラクショングループ	12,000	2,086.00	25,032,000	代用有価証券 12,000株
1766	東建コーポレーション	3,000	8,410.00	25,230,000	
1801	大成建設	32,000	3,780.00	120,960,000	代用有価証券 16,000株
1805	飛鳥建設	25,000	1,103.00	27,575,000	
1808	長谷工コーポレーション	25,000	1,360.00	34,000,000	代用有価証券 25,000株
1812	鹿島建設	70,000	1,376.00	96,320,000	代用有価証券 70,000株
1821	三井住友建設	60,000	457.00	27,420,000	代用有価証券 50,000株
1835	東鉄工業	8,000	2,631.00	21,048,000	代用有価証券 8,000株
1882	東亜道路工業	3,000	4,090.00	12,270,000	
1911	住友林業	14,000	2,013.00	28,182,000	代用有価証券 14,000株
1925	大和ハウス工業	40,000	3,128.00	125,120,000	代用有価証券 36,000株
1926	ライト工業	15,000	1,628.00	24,420,000	代用有価証券 15,000株
1929	日特建設	29,000	801.00	23,229,000	代用有価証券 26,000株
1942	関電工	25,000	880.00	22,000,000	

1944	きんでん	15,000	1,771.00	26,565,000	代用有価証券 15,000株
1949	住友電設	12,000	2,416.00	28,992,000	
1979	大気社	10,000	2,905.00	29,050,000	代用有価証券 10,000株
1982	日比谷総合設備	6,000	1,867.00	11,202,000	
2053	中部飼料	18,500	1,406.00	26,011,000	代用有価証券 18,500株
2109	三井製糖	13,000	1,902.00	24,726,000	代用有価証券 5,000株
2207	名糖産業	6,000	1,513.00	9,078,000	
2211	不二家	10,000	2,274.00	22,740,000	
2229	カルビー	28,000	2,892.00	80,976,000	
2270	雪印メグミルク	12,000	2,211.00	26,532,000	
2288	丸大食品	15,000	1,696.00	25,440,000	代用有価証券 15,000株
2292	S Foods	9,500	3,410.00	32,395,000	代用有価証券 9,500株
2503	キリンホールディングス	40,000	2,102.50	84,100,000	代用有価証券 40,000株
2593	伊藤園	15,000	6,130.00	91,950,000	代用有価証券 8,000株
2815	アリアケジャパン	4,000	6,760.00	27,040,000	
2875	東洋水産	20,000	4,585.00	91,700,000	
2915	ケンコーマヨネーズ	4,000	1,958.00	7,832,000	
4526	理研ビタミン	13,000	1,352.00	17,576,000	
3101	東洋紡	20,000	1,382.00	27,640,000	代用有価証券 20,000株
3612	ワールド	20,000	1,397.00	27,940,000	代用有価証券 20,000株
8111	ゴールドウイン	3,000	7,300.00	21,900,000	
8114	デザート	18,000	1,797.00	32,346,000	代用有価証券 15,000株
3941	レンゴー	26,000	868.00	22,568,000	
3950	ザ・パック	4,000	2,670.00	10,680,000	代用有価証券 7,000株
4004	昭和電工	14,000	2,607.00	36,498,000	代用有価証券 12,000株
4028	石原産業	40,000	807.00	32,280,000	代用有価証券 40,000株

4041	日本曹達	10,200	3,390.00	34,578,000	代用有価証券 10,200株
4042	東ソー	60,000	1,986.00	119,160,000	代用有価証券 60,000株
4043	トクヤマ	15,000	2,716.00	40,740,000	代用有価証券 15,000株
4044	セントラル硝子	15,000	2,246.00	33,690,000	代用有価証券 12,000株
4046	大阪ソーダ	12,000	2,558.00	30,696,000	代用有価証券 12,000株
4082	第一稀元素化学工業	35,000	1,001.00	35,035,000	代用有価証券 33,000株
4095	日本パーカラライジング	33,000	1,089.00	35,937,000	代用有価証券 20,000株
4099	四国化成工業	15,000	1,225.00	18,375,000	代用有価証券 15,000株
4182	三菱瓦斯化学	45,000	2,525.00	113,625,000	代用有価証券 38,900株
4185	J S R	28,000	3,160.00	88,480,000	
4188	三菱ケミカルホールディングス	150,000	751.70	112,755,000	
4189	K Hネオケム	13,000	2,466.00	32,058,000	
4206	アイカ工業	7,000	3,720.00	26,040,000	代用有価証券 7,000株
4208	宇部興産	20,000	2,194.00	43,880,000	代用有価証券 20,000株
4220	リケンテクノス	43,000	490.00	21,070,000	代用有価証券 40,000株
4228	積水化成成品工業	21,000	558.00	11,718,000	
4246	ダイキョーニシカワ	22,000	756.00	16,632,000	代用有価証券 22,000株
4401	A D E K A	18,000	1,826.00	32,868,000	代用有価証券 18,000株
4612	日本ペイントホールディングス	10,000	8,220.00	82,200,000	代用有価証券 8,000株
4631	D I C	12,000	2,748.00	32,976,000	代用有価証券 10,000株
4917	マンダム	19,000	1,896.00	36,024,000	代用有価証券 15,000株
4922	コーセー	5,500	18,350.00	100,925,000	代用有価証券 5,500株
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	40,000	2,471.00	98,840,000	代用有価証券 30,000株

4958	長谷川香料	13,000	1,881.00	24,453,000	代用有価証券 10,000株
4997	日本農薬	30,000	524.00	15,720,000	
6988	日東電工	9,000	9,130.00	82,170,000	
7970	信越ポリマー	20,900	988.00	20,649,200	
7995	バルカー	15,500	2,073.00	32,131,500	
4507	塩野義製薬	16,000	5,821.00	93,136,000	代用有価証券 13,000株
4516	日本新薬	11,000	7,660.00	84,260,000	代用有価証券 11,000株
4521	科研製薬	8,000	4,190.00	33,520,000	代用有価証券 6,000株
4523	エーザイ	15,000	7,625.00	114,375,000	
4528	小野薬品工業	25,000	3,020.00	75,500,000	
4536	参天製薬	30,000	1,530.00	45,900,000	代用有価証券 30,000株
4547	キッセイ薬品工業	12,000	2,230.00	26,760,000	代用有価証券 12,000株
4548	生化学工業	15,000	1,049.00	15,735,000	
4551	鳥居薬品	3,000	3,080.00	9,240,000	代用有価証券 3,000株
4555	沢井製薬	4,500	4,845.00	21,802,500	
4574	大幸薬品	17,000	1,298.00	22,066,000	代用有価証券 17,000株
4587	ペプチドリーム	20,000	5,180.00	103,600,000	代用有価証券 20,000株
5011	ニチレキ	16,000	1,513.00	24,208,000	代用有価証券 14,000株
5019	出光興産	52,000	2,721.00	141,492,000	代用有価証券 30,000株
5021	コスモエネルギーホールディングス	13,000	2,527.00	32,851,000	代用有価証券 13,000株
5186	ニッタ	13,000	2,350.00	30,550,000	代用有価証券 10,000株
5201	A G C	27,000	3,985.00	107,595,000	
5218	オハラ	18,000	2,010.00	36,180,000	代用有価証券 18,000株
5301	東海カーボン	14,000	1,513.00	21,182,000	
5302	日本カーボン	7,000	4,005.00	28,035,000	代用有価証券 7,000株

