

業務及び財産の状況に関する説明書

【2020年3月期】

この説明書は、金融商品取引法第46条の4の規定に基づき、全ての営業所若しくは事務所に備え置いて公衆の縦覧に供するため、又はインターネット等で公表するために作成したものです。

I. 当社の概況及び組織に関する事項

1. 商号

三菱UFJオルタナティブインベストメンツ株式会社

2. 登録年月日（登録番号）

2007年9月30日（関東財務局長（金商）第176号）

3. 沿革及び経営の組織

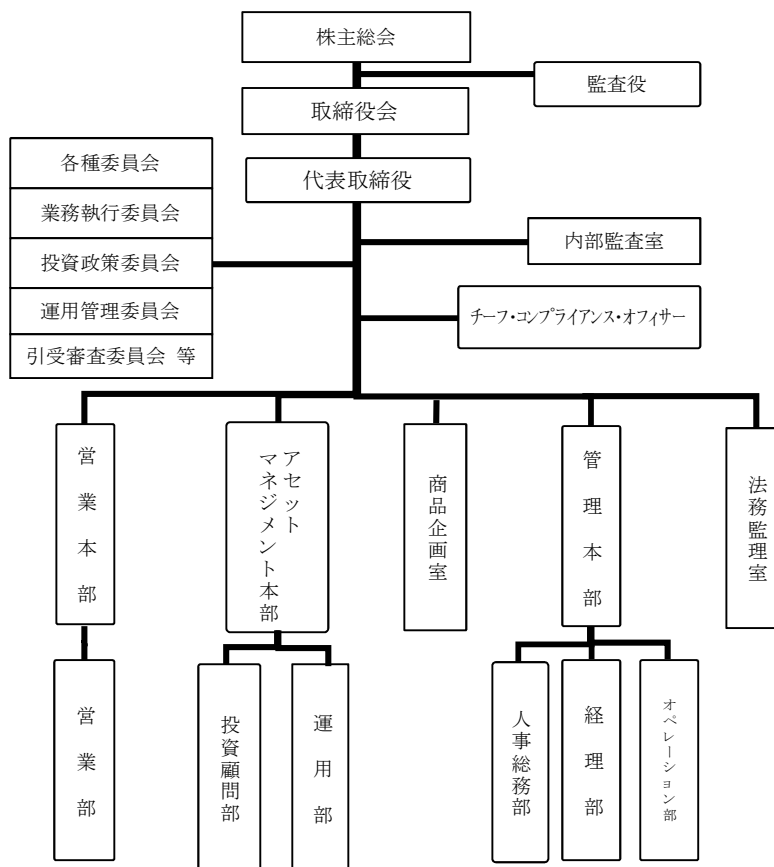
(1) 会社の沿革

年 月	沿 革
1999年 2月	三菱商事株式会社の100%子会社として設立
同 4月	投資顧問業（助言業務）及び証券業務の登録を完了し、営業開始
同 6月	情報提供、コンサルティング業務を開始
同 7月	投資顧問業（投資一任契約に係る業務）を開始
2000年 8月	リミテッド・パートナーシップ契約の締結の媒介、取次ぎ又は代理業務を開始
同 10月	組合契約又は中小企業等投資事業有限責任組合契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務並びに匿名組合契約の締結の媒介、取次ぎ又は代理に係る業務を開始
2004年 10月	国内外において有価証券及びその他の資産運用業務に携わる者から同運用業務に関わるバックオフィス業務並びにリスクの分析及び管理に関わる業務の全部又は一部を受託する業務を開始
同 10月	海外において有価証券及びその他の資産の運用業務に携わる者から、その対象とする外国籍の投資信託及びそのために実施する運用業務に関連して本邦において必要が生じる投資家対応等の一定の事務処理に関わる業務を受託する業務を開始
2006年 12月	金銭債権の売買又はその媒介、取次ぎ若しくはその代理に係る業務を開始
2007年 9月	金融商品取引法に基づく金融商品取引業者として登録
2009年 10月	他の事業者のあっせん又は紹介を行なう業務を開始
同 10月	他の事業者の業務に関する広告又は宣伝を行なう業務を開始
2010年 9月	資本金の額を30億円に減資
同 10月	三菱商事アセットマネジメント株式会社に商号変更
2012年 4月	商品先物に係る投資運用契約の代理・媒介業務及び投資運用契約の支援業務を開始
2016年 5月	引受業務（及び売出業務）を開始
2018年 3月	資本金の額を20億円に減資。本店を移転
2020年 3月	資本金の額を10億円に減資。
2020年 6月	三菱UFJオルタナティブインベストメンツ株式会社に商号変更。

