

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長殿
【提出日】	2018年11月22日提出
【計算期間】	第25期(自 2018年2月27日至 2018年8月24日)
【ファンド名】	日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）
【発行者名】	三菱UFJ国際投信株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 松田 通
【本店の所在の場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【事務連絡者氏名】	伊藤 晃
【連絡場所】	東京都千代田区有楽町一丁目12番1号
【電話番号】	03-6250-4740
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【ファンド情報】

## 第1【ファンドの状況】

## 1【ファンドの性格】

## (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

当ファンドは、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。  
信託金の限度額は、300億円です。

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

当ファンドは、一般社団法人投資信託協会が定める商品の分類方法において、以下の商品分類および属性区分に該当します。

商品分類表

単位型・追加型	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	独立区分	補足分類
単位型	国内	株式	MMF	インデックス型
	海外	債券 不動産投信	MRF	
追加型	内外	その他資産 ( ) 資産複合	ETF	特殊型 (絶対収益追求型)

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。商品分類および属性区分の内容については、一般社団法人投資信託協会のホームページ (<http://www.toushin.or.jp/>) でご覧いただけます。

ファミリーファンド、ファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資収益の源泉となる資産に投資しますので商品分類表と属性区分表の投資対象資産は異なります。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載していません。

### 商品分類の定義

単位型・追加型	単位型	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。
	追加型	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会が定める「MMF等の運営に関する規則」に規定するMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号および第2号に規定する証券投資信託ならびに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨またはそれに準じる記載があるものをいいます。
	特殊型	信託約款において、投資家（受益者）に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

### 属性区分の定義

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

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

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

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

#### [ ファンドの目的・特色 ]

## ファンドの目的

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

## ファンドの特色

特色 1

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

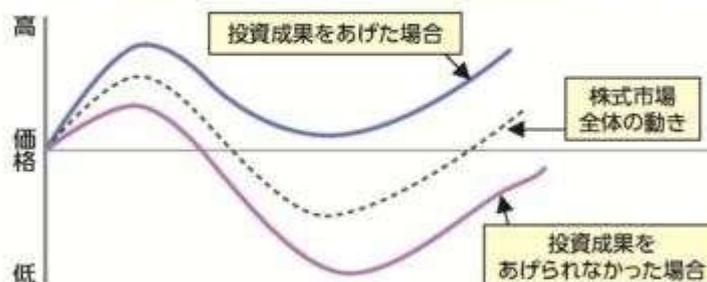
- 株式市場全体の上昇・下落の影響を抑えるためにマーケットニュートラル(市場中立)戦略が採られています。



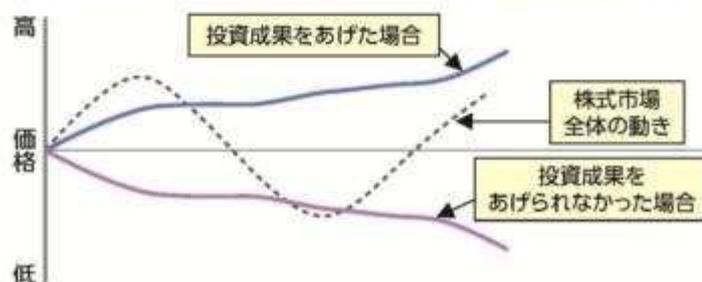
### マーケットニュートラル戦略とは

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

一般的な株式アクティブファンドの価格の動き(イメージ)



マーケットニュートラル戦略を行うファンドの価格の動き(イメージ)



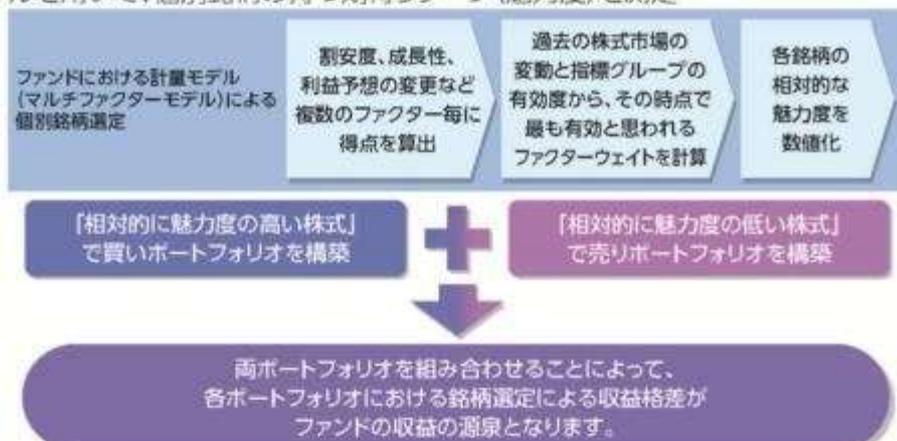
1 上図は運用戦略の概念を表すイメージ図であり、将来の運用状況・成果等を示唆・保証するものではありません。

特色 2

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

## &lt;運用戦略のコンセプト&gt;

計量モデルを用いて、個別銘柄の持つ期待リターン(魅力度)を測定



- ❗ 当該モデルは仮説に基づき構成されたものであり、市場動向は必ずしもこの仮説と同様の動きを示さない場合があります。
- 📄 「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページ(<https://www.am.mufg.jp/corp/operation/fm.html>)をご覧ください。

特色 3

## 無担保コール翌日物レートをベンチマークとします。

- 無担保コール翌日物レートとは、金融機関同士が短期資金の貸借を行うコール市場において、翌日返済とした無担保取引の際の金利をいいます。
- ベンチマークとは、ファンドの運用を行うにあたって運用成果の目標基準とする指標です。

## ■ ファンドの仕組み

運用は主に日本株マーケットニュートラル・マザーファンドへの投資を通じて、わが国の株式へ実質的に投資するファミリーファンド方式により行います。



## ■ 主な投資制限

株式	株式への実質投資割合に制限を設けません。
株式の一銘柄制限	同一銘柄の株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
デリバティブ	デリバティブの使用はヘッジ目的に限定しません。

## ■ 分配方針

- 年2回の決算時(2・8月の各24日(休業日の場合は翌営業日))に分配金額を決定します。
- 分配金額は委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には、分配を行わないことがあります。

分配金額の決定にあたっては、信託財産の成長を優先し、原則として分配を抑制する方針とします。(基準価額水準や市況動向等により変更する場合があります。)

将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

市況動向および資金動向等により、上記のような運用が行えない場合があります。

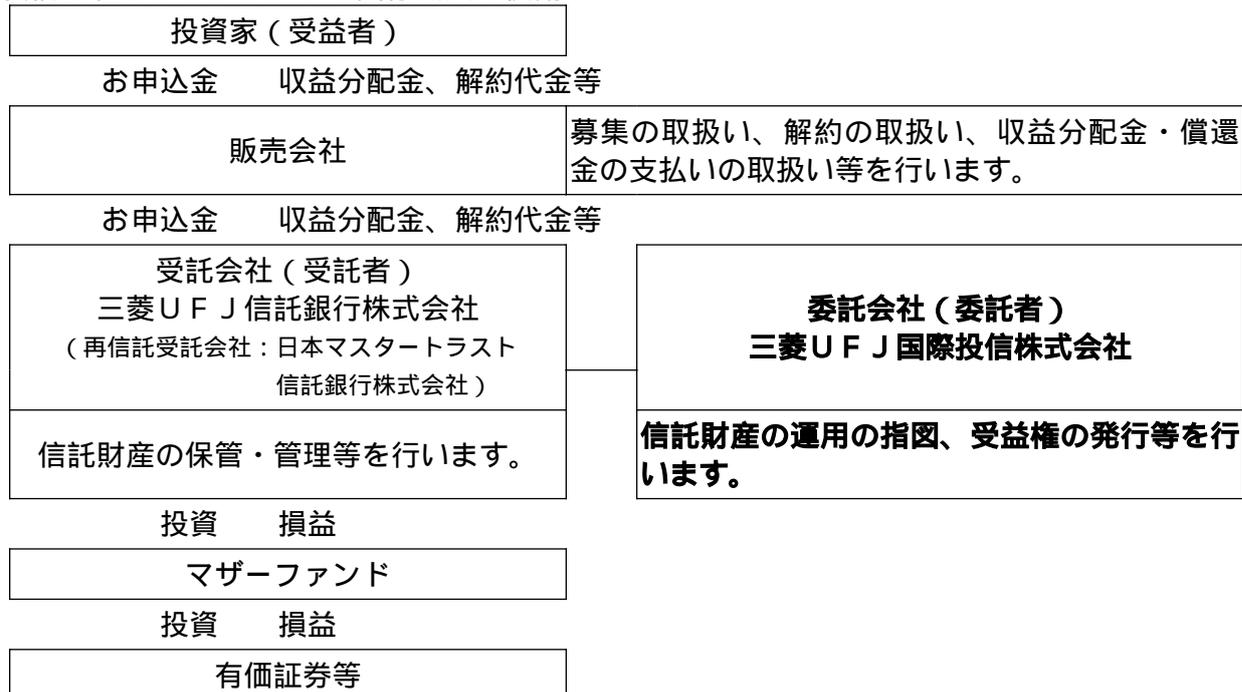
## (2) 【ファンドの沿革】

2005年12月16日

設定日、信託契約締結、運用開始

## (3)【ファンドの仕組み】

## 委託会社およびファンドの関係法人の役割



## 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%

## 2【投資方針】

### （1）【投資方針】

日本株マーケットニュートラル・マザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、わが国の株式に直接投資することがあります。組入比率は高位を維持することを基本とします。無担保コール翌日物レートをベンチマークとします。

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

### （2）【投資対象】

#### 投資の対象とする資産の種類

この信託において投資の対象とする資産（本邦通貨表示のものに限ります。）の種類は、次に掲げるものとします。

1．次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、信託約款に定める次のものに限ります。）

a．有価証券先物取引等

b．スワップ取引

ハ．約束手形

ニ．金銭債権

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

#### 有価証券の指図範囲

この信託において投資の対象とする有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）は、三菱UFJ国際投信株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社とする日本株マーケットニュートラル・マザーファンド（「マザーファンド」または「親投資信託」といいます。）の受益証券のほか、次に掲げるものとします。なお、当該有価証券は本邦通貨表示のものに限ります。

1．株券または新株引受権証券

2．国債証券

3．地方債証券

4．特別の法律により法人の発行する債券

5．社債券（新株引受権証券と社債券とが一体となった新株引受権付社債券（以下「分離型新株引受権付社債券」といいます。）の新株引受権証券を除きます。）

6．資産の流動化に係る特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）

7．特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）

8．協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）

9．資産の流動化に係る優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

10．資産の流動化に係る特定目的信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第13号で定めるものをいいます。）

11．コマーシャル・ペーパー

12．新株引受権証券（分離型新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。以下同じ。）および新株予約権証券

13．外国または外国の者の発行する証券または証書で、1．から12．の証券または証書の性質を有するもの

14．投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるもの

- のをいいます。)
15. 投資証券もしくは新投資口予約権証券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。16.において同じ。）で16.で定める以外のもの
  16. 投資法人債券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。以下16.において同じ。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券
  17. 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  18. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限りません。）
  19. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  20. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  21. 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  22. 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  23. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  24. 外国の者に対する権利で23.の有価証券の性質を有するもの
- なお、1.の証券または証書ならびに13.および19.の証券または証書のうち1.の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、2.から6.までの証券ならびに16.の証券ならびに13.および19.の証券または証書のうち2.から6.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.および15.の証券を以下「投資信託証券」といいます。

