

【表紙】

| | |
|--|------------------------------|
| 【提出書類】 | 有価証券届出書 |
| 【提出先】 | 関東財務局長 殿 |
| 【提出日】 | 平成24年12月12日提出 |
| 【発行者名】 | 明治安田アセットマネジメント株式会社 |
| 【代表者の役職氏名】 | 代表取締役社長 佐藤 公俊 |
| 【本店の所在の場所】 | 東京都港区北青山三丁目6番7号 |
| 【事務連絡者氏名】 | 阿部 一 連絡場所 東京都港区北青山三丁目6番7号 |
| 【電話番号】 | 03-5469-3587 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託 受益証券に係るファンドの名称】 | 明治安田資産形成サポートファンド（隔月決算型） |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託 受益証券の金額】 | 上限 1,000億円 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当事項はありません。 |

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

明治安田資産形成サポートファンド（隔月決算型）

（以下、「ファンド」といいます。また、愛称として「フォースマイル（隔月決算型）」という名称を用いることがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権（以下「受益権」といいます。）

当初の1口当たり元本は、1円（1万口当たり元本金額1万円）です。

当ファンドについて、委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供された信用格付、または信用格付業者から提供され、若しくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定の適用を受け、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）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ます（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である明治安田アセットマネジメント株式会社は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1,000億円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

「基準価額」とは、ファンドの資産総額から負債総額を控除した金額（純資産総額）を計算日における受益権総口数で除して得た1口当たりの価額をいいます。なお、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されます。

基準価額につきましては、取扱販売会社または下記委託会社にてご確認いただけます。また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

ホームページアドレス（<http://www.myam.co.jp/>）

(5)【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込口数を乗じた額に、2.1%（税抜2.0%）を上限として、各販売会社が別途定める料率を乗じて得た額とします。

「税抜」における税とは、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）相当額をいいます。（以下同じ。）

申込手数料につきましては、お申込みの販売会社または下記委託会社にお問合せください。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

分配金再投資コースでお申込みの受益者が販売会社との間で結んだ「自動継続投資契約（販売会社により名称が異なる場合があります。以下同じ。）」に基づいて収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

(6)【申込単位】

「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」があります。いずれのコースでも販売会社が定めるお申込単位となります。

自動継続投資契約に基づく収益分配金の再投資については、1口単位とします。

販売会社によりどちらか一方のコースのみの取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社までお問合せください。

(7)【申込期間】

平成24年12月13日（木曜日）から平成25年12月12日（木曜日）まで

申込期間は、上記期間満了前に有価証券届出書を提出することによって更新されます。

(8)【申込取扱場所】

申込取扱場所（販売会社）の照会先は以下のとおりです。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

ホームページアドレス（<http://www.myam.co.jp/>）

販売会社と販売会社以外の金融機関が取次契約を結ぶことにより、当該金融機関がファンドの取扱いを当該販売会社に取次ぐ場合があります。

(9) 【払込期日】

申込者は、申込金額（申込受付日の翌営業日の基準価額×申込口数）に申込手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額を加算した額（申込代金）を、販売会社の指定した期日までに販売会社に支払うものとします。

振替受益権に係る各取得申込受付日の発行価額の総額は、当該申込みに係る追加信託が行われる日に委託会社の指定する口座を経由して、受託会社の指定するファンド口座に払い込まれます。

(10) 【払込取扱場所】

お申込代金は販売会社にお支払いください。

販売会社につきましては、「(8) 申込取扱場所」をご参照下さい。

(11) 【振替機関に関する事項】

株式会社証券保管振替機構

(12) 【その他】

申込証拠金はありません。

本邦以外の地域における発行

該当事項はありません。

決算日

1、3、5、7、9、11月の各12日（休業日の場合は翌営業日）

振替受益権について

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

明治安田資産形成サポートファンド（隔月決算型）は、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

ファンドは、社団法人投資信託協会による分類方法において、「追加型投信／内外／資産複合」に商品分類され、属性は下記に区分されます。

当ファンドは社団法人投資信託協会が定める分類方法において以下の通りとなっております。

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。

・商品分類表

| 単位型・追加型 | 投資対象地域 | 投資対象資産（収益の源泉） |
|---------|--------|---------------|
| 単位型 | 国内 | 株式 |
| | 海外 | 債券 |
| | | 不動産投信 |
| 追加型 | 内外 | その他資産（ ） |
| | | 資産複合 |

・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 |
|---|--------------|-----------------|----------------------|-----------|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 | グローバル (日本含む) | | |
| | 年2回 | 日本 | | |
| | 年4回 | 北米 | ファミリー ファンド | あり () |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () | 年6回 (隔月) | 欧州 | | |
| | 年12回 (毎月) | アジア | | |
| | 日々 | オセアニア | ファンド・ オブ・ ファンズ | なし |
| 不動産投信 | その他 () | 中南米 | | |
| その他資産 (投資信託証券 (資産複合(株式、債券)資 産配分固定型) | | アフリカ | | |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | | 中近東 (中東) | | |
| | | エマージング | | |

< 商品分類表及び属性区分表（網掛け表示部分）の定義 >

「追加型投信／内外／資産複合」とは、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であり、目論見書または投資信託約款において、国内および海外の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。

< ファンドの属性およびその定義 >

- 投資対象資産による属性区分 ... その他資産(投資信託証券(資産複合(株式、債券)資産配分固定型))
目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信ではないその他資産である投資信託証券(親投資信託など)を通じて複数の資産(株式、債券)へ投資し、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
- 決算頻度による属性区分 ... 年6回(隔月)
目論見書または投資信託約款において、年6回(隔月)決算する旨の記載があるものをいいます。
- 投資対象地域による属性区分 ... グローバル(日本含む)

目論見書または投資信託約款において、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。なお、「世界の資産」の中には「日本」を含みます。

4. 投資形態による属性区分 ... ファミリーファンド
- 目論見書または投資信託約款において、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く。）を投資対象として投資するものをいいます。
5. 為替ヘッジによる属性区分 ... 為替ヘッジなし
- 目論見書または投資信託約款において、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。

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円で為替リスクに対するヘッジの有無を記載しております。当ファンドが該当しないその他の商品分類および属性区分の定義等については、社団法人投資信託協会ホームページ（URL: <http://www.toushin.or.jp/>）で閲覧が可能です。

信託金の限度額：上限1,000億円

ただし、受託会社と合意のうえ、当該限度額を変更することができます。

(2) 【ファンドの沿革】

平成20年10月30日 信託契約の締結、ファンドの設定、運用開始

平成21年4月1日 ファンドの名称を「明治ドレスナー資産形成サポートファンド（隔月決算型）」から「MDAM資産形成サポートファンド（隔月決算型）」に変更

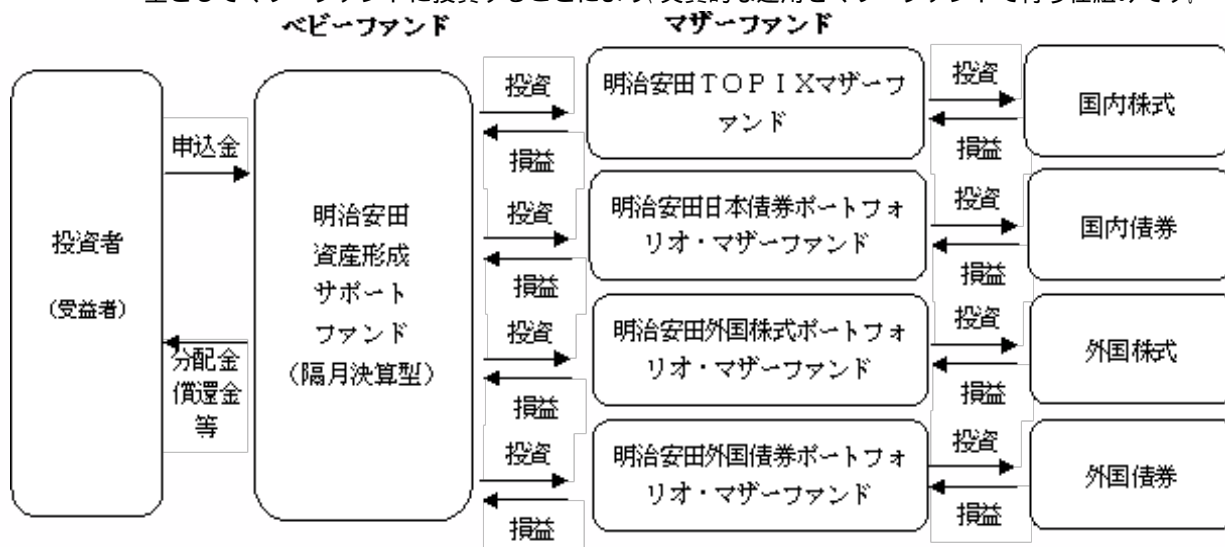
平成22年10月1日 ファンドの名称を「MDAM資産形成サポートファンド（隔月決算型）」から「明治安田資産形成サポートファンド（隔月決算型）」に変更

(3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

運用にあたってはファミリーファンド方式を採用し、主として、明治安田TOPIXマザーファンド、明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド、明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド、明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンドの各受益証券に投資することにより、実質的な運用をマザーファンド（以下「親投資信託」ともいいます。）で行う仕組みになっています。

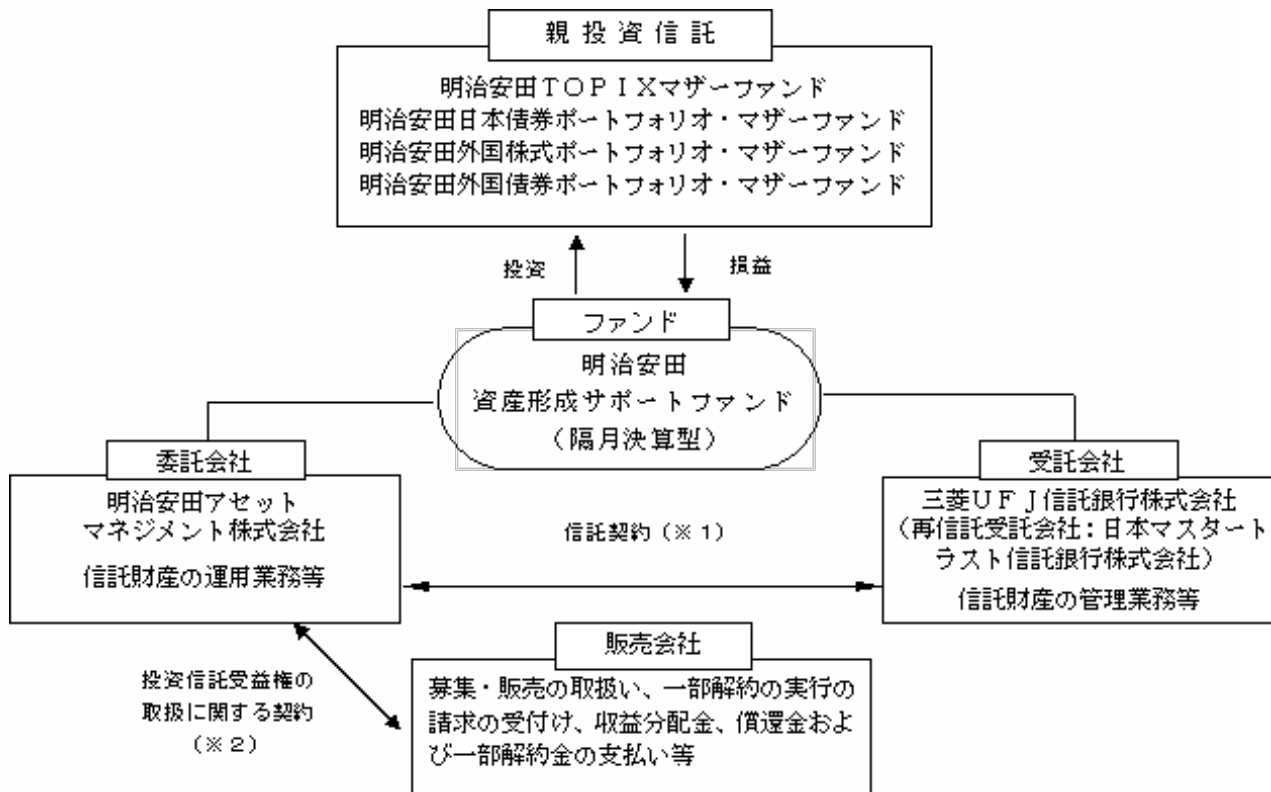
「ファミリーファンド方式」とは、お客様からご投資いただいた資金をベビーファンドとしてまとめ、その資金を主としてマザーファンドに投資することにより、実質的な運用をマザーファンドで行う仕組みです。



損益は全て投資者である受益者に帰属します。

委託会社等及びファンドの関係法人

1. 委託会社（委託者）： 明治安田アセットマネジメント株式会社
信託財産の運用指図、投資信託説明書(目論見書)及び運用報告書の作成等を行います。
2. 受託会社（受託者）： 三菱UFJ信託銀行株式会社
信託財産の保管・管理業務等を行います。(なお、受託者は信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。)
3. 販売会社
ファンドの販売会社として募集・販売の取扱い、一部解約実行の請求の受付け、収益分配金、償還金等の支払い、運用報告書の交付等を行います。



(1) 信託契約

委託会社と受託会社との間において「信託契約（信託約款）」を締結しており、委託会社及び受託会社の業務、受益者の権利、投資信託財産の運用・評価・管理、収益の分配、信託期間、償還等を規定しています。

(2) 投資信託受益権の取扱いに関する契約

委託会社と販売会社との間において「投資信託受益権の取扱いに関する契約」を締結しており、販売会社が行う募集・販売等の取扱い、収益分配金及び償還金の支払い、買取り及び解約の取扱い等を規定しています。

委託会社等の概況

1. 資本金の額（本書提出日現在） 10億円

2. 委託会社の沿革

昭和61年11月： コスモ投信株式会社設立

平成10年10月： ディーアンドシーキャピタルマネジメント株式会社と合併、商号を「コスモ投信投資顧問株式会社」に変更

平成12年2月： 商号を「明治ドレスナー投信株式会社」に変更

平成12年7月： 明治ドレスナー・アセットマネジメント株式会社と合併、商号を「明治ドレスナー・アセットマネジメント株式会社」に変更

平成21年4月： 商号を「MDAMアセットマネジメント株式会社」に変更

平成22年10月： 安田投信投資顧問株式会社と合併、商号を「明治安田アセットマネジメント株式会社」に変更

3. 大株主の状況（本書提出日現在）

| 氏名又は名称 | 住所 | 所有株式数 | 発行済株式総数に対する所有株式数の割合 |
|--|--------------------------------------|---------|---------------------|
| 明治安田生命保険相互会社 | 東京都千代田区丸の内二丁目1番1号 | 17,539株 | 92.86% |
| アリアンツ・グローバル・インベスターズ アジア・パシフィック ゲー・エム・ペー・ハー | ドイツ, 80335 ミュンヘン ジーデルシュトラッセ 24 - 24a | 1,261株 | 6.68% |
| 富国生命保険相互会社 | 東京都千代田区内幸町2-2-2 | 87株 | 0.46% |

2【投資方針】

(1)【投資方針】

運用方針

この投資信託は、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。

投資対象

明治安田TOPIXマザーファンド、明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド、明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド、明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンドの各受益証券（以下「各マザーファンド受益証券」といいます。）を主要投資対象とします。

投資対象について、詳しくは約款をご覧ください。

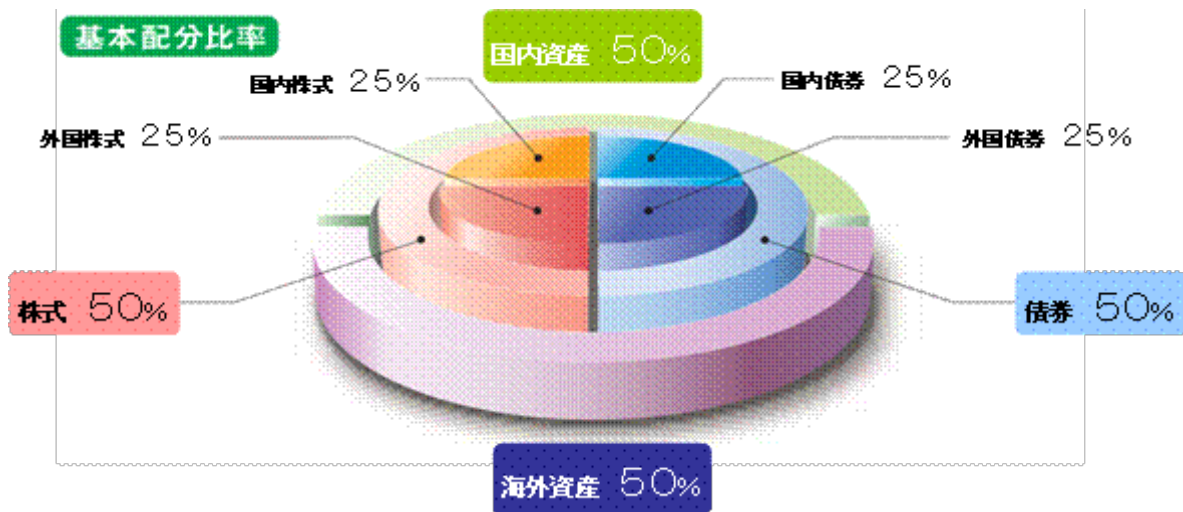
投資態度

1. 主として、各マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内株式、外国株式、国内債券および外国債券へ分散投資をすることにより、信託財産の中長期的な成長と安定的な収益の確保を目指して運用を行います。
2. 4つの資産への均等配分（以下「基本配分比率」といいます。）を基本とします。
3. 基本配分比率には各資産毎に一定の許容幅を設け、一定以上乖離した場合にはリバランスを行います。また、市況動向等の変化に応じて、当該基本配分比率の見直しを行う場合があります。
4. 実質組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。
5. 非株式割合（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては上記のような運用ができない場合があります。

【国内外の4資産に均等に分散投資】

各マザーファンドを通じて、国内株式・外国株式・国内債券・外国債券の4資産へ均等に投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。



【各資産の特長を活かした運用】

各資産の特長を活かした運用をおこないます。

- ・国内債券 安定性 信用力・流動性を考慮した国債中心の運用
- ・国内株式 成長性 TOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目指す運用
- ・外国債券 安定性・好利回り 先進国の国債中心の運用
- ・外国株式 成長性 企業の成長性・収益性等を重視した銘柄選定

（参考）各マザーファンドの概要

「明治安田TOPIXマザーファンド」

投資の基本方針

1 基本方針

TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

TOPIXとは

TOPIX（東証株価指数）は、東京証券取引所第一部の時価総額の動きをあらゆる株価指数であり、東京証券取引所が算出、公表を行っています。東京証券取引所第一部に上場しているすべての銘柄を計算の対象としていますので、日本の株式市場のほぼ全体の資産価値の動きを表しています。

- ・TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下、東京証券取引所といいます。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関するすべての権利及びTOPIXの商標に関するすべての権利は東京証券取引所が有します。
東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
東京証券取引所は、TOPIXの商標の使用もしくはTOPIXの指数の引用に関して得られる結果について、何ら保証、言及をするものではありません。
東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
東京証券取引所は、ファンドの購入者又は公衆に対し、ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持ちません。
東京証券取引所は、当社又はファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- ・ファンドは、東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ・上記に限らず、東京証券取引所はファンドの発行又は売買に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

2 運用方法

(1) 投資対象

東証一部上場銘柄の株式およびTOPIX（東証株価指数）先物取引を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

東証一部上場銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し株式の組入れを行います。

運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を行う場合があります。

株式（株価指数先物取引を含みます）の組入比率は、高位を保ちます。

運用にあたっては、当社の投資プロセスでポートフォリオの構築、リスクコントロールを行います。

〔投資対象ユニバースの決定〕

TOPIXに採用されている銘柄（採用予定銘柄を含む）から、信用リスクが極めて高く、時価総額が極めて低い銘柄を除外した投資対象となる銘柄群リスト（投資対象ユニバース・リスト）を作成します。

〔組入銘柄および株数の決定〕

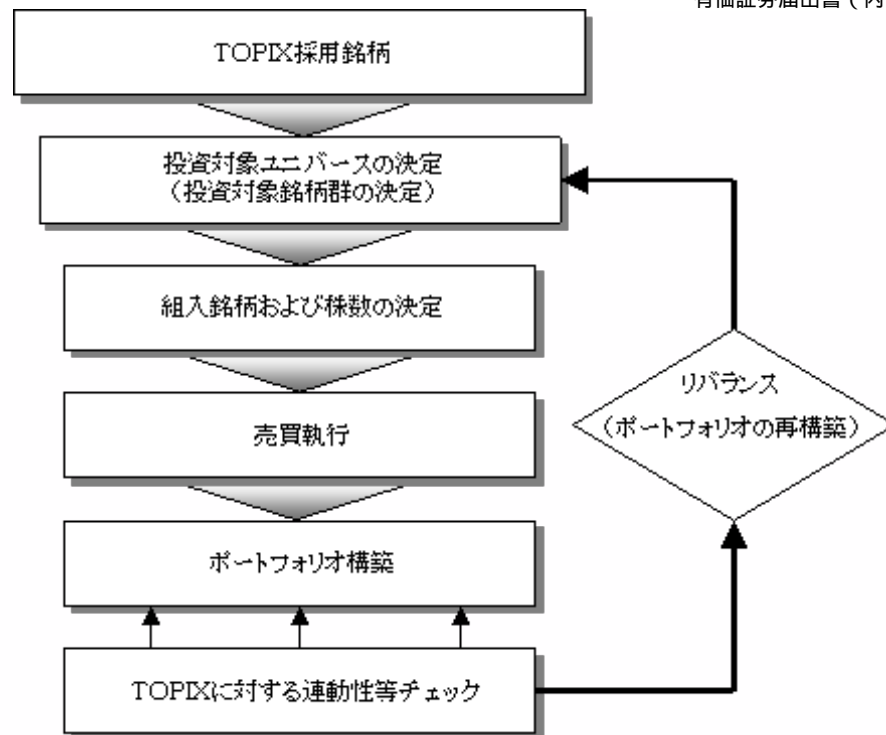
ファンドの純資産総額や個別銘柄の市場流動性、売買コスト等を勘案してTOPIXに近づくように一定の方法（最適化法）を用いて投資対象ユニバースの中から実際に買付けを行う銘柄のリストおよび株数を割り出します。

〔ポートフォリオの構築〕

運用担当者から指示を受けた専任のトレーダーが、市場でのマーケット・インパクトや取引コストを最小化するように株式を売買発注し、ポートフォリオを完成させます。

〔リバランス〕

日次、月次でTOPIXとの連動性をチェックします。連動性が低まったと判断した場合には、売買コストを考慮しつつ組入銘柄の見直しを行い、ポートフォリオを再構築（リバランス）します。また、ファンドの資金流入やTOPIX採用銘柄の入れ替えが行われた場合等にもリバランスを実施する場合があります。



非株式割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

(3) 投資制限

株式への投資割合には制限を設けません。

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には、制限を設けません。

外貨建資産への投資は行いません。

信用取引は、約款所定の範囲で行います。

有価証券先物取引等は、約款所定の範囲で行います。

スワップ取引は、約款所定の範囲で行います。

有価証券の貸付けおよび資金の借入れは、約款所定の範囲で行います。

「明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド」

投資の基本方針

1 基本方針

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2 運用方法

(1) 投資対象

邦貨建ての国債、政府保証債、地方債、利付金融債、社債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

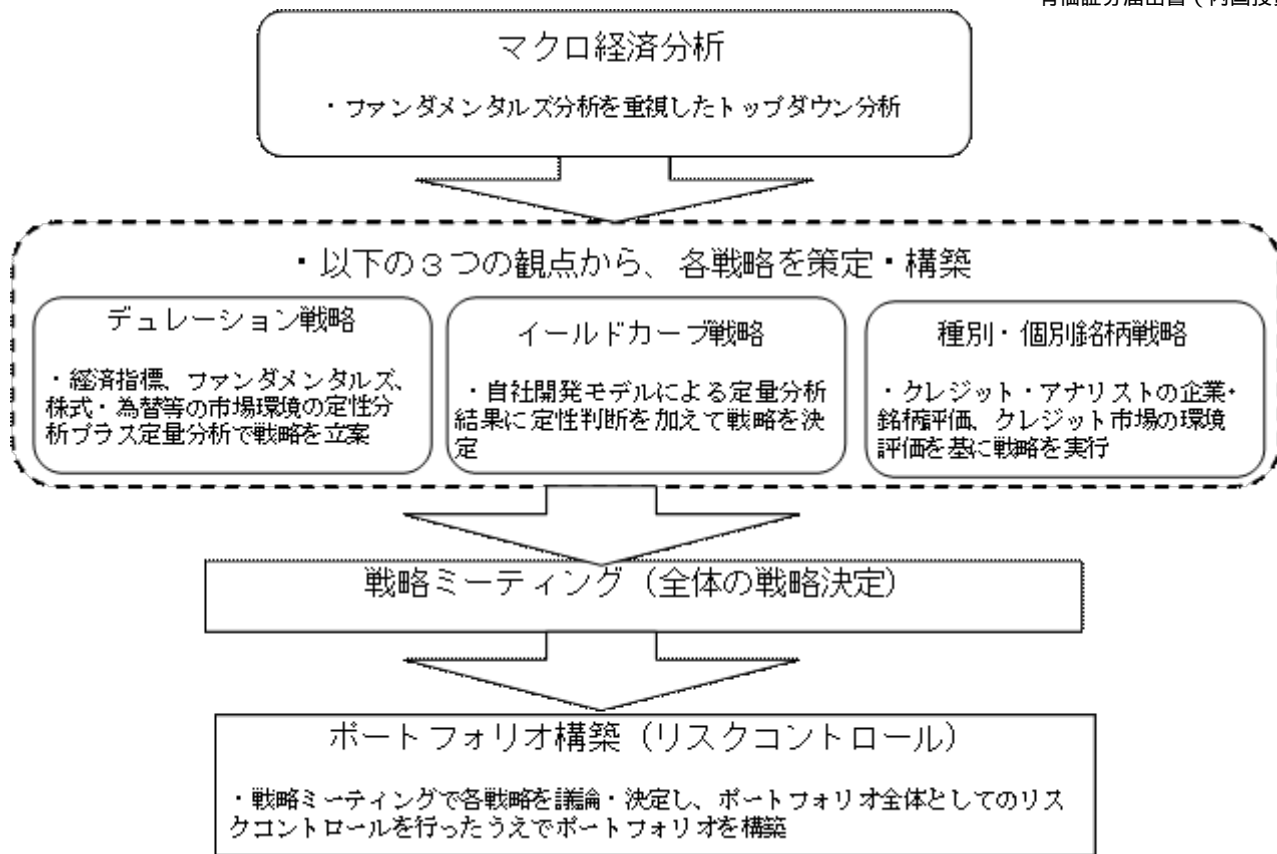
「NOMURA - BPI総合指数」をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。

NOMURA - BPI総合指数は、日本国内で発行される公募固定利付債の流通市場動向を的確に表すために、野村證券株式会社によって計算、公表されている投資収益指数で、野村證券株式会社の知的財産です。野村證券株式会社は、当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付機関によるA格相当以上の格付けを有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると委託会社が判断した公社債に投資します。

格付けとは、債券などの元本および利息の支払能力などを専門的な第三者（格付会社）が評価した意見です。格付が高い債券ほど安全性が高いとされています。一方、発行体にとっては格付けが高いほど有利な条件で発行ができるため、一般的に、格付けが高い債券ほど利回りは低く、格付けが低い債券ほど利回りは高くなります。

運用にあたっては、当社の投資プロセスでポートフォリオの構築、リスク管理を行います。



債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。

マクロ経済分析をベースとした金利の方向性予測等に基づき、市況動向やリスク分散等をも勘案して、デュレーションの調整、イールドカーブポジショニングのコントロールを行います。

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

(3) 投資制限

株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、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、ならびに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（以下会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）への投資は、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います。

スワップ取引を行います。

有価証券の貸付けおよび資金の借入れを行います。

金利先渡取引を行います。

「明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド」

投資の基本方針

1 基本方針

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2 運用方法

(1) 投資対象

世界各国（日本を除く）の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

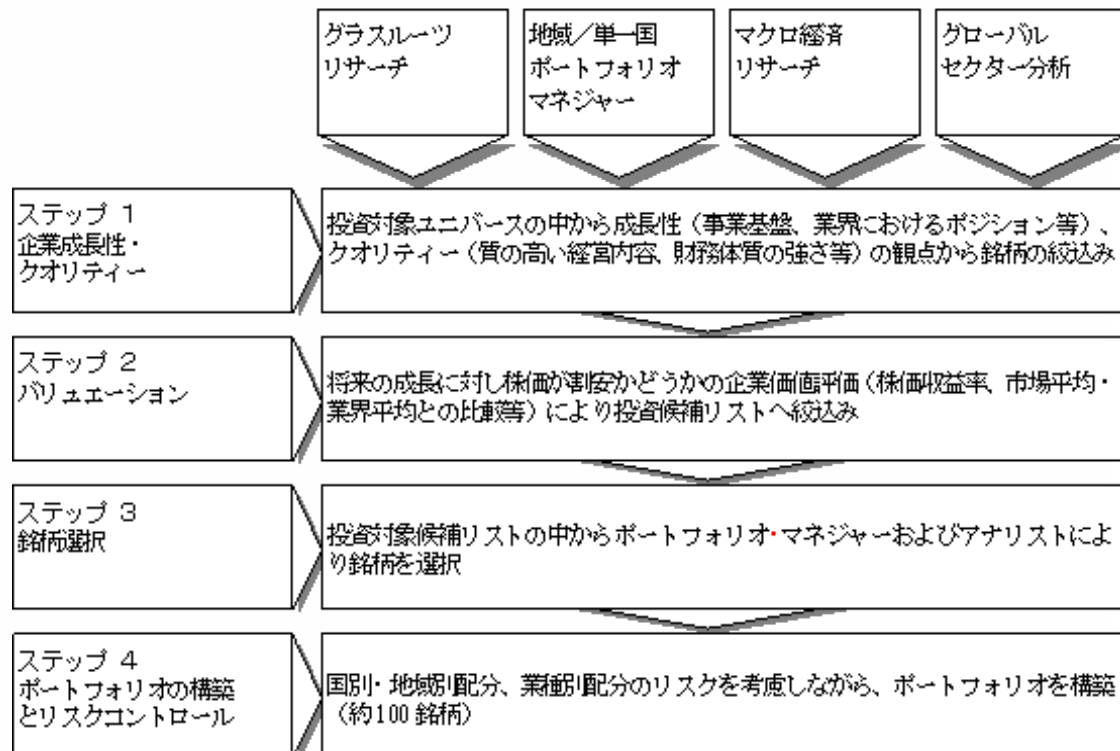
MSCI-KOKUSAI指数（円換算値）をベンチマークとし、これを中長期的に上回る運用成果をめざします。

MSCI-KOKUSAI指数は、MSCI Inc.が算出・公表している株価指数で、日本を除く世界主要国の株式市場の動きを捉える基準として広く認知されているものです。MSCI-KOKUSAI指数に関する著作権等の知的財産権、その他一切の権利はMSCI Inc.に帰属します。また、同社は当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。なお、ドルベースの指数（配当込み、ヘッジなし）をもとに、わが国の対顧客電信売買相場の仲値を乗じて、委託会社において円換算値を計算しています。

MSCI-KOKUSAI指数に採用されている国（構成国についてはMSCIの定期的な見直しにより変更される場合があります。）を主な投資対象国としますが、市況動向により、それ以外の国に投資することもあります。

リサーチを最重要視しファンダメンタルズ分析、ボトムアップ型リサーチに基づく成長株への投資が運用パフォーマンスの向上に繋がるとの考えに基づいて運用を行います。

運用プロセスの概要



国際銘柄比較を重視したグローバル・ベースのボトムアップ・リサーチ（企業調査）に付加価値の源泉を求め、成長性を持ちかつクオリティーの高い銘柄に投資します。

- 成長性（事業基盤、業界におけるポジション等）、クオリティー（質の高い経営内容、財務体質の強さ等）に着目し、投資対象銘柄の絞込みをします。
- 将来の成長に対し、株価が割安かどうかの企業価値評価（株価収益率、市場平均・業界平均との比較等）を行い、投資候補リストへの絞込みをします。
- 投資候補リストの中から、国別・地域別配分、業種別配分のリスクを考慮しながら、ポートフォリオを構築します。

銘柄選定にあたってはアナリストおよびポートフォリオ・マネジャーによるファンダメンタルズ分析に注力したグローバルリサーチと、その補完的役割を果たすグラスルーツリサーチを活用して、企業の成長性、クオリティーおよびバリュエーション（企業価値評価）を重視します。