(2) 経営の組織

当社の経営組織の概要は、次のとおりであります。

2020年6月30日現在



4. 株式の保有数の上位10位までの株主の氏名又は名称並びにその株式の保有数及び総株主等の議決権に占める当該株式に係る議決権の数の割合

2020年6月30日現在

氏名又は名称	保有株式数	割合
三菱UFJ信託銀行株式会社	株 100,000	% 100.00

5. 役員の氏名又は名称

2020年6月30日現在

役職名	氏名又は名称	代表権の有無	常勤・非常勤の別
代表取締役社長	猿田昌洋	有	常勤
取締役	星野守男	無	常勤
取締役	成川順一	無	非常勤

取締役	森山亮	無	非常勤
監査役	名村祥夫	—	常勤
監査役	矢矧由希夫	—	非常勤

以上6名

6. 政令で定める使用人の氏名

2020年6月30日現在

- (1) 金融商品取引業に関し、法令等（法令、法令に基づく行政官庁の処分又は定款その他の規則をいう。）を遵守させるための指導に関する業務を統括する者（部長、次長、課長その他いかなる名称を有する者であるかを問わず、当該業務を統括する者の権限を代行し得る地位にある者を含む。）の氏名

氏名	役職名
坂野康裕	法務監理室長

- (2) 投資助言業務（金融商品取引法（以下「法」という。）第28条第6項に規定する投資助言業務をいう。）又は投資運用業（同条第4項に規定する投資運用業をいう。）に関し、助言又は運用（その指図を含む。）を行う部門を統括する者（金融商品の価値等（法第2条第8項第11号ロに規定する金融商品の価値等をいう。）の分析に基づく投資判断を行う者を含む。）の氏名

氏名	役職名
山本雷三	アセットマネジメント本部長 兼 運用部長
吉田裕一	アセットマネジメント本部 投資顧問部長
倉ヶ崎伸一	アセットマネジメント本部 投資顧問部 兼 運用部

7. 業務の種別

- ・ 第一種金融商品取引業
(法第 28 条第 1 項第 1 号に掲げる行為に係る業務及び有価証券等管理業務)
- ・ 第二種金融商品取引業
- ・ 投資助言・代理業
- ・ 投資運用業

8. 本店その他の営業所又は事務所の名称及び所在地

名 称	所 在 地
本店	〒100-0011 東京都千代田区内幸町二丁目 1 番 6 号

9. 他に行っている事業の種類

- ・ 組合契約・匿名組合契約の締結又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- ・ 他の事業者のあっせん又は紹介を行う業務
- ・ 他の事業者の業務に関する広告又は宣伝を行う業務
- ・ 金銭債権の売買又はその媒介、取次ぎ若しくは代理に係る業務
- ・ 外国のリミテッド・パートナーシップ契約の締結の媒介、取次ぎ又は代理に係る業務
- ・ 国内外において有価証券及びその他の資産運用業務に携わる者から同運用業務に関わるバックオフィス業務並びにリスクの分析及び管理に関わる業務の全部又は一部を受託する業務
- ・ 海外において有価証券及びその他の資産の運用業務に携わる者から、その対象とする外国籍の投資信託及びそのために実施する運用業務に関連して本邦において必要が生じる投資家対応等の一定の事務処理に関わる業務を受託する業務
- ・ 商品先物に係る投資運用契約の代理・媒介業務及び投資運用契約の支援業務

10. 苦情処理及び紛争解決の体制

第一種金融商品取引業：特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター（以下「FINMAC」）との間で、特定第一種金融商品取引業務に係る手続実施基本契約を締結し、FINMACを利用する措置。

第二種金融商品取引業：FINMACに個別利用登録を行い、FINMACを利用する措置。

投資助言・代理業：一般社団法人日本投資顧問業協会を利用（FINMACに業務委託）する措置。

投資運用業：一般社団法人日本投資顧問業協会を利用（FINMACに業務委託）する措置。

11. 加入する金融商品取引業協会及び対象事業者となる認定投資者保護団体の名称
日本証券業協会
一般社団法人 日本投資顧問業協会
特定非営利活動法人 証券・金融商品あっせん相談センター