#### 金融商品の指図範囲

この信託において投資の対象とする金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）は、次に掲げるものとします。

1. 預金
2. 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託を除きます。）
3. コール・ローン
4. 手形割引市場において売買される手形
5. 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
6. 外国の者に対する権利で5.の権利の性質を有するもの

#### <日本株マーケットニュートラル・マザーファンドの概要>

##### （基本方針）

この投資信託は、安定した収益の確保と信託財産の着実な成長をめざして運用を行います。

##### （運用方法）

###### 投資対象

わが国の株式を主要投資対象とします。

###### 投資態度

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

無担保コール翌日物レートをベンチマークとし、中長期的に同指数を上回る投資成果をめざして運用を行います。

株式以外の資産への投資割合は、原則として信託財産の総額の50%以下とします。

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

##### （投資制限）

株式への投資割合に制限を設けません。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

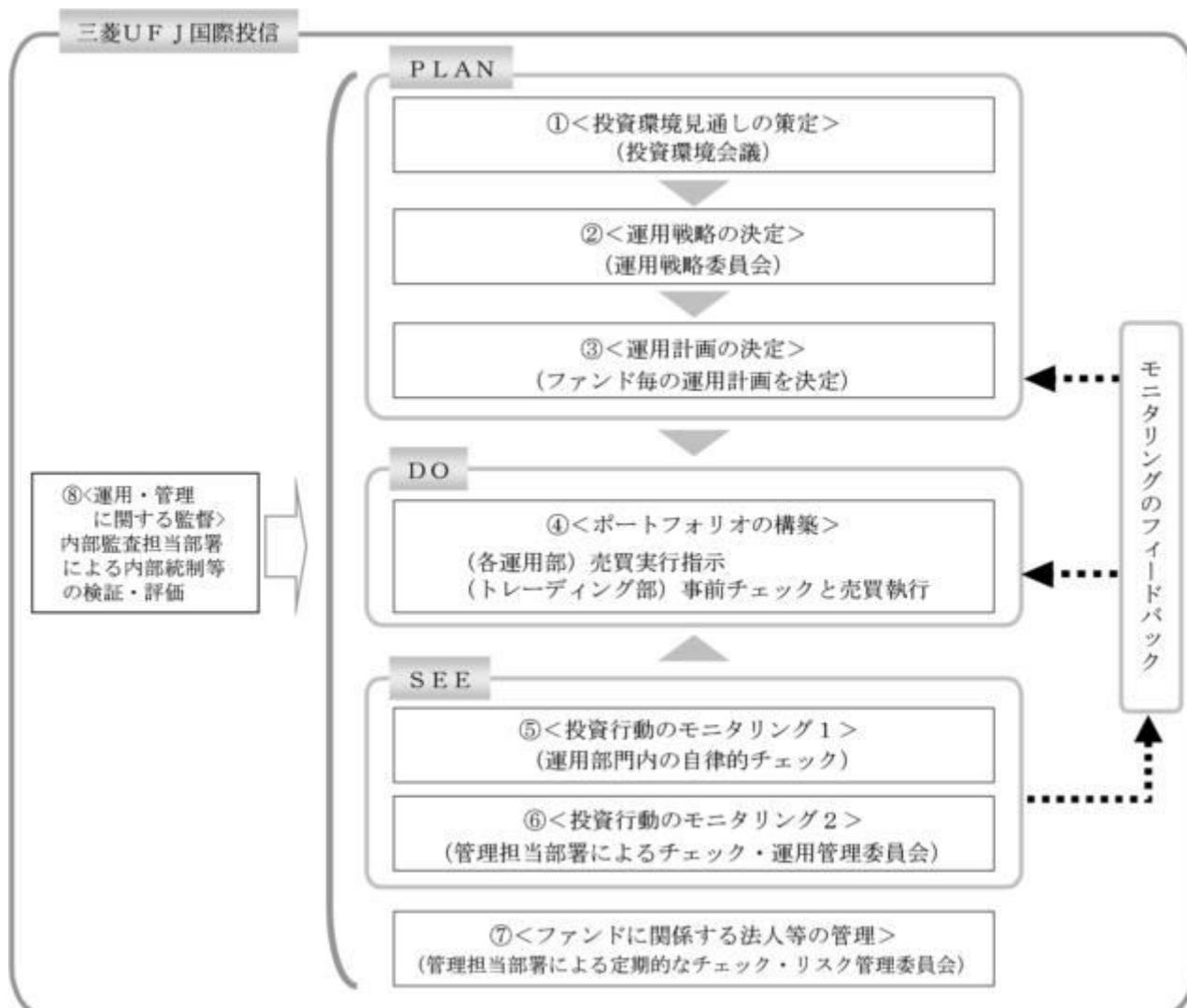
同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総

額の10%以下とします。  
外貨建資産への投資は行いません。  
有価証券先物取引等を行うことができます。  
スワップ取引は効率的な運用に資するため行うことができます。

### （3）【運用体制】



#### 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（40～60名程度）は、運用に関するパフォーマンス測定、リスク管理および法令・信託約款などの遵守状況等のモニタリングを実施します。この結果は、運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされ、必要に応じて是正を指示します。

#### ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されま

#### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署（10名程度）は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

なお、委託会社に関する「運用担当者に係る事項」については、委託会社のホームページでご覧いただけます。

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

#### （４）【分配方針】

毎決算時に、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

分配対象額は、経費等控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。

収益分配金額は、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合には分配を行わないことがあります。

収益の分配にあてなかった利益については、信託約款に定める運用の基本方針に基づいて運用を行います。

#### （５）【投資制限】

##### < 信託約款に定められた投資制限 >

##### 外貨建資産

外貨建資産への投資は行いません。

##### 新株引受権証券および新株予約権証券

a．委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

##### 投資信託証券

a．委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンドの受益証券を除きます。以下同じ。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める投資信託証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

##### 同一銘柄の株式等

a．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

b．a．において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該株式の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

c．委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額

とマザーファンドの信託財産に属する当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。

- d. c. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### 同一銘柄の転換社債等

- a. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債（新株予約権付社債のうち、会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているものならびに会社法施行前の旧商法第341条の3第1項第7号および第8号の定めがあるものをいいます。）の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- b. a. において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該転換社債および当該転換社債型新株予約権付社債の時価総額の割合を乗じて得た額とします。

#### スワップ取引

- a. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

#### 信用取引

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができます。
- b. a. の信用取引の指図は、当該売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内である場合においてできます。
- c. 信託財産の一部解約等の事由によりb. の売付けに係る建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### 有価証券の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入れの指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入れを行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. a. の指図は、当該借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の借入れに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借り入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。

#### 資金の借入れ

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性を図るため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借り入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開

始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

- c. 収益分配金の再投資に係る借入期間は、信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。

#### 投資する株式等の範囲

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、金融商品取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび金融商品取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. a. の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては委託会社が投資することを指図することができます。

#### 有価証券の貸付

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸し付けることの指図をすることができます。
1. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  2. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. a. に規定する限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 有価証券の空売り

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券またはの規定により借り入れた有価証券を売り付けることの指図をすることができます。なお、当該売付けの決済については、売り付けた有価証券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができますものとします。
- b. a. の売付けの指図は、当該売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、b. の売付けに係る有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をするものとします。

#### デリバティブ取引等

デリバティブ取引等（金融商品取引業等に関する内閣府令第130条第1項第8号に定めるデリバティブ取引をいう。）については、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標に係る変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額として、一般社団法人投資信託協会規則に定める合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないこととします。

#### 信用リスクの分散規制

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に係る株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

#### <その他法令等に定められた投資制限>

- ・同一の法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべての委託者指図型投資信託につき、投資信託財産として有する当該株式に係る議決権の総数が当該株式に係る議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) 投資リスク

ファンドの基準価額は、組み入れている有価証券等の価格変動による影響を受けますが、これらの運用により信託財産に生じた損益はすべて投資者のみなさまに帰属します。

したがって、投資者のみなさまの投資元本が保証されているものではなく、基準価額の下落により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

投資信託は預貯金と異なります。

ファンドの基準価額の変動要因として、主に以下のリスクがあります。

(主なりスクであり、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率が小さかった場合も同様です。収益分配金の支払いは、信託財産から行われます。したがって純資産総額の減少、基準価額の下落要因となります。
- 当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを共有する他のベビーファンドの追加設定・解約によってマザーファンドに売買が生じた場合などには、当ファンドの基準価額に影響する場合があります。
- 当ファンドは、実質的にわが国の株式に投資するとともに、信用取引を用いて株式を売り建てることによりマーケットリスクを極力回避しますが、ロング・ポジションとショート・ポ

ジションの価格変動の差異、逆日歩の発生その他の事情が生じた場合にはマーケットリスクを完全に回避できないことがあります。

## （２）投資リスクに対する管理体制

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

具体的な、投資リスクに対するリスク管理体制は以下の通りです。

### 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	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債券パフォーマンスインデックスで、NOMURA-BPI(国債)はそのサブインデックスです。わが国の国債で構成されており、ポートフォリオの投資収益率・利回り・クーポン・デュレーション等の各指標が日々公表されます。NOMURA-BPI(国債)は野村證券株式会社の知的財産であり、運用成果等に関し、野村證券株式会社は一切関係ありません。
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。当指数の著作権はJ.P.モルガン・セキュリティーズ・エルエルシーに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円換算しています。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

ありません。

申込手数料の対価として提供する役務の内容は、ファンドおよび投資環境の説明・情報提供、購入に関する事務手続等です。

## （２）【換金（解約）手数料】

かかりません。

ただし、解約時に信託財産留保額（当該基準価額の0.2%）が差し引かれます。

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

## （３）【信託報酬等】

- ・信託報酬の総額は、ファンドの計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に、年1.134%（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。

## （４）【その他の手数料等】

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

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

（注）手数料等については、保有金額または保有期間等により異なるため、あらかじめ合計額等を記載することはできません。なお、ファンドが負担する費用（手数料等）の支払い実績は、交付運用報告書に開示されていますのでご参照ください。

## （５）【課税上の取扱い】

課税上は、株式投資信託として取り扱われます。

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30年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国/地域	時価合計	投資比率（％）
親投資信託受益証券	日本	280,875,815	99.75
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		704,581	0.25
純資産総額		281,580,396	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30年 8月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	親投資信託受益証券	日本株マーケットニュートラル・マ ザーファンド	193,975,011	1.4522	281,690,511	1.4480	280,875,815	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30年 8月31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30年8月末日、同日前1年以内における各月末の純資産の推移は次の通りです。

	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6計算期間末日 (平成21年 2月24日)	263,099,909	263,099,909	9,831	9,831
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
平成29年 8月末日	970,213,291		12,208	
9月末日	930,805,270		12,258	
10月末日	979,681,930		12,351	
11月末日	991,521,889		12,229	
12月末日	1,013,478,212		12,298	
平成30年 1月末日	1,024,907,219		12,407	
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	

## 【分配の推移】

	1万口当たりの分配金
--	------------

第6計算期間	0円
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

## 【収益率の推移】

	収益率（％）
第6計算期間	2.35
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

（注）「収益率」とは、計算期間末の基準価額（分配額の額）から当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配額の額）を控除した額を当該基準価額（分配額の額）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6計算期間	109,388,491	254,358,230	267,634,887
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

（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30年 8月31日現在

（単位：円）

資産の種類	国／地域	時価合計	投資比率（％）
株式	日本	3,730,877,700	91.00
コール・ローン、その他資産 （負債控除後）		368,983,398	9.00

純資産総額	4,099,861,098	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30年 8月31日現在