5331	ノリタケカンパニーリミテド	5,000	3,565.00	17,825,000	
5333	日本碍子	47,000	1,893.00	88,971,000	代用有価証券 47,000株
5351	品川リフラクトリーズ	5,000	2,697.00	13,485,000	
7943	ニチハ	7,000	3,085.00	21,595,000	代用有価証券 7,000株
5401	日本製鉄	55,000	1,566.50	86,157,500	
5411	ジェイ エフ イー ホールディングス	80,000	1,124.00	89,920,000	
5423	東京製鐵	40,000	703.00	28,120,000	代用有価証券 30,000株
5440	共英製鋼	20,000	1,464.00	29,280,000	代用有価証券 13,000株
5449	大阪製鐵	13,000	1,231.00	16,003,000	代用有価証券 13,000株
5481	山陽特殊製鋼	20,000	1,777.00	35,540,000	代用有価証券 20,000株
5482	愛知製鋼	11,000	3,190.00	35,090,000	代用有価証券 8,000株
5711	三菱マテリアル	18,000	2,540.00	45,720,000	代用有価証券 18,000株
5714	DOWAホールディングス	5,000	4,090.00	20,450,000	
5801	古河電気工業	12,000	2,872.00	34,464,000	代用有価証券 12,000株
3433	トーカロ	20,000	1,349.00	26,980,000	
5911	横河ブリッジホールディングス	15,000	1,923.00	28,845,000	
5947	リンナイ	10,000	10,790.00	107,900,000	
5976	高周波熱錬	20,000	531.00	10,620,000	
5988	パイオラックス	12,000	1,556.00	18,672,000	
6103	オークマ	6,000	5,910.00	35,460,000	代用有価証券 6,000株
6113	アマダ	80,000	1,287.00	102,960,000	代用有価証券 60,000株
6134	F U J I	27,000	2,562.00	69,174,000	代用有価証券 23,000株
6135	牧野フライス製作所	7,000	3,965.00	27,755,000	
6157	日進工具	10,000	2,704.00	27,040,000	代用有価証券 7,000株
6235	オプトラン	14,000	2,606.00	36,484,000	代用有価証券 11,000株

6240	ヤマシンフィルタ	28,000	848.00	23,744,000	代用有価証券 26,000株
6264	マルマエ	21,000	1,242.00	26,082,000	代用有価証券 18,000株
6269	三井海洋開発	16,000	1,780.00	28,480,000	代用有価証券 13,000株
6272	レオン自動機	16,000	1,110.00	17,760,000	代用有価証券 16,000株
6273	S M C	2,000	64,490.00	128,980,000	代用有価証券 1,500株
6284	日精エー・エス・ビー機械	5,000	5,440.00	27,200,000	代用有価証券 5,000株
6301	小松製作所	30,000	3,193.00	95,790,000	
6302	住友重機械工業	18,000	2,909.00	52,362,000	代用有価証券 18,000株
6332	月島機械	16,000	1,267.00	20,272,000	
6339	新東工業	29,000	745.00	21,605,000	
6371	椿本チエイン	10,000	2,958.00	29,580,000	
6381	アネスト岩田	26,000	1,050.00	27,300,000	代用有価証券 24,000株
6420	フクシマガリレイ	5,000	3,975.00	19,875,000	代用有価証券 5,000株
6432	竹内製作所	14,000	2,767.00	38,738,000	代用有価証券 14,000株
6436	アマノ	12,000	2,415.00	28,980,000	代用有価証券 12,000株
6458	新晃工業	17,000	1,909.00	32,453,000	代用有価証券 17,000株
6462	リケン	15,000	2,250.00	33,750,000	代用有価証券 10,000株
6463	T P R	20,000	1,476.00	29,520,000	代用有価証券 15,000株
6471	日本精工	90,000	1,038.00	93,420,000	代用有価証券 90,000株
6473	ジェイテクト	36,000	1,139.00	41,004,000	代用有価証券 30,000株
6481	T H K	30,000	3,530.00	105,900,000	代用有価証券 25,000株
6586	マキタ	21,000	4,605.00	96,705,000	代用有価証券 17,000株
7718	スター精密	20,000	1,602.00	32,040,000	代用有価証券 16,000株

6503	三菱電機	50,000	1,581.50	79,075,000	
6506	安川電機	18,000	5,450.00	98,100,000	
6630	ヤーマン	16,000	1,782.00	28,512,000	代用有価証券 16,000株
6644	大崎電気工業	30,000	600.00	18,000,000	代用有価証券 30,000株
6651	日東工業	12,000	2,030.00	24,360,000	代用有価証券 12,000株
6652	I D E C	16,000	1,841.00	29,456,000	代用有価証券 14,000株
6723	ルネサスエレクトロニクス	70,000	1,197.00	83,790,000	
6724	セイコーエプソン	57,000	1,749.00	99,693,000	
6744	能美防災	12,000	2,261.00	27,132,000	代用有価証券 12,000株
6750	エレコム	6,000	4,880.00	29,280,000	代用有価証券 5,000株
6768	タムラ製作所	40,000	543.00	21,720,000	
6770	アルプスアルパイン	21,000	1,443.00	30,303,000	代用有価証券 16,000株
6789	ローランド ディー . ジー .	10,000	1,853.00	18,530,000	
6804	ホシデン	35,000	1,067.00	37,345,000	代用有価証券 25,000株
6807	日本航空電子工業	20,000	1,723.00	34,460,000	代用有価証券 20,000株
6817	スマダコーポレーション	25,000	997.00	24,925,000	代用有価証券 12,000株
6844	新電元工業	12,000	3,070.00	36,840,000	代用有価証券 6,500株
6857	アドバンテスト	11,000	9,350.00	102,850,000	
6866	日置電機	4,000	3,660.00	14,640,000	代用有価証券 4,000株
6869	シスメックス	7,500	11,360.00	85,200,000	
6925	ウシオ電機	20,000	1,363.00	27,260,000	代用有価証券 20,000株
6958	日本シイエムケイ	63,000	427.00	26,901,000	
7276	小糸製作所	18,500	7,290.00	134,865,000	代用有価証券 12,800株
7751	キヤノン	45,000	2,340.00	105,300,000	代用有価証券 40,000株
3116	トヨタ紡織	10,000	1,686.00	16,860,000	