グラスルーツリサーチはアナリストおよびポートフォリオ・マネジャーの問題提起に基づき外部のリサーチャーを活用して、運用判断のサポートとなる特定の業界、製品、顧客動向等の調査を行うアライアンス・グローバル・インベスターズグループのユニークなシステムで、グローバルな視点で競争環境や事業の発展など、現在及び将来の投資に影響を与える重要な情報収集を捉えることを目的とします。

株式の組入比率は、原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。

(3) 投資制限

株式への投資には制限を設けません。

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

同一銘柄の株式への投資は、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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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割合には制限を設けません。

信用取引を行います。

有価証券先物取引等を行います。

スワップ取引を行います。

有価証券の貸付けおよび資金の借入れを行います。

金利先渡取引および為替先渡取引を行います。

「明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド」

投資の基本方針

1 基本方針

この投資信託は、信託財産の長期的な成長を図ることを目標として運用を行います。

2 運用方法

(1) 投資対象

世界各国（日本を除く）の国債、国際機関債、社債等を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとしてこれを中長期的に上回る投資成果を目指します。

シティグループ世界国債インデックスに採用されている国（構成国については定期的な見直しにより変更になる場合があります。）を主な投資対象国とします。

ファンドはインデックス構成国を主要投資対象国としますが、常に投資対象国全てに投資するものではありません。

なお、ファンドは、シティグループ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）をベンチマークとしますが、ベンチマークを上回る場合もあれば下回る場合もあります。ファンドは、中長期的にベンチマークを上回る投資成果の実現を目指しますが、ベンチマークに対して一定の投資成果をあげることを保証するものではありません。また、ベンチマークは今後見直す場合があります。

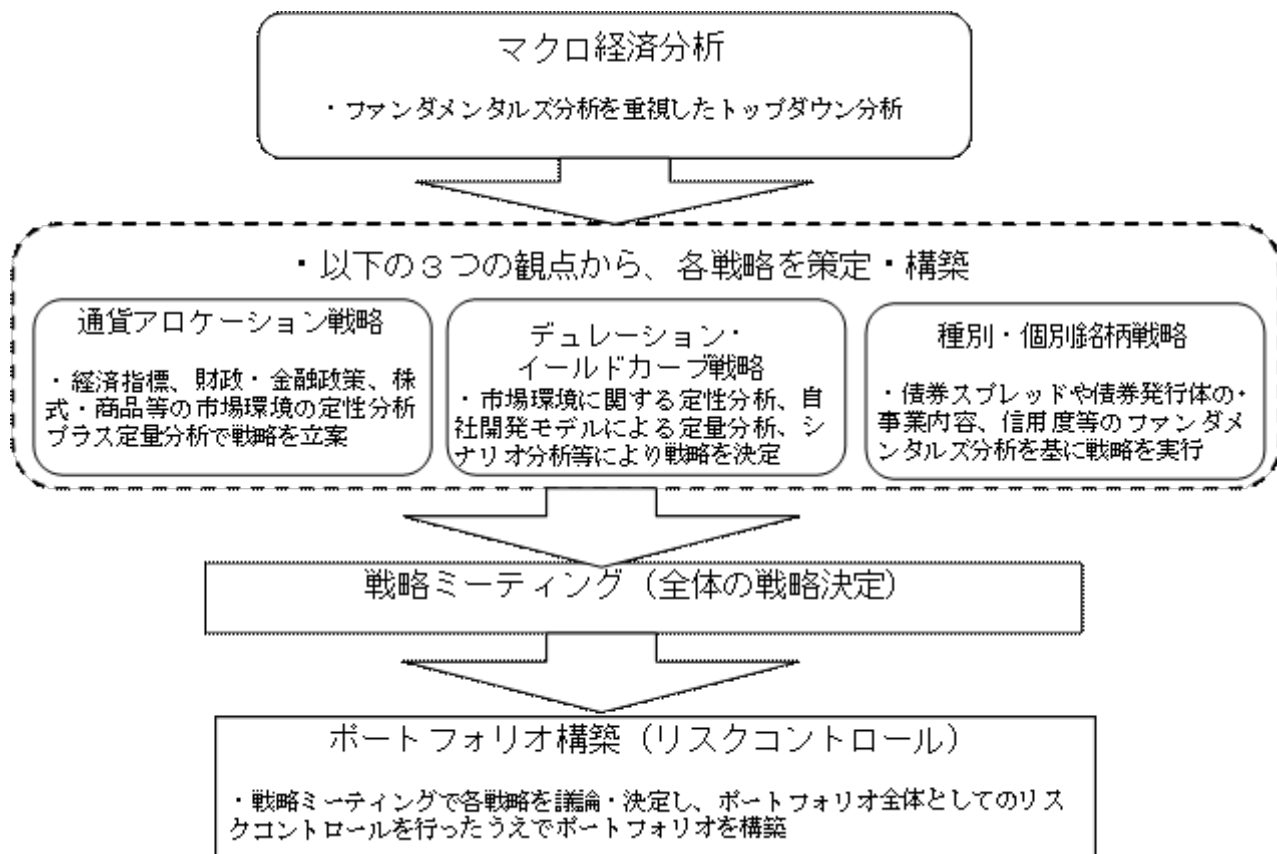
シティグループ世界国債インデックスは、シティグループ・グローバル・マーケット・インクが開発した世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

シティグループ世界国債インデックスに関する著作権等の知的財産権、その他一切の権利はシティグループ・グローバル・マーケット・インクに帰属します。また、同社は当ファンドの運用成果等に関し一切責任はありません。

信用リスクの低減を図るため、原則として取得時に信用ある格付機関によるA格相当以上の格付けを有する公社債およびそれと同等の信用度を有すると委託会社が判断した公社債に投資します。

格付けとは、債券などの元本および利息の支払能力などを専門的な第三者（格付会社）が評価した意見です。格付けが高い債券ほど安全性が高いとされています。一方、発行体にとっては格付けが高いほど有利な条件で発行ができるため、一般的に、格付けが高い債券ほど利回りは低く、格付けが低い債券ほど利回りは高くなります。

運用にあたっては、当社の投資プロセスでポートフォリオの構築、リスク管理を行います。



債券市場は、長期的には経済のファンダメンタルズによって変動するという考えを基本としファンダメンタルズ分析を重視したアクティブ運用を行います。

各国の政治、経済動向の変化や市況動向、リスク分散等を勘案して、国別・通貨別配分比率およびデュレーションの調整を行います。

公社債の組入比率は、原則として高位を保ちます。

組入外貨建資産の為替変動リスクに対するヘッジは原則として行いません。

(3) 投資制限

株式への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

同一銘柄の株式への投資は、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、ならびに転換社債型新株予約権付社債への投資は、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割合には制限を設けません。

有価証券先物取引等を行います。

スワップ取引を行います。

有価証券の貸付けおよび資金の借入れを行います。

金利先渡取引および為替先渡取引を行います。

資金動向、市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【投資対象】

この信託において投資の対象とする資産の種類は、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、約款第23条、第24条および第26条に定めるものに限ります。)

ハ．約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)

二．金銭債権

2．次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として明治安田TOPIXマザーファンド、明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド、明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンドおよび明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンドの各受益証券のほか、次の有価証券に投資することを指図します。

- 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。なお、社債券のうちで、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条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を総称して以下「転換社債型新株予約権付社債」といいます。)
- 6．特定目的会社に係る特定社債券(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．特定目的会社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．コマーシャル・ペーパー
- 11．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
- 12．外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号の証券または証書の性質を有するもの
- 13．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号で定めるものをいいます。)
- 14．投資証券もしくは投資法人債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。)
- 15．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。)
- 16．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す。)
- 17．預託証書(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。)
- 18．外国法人が発行する譲渡性預金証書
- 19．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す。)
- 20．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。)
- 21．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
- 22．外国の者に対する権利で前号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、12.ならびに17.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.までの証券および12.ならびに17.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および14.に記載する証券のうち投資法人債券を以下「公社債」といい、13.および14.の証券(ただし、投資法人債券を除きます。))を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、上記の有価証券のほか、次に掲げる金融商品(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。))により運用することを指図することができます。

- 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号に規定す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

(3)【運用体制】

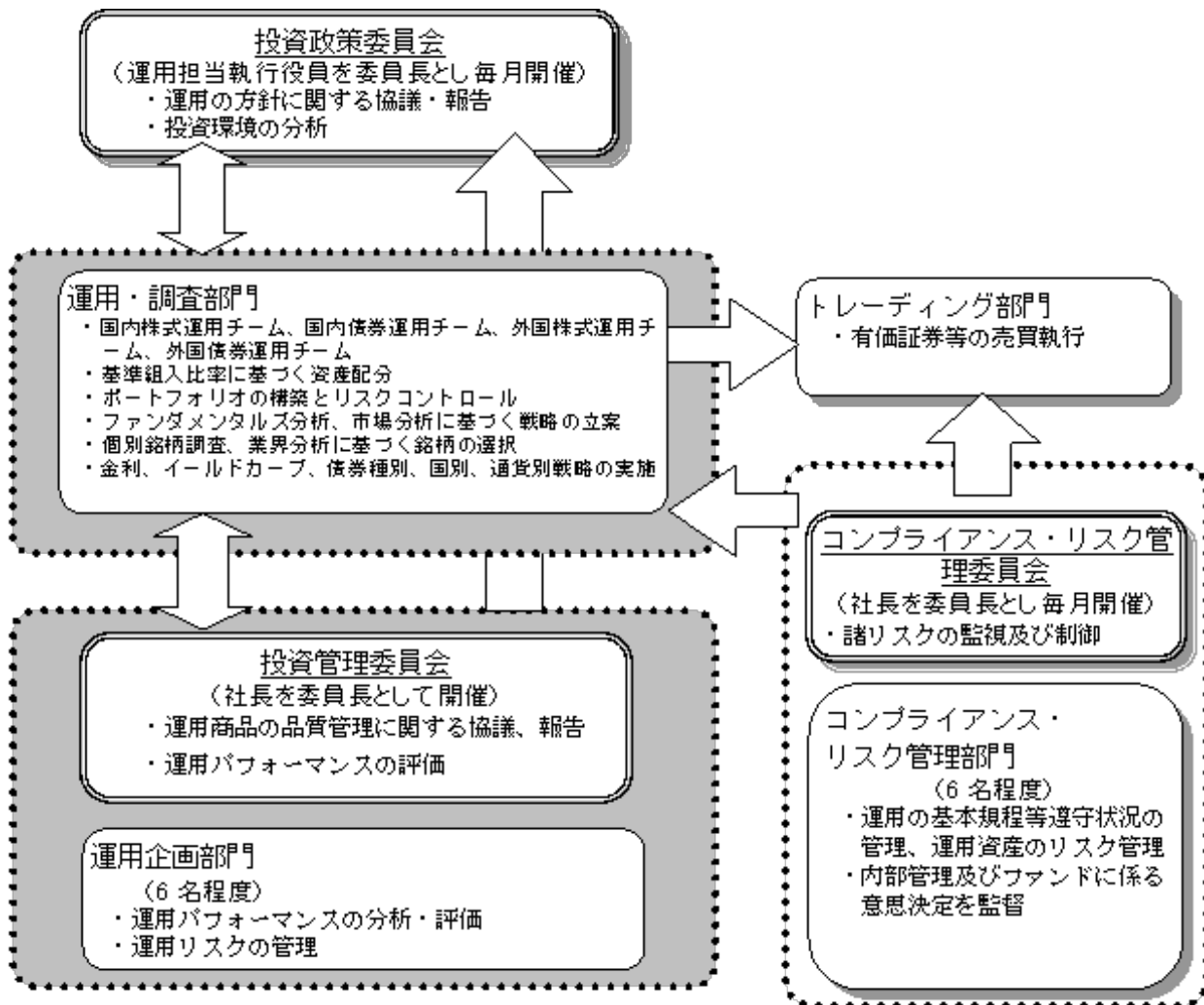
当ファンドの運用体制は以下の通りです。

投資政策委員会にて、マクロ経済環境・市況環境に関する分析、資産配分・資産毎の運用戦略に関する検討を行います。

ファンドの運用担当者は、投資政策委員会における分析・検討等を踏まえて運用計画を策定し、運用計画に基づき、有価証券等の売買をトレーディング部門に指図します。

ファンドに関する運用の基本規程等の遵守状況の管理、運用資産のリスク管理は、運用部門から独立したコンプライアンス・リスク管理部、運用企画部が行います。

投資管理委員会にて、ファンドの運用パフォーマンスの評価等を行い、これを運用部門にフィードバックすることにより、より精度の高い運用体制を維持するよう努めています。



- ファンド運用に関する社内規程として、「投資一任契約および信託財産の運用業務に関する基本規程」及び基本規程に付随する細則等の取扱い基準を設けております。
- ファンドの関係法人に対する管理は、管理関連部門において適正に管理しております。

< 受託会社に対する管理体制 >

当社では、受託会社または受託会社の再信託先に対しては、日々の純資産照会、月次の勘定残高照会などを行っています。また、受託業務の内部統制の有効性についての監査人による報告書を、受託会社より受け取っております。

ファンドの運用体制等は、本書提出日現在のものであり、今後変更となる場合があります。

(4)【分配方針】

収益分配方針

毎年1, 3, 5, 7, 9, 11月の各12日（決算日が休日の場合は翌営業日）に決算を行い、原則として以下の方針に基づき分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
2. 収益分配金額は、基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、必ず分配を行うものではありません。
3. 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

収益の分配方式

1. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

配当金、利子、貸付有価証券に係る品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬に係る消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。

2. 毎計算期末において信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

収益分配金の支払い

収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から（原則として決算日から起算して5営業日まで）、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）に支払います。収益分配金の支払いは、販売会社において行います。なお、分配金再投資コースでお申込みの受益権にかかる収益分配金は、原則として税金を差し引いた後、決算日の基準価額で翌営業日に自動的に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

将来の収益分配金のお支払いおよびその金額について示唆・保証するものではありません。

収益分配金に関する留意事項

- ・分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので、分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。

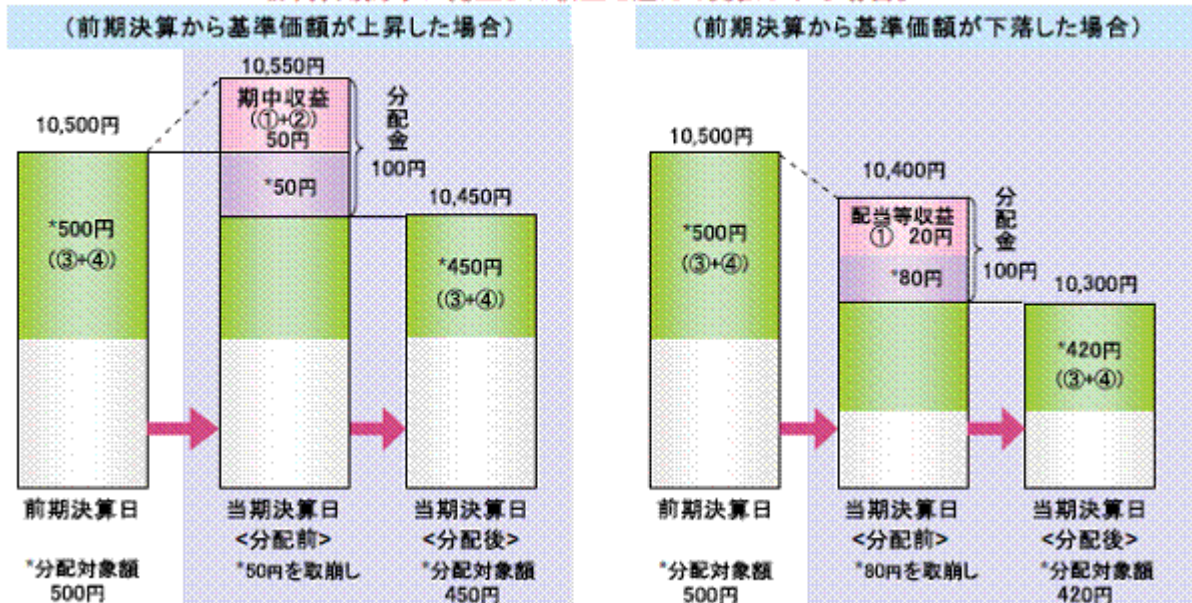
《投資信託で分配金が支払われるイメージ》



上記は投資信託での分配金の支払いをイメージ図にしたものです。

- ・分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。

《計算期間中に発生した収益を超えて支払われる場合》

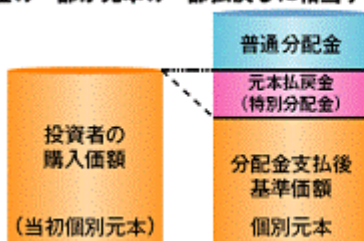


（注）分配対象額は、経費控除後の配当等収益、経費控除後の評価益を含む売買益、分配準備積立金、収益調整金です。分配金は、分配方針に基づき、分配対象額から支払われます。

上記はイメージであり、実際の分配金額や基準価額を示唆するものではありません。

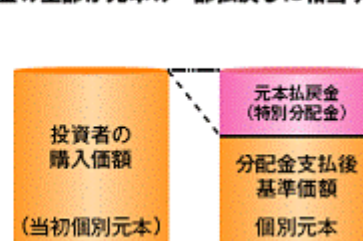
- ・投資者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全部が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンドの購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり率が小さかった場合も同様です。

（分配金の一部が元本の一部払戻しに相当する場合）



※元本払戻金(特別分配金)は、実質的には元本の一部払戻しとみなされ、その金額だけ個別元本が減少します。また、元本払戻金(特別分配金)部分は**非課税扱い**となります。

（分配金の全部が元本の一部払戻しに相当する場合）



普通分配金...個別元本（投資者（受益者）のファンドの購入価額）を上回る部分からの分配金です。

元本払戻金（特別分配金）...個別元本を下回る部分からの分配金です。分配後の投資者（受益者）の個別元本は、元本払戻金（特別分配金）の額だけ減少します。

普通分配金に対する課税については、後述の「4 手数料等及び税金 (5)課税上の取扱い」をご覧ください。

(5)【投資制限】

株式への投資制限（約款 運用の基本方針）

株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の70%未満とします。

実質投資割合とは、当ファンドが保有するある種類の資産の評価額が当ファンドの純資産総額に占める比率（「組入比率」といいます。）と、当該同一種類の資産のマザーファンドにおける組入比率に当該マザーファンド受益証券の当ファンドにおける組入比率を乗じて得た率を合計したものをいいます（以下同じ。）。

外貨建資産への投資制限（約款 運用の基本方針）

外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の75%以下とします。

新株引受権証券等の投資制限（約款 運用の基本方針）

新株引受権証券および新株予約権証券への実質投資割合は、取得時において信託財産の純資産総額の20%以下とします。

同一銘柄の株式への投資制限（約款 運用の基本方針）

同一銘柄の株式への実質投資割合には制限を設けません。

同一銘柄の新株引受権証券等への投資制限（約款 運用の基本方針）

同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券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。

同一銘柄の転換社債等への投資制限（約款 運用の基本方針）

同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債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。

投資信託証券の投資制限（約款 運用の基本方針）

投資信託証券（マザーファンド受益証券は除きます。）への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

投資する株式等の範囲（約款第20条）

1. 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、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。
2. 上記1.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るものとします。

信用取引の指図範囲（約款第22条）

1. 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、株券の引き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るものとします。
2. 上記1.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とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、上記2.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。

先物取引等の運用指図・目的・範囲（約款第23条）

1. 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、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における有価証券先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。）、有価証券指数等先物取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。）および有価証券オプション取引（金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。）ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします。
2. 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、ならびに為替変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引ならびに外国の金融商品取引所における通貨に係る先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
3. 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、ならびに価格変動リスクを回避するため、わが国の金融商品取引所における金利に係る先物取引およびオプション取引ならびに外国の金融商品取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

スワップ取引の運用指図・目的・範囲（約款第24条）

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用ならびに価格変動リスクおよび為替変動リスクを回避するため、異なった通貨、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を行うことの指図をすることができます。
2. 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。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額とマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額(以下「スワップ取引の想定元本の合計額」といいます。以下本項において同じ。)が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計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スワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. 上記3.においてマザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の総額のうち信託財産に属するとみなした額とは、マザーファンドの信託財産に係るスワップ取引の想定元本の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信託財産に属するマザーファンドの時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。
5. 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。
6. 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。

金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図(約款第26条)

1. 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、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
2. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、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。
3. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、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。
4. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡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。
5. 「金利先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ将来の特定の日(以下「決済日」といいます。)における決済日から一定の期間を経過した日(以下「満期日」といいます。)までの期間に係る国内または海外において代表的利率として公表される預金契約または金銭の貸借契約に基づく債権の利率(以下「指標利率」といいます。)の数値を取り決め、その取り決めに係る数値と決済日における当該指標利率の現実の数値との差にあらかじめ元本として定めた金額および当事者間で約定した日数を基準とした数値を乗じた額を決済日における当該指標利率の現実の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。
6. 「為替先渡取引」は、当事者間において、あらかじめ決済日から満期日までの期間に係る為替スワップ取引(同一の相手方との間で直物外国為替取引および当該直物外国為替取引と反対売買の関係に立つ先物外国為替取引を同時に約定する取引をいいます。以下本条において同じ。)のスワップ幅(当該直物外国為替取引に係る外国為替相場と当該先物外国為替取引に係る外国為替相場との差を示す数値をいいます。以下本条において同じ。)を取り決め、その取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭またはその取り決めに係るスワップ幅から決済日における当該為替スワップ取引の現実のスワップ幅を差し引いた値にあらかじめ元本として定めた金額を乗じた金額とあらかじめ元本として定めた金額について決済日を受渡日として行った先物外国為替取引を決済日における直物外国為替取引で反対売買したときの差金に係る決済日から満期日までの利息とを合算した額を決済日における指標利率の数値で決済日における現在価値に割り引いた額の金銭の授受を約する取引をいいます。

有価証券の貸付けの指図および範囲(約款第27条)

1. 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)および)の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
 -)株式の貸付けは、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の50%を超えないものとします。
 -)公社債の貸付けは、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の50%を超えないものとします。
2. 上記)~)に定め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。

3. 委託会社は、有価証券の貸付け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。

有価証券の空売りの指図範囲（約款第28条）

1. 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下記「有価証券の借入れ」の規定により借り入れた有価証券を売付ける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、売付けた有価証券の引き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るものとします。

2. 上記1. 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。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、上記2. 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。

有価証券の借入れ（約款第29条）

1. 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。

2. 上記1. 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。

3. 信託財産の一部解約等の事由により、上記2. 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。

4. 上記1. の借入れに係る品借料は信託財産中から支弁します。

特別の場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第30条）

外貨建有価証券への投資については、わが国の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

外国為替予約取引の指図（約款第31条）

1. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

2. 上記1. の予約取引の指図は、信託財産に係る為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

3. 上記2. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内に、その超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

4. 上記2. 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外貨建資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

資金の借入れ（約款第37条）

1. 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に資するため、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入れた資金の返済を含みます。）を目的として、および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。

2. 上記1. の資金借入額は、次に掲げる要件を満たす範囲内の額とします。

）一部解約に伴う支払資金の手当てにあたっては、一部解約金の支払資金の手当のために行った有価証券等の売却または解約等ならびに有価証券等の償還による受取りの確定している資金の額の範囲内

）再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てにあたっては、収益分配金の再投資額の範囲内

）借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%以内

3. 一部解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、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ます。

4. 再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てのための借入期間は、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ます。

5. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

< 法律等で規制される投資制限 >

同一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全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。

デリバティブ取引に係る投資制限（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）

委託会社は、信託財産に関し、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あらかじめ委託会社が定めた合理的な方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引（新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書に係る取引および選択権付債券売買を含みます。）を行い、または継続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) ファンドのリスクと留意点

ファンドは、マザーファンドを通じて間接的に、株式や公社債など値動きのある証券に投資します（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）ので、基準価額は変動します。したがって、金融機関の預金等と異なり投資元本は保証されず、元本を割り込むおそれがあります。また、ファンドの信託財産に生じた利益および損失は、すべて受益者に帰属します。

なお、ファンドが有する主なリスク等は、以下のとおりです。

1. 値動きの主な要因

株価変動リスク

株式の価格は、政治・経済情勢、金融情勢・金利変動等および発行体の企業の事業活動や財務状況等の影響を受けて変動します。保有する株式価格の下落は、ファンドの基準価額を下げる要因となります。

債券価格変動リスク

債券（公社債等）の価格は、金融情勢・金利変動および信用度等の影響を受けて変動します。一般に債券の価格は、市中金利の水準が上昇すると下落します。保有する債券価格の下落は、ファンドの基準価額を下げる要因となります。

為替変動リスク

外貨建資産への投資については、為替変動による影響を受けます。ファンドが保有する外貨建資産の価格が現地通貨ベースで上昇する場合であっても、当該現地通貨が対円で下落（円高）する場合、円ベースでの評価額は下落することがあります。為替の変動（円高）は、ファンドの基準価額を下げる要因となります。

基準価額の変動要因は上記に限定されるものではありません。

2. その他のリスク・留意点

投資している有価証券等の発行体において、利払いや償還金の支払い遅延等の債務不履行が起こる可能性があります。

有価証券への投資等ファンドに関する取引において、取引の相手方の業績悪化や倒産等による契約不履行が起こる可能性があります。

有価証券を売買しようとする際、需要または供給が少ない場合、希望する時期・価格・数量による売買ができなくなることがあります。

投資対象国の経済や政治等の不安定性に伴う有価証券市場の混乱により当該投資国に投資した資産の価値が大きく下落することがあります。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。ファミリーファンド方式には運用の効率性等の利点がありますが、マザーファンドにおいて他のベビーファンドの追加設定・解約等に伴う売買等を行う場合には、当ファンドの基準価額は影響を受けることがあります。

資金動向、市況動向等によっては、投資方針に沿った運用ができない場合があります。

収益分配は、計算期間中に発生した運用収益（経費控除後の配当等収益および売買益（評価益を含みます。））を超えて行われる場合があるため、分配水準は必ずしも当該計算期間中の収益率を示すものではありません。投資者の個別元本（追加型投資信託を保有する投資者毎の取得元本）の状況により、分配金額の全部または一部が、実質的に元本の一部払戻しに相当する場合があります。

分配金は純資産から支払われるため、分配金支払いに伴う純資産の減少により基準価額が下落する要因となります。当該計算期間中の運用収益を超える分配を行う場合、当期決算日の基準価額は前期決算日の基準価額と比べ下落することとなります。

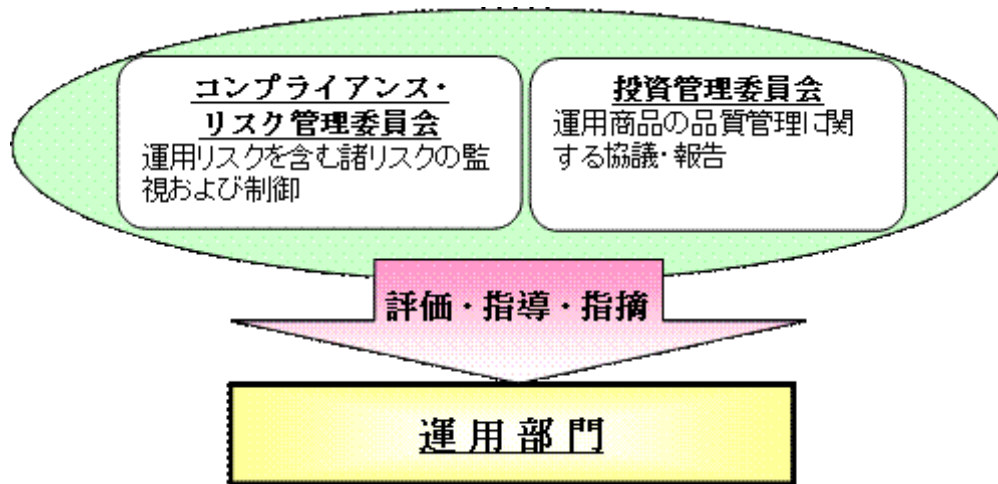
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

(2) リスク管理体制

ファンドの運用にあたっては、社内規程や運用計画に基づき、運用部門が運用プロセスの中でリスクコントロールを行います。また、運用部門から独立した部署により諸リスクの状況が確認され、各種委員会等において協議・報告される体制となっています。

コンプライアンス・リスク管理委員会は、法令諸規則・社内規程等の遵守状況、運用資産のリスク管理状況等を把握・管理し、必要に応じて指示・指摘を行います。

投資管理委員会は、運用パフォーマンスの評価・分析、トレーディング分析、運用スタイル・運用方針との整合性、投資信託財産の運用リスク等を把握・管理し、必要に応じて指導・指摘を行います。



ファンドのリスク管理体制等は、本書提出日現在のものであり、今後変更となることがあります。

4 【手数料等及び税金】

(1) 【申込手数料】

申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込口数を乗じた額に、2.1%（税抜2.0%）を上限として、各販売会社が別途定める料率を乗じて得た額とします。

「税抜」における税とは、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）相当額をいいます。（以下同じ。）

申込手数料につきましては、お申込みの販売会社または下記委託会社にお問合せください。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

分配金再投資コースでお申込みの受益者が販売会社との間で結んだ「自動継続投資契約（販売会社により名称が異なる場合があります。以下同じ。）」に基づき収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

(2) 【換金（解約）手数料】

解約手数料ならびに信託財産留保額はありませぬ。

(3) 【信託報酬等】

信託報酬の総額は、計算期間を通じて毎日、信託財産の純資産総額に対し、年0.987%（税抜0.94%）の率を乗じて得た金額とします。信託報酬の実質的な配分は以下のとおりです。

| 合計 | 委託会社 | 販売会社 | 受託会社 |
|------------------|------------------|------------------|------------------|
| 0.987% (税抜0.94%) | 0.462% (税抜0.44%) | 0.462% (税抜0.44%) | 0.063% (税抜0.06%) |

「税抜」における税とは、消費税等相当額をいいます。

上記信託報酬の支払いは、毎計算期末または信託終了の時に信託財産中から支弁します。

(4) 【その他の手数料等】

ファンドは以下の費用も負担します。

信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用、信託財産に係る監査報酬、当該監査報酬に係る消費税等相当額および受託会社が立替えた立替金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産において一部解約に伴う支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行った場合、当該借入金の利息は信託財産中より支弁します。

ファンドの組入有価証券の売買時の売買委託手数料および当該手数料に係る消費税等に相当する金額、ならびに先物・オプション取引等に要する費用、信託財産を外国で保管する場合の費用等は、受益者の負担とし、信託財産中より支弁します。

その他の費用については、運用状況等により変動するものであり、事前に料率、上限額等を表示することができません。

当該手数料等の合計額については、投資者の皆様の保有期間等に応じて異なりますので、表示することができません。

(5)【課税上の取扱い】

1)個人、法人別の課税の取扱いについて

1.個人の受益者に対する課税

<収益分配金（普通分配金）に対する課税>

個人の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については、以下の税率による源泉徴収（申告不要）となります。なお、確定申告による申告分離課税または総合課税を選択することもできます。

収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。

| 期間 | 税率 |
|--------------------------|---------------------------|
| 平成24年12月31日まで | 10%（所得税7%、地方税3%） |
| 平成25年1月1日から平成25年12月31日まで | 10.147%（所得税7.147%、地方税3%） |
| 平成26年1月1日以降 | 20.315%（所得税15.315%、地方税5%） |

<一部解約時および償還時に対する課税>

一部解約時および償還時の差益（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）については、譲渡所得とみなされ、以下の税率による申告分離課税が適用されます。なお、源泉徴収ありの特定口座を選択している場合は、源泉徴収（原則として、確定申告は不要）となります。

| 期間 | 税率 |
|--------------------------|---------------------------|
| 平成24年12月31日まで | 10%（所得税7%、地方税3%） |
| 平成25年1月1日から平成25年12月31日まで | 10.147%（所得税7.147%、地方税3%） |
| 平成26年1月1日以降 | 20.315%（所得税15.315%、地方税5%） |

<損益通算について>

一部解約時および償還時の損失については、確定申告等により、上場株式等の譲渡益と相殺することができ、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、）との損益通算も可能となります。また、一部解約時および償還時の差益については、他の上場株式等との譲渡損との相殺が可能となります。

2.法人の受益者に対する課税

法人の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一部解約時および償還時の個別元本超過額については、以下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。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）は課税されません。源泉徴収された所得税は、法人税の額から控除できます。

| 期間 | 税率 |
|--------------------------|---------------------|
| 平成24年12月31日まで | 7%（所得税7%） |
| 平成25年1月1日から平成25年12月31日まで | 7.147%（所得税7.147%） |
| 平成26年1月1日以降 | 15.315%（所得税15.315%） |