国/地域	種類	銘柄名	業種	数量	簿価 単価 (円)	簿価 金額 (円)	評価 単価 (円)	評価 金額 (円)	投資 比率 (%)
日本	株式	ソースネクスト	情報・通信業	15,000	852.00	12,780,000	976.00	14,640,000	0.36
日本	株式	メディカル・データ・ビジョン	情報・通信業	7,500	1,750.00	13,125,000	1,897.00	14,227,500	0.35
日本	株式	センコーグループホールディングス	陸運業	15,000	848.00	12,720,000	916.00	13,740,000	0.34
日本	株式	第一精工	電気機器	8,200	1,526.00	12,513,200	1,673.00	13,718,600	0.33
日本	株式	ミライアル	化学	11,000	985.00	10,835,000	1,242.00	13,662,000	0.33
日本	株式	システムリサーチ	情報・通信業	3,500	3,740.00	13,090,000	3,890.00	13,615,000	0.33
日本	株式	オービック	情報・通信業	1,300	9,940.00	12,922,000	10,440.00	13,572,000	0.33
日本	株式	バイタルケーエスケー・ホールディングス	卸売業	10,700	1,201.00	12,850,700	1,262.00	13,503,400	0.33
日本	株式	京浜急行電鉄	陸運業	7,000	1,882.00	13,174,000	1,922.00	13,454,000	0.33
日本	株式	新電元工業	電気機器	2,400	4,970.00	11,928,000	5,590.00	13,416,000	0.33
日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	600	22,265.00	13,359,000	22,315.00	13,389,000	0.33
日本	株式	K O A	電気機器	6,000	2,137.00	12,822,000	2,229.00	13,374,000	0.33
日本	株式	大真空	電気機器	9,500	1,331.00	12,644,500	1,405.00	13,347,500	0.33
日本	株式	インソース	サービス業	5,000	2,570.00	12,850,000	2,663.00	13,315,000	0.32
日本	株式	N・フィールド	サービス業	7,500	1,691.00	12,682,500	1,773.00	13,297,500	0.32
日本	株式	日本パーカライズング	化学	9,000	1,445.00	13,005,000	1,475.00	13,275,000	0.32
日本	株式	大研医器	精密機器	16,000	816.00	13,056,000	827.00	13,232,000	0.32
日本	株式	京王電鉄	陸運業	2,400	5,470.00	13,128,000	5,510.00	13,224,000	0.32
日本	株式	良品計画	小売業	400	33,147.00	13,258,800	33,000.00	13,200,000	0.32
日本	株式	日本調剤	小売業	3,800	3,320.00	12,616,000	3,465.00	13,167,000	0.32
日本	株式	トーヨーカネツ	機械	4,000	3,320.00	13,280,000	3,290.00	13,160,000	0.32
日本	株式	あらた	卸売業	2,500	5,247.00	13,117,500	5,260.00	13,150,000	0.32
日本	株式	サンデンホールディングス	機械	9,000	1,513.00	13,617,000	1,459.00	13,131,000	0.32
日本	株式	博報堂DYホールディングス	サービス業	7,000	1,795.00	12,565,000	1,875.00	13,125,000	0.32
日本	株式	日精樹脂工業	機械	11,000	1,135.00	12,485,000	1,191.00	13,101,000	0.32
日本	株式	THK	機械	4,400	2,848.93	12,535,300	2,976.00	13,094,400	0.32
日本	株式	リケンテクノス	化学	23,000	558.00	12,834,000	569.00	13,087,000	0.32
日本	株式	アイ・オー・データ機器	電気機器	10,300	1,185.00	12,205,500	1,270.00	13,081,000	0.32
日本	株式	やまびこ	機械	10,000	1,280.00	12,800,000	1,308.00	13,080,000	0.32
日本	株式	スタンレー電気	電気機器	3,400	3,635.00	12,359,000	3,845.00	13,073,000	0.32

（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30年 8月31日現在

種類	業種	投資比率（％）
株式	水産・農林業	0.59
	鉱業	0.86
	建設業	6.51
	食料品	3.78
	繊維製品	0.95
	パルプ・紙	0.55
	化学	8.09
	医薬品	2.45
	石油・石炭製品	0.28
	ゴム製品	0.58
	ガラス・土石製品	1.50
	鉄鋼	1.48
	非鉄金属	1.45
	金属製品	1.44
	機械	9.38
	電気機器	8.76
	輸送用機器	2.63
	精密機器	1.03
	その他製品	2.04
	陸運業	2.49
	海運業	0.29
	倉庫・運輸関連業	0.56
	情報・通信業	6.37
	卸売業	5.64
	小売業	10.42
	不動産業	3.03
サービス業	7.87	
	小計	91.00
合計		91.00

（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。

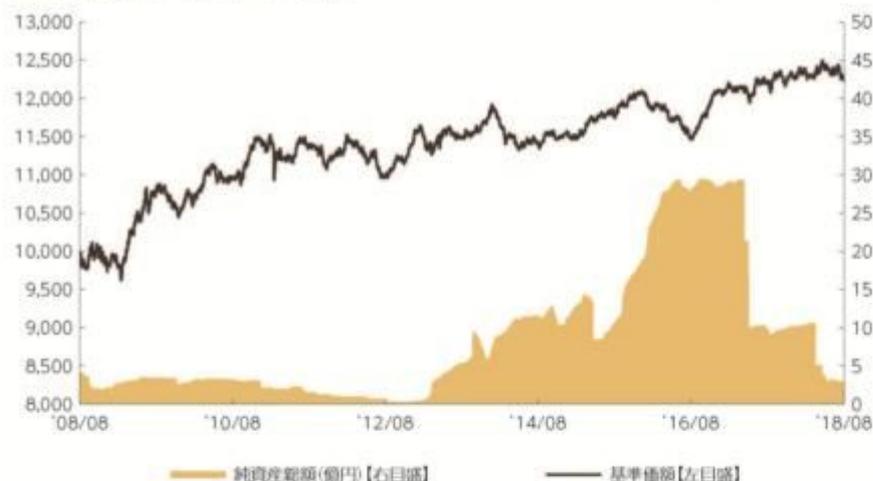
参考情報



## 運用実績

2018年8月31日現在

### ■基準価額・純資産の推移 2008年8月29日～2018年8月31日



●基準価額は運用報酬(信託報酬)控除後です。

### ■基準価額・純資産

基準価額	12,233円
純資産総額	2.8億円

### ■分配の推移

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
2016年 2月	0円
設定来累計	0円

●分配金は1万円当たり、税引前

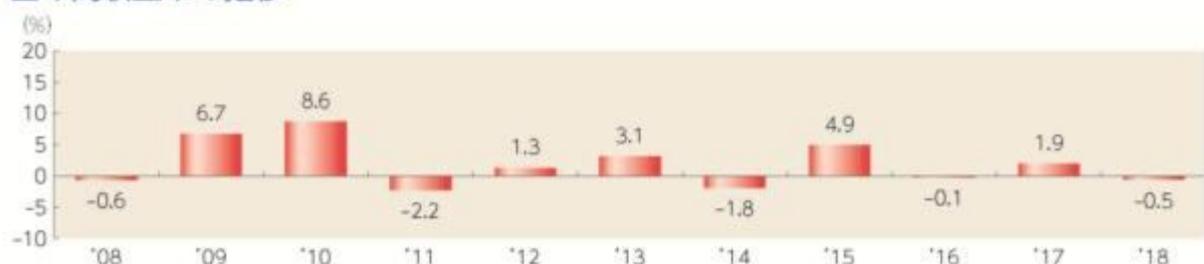
### ■主要な資産の状況

資産別構成	比率	組入上位銘柄	業種	比率
国内株式現物	90.8%	1 ソースネクスト	情報・通信業	0.4%
国内株式信用売	-90.6%	2 メディカル・データ・ビジョン	情報・通信業	0.3%
		3 センコーグループホールディングス	陸運業	0.3%
		4 第一精工	電気機器	0.3%
		5 ミライアル	化学	0.3%
		6 システムリサーチ	情報・通信業	0.3%
		7 オーピック	情報・通信業	0.3%
		8 バイタルケーエスケー・ホールディングス	卸売業	0.3%
		9 京浜急行電鉄	陸運業	0.3%
		10 新電元工業	電気機器	0.3%
株式(実質)	0.1%			

●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

●2018年は年初から8月31日までの収益率を表示

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

## 1【申込（販売）手続等】

### 申込みの受付

原則として、いつでも申込みができます。

取得申込者の受益権は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

### 申込単位

販売会社が定める単位

### 申込価額

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

### 申込価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 申込単位・申込価額の照会方法

申込単位および申込価額は、販売会社にてご確認ください。

また、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

なお、申込価額は委託会社のホームページでもご覧いただけます。

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

### 申込手数料

ありません。

### 申込方法

取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込みを行うものとします。

取得申込者は、申込金額を販売会社が定める日までに支払うものとします。

なお、申込みには分配金受取コース（一般コース）と分配金再投資コース（累積投資コース）があります。申込みコースの取扱いは販売会社により異なる場合があります。

### 申込受付時間

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

### 取得申込みの受付の中止および取消し

金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受け付けた取得申込みの受付を取り消すことがあります。

1日1件当たり5億円を超える取得申込みを受け付けない場合があります。

申込（販売）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 2【換金（解約）手続等】

### 解約の受付

原則として、いつでも解約の請求ができます。

受益者の解約請求に係る受益権の口数の減少は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されます。

### 解約単位

## 販売会社が定める単位

### 解約価額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額から信託財産留保額を差引いた価額

### 信託財産留保額

解約請求受付日の翌営業日の基準価額に0.2%をかけた額

### 解約価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

### 解約価額の照会方法

解約価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

### 支払開始日

解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して6営業日目から販売会社において支払います。

### 解約請求受付時間

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

### 解約請求受付の中止および取消し

委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよびすでに受け付けた解約請求を取り消すことがあります。その場合には、受益者は、当該受付中止以前に行った当日の解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に解約請求を受け付けたものとします。

信託財産の資金管理を円滑に行うため、1日1件当たり5億円を超える解約請求を受け付けない場合があります。また、市況動向等により、これ以外にも大口の解約請求に制限を設ける場合があります。

換金（解約）手続等の詳細に関しては販売会社にご確認ください。

## 3【資産管理等の概要】

### （1）【資産の評価】

#### 基準価額の算出方法

基準価額 = 信託財産の純資産総額 ÷ 受益権総口数

なお、便宜上1万口当りに換算した価額で表示することがあります。

「信託財産の純資産総額」とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。

#### （資産の評価方法）

- ・株式 / 上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券

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

・ 転換社債 / 転換社債型新株予約権付社債

原則として、金融商品取引所における計算日の最終相場、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額（外国で取引されているものについては、原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額）で評価します。

・ 公社債等

原則として、計算日に入手した日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）、金融商品取引業者・銀行等の提示する価額（売気配相場を除く。）または価格情報会社の提供する価額のいずれかの価額で評価します。