12. 会員又は取引参加者となる金融商品取引所の名称又は商号
該当なし

13. 加入する投資者保護基金の名称
日本投資者保護基金

Ⅱ. 業務の状況に関する事項

1. 当期の業務の概要

当期は、マイナス金利政策に伴う運用難が続く中、元本の流動性を犠牲にしても安定的なキャッシュフローを求める動きは引き続き継続しており、コロナウィルス感染拡大が一時的に金融市場へ混乱をもたらすことはあるものの、中長期的には投資家の不動産による不動産ファンド・インフラファンド、プライベートエクイティファンド等のオルタナティブ商品への関心は引き続き高いものがあります。投資家による優良アセットの選別や同業他社との競合も厳しさを増してきており、投資家の動向・ニーズを的確且つタイムリーに把握した上で最適な投資商品を提供する営業力・分析力・商品企画力が一層求められてきています。

このような事業環境下、証券業務関連においては、プライベートエクイティ、不動産及びインフラ関連ファンド等のオルタナティブ商品の取扱いが好調だったため、取扱高が大幅に増加しました。また、投資顧問業務においては、引続きマーケティングの重点対象先である企業年金基金に対して一任勧誘を進めた結果、預り残高を大幅に伸長することができ、投資一任契約の契約資産残高は2,232億円となり前期に比べ231億円増加しました。以上のことなどから当期の営業収益は1,807百万円となり前期に比べ481百万円増加しました。販売費及び一般管理費は、旅費交通費等の減少などにより990百万円となり前期に比べ12百万円減少しました。経常損益は929百万円となり前期に比べ486百万円増加しました。法人税等を控除した当期純利益は640百万円となり前期に比べ328百万円増加しました。

2. 業務の状況を示す指標

(1) 経営成績等の推移

(単位：百万円)

	2018年3月期	2019年3月期	2020年3月期
資本金	2,000	2,000	1,000
発行済株式総数	100,000株	100,000株	100,000株
営業収益	1,726	1,325	1,807
受入手数料	1,662	1,313	1,807
(委託手数料)	—	—	4
(引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料)	—	—	—
(募集・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の取扱い手数料)	689	393	894
(その他の受入手数料)	973	920	907
(株券)	3	3	2
(受益証券)	188	143	29
(その他)	780	773	875
(投資一任報酬の運用受託報酬)	613	684	720
(投資助言・代理報酬)	—	—	4
(その他)	167	88	150
トレーディング損益	64	11	—
(株券等)	64	11	—
(債券等)	—	—	—
(その他)	—	—	—
純営業収益	1,726	1,325	1,807
経常利益	614	443	929
当期純利益	358	312	640

(2) 有価証券引受・売買等の状況

① 株券の売買高の推移

(単位：百万円)

	2018年3月期	2019年3月期	2020年3月期
自 己	12,777	2,334	—
委 託	—	—	—
計	12,777	2,334	—

② 有価証券の引受け及び売出し並びに特定投資家向け売付け勧誘等並びに有価証券の募集、
売出し及び私募の取扱い並びに特定投資家向け売付け勧誘等の取扱いの状況

(単位：千株、百万円)

区 分		引受高	売出高	特定投資 家向け売 付け勧誘 等の総額	募集の 取扱高	売出しの 取扱高	私募の 取扱高	特定投資家 向け売付け 勧誘等の取 扱高
2 0 1 8 年 3 月 期	株券	—	—	—	—	—	116	—
	国債証券	—	/	/	—	/	—	—
	地方債証券	—	/	/	—	/	—	—
	特殊債券	—	—	—	—	—	—	—
	社債券	—	—	—	—	—	—	—
	受益証券	/	/	/	—	—	19,930	—
	その他	—	—	—	—	—	101,617	—
2 0 1 9 年 3 月 期	株券	—	—	—	—	—	125	—
	国債証券	—	/	/	—	/	—	—
	地方債証券	—	/	/	—	/	—	—
	特殊債券	—	—	—	—	—	—	—
	社債券	—	—	—	—	—	—	—
	受益証券	/	/	/	—	—	1,701	—
	その他	—	—	—	—	—	45,198	—
2 0 2 0 年 3 月 期	株券	—	—	—	—	—	40	—
	国債証券	—	/	/	—	/	—	—
	地方債証券	—	/	/	—	/	—	—
	特殊債券	—	—	—	—	—	—	—
	社債券	—	—	—	—	—	—	—
	受益証券	/	/	/	—	—	2,000	—
	その他	—	—	—	—	—	95,408	—

