

業務及び財産の状況に関する説明書

【平成30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、全ての営業所又は事務所に備え置き、公衆の縦覧に供するために作成したものです。

 **三菱商事アセットマネジメント株式会社**

I. 当社の概況及び組織に関する事項

1. 商号

三菱商事アセットマネジメント株式会社

2. 登録年月日（登録番号）

平成 19 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

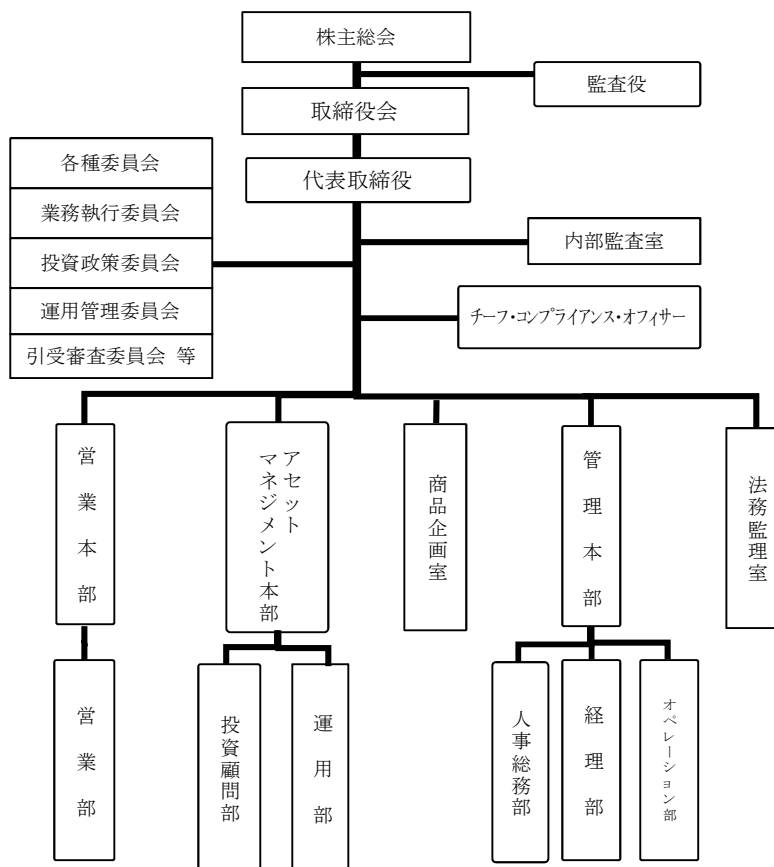
(1) 会社の沿革

年	月	沿 革
平成 11 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
平成 12 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
平成 16 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
平成 18 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
平成 19 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
平成 21 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
平成 22 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
平成 24 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
平成 28 年	5 月	引受業務（及び売出業務）を開始
平成 30 年	3 月	資本金の額を 20 億円に減資 本店を移転

(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。

平成 30 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

氏名又は名称	保有株式数	割合
三菱商事株式会社	株 100,000	% 100.00

5. 役員の名氏又は名称

平成 30 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	三 好 一 郎	有	常 勤
取 締 役	加 藤 啓 輔	無	常 勤

取締役	中江清貴	無	常勤
取締役	児島力	無	非常勤
取締役	小林健司	無	非常勤
取締役	山本崇史	無	非常勤
監査役	上田泰司	—	常勤
監査役	鎌田吉昭	—	非常勤
監査役	仙當毅行	—	非常勤

以上9名

6. 政令で定める使用人の氏名

平成30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どうかを問わず、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
加藤啓輔	アセットマネジメント本部長 兼 運用部長
山本雷三	アセットマネジメント本部 運用部
小室直道	アセットマネジメント本部 投資顧問部長
齋藤英紀	アセットマネジメント本部 投資顧問部

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の強まりは継続しており、不動産ファンド、インフラ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く、取り分け、当社取扱いの国内インフラファンドが投資家の注目を集めたように安定的な円建てキャッシュフローが期待できる資産への需要は強いものがあります。このような状況下、本邦投資家の運用体制にはより厳密さが要求され、銀行ではBIS規制、ボルカールール等、年金ではESG（環境、社会、ガバナンス）投資等、リターン以外のリスク管理にもより慎重な対応が求められています。

このような事業環境下、証券業務関連では、三菱商事株式会社グループが運用するプライベートエクイティファンドや、不動産及びインフラ等の実物資産系のファンドの取扱いが好調だったため、取扱高は期初目標を大きく上回りました。

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を中心に投資一任契約の勧誘を取り進めてきた結果、契約資産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1,844億円となり前期に比べ368億円増加しました。その他業務では、ケイマン子会社の管理するファンドが、パフォーマンスの悪化等により残高が減少したことに伴い関連収益が減少しました。