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

・ マザーファンド

計算日における基準価額で評価します。

・ 投資信託証券（上場投資信託証券 / 不動産投資信託証券を除く。）

原則として、計算日に知りうる直近の日の基準価額で評価します。

・ 外貨建資産

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

・ 外国為替予約取引

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

・ 市場デリバティブ取引

原則として、金融商品取引所が発表する計算日の清算値段等で評価します。

#### 基準価額の算出頻度

原則として、委託会社の営業日に計算されます。

#### 基準価額の照会方法

基準価額は、販売会社にてご確認いただけます。

なお、下記においてもご照会いただけます。

三菱UFJ国際投信株式会社

お客様専用フリーダイヤル 0120-151034

（受付時間：営業日の9:00～17:00）

ホームページアドレス <https://www.am.mufg.jp/>

#### (2) 【保管】

該当事項はありません。

#### (3) 【信託期間】

無期限（2005年12月16日設定）

ただし、後記「ファンドの償還条件等」の規定によりファンドを償還させることがあります。

#### (4) 【計算期間】

毎年2月25日から8月24日および8月25日から翌年2月24日まで

ただし、各計算期間終了日に該当する日(以下「該当日」といいます。)が休業日の場合、各計算期間終了日は該当日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。なお、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間の終了日とします。

#### (5)【その他】

##### ファンドの償還条件等

委託会社は、以下の場合には、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、ファンドを償還させることができます。(任意償還)

- ・受益権の口数が10億口を下回ることとなった場合
- ・信託期間中において、ファンドを償還させることが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したとき

このほか、監督官庁よりファンドの償還の命令を受けたとき、委託会社の登録取消・解散・業務廃止のときは、原則として、ファンドを償還させます。

委託会社は、ファンドを償還しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

##### 信託約款の変更

委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、法令および信託約款に定める手続きにしたがい、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することができます。委託会社は、信託約款を変更しようとするときは、あらかじめその旨を監督官庁に届け出ます。

委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記の手続きにしたがいます。

##### ファンドの償還等に関する開示方法

委託会社は、ファンドの任意償還または信託約款の変更のうち重大な内容の変更を行おうとする場合、あらかじめその旨およびその内容を公告し、かつ、原則としてこれらの事項を記載した書面を受益者に交付します(ただし、この信託約款に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。)。この公告および書面には、原則として、受益者で異議のあるものは一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。

##### 異議申立ておよび反対者の買取請求権

受益者は、委託会社がファンドの任意償還または信託約款について重大な内容の変更を行おうとする場合、原則として、一定の期間(1ヵ月以上)内に委託会社に対して異議を述べるすることができます。異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買い取るべき旨を請求することができます。なお、一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の2分の1を超えるときは、ファンドの償還または信託約款の変更を行いません。その場合、償還しない旨または信託約款を変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、原則として、これらの事項を記載した書面を受益者に交付します(ただし、この信託契約に係るすべての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。)。

##### 関係法人との契約の更改

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

##### 運用報告書

委託会社は、毎計算期間の末日および償還時に、交付運用報告書を作成し、原則として受益者に交付します。なお、信託約款の内容に委託会社が重要と判断した変更、ファンドの任意償還等があった場合は、その内容を交付運用報告書に記載します。

#### 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

委託会社は、事業の全部または一部を譲渡することがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を譲渡することがあります。また、委託会社は、分割により事業の全部または一部を承継させることがあり、これに伴い、この信託契約に関する事業を承継させることがあります。

#### 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、信託約款の規定にしたがい、新受託会社を選任します。委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はファンドを償還させます。

#### 信託事務の再信託

受託会社は、ファンドに係る信託事務の処理の一部について再信託受託会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、電子公告の方法により行い、次のアドレスに掲載します。

<https://www.am.mufg.jp/>

なお、電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は以下の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する受領権

受益者は、収益分配金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

分配金受取コース（一般コース）

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

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

分配金再投資コース（累積投資コース）

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

##### (2) 償還金に対する受領権

受益者は、償還金を持ち分に応じて受領する権利を有します。

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日以内）から、販売会社において、受益者に支払います。

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

##### (3) 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権につき、換金（解約）請求する権利を有します。

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- 1 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)ならびに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- 2 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当期(平成30年2月27日から平成30年8月24日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

#### 1【財務諸表】

## 【日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）】

## （１）【貸借対照表】

（単位：円）

	第24期 [平成30年 2月26日現在]	第25期 [平成30年 8月24日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	9,056,683	3,839,535
親投資信託受益証券	1,037,627,090	292,685,330
未収入金	3,059,009	-
流動資産合計	1,049,742,782	296,524,865
資産合計	1,049,742,782	296,524,865
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	3,315,950	-
未払受託者報酬	542,765	295,997
未払委託者報酬	5,156,216	2,811,898
未払利息	13	6
その他未払費用	14,050	7,632
流動負債合計	9,028,994	3,115,533
負債合計	9,028,994	3,115,533
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	839,525,277	239,131,341
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	201,188,511	54,277,991
（分配準備積立金）	37,093,328	10,856,848
元本等合計	1,040,713,788	293,409,332
純資産合計	1,040,713,788	293,409,332
負債純資産合計	1,049,742,782	296,524,865

## （２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第24期		第25期	
	自	平成29年 8月25日 至 平成30年 2月26日	自	平成30年 2月27日 至 平成30年 8月24日
営業収益				
受取利息		18		7
有価証券売買等損益		20,583,243		5,013,028
営業収益合計		20,583,261		5,013,021
営業費用				
支払利息		1,704		1,153
受託者報酬		542,765		295,997
委託者報酬		5,156,216		2,811,898
その他費用		14,050		7,632
営業費用合計		5,714,735		3,116,680
営業利益又は営業損失（ ）		14,868,526		8,129,701
経常利益又は経常損失（ ）		14,868,526		8,129,701
当期純利益又は当期純損失（ ）		14,868,526		8,129,701
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（ ）		520,101		4,361,167
期首剰余金又は期首欠損金（ ）		180,180,478		201,188,511
剰余金増加額又は欠損金減少額		38,905,273		20,335,385
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額		38,905,273		20,335,385
剰余金減少額又は欠損金増加額		32,245,665		163,477,371
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		32,245,665		163,477,371
分配金		-		-
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		201,188,511		54,277,991

## (3) 【注記表】

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券は時価で評価しております。時価評価にあたっては、基準価額で評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	ファンドの計算期間 当ファンドは、原則として毎年2月24日および8月24日を計算期間の末日としておりますが、前計算期間においては当該日が休業日のため、当計算期間は平成30年2月27日から平成30年8月24日までとなっております。

## (貸借対照表に関する注記)

	第24期 [平成30年 2月26日現在]	第25期 [平成30年 8月24日現在]
1. 期首元本額	816,522,044円	839,525,277円
期中追加設定元本額	170,118,710円	86,234,226円
期中一部解約元本額	147,115,477円	686,628,162円
2. 受益権の総数	839,525,277口	239,131,341口

## (損益及び剰余金計算書に関する注記)

第24期 自 平成29年 8月25日 至 平成30年 2月26日			第25期 自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8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	4,918,296円	費用控除後の配当等収益額	A	1,580,680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	7,372,952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	220,317,484円	収益調整金額	C	65,360,084円
分配準備積立金額	D	24,802,080円	分配準備積立金額	D	9,276,168円
当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	257,410,812円	当ファンドの分配対象収益額	E=A+B+C+D	76,216,932円
当ファンドの期末残存口数	F	839,525,277口	当ファンドの期末残存口数	F	239,131,341口
1万口当たり収益分配対象額	G=E/F*10,000	3,066円	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24期 自 平成29年 8月25日 至 平成30年 2月26日	第25期 自 平成30年 2月27日 至 平成30年 8月24日
1.金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。	同左
2.金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、親投資信託受益証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。	同左
3.金融商品に係るリスク管理体制	<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24期 [平成30年 2月26日現在]	第25期 [平成30年 8月24日現在]
1.貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。	同左
2.時価の算定方法	<p>(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。</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>(1) 有価証券            同左</p> <p>(2) デリバティブ取引            同左</p> <p>(3) 上記以外の金融商品            同左</p>

区分	第24期	第25期
	[平成30年 2月26日現在]	[平成30年 8月24日現在]
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	第24期	第25期
	[平成30年 2月26日現在]	[平成30年 8月24日現在]
	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額 (円)
親投資信託受益証券	20,477,616	2,274,380
合計	20,477,616	2,274,380

## （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24期	第25期
	[平成30年 2月26日現在]	[平成30年 8月24日現在]
1口当たり純資産額	1.2396円	1.2270円
(1万口当たり純資産額)	(12,396円)	(12,270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	201,546,158	292,685,330	
合計		201,546,158	292,685,330	

## 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30年 8月24日現在]

資産の部	
流動資産	
コール・ローン	592,495,870
株式	3,581,209,050
信用取引預け金	3,557,293,986
未収配当金	3,223,150
流動資産合計	7,734,222,056
資産合計	7,734,222,056
負債の部	
流動負債	
信用売証券	3,604,396,840
未払解約金	1,624,580
未払利息	945
その他未払費用	5,392,588
流動負債合計	3,611,414,953

[平成30年 8月24日現在]

負債合計	3,611,414,953
純資産の部	
元本等	
元本	2,839,011,986
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	1,283,795,117
元本等合計	4,122,807,103
純資産合計	4,122,807,103
負債純資産合計	7,734,222,056

## 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30年 8月24日現在]
1. 期首	平成30年 2月27日
期首元本額	2,293,712,623円
期中追加設定元本額	1,574,394,041円
期中一部解約元本額	1,029,094,678円
元本の内訳	
日本株プライムニュートラル・ファンド（ラップ向け）	201,546,158円
ヘッジファンドセレクション（ラップ向け）	1,223,471,523円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定型）	104,256,833円
三菱UFJ アドバンスト・バランス（安定成長型）	218,738,489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）	1,090,998,983円
合計	2,839,011,986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	2,066,173,850円
3. 受益権の総数	2,839,011,986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 2月27日 至 平成30年 8月24日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行っております。
2. 金融商品の内容及び当該金融商品に係るリスク	当ファンドは、株式に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。 当ファンドは、信用売証券に投資しております。当該投資対象は、価格変動リスク等の市場リスク、信用リスクおよび流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	ファンドのコンセプトに応じて、適切にコントロールするため、委託会社では、運用部門において、ファンドに含まれる各種投資リスクを常時把握しつつ、ファンドのコンセプトに沿ったリスクの範囲で運用を行っております。 また、運用部から独立した管理担当部署によりリスク運営状況のモニタリング等のリスク管理を行っており、この結果は運用管理委員会等を通じて運用部門にフィードバックされます。

## 2 金融商品の時価等に関する事項

区分	[平成30年 8月24日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びその差額	時価で計上しているためその差額はありません。
2. 時価の算定方法	(1) 有価証券 売買目的有価証券は、（重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2) デリバティブ取引 デリバティブ取引は、該当事項はありません。 (3) 上記以外の金融商品 上記以外の金融商品（コールローン等）は、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似していることから、当該金融商品の帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

## （有価証券に関する注記）

## 売買目的有価証券

種類	[平成30年 8月24日現在]
	当期間の損益に含まれた評価差額（円）

株式	199,098,915
信用売証券	13,383,421
合計	185,715,494

(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30年 8月24日現在]
1口当たり純資産額	1.4522円
(1万口当たり純資産額)	(14,522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	21,000	605.00	12,705,000	代用有価証券 15,000株
1333	マルハニチロ	3,000	3,875.00	11,625,000	代用有価証券 3,000株
1515	日鉄鉱業	2,400	5,070.00	12,168,000	代用有価証券 2,400株
1605	国際石油開発帝石	10,000	1,209.00	12,090,000	代用有価証券 5,000株
1662	石油資源開発	4,500	2,324.00	10,458,000	代用有価証券 2,500株
1430	ファーストコーポレーション	8,000	1,088.00	8,704,000	代用有価証券 8,000株