(3) その他業務の状況

(単位：百万円)

	2018年 3月期	2019年 3月期	2020年 3月期
商品先物に係る投資運用契約の代理・媒介業務及び投資運用契約の支援業務（注）	147	110	4

上記には重要性が高いと判断した内容についてのみ記載しております。重要性が低いと判断したその他業務の内容については、5ページに記載しております。

（注）当該手数料は、助言業務、代理・媒介及びその他業務別に区分することが困難であるため、すべて一括してその他業務の手数料として計上しています。

(4) 自己資本規制比率の状況

(単位：%、百万円)

	2018年3月期	2019年3月期	2020年3月期
自己資本規制比率（A/B×100）	401.4	522.7	329.8
固定化されていない自己資本（A）	1,907	2,051	1,459
リスク相当額（B）	475	392	442
市場リスク相当額	6	1	3
取引先リスク相当額	182	126	206
基礎的リスク相当額	285	263	232

(5) 使用人の総数及び外務員の総数

(単位：名)

	2018年3月期	2019年3月期	2020年3月期
使用人	46	44	46
（うち外務員）	27	26	27

Ⅲ. 財産の状況に関する事項

1. 経理の状況

(1) 貸借対照表

(単位：百万円)

科 目	資 産 の 部	
	第 21 期 (2019年3月31日現在)	第 22 期 (2020年3月31日現在)
	金 額	金 額
流動資産	2,794	2,223
現金・預金	2,373	1,459
預託金	0	0
立替金	0	0
前払費用	5	5
未収収益	415	757
その他	0	0
固定資産	367	327
有形固定資産	96	93
建物	66	62
器具備品	29	30
無形固定資産	8	8
ソフトウェア	8	8
投資その他の資産	262	225
関係会社株式	56	9
長期差入保証金	88	86
長期前払費用	1	1
繰延税金資産	111	125
その他	4	3
資 産 合 計	3,161	2,550

負 債 の 部		
科 目	第 21 期	第 22 期
	(2019 年 3 月 31 日現在)	(2020 年 3 月 31 日現在)
	金 額	金 額
流動負債	303	592
預り金	8	50
未払金	93	272
未払費用	181	194
未払法人税等	18	73
その他	1	0
固定負債	150	166
退職給付引当金	150	166
負債合計	453	758
純 資 産 の 部		
株主資本	2,708	1,792
資本金	2,000	1,000
資本剰余金	170	124
資本準備金	169	124
その他資本剰余金	0	0
利益剰余金	537	667
利益準備金	224	25
その他利益剰余金	313	641
繰越利益剰余金	313	641
純資産合計	2,708	1,792
負債・純資産合計	3,161	2,550

(2) 損益計算書

(単位：百万円)

	第 21 期		第 22 期	
	自 2018 年 4 月 1 日 至 2019 年 3 月 31 日		自 2019 年 4 月 1 日 至 2020 年 3 月 31 日	
	金 額		金 額	
営業収益		1,325		1,807
受入手数料	1,313		1,807	
トレーディング損益	11		—	
金融収益	—		—	
金融費用		—		—
純営業収益		1,325		1,807
販売費・一般管理費		1,003		990
営業利益		322		816
営業外収益		130		133
営業外費用		9		19
経常利益		443		929
特別利益		—		—
固定資産売却益	—		—	
特別損失		0		—
固定資産除売却損	0		—	
税引前当期純利益		443		929
法人税等	101		303	
法人税等調整額	29		△14	
当期純利益		312		640

(3) 株主資本等変動計算

株主資本等変動計算書

(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							株主資本計	純資産合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	2,000	169	0	170	192	358	550	2,720	2,720
当期変動額									
利益準備金の積立					32	△ 32	-	-	-
剰余金の配当						△ 325	△ 325	△ 325	△ 325
当期純利益						312	312	312	312
当期変動額合計	-	-	-	-	32	△ 45	△ 12	△ 12	△ 12
当期末残高	2,000	169	0	170	224	313	537	2,708	2,708