5949	ユニプレス	31,000	949.00	29,419,000	代用有価証券 31,000株
6584	三櫻工業	35,000	975.00	34,125,000	代用有価証券 35,000株
6995	東海理化電機製作所	10,000	1,786.00	17,860,000	代用有価証券 10,000株
7203	トヨタ自動車	7,500	7,891.00	59,182,500	
7205	日野自動車	100,000	1,021.00	102,100,000	
7220	武蔵精密工業	20,000	1,810.00	36,200,000	代用有価証券 20,000株
7222	日産車体	25,000	804.00	20,100,000	代用有価証券 25,000株
7231	トピー工業	17,000	1,425.00	24,225,000	代用有価証券 17,000株
7239	タチエス	20,000	1,067.00	21,340,000	
7246	プレス工業	85,000	327.00	27,795,000	代用有価証券 75,000株
7259	アイシン精機	38,000	3,705.00	140,790,000	代用有価証券 33,000株
7266	今仙電機製作所	25,000	752.00	18,800,000	
7270	S U B A R U	27,400	2,041.00	55,923,400	代用有価証券 25,100株
7272	ヤマハ発動機	45,000	2,435.00	109,575,000	
7296	エフ・シー・シー	19,000	1,741.00	33,079,000	代用有価証券 13,000株
7309	シマノ	4,200	24,310.00	102,102,000	代用有価証券 3,500株
7600	日本エム・ディ・エム	13,500	1,960.00	26,460,000	代用有価証券 13,500株
7701	島津製作所	22,000	4,050.00	89,100,000	
7717	ブイ・テクノロジー	5,000	5,590.00	27,950,000	代用有価証券 5,000株
7731	ニコン	40,000	909.00	36,360,000	代用有価証券 40,000株
7734	理研計器	8,000	2,680.00	21,440,000	
7745	エー・アンド・デイ	30,000	1,175.00	35,250,000	代用有価証券 30,000株
7747	朝日インテック	27,100	3,175.00	86,042,500	代用有価証券 19,100株
7762	シチズン時計	95,000	390.00	37,050,000	代用有価証券 95,000株



7832	バンダイナムコホールディングス	11,600	8,426.00	97,741,600	代用有価証券 11,600株
7846	パイロットコーポレーション	10,000	3,280.00	32,800,000	代用有価証券 8,000株
7915	N I S S H A	22,000	1,368.00	30,096,000	代用有価証券 22,000株
7921	T A K A R A & C O M P A N Y	12,000	1,730.00	20,760,000	代用有価証券 12,000株
7951	ヤマハ	13,000	5,860.00	76,180,000	代用有価証券 13,000株
7956	ビジョン	22,000	3,990.00	87,780,000	代用有価証券 17,000株
7974	任天堂	1,500	66,440.00	99,660,000	代用有価証券 1,500株
7984	コクヨ	20,000	1,470.00	29,400,000	
7990	グローブライド	7,000	4,030.00	28,210,000	代用有価証券 7,000株
9519	レノバ	8,000	3,155.00	25,240,000	代用有価証券 8,000株
9001	東武鉄道	43,000	3,100.00	133,300,000	代用有価証券 43,000株
9003	相鉄ホールディングス	10,000	2,488.00	24,880,000	代用有価証券 10,000株
9045	京阪ホールディングス	27,000	4,880.00	131,760,000	代用有価証券 22,000株
9048	名古屋鉄道	46,000	2,770.00	127,420,000	代用有価証券 37,000株
9068	丸全昭和運輸	4,000	3,115.00	12,460,000	
9072	ニッコンホールディングス	15,000	2,109.00	31,635,000	代用有価証券 12,000株
9076	セイノーホールディングス	20,000	1,484.00	29,680,000	代用有価証券 20,000株
9090	丸和運輸機関	15,000	2,002.00	30,030,000	
9142	九州旅客鉄道	60,000	2,671.00	160,260,000	代用有価証券 30,000株
9066	日新	17,000	1,376.00	23,392,000	
3371	ソフトクリエイトホールディングス	9,000	2,378.00	21,402,000	
3655	ブレインパッド	7,000	5,220.00	36,540,000	代用有価証券 7,000株
3697	S H I F T	2,700	13,540.00	36,558,000	代用有価証券 2,700株

3902	メディカル・データ・ビジョン	12,000	2,067.00	24,804,000	
3915	テラスカイ	9,000	3,765.00	33,885,000	代用有価証券 9,000株
3921	ネオジャパン	10,000	1,708.00	17,080,000	
3925	ダブルスタンダード	6,500	4,005.00	26,032,500	代用有価証券 6,500株
3937	Ubicomホールディングス	7,000	3,000.00	21,000,000	代用有価証券 7,000株
3962	チェンジ	8,000	3,225.00	25,800,000	
3984	ユーザーローカル	6,000	4,525.00	27,150,000	代用有価証券 6,000株
4344	ソースネクスト	70,000	351.00	24,570,000	
4348	インフォコム	9,000	2,687.00	24,183,000	代用有価証券 7,000株
4684	オービック	6,000	18,330.00	109,980,000	
4686	ジャストシステム	4,000	6,550.00	26,200,000	代用有価証券 3,000株
4743	アイティフォー	18,000	846.00	15,228,000	
8096	兼松エレクトロニクス	8,000	3,530.00	28,240,000	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	1,425.00	44,175,000	代用有価証券 15,000株
9602	東宝	11,000	4,175.00	45,925,000	代用有価証券 11,000株
9692	シーイーシー	18,000	1,425.00	25,650,000	代用有価証券 18,000株
9742	アイネス	20,000	1,356.00	27,120,000	代用有価証券 20,000株
9984	ソフトバンクグループ	9,000	9,982.00	89,838,000	
2768	双日	100,000	279.00	27,900,000	
3038	神戸物産	17,000	2,821.00	47,957,000	
3076	あいホールディングス	12,000	2,004.00	24,048,000	代用有価証券 10,000株
3176	三洋貿易	19,000	1,070.00	20,330,000	代用有価証券 27,000株
3543	コメダホールディングス	13,000	1,945.00	25,285,000	代用有価証券 13,000株
7467	萩原電気ホールディングス	1,700	2,551.00	4,336,700	
7483	ドウシシャ	13,000	1,802.00	23,426,000	代用有価証券 10,000株