1719	安藤・間	14,000	814.00	11,396,000	代用有価証券 14,000株
1720	東急建設	10,500	1,003.00	10,531,500	代用有価証券 7,000株
1722	ミサワホーム	13,000	868.00	11,284,000	代用有価証券 8,000株
1726	ピーアールホールディングス	26,000	418.00	10,868,000	代用有価証券 16,000株
1801	大成建設	2,400	5,090.00	12,216,000	
1803	清水建設	12,400	992.00	12,300,800	代用有価証券 9,400株
1808	長谷工コーポレーション	6,000	1,437.00	8,622,000	代用有価証券 6,000株
1812	鹿島建設	14,000	805.00	11,270,000	
1814	大末建設	9,400	1,285.00	12,079,000	代用有価証券 5,400株
1815	鉄建建設	4,400	2,732.00	12,020,800	代用有価証券 2,700株
1820	西松建設	4,400	2,686.00	11,818,400	代用有価証券 2,500株
1821	三井住友建設	15,000	725.00	10,875,000	代用有価証券 10,000株
1835	東鉄工業	4,000	2,970.00	11,880,000	
1861	熊谷組	3,500	3,110.00	10,885,000	代用有価証券 2,000株
1882	東亜道路工業	3,000	3,620.00	10,860,000	代用有価証券 2,000株
1893	五洋建設	18,000	646.00	11,628,000	代用有価証券 18,000株
1898	世紀東急工業	16,000	700.00	11,200,000	代用有価証券 11,000株
1928	積水ハウス	6,500	1,840.50	11,963,250	代用有価証券 6,500株
1950	日本電設工業	6,000	2,103.00	12,618,000	代用有価証券 6,000株
1959	九電工	2,600	4,130.00	10,738,000	代用有価証券 1,500株
1963	日揮	5,500	2,095.00	11,522,500	代用有価証券 5,500株
1967	ヤマト	16,000	638.00	10,208,000	代用有価証券 11,000株
1968	太平電業	4,400	2,662.00	11,712,800	代用有価証券 2,700株
1972	三晃金属工業	3,200	3,430.00	10,976,000	代用有価証券 2,200株
2002	日清製粉グループ本社	5,700	2,212.00	12,608,400	代用有価証券 5,700株
2004	昭和産業	4,000	2,903.00	11,612,000	代用有価証券 2,500株
2053	中部飼料	8,000	1,424.00	11,392,000	代用有価証券 4,000株

2060	フィード・ワン	50,000	203.00	10,150,000	代用有価証券 32,000株
2220	亀田製菓	2,400	4,945.00	11,868,000	代用有価証券 1,300株
2222	寿スピリッツ	2,500	4,810.00	12,025,000	代用有価証券 1,300株
2502	アサヒグループホールディングス	2,500	4,968.00	12,420,000	代用有価証券 1,000株
2531	宝ホールディングス	11,000	1,157.00	12,727,000	代用有価証券 9,000株
2579	コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	3,100	3,145.00	9,749,500	代用有価証券 2,500株
2587	サントリー食品インターナショナル	2,800	4,525.00	12,670,000	
2602	日清オイリオグループ	4,200	3,015.00	12,663,000	代用有価証券 2,400株
2613	J - オイルミルズ	3,300	3,740.00	12,342,000	代用有価証券 2,000株
4526	理研ビタミン	3,100	3,815.00	11,826,500	代用有価証券 1,800株
3551	ダイニック	8,000	955.00	7,640,000	代用有価証券 8,000株
8029	ルックホールディングス	8,900	1,246.00	11,089,400	代用有価証券 8,100株
8114	デサント	6,000	2,050.00	12,300,000	
8127	ヤマトインターナショナル	20,000	551.00	11,020,000	代用有価証券 13,000株
3863	日本製紙	6,000	1,966.00	11,796,000	代用有価証券 4,000株
3941	レンゴー	11,000	946.00	10,406,000	代用有価証券 8,000株
3946	トーモク	6,000	1,986.00	11,916,000	代用有価証券 3,500株
3405	クラレ	8,000	1,593.00	12,744,000	代用有価証券 8,000株
4022	ラサ工業	4,400	2,609.00	11,479,600	代用有価証券 2,700株
4064	日本カーバイド工業	6,500	1,746.00	11,349,000	代用有価証券 4,000株
4093	東邦アセチレン	5,500	1,550.00	8,525,000	代用有価証券 5,500株
4114	日本触媒	1,500	8,180.00	12,270,000	
4182	三菱瓦斯化学	5,000	2,316.00	11,580,000	代用有価証券 5,000株
4185	J S R	5,700	2,144.00	12,220,800	代用有価証券 3,600株
4202	ダイセル	10,000	1,234.00	12,340,000	
4208	宇部興産	3,900	2,750.00	10,725,000	代用有価証券 2,700株
4215	タキロンシーアイ	19,000	612.00	11,628,000	代用有価証券 12,000株

4220	リケンテクノス	23,000	558.00	12,834,000	13,500株
4228	積水化成成品工業	10,000	983.00	9,830,000	10,000株
4231	タイガースポリマー	15,000	774.00	11,610,000	10,000株
4238	ミライアル	11,000	985.00	10,835,000	6,000株
4401	A D E K A	6,000	1,787.00	10,722,000	4,000株
4631	D I C	3,200	3,815.00	12,208,000	3,200株
4634	東洋インキ S Cホールディングス	4,300	2,813.00	12,095,900	2,600株
4911	資生堂	1,600	7,556.00	12,089,600	1,300株
4922	コーセー	600	19,340.00	11,604,000	500株
4924	シーズ・ホールディングス	2,500	4,650.00	11,625,000	1,300株
4927	ポーラ・オルビスホールディングス	3,200	3,795.00	12,144,000	3,000株
4951	エステー	6,000	2,011.00	12,066,000	6,000株
4968	荒川化学工業	7,000	1,669.00	11,683,000	4,000株
4974	タカラバイオ	4,800	2,707.00	12,993,600	3,300株
4992	北興化学工業	20,500	562.00	11,521,000	13,000株
5208	有沢製作所	10,800	1,011.00	10,918,800	6,000株
7940	ウェーブブロックホールディングス	12,000	1,034.00	12,408,000	12,000株
7970	信越ポリマー	12,000	910.00	10,920,000	
4506	大日本住友製薬	5,900	2,285.00	13,481,500	5,900株
4521	科研製薬	2,200	5,500.00	12,100,000	1,300株
4523	エーザイ	1,200	9,939.00	11,926,800	600株
4528	小野薬品工業	4,400	2,820.00	12,408,000	2,400株
4540	ツムラ	1,700	3,705.00	6,298,500	
4555	沢井製薬	2,100	5,820.00	12,222,000	1,500株
4569	キョーリン製薬ホールディングス	5,500	2,206.00	12,133,000	3,000株
4581	大正製薬ホールディングス	1,000	11,800.00	11,800,000	800株
5013	ユシロ化学工業	7,700	1,477.00	11,372,900	4,500株

5108	ブリヂストン	3,000	4,058.00	12,174,000	代用有価証券 1,500株
5121	藤倉ゴム工業	19,000	583.00	11,077,000	代用有価証券 11,000株
5288	アジアパイルホールディングス	14,500	826.00	11,977,000	代用有価証券 11,000株
5301	東海カーボン	5,600	1,916.00	10,729,600	代用有価証券 3,800株
5302	日本カーボン	1,900	6,120.00	11,628,000	代用有価証券 1,100株
5333	日本碍子	6,400	1,812.00	11,596,800	代用有価証券 3,400株
5351	品川リフラクトリーズ	2,400	4,620.00	11,088,000	代用有価証券 2,000株
5401	新日鐵住金	5,800	2,242.00	13,003,600	代用有価証券 3,000株
5444	大和工業	3,500	3,200.00	11,200,000	代用有価証券 3,000株
5445	東京鐵鋼	7,400	1,781.00	13,179,400	代用有価証券 7,200株
5463	丸一鋼管	3,400	3,385.00	11,509,000	代用有価証券 1,700株
5482	愛知製鋼	3,000	4,015.00	12,045,000	代用有価証券 1,800株
5632	三菱製鋼	5,600	2,059.00	11,530,400	代用有価証券 3,500株
5703	日本輕金属ホールディングス	50,000	235.00	11,750,000	
5707	東邦亜鉛	3,100	3,735.00	11,578,500	代用有価証券 2,800株
5711	三菱マテリアル	4,200	2,902.00	12,188,400	代用有価証券 4,200株
5803	フジクラ	18,000	636.00	11,448,000	代用有価証券 18,000株
5852	アーレスティ	13,000	845.00	10,985,000	代用有価証券 7,500株
3434	アルファC o	8,500	1,404.00	11,934,000	代用有価証券 8,500株
5930	文化シャッター	12,000	875.00	10,500,000	代用有価証券 8,000株
5933	アルインコ	10,500	1,045.00	10,972,500	代用有価証券 7,000株
5970	ジーテクト	6,500	1,832.00	11,908,000	代用有価証券 6,500株
6104	東芝機械	25,000	488.00	12,200,000	
6113	アマダホールディングス	11,000	1,176.00	12,936,000	代用有価証券 6,100株
6118	アイダエンジニアリング	12,000	981.00	11,772,000	
6121	滝澤鉄工所	6,900	1,761.00	12,150,900	代用有価証券 6,900株
6134	F U J I	6,500	1,787.00	11,615,500	代用有価証券 3,000株

6140	旭ダイヤモンド工業	14,500	779.00	11,295,500	代用有価証券 14,500株
6146	ディスコ	600	18,070.00	10,842,000	
6165	パンチ工業	13,000	859.00	11,167,000	
6210	東洋機械金属	17,000	719.00	12,223,000	代用有価証券 10,000株
6256	ニューフレアテクノロジー	1,800	5,790.00	10,422,000	
6273	S M C	300	36,690.00	11,007,000	代用有価証券 300株
6284	日精エー・エス・ビー機械	2,300	4,585.00	10,545,500	
6293	日精樹脂工業	11,000	1,135.00	12,485,000	代用有価証券 7,000株
6317	北川鉄工所	4,500	2,572.00	11,574,000	代用有価証券 3,000株
6345	アイチ コーポレーション	18,500	611.00	11,303,500	代用有価証券 12,000株
6358	酒井重工業	3,500	3,170.00	11,095,000	代用有価証券 2,000株
6369	トーヨーカネツ	4,000	3,320.00	13,280,000	
6373	大同工業	10,000	1,129.00	11,290,000	代用有価証券 10,000株
6393	油研工業	5,000	2,276.00	11,380,000	代用有価証券 3,000株
6395	タダノ	9,000	1,172.00	10,548,000	
6407	C K D	7,000	1,606.00	11,242,000	代用有価証券 7,000株
6436	アマノ	5,000	2,249.00	11,245,000	
6458	新晃工業	7,000	1,650.00	11,550,000	
6459	大和冷機工業	10,000	1,167.00	11,670,000	代用有価証券 10,000株
6465	ホシザキ	1,200	10,190.00	12,228,000	
6472	N T N	28,000	441.00	12,348,000	
6473	ジェイテクト	8,000	1,478.00	11,824,000	
6481	T H K	3,900	2,832.00	11,044,800	代用有価証券 3,900株
6501	日立製作所	16,000	718.10	11,489,600	
6513	オリジン電気	6,500	1,676.00	10,894,000	代用有価証券 3,500株
6516	山洋電気	2,000	5,490.00	10,980,000	代用有価証券 1,700株
6592	マブチモーター	2,400	4,480.00	10,752,000	
6616	トレックス・セミコンダクター	8,500	1,678.00	14,263,000	代用有価証券 5,000株
6632	J V C ケンウッド	40,000	305.00	12,200,000	代用有価証券 40,000株
6640	第一精工	9,000	1,526.00	13,734,000	
6703	沖電気工業	9,000	1,338.00	12,042,000	代用有価証券 9,000株
6707	サンケン電気	19,000	603.00	11,457,000	