株主資本等変動計算書

(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本							株主資本計	純資産合計
	資本金	資本剰余金			利益準備金	利益剰余金			
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金合計		
当期首残高	2,000	169	0	170	224	313	537	2,708	2,708
当期変動額									
減資	△ 1,000		1,000	1,000				-	-
資本準備金の積立		△ 45	45	-				-	-
利益準備金の積立					△ 198	198	-	-	-
剰余金の配当			△ 1,045	△ 1,045		△ 511	△ 511	△ 1,556	△ 1,556
当期純利益						640	640	640	640
当期変動額合計	△ 1,000	△ 45	-	△ 45	△ 198	328	129	△ 916	△ 916
当期末残高	1,000	124	0	124	25	641	667	1,792	1,792

注 記 事 項

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

(1) 資産の評価基準及び評価方法

①トレーディング商品に属さない有価証券の評価基準及び評価方法

子会社株式及び関連会社株式 移動平均法に基づく原価法

②デリバティブの評価基準及び評価方法

デリバティブ 時価法

(2) 固定資産の減価償却の方法

①有形固定資産

建物 定額法

工具器具備品 定率表

主な耐用年数は以下の通りであります。

建物 8～18年 工具器具備品 4～15年

②無形固定資産

自社利用のソフトウェア 定額法(見込利用可能期間5年)

(3) 引当金の計上基準

退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当期末における自己都合要支給額を計上しております。

(4) その他計算書類作成のための基本となる重要な事項

①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、決算日の直物為替相場により円貨に換算し、換算差額は損益として処理しております。

②消費税等の会計処理

税抜方式によっております。

③連結納税制度の適用

連結納税制度を適用しております。

(貸借対照表に関する注記)

(単位：百万円)

2019年3月期		2020年3月期	
1	有形固定資産の減価償却累計額	1	有形固定資産の減価償却累計額
	建物		建物
	4		9
	器具・備品		器具・備品
	12		22
	計		計
	17		31
2	関係会社に対する金銭債権及び金銭債務	2	関係会社に対する金銭債権及び金銭債務
	短期金銭債権		短期金銭債権
	27		1
	短期金銭債務		短期金銭債務
	80		231

(損益計算書に関する注記)

(単位：百万円)

2019年3月期				2020年3月期				
1	受入手数料の内訳			1	受入手数料の内訳			
	委託手数料		—		委託手数料		4	
	募集・売出し・特定投資家向		393		募集・売出し・特定投資家向		894	
	け売付け勧誘等の取扱手数料				け売付け勧誘等の取扱手数料			
	その他の手数料		920		その他の手数料		907	
	株式		3		株式		2	
	受益証券		143		受益証券		29	
	その他		773		その他		875	
	投資一任契約の運用受託報酬		684		投資一任契約の運用受託報酬		720	
	その他		88		投資助言・代理報酬		4	
	計		1,313		計		1,807	
2	トレーディング損益の内訳			2	トレーディング損益の内訳			
		実現	評価			実現	評価	
		損益	損益			損益	損益	
			合計				合計	
	株券等トレーディング損益	11	—	11	株券等トレーディング損益	—	—	—
	債券等トレーディング損益	—	—	—	債券等トレーディング損益	—	—	—
	その他のトレーディング損益	—	—	—	その他のトレーディング損益	—	—	—
	計	11	—	11	計	—	—	—

(単位：百万円)

2019年3月期		2020年3月期	
3	販売費・一般管理費の内訳	3	販売費・一般管理費の内訳
	取引関係費		取引関係費
	128		108
	人件費		人件費
	703		704
	不動産関係費		不動産関係費
	102		105
	事務費		事務費
	9		9
	減価償却費		減価償却費
	16		17
	租税公課		租税公課
	23		26
	その他		その他
	19		19
	計		計
	1,003		990
4	関係会社との取引高	4	関係会社との取引高
	営業取引による取引高		営業取引による取引高
	受入手数料		受入手数料
	139		13
	営業費用		営業費用
	143		126
	営業取引以外の取引による取引高		営業取引以外の取引による取引高
	受取配当金		受取配当金
	130		100

(株主資本等変動計算書に関する注記)