7504	高速	10,000	1,514.00	15,140,000	
7575	日本ライフライン	21,000	1,269.00	26,649,000	代用有価証券 18,000株
7599	I D O M	45,000	629.00	28,305,000	代用有価証券 45,000株
7607	進和	10,000	2,113.00	21,130,000	代用有価証券 10,000株
8020	兼松	23,000	1,371.00	31,533,000	代用有価証券 18,000株
8043	スターゼン	4,500	4,260.00	19,170,000	
8053	住友商事	90,000	1,551.50	139,635,000	
8084	菱電商事	5,000	1,584.00	7,920,000	代用有価証券 10,000株
8129	東邦ホールディングス	11,000	1,923.00	21,153,000	
8154	加賀電子	13,000	2,332.00	30,316,000	代用有価証券 8,000株
9869	加藤産業	6,000	3,555.00	21,330,000	代用有価証券 5,000株
9902	日伝	10,000	2,159.00	21,590,000	
2659	サンエー	7,500	4,220.00	31,650,000	代用有価証券 6,500株
2670	エービーシー・マート	16,000	6,050.00	96,800,000	代用有価証券 14,000株
2685	アダストリア	15,000	2,090.00	31,350,000	代用有価証券 15,000株
2726	バルグループホールディングス	20,000	1,644.00	32,880,000	代用有価証券 20,000株
2730	エディオン	20,000	1,069.00	21,380,000	
3034	クオールホールディングス	18,000	1,416.00	25,488,000	代用有価証券 18,000株
3050	D C Mホールディングス	20,000	1,087.00	21,740,000	
3064	M o n o t a R O	16,000	6,210.00	99,360,000	代用有価証券 16,000株
3085	アークランドサービスホールディングス	13,600	2,129.00	28,954,400	代用有価証券 10,600株
3086	J . フロント リテイリング	22,000	1,059.00	23,298,000	
3091	ブロンコビリー	10,000	2,342.00	23,420,000	代用有価証券 8,000株
3097	物語コーポレーション	3,000	12,530.00	37,590,000	
3098	ココカラファイン	5,000	7,390.00	36,950,000	代用有価証券 5,000株

3182	オイシックス・ラ・大地	8,000	2,853.00	22,824,000	
3186	ネクステージ	14,000	1,738.00	24,332,000	代用有価証券 14,000株
3221	ヨシックス	7,500	2,232.00	16,740,000	代用有価証券 3,700株
3382	セブン&アイ・ホールディングス	26,000	4,275.00	111,150,000	
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	22,000	861.00	18,942,000	代用有価証券 22,000株
3391	ツルハホールディングス	6,500	13,970.00	90,805,000	代用有価証券 6,500株
3415	TOKYO BASE	50,000	716.00	35,800,000	代用有価証券 50,000株
3539	JMホールディングス	13,000	1,972.00	25,636,000	代用有価証券 9,000株
3548	パロックジャパンリミテッド	13,000	798.00	10,374,000	
3563	スシローグローバルホールディングス	12,000	4,075.00	48,900,000	代用有価証券 12,000株
7520	エコス	9,000	1,914.00	17,226,000	
7606	ユナイテッドアローズ	15,000	2,095.00	31,425,000	代用有価証券 15,000株
7611	ハイデイ日高	12,000	1,778.00	21,336,000	代用有価証券 9,000株
7618	ピーシーデポコーポレーション	35,000	516.00	18,060,000	代用有価証券 30,000株
7630	壱番屋	5,000	5,020.00	25,100,000	代用有価証券 4,000株
8005	スクロール	18,000	1,205.00	21,690,000	
8174	日本瓦斯	2,000	4,930.00	9,860,000	
8279	ヤオコー	4,000	6,580.00	26,320,000	代用有価証券 4,000株
9267	Genky DrugStores	7,500	3,435.00	25,762,500	代用有価証券 7,500株
9842	アークランドサカモト	21,000	1,563.00	32,823,000	代用有価証券 14,500株
9843	ニトリホールディングス	2,000	19,850.00	39,700,000	代用有価証券 2,000株
9974	ベルク	5,000	5,640.00	28,200,000	代用有価証券 5,000株
9997	ベルーナ	20,000	1,035.00	20,700,000	代用有価証券 20,000株

3003	ヒューリック	95,000	1,228.00	116,660,000	代用有価証券 95,000株
8801	三井不動産	46,000	2,501.00	115,046,000	代用有価証券 46,000株
8919	カチタス	10,000	2,900.00	29,000,000	代用有価証券 10,000株
2127	日本M&Aセンター	15,000	5,840.00	87,600,000	代用有価証券 15,000株
2146	UTグループ	10,000	3,280.00	32,800,000	代用有価証券 10,000株
2174	G C A	25,000	770.00	19,250,000	代用有価証券 25,000株
2181	パーソルホールディングス	30,000	2,194.00	65,820,000	
2305	スタジオアリス	5,000	2,104.00	10,520,000	
2374	セントケア・ホールディング	30,000	901.00	27,030,000	代用有価証券 25,000株
2413	エムスリー	8,000	8,354.00	66,832,000	代用有価証券 8,000株
2427	アウトソーシング	21,000	1,521.00	31,941,000	代用有価証券 17,000株
2475	W D Bホールディングス	5,000	2,578.00	12,890,000	
4282	E P Sホールディングス	20,000	1,160.00	23,200,000	
4318	クイック	6,000	1,135.00	6,810,000	
4324	電通グループ	18,000	3,710.00	66,780,000	代用有価証券 30,000株
4544	H . U . グループホールディングス	10,000	3,340.00	33,400,000	代用有価証券 10,000株
4665	ダスキン	7,000	2,803.00	19,621,000	
4732	ユー・エス・エス	41,000	2,057.00	84,337,000	
4848	フルキャストホールディングス	17,000	1,981.00	33,677,000	代用有価証券 17,000株
4849	エン・ジャパン	12,000	3,350.00	40,200,000	代用有価証券 12,000株
6035	アイ・アールジャパンホールディングス	1,500	13,200.00	19,800,000	代用有価証券 1,500株
6036	Keepers 技研	12,000	1,846.00	22,152,000	
6080	M & Aキャピタルパートナーズ	4,000	4,785.00	19,140,000	代用有価証券 4,000株
6082	ライドオンエクスプレスホールディングス	13,000	1,677.00	21,801,000	代用有価証券 13,000株

6088	シグマクシス	15,000	1,700.00	25,500,000	代用有価証券 15,000株
6095	メドピア	5,000	6,130.00	30,650,000	代用有価証券 5,000株
6098	リクルートホールディングス	26,000	5,497.00	142,922,000	代用有価証券 22,000株
6196	ストライク	6,000	4,515.00	27,090,000	代用有価証券 4,000株
6200	インソース	14,000	2,217.00	31,038,000	代用有価証券 14,000株
6532	バイカレント・コンサルティング	2,000	20,100.00	40,200,000	
6544	ジャパンエレベーターサービスホール ディン	13,000	2,099.00	27,287,000	
7034	プロレド・パートナーズ	7,500	3,500.00	26,250,000	代用有価証券 4,500株
9632	スバル興業	1,500	7,890.00	11,835,000	
9672	東京都競馬	6,000	4,895.00	29,370,000	代用有価証券 4,000株
合 計		6,553,900		13,759,228,800	