6724	セイコーエプソン	6,300	1,882.00	11,856,600	
6728	アルバック	2,500	4,190.00	10,475,000	代用有価証券 1,500株
6742	京三製作所	19,000	630.00	11,970,000	代用有価証券 18,000株
6763	帝国通信工業	10,000	1,278.00	12,780,000	代用有価証券 6,000株
6785	鈴木	14,000	802.00	11,228,000	代用有価証券 8,000株
6789	ローランド ディー . ジー .	4,800	2,450.00	11,760,000	
6794	フォスター電機	10,000	1,265.00	12,650,000	
6815	ユニデンホールディングス	37,000	289.00	10,693,000	代用有価証券 23,000株
6820	アイコム	4,700	2,456.00	11,543,200	代用有価証券 3,000株
6844	新電元工業	2,400	4,970.00	11,928,000	代用有価証券 1,300株
6855	日本電子材料	13,500	873.00	11,785,500	代用有価証券 13,500株
6856	堀場製作所	1,500	6,950.00	10,425,000	
6861	キーエンス	200	60,240.00	12,048,000	代用有価証券 100株
6915	千代田インテグレ	5,000	2,272.00	11,360,000	代用有価証券 3,000株
6916	アイ・オー・データ機器	10,300	1,185.00	12,205,500	代用有価証券 6,300株
6923	スタンレー電気	3,400	3,635.00	12,359,000	代用有価証券 2,900株
6962	大真空	9,500	1,331.00	12,644,500	代用有価証券 5,500株
6963	ローム	1,300	9,270.00	12,051,000	
6965	浜松ホトニクス	2,600	4,380.00	11,388,000	代用有価証券 2,500株
6971	京セラ	1,800	6,921.00	12,457,800	
7244	市光工業	10,000	1,164.00	11,640,000	代用有価証券 9,000株
8035	東京エレクトロン	600	18,765.00	11,259,000	代用有価証券 600株
7012	川崎重工業	4,000	3,030.00	12,120,000	
7230	日信工業	6,500	1,820.00	11,830,000	代用有価証券 6,500株
7236	ティラド	3,700	2,964.00	10,966,800	代用有価証券 2,200株
7242	K Y B	2,500	4,455.00	11,137,500	代用有価証券 2,500株
7259	アイシン精機	2,500	5,000.00	12,500,000	代用有価証券 2,500株
7261	マツダ	9,000	1,272.50	11,452,500	
7266	今仙電機製作所	11,000	1,105.00	12,155,000	代用有価証券 6,000株

7270	S U B A R U	3,900	3,320.00	12,948,000	代用有価証券 2,000株
7272	ヤマハ発動機	4,300	2,785.00	11,975,500	
5187	クリエートメディック	6,000	1,228.00	7,368,000	代用有価証券 5,400株
7775	大研医器	16,000	816.00	13,056,000	代用有価証券 11,000株
7820	ニホンフラッシュ	4,500	2,375.00	10,687,500	代用有価証券 4,500株
7868	廣濟堂	23,500	495.00	11,632,500	代用有価証券 15,000株
7911	凸版印刷	15,000	877.00	13,155,000	
7914	共同印刷	4,400	2,826.00	12,434,400	代用有価証券 2,700株
7951	ヤマハ	2,300	5,400.00	12,420,000	
7966	リンテック	4,000	3,005.00	12,020,000	代用有価証券 4,000株
8022	美津濃	3,800	2,980.00	11,324,000	代用有価証券 1,300株
9006	京浜急行電鉄	7,000	1,882.00	13,174,000	代用有価証券 7,000株
9008	京王電鉄	2,400	5,470.00	13,128,000	
9010	富士急行	2,000	3,155.00	6,310,000	
9022	東海旅客鉄道	600	22,265.00	13,359,000	
9069	センコーグループホールディングス	15,000	848.00	12,720,000	代用有価証券 9,000株
9078	エスライン	7,000	1,164.00	8,148,000	代用有価証券 7,000株
9142	九州旅客鉄道	3,500	3,345.00	11,707,500	
9110	N S ユナイテッド海運	5,000	2,241.00	11,205,000	
9058	トランコム	1,500	7,420.00	11,130,000	代用有価証券 1,000株
9304	澁澤倉庫	7,000	1,664.00	11,648,000	
3636	三菱総合研究所	3,000	4,095.00	12,285,000	代用有価証券 3,000株
3654	ヒト・コミュニケーションズ	6,000	1,708.00	10,248,000	
3675	クロス・マーケティンググループ	21,000	545.00	11,445,000	代用有価証券 21,000株
3681	ブイキューブ	22,000	581.00	12,782,000	代用有価証券 14,000株
3751	日本アジアグループ	27,000	420.00	11,340,000	代用有価証券 15,000株
3771	システムリサーチ	3,500	3,740.00	13,090,000	代用有価証券 2,500株
3778	さくらインターネット	17,000	677.00	11,509,000	代用有価証券 10,000株
3817	S R Aホールディングス	4,000	3,250.00	13,000,000	代用有価証券 4,000株
3902	メディカル・データ・ビジョン	7,500	1,750.00	13,125,000	代用有価証券 5,000株

3918	P C Iホールディングス	4,000	2,778.00	11,112,000	代用有価証券 2,500株
3937	U b i c o mホールディングス	13,000	1,004.00	13,052,000	代用有価証券 8,000株
3978	マクロミル	4,000	2,860.00	11,440,000	
4344	ソースネクスト	15,000	852.00	12,780,000	代用有価証券 10,000株
4674	クレスコ	4,500	2,743.00	12,343,500	
4684	オービック	1,300	9,940.00	12,922,000	代用有価証券 1,300株
4687	T D Cソフト	3,500	1,771.00	6,198,500	代用有価証券 3,500株
4716	日本オラクル	1,300	9,030.00	11,739,000	代用有価証券 1,300株
4725	C A C H o l d i n g s	11,500	1,049.00	12,063,500	代用有価証券 7,200株
4743	アイティフォー	12,000	999.00	11,988,000	代用有価証券 12,000株
4779	ソフトブレーン	27,000	437.00	11,799,000	代用有価証券 12,000株
4845	スカラ	11,500	1,166.00	13,409,000	代用有価証券 7,000株
8096	兼松エレクトロニクス	3,000	3,540.00	10,620,000	代用有価証券 2,000株
9613	エヌ・ティ・ティ・データ	9,000	1,418.00	12,762,000	
9928	ミロク情報サービス	5,000	2,395.00	11,975,000	
3053	ベッパーフードサービス	2,000	3,895.00	7,790,000	代用有価証券 2,000株
3107	ダイワボウホールディングス	1,900	6,360.00	12,084,000	代用有価証券 1,300株
3151	バイタルケーエスケー・ホールディングス	10,700	1,201.00	12,850,700	代用有価証券 6,700株
3154	メディアスホールディングス	13,000	855.00	11,115,000	代用有価証券 8,000株
3183	ウイン・パートナーズ	10,000	1,353.00	13,530,000	
7414	小野建	6,500	1,782.00	11,583,000	代用有価証券 4,000株
7467	萩原電気ホールディングス	3,700	3,190.00	11,803,000	代用有価証券 2,500株
7537	丸文	13,000	828.00	10,764,000	代用有価証券 8,000株
7575	日本ライフライン	5,000	2,038.00	10,190,000	代用有価証券 3,000株
7594	マルカキカイ	6,200	1,998.00	12,387,600	代用有価証券 4,000株
8007	高島	3,500	2,050.00	7,175,000	代用有価証券 3,500株
8020	兼松	7,200	1,601.00	11,527,200	代用有価証券 5,000株
8036	日立ハイテクノロジーズ	2,800	4,130.00	11,564,000	代用有価証券 2,600株

8037	カメイ	8,000	1,367.00	10,936,000	代用有価証券 5,000株
8052	椿本興業	3,500	3,250.00	11,375,000	代用有価証券 3,000株
8084	菱電商事	7,000	1,616.00	11,312,000	代用有価証券 4,500株
8137	サンワテクノス	8,000	1,434.00	11,472,000	
8154	加賀電子	5,000	2,098.00	10,490,000	
8159	立花エレテック	6,000	1,893.00	11,358,000	代用有価証券 4,000株
9260	西本Wismettacホールディングス	2,300	4,610.00	10,603,000	代用有価証券 1,300株
9305	ヤマタネ	5,500	2,001.00	11,005,500	
9832	オートバックスセブン	6,000	1,870.00	11,220,000	
9880	イノテック	9,000	1,315.00	11,835,000	
9991	ジェコス	10,300	1,162.00	11,968,600	
2685	アダストリア	9,000	1,362.00	12,258,000	代用有価証券 5,000株
2726	パルグループホールディングス	5,000	2,498.00	12,490,000	代用有価証券 2,800株
2730	エディオン	10,000	1,229.00	12,290,000	代用有価証券 10,000株
2734	サーラコーポレーション	18,000	653.00	11,754,000	代用有価証券 18,000株
2764	ひらまつ	17,000	450.00	7,650,000	代用有価証券 10,000株
3073	DDホールディングス	2,000	2,698.00	5,396,000	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	3,500	2,133.00	7,465,500	代用有価証券 2,500株
3088	マツモトキヨシホールディングス	2,500	4,390.00	10,975,000	代用有価証券 1,500株
3091	ブロンコピリー	2,300	3,445.00	7,923,500	代用有価証券 700株
3097	物語コーポレーション	600	10,310.00	6,186,000	代用有価証券 600株
3099	三越伊勢丹ホールディングス	9,100	1,242.00	11,302,200	代用有価証券 8,100株
3193	鳥貴族	3,000	2,299.00	6,897,000	代用有価証券 2,000株
3194	キリン堂ホールディングス	5,700	1,911.00	10,892,700	代用有価証券 4,700株
3197	すかいらーくホールディングス	3,500	1,654.00	5,789,000	代用有価証券 3,500株
3221	ヨシックス	1,300	2,813.00	3,656,900	代用有価証券 1,300株
3341	日本調剤	3,800	3,320.00	12,616,000	代用有価証券 3,800株
3387	クリエイト・レストランツ・ホールディング	2,000	1,381.00	2,762,000	