2)個別元本方式について

- 追加型株式投資信託について、受益者毎の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）が当該受益者の元本（個別元本）にあたります。

2. 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。同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合には各販売会社毎に、個別元本の算出が行われます。また、同一取扱販売会社であっても複数支店で同一ファンドを取得する場合は当該支店毎に、「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」の両コースで取得する場合はコース別に、個別元本の計算が行われる場合があります。
3. 受益者が元本払戻金（特別分配金）を受取った場合、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。

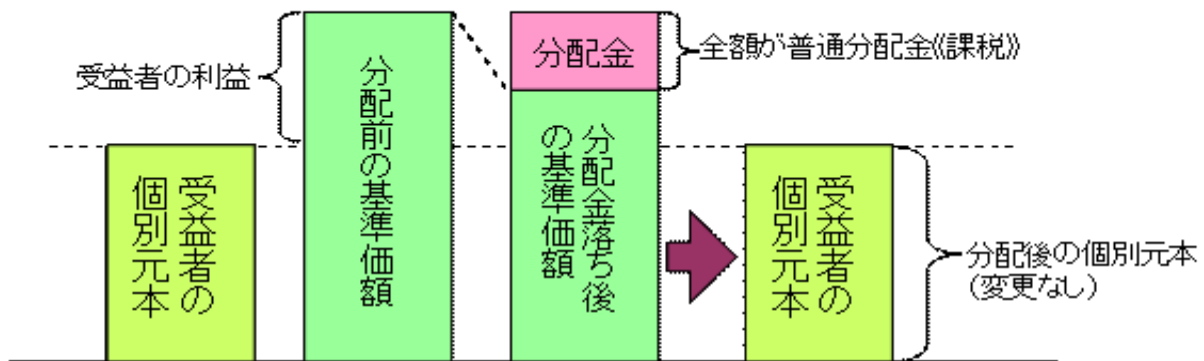
3) 収益分配金の課税について

収益分配金には、課税扱いとなる「普通分配金」と、非課税扱いとなる「元本払戻金（特別分配金）」（受益者毎の元本の一部払い戻しに相当する部分）があります。

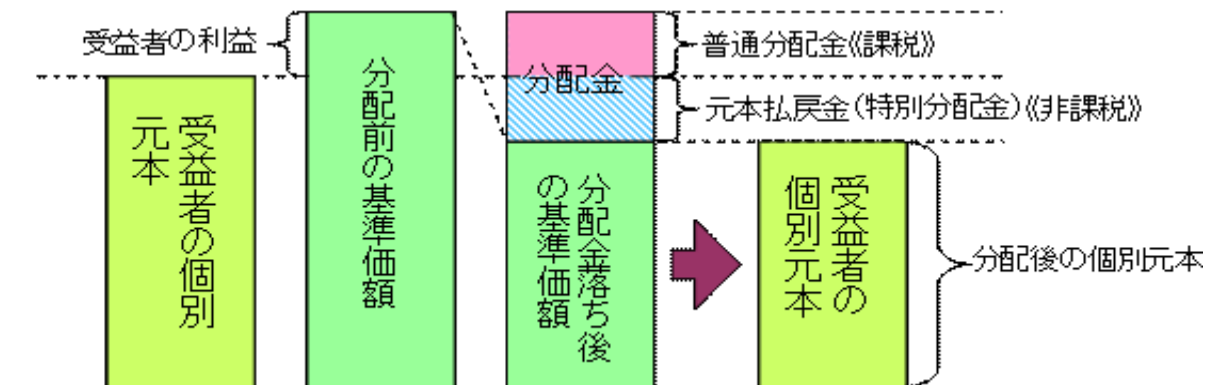
収益分配金落ち後の基準価額が、当該受益者の個別元本と同額の場合または受益者の個別元本を上回っている場合には、当該収益分配金の全額が普通分配金となります。

収益分配金落ち後の基準価額が、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、収益分配金の発生時に、その個別元本から元本払戻金（特別分配金）を控除した額がその後の受益者の個別元本になります。

①の場合



②の場合



上記の図はイメージ図であり、個別元本、基準価額および分配金の各水準等を示唆するものではありません。

当ファンドは、配当控除ならびに益金不算入制度の適用対象となります。

課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家に確認されることをお勧めいたします。

税法が改正された場合等は、上記の内容が変更されることがあります。

5【運用状況】

以下は平成24年10月31日現在の運用状況です。

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比率をいいます。

投資比率の合計は四捨五入の関係で合わない場合があります。

(1)【投資状況】

| 資産の種類 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------------------------|------------|---------|
| 明治安田TOPIXマザーファンド受益証券 | 8,480,141 | 26.69 |
| 明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド受益証券 | 8,291,294 | 26.09 |
| 明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド受益証券 | 7,442,222 | 23.42 |
| 明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド受益証券 | 7,260,224 | 22.85 |
| 小計 | 31,473,881 | 99.05 |
| コール・ローン、その他資産(負債控除後) | 303,385 | 0.95 |
| 合計(純資産総額) | 31,777,266 | 100.00 |

(参考)マザーファンドの投資状況

明治安田TOPIXマザーファンド

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------------------|----|---------------|---------|
| 株式 | 日本 | 3,199,775,510 | 96.70 |
| コール・ローン、その他資産(負債控除後) | | 109,305,874 | 3.30 |
| 合計(純資産総額) | | 3,309,081,384 | 100.00 |

明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|----------------------|------|---------------|---------|
| 国債証券 | 日本 | 2,652,685,660 | 49.63 |
| 社債券 | 日本 | 1,522,345,000 | 28.48 |
| | 韓国 | 301,131,000 | 5.63 |
| | アメリカ | 205,245,000 | 3.84 |
| | オランダ | 100,008,000 | 1.87 |
| | 小計 | 2,128,729,000 | 39.83 |
| 地方債証券 | 日本 | 301,757,090 | 5.65 |
| 特殊債券 | 韓国 | 100,607,000 | 1.88 |
| | 日本 | 62,238,158 | 1.16 |
| | 小計 | 162,845,158 | 3.05 |
| コール・ローン、その他資産(負債控除後) | | 98,695,767 | 1.85 |
| 合計(純資産総額) | | 5,344,712,675 | 100.00 |

明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計(円) | 投資比率(%) |
|-----------|----------------------|---------------|------------|
| 株式 | アメリカ | 2,007,742,340 | 58.99 |
| | イギリス | 361,542,845 | 10.62 |
| | ドイツ | 194,414,707 | 5.71 |
| | フランス | 180,671,516 | 5.31 |
| | カナダ | 163,931,809 | 4.82 |
| | スイス | 150,634,890 | 4.43 |
| | オーストラリア | 54,371,943 | 1.60 |
| | 中国 | 50,907,855 | 1.50 |
| | 香港 | 47,914,565 | 1.41 |
| | スウェーデン | 42,243,974 | 1.24 |
| | オーストリア | 41,440,825 | 1.22 |
| | オランダ | 34,632,775 | 1.02 |
| | ノルウェー | 11,876,358 | 0.35 |
| | スペイン | 8,554,291 | 0.25 |
| | アイルランド | 6,408,111 | 0.19 |
| | 小計 | 3,357,288,804 | 98.64 |
| | コール・ローン、その他資産(負債控除後) | | 46,325,553 |
| 合計(純資産総額) | | 3,403,614,357 | 100.00 |

明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド

| 資産の種類 | 国名 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|----------------------|----------------|----------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 9,900,314,713 | 24.83 |
| | ドイツ | 4,219,203,140 | 10.58 |
| | イタリア | 3,097,801,581 | 7.77 |
| | イギリス | 2,970,382,942 | 7.45 |
| | フランス | 2,524,703,006 | 6.33 |
| | ベルギー | 2,014,037,247 | 5.05 |
| | スペイン | 1,669,915,250 | 4.19 |
| | フィンランド | 1,167,430,060 | 2.93 |
| | メキシコ | 966,775,229 | 2.42 |
| | オランダ | 443,372,427 | 1.11 |
| | オーストリア | 411,961,836 | 1.03 |
| | カナダ | 344,955,457 | 0.87 |
| | ノルウェー | 335,898,680 | 0.84 |
| | デンマーク | 327,707,620 | 0.82 |
| | スウェーデン | 256,564,225 | 0.64 |
| | 南アフリカ | 237,069,250 | 0.59 |
| | マレーシア | 217,702,886 | 0.55 |
| | シンガポール | 166,747,680 | 0.42 |
| | スイス | 161,818,641 | 0.41 |
| | オーストラリア | 119,392,910 | 0.30 |
| 小計 | 31,553,754,780 | 79.13 | |
| 特殊債券 | 国際機関 | 3,110,087,834 | 7.80 |
| | オーストリア | 982,016,616 | 2.46 |
| | ドイツ | 741,475,280 | 1.86 |
| | オランダ | 731,278,800 | 1.83 |
| | フランス | 679,085,568 | 1.70 |
| | オーストラリア | 486,637,275 | 1.22 |
| 小計 | 6,730,581,373 | 16.88 | |
| 地方債証券 | カナダ | 769,947,646 | 1.93 |
| コール・ローン、その他資産（負債控除後） | | 823,096,656 | 2.06 |
| 合計（純資産総額） | | 39,877,380,455 | 100.00 |

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

1.上位銘柄

| 順位 | 銘柄名 | 国名/業種 種類 | 数量（口） | 簿価単価 /簿価額（円） | 評価単価 /評価額 （円） | 投資 比率 （％） |
|----|-------------------------|---------------------|-----------|---------------------|---------------------|-----------------|
| 1 | 明治安田TOPIXマザーファンド | 日本 / - 親投資信託受益証券 | 8,048,730 | 1.0424 8,389,997 | 1.0536 8,480,141 | 26.69 |
| 2 | 明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド | 日本 / - 親投資信託受益証券 | 9,405,893 | 0.8675 8,159,613 | 0.8815 8,291,294 | 26.09 |
| 3 | 明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド | 日本 / - 親投資信託受益証券 | 4,994,780 | 1.4457 7,220,954 | 1.4900 7,442,222 | 23.42 |
| 4 | 明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド | 日本 / - 親投資信託受益証券 | 5,921,880 | 1.2231 7,243,052 | 1.2260 7,260,224 | 22.85 |

2.種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.05 |
| 合計 | 99.05 |

【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) マザーファンドの投資資産

明治安田TOPIXマザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

1. 上位銘柄

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|------|----|-------------------|--------|---------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 株式 | トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 39,900 | 3,397.60 | 135,564,240 | 3,065.00 | 122,293,500 | 3.70 |
| 2 | 日本 | 株式 | 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 232,200 | 417.67 | 96,982,974 | 361.00 | 83,824,200 | 2.53 |
| 3 | 日本 | 株式 | 本田技研工業 | 輸送用機器 | 26,200 | 3,086.63 | 80,869,706 | 2,390.00 | 62,618,000 | 1.89 |
| 4 | 日本 | 株式 | 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 23,100 | 2,756.24 | 63,669,144 | 2,444.00 | 56,456,400 | 1.71 |
| 5 | 日本 | 株式 | キヤノン | 電気機器 | 19,400 | 3,693.91 | 71,661,854 | 2,578.00 | 50,013,200 | 1.51 |
| 6 | 日本 | 株式 | みずほフィナンシャルグループ | 銀行業 | 393,600 | 135.67 | 53,399,712 | 125.00 | 49,200,000 | 1.49 |
| 7 | 日本 | 株式 | 日本電信電話 | 情報・通信業 | 12,900 | 3,839.57 | 49,530,453 | 3,635.00 | 46,891,500 | 1.42 |
| 8 | 日本 | 株式 | 武田薬品工業 | 医薬品 | 12,200 | 3,691.83 | 45,040,326 | 3,710.00 | 45,262,000 | 1.37 |
| 9 | 日本 | 株式 | ファナック | 電気機器 | 3,200 | 14,604.73 | 46,735,136 | 12,710.00 | 40,672,000 | 1.23 |
| 10 | 日本 | 株式 | ソフトバンク | 情報・通信業 | 14,000 | 2,390.12 | 33,461,680 | 2,527.00 | 35,378,000 | 1.07 |
| 11 | 日本 | 株式 | 三菱地所 | 不動産業 | 22,000 | 1,481.91 | 32,602,020 | 1,579.00 | 34,738,000 | 1.05 |
| 12 | 日本 | 株式 | 日本たばこ産業 | 食料品 | 15,300 | 2,279.27 | 34,872,831 | 2,206.00 | 33,751,800 | 1.02 |
| 13 | 日本 | 株式 | 三菱商事 | 卸売業 | 23,400 | 1,926.08 | 45,070,437 | 1,425.00 | 33,345,000 | 1.01 |
| 14 | 日本 | 株式 | セブン&アイ・ホールディングス | 小売業 | 12,800 | 2,321.02 | 29,709,056 | 2,462.00 | 31,513,600 | 0.95 |
| 15 | 日本 | 株式 | 東日本旅客鉄道 | 陸運業 | 5,700 | 5,358.89 | 30,545,693 | 5,480.00 | 31,236,000 | 0.94 |
| 16 | 日本 | 株式 | 日立製作所 | 電気機器 | 73,000 | 478.62 | 34,939,260 | 423.00 | 30,879,000 | 0.93 |
| 17 | 日本 | 株式 | 三井物産 | 卸売業 | 26,300 | 1,399.19 | 36,798,697 | 1,125.00 | 29,587,500 | 0.89 |
| 18 | 日本 | 株式 | エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 情報・通信業 | 251 | 140,834.67 | 35,349,502 | 117,300.00 | 29,442,300 | 0.89 |
| 19 | 日本 | 株式 | アステラス製薬 | 医薬品 | 7,200 | 3,415.40 | 24,590,880 | 3,965.00 | 28,548,000 | 0.86 |
| 20 | 日本 | 株式 | KDDI | 情報・通信業 | 4,300 | 5,312.91 | 22,845,513 | 6,200.00 | 26,660,000 | 0.81 |
| 21 | 日本 | 株式 | 日産自動車 | 輸送用機器 | 39,200 | 841.12 | 32,971,904 | 668.00 | 26,185,600 | 0.79 |
| 22 | 日本 | 株式 | 信越化学工業 | 化学 | 5,800 | 4,513.99 | 26,181,142 | 4,500.00 | 26,100,000 | 0.79 |
| 23 | 日本 | 株式 | 小松製作所 | 機械 | 15,200 | 2,315.11 | 35,189,672 | 1,672.00 | 25,414,400 | 0.77 |
| 24 | 日本 | 株式 | 東京海上ホールディングス | 保険業 | 11,900 | 2,236.72 | 26,616,968 | 2,113.00 | 25,144,700 | 0.76 |
| 25 | 日本 | 株式 | 新日鐵住金 | 鉄鋼 | 137,000 | 227.37 | 31,150,346 | 176.00 | 24,112,000 | 0.73 |
| 26 | 日本 | 株式 | 三井不動産 | 不動産業 | 14,000 | 1,578.25 | 22,095,507 | 1,613.00 | 22,582,000 | 0.68 |
| 27 | 日本 | 株式 | 国際石油開発帝石 | 鉱業 | 43 | 561,265.84 | 24,134,431 | 455,000.00 | 19,565,000 | 0.59 |
| 28 | 日本 | 株式 | 住友商事 | 卸売業 | 17,900 | 1,220.09 | 21,839,611 | 1,088.00 | 19,475,200 | 0.59 |
| 29 | 日本 | 株式 | 伊藤忠商事 | 卸売業 | 24,300 | 913.37 | 22,194,891 | 799.00 | 19,415,700 | 0.59 |
| 30 | 日本 | 株式 | 花王 | 化学 | 8,600 | 2,101.18 | 18,070,148 | 2,242.00 | 19,281,200 | 0.58 |

2. 種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率 (%) |
|----|----------|
| 株式 | 96.70 |
| 合計 | 96.70 |

3. 株式の業種別の投資比率

| 業種名 | 投資比率(%) |
|------------|---------|
| 電気機器 | 11.60 |
| 輸送用機器 | 9.77 |
| 銀行業 | 9.60 |
| 情報・通信業 | 6.24 |
| 化学 | 5.59 |
| 医薬品 | 5.30 |
| 卸売業 | 5.09 |
| 機械 | 4.71 |
| 小売業 | 4.45 |
| 陸運業 | 4.37 |
| 食料品 | 4.04 |
| 不動産業 | 2.91 |
| 建設業 | 2.65 |
| 保険業 | 2.30 |
| 電気・ガス業 | 2.20 |
| サービス業 | 2.06 |
| その他製品 | 1.54 |
| 鉄鋼 | 1.49 |
| 精密機器 | 1.37 |
| 証券、商品先物取引業 | 1.10 |
| 非鉄金属 | 1.09 |
| ガラス・土石製品 | 0.95 |
| その他金融業 | 0.93 |
| 繊維製品 | 0.88 |
| ゴム製品 | 0.81 |
| 石油・石炭製品 | 0.78 |
| 金属製品 | 0.68 |
| 鉱業 | 0.65 |
| 空運業 | 0.58 |
| パルプ・紙 | 0.27 |
| 海運業 | 0.27 |
| 倉庫・運輸関連業 | 0.27 |
| 水産・農林業 | 0.13 |
| 合計 | 96.70 |

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

株価指数先物取引

| 銘柄名 | 取引所 | 買建/ 売建 | 数量 (枚) | 簿価額(円) | 評価額(円) | 投資比率 (%) |
|---------------------|---------|-----------|-----------|-------------|-------------|-------------|
| 株価指数先物取引 TOPIX先物 | 東京証券取引所 | 買建 | 14 | 103,251,760 | 103,740,000 | 3.14 |

(注) 評価額の算定方法：基準日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しています。

明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

1. 上位銘柄

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿 価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 利率 (%) | 償還 期限 | 投資 比率 (%) |
|----|------|-------|-------------------------|-------------|-----------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | 日本 | 国債証券 | 第72回利付国債5年 | 670,000,000 | 100.89 | 675,980,600 | 100.88 | 675,902,700 | 1.5 | 2013/6/20 | 12.65 |
| 2 | 日本 | 国債証券 | 第313回利付国債10年 | 319,000,000 | 105.60 | 336,888,250 | 105.79 | 337,482,860 | 1.3 | 2021/3/20 | 6.31 |
| 3 | 日本 | 社債券 | 第50回トヨタファイナンス無担保社債 | 200,000,000 | 100.00 | 200,000,000 | 99.98 | 199,974,000 | 0.191 | 2015/12/18 | 3.74 |
| 4 | 日本 | 地方債証券 | 平成18年度第8回兵庫県公募債 | 181,000,000 | 107.48 | 194,555,090 | 107.08 | 193,831,090 | 2.1 | 2016/8/24 | 3.63 |
| 5 | 日本 | 国債証券 | 第120回利付国債20年 | 185,000,000 | 100.83 | 186,536,420 | 100.76 | 186,409,700 | 1.6 | 2030/6/20 | 3.49 |
| 6 | 日本 | 社債券 | 第7回みずほコーポレート銀行 | 100,000,000 | 108.59 | 108,590,000 | 109.99 | 109,996,000 | 2.5 | 2019/6/3 | 2.06 |
| 7 | 日本 | 地方債証券 | 第304回大阪府公募債 | 100,000,000 | 107.94 | 107,947,000 | 107.92 | 107,926,000 | 1.98 | 2017/7/28 | 2.02 |
| 8 | 日本 | 国債証券 | 第303回利付国債10年 | 100,000,000 | 106.76 | 106,761,000 | 106.76 | 106,769,000 | 1.4 | 2019/9/20 | 2.00 |
| 9 | 日本 | 社債券 | 第31回大成建設無担保社債 | 100,000,000 | 102.29 | 102,296,000 | 103.25 | 103,253,000 | 1.58 | 2017/12/15 | 1.93 |
| 10 | アメリカ | 社債券 | 第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース円貨社債 | 100,000,000 | 100.73 | 100,733,000 | 103.20 | 103,201,000 | 1.93 | 2015/11/10 | 1.93 |
| 11 | 日本 | 社債券 | 第118回オリックス無担保社債 | 100,000,000 | 103.25 | 103,255,000 | 102.97 | 102,978,000 | 2.18 | 2014/7/30 | 1.93 |
| 12 | 日本 | 社債券 | 第11回りそな銀行 | 100,000,000 | 100.15 | 100,156,000 | 102.74 | 102,749,000 | 1.78 | 2022/3/15 | 1.92 |
| 13 | アメリカ | 社債券 | 第22回シティグループ・インク円貨社債 | 100,000,000 | 102.33 | 102,338,000 | 102.04 | 102,044,000 | 2.13 | 2014/6/20 | 1.91 |
| 14 | 日本 | 社債券 | 第14回KDDI無担保社債 | 100,000,000 | 102.09 | 102,098,000 | 101.58 | 101,589,000 | 1.278 | 2014/5/29 | 1.90 |
| 15 | 韓国 | 特殊債券 | 第9回韓国輸出入銀行円貨債券 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 100.60 | 100,607,000 | 1.11 | 2014/5/27 | 1.88 |
| 16 | 日本 | 社債券 | 第153回オリックス無担保社債 | 100,000,000 | 98.97 | 98,976,000 | 100.59 | 100,590,000 | 0.78 | 2016/9/5 | 1.88 |
| 17 | 韓国 | 社債券 | 第1回新韓銀行円貨社債 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 100.51 | 100,510,000 | 1.32 | 2014/7/17 | 1.88 |
| 18 | 日本 | 社債券 | 第1回三井住友信託銀行 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 100.45 | 100,451,000 | 1.389 | 2022/9/20 | 1.88 |
| 19 | 日本 | 社債券 | 第495回中部電力 | 100,000,000 | 100.11 | 100,110,000 | 100.40 | 100,404,000 | 0.638 | 2016/6/24 | 1.88 |
| 20 | 韓国 | 社債券 | 第5回ハナ銀行円貨社債 | 100,000,000 | 100.47 | 100,474,000 | 100.38 | 100,385,000 | 1.27 | 2014/8/6 | 1.88 |
| 21 | 韓国 | 社債券 | 第4回ウリ銀行円貨社債 | 100,000,000 | 99.60 | 99,600,000 | 100.23 | 100,236,000 | 1.29 | 2014/7/23 | 1.88 |
| 22 | 日本 | 社債券 | 第163回オリックス無担保社債 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 100.16 | 100,168,000 | 0.746 | 2017/8/7 | 1.87 |
| 23 | 日本 | 社債券 | 第16回三菱UFJリース無担保社債 | 100,000,000 | 99.91 | 99,916,000 | 100.11 | 100,119,000 | 0.402 | 2015/2/27 | 1.87 |
| 24 | 日本 | 社債券 | 第17回イオン無担保社債 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 100.10 | 100,100,000 | 0.72 | 2019/8/9 | 1.87 |
| 25 | オランダ | 社債券 | 第18回ラボバンク・ネーデルランド円貨社債 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 100.00 | 100,008,000 | 0.778 | 2017/11/2 | 1.87 |
| 26 | 日本 | 社債券 | 第20回三菱UFJリース無担保社債 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 100.00 | 100,001,000 | 0.331 | 2014/10/31 | 1.87 |
| 27 | 日本 | 社債券 | 第30回富士通無担保社債 | 100,000,000 | 100.00 | 100,000,000 | 99.97 | 99,973,000 | 0.331 | 2015/10/16 | 1.87 |
| 28 | 日本 | 国債証券 | 第82回利付国債20年 | 84,000,000 | 111.96 | 94,046,400 | 112.10 | 94,168,200 | 2.1 | 2025/9/20 | 1.76 |
| 29 | 日本 | 国債証券 | 第296回利付国債10年 | 86,000,000 | 107.15 | 92,149,000 | 107.12 | 92,124,060 | 1.5 | 2018/9/20 | 1.72 |
| 30 | 日本 | 国債証券 | 第113回利付国債20年 | 81,000,000 | 107.71 | 87,246,890 | 109.11 | 88,379,910 | 2.1 | 2029/9/20 | 1.65 |

2. 種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|-------|---------|
| 国債証券 | 49.63 |
| 社債券 | 39.83 |
| 地方債証券 | 5.65 |
| 特殊債券 | 3.05 |
| 合計 | 98.15 |

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。

明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

1. 上位銘柄

| 順位 | 国/地域 | 種類 | 銘柄名 | 業種 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 投資 比率 (%) |
|----|--------|----|------------------------------|------------------------|--------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 株式 | APPLE INC | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 2,260 | 50,458.71 | 114,036,699 | 48,114.63 | 108,739,086 | 3.19 |
| 2 | アメリカ | 株式 | PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 食品・飲料・タバコ | 11,100 | 7,031.68 | 78,051,744 | 7,032.38 | 78,059,471 | 2.29 |
| 3 | アメリカ | 株式 | EXXON MOBIL CORP | エネルギー | 9,300 | 6,697.07 | 62,282,836 | 7,218.78 | 67,134,739 | 1.97 |
| 4 | アメリカ | 株式 | NEXTERA ENERGY INC | 公益事業 | 11,900 | 5,002.82 | 59,533,582 | 5,537.96 | 65,901,762 | 1.94 |
| 5 | スイス | 株式 | NESTLE SA-REG | 食品・飲料・タバコ | 12,700 | 4,785.06 | 60,770,364 | 5,098.28 | 64,748,225 | 1.90 |
| 6 | アメリカ | 株式 | PFIZER INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 31,000 | 1,764.20 | 54,690,254 | 2,025.75 | 62,798,367 | 1.85 |
| 7 | アメリカ | 株式 | WELLS FARGO & CO | 銀行 | 23,100 | 2,659.52 | 61,435,066 | 2,706.05 | 62,509,759 | 1.84 |
| 8 | アメリカ | 株式 | MICROSOFT CORP | ソフトウェア・サービス | 25,000 | 2,459.05 | 61,476,489 | 2,247.20 | 56,180,215 | 1.65 |
| 9 | アメリカ | 株式 | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 電気通信サービス | 15,500 | 3,007.60 | 46,617,908 | 3,563.19 | 55,229,472 | 1.62 |
| 10 | ドイツ | 株式 | BAYER AG-REG | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7,700 | 5,532.45 | 42,599,906 | 6,987.56 | 53,804,277 | 1.58 |
| 11 | フランス | 株式 | PERNOD-RICARD SA | 食品・飲料・タバコ | 6,100 | 7,945.06 | 48,464,907 | 8,624.71 | 52,610,761 | 1.55 |
| 12 | アメリカ | 株式 | GOOGLE INC-CL A | ソフトウェア・サービス | 950 | 50,033.64 | 47,531,966 | 53,782.44 | 51,093,326 | 1.50 |
| 13 | イギリス | 株式 | BG GROUP PLC | エネルギー | 29,900 | 1,808.76 | 54,082,123 | 1,702.42 | 50,902,500 | 1.50 |
| 14 | カナダ | 株式 | BANK OF NOVA SCOTIA | 銀行 | 10,900 | 4,334.07 | 47,241,440 | 4,314.41 | 47,027,140 | 1.38 |
| 15 | スイス | 株式 | CIE FINANCIERE RICHEMON-BR A | 耐久消費財・アパレル | 8,700 | 4,910.55 | 42,721,811 | 5,200.84 | 45,247,390 | 1.33 |
| 16 | イギリス | 株式 | JOHNSON MATTHEY PLC | 素材 | 15,500 | 3,077.64 | 47,703,426 | 2,893.93 | 44,855,915 | 1.32 |
| 17 | アメリカ | 株式 | US BANCORP | 銀行 | 16,900 | 2,473.18 | 41,796,885 | 2,640.72 | 44,628,320 | 1.31 |
| 18 | アメリカ | 株式 | DANAHER CORP | 資本財 | 10,700 | 4,341.93 | 46,458,747 | 4,123.99 | 44,126,780 | 1.30 |
| 19 | アメリカ | 株式 | ALLERGAN INC | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 6,000 | 7,474.49 | 44,846,986 | 7,300.04 | 43,800,254 | 1.29 |
| 20 | アメリカ | 株式 | ABBOTT LABORATORIES | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 8,200 | 4,860.05 | 39,852,464 | 5,216.13 | 42,772,321 | 1.26 |
| 21 | アメリカ | 株式 | WALT DISNEY CO/THE | メディア | 10,700 | 3,364.83 | 36,003,770 | 3,989.37 | 42,686,288 | 1.25 |
| 22 | アメリカ | 株式 | ORACLE CORP | ソフトウェア・サービス | 17,200 | 2,305.51 | 39,654,907 | 2,468.66 | 42,461,010 | 1.25 |
| 23 | スウェーデン | 株式 | ATLAS COPCO AB-A SHS | 資本財 | 21,500 | 1,870.32 | 40,211,989 | 1,964.83 | 42,243,974 | 1.24 |
| 24 | アメリカ | 株式 | HOME DEPOT INC | 小売 | 8,740 | 4,028.40 | 35,208,270 | 4,782.78 | 41,801,553 | 1.23 |
| 25 | カナダ | 株式 | SUNCOR ENERGY INC | エネルギー | 15,500 | 2,411.28 | 37,374,849 | 2,651.28 | 41,094,937 | 1.21 |
| 26 | アメリカ | 株式 | COLGATE-PALMOLIVE CO | 家庭用品・パーソナル用品 | 4,900 | 7,755.92 | 38,004,033 | 8,274.28 | 40,543,992 | 1.19 |

| | | | | | | | | | | |
|----|---------|----|-----------------------------|-------|---------|----------|------------|----------|------------|------|
| 27 | オーストラリア | 株式 | RIO TINTO LTD | 素材 | 8,400 | 5,374.04 | 45,141,972 | 4,706.30 | 39,532,938 | 1.16 |
| 28 | 香港 | 株式 | AIA GROUP LTD | 保険 | 124,200 | 288.45 | 35,825,742 | 314.05 | 39,005,506 | 1.15 |
| 29 | アメリカ | 株式 | AMERICAN EXPRESS CO | 各種金融 | 8,600 | 4,552.15 | 39,148,508 | 4,441.04 | 38,192,987 | 1.12 |
| 30 | イギリス | 株式 | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | エネルギー | 13,500 | 2,807.51 | 37,901,406 | 2,821.58 | 38,091,353 | 1.12 |

2. 種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率(%) |
|----|---------|
| 株式 | 98.64 |
| 合計 | 98.64 |

3. 株式の業種別の投資比率

| 業種名 | 投資比率(%) |
|------------------------|---------|
| エネルギー | 10.96 |
| 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 9.96 |
| 資本財 | 8.84 |
| 食品・飲料・タバコ | 7.46 |
| 素材 | 6.80 |
| 銀行 | 6.49 |
| ソフトウェア・サービス | 6.38 |
| 電気通信サービス | 4.69 |
| 各種金融 | 4.32 |
| テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 4.09 |
| 家庭用品・パーソナル用品 | 3.85 |
| 公益事業 | 3.42 |
| 保険 | 3.13 |
| 耐久消費財・アパレル | 2.87 |
| 小売 | 2.77 |
| 消費者サービス | 2.61 |
| メディア | 2.52 |
| 半導体・半導体製造装置 | 2.42 |
| ヘルスケア機器・サービス | 1.72 |
| 食品・生活必需品小売り | 1.10 |
| 自動車・自動車部品 | 0.97 |
| 運輸 | 0.82 |
| 商業・専門サービス | 0.44 |
| 合計 | 98.64 |