以上のことなどから当期の営業収益は1,726百万円となり前期に比べ△37百万円減少したものの、期初目標を越えることができました。

販売費・一般管理費は、人員の減等による人件費の減少などにより1,149百万円となり前期に比べ△51百万円減少しました。経常損益は614百万円となり前期に比べ78百万円増加しました。なお、当社はオフィススペースの効率化を図ることで家賃を削減するために平成30年3月19日付けでオフィスを移転しました。これにより原状回復費及び固定資産除却損等による特別損失80百万円を計上したことなどから、当期純利益は358百万円となり前期に比べ△200百万円減少しました。

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)

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
資本金	3,000	3,000	2,000
発行済株式総数	100,000 株	100,000 株	100,000 株
営業収益	1,712	1,763	1,726
(受入手数料)	1,701	1,713	1,662
((委託手数料))	49	—	—
((引受け・売出し・特定投資家向け売付け勧誘等の手数料))	—	10	—
((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))	682	876	689
((その他の受入手数料))	969	827	973
(トレーディング損益)	11	50	64
((株券等))	11	50	64
((債券等))	—	—	—
((その他))	—	—	—
純営業収益	1,712	1,763	1,726
経常利益	532	535	614
当期純利益	531	558	358

(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)

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
自 己	2,284	9,976	12,777
委 託	—	—	—
計	2,284	9,976	12,777

- 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
平成28年3月期	株券	—	—	—	—	203	—
	国債証券	—	/	/	—	—	—
	地方債証券	—	/	/	—	—	—
	特殊債券	—	—	—	—	—	—
	社債券	—	—	—	—	—	—
	受益証券	/	/	/	—	35,224	—
	その他	—	—	—	—	92,496	—
平成29年3月期	株券	—	—	—	—	7	—
	国債証券	—	/	/	—	—	—
	地方債証券	—	/	/	—	—	—
	特殊債券	—	—	—	—	—	—
	社債券	2,000	—	—	—	3,637	—
	受益証券	/	/	/	—	35,122	—
	その他	—	—	—	—	74,145	—
平成30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	—

(3) その他業務の状況

(単位：百万円)

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
国内外の投資運用業務に携わる者からのミドル・バックオフィス業務の受託業務 及び 海外の投資運用業務に携わる者からの本邦投資家対応等の受託業務	37	15	—
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)	107	86	147

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)

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
自己資本規制比率 (A/B × 100)	441.5	380.1	401.4
固定化されていない自己資本 (A)	1,937	1,845	1,907
リスク相当額 (B)	438	485	475
市場リスク相当額	10	7	6
取引先リスク相当額	140	183	182
基礎的リスク相当額	288	294	285

(5) 使用人の総数及び外務員の総数

(単位：名)

	平成 28 年 3 月期	平成 29 年 3 月期	平成 30 年 3 月期
使用人	48	49	46
(うち外務員)	32	31	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)

資 産 の 部		
科 目	第 19 期	第 20 期
	(平成 29 年 3 月 31 日現在)	(平成 30 年 3 月 31 日現在)
	金 額	金 額
流動資産	3,890	2,668
現金・預金	1,620	1,619
預託金	0	0
立替金	0	0
短期貸付金	1,500	350
前払費用	23	4
未収入金	—	5
未収収益	678	687
繰延税金資産	64	—
その他	2	0
固定資産	410	458
有形固定資産	17	107
建物	13	71
器具備品	4	36
無形固定資産	6	9
ソフトウェア	5	9
電話加入権	1	—
投資その他の資産	386	341
関係会社株式	56	56
長期差入保証金	115	136
長期前払費用	2	3
繰延税金資産	207	140
その他	4	4
資 産 合 計	4,301	3,126

負 債 の 部		
科 目	第 19 期	第 20 期
	(平成 29 年 3 月 31 日現在)	(平成 30 年 3 月 31 日現在)
	金 額	金 額
流動負債	384	250
預り金	5	7
未払金	19	42
未払費用	176	180
未払法人税等	182	20
固定負債	136	155
退職給付引当金	136	155
負債合計	521	405
純 資 産 の 部		
株主資本	3,779	2,720
資本金	3,000	2,000
資本剰余金	79	170
資本準備金	79	169
その他資本剰余金	0	0
利益剰余金	700	550
利益準備金	141	192
その他利益剰余金	559	358
繰越利益剰余金	559	358
純資産合計	3,779	2,720
負債・純資産合計	4,301	3,126

(2) 損益計算書

(単位：百万円)