3397	トリドールホールディングス	3,000	2,376.00	7,128,000	3,000株 代用有価証券
7475	アルビス	3,500	3,045.00	10,657,500	2,500株 代用有価証券
7508	G - 7ホールディングス	4,500	2,671.00	12,019,500	2,500株 代用有価証券
7516	コーナン商事	5,000	2,547.00	12,735,000	3,000株 代用有価証券
7520	エコス	7,200	1,682.00	12,110,400	4,500株 代用有価証券
7532	ドンキホーテホールディングス	2,400	5,390.00	12,936,000	2,100株 代用有価証券
7596	魚力	8,000	1,500.00	12,000,000	5,500株 代用有価証券
7605	フジ・コーポレーション	4,700	2,555.00	12,008,500	3,000株 代用有価証券
7611	ハイデイ日高	3,000	2,253.00	6,759,000	
8005	スクロール	16,000	864.00	13,824,000	16,000株 代用有価証券
8028	ユニー・ファミリーマートホールディングス	1,200	10,060.00	12,072,000	1,000株 代用有価証券
8227	しまむら	1,200	9,940.00	11,928,000	
8237	松屋	7,800	1,184.00	9,235,200	6,800株 代用有価証券
8267	イオン	5,600	2,446.00	13,697,600	5,600株 代用有価証券
8278	フジ	5,900	2,042.00	12,047,800	5,900株 代用有価証券
8281	ゼビオホールディングス	7,500	1,618.00	12,135,000	4,500株 代用有価証券
9842	アークランドサカモト	8,000	1,462.00	11,696,000	5,000株 代用有価証券
9956	パローホールディングス	5,000	2,339.00	11,695,000	
9983	ファーストリテイリング	200	52,020.00	10,404,000	
3231	野村不動産ホールディングス	5,200	2,424.00	12,604,800	4,700株 代用有価証券
3232	三重交通グループホールディングス	11,500	534.00	6,141,000	11,500株 代用有価証券
3258	ユニゾホールディングス	4,000	2,115.00	8,460,000	2,500株 代用有価証券
3289	東急不動産ホールディングス	16,300	743.00	12,110,900	16,300株 代用有価証券
3291	飯田グループホールディングス	5,700	2,008.00	11,445,600	5,200株 代用有価証券
3299	ムゲンエステート	8,000	727.00	5,816,000	5,000株 代用有価証券
8803	平和不動産	2,000	1,865.00	3,730,000	
8818	京阪神ビルディング	5,000	840.00	4,200,000	
8877	日本エスリード	4,500	1,582.00	7,119,000	2,500株 代用有価証券
8881	日神不動産	13,000	594.00	7,722,000	

8890	レーサム	4,000	1,653.00	6,612,000	
8892	日本エスコン	12,000	702.00	8,424,000	
8935	エフ・ジェー・ネクスト	5,000	963.00	4,815,000	
9706	日本空港ビルデング	2,200	4,880.00	10,736,000	
2124	ジェイエイシーリクルートメント	5,200	2,190.00	11,388,000	代用有価証券 3,200株
2151	タケエイ	13,000	890.00	11,570,000	
2154	トラスト・テック	3,000	4,730.00	14,190,000	代用有価証券 2,000株
2157	コシダカホールディングス	9,500	1,131.00	10,744,500	代用有価証券 4,500株
2174	G C A	14,000	952.00	13,328,000	代用有価証券 14,000株
2183	リニカル	5,000	1,661.00	8,305,000	代用有価証券 5,000株
2196	エスクリ	16,000	766.00	12,256,000	代用有価証券 9,000株
2410	キャリアデザインセンター	7,500	1,599.00	11,992,500	代用有価証券 6,500株
2418	ツカダ・グローバルホールディング	19,000	648.00	12,312,000	代用有価証券 12,000株
2433	博報堂D Yホールディングス	7,000	1,795.00	12,565,000	代用有価証券 6,500株
2749	J Pホールディングス	35,000	309.00	10,815,000	代用有価証券 35,000株
4282	E P Sホールディングス	5,700	2,250.00	12,825,000	代用有価証券 3,200株
4343	イオンファンタジー	2,200	3,860.00	8,492,000	代用有価証券 1,000株
4718	早稲田アカデミー	5,300	1,973.00	10,456,900	代用有価証券 3,200株
6059	ウチヤマホールディングス	23,000	504.00	11,592,000	代用有価証券 14,000株
6065	ライクキッズネクスト	9,000	1,155.00	10,395,000	代用有価証券 8,000株
6082	ライドオンエクスプレスホールディ ングス	6,000	1,626.00	9,756,000	代用有価証券 4,000株
6088	シグマクシス	9,000	1,384.00	12,456,000	
6089	ウィルグループ	11,500	1,004.00	11,546,000	代用有価証券 10,700株
6540	船場	9,000	1,037.00	9,333,000	代用有価証券 7,000株
6547	グリーンズ	8,000	1,357.00	10,856,000	代用有価証券 5,000株
9678	カナモト	3,500	3,415.00	11,952,500	
9715	トランス・コスモス	4,700	2,609.00	12,262,300	代用有価証券 3,000株
9765	オオバ	18,000	630.00	11,340,000	
9792	ニチイ学館	13,000	901.00	11,713,000	代用有価証券 6,000株

合計	2,558,000	3,581,209,050	
----	-----------	---------------	--

(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

銘柄	信用取引		備考
	売建株数	評価額	
ショーボンドホールディングス	1,700	13,260,000	
東建コーポレーション	1,600	12,208,000	
ヤマウラ	15,000	13,305,000	
大林組	11,500	11,983,000	
銭高組	2,300	11,684,000	
奥村組	3,500	11,760,000	
矢作建設工業	14,000	11,690,000	
N I P P O	6,000	12,390,000	
前田道路	6,200	13,168,800	
東亜建設工業	4,700	13,634,700	
きんでん	7,000	12,229,000	
中外炉工業	4,500	12,942,000	
明星工業	15,000	12,330,000	
東芝プラントシステム	5,000	12,175,000	
東洋エンジニアリング	5,000	4,575,000	
千代田化工建設	13,000	10,023,000	
江崎グリコ	2,400	13,704,000	
井村屋グループ	3,700	12,265,500	
不二家	5,000	11,820,000	
モロゾフ	2,000	11,320,000	
六甲バター	5,200	13,026,000	
ヤクルト本社	1,600	12,544,000	
日本ハム	2,800	11,396,000	
サッポロホールディングス	5,000	11,730,000	
不二製油グループ本社	3,500	11,760,000	
かどや製油	2,100	13,083,000	
キッコーマン	2,300	12,650,000	
ハウス食品グループ本社	1,900	6,289,000	
東洋水産	3,200	12,848,000	
日清食品ホールディングス	1,700	11,968,000	
一正蒲鉾	10,000	10,400,000	

アツギ	11,000	12,716,000	
セーレン	7,300	13,220,300	
T S Iホールディングス	15,000	11,250,000	
マツオカコーポレーション	4,000	15,060,000	
大王製紙	8,000	12,144,000	
旭化成	8,000	12,712,000	
日産化学	2,500	12,550,000	
クレハ	800	5,992,000	
石原産業	10,000	16,440,000	
大陽日酸	7,800	12,214,800	
戸田工業	4,100	11,324,200	
ステラ ケミファ	3,500	13,650,000	
保土谷化学工業	3,900	12,714,000	
三菱ケミカルホールディングス	13,100	12,763,330	
K Hネオケム	3,600	13,824,000	
住友ベークライト	8,000	8,640,000	
ダイキョーニシカワ	8,000	11,696,000	
竹本容器	4,000	11,616,000	
扶桑化学工業	4,700	12,699,400	
トリケミカル研究所	3,200	13,920,000	
花王	1,400	11,708,200	
日本ペイントホールディングス	2,700	11,394,000	
関西ペイント	5,500	11,830,500	
中国塗料	11,000	11,275,000	
サカタインクス	8,000	11,376,000	
高砂香料工業	3,500	13,510,000	
ファンケル	2,000	10,920,000	
シーボン	2,500	6,410,000	
アグロ カネショウ	4,600	12,539,600	
デクセリアルズ	11,000	12,485,000	
協和発酵キリン	5,600	10,869,600	
武田薬品工業	2,800	12,924,800	
田辺三菱製薬	5,200	9,911,200	
あすか製薬	9,000	12,132,000	
生化学工業	9,000	13,761,000	
鳥居薬品	4,800	12,964,800	
富士製薬工業	7,000	12,586,000	
第一三共	2,800	12,339,600	
日本コークス工業	40,000	4,520,000	
出光興産	2,900	15,747,000	
J X T Gホールディングス	15,600	12,130,560	
日本電気硝子	3,900	13,669,500	

太平洋セメント	3,500	11,987,500	
日本コンクリート工業	38,000	12,768,000	
TOTO	2,500	11,662,500	
黒崎播磨	1,500	12,450,000	
ニッカトー	9,000	13,500,000	
フジインコーポレーテッド	5,000	14,270,000	
東京製鐵	13,000	11,466,000	
日本高周波鋼業	16,000	12,256,000	
山陽特殊製鋼	4,500	10,858,500	
日立金属	10,000	12,540,000	
大平洋金属	3,500	13,090,000	
栗本鐵工所	3,000	5,241,000	
古河機械金属	7,000	12,663,000	
大阪チタニウムテクノロジーズ	3,500	5,449,500	
東邦チタニウム	6,000	6,486,000	
稲葉製作所	8,000	10,088,000	
トーカロ	8,000	9,992,000	
川田テクノロジーズ	1,700	9,469,000	
RS Technologies	1,800	9,738,000	
横河ブリッジホールディングス	5,000	10,600,000	
高田機工	1,200	3,394,800	
三協立山	8,000	10,624,000	
LIXILグループ	6,200	12,914,600	
長府製作所	4,700	11,341,100	
高周波熱錬	10,000	10,000,000	
パイオラックス	5,000	12,155,000	
エイチワン	9,000	11,754,000	
アドバネクス	6,800	12,505,200	
三浦工業	4,700	14,335,000	
タクマ	9,000	12,285,000	
豊和工業	12,000	11,304,000	
OKK	5,000	5,390,000	
オプトラン	3,800	11,476,000	
レオン自動機	6,000	11,760,000	
新川	14,000	8,820,000	
ユニオンツール	3,200	11,792,000	
オイレス工業	5,200	11,887,200	
サトーホールディングス	3,600	12,312,000	
カワタ	6,000	13,314,000	
オカダアイヨン	4,000	6,944,000	
巴工業	3,200	7,577,600	
井関農機	6,000	11,418,000	

クボタ	6,900	11,712,750	
ダイキン工業	900	12,366,000	
ダイフク	2,300	12,397,000	
理想科学工業	5,500	14,652,000	
福島工業	2,400	12,168,000	
竹内製作所	3,000	7,947,000	
I H I	3,300	12,573,000	
コニカミノルタ	11,500	12,730,500	
メルコホールディングス	3,100	13,082,000	
日本電気	4,200	12,595,800	
富士通	8,000	6,306,400	
アンリツ	8,500	13,846,500	
富士通ゼネラル	7,000	12,481,000	
ソニー	1,100	6,660,500	
T D K	1,100	12,870,000	
アルプス電気	4,200	13,650,000	
パイオニア	40,000	5,200,000	
日本トリム	2,000	11,840,000	
横河電機	6,000	13,020,000	
東亜ディーケーケー	9,000	10,989,000	
日本光電工業	2,000	6,370,000	
日置電機	2,500	9,925,000	
メガチップス	2,000	4,192,000	
イリソ電子工業	2,000	12,120,000	
レーザーテック	4,200	16,905,000	
日本セラミック	4,000	11,836,000	
ファナック	500	10,695,000	
日本シイエムケイ	17,000	12,223,000	
三井ハイテック	8,200	12,595,200	
太陽誘電	4,500	13,927,500	
村田製作所	600	10,977,000	
双葉電子工業	6,000	12,060,000	
小糸製作所	1,800	12,078,000	
リコー	13,000	14,885,000	
トヨタ紡織	6,000	11,568,000	
デンソー	2,300	11,927,800	
名村造船所	25,500	12,112,500	
日本車輛製造	33,000	9,141,000	
三菱ロジスネクスト	10,000	11,970,000	
近畿車輛	5,200	12,235,600	
トヨタ自動車	1,700	11,611,000	
日野自動車	10,000	11,430,000	