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。

明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド

投資有価証券の主要銘柄

1. 上位銘柄

| 順位 | 国/ 地域 | 種類 | 銘柄名 | 数量 | 帳簿価額 単価 (円) | 帳簿価額 金額 (円) | 評価額 単価 (円) | 評価額 金額 (円) | 利率 (%) | 償還期限 | 投資 比率 (%) |
|----|------------|-----------|----------------------------|-------------|-------------------|-------------------|------------------|------------------|-----------|------------|-----------------|
| 1 | アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B 4.25% | 28,910,000 | 8,749.85 | 2,529,582,907 | 8,605.76 | 2,487,927,925 | 4.25 | 2014/11/15 | 6.24 |
| 2 | ドイツ | 国債 証券 | DEUTSCHLAND REP 4.25% | 17,290,000 | 12,175.25 | 2,105,102,103 | 12,154.13 | 2,101,449,820 | 4.25 | 2017/7/4 | 5.27 |
| 3 | アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B 2% | 22,100,000 | 8,289.54 | 1,831,988,417 | 8,224.89 | 1,817,701,795 | 2 | 2022/2/15 | 4.56 |
| 4 | アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B 4.25% | 14,500,000 | 9,655.58 | 1,400,060,347 | 10,246.88 | 1,485,799,032 | 4.25 | 2040/11/15 | 3.73 |
| 5 | イタリア | 国債 証券 | BTPS 4.75% | 12,700,000 | 10,409.58 | 1,322,017,747 | 10,769.01 | 1,367,664,955 | 4.75 | 2017/5/1 | 3.43 |
| 6 | イタリア | 国債 証券 | BTPS 6.5% | 11,660,000 | 10,678.79 | 1,245,147,749 | 11,472.42 | 1,337,684,206 | 6.5 | 2027/11/1 | 3.35 |
| 7 | アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B 1.25% | 13,500,000 | 8,112.57 | 1,095,197,544 | 8,079.88 | 1,090,785,007 | 1.25 | 2014/4/15 | 2.74 |
| 8 | イギリス | 国債 証券 | TREASURY 1.75% | 7,750,000 | 13,332.96 | 1,033,304,558 | 13,396.97 | 1,038,265,574 | 1.75 | 2017/1/22 | 2.60 |
| 9 | ドイツ | 国債 証券 | DEUTSCHLAND REP 4.25% | 9,300,000 | 11,181.75 | 1,039,903,062 | 11,058.22 | 1,028,415,148 | 4.25 | 2014/7/4 | 2.58 |
| 10 | アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B 1% | 12,500,000 | 8,124.69 | 1,015,587,207 | 8,101.04 | 1,012,631,078 | 1 | 2016/8/31 | 2.54 |
| 11 | オースト リア | 特殊 債券 | OESTER KONTROLBK 1.75% | 12,000,000 | 8,017.77 | 962,133,480 | 8,183.47 | 982,016,616 | 1.75 | 2015/10/5 | 2.46 |
| 12 | ベルギー | 国債 証券 | BELGIAN 3% | 8,300,000 | 10,989.47 | 912,126,463 | 11,045.83 | 916,804,105 | 3 | 2019/9/28 | 2.30 |
| 13 | フィンラ ンド | 国債 証券 | FINNISH GOV'T 3.875% | 7,500,000 | 11,705.18 | 877,888,565 | 11,904.17 | 892,812,937 | 3.875 | 2017/9/15 | 2.24 |
| 14 | フランス | 国債 証券 | FRANCE O.A.T. 5.75% | 5,490,000 | 13,435.91 | 737,631,900 | 14,610.37 | 802,109,340 | 5.75 | 2032/10/25 | 2.01 |
| 15 | ドイツ | 特殊 債券 | KfW 4.875% | 8,000,000 | 9,207.10 | 736,568,224 | 9,268.44 | 741,475,280 | 4.875 | 2017/1/17 | 1.86 |
| 16 | 国際機関 | 特殊 債券 | EUROPEAN INVT BK 4.875% | 8,000,000 | 9,152.93 | 732,234,720 | 9,248.52 | 739,882,080 | 4.875 | 2017/1/17 | 1.86 |
| 17 | 国際機関 | 特殊 債券 | EURO BK RECON&DV 1.625% | 9,000,000 | 8,138.06 | 732,425,904 | 8,183.47 | 736,512,462 | 1.625 | 2015/9/3 | 1.85 |
| 18 | オランダ | 特殊 債券 | BK NED GEMEENTEN 5.125% | 8,000,000 | 8,953.78 | 716,302,720 | 9,140.98 | 731,278,800 | 5.125 | 2016/10/5 | 1.83 |
| 19 | メキシコ | 国債 証券 | MEXICAN BONOS 8% | 102,340,000 | 703.62 | 720,091,564 | 713.81 | 730,516,193 | 8 | 2020/6/11 | 1.83 |
| 20 | アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B 3.625% | 7,800,000 | 9,296.32 | 725,113,116 | 9,355.07 | 729,695,557 | 3.625 | 2021/2/15 | 1.83 |
| 21 | 国際機関 | 特殊 債券 | COUNCIL OF EUROP 5.125% | 7,500,000 | 9,101.15 | 682,586,625 | 9,324.20 | 699,315,225 | 5.125 | 2017/4/20 | 1.75 |
| 22 | カナダ | 地方 債証券 | ONTARIO PROVINCE 4.4% | 7,900,000 | 8,688.60 | 686,399,455 | 8,700.95 | 687,375,259 | 4.4 | 2016/3/8 | 1.72 |
| 23 | フランス | 特殊 債券 | CAISSE AMORT DET 5.25% | 7,400,000 | 9,021.49 | 667,590,630 | 9,176.83 | 679,085,568 | 5.25 | 2016/11/2 | 1.70 |
| 24 | イギリス | 国債 証券 | TREASURY 4.25% | 4,230,000 | 14,994.65 | 634,273,906 | 15,673.32 | 662,981,436 | 4.25 | 2040/12/7 | 1.66 |
| 25 | フランス | 国債 証券 | FRANCE O.A.T. 3% | 5,900,000 | 10,898.12 | 642,989,546 | 11,079.91 | 653,715,179 | 3 | 2022/4/25 | 1.64 |
| 26 | スペイン | 国債 証券 | SPANISH GOV'T 4.25% | 6,200,000 | 10,072.42 | 624,490,100 | 10,372.38 | 643,087,671 | 4.25 | 2016/10/31 | 1.61 |
| 27 | ベルギー | 国債 証券 | BELGIAN 0307 3.25% | 4,750,000 | 10,924.81 | 518,928,505 | 11,277.20 | 535,667,104 | 3.25 | 2016/9/28 | 1.34 |
| 28 | 国際機関 | 特殊 債券 | EUROPEAN INVT BK 5.125% | 5,000,000 | 9,312.25 | 465,612,700 | 9,435.72 | 471,786,350 | 5.125 | 2017/5/30 | 1.18 |
| 29 | アメリカ | 国債 証券 | US TREASURY N/B 3.5% | 5,140,000 | 9,029.46 | 464,114,295 | 9,075.63 | 466,487,841 | 3.5 | 2018/2/15 | 1.17 |
| 30 | ドイツ | 国債 証券 | DEUTSCHLAND REP 4.75% | 2,850,000 | 15,925.25 | 453,869,687 | 15,511.05 | 442,065,190 | 4.75 | 2040/7/4 | 1.11 |

2. 種類別の投資比率

| 種類 | 投資比率（％） |
|-------|---------|
| 国債証券 | 79.13 |
| 特殊債券 | 16.88 |
| 地方債証券 | 1.93 |
| 合計 | 97.94 |

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】

| 期 別 | 純資産総額（円） | | 1万口当たり純資産額（円） | |
|----------------------|-------------|-------------|---------------|--------|
| | 分配落 | 分配付 | 分配落 | 分配付 |
| 第1 特定期間末(平成21年3月12日) | 10,610,523 | 10,627,929 | 9,144 | 9,159 |
| 第2 特定期間末(平成21年9月14日) | 103,655,358 | 103,845,702 | 10,891 | 10,911 |
| 第3 特定期間末(平成22年3月12日) | 109,198,736 | 109,397,361 | 10,995 | 11,015 |
| 第4 特定期間末(平成22年9月13日) | 82,157,947 | 82,319,429 | 10,175 | 10,195 |
| 第5 特定期間末(平成23年3月14日) | 59,400,219 | 59,513,064 | 10,528 | 10,548 |
| 第6 特定期間末(平成23年9月12日) | 44,762,790 | 44,855,411 | 9,666 | 9,686 |
| 第7 特定期間末(平成24年3月12日) | 36,945,745 | 37,014,422 | 10,759 | 10,779 |
| 第8 特定期間末(平成24年9月12日) | 32,387,864 | 32,450,949 | 10,268 | 10,288 |

| | 純資産総額（円） | 1万口当たり純資産額（円） |
|------------|------------|---------------|
| 平成23年10月末日 | 39,424,954 | 10,077 |
| 平成23年11月末日 | 35,059,353 | 9,662 |
| 平成23年12月末日 | 35,462,726 | 9,768 |
| 平成24年1月末日 | 35,199,322 | 9,945 |
| 平成24年2月末日 | 36,697,755 | 10,690 |
| 平成24年3月末日 | 37,341,934 | 10,872 |
| 平成24年4月末日 | 33,355,889 | 10,646 |
| 平成24年5月末日 | 32,154,458 | 9,926 |
| 平成24年6月末日 | 32,460,537 | 10,157 |
| 平成24年7月末日 | 32,312,538 | 10,105 |
| 平成24年8月末日 | 32,089,629 | 10,176 |
| 平成24年9月末日 | 32,515,319 | 10,305 |
| 平成24年10月末日 | 31,777,266 | 10,406 |

【分配の推移】

| | 1万口当たり税込み分配金(円) |
|------------------------------------|-----------------|
| 第1 特定期間（平成20年10月30日から平成21年3月12日まで） | 30 |
| 第2 特定期間（平成21年3月13日から平成21年9月14日まで） | 55 |
| 第3 特定期間（平成21年9月15日から平成22年3月12日まで） | 60 |
| 第4 特定期間（平成22年3月13日から平成22年9月13日まで） | 60 |
| 第5 特定期間（平成22年9月14日から平成23年3月14日まで） | 60 |
| 第6 特定期間（平成23年3月15日から平成23年9月12日まで） | 60 |
| 第7 特定期間（平成23年9月13日から平成24年3月12日まで） | 60 |
| 第8 特定期間（平成24年3月13日から平成24年9月12日まで） | 60 |

【収益率の推移】

| | 収益率（％） |
|------------------------------------|--------|
| 第1 特定期間（平成20年10月30日から平成21年3月12日まで） | 8.26 |
| 第2 特定期間（平成21年3月13日から平成21年9月14日まで） | 19.71 |
| 第3 特定期間（平成21年9月15日から平成22年3月12日まで） | 1.51 |
| 第4 特定期間（平成22年3月13日から平成22年9月13日まで） | 6.91 |
| 第5 特定期間（平成22年9月14日から平成23年3月14日まで） | 4.06 |
| 第6 特定期間（平成23年3月15日から平成23年9月12日まで） | 7.62 |
| 第7 特定期間（平成23年9月13日から平成24年3月12日まで） | 11.93 |
| 第8 特定期間（平成24年3月13日から平成24年9月12日まで） | 4.01 |

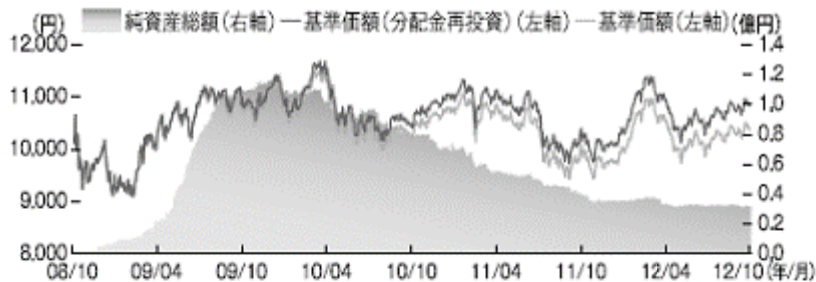
（注）収益率は、特定期間末の基準価額（分配付の額）から当該特定期間の直前の特定期間末の基準価額（分配落の額、以下、「前期末基準価額」といいます。）を控除した額を前期末基準価額で除して得た数に100を乗じた数です。

<参考情報>

以下の事項は交付目論見書の運用実績に記載されているものです。

2012年10月31日現在

基準価額・純資産の推移



※基準価額(分配金再投資)は信託報酬控除後のものであり、分配金(税引前)を再投資したものととして算出しています。

分配の推移

| 分配金の推移 | |
|-------------------------|---------|
| 2012年9月 | 20円 |
| 2012年7月 | 20円 |
| 2012年5月 | 20円 |
| 2012年3月 | 20円 |
| 2012年1月 | 20円 |
| 設定来累計 | 445円 |
| ※分配金は、10,000口あたりの税引前の金額 | |
| 基準価額 | 10,406円 |
| 純資産総額 | 31百万円 |

主要な資産の状況

資産の組入比率

| 資産の種類 | 投資比率(%) |
|-------------------------|---------|
| 明治安田TOPIXマザーファンド | 26.69 |
| 明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド | 26.09 |
| 明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド | 22.85 |
| 明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド | 23.42 |
| その他の資産 | 0.95 |
| 合計(純資産総額) | 100.00 |

組入上位銘柄(マザーファンド)

明治安田TOPIXマザーファンド

| 銘柄名 | 業種 | 投資比率(%) |
|---------------------|-------|---------|
| 1 トヨタ自動車 | 輸送用機器 | 3.70 |
| 2 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 銀行業 | 2.53 |
| 3 本田技研工業 | 輸送用機器 | 1.89 |
| 4 三井住友フィナンシャルグループ | 銀行業 | 1.71 |
| 5 キヤノン | 電気機器 | 1.51 |

明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド

| 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 種類 | 投資比率(%) |
|----------------------|-------|-------------|-------|---------|
| 1 第72回利付国債5年 | 1.5 | 2013年6月20日 | 国債証券 | 12.65 |
| 2 第313回利付国債10年 | 1.3 | 2021年3月20日 | 国債証券 | 6.31 |
| 3 第50回397ファイナンス無担保社債 | 0.191 | 2015年12月18日 | 社債券 | 3.74 |
| 4 平成18年度第8回兵庫県公債 | 2.1 | 2016年8月24日 | 地方債証券 | 3.63 |
| 5 第120回利付国債20年 | 1.6 | 2030年6月20日 | 国債証券 | 3.49 |

明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド

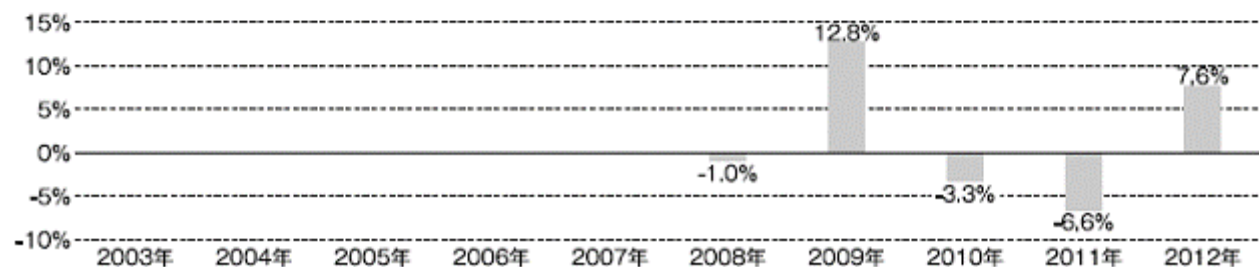
| 銘柄名 | 国/地域 | 業種 | 投資比率(%) |
|-------------------------------|------|-------------|---------|
| 1 APPLE INC | アメリカ | ソフトウェア・IT設備 | 3.19 |
| 2 PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | アメリカ | 食品・飲料・タバコ | 2.29 |
| 3 EXXON MOBIL CORP | アメリカ | エネルギー | 1.97 |
| 4 NEXTERA ENERGY INC | アメリカ | 公益事業 | 1.94 |
| 5 NESTLE SA-REG | スイス | 食品・飲料・タバコ | 1.90 |

明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド

| 銘柄名 | 利率(%) | 償還期限 | 通貨 | 国/地域 | 種類 | 投資比率(%) |
|-------------------------|-------|-------------|-----|------|------|---------|
| 1 US TREASURY N/B 4.25% | 4.25 | 2014年11月15日 | USD | アメリカ | 国債証券 | 6.24 |
| 2 DEUTSCHLAND REP 4.25% | 4.25 | 2017年7月4日 | EUR | ドイツ | 国債証券 | 5.27 |
| 3 US TREASURY N/B 2% | 2 | 2022年2月15日 | USD | アメリカ | 国債証券 | 4.56 |
| 4 US TREASURY N/B 4.25% | 4.25 | 2040年11月15日 | USD | アメリカ | 国債証券 | 3.73 |
| 5 BTPS 4.75% | 4.75 | 2017年5月1日 | EUR | イタリア | 国債証券 | 3.43 |

※投資比率はマザーファンドの対純資産総額比

年間収益率の推移(暦年ベース)



※収益率は分配金(税引前)を再投資したものととして算出しています。

※2008年は設定日(2008年10月30日)から年末までの収益率、2012年は2012年10月末までの収益率を表示しています。

※ファンドにはベンチマークはありません。

ファンドの運用実績はあくまで過去のものであり、将来の運用成果等を約束するものではありません。

(4)【設定及び解約の実績】

| | 設定数量(口) | 解約数量(口) |
|------------------------------------|------------|------------|
| 第1 特定期間（平成20年10月30日から平成21年3月12日まで） | 11,604,344 | 0 |
| 第2 特定期間（平成21年3月13日から平成21年9月14日まで） | 83,888,307 | 320,370 |
| 第3 特定期間（平成21年9月15日から平成22年3月12日まで） | 13,214,680 | 9,074,298 |
| 第4 特定期間（平成22年3月13日から平成22年9月13日まで） | 6,199,450 | 24,770,683 |
| 第5 特定期間（平成22年9月14日から平成23年3月14日まで） | 7,531,558 | 31,850,272 |
| 第6 特定期間（平成23年3月15日から平成23年9月12日まで） | 94,686 | 10,206,449 |
| 第7 特定期間（平成23年9月13日から平成24年3月12日まで） | 119,765 | 12,092,075 |
| 第8 特定期間（平成24年3月13日から平成24年9月12日まで） | 1,159,601 | 3,955,349 |

設定数量には当初申込期間中の販売口数を含みます。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

1. 取得のお申込みの際には、販売会社取引口座を開設していただきます。

販売会社と販売会社以外の取次会社が取次契約を結ぶことにより、当該取次会社がファンドの取扱いを当該販売会社に取次ぐ場合があります。

2. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者に係る口数の増加の記載または記録を行うことができます。
3. 取得価額は取得申込受付日の翌営業日の基準価額となります。取得申込者は、申込金額（取得申込受付日の翌営業日の基準価額に申込口数を乗じた額）、申込手数料および申込手数料に対する消費税等に相当する額の合計額（申込代金）を、販売会社が指定する期日までに販売会社においてお支払いいただきます。
基準価額につきましては、取扱販売会社または下記委託会社にてご確認いただけます。また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

ホームページアドレス（<http://www.myam.co.jp/>）

4. 申込手数料は、取得申込受付日の翌営業日の基準価額に、2.1%（税抜2.0%）を上限として、販売会社が別途定める料率を乗じて得た額とします。

「税抜」における税とは、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）相当額をいいます。（以下同じ。）

申込手数料につきましては、お申込みの販売会社または下記委託会社にお問合せください。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

分配金再投資コースでお申込みの受益者が販売会社との間で結んだ「自動継続投資契約（販売会社により名称が異なる場合があります。以下同じ。）」に基づいて収益分配金を再投資する場合は無手数料とします。

5. お申込単位は、販売会社が定める単位となります。

自動継続投資契約に基づく収益分配金の再投資については、1口単位とします。

6. ファンドのお申込みには、収益の分配が行われるごとに分配金を受益者に支払う「分配金受取りコース」と、分配金は税金を差し引いた後、自動的に無手数料でファンドに再投資する「分配金再投資コース」があります。分配金の受取方法を途中で変更することはできません。

「分配金再投資コース」を選択する場合には、取得申込者は、販売会社との間で自動継続投資契約を締結する必要があります。

販売会社により「分配金受取りコース」と「分配金再投資コース」のどちらか一方のコースのみのお取扱いとなる場合があります。詳しくは販売会社までお問い合わせください。

「分配金再投資コース」で当ファンドの取得申込みをする場合であっても、販売会社によっては、分配金を定期的に受取るための定期引出契約（販売会社により異なる名称を用いる場合があります。）または「分配金出金」に関する契約を締結することにより、分配金を受取ることができる場合があります。

7. 申込期間中における取得申込みの受付時間は、原則として午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は翌営業日の受付として取扱います。
8. 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、取得申込みの受付を中止することおよび既に受付けた取得申込みの受付を取消することができるものとします。

2【換金（解約）手続等】

・信託の一部解約（解約請求制）

1. 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
2. 一部解約の価額（解約価額）は、一部解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。また、当該金額は請求を受付けた日から起算して、原則として5営業日目から受益者に支払います。

基準価額につきましては、取扱販売会社または下記委託会社にてご確認いただけます。また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

ホームページアドレス（<http://www.myam.co.jp/>）

3. 換金の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求に係るこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約に係る受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
4. 換金手数料ならびに信託財産留保額はありませぬ。
5. ご換金単位は、販売会社が定める単位とします。

自動継続投資契約にかかる受益権については1口の整数倍をもって一部解約の実行を請求することができます。

6. 一部解約の実行の請求の受付時間は、原則として午後3時までとし、当該受付時間を過ぎた場合は翌営業日の受付となります。
7. 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、外国為替取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情（投資対象国における非常事態（金融危機、デフォルト、重大な政策変更や資産凍結を含む規制の導入、自然災害、クーデターや重大な政治体制の変更、戦争等）による市場の閉鎖もしくは流動性の極端な減少等）があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよび既に受付けた一部解約の実行の請求の受付を取消することができます。
8. 上記により、一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、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一部解約の実行の請求を受付けたものとして上記の規定に準じて計算された価額とします。
9. 信託財産の資金管理を円滑に行うために大口の解約請求には制限を設ける場合があります。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

基準価額とは、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。）を法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価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（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権総口数で除した金額をいいます。便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されます。

| | |
|-----------|--|
| 株 式 | 原則として、基準価額計算日の金融商品取引所の終値で評価します。 外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。 |
| 公社債等 | 原則として、基準価額計算日における以下のいずれかの価額で評価します。 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（売気配相場を除きます。） 価格情報会社の提供する価額 外国で取引されているものについては、原則として、基準価額計算日の前日とします。 |
| 親投資信託受益証券 | 基準価額計算日の基準価額で評価します。 |
| 外貨建資産 | 原則として、基準価額計算日の対顧客相場の仲値で円換算を行いません。 また、予約為替の評価は、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るものとします。 |

基準価額につきましては、取扱販売会社または下記委託会社にてご確認いただけます。また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

明治安田アセットマネジメント株式会社

電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）

ホームページアドレス（<http://www.myam.co.jp/>）

(2)【保管】

ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、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るため、原則として受益証券は発行されません。したがって、受益証券の保管に関する該当事項はありません。

(3)【信託期間】

この信託の期間は無期限です。

(4)【計算期間】

ファンドの計算期間は、毎年1月13日から3月12日まで、3月13日から5月12日まで、5月13日から7月12日まで、7月13日から9月12日まで、9月13日から11月12日まで、11月13日から翌年1月12日までとすることを原則とします。各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日以降の営業日で該当日に最も近い日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。

(5)【その他】

信託の終了および繰上償還条項

1. 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が30億口を下回ることとなった場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときあるいはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、この信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
2. 委託会社は、上記1. の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
3. 上記2. の書面決議において、受益者（委託会社および当ファンドの信託財産に当ファンドの受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 上記2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の半数以上であって、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。

5. 上記2. から4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記2. から4. までの手続を行うことが困難な場合においては適用しません。

信託契約に関する監督官庁の命令

委託会社は、監督官庁よりこの信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し信託を終了させます。

委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引き継ぐことを命じたときは、「信託約款の変更等」の書面決議が否決された場合を除き、この信託は、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

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。受託会社が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、「信託約款の変更等」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。ただし、委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社はこの信託契約を解約し、信託を終了させます。

償還金について

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から（原則として償還日（償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日）から起算して5営業日までに）、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

1. 委託会社は、事業の全部又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。
2. 委託会社は、分割により事業の全部又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。

信託約款の変更等

1. 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、受託会社と合意のうえ、この信託約款を変更することまたはこの信託と他の信託との併合（投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。）を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は、本項に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
2. 委託会社は、上記1. の事項のうちその内容が重要なもの（変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限ります。以下、併合と合わせて「重大な約款変更等」といいます。）について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款に係る知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
3. 上記2. の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権に係る受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 上記2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の半数以上であつて、当該受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 上記2. から5. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款に係るすべての受益者が書面又は電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 上記各項の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合に係る一又は複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行う

ことはできません。

8. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいてこの信託約款を変更しようとするときは、上記の規定にしたがいます。

反対者の買取請求権

信託契約の解約またはその内容が重大な信託約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該信託契約の解約またはその内容が重大な約款変更等に反対した受益者は、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取すべき旨を請求することができます。ただし、当該買取請求の内容および買取請求の手續事項は、上記「信託の終了および繰上償還条項」および「信託約款の変更等」に規定する書面に付記します。

運用報告書

委託会社は、法令等の定めるところにより、期中の運用経過のほか、信託財産の内容、有価証券売買状況等を記載した運用報告書を、3月および9月の計算期間終了時および償還時に作成のうえ、販売会社を通じて、信託財産にかかる知れている受益者に対して交付します。

その他のディスクロージャー資料について

委託会社は、通常、月次の運用レポートを作成しており、販売会社にて入手可能です。また、委託会社のホームページにおいても入手可能です。

公告

1. 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ない、次のアドレスに掲載します。

<http://www.myam.co.jp/>

2. 前項の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。

他の受益者の氏名等の開示の請求の制限

この信託の受益者は、委託会社または受託会社に対し、次に掲げる事項の開示の請求を行うことはできません。

1. 他の受益者の氏名または名称および住所

2. 他の受益者が有する受益権の内容

関係法人との契約の更改等に関する手続き

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」は、契約期間満了日の3ヵ月前までに委託会社および販売会社いずれかから別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。また、本契約が終了した場合は、受益者に対する支払事務等において受益者に不測の損害を与えぬよう協議します。

4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次のとおりです。

(1) 収益分配金請求権

受益者は委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

収益分配金は、毎計算期間終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から（原則として決算日から起算して5営業日までに）、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

収益分配金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が、収益分配金についてその支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

分配金再投資コースにお申込みされている受益者の収益分配金については、販売会社を通じて、自動継続投資契約に基づき、原則として税控除後、決算日の基準価額で翌営業日に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

(2) 償還金請求権

受益者はファンドにかかる償還金を持分に応じて請求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から（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに）、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）に支払います。

償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

受益者が、信託終了による償還金についてその支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社から交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。

(3) 受益権の買取請求権

信託契約の解約またはその内容が重大な信託約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該信託契約の解約またはその内容が重大な約款変更等に反対した受益者は、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取すべき旨を請求することができます。ただし、当該買取請求の内容及び手続事項は、上記1 資産管理等の概要(5)その他「 信託の終了および繰上償還条項」および「 信託約款の変更等」に規定する書面に付記します。

(4) 信託の一部解約の実行請求権

受益者は、一部解約の実行を販売会社を通して委託会社に請求することができます。一部解約金は、受益者の請求を受付けた日から起算して、原則として、5 営業日目から受益者に支払います。

(5) 帳簿閲覧権

受益者は、委託会社に対し、その営業時間内に、当該受益者に係る信託財産に関する帳簿書類の閲覧または謄写を請求することができます。

第3【ファンドの経理状況】

1. 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和38年大蔵省令第59号）並びに同規則第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. 当ファンドの計算期間は6ヶ月未満であるため、財務諸表は6ヶ月毎に作成しております。
3. 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、第8特定期間（平成24年3月13日から平成24年9月12日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人による監査を受けております。

1【財務諸表】

明治安田資産形成サポートファンド（隔月決算型）

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第7特定期間 (平成24年3月12日現在) | 第8特定期間 (平成24年9月12日現在) |
|-----------------|--------------------------|--------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | 492,012 | 431,226 |
| 親投資信託受益証券 | 36,580,674 | 32,074,097 |
| 流動資産合計 | 37,072,686 | 32,505,323 |
| 資産合計 | 37,072,686 | 32,505,323 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払収益分配金 | 68,677 | 63,085 |
| 未払受託者報酬 | 3,699 | 3,455 |
| 未払委託者報酬 | 54,265 | 50,659 |
| その他未払費用 | 300 | 260 |
| 流動負債合計 | 126,941 | 117,459 |
| 負債合計 | 126,941 | 117,459 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 34,338,643 | 31,542,895 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金() | 2,607,102 | 844,969 |
| (分配準備積立金) | 2,401,040 | 2,213,930 |
| 元本等合計 | 36,945,745 | 32,387,864 |
| 純資産合計 | 36,945,745 | 32,387,864 |
| 負債純資産合計 | 37,072,686 | 32,505,323 |

（２）【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

| | 第7特定期間 （自平成23年9月13日 至平成24年3月12日） | 第8特定期間 （自平成24年3月13日 至平成24年9月12日） |
|---|--|--|
| 営業収益 | | |
| 受取利息 | 28 | 24 |
| 有価証券売買等損益 | 4,258,832 | 1,196,577 |
| 営業収益合計 | 4,258,860 | 1,196,553 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 11,829 | 10,600 |
| 委託者報酬 | 173,548 | 155,404 |
| その他費用 | 950 | 810 |
| 営業費用合計 | 186,327 | 166,814 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 4,072,533 | 1,363,367 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 4,072,533 | 1,363,367 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 4,072,533 | 1,363,367 |
| 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（ ） | 81,506 | 36,658 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | 1,548,163 | 2,607,102 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 381,168 | 3,251 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 380,446 | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 722 | 3,251 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,996 | 248,977 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 248,493 |
| 当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 1,996 | 484 |
| 分配金 | 214,934 | 189,698 |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 2,607,102 | 844,969 |

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | 第8特定期間 (自平成24年3月13日 至平成24年9月12日) |
|------------------------|--|
| 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 移動平均法に基づき、時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | 第7特定期間 (平成24年3月12日現在) | 第8特定期間 (平成24年9月12日現在) |
|----------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 1. 当該特定期間の末日における受 益権の総数 | 34,338,643口 | 31,542,895口 |
| 2. 当該特定期間の末日における1 単位当たりの純資産の額 | 1.0759円 | 1.0268円 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第7特定期間 (自平成23年9月13日 至平成24年3月12日) | | | 第8特定期間 (自平成24年3月13日 至平成24年9月12日) | | |
|--|---|-------------|---|---|-------------|
| 分配金の計算過程 第18期（平成23年9月13日から平成23年11月14日まで） 計算期間末における分配対象額5,328,788円(10,000口 当たり1,447円50銭)のうち、73,627円（10,000口当たり 20円00銭）を分配金額としております。 | | | 分配金の計算過程 第21期（平成24年3月13日から平成24年5月14日まで） 計算期間末における分配対象額4,629,460円(10,000口 当たり1,477円16銭)のうち、62,680円（10,000口当たり 20円00銭）を分配金額としております。 | | |
| 項目 | | 金額または口数 | 項目 | | 金額または口数 |
| 配当等収益額（費用控除後） | A | 178,988円 | 配当等収益額（費用控除後） | A | 142,443円 |
| 有価証券売買等損益額 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | B | -円 | 有価証券売買等損益額 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | B | -円 |
| 収益調整金額 | C | 2,690,783円 | 収益調整金額 | C | 2,298,060円 |
| 分配準備積立金額 | D | 2,459,017円 | 分配準備積立金額 | D | 2,188,957円 |
| 分配対象額（A + B + C + D） | E | 5,328,788円 | 分配対象額（A + B + C + D） | E | 4,629,460円 |
| 期末受益権口数 | F | 36,813,539口 | 期末受益権口数 | F | 31,340,110口 |
| 10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000） | G | 1,447円 50銭 | 10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000） | G | 1,477円 16銭 |
| 10,000口当たりの分配金額 | H | 20円 00銭 | 10,000口当たりの分配金額 | H | 20円 00銭 |
| 分配金額（F × H ÷ 10,000） | I | 73,627円 | 分配金額（F × H ÷ 10,000） | I | 62,680円 |
| 第19期（平成23年11月15日から平成24年1月12日まで） 計算期間末における分配対象額5,240,048円(10,000口 当たり1,442円91銭)のうち、72,630円（10,000口当たり 20円00銭）を分配金額としております。 | | | 第22期（平成24年5月15日から平成24年7月12日まで） 計算期間末における分配対象額4,712,400円(10,000口 当たり1,474円13銭)のうち、63,933円（10,000口当たり 20円00銭）を分配金額としております。 | | |
| 項目 | | 金額または口数 | 項目 | | 金額または口数 |
| 配当等収益額（費用控除後） | A | 55,972円 | 配当等収益額（費用控除後） | A | 53,164円 |
| 有価証券売買等損益額 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | B | -円 | 有価証券売買等損益額 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | B | -円 |
| 収益調整金額 | C | 2,657,212円 | 収益調整金額 | C | 2,422,489円 |
| 分配準備積立金額 | D | 2,526,864円 | 分配準備積立金額 | D | 2,236,747円 |
| 分配対象額（A + B + C + D） | E | 5,240,048円 | 分配対象額（A + B + C + D） | E | 4,712,400円 |
| 期末受益権口数 | F | 36,315,379口 | 期末受益権口数 | F | 31,966,950口 |
| 10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000） | G | 1,442円 91銭 | 10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000） | G | 1,474円 13銭 |
| 10,000口当たりの分配金額 | H | 20円 00銭 | 10,000口当たりの分配金額 | H | 20円 00銭 |
| 分配金額（F × H ÷ 10,000） | I | 72,630円 | 分配金額（F × H ÷ 10,000） | I | 63,933円 |