2019年3月期		2020年3月期																															
1	当期末の発行済株式の種類及び総数 普通株式 100,000株	1	当期末の発行済株式の種類及び総数 普通株式 100,000株																														
2	配当に関する事項	2	配当に関する事項																														
①	当期中に行った剰余金の配当に関する事項	①	当期中に行った剰余金の配当に関する事項																														
	<table border="1"> <tr> <td>決議</td> <td>2018年6月20日 定時株主総会</td> </tr> <tr> <td>株式の種類</td> <td>普通株式</td> </tr> <tr> <td>配当金の総額</td> <td>325百万円</td> </tr> <tr> <td>1株当たり配当額</td> <td>3,250円</td> </tr> <tr> <td>効力発生日</td> <td>2018年6月22日</td> </tr> </table>	決議	2018年6月20日 定時株主総会	株式の種類	普通株式	配当金の総額	325百万円	1株当たり配当額	3,250円	効力発生日	2018年6月22日		<table border="1"> <tr> <td>決議</td> <td>2019年6月19日 定時株主総会</td> </tr> <tr> <td>株式の種類</td> <td>普通株式</td> </tr> <tr> <td>配当金の総額</td> <td>284百万円</td> </tr> <tr> <td>1株当たり配当額</td> <td>2,840円</td> </tr> <tr> <td>効力発生日</td> <td>2019年6月24日</td> </tr> </table> <table border="1"> <tr> <td>決議</td> <td>2020年1月24日 臨時株主総会</td> </tr> <tr> <td>株式の種類</td> <td>普通株式</td> </tr> <tr> <td>配当金の総額</td> <td>1,272百万円</td> </tr> <tr> <td>1株当たり配当額</td> <td>12,727円</td> </tr> <tr> <td>効力発生日</td> <td>2020年3月10日</td> </tr> </table>	決議	2019年6月19日 定時株主総会	株式の種類	普通株式	配当金の総額	284百万円	1株当たり配当額	2,840円	効力発生日	2019年6月24日	決議	2020年1月24日 臨時株主総会	株式の種類	普通株式	配当金の総額	1,272百万円	1株当たり配当額	12,727円	効力発生日	2020年3月10日
決議	2018年6月20日 定時株主総会																																
株式の種類	普通株式																																
配当金の総額	325百万円																																
1株当たり配当額	3,250円																																
効力発生日	2018年6月22日																																
決議	2019年6月19日 定時株主総会																																
株式の種類	普通株式																																
配当金の総額	284百万円																																
1株当たり配当額	2,840円																																
効力発生日	2019年6月24日																																
決議	2020年1月24日 臨時株主総会																																
株式の種類	普通株式																																
配当金の総額	1,272百万円																																
1株当たり配当額	12,727円																																
効力発生日	2020年3月10日																																
②	当期末後に行う剰余金の配当に関する事項	②	当期末後に行う剰余金の配当に関する事項																														
	1) 配当金の総額 284百万円 2) 1株当たり配当額 2,840円 3) 効力発生日 2019年6月24日		該当なし																														

(税効果会計に関する注記)

(1) 繰延税金資産の発生の主な原因別内訳

(単位：百万円)

2019年3月期		2020年3月期	
1 繰延税金資産		1 繰延税金資産	
未払費用	42	未払費用	50
未払事業税	2	未払事業税	12
繰越欠損金	4	退職給付引当金	50
退職給付引当金	45	オフィス移転関連費用	10
オフィス移転関連費用	14	ゴルフ会員権減損等	1
ゴルフ会員権減損等	1	その他	1
その他	0		
繰延税金資産計	113	繰延税金資産計	128
評価性引当金	△2	評価性引当金	△2
繰延税金資産の純額	111	繰延税金資産の純額	125

2. 借入金の主要な借入先及び借入金額

該当なし

3. 保有する有価証券（トレーディング商品に属するものとして経理された有価証券を除く。）
の取得価額、時価及び評価損益

(1) その他の有価証券で時価があるもの

該当なし

(2) 時価評価されていない主な有価証券の内容

(単位：百万円)

	2019年3月期	2020年3月期
	貸借対照表計上額	貸借対照表計上額
関係会社株式	56	9
非上場株式	—	—

4. デリバティブ取引（トレーディング商品に属するものとして経理された取引を除く。）の契約価額、時価及び評価損益

(1) 先物取引・オプション取引の状況

① 株式

該当なし

② 債券

該当なし

(2) 有価証券店頭デリバティブ取引の状況

該当なし

5. 財務諸表に関する会計監査人等による監査の有無

会社法第 436 条第 2 項 1 号の規定に基づき会計監査人である有限責任監査法人トーマツの監査を受け適正意見を受けております。

IV. 管理の状況

1. 内部管理の状況の概要

当社は、法令諸規則等の遵守を徹底させ、投資勧誘等の営業活動、顧客管理を適正に行うため、内部管理統括責任者の指揮監督のもとに、内部管理部門として、オペレーション部、法務監理室、内部監査室を組織し、また、営業本部に営業責任者を、法務監理室に内部管理責任者を置き、内部管理を徹底させております。