新明和工業	10,000	13,270,000	
曙ブレーキ工業	20,000	4,700,000	
ケーヒン	6,000	13,434,000	
スズキ	1,800	12,974,400	
エフ・シー・シー	3,600	11,430,000	
ジャムコ	5,000	15,225,000	
日機装	11,000	13,629,000	
島津製作所	4,000	12,220,000	
マニー	1,500	7,222,500	
トプコン	7,000	12,649,000	
オリンパス	2,900	13,093,500	
ニプロ	6,000	8,922,000	
前田工織	6,000	11,574,000	
フランスベッドホールディングス	12,000	11,352,000	
パイロットコーポレーション	2,000	12,560,000	
トッパン・フォームズ	10,500	11,056,500	
フジシールインターナショナル	3,200	12,496,000	
N I S S H A	5,000	11,115,000	
アシックス	6,800	11,138,400	
河合楽器製作所	2,700	13,378,500	
コクヨ	6,500	12,499,500	
グローブライド	3,500	10,416,000	
オカムラ	7,800	11,528,400	
東武鉄道	4,300	13,265,500	
東京急行電鉄	6,800	12,185,600	
鴻池運輸	7,000	12,110,000	
近鉄グループホールディングス	3,100	13,314,500	
神戸電鉄	3,200	12,800,000	
名古屋鉄道	4,600	11,799,000	
日本通運	1,700	11,815,000	
山九	2,000	11,440,000	
福山通運	2,300	12,052,000	
セイノーホールディングス	6,500	11,199,500	
日立物流	4,000	12,160,000	
日本郵船	6,100	12,297,600	
飯野海運	22,500	12,285,000	
三菱倉庫	4,700	11,928,600	
川西倉庫	3,500	5,274,500	
キューソー流通システム	3,300	9,078,300	
近鉄エクスプレス	5,000	10,700,000	
新日鉄住金ソリューションズ	3,500	12,127,500	
ソリトンシステムズ	4,000	4,068,000	

テクノスジャパン	12,000	11,436,000	
ベリサーブ	2,800	12,558,000	
セック	4,000	15,860,000	
GMOクラウド	2,000	7,900,000	
アバント	11,000	15,950,000	
アドソル日進	7,500	14,070,000	
オロ	3,000	15,210,000	
フジ・メディア・ホールディングス	6,000	11,478,000	
ジャストシステム	5,500	10,428,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,600	13,968,000	
サイボウズ	25,000	18,225,000	
EMシステムズ	10,000	11,120,000	
ネットワンシステムズ	5,500	12,611,500	
東京放送ホールディングス	5,500	12,595,000	
テレビ東京ホールディングス	4,000	10,896,000	
学研ホールディングス	2,700	11,650,500	
ゼンリン	4,500	14,332,500	
インプレスホールディングス	55,000	10,120,000	
S C S K	2,500	12,675,000	
富士ソフト	2,800	14,336,000	
伊藤忠食品	2,100	11,613,000	
アルフレッサ ホールディングス	4,800	12,715,200	
横浜冷凍	13,000	11,700,000	
神戸物産	2,000	10,340,000	
あい ホールディングス	5,000	11,370,000	
ラクト・ジャパン	2,000	11,660,000	
U K Cホールディングス	5,500	12,677,500	
三菱食品	4,500	13,567,500	
松田産業	8,000	12,160,000	
メディバルホールディングス	5,700	12,465,900	
小津産業	6,300	12,467,700	
エクセル	5,000	10,490,000	
シークス	5,000	10,415,000	
三菱商事	2,600	8,101,600	
菱洋エレクトロ	7,000	12,159,000	
東京産業	17,000	13,073,000	
正栄食品工業	3,000	11,730,000	
三愛石油	9,500	12,283,500	
ワキタ	9,000	11,241,000	
東邦ホールディングス	4,500	12,919,500	
サンリオ	6,000	13,758,000	
東陽テクニカ	14,000	12,586,000	

モスフードサービス	3,000	8,928,000	
三谷産業	37,000	12,395,000	
トラスコ中山	4,700	13,296,300	
バイテックホールディングス	5,000	10,310,000	
ミスミグループ本社	4,000	11,500,000	
ローソン	2,000	13,560,000	
サンエー	1,200	6,228,000	
大黒天物産	2,500	10,762,500	
ハニーズホールディングス	11,000	11,121,000	
ビックカメラ	7,500	10,965,000	
J・フロント リテイリング	7,000	11,340,000	
ドトール・日レスホールディングス	2,000	4,024,000	
ココカラファイン	1,800	11,556,000	
ジョイフル本田	8,000	13,112,000	
綿半ホールディングス	4,000	11,100,000	
薬王堂	3,700	14,115,500	
クスリのアオキホールディングス	1,500	13,665,000	
カッパ・クリエイト	6,000	8,106,000	
ライトオン	12,000	12,504,000	
ワタミ	5,000	6,095,000	
幸楽苑ホールディングス	5,000	8,110,000	
ハークスレイ	8,000	8,408,000	
木曾路	3,500	9,198,000	
ケーヨー	24,000	12,792,000	
上新電機	1,800	5,400,000	
いなげや	7,000	11,501,000	
チヨダ	6,000	13,164,000	
ライフコーポレーション	4,000	10,692,000	
AOKIホールディングス	8,000	12,024,000	
丸井グループ	5,100	12,372,600	
イズミ	1,600	10,672,000	
ヤオコー	2,000	12,280,000	
ヤマダ電機	22,500	12,195,000	
松屋フーズ	2,500	9,137,500	
サガミチェーン	5,000	6,990,000	
大庄	4,000	6,992,000	
サックスパー ホールディングス	12,000	10,560,000	
いちご	15,000	6,690,000	
ヒューリック	11,800	12,095,000	
スター・マイカ	4,000	8,536,000	
ディア・ライフ	10,000	5,350,000	
パーク24	4,000	13,000,000	

三井不動産	5,000	12,485,000	
ダイビル	7,000	7,889,000	
住友不動産	3,000	11,295,000	
東京楽天地	2,000	10,040,000	
カチタス	2,000	7,130,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	7,000	8,484,000	
エス・エム・エス	6,500	13,169,000	
スタジオアリス	4,500	11,286,000	
シミックホールディングス	5,000	11,780,000	
ツクイ	13,500	13,540,500	
ジャパンベストレスキューシステム	16,000	17,088,000	
WDBホールディングス	3,500	13,247,500	
プレステージ・インターナショナル	9,000	11,133,000	
ケネディクス	13,000	8,801,000	
電通	2,600	13,494,000	
ぴあ	2,200	11,308,000	
明光ネットワークジャパン	11,000	12,320,000	
リゾートトラスト	4,500	8,086,500	
りらいあコミュニケーションズ	8,000	11,688,000	
ユー・エス・エス	2,500	5,200,000	
東京個別指導学院	11,000	16,467,000	
テクノプロ・ホールディングス	1,800	11,952,000	
Keeper 技研	7,000	7,749,000	
ジャパンマテリアル	7,300	10,468,200	
リクルートホールディングス	4,000	13,732,000	
ベルシステム24ホールディングス	6,000	11,082,000	
ソラスト	11,000	13,376,000	
ナガワ	2,400	11,208,000	
東京都競馬	1,700	6,851,000	
KNT-CTホールディングス	8,500	10,404,000	
セコム	1,400	12,745,600	
セントラル警備保障	2,500	10,800,000	
イオンディライト	3,200	12,496,000	
合計	2,087,400	3,604,396,840	

### 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30年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	292,575,692
負債総額	10,995,296
純資産総額（ - ）	281,580,396
発行済口数	230,187,800口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.2233
（10,000口当たり）	（12,233）

（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30年 8月31日現在

（単位：円）

資産総額	7,843,189,809
負債総額	3,743,328,711
純資産総額（ - ）	4,099,861,098
発行済口数	2,831,440,839口
1口当たり純資産価額（ / ）	1.4480
（10,000口当たり）	（14,480）

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

## （1）名義書換等

該当事項はありません。

ファンドの受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まり、委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

## （2）受益者等に対する特典

該当事項はありません。

( 3 ) 譲渡制限の内容

該当事項はありません。

( 4 ) 受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等に振替の申請をするものとし、

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとし、

ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとし、

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿に係る振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

( 5 ) 受益権の譲渡の対抗要件

受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。

( 6 ) 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、解約請求の受付け、解約代金および償還金の支払い等については、信託約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第二部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

##### （1）資本金の額等

2018年8月末現在、資本金は2,000百万円です。なお、発行可能株式総数は400,000株であり、211,581株を発行済です。最近5年間における資本金の額の増減はありません。

##### （2）委託会社の機構

###### ・会社の意思決定機構

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

###### ・投資運用の意思決定機構

###### 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。

###### ファンドに係る法人等の管理

受託会社等、ファンドの運営に係る法人については、その業務に関する委託会社の管理担当部署が、体制、業務執行能力、信用力等のモニタリング・評価を実施します。この結果は、リスク管理委員会等を通じて委託会社の経営陣に報告され、必要に応じて是正が指示されます。

###### 運用・管理に関する監督

内部監査担当部署は、運用、管理等に関する委託会社の業務全般についてその健全性・適切性を担保するために、リスク管理、内部統制、ガバナンス・プロセスの適切性・有効性を検証・評価します。その評価結果は問題点の改善方法の提言等も含めて委託会社の経営陣に報告される、内部監査態勢が構築されています。

ファンドの運用体制等は、今後変更される可能性があります。

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

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

2018年8月31日現在における委託会社の運用する証券投資信託は以下の通りです。(親投資信託を除きます。)

商品分類	本数 (本)	純資産総額 (百万円)
追加型株式投資信託	873	12,276,929
追加型公社債投資信託	16	1,273,683
単位型株式投資信託	58	284,760
単位型公社債投資信託	1	6,001
合計	948	13,841,372

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

### 3【委託会社等の経理状況】

#### (1) 財務諸表の作成方法について

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

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。

#### (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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金合計	
						別途積立金	繰越利益剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	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								
	資本金	資本剰余金			利益剰余金				株主資本合計
		資本 準備金	その他 資本剰余金	資本 剰余金合計	利益 準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
						別途 積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,131	3,572,096	41,160,616	44,732,712	342,589	6,998,000	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 (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)
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 (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)
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つのグループニ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プニ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、記載しておりません。

## 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）	
		千円		千円
退職給付債務の期首残高	2,997,931		3,649,089	
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 （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）	
		千円		千円
年金資産の期首残高	2,678,827		2,698,738	
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 (平成29年3月31日現在)	第33期 (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 (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)
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	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

会社						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	5,528,131 千円	未払手数料	665,262 千円
						投資の助言 役員の兼任	投資助言料	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㈱	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

## 4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己またはその取締役もしくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと（投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。）。

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等（委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。）または子法人等（委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。）と有価証券の売買その他の取引または店頭デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等または子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額もしくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等または子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、もしくは取引の公正を害し、または金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為

## 5【その他】

定款の変更等

定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

訴訟事件その他重要事項

該当事項はありません。

## 第2【その他の関係法人の概況】

## 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

## (1) 受託会社

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3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3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。

## 2【関係業務の概要】

(1) 受託会社：ファンドの受託会社として、信託財産の保管・管理等を行います。

(2) 販売会社：ファンドの募集の取扱い、解約の取扱い、収益分配金・償還金の支払いの取扱い等を行います。

## 3【資本関係】

委託会社と関係法人の主な資本関係は次の通りです。(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。

## 第3【参考情報】

ファンドについては、当計算期間において以下の書類が提出されております。

提出年月日	提出書類
2018年 5月25日	有価証券届出書の訂正届出書
2018年 5月25日	有価証券報告書

# 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。

独立監査人の監査報告書

平成30年9月26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2月27日から平成30年8月24日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

**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30年8月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**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。