第20期（平成24年1月13日から平成24年3月12日まで）
 計算期間末における分配対象額4,984,945円(10,000口当たり1,451円68銭)のうち、68,677円（10,000口当たり20円00銭）を分配金額としております。

| 項目 | | 金額または口数 |
|--------------------------------------|---|-------------|
| 配当等収益額（費用控除後） | A | 98,777円 |
| 有価証券売買等損益額 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | B | -円 |
| 収益調整金額 | C | 2,515,228円 |
| 分配準備積立金額 | D | 2,370,940円 |
| 分配対象額（A + B + C + D） | E | 4,984,945円 |
| 期末受益権口数 | F | 34,338,643口 |
| 10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000） | G | 1,451円 68銭 |
| 10,000口当たりの分配金額 | H | 20円 00銭 |
| 分配金額（F × H ÷ 10,000） | I | 68,677円 |

第23期（平成24年7月13日から平成24年9月12日まで）
 計算期間末における分配対象額4,670,093円(10,000口当たり1,480円53銭)のうち、63,085円（10,000口当たり20円00銭）を分配金額としております。

| 項目 | | 金額または口数 |
|--------------------------------------|---|-------------|
| 配当等収益額（費用控除後） | A | 83,259円 |
| 有価証券売買等損益額 （費用控除後、繰越欠損金補填後） | B | -円 |
| 収益調整金額 | C | 2,393,078円 |
| 分配準備積立金額 | D | 2,193,756円 |
| 分配対象額（A + B + C + D） | E | 4,670,093円 |
| 期末受益権口数 | F | 31,542,895口 |
| 10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000） | G | 1,480円 53銭 |
| 10,000口当たりの分配金額 | H | 20円 00銭 |
| 分配金額（F × H ÷ 10,000） | I | 63,085円 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

（1）金融商品の状況に関する事項

| 第8 特定期間 （自 平成24年3月13日 至 平成24年9月12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第2条第4項に定める証券投資信託であり、証券投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（4）附属明細表」に記載しております。これらは、株価変動リスク、信用リスク、流動性リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスクなどに晒されております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | ファンドの運用にあたっては、社内規程や運用計画に基づき、運用部門が運用プロセスの中でリスクコントロールを行います。また、運用部門から独立した部署により諸リスクの状況が確認され、各種委員会等において協議・報告される体制となっております。 |

（2）金融商品の時価等に関する事項

| 第8 特定期間 （平成24年9月12日現在） | |
|---------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | 親投資信託受益証券 「（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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該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 | 第7特定期間 (平成24年3月12日現在) | 第8特定期間 (平成24年9月12日現在) |
|-----------|----------------------------|----------------------------|
| | 最終の計算期間の損益に含まれた評価差額 (円) | 最終の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 | 3,600,683 | 535,417 |
| 合計 | 3,600,683 | 535,417 |

(デリバティブ取引に関する注記)

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。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | 第7特定期間 (平成24年3月12日現在) | 第8特定期間 (平成24年9月12日現在) |
|-----------|--------------------------|--------------------------|
| 1. 期首元本額 | 46,310,953円 | 34,338,643円 |
| 期中追加設定元本額 | 119,765円 | 1,159,601円 |
| 期中一部解約元本額 | 12,092,075円 | 3,955,349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

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|---------------|-----------------------------|------------|------------|----|
| 親投資信託 受益証券 | 明治安田外国債券ポートフォリオ・マザー ファンド | 5,186,430 | 7,498,021 | |
| 親投資信託 受益証券 | 明治安田日本債券ポートフォリオ・マザー ファンド | 6,044,299 | 7,392,782 | |
| 親投資信託 受益証券 | 明治安田外国株式ポートフォリオ・マザー ファンド | 9,961,764 | 8,641,830 | |
| 親投資信託 受益証券 | 明治安田T O P I Xマザーファンド | 8,194,037 | 8,541,464 | |
| | 合計 | 29,386,530 | 32,074,097 | |

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）

当ファンドは「明治安田TOPIXマザーファンド」受益証券、「明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド」受益証券、「明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド」受益証券、「明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド」受益証券を主要投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」は、すべて同親投資信託の受益証券です。

なお、同親投資信託の状況は次の通りです。

「明治安田TOPIXマザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

明治安田TOPIXマザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区分 | (平成24年9月12日現在) | |
|-------------|----------------|---------------|
| | 金額(円) | |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| コール・ローン | | 83,047,591 |
| 株式 1 | | 3,234,324,940 |
| 派生商品評価勘定 | | 177,760 |
| 未収入金 | | 2,567,880 |
| 未収配当金 | | 1,693,455 |
| 未収利息 | | 136 |
| 流動資産合計 | | 3,321,811,762 |
| 資産合計 | | 3,321,811,762 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 前受金 | | 1,355,000 |
| 未払金 | | 219,360 |
| 流動負債合計 | | 1,574,360 |
| 負債合計 | | 1,574,360 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 3,185,303,809 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 134,933,593 |
| 元本等合計 | | 3,320,237,402 |
| 純資産合計 | | 3,320,237,402 |
| 負債純資産合計 | | 3,321,811,762 |

(注) 明治安田TOPIXマザーファンドの計算期間は、毎年3月11日から翌年3月10日までであり、開示対象ファンドの特定期間とは異なります。上記の貸借対照表は平成24年9月12日現在における明治安田TOPIXマザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | (自平成24年3月13日 至平成24年9月12日) |
|-----------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 先物取引 個別法に基づき、市場価額に基づいて時価で評価しております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として株式の配当落ち日において、確定配当金額または予想配当金額を計上しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | (平成24年9月12日現在) |
|------------------------------|--|
| 1. 1 差入委託証拠金代用有価証券 | 先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下のとおり差入を行っております。 株式 51,230,000円 |
| 2. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | 3,185,303,809口 |
| 3. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1.0424円 |

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| (自平成24年3月13日 至平成24年9月12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第2条第4項に定める証券投資信託であり、証券投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、株価変動リスク、信用リスク、流動性リスクなどに晒されております。また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、株価指数先物取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする株価指数先物取引に係る価格変動リスクを有しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | ファンドの運用にあたっては、社内規程や運用計画に基づき、運用部門が運用プロセスの中でリスクコントロールを行います。また、運用部門から独立した部署により諸リスクの状況が確認され、各種委員会等において協議・報告される体制となっております。 |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| (平成24年9月12日現在) | |
|------------------------|---|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | 株式 「(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。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該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の補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| (平成24年9月12日現在) | |
|----------------|----------------------|
| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 437,810,286 |
| 合計 | 437,810,286 |

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(株式関連)

| 区分 | 種類 | (平成24年9月12日現在) | | | |
|------|----------|----------------------------|----------|------------|----------------------|
| | | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 80,553,000 (80,562,240) | - (-) | 80,740,000 | 187,000 (177,760) |
| 合計 | | 80,553,000 (80,562,240) | - (-) | 80,740,000 | 187,000 (177,760) |

(注) 1. 時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

原則として計算期間末日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場で評価しております。このような時価が発表されていない場合には、計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。なお、()内は手数料相当額を含んだ場合の金額を表しております。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | (平成24年9月12日現在) | |
|--------------------------|-----------------------------|----------------|
| 1. 期首元本額 | | 3,230,099,528円 |
| 期中追加設定元本額 | | 174,784,856円 |
| 期中一部解約元本額 | | 219,580,575円 |
| 平成24年9月12日現在における元本の内訳(注) | グローバル・インカム・プラス(毎月分配型) | 1,571,929,925円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(隔月決算型) | 8,194,037円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(1年決算型) | 5,950,932円 |
| | 明治安田TOPIXオープン | 127,350,933円 |
| | 明治安田DC・TOPIXオープン | 1,396,160,307円 |
| | 明治安田VA・TOPIXオープン(適格機関投資家私募) | 75,717,675円 |
| | 合計 | 3,185,303,809円 |

(注) 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

[次へ](#)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----------------|--------|---------|------------|----|
| | | 単価(円) | 金額(円) | |
| 極洋 | 4,000 | 179 | 716,000 | |
| 日本水産 | 5,100 | 176 | 897,600 | |
| マルハニチロホールディングス | 9,000 | 135 | 1,215,000 | |
| サカタのタネ | 700 | 1,030 | 721,000 | |
| ホクト | 500 | 1,570 | 785,000 | |
| 三井松島産業 | 3,000 | 108 | 324,000 | |
| 国際石油開発帝石 | 43 | 455,500 | 19,586,500 | |
| 日本海洋掘削 | 100 | 2,100 | 210,000 | |
| 石油資源開発 | 500 | 3,055 | 1,527,500 | |
| ショーボンドホールディングス | 400 | 2,521 | 1,008,400 | |
| ミライト・ホールディングス | 1,200 | 572 | 686,400 | |
| 間組 | 1,700 | 158 | 268,600 | |
| 東急建設 | 2,540 | 147 | 373,380 | |
| コムシスホールディングス | 1,900 | 1,050 | 1,995,000 | |
| ミサワホーム | 400 | 1,119 | 447,600 | |
| 高松コンストラクショングループ | 400 | 1,452 | 580,800 | |
| 東建コーポレーション | 190 | 3,190 | 606,100 | |
| 大成建設 | 18,000 | 212 | 3,816,000 | |
| 大林組 | 11,000 | 339 | 3,729,000 | |
| 清水建設 | 12,000 | 257 | 3,084,000 | |
| 長谷工コーポレーション | 24,000 | 48 | 1,152,000 | |
| 鹿島建設 | 17,000 | 216 | 3,672,000 | |
| 不動テトラ | 3,200 | 112 | 358,400 | |
| 西松建設 | 6,000 | 113 | 678,000 | |
| 前田建設工業 | 3,000 | 356 | 1,068,000 | |
| 奥村組 | 4,000 | 246 | 984,000 | |
| 東鉄工業 | 700 | 919 | 643,300 | |
| 戸田建設 | 4,000 | 235 | 940,000 | |
| 大東建託 | 1,300 | 7,820 | 10,166,000 | |
| NIPPO | 1,000 | 842 | 842,000 | |
| 前田道路 | 1,000 | 987 | 987,000 | |
| 日本道路 | 1,000 | 276 | 276,000 | |
| 東亜建設工業 | 4,000 | 122 | 488,000 | |
| 東洋建設 | 7,000 | 49 | 343,000 | |
| 五洋建設 | 5,000 | 180 | 900,000 | |
| 住友林業 | 2,600 | 671 | 1,744,600 | |
| 日成ビルド工業 | 2,000 | 139 | 278,000 | |
| エス・パイ・エル | 2,000 | 143 | 286,000 | |
| パナホーム | 2,000 | 470 | 940,000 | |
| 大和ハウス工業 | 9,000 | 1,101 | 9,909,000 | |
| ライト工業 | 1,000 | 298 | 298,000 | |
| 積水ハウス | 10,000 | 778 | 7,780,000 | |
| ユアテック | 1,000 | 247 | 247,000 | |
| 中電工 | 800 | 709 | 567,200 | |
| 関電工 | 2,000 | 363 | 726,000 | |
| きんでん | 3,000 | 481 | 1,443,000 | |
| 東京エネシス | 1,000 | 345 | 345,000 | |
| 日本電設工業 | 1,000 | 717 | 717,000 | |
| 協和エクシオ | 1,200 | 858 | 1,029,600 | |
| 九電工 | 1,000 | 347 | 347,000 | |
| 三機工業 | 1,000 | 364 | 364,000 | |
| 日揮 | 3,000 | 2,525 | 7,575,000 | |
| 中外炉工業 | 2,000 | 228 | 456,000 | |
| 太平電業 | 1,000 | 483 | 483,000 | |
| 高砂熱学工業 | 1,200 | 610 | 732,000 | |
| 大気社 | 600 | 1,556 | 933,600 | |
| 日比谷総合設備 | 700 | 981 | 686,700 | |
| 東芝プラントシステム | 1,000 | 985 | 985,000 | |
| 東洋エンジニアリング | 2,000 | 318 | 636,000 | |

| | | | |
|-----------------|--------|-------|------------|
| 千代田化工建設 | 3,000 | 1,101 | 3,303,000 |
| 新興ブランテック | 900 | 641 | 576,900 |
| 日本製粉 | 3,000 | 334 | 1,002,000 |
| 日清製粉グループ本社 | 3,500 | 949 | 3,321,500 |
| 昭和産業 | 3,000 | 256 | 768,000 |
| 東洋精糖 | 4,000 | 83 | 332,000 |
| 日本甜菜製糖 | 3,000 | 153 | 459,000 |
| 三井製糖 | 2,000 | 256 | 512,000 |
| 森永製菓 | 5,000 | 178 | 890,000 |
| 中村屋 | 2,000 | 403 | 806,000 |
| 江崎グリコ | 1,000 | 926 | 926,000 |
| 不二家 | 2,000 | 193 | 386,000 |
| 山崎製パン | 3,000 | 1,012 | 3,036,000 |
| カルビー | 200 | 6,280 | 1,256,000 |
| 森永乳業 | 4,000 | 262 | 1,048,000 |
| ヤクルト本社 | 1,800 | 3,450 | 6,210,000 |
| 明治ホールディングス | 1,100 | 3,825 | 4,207,500 |
| 雪印メグミルク | 900 | 1,344 | 1,209,600 |
| 日本ハム | 3,000 | 1,051 | 3,153,000 |
| 伊藤ハム | 2,000 | 344 | 688,000 |
| 丸大食品 | 2,000 | 288 | 576,000 |
| 米久 | 500 | 689 | 344,500 |
| S Foods | 1,000 | 701 | 701,000 |
| サッポロホールディングス | 7,000 | 214 | 1,498,000 |
| アサヒグループホールディングス | 6,600 | 1,883 | 12,427,800 |
| キリンホールディングス | 14,000 | 1,023 | 14,322,000 |
| 宝ホールディングス | 4,000 | 553 | 2,212,000 |
| コカ・コーラウエスト | 1,200 | 1,270 | 1,524,000 |
| ダイドードリンコ | 300 | 3,565 | 1,069,500 |
| 伊藤園 | 1,100 | 1,565 | 1,721,500 |
| キーコーヒー | 400 | 1,535 | 614,000 |
| ジャパンフーズ | 700 | 895 | 626,500 |
| 日清オイリオグループ | 2,000 | 306 | 612,000 |
| 不二製油 | 1,000 | 1,069 | 1,069,000 |
| J - オイルミルズ | 3,000 | 212 | 636,000 |
| キッコーマン | 3,000 | 1,039 | 3,117,000 |
| 味の素 | 9,000 | 1,208 | 10,872,000 |
| キュービー | 1,500 | 1,250 | 1,875,000 |
| ハウス食品 | 1,200 | 1,297 | 1,556,400 |
| カゴメ | 1,200 | 1,734 | 2,080,800 |
| アリアケジャパン | 400 | 1,691 | 676,400 |
| ニチレイ | 5,000 | 407 | 2,035,000 |
| 東洋水産 | 1,000 | 1,967 | 1,967,000 |
| 日清食品ホールディングス | 1,200 | 3,080 | 3,696,000 |
| ロック・フィールド | 400 | 1,437 | 574,800 |
| 日本たばこ産業 | 15,600 | 2,178 | 33,976,800 |
| 片倉工業 | 800 | 694 | 555,200 |
| グンゼ | 3,000 | 197 | 591,000 |
| 東洋紡績 | 15,000 | 85 | 1,275,000 |
| ユニチカ | 12,000 | 38 | 456,000 |
| 富士紡ホールディングス | 2,000 | 267 | 534,000 |
| 日清紡ホールディングス | 2,000 | 482 | 964,000 |
| 倉敷紡績 | 5,000 | 125 | 625,000 |
| シキボウ | 3,000 | 88 | 264,000 |
| 日本毛織 | 2,000 | 535 | 1,070,000 |
| ダイドーリミテッド | 800 | 507 | 405,600 |
| 帝人 | 14,000 | 176 | 2,464,000 |
| 東レ | 24,000 | 475 | 11,400,000 |
| アツギ | 6,000 | 92 | 552,000 |
| ダイニック | 3,000 | 144 | 432,000 |
| セーレン | 1,200 | 523 | 627,600 |
| ワコールホールディングス | 2,000 | 877 | 1,754,000 |
| ホギメディカル | 200 | 4,040 | 808,000 |
| T S Iホールディングス | 1,800 | 475 | 855,000 |
| 三陽商会 | 2,000 | 238 | 476,000 |
| オンワードホールディングス | 2,000 | 600 | 1,200,000 |

| | | | |
|--------------------|--------|-------|------------|
| ルック | 1,000 | 548 | 548,000 |
| ゴールドウイン | 1,000 | 479 | 479,000 |
| デサント | 1,000 | 447 | 447,000 |
| 特種東海製紙 | 3,000 | 201 | 603,000 |
| 王子製紙 | 16,000 | 244 | 3,904,000 |
| 三菱製紙 | 10,000 | 65 | 650,000 |
| 北越紀州製紙 | 2,500 | 377 | 942,500 |
| 日本製紙グループ本社 | 1,800 | 944 | 1,699,200 |
| レンゴー | 3,000 | 380 | 1,140,000 |
| クラレ | 5,200 | 916 | 4,763,200 |
| 旭化成 | 19,000 | 405 | 7,695,000 |
| 昭和電工 | 21,000 | 128 | 2,688,000 |
| 住友化学 | 23,000 | 206 | 4,738,000 |
| 日産化学工業 | 2,700 | 929 | 2,508,300 |
| クレハ | 3,000 | 321 | 963,000 |
| 石原産業 | 7,000 | 58 | 406,000 |
| 日本曹達 | 3,000 | 350 | 1,050,000 |
| 東ソー | 10,000 | 157 | 1,570,000 |
| トクヤマ | 5,000 | 174 | 870,000 |
| セントラル硝子 | 4,000 | 253 | 1,012,000 |
| 東亜合成 | 5,000 | 292 | 1,460,000 |
| ダイソー | 2,000 | 205 | 410,000 |
| 関東電化工業 | 1,000 | 178 | 178,000 |
| 電気化学工業 | 8,000 | 249 | 1,992,000 |
| 信越化学工業 | 5,900 | 4,395 | 25,930,500 |
| エア・ウォーター | 3,000 | 928 | 2,784,000 |
| 大陽日酸 | 4,000 | 412 | 1,648,000 |
| 日本パーカライジング | 1,000 | 1,132 | 1,132,000 |
| 戸田工業 | 1,000 | 299 | 299,000 |
| ステラ ケミファ | 200 | 1,515 | 303,000 |
| 保土谷化学工業 | 2,000 | 170 | 340,000 |
| 日本触媒 | 2,000 | 882 | 1,764,000 |
| 大日精化工業 | 2,000 | 334 | 668,000 |
| カネカ | 4,000 | 376 | 1,504,000 |
| 三菱瓦斯化学 | 6,000 | 421 | 2,526,000 |
| 三井化学 | 14,000 | 157 | 2,198,000 |
| J S R | 3,000 | 1,359 | 4,077,000 |
| 東京応化工業 | 700 | 1,788 | 1,251,600 |
| 三菱ケミカルホールディングス | 21,000 | 303 | 6,363,000 |
| 日本合成化学工業 | 1,000 | 521 | 521,000 |
| ダイセル | 4,000 | 476 | 1,904,000 |
| 住友ベークライト | 3,000 | 311 | 933,000 |
| 積水化学工業 | 7,000 | 615 | 4,305,000 |
| 日本ゼオン | 3,000 | 620 | 1,860,000 |
| アイカ工業 | 1,100 | 1,338 | 1,471,800 |
| 宇部興産 | 15,000 | 176 | 2,640,000 |
| 積水樹脂 | 1,000 | 787 | 787,000 |
| 旭有機材工業 | 2,000 | 183 | 366,000 |
| 日立化成工業 | 1,400 | 1,133 | 1,586,200 |
| リケンテクノス | 2,000 | 216 | 432,000 |
| 日本化薬 | 3,000 | 810 | 2,430,000 |
| A D E K A | 1,600 | 591 | 945,600 |
| 日油 | 3,000 | 379 | 1,137,000 |
| 花王 | 8,700 | 2,346 | 20,410,200 |
| 三洋化成工業 | 1,000 | 411 | 411,000 |
| 日本ペイント | 3,000 | 671 | 2,013,000 |
| 関西ペイント | 4,000 | 788 | 3,152,000 |
| 中国塗料 | 1,000 | 376 | 376,000 |
| 太陽ホールディングス | 300 | 2,162 | 648,600 |
| D I C | 13,000 | 131 | 1,703,000 |
| サカタインクス | 1,000 | 369 | 369,000 |
| 東洋インキ S C ホールディングス | 3,000 | 272 | 816,000 |
| 富士フイルムホールディングス | 7,100 | 1,334 | 9,471,400 |
| 資生堂 | 5,500 | 1,120 | 6,160,000 |
| ライオン | 4,000 | 462 | 1,848,000 |
| 高砂香料工業 | 2,000 | 397 | 794,000 |

| | | | |
|------------------|--------|---------|------------|
| マンダム | 500 | 2,025 | 1,012,500 |
| ファンケル | 900 | 908 | 817,200 |
| コーセー | 600 | 1,760 | 1,056,000 |
| ドクターシーラボ | 3 | 264,000 | 792,000 |
| ポーラ・オルビスホールディングス | 400 | 2,684 | 1,073,600 |
| コニシ | 400 | 1,194 | 477,600 |
| 長谷川香料 | 500 | 979 | 489,500 |
| 小林製薬 | 400 | 4,210 | 1,684,000 |
| 日本高純度化学 | 2 | 188,600 | 377,200 |
| 荏原ユーザライト | 100 | 2,430 | 243,000 |
| アース製薬 | 300 | 2,897 | 869,100 |
| 日本農薬 | 1,000 | 362 | 362,000 |
| アキレス | 6,000 | 103 | 618,000 |
| 日東電工 | 2,700 | 3,760 | 10,152,000 |
| レック | 300 | 1,027 | 308,100 |
| 藤森工業 | 400 | 1,664 | 665,600 |
| J S P | 300 | 1,165 | 349,500 |
| エフピコ | 200 | 5,800 | 1,160,000 |
| ニフコ | 800 | 1,872 | 1,497,600 |
| 日本バルカー工業 | 2,000 | 213 | 426,000 |
| ユニ・チャーム | 1,700 | 4,515 | 7,675,500 |
| 協和発酵キリン | 5,000 | 901 | 4,505,000 |
| 武田薬品工業 | 12,400 | 3,685 | 45,694,000 |
| アステラス製薬 | 7,400 | 4,040 | 29,896,000 |
| 大日本住友製薬 | 2,500 | 848 | 2,120,000 |
| 塩野義製薬 | 5,300 | 1,166 | 6,179,800 |
| 田辺三菱製薬 | 3,200 | 1,152 | 3,686,400 |
| 日本新薬 | 1,000 | 952 | 952,000 |
| 中外製薬 | 3,900 | 1,585 | 6,181,500 |
| 科研製薬 | 1,000 | 1,135 | 1,135,000 |
| エーザイ | 4,100 | 3,515 | 14,411,500 |
| ロート製薬 | 2,000 | 1,161 | 2,322,000 |
| 小野薬品工業 | 1,600 | 4,710 | 7,536,000 |
| 久光製薬 | 1,000 | 4,270 | 4,270,000 |
| 持田製薬 | 1,000 | 956 | 956,000 |
| 参天製薬 | 1,100 | 3,405 | 3,745,500 |
| ツムラ | 900 | 2,439 | 2,195,100 |
| 日医工 | 600 | 1,824 | 1,094,400 |
| キッセイ薬品工業 | 700 | 1,345 | 941,500 |
| 生化学工業 | 900 | 902 | 811,800 |
| 鳥居薬品 | 400 | 1,727 | 690,800 |
| 東和薬品 | 200 | 5,140 | 1,028,000 |
| 沢井製薬 | 200 | 9,080 | 1,816,000 |
| ゼリア新薬工業 | 1,000 | 1,310 | 1,310,000 |
| 第一三共 | 11,200 | 1,293 | 14,481,600 |
| キョーリン製薬ホールディングス | 900 | 1,781 | 1,602,900 |
| 大塚ホールディングス | 6,400 | 2,399 | 15,353,600 |
| 大正製薬ホールディングス | 800 | 6,350 | 5,080,000 |
| 日本コークス工業 | 5,000 | 97 | 485,000 |
| 昭和シェル石油 | 3,400 | 389 | 1,322,600 |
| コスモ石油 | 10,000 | 146 | 1,460,000 |
| 東燃ゼネラル石油 | 5,000 | 641 | 3,205,000 |
| ピーピー・カストロール | 1,500 | 340 | 510,000 |
| A O Cホールディングス | 1,200 | 232 | 278,400 |
| 出光興産 | 400 | 6,230 | 2,492,000 |
| J Xホールディングス | 36,800 | 408 | 15,014,400 |
| 横浜ゴム | 4,000 | 589 | 2,356,000 |
| 東洋ゴム工業 | 3,000 | 212 | 636,000 |
| ブリヂストン | 10,400 | 1,899 | 19,749,600 |
| 住友ゴム工業 | 2,500 | 946 | 2,365,000 |
| オカモト | 2,000 | 314 | 628,000 |
| ニッタ | 400 | 1,207 | 482,800 |
| 東海ゴム工業 | 800 | 824 | 659,200 |
| 三ツ星ベルト | 1,000 | 480 | 480,000 |
| バンドー化学 | 2,000 | 272 | 544,000 |
| 日東紡績 | 3,000 | 260 | 780,000 |

| | | | |
|--------------------|--------|-------|------------|
| 旭硝子 | 17,000 | 483 | 8,211,000 |
| 日本電気硝子 | 7,000 | 412 | 2,884,000 |
| 住友大阪セメント | 7,000 | 253 | 1,771,000 |
| 太平洋セメント | 20,000 | 163 | 3,260,000 |
| 東海カーボン | 4,000 | 244 | 976,000 |
| 日本カーボン | 3,000 | 138 | 414,000 |
| 東洋炭素 | 200 | 1,936 | 387,200 |
| ノリタケカンパニーリミテド | 3,000 | 197 | 591,000 |
| TOTO | 6,000 | 566 | 3,396,000 |
| 日本碍子 | 5,000 | 953 | 4,765,000 |
| 日本特殊陶業 | 3,000 | 867 | 2,601,000 |
| MARUWA | 100 | 2,350 | 235,000 |
| フジインコーポレーテッド | 500 | 1,208 | 604,000 |
| ニチアス | 2,000 | 396 | 792,000 |
| ニチハ | 600 | 941 | 564,600 |
| 新日本製鐵 | 87,000 | 165 | 14,355,000 |
| 住友金属工業 | 62,000 | 121 | 7,502,000 |
| 神戸製鋼所 | 47,000 | 61 | 2,867,000 |
| 日新製鋼 | 13,000 | 86 | 1,118,000 |
| 合同製鐵 | 3,000 | 123 | 369,000 |
| ジェイ エフ イー ホールディングス | 7,900 | 1,092 | 8,626,800 |
| 東京製鐵 | 1,800 | 277 | 498,600 |
| 共英製鋼 | 400 | 1,448 | 579,200 |
| 大和工業 | 800 | 2,358 | 1,886,400 |
| 大阪製鐵 | 300 | 1,382 | 414,600 |
| 淀川製鋼所 | 3,000 | 271 | 813,000 |
| 丸一鋼管 | 1,000 | 1,626 | 1,626,000 |
| 大同特殊鋼 | 6,000 | 402 | 2,412,000 |
| 山陽特殊製鋼 | 2,000 | 262 | 524,000 |
| 愛知製鋼 | 2,000 | 321 | 642,000 |
| 日立金属 | 2,000 | 808 | 1,616,000 |
| 大平洋金属 | 3,000 | 262 | 786,000 |
| 日本電工 | 1,000 | 222 | 222,000 |
| 栗本鐵工所 | 2,000 | 285 | 570,000 |
| 三菱製鋼 | 3,000 | 145 | 435,000 |
| 日本軽金属 | 9,000 | 78 | 702,000 |
| 三井金属鉱業 | 10,000 | 165 | 1,650,000 |
| 東邦亜鉛 | 2,000 | 268 | 536,000 |
| 三菱マテリアル | 21,000 | 232 | 4,872,000 |
| 住友金属鉱山 | 9,000 | 908 | 8,172,000 |
| DOWAホールディングス | 4,000 | 525 | 2,100,000 |
| 古河機械金属 | 10,000 | 69 | 690,000 |
| 大阪チタニウムテクノロジーズ | 300 | 1,701 | 510,300 |
| 東邦チタニウム | 600 | 747 | 448,200 |
| 住友軽金属工業 | 9,000 | 68 | 612,000 |
| 古河スカイ | 2,000 | 197 | 394,000 |
| 古河電気工業 | 11,000 | 151 | 1,661,000 |
| 住友電気工業 | 11,800 | 902 | 10,643,600 |
| フジクラ | 6,000 | 245 | 1,470,000 |
| 昭和電線ホールディングス | 6,000 | 61 | 366,000 |
| 日立電線 | 3,000 | 105 | 315,000 |
| リョービ | 2,000 | 182 | 364,000 |
| アサヒホールディングス | 500 | 1,412 | 706,000 |
| 宮地エンジニアリンググループ | 2,000 | 118 | 236,000 |
| 三協・立山ホールディングス | 6,000 | 159 | 954,000 |
| トーカロ | 300 | 1,123 | 336,900 |
| SUMCO | 2,200 | 550 | 1,210,000 |
| 東洋製罐 | 2,400 | 820 | 1,968,000 |
| 横河ブリッジホールディングス | 1,000 | 569 | 569,000 |
| 駒井ハルテック | 1,000 | 197 | 197,000 |
| 三和ホールディングス | 4,000 | 309 | 1,236,000 |
| 文化シャッター | 1,000 | 335 | 335,000 |
| LIXILグループ | 4,300 | 1,755 | 7,546,500 |
| ノーリツ | 800 | 1,335 | 1,068,000 |
| 長府製作所 | 400 | 1,774 | 709,600 |
| リンナイ | 500 | 5,610 | 2,805,000 |

| | | | |
|---------------|--------|--------|------------|
| 東プレ | 800 | 728 | 582,400 |
| 高周波熱錬 | 800 | 468 | 374,400 |
| 東京製綱 | 3,000 | 94 | 282,000 |
| 日本発條 | 2,500 | 745 | 1,862,500 |
| 三益半導体工業 | 600 | 617 | 370,200 |
| 日本製鋼所 | 5,000 | 445 | 2,225,000 |
| 三浦工業 | 500 | 1,950 | 975,000 |
| タクマ | 1,000 | 384 | 384,000 |
| ツガミ | 1,000 | 494 | 494,000 |
| オークマ | 2,000 | 460 | 920,000 |
| 東芝機械 | 2,000 | 308 | 616,000 |
| アマダ | 5,000 | 356 | 1,780,000 |
| アイダエンジニアリング | 1,200 | 516 | 619,200 |
| 牧野フライス製作所 | 2,000 | 365 | 730,000 |
| オーエスジー | 1,500 | 1,055 | 1,582,500 |
| 旭ダイヤモンド工業 | 900 | 858 | 772,200 |
| 森精機製作所 | 1,900 | 500 | 950,000 |
| ディスコ | 400 | 3,770 | 1,508,000 |
| 島精機製作所 | 500 | 1,055 | 527,500 |
| 日阪製作所 | 1,000 | 540 | 540,000 |
| ナブテスコ | 1,400 | 1,568 | 2,195,200 |
| 三井海洋開発 | 300 | 1,477 | 443,100 |
| S M C | 1,000 | 12,200 | 12,200,000 |
| 新川 | 800 | 362 | 289,600 |
| ホソカワミクロン | 1,000 | 410 | 410,000 |
| ユニオンツール | 300 | 1,201 | 360,300 |
| オイレス工業 | 500 | 1,642 | 821,000 |
| サトーホールディングス | 500 | 1,155 | 577,500 |
| 小松製作所 | 15,500 | 1,590 | 24,645,000 |
| 住友重機械工業 | 9,000 | 270 | 2,430,000 |
| 日立建機 | 1,700 | 1,308 | 2,223,600 |
| 井関農機 | 4,000 | 187 | 748,000 |
| T O W A | 500 | 474 | 237,000 |
| クボタ | 15,000 | 784 | 11,760,000 |
| 月島機械 | 1,000 | 640 | 640,000 |
| 新東工業 | 1,000 | 588 | 588,000 |
| アイチ コーポレーション | 1,300 | 327 | 425,100 |
| 小森コーポレーション | 1,200 | 385 | 462,000 |
| 荏原製作所 | 6,000 | 322 | 1,932,000 |
| 西島製作所 | 500 | 586 | 293,000 |
| ダイキン工業 | 4,100 | 2,064 | 8,462,400 |
| オルガノ | 1,000 | 488 | 488,000 |
| トーヨーカネツ | 3,000 | 160 | 480,000 |
| 栗田工業 | 1,700 | 1,636 | 2,781,200 |
| 椿本チエイン | 2,000 | 459 | 918,000 |
| ダイフク | 2,000 | 404 | 808,000 |
| 加藤製作所 | 1,000 | 235 | 235,000 |
| タダノ | 2,000 | 579 | 1,158,000 |
| フジテック | 1,000 | 480 | 480,000 |
| C K D | 1,100 | 487 | 535,700 |
| 平和 | 800 | 1,363 | 1,090,400 |
| 理想科学工業 | 300 | 1,397 | 419,100 |
| S A N K Y O | 1,000 | 3,675 | 3,675,000 |
| アマノ | 1,100 | 668 | 734,800 |
| J U K I | 3,000 | 115 | 345,000 |
| サンデン | 2,000 | 231 | 462,000 |
| マックス | 1,000 | 855 | 855,000 |
| グローリー | 1,000 | 1,779 | 1,779,000 |
| セガサミーホールディングス | 3,400 | 1,608 | 5,467,200 |
| リケン | 2,000 | 316 | 632,000 |
| T P R | 400 | 1,000 | 400,000 |
| ホシザキ電機 | 600 | 2,220 | 1,332,000 |
| 日本精工 | 7,000 | 477 | 3,339,000 |
| N T N | 8,000 | 170 | 1,360,000 |
| ジェイテクト | 3,100 | 617 | 1,912,700 |
| 不二越 | 4,000 | 236 | 944,000 |