(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。

備考欄以外に下記の通り、約定未受渡にかかる有価証券を差入保証金代用有価証券として担保に差し入れております。

	銘 柄	株式数
1605	国際石油開発帝石	98,000
1861	熊谷組	9,000
2384	S B Sホールディングス	8,000
3405	クラレ	60,000
3694	オブティム	9,000
4581	大正製薬ホールディングス	10,000
4951	エステー	4,000
6141	D M G 森精機	13,000
6465	ホシザキ	10,000
6490	日本ピラー工業	10,000
6592	マブチモーター	7,000
6641	日新電機	21,000
7839	S H O E I	7,000
9065	山九	8,000
9787	イオンディライト	10,000

## (2) 株式以外の有価証券

該当事項はありません。

## 第2 信用取引契約残高明細表

（単位：円）

銘柄	信用取引		備考
	売建株数	評価額	
極洋	4,000	12,160,000	
タマホーム	15,000	27,660,000	
不動テトラ	15,000	27,180,000	
西松建設	15,000	39,060,000	
大豊建設	10,000	36,850,000	
浅沼組	6,500	29,672,500	
戸田建設	50,000	36,950,000	
ピーエス三菱	22,000	14,872,000	
N I P P O	10,000	27,590,000	
日本道路	2,500	20,050,000	
東亜建設工業	12,000	27,264,000	
東洋建設	60,000	32,400,000	
日本リーテック	5,500	13,277,000	
中電工	13,000	28,522,000	
日揮ホールディングス	25,000	34,275,000	
昭和産業	10,000	31,550,000	
フィード・ワン	12,000	10,740,000	
山崎製パン	65,000	121,485,000	
プリマハム	10,000	32,700,000	
サッポロホールディングス	14,000	31,962,000	
宝ホールディングス	15,000	22,725,000	
日清オイリオグループ	8,000	25,480,000	
不二製油グループ本社	10,000	31,200,000	
キッコーマン	19,000	139,270,000	
味の素	48,000	108,096,000	
キューピー	14,000	33,320,000	

ニチレイ	11,000	30,558,000	
日清食品ホールディングス	12,500	103,625,000	
日本たばこ産業	70,000	135,030,000	
ユニチカ	80,000	35,200,000	
富士紡ホールディングス	6,500	26,877,500	
オンワードホールディングス	105,000	29,400,000	
王子ホールディングス	200,000	138,400,000	
大王製紙	20,000	41,560,000	
クラレ	90,000	110,430,000	
旭化成	140,000	161,910,000	
クレハ	5,500	38,170,000	
多木化学	4,500	27,135,000	
関東電化工業	33,000	28,578,000	
デンカ	9,000	36,900,000	
堺化学工業	10,000	19,570,000	
エア・ウォーター	70,000	125,580,000	
日本化学工業	11,000	35,365,000	
戸田工業	7,000	15,421,000	
東京応化工業	5,000	31,300,000	
大阪有機化学工業	9,000	31,590,000	
日本ゼオン	18,000	29,700,000	
カーリットホールディングス	23,000	15,985,000	
扶桑化学工業	8,000	31,480,000	
日油	7,000	39,900,000	
花王	14,000	99,330,000	
三洋化成工業	5,500	27,940,000	
関西ペイント	46,000	132,618,000	
太陽ホールディングス	5,500	31,515,000	
ミルボン	2,500	15,325,000	
ファンケル	4,500	17,640,000	
ノエビアホールディングス	6,000	29,160,000	
アース製薬	3,000	18,300,000	
エフピコ	6,000	25,170,000	
武田薬品工業	35,000	126,175,000	
大日本住友製薬	80,000	137,680,000	
ツムラ	10,000	33,800,000	



ゼリア新薬工業	15,000	30,495,000	
キョーリン製薬ホールディングス	14,000	26,880,000	
大塚ホールディングス	28,000	123,760,000	
日本コークス工業	240,000	24,720,000	
横浜ゴム	20,000	37,420,000	
住友ゴム工業	20,000	23,740,000	
日本板硝子	50,000	27,100,000	
太平洋セメント	40,000	110,400,000	
TOTO	17,500	117,075,000	
黒崎播磨	6,000	28,320,000	
ヨータイ	14,000	14,182,000	
丸一鋼管	13,000	32,201,000	
日立金属	65,000	110,045,000	
大平洋金属	13,000	31,954,000	
新日本電工	110,000	31,350,000	
大紀アルミニウム工業所	37,000	29,045,000	
古河機械金属	24,000	32,016,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	40,000	32,360,000	
UACJ	13,000	31,668,000	
昭和電線ホールディングス	20,000	33,680,000	
ノーリツ	19,000	30,704,000	
エイチワン	27,000	20,439,000	
三浦工業	24,000	138,000,000	
タクマ	15,000	30,855,000	
芝浦機械	12,000	34,332,000	
アイダエンジニアリング	35,000	32,270,000	
島精機製作所	18,000	41,778,000	
ユニオンツール	4,000	13,840,000	
技研製作所	5,000	25,900,000	
日立建機	49,600	165,664,000	
井関農機	23,000	36,202,000	
ローツェ	4,000	29,840,000	
三菱化工機	10,500	29,914,500	
荏原製作所	8,000	32,240,000	
トーヨーカネツ	14,000	37,520,000	
タダノ	14,000	14,266,000	

C K D	30,000	70,320,000	
セガサミーホールディングス	50,000	91,250,000	
N T N	140,000	43,960,000	
不二越	8,000	37,320,000	
日本トムソン	70,000	38,220,000	
ユーシン精機	7,000	6,545,000	
イーグル工業	36,000	40,752,000	
日立造船	50,000	34,900,000	
三菱重工業	47,000	145,747,000	
日清紡ホールディングス	38,000	31,046,000	
イビデン	26,000	115,830,000	
コニカミノルタ	50,000	27,300,000	
明電舎	14,000	31,794,000	
山洋電気	5,000	29,150,000	
日本電産	9,000	124,605,000	
東光高岳	14,000	21,126,000	
ダイヘン	6,000	27,060,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	9,000	29,475,000	
メルコホールディングス	8,500	32,215,000	
日本電気	20,000	118,800,000	
富士通	7,000	106,470,000	
電気興業	11,500	33,005,000	
ワコム	35,000	27,405,000	
日本信号	20,000	18,880,000	
シャープ	88,200	175,606,200	
フォスター電機	21,000	27,069,000	
ヒロセ電機	8,000	129,360,000	
マクセルホールディングス	22,000	31,614,000	
古野電気	28,000	31,248,000	
横河電機	49,000	102,606,000	
アズビル	24,000	113,760,000	
キーエンス	2,000	106,280,000	
日本マイクロニクス	22,000	38,896,000	
メガチップス	11,000	36,410,000	
O B A R A G R O U P	8,000	30,440,000	
イリソ電子工業	6,500	32,467,500	