また、チーフ・コンプライアンス・オフィサーが、証券業務及び投資運用業務を営むにあたり必要とされる会社の法令遵守を担保することを目的として、内部管理体制を整備し、業務運営が適正になされているか常に監視し、必要に応じてこれを指導・監督する体制をとっております。

内部管理部門の主な業務分掌は以下の通りです。

部署名	主な業務分掌
法務監理室	<ul style="list-style-type: none"> ・ 内部管理態勢の整備及び業務関連諸法令等の遵守状況の調査、指導・監督に関する事項 ・ 主務官庁等への承認申請、報告、渉外及び金融検査等に関する事項 ・ 金融商品取引における法的対応に関する事項 ・ 引受審査業務に関する事項 ・ 子会社の管理に関連する事項
内部監査室	<ul style="list-style-type: none"> ・ 内部監査に関する事項

2. 分別管理等の状況

(1) 金融商品取引法第 43 条の 2 の規定に基づく分別管理の状況

① 顧客分別金信託の状況

(単位: 百万円)

項目	2019年3月31日現在の金額	2020年3月31日現在の金額
直近差替計算基準日の顧客分別金必要額	—	—
期末日現在の顧客分別金信託額	0	0
期末日現在の顧客分別金必要額	—	—

② 有価証券の分別管理の状況

イ. 保護預り等有価証券

有価証券の種類		2019年3月31日現在		2020年3月31日現在	
		国内証券	外国証券	国内証券	外国証券
株券	株数	—	—	—	—
債券	額面金額	—	—	—	—
受益証券	口数	5,175百万口	213,725.569862口	7,175百万口	202,314.499687口
その他	額面金額	—	—	—	—

ロ. 受入保証金代用有価証券

該当なし

ハ. 管理の状況

管理場所及び国名	管理方法	区分	数・額面金額	単位
SS&C Fund Services (Cayman) Ltd. (Cayman)	混蔵管理	株券	—	—
		債券	—	—
		受益証券	202,314.499687	口
		その他	—	—
証券保管振替機構 (上位機関 株式会社だい こう証券ビジネス) (日本)	混蔵管理	株券	—	—
		債券	—	—
		受益証券	7,175	百万口
		その他	—	—

③ 対象有価証券関連店頭デリバティブ取引等に係る分別管理の状況

該当なし

(2) 金融商品取引法第43条の2の2の規定に基づく区分管理の状況

① 商品顧客区分管理信託の状況

該当なし

② 有価証券等の区分管理の状況

該当なし

(3) 金融商品取引法第43条の3の規定に基づく区分管理の状況

① 法第43条の3第1項の規定に基づく区分管理の状況

該当なし

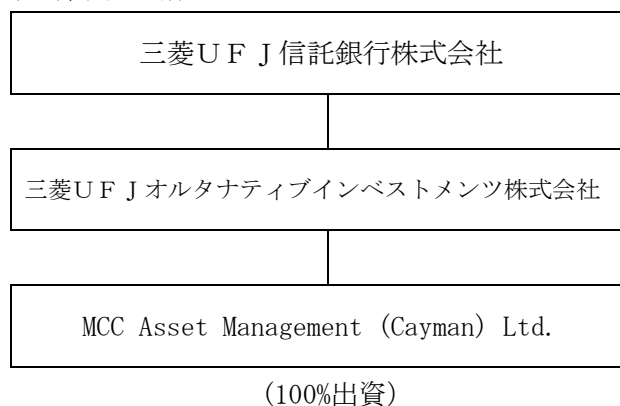
② 法第43条の3第2項の規定に基づく区分管理の状況

該当なし

V. 連結子会社等の状況に関する事項

2020年6月30日現在

1. 当社及びその子会社等の集団の構成



2. 子会社等の商号又は名称、本店又は主たる事務所の所在地、資本金の額、事業の内容等

商号又は名称	本店所在地	資本金	事業内容	当社及び子会社等の保有する議決権の数	子会社等の総株主の議決権に占める当該保有する議決権の数の割合
MCC Asset Management (Cayman) Ltd.	グランド ケイマン	US\$80,000	ファンド管理業務 投資運用業務	80,000株	100%

以上