| | | | |
|------------------|--------|---------|------------|
| 日本トムソン | 1,000 | 282 | 282,000 |
| THK | 2,100 | 1,262 | 2,650,200 |
| イーグル工業 | 1,000 | 527 | 527,000 |
| キッツ | 1,600 | 328 | 524,800 |
| 日立工機 | 1,100 | 592 | 651,200 |
| マキタ | 2,100 | 2,799 | 5,877,900 |
| 日立造船 | 14,000 | 89 | 1,246,000 |
| 三菱重工業 | 53,000 | 324 | 17,172,000 |
| IHI | 22,000 | 176 | 3,872,000 |
| イビデン | 2,100 | 1,169 | 2,454,900 |
| コニカミノルタホールディングス | 8,500 | 585 | 4,972,500 |
| ブラザー工業 | 4,100 | 769 | 3,152,900 |
| ミネベア | 5,000 | 269 | 1,345,000 |
| 日立製作所 | 73,000 | 458 | 33,434,000 |
| 東芝 | 67,000 | 254 | 17,018,000 |
| 三菱電機 | 32,000 | 632 | 20,224,000 |
| 富士電機 | 10,000 | 164 | 1,640,000 |
| 東洋電機製造 | 1,000 | 249 | 249,000 |
| 安川電機 | 4,000 | 509 | 2,036,000 |
| シンフォニアテクノロジー | 3,000 | 147 | 441,000 |
| 明電舎 | 4,000 | 292 | 1,168,000 |
| オリジン電気 | 1,000 | 284 | 284,000 |
| デンヨー | 400 | 877 | 350,800 |
| 東芝テック | 2,000 | 354 | 708,000 |
| マブチモーター | 400 | 3,400 | 1,360,000 |
| 日本電産 | 1,700 | 5,750 | 9,775,000 |
| 高岳製作所 | 2,000 | 141 | 282,000 |
| ダイヘン | 2,000 | 221 | 442,000 |
| JVCケンウッド | 2,100 | 289 | 606,900 |
| 日新電機 | 1,000 | 523 | 523,000 |
| 大崎電気工業 | 1,000 | 492 | 492,000 |
| オムロン | 3,500 | 1,595 | 5,582,500 |
| 日東工業 | 600 | 1,272 | 763,200 |
| IDEC | 700 | 664 | 464,800 |
| ジーエス・ユアサコーポレーション | 7,000 | 308 | 2,156,000 |
| メルコホールディングス | 200 | 1,627 | 325,400 |
| テクノメディカ | 1 | 349,500 | 349,500 |
| 日本電気 | 45,000 | 114 | 5,130,000 |
| 富士通 | 31,000 | 313 | 9,703,000 |
| 沖電気工業 | 13,000 | 89 | 1,157,000 |
| 電気興業 | 1,000 | 294 | 294,000 |
| サンケン電気 | 2,000 | 243 | 486,000 |
| アイホン | 200 | 1,600 | 320,000 |
| セイコーエプソン | 2,200 | 506 | 1,113,200 |
| ワコム | 7 | 169,100 | 1,183,700 |
| アルバック | 800 | 602 | 481,600 |
| ナナオ | 400 | 1,396 | 558,400 |
| 日本信号 | 1,200 | 485 | 582,000 |
| パナソニック | 36,300 | 546 | 19,819,800 |
| アンリツ | 2,000 | 933 | 1,866,000 |
| 富士通ゼネラル | 1,000 | 715 | 715,000 |
| 日立国際電気 | 1,000 | 520 | 520,000 |
| ソニー | 19,800 | 930 | 18,414,000 |
| TDK | 1,700 | 2,965 | 5,040,500 |
| ミツミ電機 | 1,400 | 413 | 578,200 |
| アルプス電気 | 2,700 | 415 | 1,120,500 |
| パイオニア | 4,600 | 244 | 1,122,400 |
| 日本電波工業 | 400 | 920 | 368,000 |
| フォスター電機 | 400 | 1,260 | 504,000 |
| クラリオン | 2,000 | 134 | 268,000 |
| SMK | 2,000 | 219 | 438,000 |
| 東光 | 2,000 | 211 | 422,000 |
| ホシデン | 1,200 | 402 | 482,400 |
| ヒロセ電機 | 600 | 8,660 | 5,196,000 |
| 日本航空電子工業 | 1,000 | 704 | 704,000 |
| アルパイン | 800 | 754 | 603,200 |

| | | | |
|------------|--------|--------|-------------|
| アイコム | 300 | 1,735 | 520,500 |
| 船井電機 | 300 | 1,089 | 326,700 |
| 横河電機 | 3,600 | 935 | 3,366,000 |
| 新電元工業 | 2,000 | 191 | 382,000 |
| アズビル | 900 | 1,571 | 1,413,900 |
| 日本光電工業 | 700 | 2,696 | 1,887,200 |
| 共和電業 | 2,000 | 231 | 462,000 |
| 堀場製作所 | 600 | 2,274 | 1,364,400 |
| アドバンテスト | 2,400 | 1,125 | 2,700,000 |
| エスベック | 600 | 665 | 399,000 |
| キーエンス | 800 | 20,540 | 16,432,000 |
| 日置電機 | 300 | 1,312 | 393,600 |
| シスメックス | 1,100 | 3,720 | 4,092,000 |
| メガチップス | 400 | 1,681 | 672,400 |
| コーセル | 700 | 1,004 | 702,800 |
| スタンレー電気 | 2,100 | 1,233 | 2,589,300 |
| ウシオ電機 | 2,100 | 942 | 1,978,200 |
| 日本電子 | 2,000 | 165 | 330,000 |
| カシオ計算機 | 3,200 | 607 | 1,942,400 |
| ファナック | 3,300 | 13,170 | 43,461,000 |
| 日本シイエムケイ | 1,100 | 259 | 284,900 |
| エンプラス | 200 | 2,615 | 523,000 |
| ローム | 1,600 | 2,664 | 4,262,400 |
| 浜松ホトニクス | 1,200 | 2,845 | 3,414,000 |
| 新光電気工業 | 1,200 | 503 | 603,600 |
| 京セラ | 2,600 | 6,470 | 16,822,000 |
| 太陽誘電 | 1,600 | 712 | 1,139,200 |
| 村田製作所 | 3,300 | 4,030 | 13,299,000 |
| ユージン | 700 | 403 | 282,100 |
| 双葉電子工業 | 600 | 997 | 598,200 |
| 北陸電気工業 | 4,000 | 89 | 356,000 |
| ニチコン | 1,200 | 604 | 724,800 |
| 日本ケミコン | 2,000 | 145 | 290,000 |
| K O A | 700 | 680 | 476,000 |
| 小糸製作所 | 2,000 | 984 | 1,968,000 |
| ミツバ | 1,000 | 509 | 509,000 |
| スター精密 | 700 | 756 | 529,200 |
| 大日本スクリーン製造 | 3,000 | 430 | 1,290,000 |
| キャノン電子 | 400 | 1,702 | 680,800 |
| キャノン | 19,600 | 2,640 | 51,744,000 |
| リコー | 9,000 | 640 | 5,760,000 |
| 東京エレクトロン | 2,700 | 3,595 | 9,706,500 |
| トヨタ紡織 | 1,200 | 913 | 1,095,600 |
| 鬼怒川ゴム工業 | 1,000 | 502 | 502,000 |
| ユニプレス | 500 | 2,185 | 1,092,500 |
| 豊田自動織機 | 2,800 | 2,274 | 6,367,200 |
| デンソー | 7,800 | 2,704 | 21,091,200 |
| 東海理化電機製作所 | 800 | 1,218 | 974,400 |
| 三井造船 | 13,000 | 90 | 1,170,000 |
| 佐世保重工業 | 4,000 | 68 | 272,000 |
| 川崎重工業 | 23,000 | 165 | 3,795,000 |
| 日本車輛製造 | 2,000 | 274 | 548,000 |
| 日産自動車 | 40,200 | 740 | 29,748,000 |
| いすゞ自動車 | 20,000 | 385 | 7,700,000 |
| トヨタ自動車 | 41,100 | 3,200 | 131,520,000 |
| 日野自動車 | 5,000 | 544 | 2,720,000 |
| 三菱自動車工業 | 73,000 | 72 | 5,256,000 |
| 武蔵精密工業 | 400 | 1,523 | 609,200 |
| 日産車体 | 1,000 | 894 | 894,000 |
| 新明和工業 | 2,000 | 399 | 798,000 |
| 極東開発工業 | 700 | 635 | 444,500 |
| 日信工業 | 700 | 1,093 | 765,100 |
| トビー工業 | 3,000 | 174 | 522,000 |
| ティラド | 2,000 | 199 | 398,000 |
| 曙ブレーキ工業 | 1,900 | 378 | 718,200 |
| タチエス | 500 | 1,527 | 763,500 |

| | | | | |
|------------|-------|-------|-----------|--|
| NOK | 1,500 | 1,333 | 1,999,500 | |
| フタバ産業 | 1,100 | 354 | 389,400 | |
| カヤバ工業 | 2,000 | 295 | 590,000 | |
| 大同メタル工業 | 1,000 | 633 | 633,000 | |
| プレス工業 | 2,000 | 333 | 666,000 | |
| カルゾニックカンセイ | 2,000 | 373 | 746,000 | |
| 太平洋工業 | 1,000 | 490 | 490,000 | |

[次へ](#)

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-------------------|--------|---------|------------|----|
| | | 単価（円） | 金額（円） | |
| ケーヒン | 700 | 1,030 | 721,000 | |
| アイシン精機 | 2,600 | 2,457 | 6,388,200 | |
| マツダ | 43,000 | 95 | 4,085,000 | |
| ダイハツ工業 | 3,000 | 1,278 | 3,834,000 | |
| 本田技研工業 | 26,800 | 2,629 | 70,457,200 | |
| スズキ | 6,600 | 1,447 | 9,550,200 | |
| 富士重工業 | 10,000 | 649 | 6,490,000 | |
| ヤマハ発動機 | 5,300 | 737 | 3,906,100 | |
| ショーワ | 900 | 708 | 637,200 | |
| エクセディ | 500 | 1,634 | 817,000 | |
| 豊田合成 | 900 | 1,703 | 1,532,700 | |
| ヨロズ | 300 | 1,286 | 385,800 | |
| エフ・シー・シー | 600 | 1,310 | 786,000 | |
| シマノ | 1,200 | 5,710 | 6,852,000 | |
| タカタ | 600 | 1,463 | 877,800 | |
| テイ・エス テック | 800 | 1,469 | 1,175,200 | |
| テルモ | 2,300 | 3,490 | 8,027,000 | |
| クリエートメディック | 600 | 792 | 475,200 | |
| 日機装 | 1,000 | 984 | 984,000 | |
| 島津製作所 | 4,000 | 540 | 2,160,000 | |
| 東京計器 | 2,000 | 120 | 240,000 | |
| 東京精密 | 600 | 1,153 | 691,800 | |
| ニコン | 5,600 | 2,068 | 11,580,800 | |
| トプコン | 900 | 439 | 395,100 | |
| オリンパス | 3,800 | 1,498 | 5,692,400 | |
| タムロン | 300 | 2,558 | 767,400 | |
| HOYA | 7,600 | 1,760 | 13,376,000 | |
| シチズンホールディングス | 4,100 | 436 | 1,787,600 | |
| ニプロ | 1,700 | 472 | 802,400 | |
| パラマウントベッドホールディングス | 300 | 2,456 | 736,800 | |
| バンダイナムコホールディングス | 3,400 | 1,305 | 4,437,000 | |
| フランスベッドホールディングス | 3,000 | 173 | 519,000 | |
| パイロットコーポレーション | 4 | 145,300 | 581,200 | |
| トッパン・フォームズ | 1,000 | 740 | 740,000 | |
| フジシールインターナショナル | 500 | 1,555 | 777,500 | |
| タカラトミー | 1,400 | 438 | 613,200 | |
| プロネクサス | 1,100 | 471 | 518,100 | |
| 大建工業 | 2,000 | 189 | 378,000 | |
| 凸版印刷 | 10,000 | 461 | 4,610,000 | |
| 大日本印刷 | 10,000 | 563 | 5,630,000 | |
| 日本写真印刷 | 700 | 741 | 518,700 | |
| アシックス | 3,100 | 1,063 | 3,295,300 | |
| ローランド | 600 | 598 | 358,800 | |
| ヤマハ | 2,600 | 777 | 2,020,200 | |
| ビジョン | 300 | 3,585 | 1,075,500 | |
| リンテック | 700 | 1,432 | 1,002,400 | |
| イトーキ | 1,100 | 457 | 502,700 | |
| 任天堂 | 1,800 | 9,020 | 16,236,000 | |
| 三菱鉛筆 | 400 | 1,422 | 568,800 | |
| タカラスタンダード | 2,000 | 620 | 1,240,000 | |
| コクヨ | 2,000 | 630 | 1,260,000 | |
| 岡村製作所 | 1,000 | 625 | 625,000 | |
| 美津濃 | 2,000 | 391 | 782,000 | |
| アデランス | 600 | 969 | 581,400 | |
| 中部電力 | 10,500 | 878 | 9,219,000 | |
| 関西電力 | 13,000 | 497 | 6,461,000 | |
| 中国電力 | 4,400 | 858 | 3,775,200 | |
| 北陸電力 | 3,300 | 821 | 2,709,300 | |
| 東北電力 | 8,000 | 468 | 3,744,000 | |
| 四国電力 | 2,900 | 728 | 2,111,200 | |
| 九州電力 | 6,900 | 465 | 3,208,500 | |
| 北海道電力 | 3,100 | 496 | 1,537,600 | |
| 沖縄電力 | 300 | 2,331 | 699,300 | |

| | | | |
|-------------------|--------|---------|------------|
| 電源開発 | 2,000 | 1,682 | 3,364,000 |
| 東京瓦斯 | 39,000 | 437 | 17,043,000 |
| 大阪瓦斯 | 31,000 | 341 | 10,571,000 |
| 東邦瓦斯 | 8,000 | 512 | 4,096,000 |
| 北海道瓦斯 | 3,000 | 241 | 723,000 |
| 西部瓦斯 | 5,000 | 223 | 1,115,000 |
| 静岡瓦斯 | 1,000 | 555 | 555,000 |
| 東武鉄道 | 18,000 | 429 | 7,722,000 |
| 相鉄ホールディングス | 6,000 | 272 | 1,632,000 |
| 東京急行電鉄 | 19,000 | 380 | 7,220,000 |
| 京浜急行電鉄 | 8,000 | 758 | 6,064,000 |
| 小田急電鉄 | 10,000 | 837 | 8,370,000 |
| 京王電鉄 | 9,000 | 603 | 5,427,000 |
| 京成電鉄 | 6,000 | 747 | 4,482,000 |
| 富士急行 | 1,000 | 508 | 508,000 |
| 東日本旅客鉄道 | 5,500 | 5,240 | 28,820,000 |
| 西日本旅客鉄道 | 2,800 | 3,385 | 9,478,000 |
| 東海旅客鉄道 | 26 | 687,000 | 17,862,000 |
| 西日本鉄道 | 4,000 | 337 | 1,348,000 |
| 近畿日本鉄道 | 29,000 | 318 | 9,222,000 |
| 阪急阪神ホールディングス | 21,000 | 425 | 8,925,000 |
| 南海電気鉄道 | 7,000 | 362 | 2,534,000 |
| 京阪電気鉄道 | 7,000 | 380 | 2,660,000 |
| 名糖運輸 | 700 | 590 | 413,000 |
| 名古屋鉄道 | 12,000 | 220 | 2,640,000 |
| 日本通運 | 12,000 | 300 | 3,600,000 |
| ヤマトホールディングス | 6,300 | 1,248 | 7,862,400 |
| 山九 | 4,000 | 297 | 1,188,000 |
| センコー | 2,000 | 329 | 658,000 |
| 日本梱包運輸倉庫 | 1,100 | 1,009 | 1,109,900 |
| 福山通運 | 2,000 | 423 | 846,000 |
| セイノーホールディングス | 3,000 | 493 | 1,479,000 |
| 神奈川中央交通 | 1,000 | 462 | 462,000 |
| 日立物流 | 700 | 1,318 | 922,600 |
| 日本郵船 | 25,000 | 134 | 3,350,000 |
| 商船三井 | 17,000 | 180 | 3,060,000 |
| 川崎汽船 | 12,000 | 95 | 1,140,000 |
| N Sユナイテッド海運 | 3,000 | 84 | 252,000 |
| 飯野海運 | 2,000 | 264 | 528,000 |
| 第一中央汽船 | 4,000 | 61 | 244,000 |
| 全日本空輸 | 56,000 | 182 | 10,192,000 |
| 日新 | 3,000 | 204 | 612,000 |
| 三菱倉庫 | 3,000 | 889 | 2,667,000 |
| 三井倉庫 | 2,000 | 254 | 508,000 |
| 住友倉庫 | 3,000 | 345 | 1,035,000 |
| 澁澤倉庫 | 2,000 | 223 | 446,000 |
| 上組 | 4,000 | 643 | 2,572,000 |
| 近鉄エクスプレス | 400 | 2,486 | 994,400 |
| システナ | 6 | 63,600 | 381,600 |
| I Tホールディングス | 1,100 | 968 | 1,064,800 |
| グリー | 1,600 | 1,464 | 2,342,400 |
| コーエーテクモホールディングス | 1,000 | 621 | 621,000 |
| ネクソン | 2,200 | 1,059 | 2,329,800 |
| ドワンゴ | 2 | 114,800 | 229,600 |
| マクロミル | 500 | 1,007 | 503,500 |
| ティーガイア | 3 | 141,400 | 424,200 |
| GMOペイメントゲートウェイ | 200 | 1,356 | 271,200 |
| インターネットイニシアティブ | 2 | 385,000 | 770,000 |
| ソネットエンタテインメント | 2 | 566,000 | 1,132,000 |
| 野村総合研究所 | 1,700 | 1,640 | 2,788,000 |
| フジ・メディア・ホールディングス | 33 | 128,200 | 4,230,600 |
| オービック | 100 | 16,330 | 1,633,000 |
| TDCソフトウェアエンジニアリング | 600 | 753 | 451,800 |
| ヤフー | 230 | 29,340 | 6,748,200 |
| トレンドマイクロ | 1,400 | 2,141 | 2,997,400 |
| 日本オラクル | 600 | 3,800 | 2,280,000 |

| | | | |
|----------------------|--------|---------|------------|
| オービックビジネスコンサルタント | 150 | 4,285 | 642,750 |
| 伊藤忠テクノソリューションズ | 400 | 4,295 | 1,718,000 |
| 大塚商会 | 300 | 6,920 | 2,076,000 |
| ネットワンシステムズ | 1,500 | 994 | 1,491,000 |
| エイベックス・グループ・ホールディングス | 800 | 1,515 | 1,212,000 |
| 日本ユニシス | 1,100 | 540 | 594,000 |
| 東京放送ホールディングス | 1,900 | 792 | 1,504,800 |
| 日本テレビ放送網 | 270 | 10,870 | 2,934,900 |
| テレビ朝日 | 9 | 111,100 | 999,900 |
| スカパーJ S A Tホールディングス | 28 | 35,350 | 989,800 |
| アイ・ティー・シーネットワーク | 1,000 | 590 | 590,000 |
| イー・アクセス | 30 | 14,560 | 436,800 |
| 日本電信電話 | 14,400 | 3,570 | 51,408,000 |
| K D D I | 49 | 563,000 | 27,587,000 |
| 光通信 | 300 | 4,100 | 1,230,000 |
| エヌ・ティ・ティ・ドコモ | 256 | 128,200 | 32,819,200 |
| G M Oインターネット | 1,200 | 521 | 625,200 |
| 学研ホールディングス | 2,000 | 198 | 396,000 |
| ゼンリン | 800 | 972 | 777,600 |
| 角川グループホールディングス | 400 | 2,102 | 840,800 |
| 松竹 | 2,000 | 750 | 1,500,000 |
| 東宝 | 2,400 | 1,371 | 3,290,400 |
| 東映 | 2,000 | 386 | 772,000 |
| エヌ・ティ・ティ・データ | 20 | 238,600 | 4,772,000 |
| D T S | 600 | 1,071 | 642,600 |
| スクウェア・エニックス・ホールディングス | 1,100 | 1,283 | 1,411,300 |
| カプコン | 700 | 1,520 | 1,064,000 |
| S C S K | 700 | 1,267 | 886,900 |
| 日本システムウエア | 1,200 | 312 | 374,400 |
| T K C | 400 | 1,620 | 648,000 |
| 富士ソフト | 600 | 1,432 | 859,200 |
| N S D | 900 | 730 | 657,000 |
| コナミ | 1,500 | 1,810 | 2,715,000 |
| ソフトバンク | 14,200 | 3,290 | 46,718,000 |
| 双日 | 22,300 | 100 | 2,230,000 |
| アルフレッサ ホールディングス | 800 | 3,870 | 3,096,000 |
| 山下医科器械 | 100 | 978 | 97,800 |
| ダイワボウホールディングス | 4,000 | 137 | 548,000 |
| バイタルケーエスケー・ホールディングス | 800 | 766 | 612,800 |
| T O K A Iホールディングス | 2,200 | 348 | 765,600 |
| シップヘルスケアホールディングス | 500 | 2,399 | 1,199,500 |
| エコトレーディング | 600 | 682 | 409,200 |
| 三菱食品 | 400 | 1,884 | 753,600 |
| 松田産業 | 400 | 1,163 | 465,200 |
| メディカルホールディングス | 3,400 | 1,102 | 3,746,800 |
| アズワン | 400 | 1,834 | 733,600 |
| ドウシシャ | 200 | 2,269 | 453,800 |
| 高速 | 800 | 675 | 540,000 |
| 黒田電気 | 600 | 948 | 568,800 |
| ガリバーインターナショナル | 130 | 2,315 | 300,950 |
| マクニカ | 300 | 1,679 | 503,700 |
| 伊藤忠商事 | 24,800 | 800 | 19,840,000 |
| 丸紅 | 27,000 | 505 | 13,635,000 |
| 長瀬産業 | 1,800 | 879 | 1,582,200 |
| 豊田通商 | 3,500 | 1,675 | 5,862,500 |
| 兼松 | 9,000 | 88 | 792,000 |
| 三井物産 | 26,900 | 1,138 | 30,612,200 |
| 日立ハイテクノロジーズ | 1,000 | 1,921 | 1,921,000 |
| 東都水産 | 2,000 | 120 | 240,000 |
| 山善 | 1,600 | 525 | 840,000 |
| 住友商事 | 18,300 | 1,071 | 19,599,300 |
| 内田洋行 | 1,000 | 219 | 199,000 |
| 三菱商事 | 22,700 | 1,463 | 33,210,100 |
| 第一実業 | 1,000 | 351 | 351,000 |
| キャノンマーケティングジャパン | 1,100 | 1,091 | 1,200,100 |
| 菱洋エレクトロ | 600 | 790 | 474,000 |

| | | | |
|-------------------|--------|--------|------------|
| ユアサ商事 | 5,000 | 138 | 690,000 |
| 阪和興業 | 4,000 | 268 | 1,072,000 |
| 岩谷産業 | 4,000 | 278 | 1,112,000 |
| すてきナイスグループ | 2,000 | 176 | 352,000 |
| 昭光通商 | 4,000 | 117 | 468,000 |
| 三愛石油 | 1,000 | 344 | 344,000 |
| 稲畑産業 | 1,200 | 513 | 615,600 |
| 東邦ホールディングス | 1,100 | 1,564 | 1,720,400 |
| サンゲツ | 600 | 2,099 | 1,259,400 |
| 伊藤忠エネクス | 1,300 | 427 | 555,100 |
| サンリオ | 800 | 2,901 | 2,320,800 |
| リョーサン | 600 | 1,410 | 846,000 |
| 三信電気 | 800 | 566 | 452,800 |
| 東陽テクニカ | 700 | 880 | 616,000 |
| モスフードサービス | 400 | 1,567 | 626,800 |
| 加賀電子 | 600 | 754 | 452,400 |
| 立花エレテック | 500 | 644 | 322,000 |
| トラスコ中山 | 600 | 1,373 | 823,800 |
| オートバックスセブン | 400 | 3,560 | 1,424,000 |
| 加藤産業 | 600 | 1,462 | 877,200 |
| イエローハット | 400 | 1,147 | 458,800 |
| 因幡電機産業 | 500 | 2,168 | 1,084,000 |
| 住金物産 | 3,000 | 192 | 576,000 |
| ミスミグループ本社 | 1,200 | 1,939 | 2,326,800 |
| スズケン | 1,200 | 2,670 | 3,204,000 |
| ローソン | 900 | 5,820 | 5,238,000 |
| カワチ薬品 | 400 | 1,513 | 605,200 |
| エービーシー・マート | 500 | 3,425 | 1,712,500 |
| アスクル | 300 | 1,061 | 318,300 |
| ゲオホールディングス | 7 | 92,900 | 650,300 |
| ポイント | 300 | 2,797 | 839,100 |
| パル | 150 | 4,480 | 672,000 |
| エディオン | 1,400 | 358 | 501,200 |
| サーラコーポレーション | 1,000 | 535 | 535,000 |
| ハニーズ | 350 | 1,153 | 403,550 |
| ビックカメラ | 12 | 39,150 | 469,800 |
| D C Mホールディングス | 1,800 | 507 | 912,600 |
| MonotaRO | 200 | 1,928 | 385,600 |
| J.フロントリテイリング | 8,000 | 419 | 3,352,000 |
| ドトール・日レスホールディングス | 700 | 972 | 680,400 |
| マツモトキヨシホールディングス | 700 | 1,896 | 1,327,200 |
| スタートトゥデイ | 600 | 1,152 | 691,200 |
| ココカラファイン | 400 | 2,729 | 1,091,600 |
| 三越伊勢丹ホールディングス | 6,300 | 827 | 5,210,100 |
| あさひ | 200 | 1,094 | 218,800 |
| コスモス薬品 | 200 | 6,460 | 1,292,000 |
| セブン&アイ・ホールディングス | 13,000 | 2,402 | 31,226,000 |
| ツルハホールディングス | 300 | 5,270 | 1,581,000 |
| トリドール | 300 | 1,206 | 361,800 |
| カッパ・クリエイトホールディングス | 350 | 1,771 | 619,850 |
| ライトオン | 500 | 638 | 319,000 |
| 良品計画 | 300 | 5,030 | 1,509,000 |
| コナカ | 500 | 750 | 375,000 |
| コーナン商事 | 500 | 948 | 474,000 |
| エコス | 1,000 | 503 | 503,000 |
| ワタミ | 500 | 1,752 | 876,000 |
| ドン・キホーテ | 700 | 2,931 | 2,051,700 |
| メガネトップ | 500 | 826 | 413,000 |
| 西松屋チェーン | 900 | 668 | 601,200 |
| ゼンショーホールディングス | 1,200 | 1,024 | 1,228,800 |
| サイゼリヤ | 600 | 1,200 | 720,000 |
| ユナイテッドアローズ | 400 | 2,270 | 908,000 |
| コロワイド | 1,500 | 698 | 1,047,000 |
| スギホールディングス | 600 | 2,632 | 1,579,200 |
| ファミリーマート | 900 | 3,780 | 3,402,000 |
| 木曽路 | 500 | 1,670 | 835,000 |

| | | | |
|-------------------|---------|---------|------------|
| 千趣会 | 900 | 501 | 450,900 |
| ケーヨー | 1,000 | 464 | 464,000 |
| 上新電機 | 1,000 | 910 | 910,000 |
| 日本瓦斯 | 500 | 1,043 | 521,500 |
| ベスト電器 | 2,000 | 136 | 272,000 |
| ロイヤルホールディングス | 800 | 939 | 751,200 |
| 島忠 | 800 | 1,622 | 1,297,600 |
| チヨダ | 500 | 2,030 | 1,015,000 |
| カスミ | 1,200 | 530 | 636,000 |
| リンガーハット | 500 | 1,024 | 512,000 |
| AOKIホールディングス | 400 | 1,629 | 651,600 |
| オークワ | 1,000 | 1,068 | 1,068,000 |
| コメリ | 500 | 1,909 | 954,500 |
| 青山商事 | 900 | 1,544 | 1,389,600 |
| しまむら | 400 | 9,160 | 3,664,000 |
| 高島屋 | 5,000 | 544 | 2,720,000 |
| 松屋 | 900 | 767 | 690,300 |
| エイチ・ツー・オー リテイリング | 2,000 | 816 | 1,632,000 |
| ニッセンホールディングス | 1,200 | 314 | 376,800 |
| パルコ | 900 | 839 | 755,100 |
| 丸井グループ | 4,300 | 563 | 2,420,900 |
| ダイエー | 2,500 | 165 | 412,500 |
| イズミヤ | 2,000 | 380 | 760,000 |
| イオン | 10,900 | 897 | 9,777,300 |
| ユニー | 2,600 | 636 | 1,653,600 |
| イズミ | 900 | 1,592 | 1,432,800 |
| 平和堂 | 800 | 1,192 | 953,600 |
| フジ | 500 | 1,741 | 870,500 |
| ヤオコー | 300 | 3,000 | 900,000 |
| ゼビオ | 500 | 1,620 | 810,000 |
| ケーズホールディングス | 800 | 2,096 | 1,676,800 |
| アインファーマシーズ | 200 | 5,330 | 1,066,000 |
| ヤマダ電機 | 1,500 | 3,645 | 5,467,500 |
| アークランドサカモト | 300 | 1,210 | 363,000 |
| ニトリホールディングス | 600 | 8,060 | 4,836,000 |
| 吉野家ホールディングス | 9 | 101,600 | 914,400 |
| ブレナス | 500 | 1,306 | 653,000 |
| アークス | 600 | 1,763 | 1,057,800 |
| パロー | 800 | 1,335 | 1,068,000 |
| ファーストリテイリング | 600 | 18,310 | 10,986,000 |
| サンドラッグ | 600 | 2,779 | 1,667,400 |
| 新生銀行 | 25,000 | 94 | 2,350,000 |
| あおぞら銀行 | 10,000 | 244 | 2,440,000 |
| 三菱UFJフィナンシャル・グループ | 236,800 | 367 | 86,905,600 |
| りそなホールディングス | 26,700 | 318 | 8,490,600 |
| 三井住友トラスト・ホールディングス | 62,000 | 227 | 14,074,000 |
| 三井住友フィナンシャルグループ | 23,700 | 2,484 | 58,870,800 |
| 第四銀行 | 4,000 | 249 | 996,000 |
| 北越銀行 | 5,000 | 153 | 765,000 |
| 西日本シティ銀行 | 11,000 | 172 | 1,892,000 |
| 札幌北洋ホールディングス | 4,700 | 204 | 958,800 |
| 千葉銀行 | 12,000 | 458 | 5,496,000 |
| 横浜銀行 | 19,000 | 373 | 7,087,000 |
| 常陽銀行 | 11,000 | 387 | 4,257,000 |
| 群馬銀行 | 7,000 | 405 | 2,835,000 |
| 武蔵野銀行 | 500 | 2,357 | 1,178,500 |
| 千葉興業銀行 | 1,100 | 413 | 454,300 |
| 筑波銀行 | 1,500 | 258 | 387,000 |
| 東京都民銀行 | 700 | 726 | 508,200 |
| 七十七銀行 | 5,000 | 303 | 1,515,000 |
| 青森銀行 | 3,000 | 243 | 729,000 |
| 秋田銀行 | 3,000 | 224 | 672,000 |
| 山形銀行 | 2,000 | 335 | 670,000 |
| 岩手銀行 | 200 | 3,735 | 747,000 |
| 東邦銀行 | 3,000 | 256 | 768,000 |
| 東北銀行 | 4,000 | 117 | 468,000 |