オブテックスグループ	10,000	16,690,000	
スタンレー電気	42,000	139,020,000	
古河電池	20,000	31,960,000	
大真空	13,000	33,683,000	
浜松ホトニクス	21,000	138,600,000	
三井ハイテック	9,000	39,510,000	
新光電気工業	13,000	37,869,000	
太陽誘電	6,000	33,060,000	
K O A	18,000	26,496,000	
市光工業	30,000	22,290,000	
S C R E E Nホールディングス	3,000	26,070,000	
リコー	190,500	181,737,000	
デンソー	21,000	134,988,000	
川崎重工業	22,000	52,162,000	
新明和工業	26,000	24,960,000	
曙ブレーキ工業	110,000	17,600,000	
K Y B	7,000	21,350,000	
太平洋工業	23,000	27,071,000	
マツダ	150,000	130,050,000	
ジャムコ	42,000	37,926,000	
長野計器	15,000	14,760,000	
マニー	11,000	28,457,000	
オリンパス	48,000	108,120,000	
H O Y A	10,000	124,150,000	
ニプロ	28,000	37,800,000	
スノーピーク	10,000	30,250,000	
トッパン・フォームズ	26,000	26,494,000	
大建工業	15,000	30,060,000	
共同印刷	4,000	12,000,000	
アシックス	15,000	27,405,000	
オカムラ	30,000	33,180,000	
西部瓦斯	3,500	9,936,500	
東急	110,000	163,130,000	
京成電鉄	35,000	134,575,000	
東日本旅客鉄道	19,000	146,034,000	
鴻池運輸	25,000	26,700,000	

西日本鉄道	10,000	30,150,000	
近鉄グループホールディングス	31,000	142,135,000	
センコーグループホールディングス	25,000	25,500,000	
川崎汽船	17,000	34,255,000	
三菱倉庫	10,000	34,500,000	
三井倉庫ホールディングス	16,000	36,384,000	
NEC ネットズエスアイ	13,000	23,530,000	
ネクソン	36,000	124,380,000	
ブロードリーフ	50,000	25,250,000	
ブイキューブ	11,000	28,270,000	
さくらインターネット	40,000	26,160,000	
GMOグローバルサイン・ホールディングス	2,200	17,138,000	
アドソル日進	10,000	26,760,000	
アイル	10,000	16,390,000	
マクロミル	40,000	36,040,000	
インテージホールディングス	23,000	26,335,000	
日本オラクル	11,000	124,190,000	
オービックビジネスコンサルタント	4,500	27,855,000	
大塚商会	25,000	125,000,000	
電通国際情報サービス	7,000	26,950,000	
EMシステムズ	26,000	21,892,000	
日本ユニシス	9,000	27,855,000	
都築電気	9,000	13,716,000	
テレビ朝日ホールディングス	17,000	35,598,000	
テレビ東京ホールディングス	5,500	13,348,500	
松竹	2,500	38,300,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	77,000	124,971,000	
ジャステック	13,000	15,964,000	
TKC	4,500	29,160,000	
富士ソフト	5,000	27,250,000	
NSD	13,000	24,752,000	
福井コンピュータホールディングス	8,000	27,760,000	
ミロク情報サービス	11,000	23,672,000	
横浜冷凍	36,000	32,292,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	30,000	23,580,000	
レスターホールディングス	15,000	30,705,000	

シップヘルスケアホールディングス	6,000	35,340,000	
ナガイレーベン	5,500	14,745,500	
三菱食品	9,000	26,136,000	
第一興商	7,000	30,275,000	
メディバルホールディングス	55,000	120,780,000	
アズワン	2,000	27,580,000	
伊藤忠商事	45,000	143,595,000	
長瀬産業	17,000	29,376,000	
三井物産	67,000	151,085,000	
キヤノンマーケティングジャパン	13,000	30,875,000	
阪和興業	14,000	38,892,000	
正栄食品工業	7,500	29,062,500	
岩谷産業	5,000	30,600,000	
三愛石油	27,000	28,242,000	
モスフードサービス	12,000	37,680,000	
三谷産業	35,000	14,805,000	
東テク	9,000	25,056,000	
アルペン	10,000	22,870,000	
ビックカメラ	28,000	33,124,000	
ドトール・日レスホールディングス	15,000	25,200,000	
三越伊勢丹ホールディングス	55,000	42,350,000	
クリエイトSDホールディングス	9,000	30,105,000	
日本調剤	8,000	12,768,000	
コスモス薬品	6,000	95,160,000	
アレンザホールディングス	21,000	28,350,000	
クスリのアオキホールディングス	4,000	33,960,000	
カップ・クリエイト	16,000	24,544,000	
ワタミ	20,000	20,880,000	
幸楽苑ホールディングス	13,600	24,221,600	
コロワイド	15,000	30,465,000	
スギホールディングス	4,500	33,885,000	
ヨンドシーホールディングス	9,500	18,867,000	
木曽路	12,000	29,544,000	
SRSホールディングス	14,000	12,264,000	
ケーヨー	35,000	26,075,000	
ロイヤルホールディングス	10,000	19,250,000	

いなげや	14,000	23,604,000	
チヨダ	20,000	19,800,000	
ライフコーポレーション	7,000	22,925,000	
MrMaxHD	37,000	27,639,000	
オークワ	19,000	22,154,000	
青山商事	40,000	31,560,000	
松屋	21,000	20,475,000	
丸井グループ	61,000	129,137,000	
イオン	35,000	123,480,000	
ケーズホールディングス	15,000	22,140,000	
ヤマダホールディングス	210,000	110,040,000	
関西スーパーマーケット	9,000	10,188,000	
プレナス	16,000	30,352,000	
セブン銀行	150,000	36,150,000	
野村不動産ホールディングス	40,000	98,520,000	
プレサンスコーポレーション	16,000	24,048,000	
フージャースホールディングス	20,000	13,700,000	
飯田グループホールディングス	50,000	121,050,000	
パーク24	15,000	34,350,000	
住友不動産	30,000	114,540,000	
タカラレーベン	60,000	21,180,000	
タケエイ	20,000	24,600,000	
コシダカホールディングス	55,000	31,405,000	
エス・エム・エス	7,000	24,640,000	
学情	10,000	14,170,000	
シミックホールディングス	16,000	26,416,000	
カカクコム	30,000	102,750,000	
ベネフィット・ワン	11,000	30,195,000	
ワールドホールディングス	15,000	37,035,000	
エスプール	20,000	20,560,000	
ぴあ	7,000	24,080,000	
ラウンドワン	38,000	44,042,000	
リゾートトラスト	20,000	36,380,000	
楽天	60,000	69,420,000	
クリーク・アンド・リバー社	18,000	23,022,000	
チャーム・ケア・コーポレーション	20,000	27,360,000	