	第 19 期		第 20 期	
	自 平成 28 年 4 月 1 日 至 平成 29 年 3 月 31 日		自 平成 29 年 4 月 1 日 至 平成 30 年 3 月 31 日	
	金 額		金 額	
営業収益		1,763		1,726
受入手数料	1,713		1,662	
トレーディング損益	50		64	
金融収益	—		—	
金融費用		—		—
純営業収益		1,763		1,726
販売費・一般管理費		1,201		1,149
営業利益		562		577
営業外収益		0		50
営業外費用		27		13
経常利益		535		614
特別利益		—		0
固定資産売却益	—		0	
特別損失		2		80
ゴルフ会員権評価損	2		—	
固定資産除売却損	0		14	
オフィス移転関連費用	—		66	
税引前当期純利益		533		533
法人税等	171		44	
法人税等調整額	△197		131	
当期純利益		558		358

(3) 株主資本等変動計算

(自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								純資産 合計
	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 繰越 利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	3,000	79	0	79	92	532	625	3,704	3,704
当期変動額									
利益準備金の積立					48	△ 48	-	-	-
剰余金の配当						△ 484	△ 484	△ 484	△ 484
当期純利益						558	558	558	558
当期変動額合計	-	-	-	-	48	26	74	74	74
当期末残高	3,000	79	0	79	141	559	700	3,779	3,779

(自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日)

(単位:百万円)

	株主資本								純資産 合計
	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 繰越 利益 剰余金	利益 剰余金 合計		
当期首残高	3,000	79	0	79	141	559	700	3,779	3,779
当期変動額									
減資	△ 1,000		1,000	1,000				-	-
資本準備金の積立		90	△ 90	-				-	-
利益準備金の積立					50	△ 50	-	-	-
剰余金の配当			△ 909	△ 909		△ 508	△ 508	△ 1,417	△ 1,417
当期純利益						358	358	358	358
当期変動額合計	△ 1,000	90	-	90	50	△ 200	△ 149	△ 1,058	△ 1,058
当期末残高	2,000	169	0	170	192	358	550	2,720	2,720

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 5～15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。

(表示方法の変更に関する注記)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の早期適用に伴う変更

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日。以下「税効果会計基準一部改正」という。)が当事業年度末に係る財務諸表から適用できるようになったことに伴い、当事業年度から税効果会計基準一部改正を適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

(貸借対照表に関する注記)

(単位：百万円)

平成 29 年 3 月期		平成 30 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	89	建物	—
器具・備品	40	器具・備品	4
計	130	計	4
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	27	短期金銭債権	44
短期金銭債務	139	短期金銭債務	26

(損益計算書に関する注記)

(単位：百万円)

平成 29 年 3 月期				平成 30 年 3 月期			
1 受入手数料の内訳				1 受入手数料の内訳			
引受け・売出し・特定投資家 向け売付け勧誘等の手数料	10			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手数料	876			募集・売出し・特定投資家向 け売付け勧誘等の取扱手数料	689		
その他の受入手数料	827			その他の受入手数料	973		
計	1,713			計	1,662		
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 損益	評価 損益	合計		実現 損益	評価 損益	合計
株券等トレーディング損益	50	—	50	株券等トレーディング損益	64	—	64
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	50	—	50	計	64	—	64

(単位：百万円)

平成 29 年 3 月期		平成 30 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
	189		146
	人件費		人件費
	799		741
	不動産関係費		不動産関係費
	144		180
	事務費		事務費
	10		17
	減価償却費		減価償却費
	6		6
	租税公課		租税公課
	31		34
	その他		その他
	19		22
	計		計
	1,201		1,149
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
	146		175
	営業費用		営業費用
	133		144
	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
	該当なし		受取配当金
			50

(株主資本等変動計算書に関する注記)