| | | | | |
|----------------------|---------|-------|------------|--|
| みちのく銀行 | 3,000 | 164 | 492,000 | |
| ふくおかフィナンシャルグループ | 12,000 | 323 | 3,876,000 | |
| 静岡銀行 | 9,000 | 809 | 7,281,000 | |
| 十六銀行 | 4,000 | 259 | 1,036,000 | |
| スルガ銀行 | 3,000 | 905 | 2,715,000 | |
| 八十二銀行 | 5,000 | 435 | 2,175,000 | |
| 山梨中央銀行 | 2,000 | 336 | 672,000 | |
| 大垣共立銀行 | 4,000 | 278 | 1,112,000 | |
| 福井銀行 | 3,000 | 187 | 561,000 | |
| 北國銀行 | 4,000 | 300 | 1,200,000 | |
| 清水銀行 | 200 | 2,280 | 456,000 | |
| 滋賀銀行 | 3,000 | 477 | 1,431,000 | |
| 南都銀行 | 3,000 | 370 | 1,110,000 | |
| 百五銀行 | 3,000 | 357 | 1,071,000 | |
| 京都銀行 | 5,000 | 639 | 3,195,000 | |
| 三重銀行 | 3,000 | 176 | 528,000 | |
| ほくほくフィナンシャルグループ | 20,000 | 116 | 2,320,000 | |
| 広島銀行 | 9,000 | 247 | 2,223,000 | |
| 山陰合同銀行 | 2,000 | 566 | 1,132,000 | |
| 中国銀行 | 2,000 | 1,098 | 2,196,000 | |
| 鳥取銀行 | 2,000 | 154 | 308,000 | |
| 伊予銀行 | 3,000 | 649 | 1,947,000 | |
| 百十四銀行 | 4,000 | 301 | 1,204,000 | |
| 四国銀行 | 3,000 | 196 | 588,000 | |
| 阿波銀行 | 2,000 | 493 | 986,000 | |
| 鹿児島銀行 | 2,000 | 512 | 1,024,000 | |
| 大分銀行 | 3,000 | 256 | 768,000 | |
| 宮崎銀行 | 3,000 | 197 | 591,000 | |
| 肥後銀行 | 2,000 | 457 | 914,000 | |
| 佐賀銀行 | 3,000 | 187 | 561,000 | |
| 十八銀行 | 3,000 | 200 | 600,000 | |
| 沖縄銀行 | 300 | 3,405 | 1,021,500 | |
| 琉球銀行 | 800 | 1,023 | 818,400 | |
| 八千代銀行 | 200 | 1,467 | 293,400 | |
| セブン銀行 | 12,500 | 231 | 2,887,500 | |
| みずほフィナンシャルグループ | 402,900 | 131 | 52,779,900 | |
| 紀陽ホールディングス | 12,000 | 106 | 1,272,000 | |
| 山口フィナンシャルグループ | 3,000 | 651 | 1,953,000 | |
| 長野銀行 | 2,000 | 150 | 300,000 | |
| 名古屋銀行 | 3,000 | 261 | 783,000 | |
| 愛知銀行 | 100 | 4,220 | 422,000 | |
| 第三銀行 | 3,000 | 145 | 435,000 | |
| 中京銀行 | 2,000 | 180 | 360,000 | |
| 東日本銀行 | 3,000 | 178 | 534,000 | |
| 愛媛銀行 | 3,000 | 214 | 642,000 | |
| トマト銀行 | 3,000 | 150 | 450,000 | |
| みなと銀行 | 3,000 | 153 | 459,000 | |
| 京葉銀行 | 3,000 | 359 | 1,077,000 | |
| 関西アーバン銀行 | 4,000 | 101 | 404,000 | |
| 栃木銀行 | 2,000 | 277 | 554,000 | |
| 北日本銀行 | 200 | 2,230 | 446,000 | |
| 福島銀行 | 6,000 | 48 | 288,000 | |
| 大東銀行 | 5,000 | 66 | 330,000 | |
| トモニホールディングス | 2,700 | 323 | 872,100 | |
| フィデアホールディングス | 2,600 | 162 | 421,200 | |
| 池田泉州ホールディングス | 2,200 | 448 | 985,600 | |
| SBIホールディングス | 339 | 4,910 | 1,664,490 | |
| ジャフコ | 500 | 1,513 | 756,500 | |
| 大和証券グループ本社 | 31,000 | 295 | 9,145,000 | |
| 野村ホールディングス | 67,200 | 286 | 19,219,200 | |
| 岡三証券グループ | 3,000 | 286 | 858,000 | |
| 丸三証券 | 1,600 | 241 | 385,600 | |
| 東洋証券 | 2,000 | 133 | 266,000 | |
| 東海東京フィナンシャル・ホールディングス | 4,000 | 260 | 1,040,000 | |
| 水戸証券 | 2,000 | 143 | 286,000 | |
| いちよし証券 | 1,100 | 400 | 440,000 | |

| | | | |
|-------------------------------|--------|---------|------------|
| 松井証券 | 2,100 | 504 | 1,058,400 |
| マネックスグループ | 30 | 13,920 | 417,600 |
| カブドットコム証券 | 1,600 | 230 | 368,000 |
| 極東証券 | 700 | 580 | 406,000 |
| NK S Jホールディングス | 6,500 | 1,509 | 9,808,500 |
| M S & A Dインシュアランスグループホールディングス | 9,400 | 1,317 | 12,379,800 |
| ソニーフィナンシャルホールディングス | 3,100 | 1,335 | 4,138,500 |
| 第一生命保険 | 168 | 89,900 | 15,103,200 |
| 東京海上ホールディングス | 11,900 | 1,973 | 23,478,700 |
| T & Dホールディングス | 11,400 | 841 | 9,587,400 |
| クレディセゾン | 2,600 | 1,831 | 4,760,600 |
| 芙蓉総合リース | 300 | 2,348 | 704,400 |
| 興銀リース | 500 | 2,083 | 1,041,500 |
| 東京センチュリーリース | 900 | 1,495 | 1,345,500 |
| 日本証券金融 | 1,700 | 361 | 613,700 |
| リコーリース | 300 | 1,808 | 542,400 |
| イオンクレジットサービス | 1,300 | 1,482 | 1,926,600 |
| アコム | 690 | 1,784 | 1,230,960 |
| ジャックス | 2,000 | 298 | 596,000 |
| オリエントコーポレーション | 6,500 | 121 | 786,500 |
| 日立キャピタル | 700 | 1,322 | 925,400 |
| オリックス | 1,620 | 7,470 | 12,101,400 |
| 三菱UFJリース | 800 | 3,465 | 2,772,000 |
| ヒューリック | 3,800 | 425 | 1,615,000 |
| 野村不動産ホールディングス | 1,600 | 1,327 | 2,123,200 |
| パーク24 | 1,800 | 1,252 | 2,253,600 |
| 三井不動産 | 14,000 | 1,531 | 21,434,000 |
| 三菱地所 | 22,000 | 1,424 | 31,328,000 |
| 平和不動産 | 4,500 | 173 | 778,500 |
| 東京建物 | 6,000 | 260 | 1,560,000 |
| ダイビル | 1,300 | 533 | 692,900 |
| 東急不動産 | 7,000 | 390 | 2,730,000 |
| 住友不動産 | 8,000 | 1,996 | 15,968,000 |
| 大京 | 5,000 | 194 | 970,000 |
| テーオーシー | 1,700 | 417 | 708,900 |
| レオパレス21 | 2,600 | 259 | 673,400 |
| ゴールドクレスト | 410 | 1,166 | 478,060 |
| 東急リバブル | 500 | 979 | 489,500 |
| アーネストワン | 600 | 1,163 | 697,800 |
| イオンモール | 1,500 | 1,893 | 2,839,500 |
| フージャースコーポレーション | 6 | 49,900 | 299,400 |
| エヌ・ティ・ティ都市開発 | 22 | 61,000 | 1,342,000 |
| 日本空港ビルデング | 1,200 | 861 | 1,033,200 |
| 日本工営 | 2,000 | 270 | 540,000 |
| 日本M & Aセンター | 200 | 2,245 | 449,000 |
| アコーディア・ゴルフ | 16 | 49,100 | 785,600 |
| テンブホールディングス | 700 | 935 | 654,500 |
| NECフィールドディング | 600 | 960 | 576,000 |
| 総合警備保障 | 1,400 | 1,138 | 1,593,200 |
| カカクコム | 500 | 2,878 | 1,439,000 |
| エムスリー | 3 | 405,500 | 1,216,500 |
| ディー・エヌ・エー | 1,500 | 2,529 | 3,793,500 |
| 博報堂DYホールディングス | 440 | 5,100 | 2,244,000 |
| イービーエス | 3 | 231,000 | 693,000 |
| ケネディクス | 45 | 9,010 | 405,450 |
| 電通 | 3,000 | 1,997 | 5,991,000 |
| みらかホールディングス | 900 | 3,520 | 3,168,000 |
| オリエンタルランド | 900 | 10,440 | 9,396,000 |
| ダスキン | 1,000 | 1,577 | 1,577,000 |
| ラウンドワン | 1,200 | 382 | 458,400 |
| リゾートトラスト | 700 | 1,413 | 989,100 |
| もしもしホットライン | 900 | 1,209 | 1,088,100 |
| ユー・エス・エス | 430 | 8,260 | 3,551,800 |
| エイチ・アイ・エス | 400 | 2,451 | 980,400 |
| スバル興業 | 2,000 | 242 | 484,000 |
| カナモト | 1,000 | 804 | 804,000 |

| | | | | |
|--------------|-----------|-------|---------------|--|
| 東京ドーム | 4,000 | 239 | 956,000 | |
| トランス・コスモス | 600 | 962 | 577,200 | |
| 藤田観光 | 2,000 | 253 | 506,000 | |
| 日本管財 | 400 | 1,521 | 608,400 | |
| セコム | 3,200 | 3,995 | 12,784,000 | |
| メイテック | 700 | 1,768 | 1,237,600 | |
| アサツー ディ・ケイ | 700 | 1,953 | 1,367,100 | |
| 応用地質 | 500 | 948 | 474,000 | |
| ベネッセホールディングス | 1,100 | 3,710 | 4,081,000 | |
| イオンディライト | 500 | 1,750 | 875,000 | |
| ニチイ学館 | 900 | 779 | 701,100 | |
| ダイセキ | 700 | 1,192 | 834,400 | |
| 合計 | 4,889,636 | | 3,234,324,940 | |

先物取引に係る差入委託証拠金代用有価証券として以下の有価証券が差し入れられております。

トヨタ自動車 10,000株
エヌ・ティ・ティ・ドコモ 150株

(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
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
「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[前へ](#) [次へ](#)

「明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区分 | (平成24年9月12日現在) |
|-------------|----------------|
| | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| コール・ローン | 280,785,134 |
| 国債証券 | 2,404,613,140 |
| 地方債証券 | 504,924,760 |
| 特殊債券 | 366,867,113 |
| 社債券 | 1,930,040,000 |
| 未収利息 | 16,396,589 |
| 前払費用 | 4,923,881 |
| 流動資産合計 | 5,508,550,617 |
| 資産合計 | 5,508,550,617 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払金 | 200,000,000 |
| 未払解約金 | 1,470,000 |
| 流動負債合計 | 201,470,000 |
| 負債合計 | 201,470,000 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 4,338,918,748 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 968,161,869 |
| 元本等合計 | 5,307,080,617 |
| 純資産合計 | 5,307,080,617 |
| 負債純資産合計 | 5,508,550,617 |

(注) 明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンドの計算期間は、毎年4月11日から翌年4月10日までであり、開示対象ファンドの特定期間とは異なります。上記の貸借対照表は平成24年9月12日現在における明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | (自平成24年3月13日 至平成24年9月12日) |
|--------------------|--|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | <p>公社債 個別法に基づき、以下のとおり、法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価で評価しております。原則として、日本証券業協会発表の店頭売買参考統計値(平均値)、金融商品取引業者の提示する価額(ただし、売気配相場は使用しない)、価格情報会社(野村総合研究所)の提供する価額などに基づいて時価評価しております。時価が入手不能の場合、又は入手した評価額が時価と認定できない事由を認めた場合は、忠実義務に基づき当社が合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | (平成24年9月12日現在) |
|------------------------------|----------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | 4,338,918,748口 |
| 2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1.2231円 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

（1）金融商品の状況に関する事項

| （自 平成24年 3月13日 至 平成24年 9月12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第2条第4項に定める証券投資信託であり、証券投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. | 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、信用リスク、流動性リスク、金利変動リスクなどに晒されております。 |
| 3. | 金融商品に係るリスク管理体制 ファンドの運用にあたっては、社内規程や運用計画に基づき、運用部門が運用プロセスの中でリスクコントロールを行います。また、運用部門から独立した部署により諸リスクの状況が確認され、各種委員会等において協議・報告される体制となっております。 |

（2）金融商品の時価等に関する事項

| （平成24年 9月12日現在） | |
|-----------------|--|
| 1. | 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. | 時価の算定方法 公社債 「（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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該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の補足説明 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。 |

（有価証券に関する注記）

売買目的有価証券

| （平成24年 9月12日現在） | |
|-----------------|----------------------|
| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額（円） |
| 国債証券 | 11,568,440 |
| 地方債証券 | 726,330 |
| 特殊債券 | 623,646 |
| 社債券 | 7,140,000 |
| 合計 | 18,605,756 |

（デリバティブ取引に関する注記）

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | (平成24年9月12日現在) | |
|--------------------------|-----------------------------|----------------|
| 1. 期首元本額 | | 4,609,663,606円 |
| 期中追加設定元本額 | | 430,838,588円 |
| 期中一部解約元本額 | | 701,583,446円 |
| 平成24年9月12日現在における元本の内訳(注) | | |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン70) | 107,577,805円 |
| | 明治安田グローバルバランスオープン | 77,771,106円 |
| | 明治安田DCグローバルバランスオープン | 169,455,477円 |
| | 明治安田日本債券オープン(毎月決算型) | 58,373,851円 |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン30) | 282,863,798円 |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン50) | 287,662,375円 |
| | 明治安田DC日本債券オープン | 2,810,181,929円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(隔月決算型) | 6,044,299円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(1年決算型) | 4,337,616円 |
| | 明治安田VAハートフルライフ30(適格機関投資家私募) | 405,751,376円 |
| | 明治安田VAハートフルライフ50(適格機関投資家私募) | 128,899,116円 |
| | 合計 | 4,338,918,748円 |

(注) 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

(3) 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

| 種類 | 銘柄 | 券面総額(円) | 評価額(円) | 備考 |
|------|--------------|-------------|-------------|----|
| 国債証券 | 第105回利付国債5年 | 20,000,000 | 20,004,600 | |
| 国債証券 | 第1回利付国債40年 | 6,000,000 | 6,622,080 | |
| 国債証券 | 第2回利付国債40年 | 9,000,000 | 9,449,550 | |
| 国債証券 | 第3回利付国債40年 | 13,000,000 | 13,586,300 | |
| 国債証券 | 第4回利付国債40年 | 14,000,000 | 14,561,540 | |
| 国債証券 | 第5回利付国債40年 | 5,000,000 | 4,907,900 | |
| 国債証券 | 第293回利付国債10年 | 25,000,000 | 27,163,250 | |
| 国債証券 | 第293回利付国債10年 | 70,000,000 | 76,057,100 | |
| 国債証券 | 第298回利付国債10年 | 30,000,000 | 31,776,600 | |
| 国債証券 | 第301回利付国債10年 | 10,000,000 | 10,728,000 | |
| 国債証券 | 第302回利付国債10年 | 127,000,000 | 135,408,670 | |
| 国債証券 | 第303回利付国債10年 | 268,000,000 | 285,800,560 | |
| 国債証券 | 第305回利付国債10年 | 214,000,000 | 226,718,020 | |
| 国債証券 | 第309回利付国債10年 | 60,000,000 | 62,596,800 | |
| 国債証券 | 第312回利付国債10年 | 109,000,000 | 114,284,320 | |
| 国債証券 | 第312回利付国債10年 | 210,000,000 | 220,180,800 | |
| 国債証券 | 第4回利付国債30年 | 20,000,000 | 24,190,200 | |
| 国債証券 | 第8回利付国債30年 | 7,000,000 | 7,175,280 | |
| 国債証券 | 第9回利付国債30年 | 20,000,000 | 19,110,000 | |
| 国債証券 | 第14回利付国債30年 | 11,000,000 | 12,378,520 | |
| 国債証券 | 第18回利付国債30年 | 15,000,000 | 16,600,350 | |
| 国債証券 | 第18回利付国債30年 | 6,000,000 | 6,640,140 | |
| 国債証券 | 第22回利付国債30年 | 18,000,000 | 20,591,820 | |
| 国債証券 | 第22回利付国債30年 | 8,000,000 | 9,151,920 | |
| 国債証券 | 第23回利付国債30年 | 25,000,000 | 28,603,000 | |
| 国債証券 | 第27回利付国債30年 | 21,000,000 | 24,011,820 | |
| 国債証券 | 第28回利付国債30年 | 14,000,000 | 16,007,180 | |
| 国債証券 | 第29回利付国債30年 | 20,000,000 | 22,444,400 | |
| 国債証券 | 第31回利付国債30年 | 18,000,000 | 19,414,440 | |
| 国債証券 | 第31回利付国債30年 | 12,000,000 | 12,942,960 | |
| 国債証券 | 第33回利付国債30年 | 7,000,000 | 7,233,730 | |
| 国債証券 | 第34回利付国債30年 | 32,000,000 | 34,444,160 | |
| 国債証券 | 第35回利付国債30年 | 5,000,000 | 5,151,300 | |
| 国債証券 | 第36回利付国債30年 | 6,000,000 | 6,171,780 | |
| 国債証券 | 第36回利付国債30年 | 44,000,000 | 45,259,720 | |
| 国債証券 | 第38回利付国債20年 | 58,000,000 | 65,744,160 | |
| 国債証券 | 第82回利付国債20年 | 21,000,000 | 23,457,840 | |
| 国債証券 | 第88回利付国債20年 | 32,000,000 | 36,394,560 | |
| 国債証券 | 第90回利付国債20年 | 28,000,000 | 31,453,800 | |
| 国債証券 | 第92回利付国債20年 | 15,000,000 | 16,634,100 | |
| 国債証券 | 第94回利付国債20年 | 30,000,000 | 33,213,900 | |
| 国債証券 | 第95回利付国債20年 | 38,000,000 | 43,026,640 | |
| 国債証券 | 第98回利付国債20年 | 10,000,000 | 11,032,800 | |
| 国債証券 | 第99回利付国債20年 | 15,000,000 | 16,528,500 | |
| 国債証券 | 第102回利付国債20年 | 44,000,000 | 50,167,920 | |
| 国債証券 | 第103回利付国債20年 | 3,000,000 | 3,379,230 | |
| 国債証券 | 第104回利付国債20年 | 10,000,000 | 10,981,900 | |
| 国債証券 | 第105回利付国債20年 | 50,000,000 | 54,830,000 | |
| 国債証券 | 第105回利付国債20年 | 2,000,000 | 2,193,200 | |
| 国債証券 | 第110回利付国債20年 | 30,000,000 | 32,794,500 | |
| 国債証券 | 第111回利付国債20年 | 16,000,000 | 17,689,760 | |
| 国債証券 | 第113回利付国債20年 | 61,000,000 | 66,457,060 | |
| 国債証券 | 第113回利付国債20年 | 20,000,000 | 21,789,200 | |
| 国債証券 | 第115回利付国債20年 | 18,000,000 | 19,850,400 | |
| 国債証券 | 第117回利付国債20年 | 11,000,000 | 11,940,170 | |
| 国債証券 | 第117回利付国債20年 | 13,000,000 | 14,111,110 | |
| 国債証券 | 第121回利付国債20年 | 6,000,000 | 6,313,500 | |
| 国債証券 | 第121回利付国債20年 | 14,000,000 | 14,731,500 | |
| 国債証券 | 第128回利付国債20年 | 74,000,000 | 77,483,180 | |
| 国債証券 | 第134回利付国債20年 | 71,000,000 | 72,894,280 | |
| 国債証券 | 第135回利付国債20年 | 16,000,000 | 16,165,760 | |
| 国債証券 | 第135回利付国債20年 | 20,000,000 | 20,207,200 | |
| 国債証券 | 第138回利付国債20年 | 6,000,000 | 5,852,760 | |
| 国債証券 | 第139回利付国債20年 | 10,000,000 | 9,925,400 | |

| | | | | |
|-------|--------------------------------|---------------|---------------|--|
| 地方債証券 | 平成20年度第15回北海道公募公債 | 100,000,000 | 101,477,000 | |
| 地方債証券 | 第304回大阪府公募公債 | 100,000,000 | 108,055,000 | |
| 地方債証券 | 平成18年度第8回兵庫県公募公債 | 181,000,000 | 194,205,760 | |
| 地方債証券 | 平成21年度第14回兵庫県公募公債 | 100,000,000 | 101,187,000 | |
| 特殊債券 | 政府保証第341回日本高速道路保有・債務返済機構債券 | 100,000,000 | 103,131,000 | |
| 特殊債券 | S種第14回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 60,192,000 | 63,237,113 | |
| 特殊債券 | 第64回貸付債権担保住宅金融支援機構債券 | 100,000,000 | 100,064,000 | |
| 特殊債券 | 第9回韓国輸出入銀行円貨債券 | 100,000,000 | 100,435,000 | |
| 社債券 | 第1回新韓銀行円貨社債 | 100,000,000 | 100,158,000 | |
| 社債券 | 第2回ジェー・ピー・モルガン・チェース円貨社債(劣後特約付) | 100,000,000 | 101,774,000 | |
| 社債券 | 第2回シティグループ・インク円貨社債 | 100,000,000 | 101,890,000 | |
| 社債券 | 第3回八ナ銀行円貨社債 | 100,000,000 | 100,206,000 | |
| 社債券 | 第4回ウリィ銀行円貨社債 | 100,000,000 | 100,105,000 | |
| 社債券 | 第31回大成建設無担保社債 | 100,000,000 | 103,068,000 | |
| 社債券 | 第17回イオン無担保社債 | 100,000,000 | 99,758,000 | |
| 社債券 | 第7回みずほコーポレート銀行(劣後特約付) | 100,000,000 | 109,685,000 | |
| 社債券 | 第11回りそな銀行(劣後特約付) | 100,000,000 | 102,287,000 | |
| 社債券 | 第1回三井住友信託銀行(劣後特約付) | 100,000,000 | 100,029,000 | |
| 社債券 | 第8回三井住友銀行(劣後特約付) | 100,000,000 | 103,212,000 | |
| 社債券 | 第4回東京センチュリーリース無担保社債 | 100,000,000 | 100,044,000 | |
| 社債券 | 第118回オリックス無担保社債 | 100,000,000 | 103,149,000 | |
| 社債券 | 第153回オリックス無担保社債 | 100,000,000 | 100,438,000 | |
| 社債券 | 第163回オリックス無担保社債 | 100,000,000 | 99,931,000 | |
| 社債券 | 第16回三菱UFJリース無担保社債 | 100,000,000 | 100,128,000 | |
| 社債券 | 第2回イオンモール無担保社債 | 100,000,000 | 102,146,000 | |
| 社債券 | 第14回KDDI無担保社債 | 100,000,000 | 101,725,000 | |
| 社債券 | 第495回中部電力(一般担保付) | 100,000,000 | 100,307,000 | |
| 合計 | | 4,982,192,000 | 5,206,445,013 | |

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。

「明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド」の状況
 なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区分 | (平成24年9月12日現在) | |
|-------------|----------------|---------------|
| | 金額(円) | |
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 預金 | | 19,690,929 |
| コール・ローン | | 36,129,841 |
| 株式 | | 3,289,905,582 |
| 未収配当金 | | 4,294,508 |
| 未収利息 | | 59 |
| 流動資産合計 | | 3,350,020,919 |
| 資産合計 | | 3,350,020,919 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | | 1,700,000 |
| 流動負債合計 | | 1,700,000 |
| 負債合計 | | 1,700,000 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | | 3,859,864,904 |
| 剰余金 | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 511,543,985 |
| 元本等合計 | | 3,348,320,919 |
| 純資産合計 | | 3,348,320,919 |
| 負債純資産合計 | | 3,350,020,919 |

(注) 明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンドの計算期間は、毎年4月11日から翌年4月10日までであり、開示対象ファンドの特定期間とは異なります。上記の貸借対照表は平成24年9月12日現在における明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | (自平成24年3月13日 至平成24年9月12日) |
|-----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、外国金融商品市場における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、または金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. 収益及び費用の計上基準 | 受取配当金 原則として株式の配当落ち日において、その金額が確定しているものについては当該金額を計上し、未だ確定していない場合には入金日基準で計上しております。 |
| 4. その他財務諸表の作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 |

（貸借対照表に関する注記）

| 区分 | （平成24年9月12日現在） | |
|------------------------------------|----------------|----------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | | 3,859,864,904口 |
| 2. 投資信託財産の計算に関する規則第55条の6第10号に規定する額 | 元本の欠損 | 511,543,985円 |
| 3. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | | 0.8675円 |

（重要な後発事象に関する注記）

該当事項はありません。

（金融商品に関する注記）

（1）金融商品の状況に関する事項

| （自平成24年3月13日 至平成24年9月12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第2条第4項に定める証券投資信託であり、証券投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク | 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「（3）附属明細表」に記載しております。これらは、株価変動リスク、信用リスク、流動性リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスクなどに晒されております。 また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、外国為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする外国為替予約取引に係る為替変動リスクを有しております。 |
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | ファンドの運用にあたっては、社内規程や運用計画に基づき、運用部門が運用プロセスの中でリスクコントロールを行います。また、運用部門から独立した部署により諸リスクの状況が確認され、各種委員会等において協議・報告される体制となっております。 |

（2）金融商品の時価等に関する事項

| （平成24年9月12日現在） | |
|------------------------|--|
| 1. 貸借対照表計上額、時価及び差額 | 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. 時価の算定方法 | 株式 「（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。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該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る場合、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

| (平成24年9月12日現在) | |
|----------------|----------------------|
| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 株式 | 104,802,050 |
| 合計 | 104,802,050 |

(デリバティブ取引に関する注記)

該当事項はありません。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | (平成24年9月12日現在) | |
|--------------------------|-----------------------------|----------------|
| 1. 期首元本額 | | 3,819,165,678円 |
| 期中追加設定元本額 | | 287,649,859円 |
| 期中一部解約元本額 | | 246,950,633円 |
| 平成24年9月12日現在における元本の内訳(注) | | |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン70) | 206,046,036円 |
| | 明治安田グローバルバランスオープン | 81,565,724円 |
| | 明治安田DCグローバルバランスオープン | 178,274,176円 |
| | 明治安田DC外国株式リサーチオープン | 2,898,745,738円 |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン30) | 68,675,526円 |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン50) | 213,025,473円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(隔月決算型) | 9,961,764円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(1年決算型) | 7,000,721円 |
| | 明治安田VAハートフルライフ30(適格機関投資家私募) | 96,344,453円 |
| | 明治安田VAハートフルライフ50(適格機関投資家私募) | 100,225,293円 |
| | 合計 | 3,859,864,904円 |