バリューHR	14,000	26,474,000	
エラン	20,000	26,800,000	
ベルシステム24ホールディングス	20,000	36,920,000	
ソラスト	19,000	27,664,000	
MS - Japan	19,000	20,881,000	
キュービーネットホールディングス	13,000	22,737,000	
東祥	12,000	25,380,000	
エイチ・アイ・エス	12,000	30,612,000	
ラックランド	3,000	7,050,000	
共立メンテナンス	8,000	31,280,000	
建設技術研究所	10,000	23,590,000	
ナガワ	2,700	26,352,000	
KNT - CTホールディングス	12,000	14,424,000	
丹青社	39,000	32,838,000	
ベネッセホールディングス	9,000	19,494,000	
ダイセキ	9,000	30,600,000	
合計	7,695,300	13,760,076,800	

### 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3年2月26日現在

（単位：円）

資産総額	420,720,957
負債総額	3,306,221
純資産総額（ - ）	417,414,736
発行済口数	352,100,990口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.1855

(10,000口当たり)	(11,855)
--------------	----------

(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3年2月26日現在

(単位:円)

資産総額	30,774,505,533
負債総額	13,522,085,717
純資産総額( - )	17,252,419,816
発行済口数	12,006,062,790口
1口当たり純資産価額( / )	1.4370
(10,000口当たり)	(14,370)



## 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

2021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。

2021年 2月26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	877	16,102,922
追加型公社債投資信託	16	1,541,493
単位型株式投資信託	75	334,899
単位型公社債投資信託	38	176,313
合計	1,006	18,155,626

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。

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36期事業年度に係る中間会計期

間(自 令和2年4月1日 至 令和2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】

	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)	
(単位：千円)				
<b>(資産の部)</b>				
<b>流動資産</b>				
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
<b>固定資産</b>				
<b>有形固定資産</b>				
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
<b>無形固定資産</b>				
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
<b>投資その他の資産</b>				
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)	
<b>(負債の部)</b>				
<b>流動負債</b>				
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								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								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	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		純資産合計
	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,126,733	1,126,733	81,269,762
当期変動額			
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。

###### 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。

##### (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、統一した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。

配当金の総額	11,363,380千円
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

## (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。

配当金の総額	9,675,175千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
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。

配当金の総額	9,675,175千円
1株当たり配当額	45,728円
基準日	平成31年3月31日
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。

配当金の総額	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
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
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	株式	-	-	-
	債券	-	-	-
	その他	8,012,389	8,573,551	561,161
	小計	8,012,389	8,573,551	561,161
合計		22,756,935	21,132,932	1,624,002

## 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

## 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

## 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	(株)三菱UFJ銀行	東京都千代田区	1,711,958 百万円	銀行業	なし (注1)	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注2)	4,629,670 千円	未払手数料	734,633 千円
						取引銀行	コーラブル預金の預入 (注3)	20,000,000 千円	現金及び預金	20,000,000 千円
							コーラブル預金に係る受取利息 (注3)	1,578 千円	未収収益	1,578 千円
同一の親会社を持つ会社	三菱UFJモルガン・スタンレー証券(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注2)	6,152,016 千円	未払手数料	962,840 千円

## 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	(株)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	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
						取引銀行	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(株)	東京都千代田区	40,500 百万円	証券業	なし	当社投資信託の募集の取扱及び投資信託に係る事務代行の委託等	投資信託に係る事務代行手数料の支払 (注2)	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. (株)三菱UFJ銀行は、平成30年4月2日付で、保有する当社株式のすべてを(株)三菱UFJフィナンシャル・グループに対して現物配当しております。その結果、(株)三菱UFJ銀行は当社の主要株主から同一の親会社を持つ会社に該当することとなりました。
- なお、(株)三菱UFJフィナンシャル・グループは、同日付で、取得した当社株式のすべてを会社分割の方法により三菱UFJ信託銀行(株)に対して承継させております。
2. 投資信託に係る事務代行手数料については、商品毎に、過去の料率、市場実勢等を勘案して決定しております。

3. 預金利率の条件は、市場金利等を勘案して決定しております。なお、預入期間は1年であります。
4. 上記金額のうち、取引金額は消費税等を含まず、期末残高は消費税等を含んで表示しております。

## 2. 親会社に関する注記

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

三菱UFJ信託銀行株式会社(非上場)

## (1株当たり情報)

	第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

## 中間財務諸表

## (1) 中間貸借対照表

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (令和2年9月30日現在)	
(資産の部)	
流動資産	
現金及び預金	51,757,620
有価証券	47,281
前払費用	533,748
未収入金	22,328
未収委託者報酬	11,205,707
未収収益	1,109,882
金銭の信託	200,000
その他	216,914
流動資産合計	65,093,483
固定資産	
有形固定資産	
建物	1 561,961
器具備品	1 1,130,570
土地	628,433
有形固定資産合計	2,320,965
無形固定資産	
電話加入権	15,822
ソフトウェア	3,039,396

ソフトウェア仮勘定		2,003,918
無形固定資産合計		5,059,137
投資その他の資産		
投資有価証券		17,150,138
関係会社株式		320,136
投資不動産	1	817,921
長期差入保証金		552,888
前払年金費用		316,933
繰延税金資産		1,088,156
その他		45,230
貸倒引当金		23,600
投資その他の資産合計		20,267,805
固定資産合計		27,647,907
資産合計		92,741,391

(単位：千円)

第36期中間会計期間  
(令和2年9月30日現在)

## (負債の部)

## 流動負債

預り金		326,091
未払金		
未払収益分配金		158,732
未払償還金		133,877
未払手数料		4,401,647
その他未払金		2,173,325
未払費用		4,669,476
未払消費税等	2	507,145
未払法人税等		523,722
賞与引当金		895,400
役員賞与引当金		76,200
その他		699,988
流動負債合計		14,565,607

## 固定負債

長期未払金		21,600
退職給付引当金		1,075,559
役員退職慰労引当金		133,578
時効後支払損引当金		248,354
固定負債合計		1,479,092