平成 29 年 3 月期		平成 30 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>平成 28 年 6 月 22 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>484 百万円</td> </tr> <tr> <td>1 株当たり配当額</td> <td>4,840 円</td> </tr> <tr> <td>効力発生日</td> <td>平成 28 年 6 月 24 日</td> </tr> </table>	決 議	平成 28 年 6 月 22 日 定時株主総会	株式の種類	普通株式	配当金の総額	484 百万円	1 株当たり配当額	4,840 円	効力発生日	平成 28 年 6 月 24 日		<table border="1"> <tr> <td>決 議</td> <td>平成 29 年 6 月 21 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>508 百万円</td> </tr> <tr> <td>1 株当たり配当額</td> <td>5,080 円</td> </tr> <tr> <td>効力発生日</td> <td>平成 29 年 6 月 23 日</td> </tr> </table> <table border="1"> <tr> <td>決 議</td> <td>平成 30 年 1 月 22 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>909 百万円</td> </tr> <tr> <td>1 株当たり配当額</td> <td>9,090 円</td> </tr> <tr> <td>効力発生日</td> <td>平成 30 年 3 月 12 日</td> </tr> </table>	決 議	平成 29 年 6 月 21 日 定時株主総会	株式の種類	普通株式	配当金の総額	508 百万円	1 株当たり配当額	5,080 円	効力発生日	平成 29 年 6 月 23 日	決 議	平成 30 年 1 月 22 日 臨時株主総会	株式の種類	普通株式	配当金の総額	909 百万円	1 株当たり配当額	9,090 円	効力発生日	平成 30 年 3 月 12 日
決 議	平成 28 年 6 月 22 日 定時株主総会																																
株式の種類	普通株式																																
配当金の総額	484 百万円																																
1 株当たり配当額	4,840 円																																
効力発生日	平成 28 年 6 月 24 日																																
決 議	平成 29 年 6 月 21 日 定時株主総会																																
株式の種類	普通株式																																
配当金の総額	508 百万円																																
1 株当たり配当額	5,080 円																																
効力発生日	平成 29 年 6 月 23 日																																
決 議	平成 30 年 1 月 22 日 臨時株主総会																																
株式の種類	普通株式																																
配当金の総額	909 百万円																																
1 株当たり配当額	9,090 円																																
効力発生日	平成 30 年 3 月 12 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 508 百万円 2) 1 株当たり配当額 5,080 円 3) 効力発生日 平成 29 年 6 月 23 日		1) 配当金の総額 325 百万円 2) 1 株当たり配当額 3,250 円 3) 効力発生日 平成 30 年 6 月 22 日																														

(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)

平成 29 年 3 月期		平成 30 年 3 月期	
1 繰延税金資産		1 繰延税金資産	
未払費用	52	未払費用	48
未払事業税	6	未払事業税	6
繰越欠損金	169	繰越欠損金	11
退職給付引当金	41	退職給付引当金	47
減価償却超過額	1	オフィス移転関連費用	26
ゴルフ会員権名義書換料	1	ゴルフ会員権減損等	1
その他	0	その他	0
繰延税金資産計	273	繰延税金資産計	141
評価性引当金	△1	評価性引当金	△1
繰延税金資産の純額	271	繰延税金資産の純額	140

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)

	平成 29 年 3 月期	平成 30 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	56
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
管理本部 オペレーション部	<ul style="list-style-type: none"> ・証券業務の起票・決済・報告、顧客管理、取引管理に係る事項 ・投資顧問業務の起票・決済・報告、顧客管理に係る事項及び運用報告に係る事項 ・自己勘定取引の管理・決済に係る事項 ・リスクモニタリングに関する事項
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	平成29年3月31日現在の金額	平成30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		平成 29 年 3 月 31 日現在		平成 30 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	4,757 百万口	248,571.469694 口	5,175 百万口	220,234.377438 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	220,234.377438	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	5,175	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

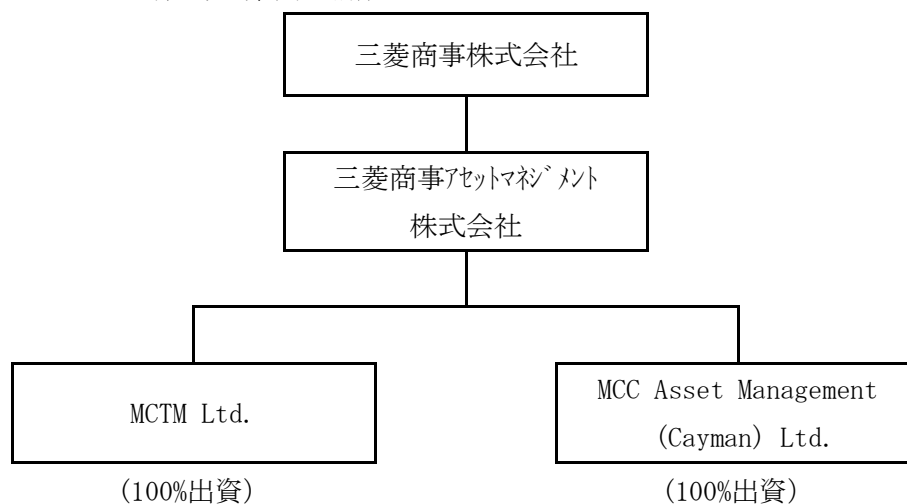
② 法第 43 条の 3 第 2 項の規定に基づく区分管理の状況

該当なし

V. 連結子会社等の状況に関する事項

平成 30 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%
MCTM Limited	グランド ケイマン	US\$501,000	ファンド管理業務 投資運用業務	1,500 株	100%

以 上