## 負債合計

16,044,700

## (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		20,902,380
利益剰余金合計		28,242,970
株主資本合計		74,975,814

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (令和2年9月30日現在)	
評価・換算差額等	
その他有価証券評価差額金	1,720,876
評価・換算差額等合計	1,720,876
純資産合計	76,696,691
負債純資産合計	92,741,391

## (2)中間損益計算書

(単位：千円)

第36期中間会計期間 (自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	32,500,161
投資顧問料	1,178,818
その他営業収益	6,615
営業収益合計	33,685,595
営業費用	
支払手数料	12,792,753
広告宣伝費	275,488
公告費	250
調査費	
調査費	1,005,823
委託調査費	5,663,034
事務委託費	344,079
営業雑経費	
通信費	208,539
印刷費	182,427
協会費	26,229
諸会費	8,309
事務機器関連費	917,566
その他営業雑経費	126
営業費用合計	21,424,626
一般管理費	
給料	
役員報酬	171,181
給料・手当	2,786,316
賞与引当金繰入	895,400
役員賞与引当金繰入	76,200
福利厚生費	625,724
交際費	1,235
旅費交通費	10,767
租税公課	186,405
不動産賃借料	327,689
退職給付費用	229,835
役員退職慰労引当金繰入	11,763
固定資産減価償却費	1 643,956
諸経費	188,448
一般管理費合計	6,154,923
営業利益	6,106,045

(単位：千円)

第36期中間会計期間  
（自 令和2年4月1日  
至 令和2年9月30日）

営業外収益		
受取配当金		17,539
受取利息		2,089
投資有価証券償還益		24,505
収益分配金等時効完成分		275,165
受取賃貸料		32,904
その他		9,312
営業外収益合計		361,516
営業外費用		
投資有価証券償還損		37,772
時効後支払損引当金繰入		13,892
賃貸関連費用	1	6,562
その他		2,149
営業外費用合計		60,377
経常利益		6,407,184
特別利益		
投資有価証券売却益		157,075
特別利益合計		157,075
特別損失		
投資有価証券売却損		37,339
特別損失合計		37,339
税引前中間純利益		6,526,919
法人税、住民税及び事業税		1,948,492
法人税等調整額		65,981
法人税等合計		2,014,473
中間純利益		4,512,445

## (3) 中間株主資本等変動計算書

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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	25,847,605	33,188,194	79,921,039
当中間期変動額									
剰余金の配当							9,457,670	9,457,670	9,457,670
中間純利益							4,512,445	4,512,445	4,512,445
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）									
当中間期変動額合計							4,945,224	4,945,224	4,945,224
当中間期末残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	20,902,380	28,242,970	74,975,814

	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	1,815	1,815	79,922,854
当中間期変動額			

剰余金の配当			9,457,670
中間純利益			4,512,445
株主資本以外の 項目の当中間期 変動額（純額）	1,719,061	1,719,061	1,719,061
当中間期変動額合計	1,719,061	1,719,061	3,226,163
当中間期末残高	1,720,876	1,720,876	76,696,691

## [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。

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。

(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。

**[注記事項]**

（中間貸借対照表関係）

1 減価償却累計額

	第36期中間会計期間 (令和2年9月30日現在)
建物	621,629千円
器具備品	1,475,730千円
投資不動産	148,595千円

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36期中間会計期間 (自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日)
有形固定資産	83,458千円
無形固定資産	560,498千円
投資不動産	3,204千円

（中間株主資本等変動計算書関係）

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）

1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項

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



## 2. 配当に関する事項

令和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。

配当金の総額	9,457,670千円
配当の原資	利益剰余金
1株当たり配当額	44,700円
基準日	令和2年3月31日
効力発生日	令和2年6月29日

（リース取引関係）

第36期中間会計期間(令和2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	337,978千円
1年超	-
合計	337,978千円

（金融商品関係）

第36期中間会計期間(令和2年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

令和2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	51,757,620	51,757,620	-
(2) 有価証券	47,281	47,281	-
(3) 未収委託者報酬	11,205,707	11,205,707	-
(4) 投資有価証券	17,118,778	17,118,778	-
資産計	80,129,387	80,129,387	-
(1) 未払手数料	4,401,647	4,401,647	-
負債計	4,401,647	4,401,647	-

（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

非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められるため、「(4)投資有価証券」には含めておりません。

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

（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36期中間会計期間（令和2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	14,690,037	11,992,800	2,697,236
	小計	14,690,037	11,992,800	2,697,236
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	2,476,022	2,692,895	216,872
	小計	2,476,022	2,692,895	216,872
合計		17,166,060	14,685,695	2,480,364

（注）非上場株式（中間貸借対照表計上額31,360千円）については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難であると認められることから、上表の「その他有価証券」には含めておりません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

第36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2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36期中間会計期間（自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦以外に所在している有形固定資産がないため、該当事項はありません。

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の受益者の情報を制度上把握していないため、記載を省略しております。

（1株当たり情報）

1株当たり純資産額及び算定上の基礎は、以下のとおりであります。

	第36期中間会計期間 （令和2年9月30日現在）
1株当たり純資産額 （算定上の基礎）	362,493.28円
純資産の部の合計額（千円）	76,696,691
普通株式に係る中間期末の純資産額（千円）	76,696,691
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36期中間会計期間 (自 令和2年4月1日 至 令和2年9月30日)
1株当たり中間純利益金額 (算定上の基礎)	21,327.27円
中間純利益金額(千円)	4,512,445
普通株主に帰属しない金額(千円)	-
普通株式に係る中間純利益金額(千円)	4,512,445
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(2020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 (2020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。(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。

<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。(2021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

令和3年3月31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 公認会計士 鶴田 光夫 印  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 和田 渉 印  
業務執行社員

## 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8月25日から令和3年2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3年2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。

[次へ](#)

# 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 公認会計士 青 木 裕 晃 印  
行社員指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 伊 藤 鉄 也 印  
行社員

## 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。

# 独立監査人の中間監査報告書

令和2年11月30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 公認会計士 青 木 裕 晃 印  
行社員指定有限責任社  
員 業務執 公認会計士 伊 藤 鉄 也 印  
行社員

## 中間監査意見

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令和2年4月1日から令和3年3月31日までの第36期事業年度の中間会計期間（令和2年4月1日から令和2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。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、三菱UFJ国際投信株式会社の令和2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（令和2年4月1日から令和2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。

## 中間監査意見の根拠

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。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間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、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。

中間財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき中間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中間財務諸表の作成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。



## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。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、中間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中間監査の基準に従って、中間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中間財務諸表の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する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- ・ 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中間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、継続企業的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。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間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中間財務諸表の注記事項が適切でない場合は、中間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、中間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。
- ・ 中間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中間財務諸表の作成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中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を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、計画した中間監査の範囲とその実施時期、中間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中間監査上の重要な発見事項、及び中間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。