(注) 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

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

| 通貨 | 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|-----|-----------------------------|--------|--------|--------------|----|
| | | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | | | 米ドル | 米ドル | |
| | AMAZON.COM INC | 1,700 | 255.67 | 434,639.00 | |
| | ABBOTT LABORATORIES | 8,200 | 67.33 | 552,106.00 | |
| | ADOBE SYSTEMS INC | 4,400 | 32.43 | 142,692.00 | |
| | ALLERGAN INC | 6,000 | 89.30 | 535,800.00 | |
| | AMERICAN EXPRESS CO | 8,500 | 57.23 | 486,455.00 | |
| | APPLE INC | 2,240 | 660.59 | 1,479,721.60 | |
| | VERIZON COMMUNICATIONS INC | 15,300 | 44.24 | 676,872.00 | |
| | CELGENE CORP | 4,500 | 73.62 | 331,290.00 | |
| | JPMORGAN CHASE & CO | 10,900 | 39.60 | 431,640.00 | |
| | COLGATE-PALMOLIVE CO | 4,800 | 102.82 | 493,536.00 | |
| | DANAHER CORP | 10,600 | 54.54 | 578,124.00 | |
| | COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 5,440 | 67.26 | 365,894.40 | |
| | WALT DISNEY CO/THE | 10,700 | 51.56 | 551,692.00 | |
| | DOLLAR TREE INC | 6,200 | 46.42 | 287,804.00 | |
| | CROWN CASTLE INTL CORP | 6,500 | 64.12 | 416,780.00 | |
| | FLOWSERVE CORP | 3,100 | 132.15 | 409,665.00 | |
| | EATON CORP | 5,700 | 47.62 | 271,434.00 | |
| | ECOLAB INC | 6,200 | 64.20 | 398,040.00 | |
| | ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 5,500 | 60.22 | 331,210.00 | |
| | EXXON MOBIL CORP | 9,300 | 89.62 | 833,466.00 | |
| | NEXTERA ENERGY INC | 11,800 | 67.74 | 799,332.00 | |
| | FRANKLIN RESOURCES INC | 3,100 | 121.88 | 377,828.00 | |
| | FREEPORT-MCMORAN COPPER | 7,800 | 39.93 | 311,454.00 | |

| | | | | | |
|-------------|---------------------------------------|---------|-----------|-----------------|--|
| | GILEAD SCIENCES INC | 5,700 | 59.31 | 338,067.00 | |
| | GENERAL ELECTRIC CO | 17,800 | 21.59 | 384,302.00 | |
| | GOLDMAN SACHS GROUP INC | 2,300 | 116.69 | 268,387.00 | |
| | F5 NETWORKS INC | 2,300 | 95.31 | 219,213.00 | |
| | HOME DEPOT INC | 8,740 | 56.72 | 495,732.80 | |
| | INTEL CORP | 20,200 | 23.34 | 471,468.00 | |
| | INTL GAME TECHNOLOGY | 8,100 | 12.72 | 103,032.00 | |
| | UNITED PARCEL SERVICE-CL B | 4,800 | 73.54 | 352,992.00 | |
| | AGILENT TECHNOLOGIES INC | 8,700 | 37.83 | 329,121.00 | |
| | MICROSOFT CORP | 24,600 | 30.79 | 757,434.00 | |
| | NATIONAL OILWELL VARCO INC | 3,400 | 83.13 | 282,642.00 | |
| | NETAPP INC | 6,800 | 35.18 | 239,224.00 | |
| | COACH INC | 5,400 | 61.48 | 331,992.00 | |
| | WELLS FARGO & CO | 22,800 | 34.15 | 778,620.00 | |
| | MONSANTO CO | 5,400 | 89.50 | 483,300.00 | |
| | ORACLE CORP | 17,000 | 32.32 | 549,440.00 | |
| | PEPSICO INC | 6,000 | 71.58 | 429,480.00 | |
| | PFIZER INC | 30,600 | 24.17 | 739,602.00 | |
| | PRECISION CASTPARTS CORP | 2,500 | 159.39 | 398,475.00 | |
| | US BANCORP | 16,700 | 34.04 | 568,468.00 | |
| | SCHLUMBERGER LTD | 6,400 | 73.66 | 471,424.00 | |
| | PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 6,900 | 56.68 | 391,092.00 | |
| | STARBUCKS CORP | 10,000 | 50.73 | 507,300.00 | |
| | TEXAS INSTRUMENTS INC | 8,100 | 28.58 | 231,498.00 | |
| | THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 5,800 | 59.08 | 342,664.00 | |
| | MARATHON OIL CORP | 7,400 | 29.22 | 216,228.00 | |
| | UNITED TECHNOLOGIES CORP | 5,500 | 78.76 | 433,180.00 | |
| | UNITEDHEALTH GROUP INC | 6,700 | 52.80 | 353,760.00 | |
| | WAL-MART STORES INC | 3,900 | 74.06 | 288,834.00 | |
| | GOOGLE INC-CL A | 950 | 692.19 | 657,580.50 | |
| | P H I L I P M O R R I S INTERNATIONAL | 11,000 | 88.38 | 972,180.00 | |
| | MEAD JOHNSON NUTRITION CO | 5,200 | 74.71 | 388,492.00 | |
| | EXPRESS SCRIPTS HOLDING CO | 5,800 | 61.71 | 357,918.00 | |
| 米ドル小計 | | | | 米ドル | |
| | | 461,970 | | 25,630,617.30 | |
| | | | | (1,996,368,781) | |
| カナダドル | | | カナダドル | カナダドル | |
| | BARRICK GOLD CORP | 6,700 | 38.40 | 257,280.00 | |
| | TALISMAN ENERGY INC | 16,900 | 13.97 | 236,093.00 | |
| | BANK OF NOVA SCOTIA | 10,600 | 53.00 | 561,800.00 | |
| | CANADIAN NATURAL RESOURCES | 9,700 | 32.18 | 312,146.00 | |
| | SHOPPERS DRUG MART CORP | 4,200 | 43.19 | 181,398.00 | |
| | SUNCOR ENERGY INC | 15,300 | 32.60 | 498,780.00 | |
| カナダドル小計 | | | | カナダドル | |
| | | 63,400 | | 2,047,497.00 | |
| | | | | (163,943,084) | |
| オーストラリアドル | | | オーストラリアドル | オーストラリアドル | |
| | RIO TINTO LTD | 8,300 | 54.53 | 452,599.00 | |
| | BRAMBLES LTD | 24,400 | 6.99 | 170,556.00 | |
| オーストラリアドル小計 | | | | オーストラリアドル | |
| | | 32,700 | | 623,155.00 | |
| | | | | (50,724,817) | |
| ポンド | | | ポンド | ポンド | |
| | STANDARD CHARTERED PLC | 14,100 | 14.28 | 201,348.00 | |
| | COMPASS GROUP PLC | 40,400 | 7.01 | 283,204.00 | |
| | BG GROUP PLC | 29,600 | 12.71 | 376,068.00 | |
| | CENTRICA PLC | 82,900 | 3.31 | 274,481.90 | |
| | ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 13,400 | 23.00 | 308,133.00 | |
| | INMARSAT PLC | 45,600 | 5.81 | 264,936.00 | |

| | | | | | |
|--------------|---|---------|------------|---------------|--|
| | VODAFONE GROUP PLC | 166,200 | 1.77 | 293,592.30 | |
| | RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 7,400 | 36.26 | 268,324.00 | |
| | AEGIS GROUP PLC | 78,900 | 2.38 | 187,387.50 | |
| | JOHNSON MATTHEY PLC | 15,090 | 24.41 | 368,346.90 | |
| ボンド小計 | | | | ボンド | |
| | | 493,590 | | 2,825,821.60 | |
| | | | | (353,736,347) | |
| スイスフラン | | | スイスフラン | スイスフラン | |
| | NOVARTIS AG-REG | 6,200 | 56.05 | 347,510.00 | |
| | NESTLE SA-REG | 12,500 | 58.95 | 736,875.00 | |
| | CREDIT SUISSE GROUP AG-REG | 5,500 | 20.27 | 111,485.00 | |
| | C I E F I N A N C I E R E R I C H E M O N - B R A | 8,600 | 60.85 | 523,310.00 | |
| スイスフラン小計 | | | | スイスフラン | |
| | | 32,800 | | 1,719,180.00 | |
| | | | | (142,605,981) | |
| 香港ドル | | | 香港ドル | 香港ドル | |
| | HENGAN INTL GROUP CO LTD | 38,000 | 76.55 | 2,908,900.00 | |
| | HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 6,900 | 108.40 | 747,960.00 | |
| | CNOOC LTD | 139,300 | 14.70 | 2,047,710.00 | |
| | AIA GROUP LTD | 122,600 | 27.50 | 3,371,500.00 | |
| 香港ドル小計 | | | | 香港ドル | |
| | | 306,800 | | 9,076,070.00 | |
| | | | | (91,123,742) | |
| スウェーデンクローネ | | | スウェーデンクローネ | スウェーデンクローネ | |
| | ATLAS COPCO AB-A SHS | 20,800 | 154.60 | 3,215,680.00 | |
| スウェーデンクローネ小計 | | | | スウェーデンクローネ | |
| | | 20,800 | | 3,215,680.00 | |
| | | | | (37,912,867) | |
| ノルウェークローネ | | | ノルウェークローネ | ノルウェークローネ | |
| | STATOIL ASA | 5,900 | 149.00 | 879,100.00 | |
| ノルウェークローネ小計 | | | | ノルウェークローネ | |
| | | 5,900 | | 879,100.00 | |
| | | | | (11,876,641) | |
| ユーロ | | | ユーロ | ユーロ | |
| | ADIDAS AG | 3,900 | 63.76 | 248,664.00 | |
| | CRH PLC | 4,400 | 15.10 | 66,440.00 | |
| | C I E G E N E R A L E D E G E O P H Y S I Q U E | 7,900 | 25.02 | 197,618.50 | |
| | PERNOD-RICARD SA | 6,100 | 86.51 | 527,711.00 | |
| | SAP AG | 4,500 | 53.70 | 241,650.00 | |
| | BAYER AG-REG | 7,700 | 65.47 | 504,119.00 | |
| | VOLKSWAGEN AG-PFD | 1,000 | 143.45 | 143,450.00 | |
| | BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 13,000 | 6.57 | 85,410.00 | |
| | SIEMENS AG-REG | 3,800 | 78.40 | 297,920.00 | |
| | LINDE AG | 1,700 | 129.80 | 220,660.00 | |
| | ACCOR SA | 3,100 | 26.98 | 83,638.00 | |
| | ASML HOLDING NV | 7,700 | 43.64 | 336,028.00 | |
| | SOCIETE GENERALE | 2,200 | 24.66 | 54,252.00 | |
| | AXA SA | 14,600 | 12.53 | 182,865.00 | |
| | P O R S C H E A U T O M O B I L H L D G - P F D | 3,200 | 42.60 | 136,320.00 | |
| | BNP PARIBAS | 6,300 | 39.01 | 245,763.00 | |
| | VIENNA INSURANCE GROUP AG | 4,900 | 33.72 | 165,228.00 | |
| | EUTELSAT COMMUNICATIONS | 7,500 | 25.39 | 190,425.00 | |
| | VALLUREC | 2,500 | 36.17 | 90,425.00 | |
| | ANDRITZ AG | 5,100 | 43.75 | 223,125.00 | |
| | SUEZ ENVIRONNEMENT CO | 18,000 | 9.45 | 170,010.00 | |
| ユーロ小計 | | | | ユーロ | |
| | | 129,100 | | 4,411,721.50 | |
| | | | | (441,613,322) | |

| | | | | | |
|----|--|--|--|-----------------|--|
| 合計 | | | | 3,289,905,582 | |
| | | | | (3,289,905,582) | |

(注1) 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額です。

(注2) 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

(注3) 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入株式時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|------------|-----------|----------|------------|
| 米ドル | 株式 5 6 銘柄 | 100.0% | 60.7% |
| カナダドル | 株式 6 銘柄 | 100.0% | 5.0% |
| オーストラリアドル | 株式 2 銘柄 | 100.0% | 1.5% |
| ポンド | 株式 1 0 銘柄 | 100.0% | 10.7% |
| スイスフラン | 株式 4 銘柄 | 100.0% | 4.3% |
| 香港ドル | 株式 4 銘柄 | 100.0% | 2.8% |
| スウェーデンクローネ | 株式 1 銘柄 | 100.0% | 1.2% |
| ノルウェークローネ | 株式 1 銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| ユーロ | 株式 2 1 銘柄 | 100.0% | 13.4% |

(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

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。

「明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド」の状況

なお、以下に記載した情報は監査の対象外であります。

明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド

(1) 貸借対照表

| 区分 | (平成24年9月12日現在) |
|-------------|----------------|
| | 金額(円) |
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 預金 | 447,103,184 |
| コール・ローン | 418,335,237 |
| 国債証券 | 32,277,392,132 |
| 地方債証券 | 825,768,715 |
| 特殊債券 | 6,100,519,483 |
| 派生商品評価勘定 | 33,299 |
| 未収利息 | 352,068,632 |
| 前払費用 | 131,962,850 |
| 流動資産合計 | 40,553,183,532 |
| 資産合計 | 40,553,183,532 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 派生商品評価勘定 | 18,006 |
| 未払金 | 380,023,644 |
| 未払解約金 | 109,670,000 |
| 流動負債合計 | 489,711,650 |
| 負債合計 | 489,711,650 |
| 純資産の部 | |
| 元本等 | |
| 元本 | 27,712,096,242 |
| 剰余金 | |
| 剰余金又は欠損金() | 12,351,375,640 |
| 元本等合計 | 40,063,471,882 |
| 純資産合計 | 40,063,471,882 |
| 負債純資産合計 | 40,553,183,532 |

(注) 明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンドの計算期間は、毎年4月11日から翌年4月10日までであり、開示対象ファンドの特定期間とは異なります。上記の貸借対照表は平成24年9月12日現在における明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンドの状況です。

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区分 | (自 平成24年3月13日 至 平成24年9月12日) |
|-----------------------------|---|
| 1. 有価証券の評価基準及び評価方法 | 公社債 個別法に基づき、以下のとおり、法令および社団法人投資信託協会規則に従って時価で評価しております。原則として、金融商品取引業者の提示する価額（ただし、売気配相場は使用しない）価格情報会社（野村総合研究所）の提供する価額などに基づいて時価評価しております。時価が入手不能の場合、又は入手した評価額が時価と認定できない事由を認めた場合は、忠実義務に基づき当社が合理的事由をもって時価と認める評価額により評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | 為替予約 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 為替予約の評価は、原則として、わが国における計算期間末日の対顧客先物相場の仲値によって計算しております。 |
| 3. その他財務諸表の作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区分 | (平成24年9月12日現在) |
|------------------------------|-----------------|
| 1. 当該計算期間の末日における受益権の総数 | 27,712,096,242口 |
| 2. 当該計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額 | 1.4457円 |

(重要な後発事象に関する注記)

該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

(1) 金融商品の状況に関する事項

| (自 平成24年 3月13日 至 平成24年 9月12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第2条第4項に定める証券投資信託であり、証券投資信託約款に規定する「運用の基本方針」に従い、有価証券等の金融商品に対して投資として運用することを目的としております。 |
| 2. | 金融商品の内容及び金融商品に係るリスク 当ファンドが保有する金融商品の種類は、有価証券、デリバティブ取引、コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務であります。当ファンドが保有する有価証券の詳細は「(3) 附属明細表」に記載しております。これらは、信用リスク、流動性リスク、金利変動リスク、為替変動リスク、カントリーリスクなどに晒されております。また、当ファンドは、信託財産に属する資産の効率的な運用に資することを目的として、外国為替予約取引を行っております。当該デリバティブ取引は、対象とする外国為替予約取引に係る為替変動リスクを有しております。 |
| 3. | 金融商品に係るリスク管理体制 ファンドの運用にあたっては、社内規程や運用計画に基づき、運用部門が運用プロセスの中でリスクコントロールを行います。また、運用部門から独立した部署により諸リスクの状況が確認され、各種委員会等において協議・報告される体制となっております。 |

(2) 金融商品の時価等に関する事項

| (平成24年 9月12日現在) | |
|-----------------|--|
| 1. | 貸借対照表計上額、時価及び差額 貸借対照表上の金融商品は原則としてすべて時価で評価しているため、貸借対照表計上額と時価との差額はありません。 |
| 2. | 時価の算定方法 公社債 「(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。 派生商品評価勘定 デリバティブ取引については、「(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。 コール・ローン等の金銭債権及び金銭債務 これらの科目は短期間で決済されるため、時価は帳簿価額と近似していることから、当該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。 また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額または計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。 |

(有価証券に関する注記)

売買目的有価証券

| (平成24年 9月12日現在) | |
|-----------------|----------------------|
| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額(円) |
| 国債証券 | 495,107,806 |
| 地方債証券 | 249,018 |
| 特殊債券 | 86,190,143 |
| 合計 | 581,546,967 |

(デリバティブ取引に関する注記)

ヘッジ会計が適用されていないデリバティブ取引

(通貨関連)

| 区分 | 種類 | (平成24年9月12日現在) | | | |
|-----------|----------|----------------|-------|------------|---------|
| | | 契約額等(円) | | 時価(円) | 評価損益(円) |
| | | | うち1年超 | | |
| 市場取引以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 売建 | 61,104,493 | - | 61,089,200 | 15,293 |
| | 米ドル | 5,717,643 | - | 5,694,975 | 22,668 |
| | カナダドル | 14,974,960 | - | 14,971,220 | 3,740 |
| | ポンド | 28,756,875 | - | 28,749,984 | 6,891 |
| | シンガポールドル | 2,913,640 | - | 2,915,020 | 1,380 |
| | ユーロ | 8,741,375 | - | 8,758,001 | 16,626 |
| | 合計 | 61,104,493 | - | 61,089,200 | 15,293 |

(注)時価の算定方法

1. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
 計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物相場が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの先物相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・ 計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物相場の仲値を用いております。
2. 計算期間末日に対顧客先物相場の仲値が発表されていない外貨については、計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
3. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

(その他の注記)

元本の移動

| 区分 | (平成24年9月12日現在) | |
|------------------------------|-----------------------------|-----------------|
| 1. 期首元本額 | | 32,090,348,678円 |
| 期中追加設定元本額 | | 168,521,965円 |
| 期中一部解約元本額 | | 4,546,774,401円 |
| 平成24年9月12日現在における元本の内訳 (注) | 明治安田DCハートフルライフ(プラン70) | 48,116,492円 |
| | 明治安田グローバルバランスオープン | 34,794,008円 |
| | 明治安田DCグローバルバランスオープン | 76,054,292円 |
| | 明治安田外国債券オープン | 1,050,677,795円 |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン30) | 40,717,784円 |
| | 明治安田DCハートフルライフ(プラン50) | 62,858,636円 |
| | 明治安田DC外国債券オープン | 2,453,411,362円 |
| | 明治安田外国債券オープン(毎月分配型) | 21,467,133,468円 |
| | グローバル・インカム・プラス(毎月分配型) | 2,098,321,444円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(隔月決算型) | 5,186,430円 |
| | 明治安田資産形成サポートファンド(1年決算型) | 3,680,399円 |
| | 明治安田VAハートフルライフ30(適格機関投資家私募) | 58,060,173円 |
| | 明治安田VAハートフルライフ50(適格機関投資家私募) | 29,210,654円 |
| | 明治安田VA外国債券オープン(適格機関投資家私募) | 283,873,305円 |
| | 合計 | 27,712,096,242円 |

(注) 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

(3) 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

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------|--------------|------------------------|-----------------|------------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | | 米ドル | 米ドル | |
| | | US TREASURY N/B 0.25% | 2,000,000 | 1,996,562.50 | |
| | | US TREASURY N/B 0.75% | 2,800,000 | 2,814,656.26 | |
| | | US TREASURY N/B 1.25% | 7,000,000 | 7,111,562.50 | |
| | | US TREASURY N/B 1.25% | 4,000,000 | 4,063,750.00 | |
| | | US TREASURY N/B 1.25% | 5,500,000 | 5,587,656.25 | |
| | | US TREASURY N/B 2% | 30,100,000 | 31,132,336.08 | |
| | | US TREASURY N/B 2.75% | 7,100,000 | 7,881,000.00 | |
| | | US TREASURY N/B 3.5% | 5,140,000 | 5,883,693.75 | |
| | | US TREASURY N/B 3.625% | 10,500,000 | 12,366,210.99 | |
| | | US TREASURY N/B 4.25% | 28,910,000 | 31,394,453.12 | |
| | | US TREASURY N/B 4.25% | 17,000,000 | 22,024,296.96 | |
| | | US TREASURY N/B 5.375% | 3,500,000 | 5,054,218.75 | |
| | | US TREASURY N/B 6.25% | 600,000 | 938,531.25 | |
| | 米ドル 小計 | | 米ドル | 米ドル | |
| | | | 124,150,000 | 138,248,928.41 | |
| | | | (9,670,043,500) | (10,768,209,033) | |
| | カナダドル | | カナダドル | カナダドル | |
| | | CANADA-GOV'T 5.75% | 2,500,000 | 3,698,625.00 | |
| | | CANADA-GOV'T 5.75% | 400,000 | 618,472.00 | |
| | カナダドル 小計 | | カナダドル | カナダドル | |
| | | | 2,900,000 | 4,317,097.00 | |
| | | | (232,203,000) | (345,669,956) | |
| | オーストラリアドル | | オーストラリアドル | オーストラリアドル | |
| | | AUSTRALIAN GOVT. 6% | 1,470,000 | 1,681,165.50 | |
| | オーストラリアドル 小計 | | オーストラリアドル | オーストラリアドル | |
| | | | 1,470,000 | 1,681,165.50 | |
| | | | (119,658,000) | (136,846,871) | |
| | ポンド | | ポンド | ポンド | |
| | | TREASURY 1.75% | 4,850,000 | 5,101,036.00 | |

| | | | |
|----------------|------------------------|-----------------|-----------------|
| | TREASURY 1.75% | 900,000 | 946,584.00 |
| | TREASURY 1.75% | 2,000,000 | 2,103,520.00 |
| | TREASURY 4% | 650,000 | 741,942.50 |
| | TREASURY 4.25% | 4,230,000 | 5,179,635.00 |
| | TREASURY 4.5% | 1,500,000 | 1,907,400.00 |
| | TREASURY 4.5% | 800,000 | 1,017,280.00 |
| | TREASURY 4.75% | 2,470,000 | 3,278,678.00 |
| | TREASURY 5% | 3,400,000 | 4,172,650.00 |
| | TREASURY 5% | 200,000 | 245,450.00 |
| ポンド 小計 | ポンド | ポンド | |
| | | 21,000,000 | 24,694,175.50 |
| | | (2,628,780,000) | (3,091,216,889) |
| スイスフラン | スイスフラン | スイスフラン | |
| | SWISS (GOVT) 3% | 1,800,000 | 2,125,440.00 |
| スイスフラン 小計 | スイスフラン | スイスフラン | |
| | | 1,800,000 | 2,125,440.00 |
| | | (149,310,000) | (176,305,248) |
| シンガポールドル | シンガポールドル | シンガポールドル | |
| | SINGAPORE GOV'T 4% | 2,300,000 | 2,742,612.00 |
| シンガポールドル 小計 | シンガポールドル | シンガポールドル | |
| | | 2,300,000 | 2,742,612.00 |
| | | (145,774,000) | (173,826,748) |
| マレーシアリングgit | マレーシアリングgit | マレーシアリングgit | |
| | MALAYSIAN GOV'T 4.262% | 8,000,000 | 8,304,720.00 |
| マレーシアリングgit 小計 | マレーシアリングgit | マレーシアリングgit | |
| | | 8,000,000 | 8,304,720.00 |
| | | (202,080,000) | (209,777,227) |
| ノルウェークローネ | ノルウェークローネ | ノルウェークローネ | |
| | NORWEGIAN GOV'T 4.25% | 6,000,000 | 6,776,700.00 |
| | NORWEGIAN GOV'T 5% | 16,000,000 | 17,564,800.00 |
| ノルウェークローネ 小計 | ノルウェークローネ | ノルウェークローネ | |
| | | 22,000,000 | 24,341,500.00 |
| | | (297,220,000) | (328,853,665) |
| デンマーククローネ | デンマーククローネ | デンマーククローネ | |
| | DENMARK - BULLET 4% | 7,050,000 | 8,546,715.00 |
| | DENMARK - BULLET 4% | 8,000,000 | 9,698,400.00 |
| | DENMARK - BULLET 7% | 3,310,000 | 5,318,177.00 |
| デンマーククローネ 小計 | デンマーククローネ | デンマーククローネ | |
| | | 18,360,000 | 23,563,292.00 |
| | | (246,574,800) | (316,455,011) |
| メキシコペソ | メキシコペソ | メキシコペソ | |
| | MEXICAN BONOS 6.5% | 36,000,000 | 38,674,800.00 |
| | MEXICAN BONOS 8% | 60,340,000 | 70,938,117.60 |
| メキシコペソ 小計 | メキシコペソ | メキシコペソ | |
| | | 96,340,000 | 109,612,917.60 |
| | | (579,003,400) | (658,773,634) |
| ポーランドズロチ | ポーランドズロチ | ポーランドズロチ | |
| | POLAND GOVT BOND 4.75% | 13,740,000 | 14,007,930.00 |
| ポーランドズロチ 小計 | ポーランドズロチ | ポーランドズロチ | |
| | | 13,740,000 | 14,007,930.00 |
| | | (337,729,200) | (344,314,919) |
| ユーロ | ユーロ | ユーロ | |
| | DEUTSCHLAND REP 1.75% | 1,500,000 | 1,535,850.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 1.75% | 800,000 | 819,120.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 3.5% | 2,100,000 | 2,331,000.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 4.25% | 8,000,000 | 8,612,400.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 4.25% | 3,500,000 | 3,767,925.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 4.25% | 9,640,000 | 11,356,884.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 4.25% | 9,850,000 | 11,604,285.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 4.75% | 2,850,000 | 4,242,225.00 |
| | DEUTSCHLAND REP 6.5% | 1,000,000 | 1,572,600.00 |
| | BTPS 4.75% | 13,200,000 | 13,701,600.00 |
| | BTPS 4.75% | 2,500,000 | 2,595,000.00 |
| | BTPS 5% | 1,500,000 | 1,509,150.00 |
| | BTPS 6.5% | 11,060,000 | 11,987,934.00 |
| | BTPS 6.5% | 600,000 | 650,340.00 |

| | | | | | |
|-------------|----------|-------------------------|------------------|------------------|--|
| | | BTAN 3% | 2,300,000 | 2,418,565.00 | |
| | | FRANCE O.A.T. 3% | 6,500,000 | 6,942,000.00 | |
| | | FRANCE O.A.T. 3.25% | 1,000,000 | 1,094,100.00 | |
| | | FRANCE O.A.T. 3.25% | 1,400,000 | 1,531,740.00 | |
| | | FRANCE O.A.T. 4.25% | 1,200,000 | 1,403,760.00 | |
| | | FRANCE O.A.T. 4.5% | 3,150,000 | 3,913,560.00 | |
| | | FRANCE O.A.T. 5% | 300,000 | 351,510.00 | |
| | | FRANCE O.A.T. 5.75% | 4,790,000 | 6,741,925.00 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 0.75% | 2,800,000 | 2,839,340.00 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3.75% | 200,000 | 244,000.00 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 3.75% | 600,000 | 732,000.00 | |
| | | NETHERLANDS GOVT 4.5% | 640,000 | 750,912.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 4% | 2,900,000 | 2,921,895.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 4.25% | 4,800,000 | 4,791,360.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 4.25% | 1,400,000 | 1,397,480.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 4.3% | 4,000,000 | 3,732,400.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 4.7% | 500,000 | 384,250.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 4.7% | 3,200,000 | 2,459,200.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 5.5% | 800,000 | 783,040.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 5.75% | 550,000 | 508,750.00 | |
| | | SPANISH GOV'T 5.9% | 800,000 | 758,720.00 | |
| | | BELGIAN 0303 4.25% | 3,000,000 | 3,233,100.00 | |
| | | BELGIAN 0307 3.25% | 3,150,000 | 3,437,847.00 | |
| | | BELGIAN 0307 3.25% | 600,000 | 654,828.00 | |
| | | BELGIAN 0307 3.25% | 1,000,000 | 1,091,380.00 | |
| | | BELGIAN 0320 4.25% | 700,000 | 796,880.00 | |
| | | BELGIAN 0320 4.25% | 1,000,000 | 1,138,400.00 | |
| | | BELGIAN 3% | 1,300,000 | 1,371,760.00 | |
| | | BELGIAN 3% | 7,000,000 | 7,386,400.00 | |
| | | BELGIAN 4.5% | 200,000 | 232,320.00 | |
| | | REP OF AUSTRIA 3.2% | 1,900,000 | 2,095,700.00 | |
| | | REP OF AUSTRIA 6.25% | 1,300,000 | 1,880,580.00 | |
| | | FINNISH GOV'T 3.875% | 7,100,000 | 8,165,000.00 | |
| | | FINNISH GOV'T 4.375% | 2,200,000 | 2,643,300.00 | |
| | ユーロ 小計 | | ユーロ | ユーロ | |
| | | | 142,380,000 | 157,114,315.00 | |
| | | | (14,252,238,000) | (15,727,142,931) | |
| 国債証券 合計 | | | 28,860,613,900 | 32,277,392,132 | |
| | | | (28,860,613,900) | (32,277,392,132) | |
| 地方債証券 | カナダドル | | カナダドル | カナダドル | |
| | | BRIT COLUMBIA 4.65% | 900,000 | 1,036,440.00 | |
| | | ONTARIO PROVINCE 4.4% | 8,500,000 | 9,276,645.00 | |
| | カナダドル 小計 | | カナダドル | カナダドル | |
| | | | 9,400,000 | 10,313,085.00 | |
| | | | (752,658,000) | (825,768,715) | |
| 地方債証券 合計 | | | 752,658,000 | 825,768,715 | |
| | | | (752,658,000) | (825,768,715) | |
| 特殊債券 | 米ドル | | 米ドル | 米ドル | |
| | | KFW 4.875% | 8,000,000 | 9,355,200.00 | |
| | | CAISSE AMORT DET 5.25% | 7,400,000 | 8,484,100.00 | |
| | | BK NED GEMEENTEN 5.125% | 8,000,000 | 9,120,000.00 | |
| | | OESTER KONTROLBK 1.75% | 12,000,000 | 12,276,000.00 | |
| | | COUNCIL OF EUROP 4% | 3,000,000 | 3,238,800.00 | |
| | | COUNCIL OF EUROP 5.125% | 7,500,000 | 8,799,750.00 | |
| | | EURO BK RECON&DV 1.625% | 9,000,000 | 9,264,600.00 | |
| | | EUROPEAN INVT BK 4.875% | 8,000,000 | 9,296,000.00 | |
| | | EUROPEAN INVT BK 5.125% | 5,000,000 | 5,930,000.00 | |
| | 米ドル 小計 | | 米ドル | 米ドル | |
| | | | 67,900,000 | 75,764,450.00 | |
| | | | (5,288,731,000) | (5,901,293,010) | |
| | ボンド | | ボンド | ボンド | |
| | | EUROPEAN INVT BK 4.875% | 1,400,000 | 1,591,520.00 | |
| | ボンド 小計 | | | | |
| | | | 1,400,000 | 1,591,520.00 | |

| | | | | |
|------------|--|------------------|------------------|--|
| | | (175,252,000) | (199,226,473) | |
| 特殊債券 合計 | | 5,463,983,000 | 6,100,519,483 | |
| | | (5,463,983,000) | (6,100,519,483) | |
| 合計 | | 35,077,254,900 | 39,203,680,330 | |
| | | (35,077,254,900) | (39,203,680,330) | |

(注1) 各種通貨ごとの小計の欄における()内の金額は、邦貨換算額です。

(注2) 合計欄における()内の金額は、外貨建有価証券の邦貨換算額の合計額であり、内数で表示しております。

(注3) 外貨建有価証券の内訳

| 通貨 | 銘柄数 | 組入債券時価比率 | 合計金額に対する比率 |
|-------------|-------------|----------|------------|
| 米ドル | 国債証券 1 1 銘柄 | 100.0% | 27.5% |
| | 特殊債券 9 銘柄 | 100.0% | 15.1% |
| カナダドル | 国債証券 2 銘柄 | 100.0% | 0.9% |
| | 地方債証券 2 銘柄 | 100.0% | 2.1% |
| オーストラリアドル | 国債証券 1 銘柄 | 100.0% | 0.3% |
| ポンド | 国債証券 6 銘柄 | 100.0% | 7.9% |
| | 特殊債券 1 銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| スイスフラン | 国債証券 1 銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| シンガポールドル | 国債証券 1 銘柄 | 100.0% | 0.4% |
| マレーシアリングギット | 国債証券 1 銘柄 | 100.0% | 0.5% |
| ノルウェークローネ | 国債証券 2 銘柄 | 100.0% | 0.8% |
| デンマーククローネ | 国債証券 2 銘柄 | 100.0% | 0.8% |
| メキシコペソ | 国債証券 2 銘柄 | 100.0% | 1.7% |
| ポーランドズロチ | 国債証券 1 銘柄 | 100.0% | 0.9% |
| ユーロ | 国債証券 3 5 銘柄 | 100.0% | 40.1% |

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

「注記表(デリバティブ取引に関する注記)」に記載しております。

[前へ](#)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】 (平成24年10月31日現在)

| | |
|-----------------|--------------|
| 資産総額 | 31,820,038 円 |
| 負債総額 | 42,772 円 |
| 純資産総額 (-) | 31,777,266 円 |
| 発行済数量 | 30,536,154 口 |
| 1口当たり純資産額 (/) | 1.0406 円 |

(参考) マザーファンドの現況

明治安田TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

(平成24年10月31日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 3,336,683,132 円 |
| 負債総額 | 27,601,748 円 |
| 純資産総額 (-) | 3,309,081,384 円 |
| 発行済数量 | 3,140,858,571 口 |
| 1口当たり純資産額 (/) | 1.0536 円 |

明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド

純資産額計算書

(平成24年10月31日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 6,146,463,855 円 |
| 負債総額 | 801,751,180 円 |
| 純資産総額 (-) | 5,344,712,675 円 |
| 発行済数量 | 4,359,389,506 口 |
| 1口当たり純資産額 (/) | 1.2260 円 |

明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド

純資産額計算書

(平成24年10月31日現在)

| | |
|-----------------|-----------------|
| 資産総額 | 3,441,554,357 円 |
| 負債総額 | 37,940,000 円 |
| 純資産総額 (-) | 3,403,614,357 円 |
| 発行済数量 | 3,861,323,818 口 |
| 1口当たり純資産額 (/) | 0.8815 円 |

明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド

純資産額計算書

(平成24年10月31日現在)

| | |
|-----------------|------------------|
| 資産総額 | 39,980,120,455 円 |
| 負債総額 | 102,740,000 円 |
| 純資産総額 (-) | 39,877,380,455 円 |
| 発行済数量 | 26,764,114,742 口 |
| 1口当たり純資産額 (/) | 1.4900 円 |

第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

(1)名義書換の事務等

該当事項はありません。

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。

したがって、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、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

(2)受益者に対する特典

該当事項はありません。

(3)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ます。

前項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ます。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ます。

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え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。

(4)受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

譲渡制限はありません。ただし、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。

(5)受益権の再分割

委託会社は、受託会社と協議のうえ、社振法に定めるところにしたがい、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。

(6)質権口記載又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かかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、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扱われます。

(7)償還金

償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）に支払います。

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

(1)資本金の額

| | |
|----------------|---------|
| 本書提出日現在の資本金の額： | 10億円 |
| 会社が発行する株式総数： | 33,220株 |
| 発行済株式総数： | 18,887株 |

<過去5年間における資本金の額の推移>

該当事項はありません。

(2)委託会社の機構

会社の意思決定機構

経営の意思決定機関として取締役会をおきます。取締役会は、法令、定款に定める事項ならびに本会社の業務執行に関する重要事項を決定するほか、執行役員を選任し、本会社の業務執行を委任します。執行役員は取締役会において決定された基本方針に則り、本会社の業務執行を行います。

投資運用の意思決定機構

- 投資政策委員会にて、マクロ経済環境・市況環境に関する分析、資産配分・資産毎の運用戦略に関する検討を行います。
- ファンドの運用担当者は、投資政策委員会における分析・検討等を踏まえて運用計画を策定し、運用計画に基づき、有価証券等の売買をトレーディング部門に指図します。
- ファンドの運用の基本規程等の遵守状況の管理、運用資産のリスク管理は、運用部門から独立したコンプライアンス・リスク管理部、運用企画部が行います。
- 投資管理委員会にて、ファンドの運用パフォーマンスの評価等を行い、これを運用部門にフィードバックすることにより、より精度の高い運用体制を維持するよう努めています。

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）およびその受益権の募集又は私募（第二種金融商品取引業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成24年10月31日現在、委託会社が運用の指図を行っている証券投資信託は以下の通りです（ただし、親投資信託を除きます。）。

| 種 類 | 本数 | 純資産総額 |
|-----------|-------|-------------------|
| 追加型株式投資信託 | 130 本 | 412,996,477,306 円 |
| 単位型株式投資信託 | 2 本 | 2,767,803,097 円 |
| 合 計 | 132 本 | 415,764,280,403 円 |

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

委託会社である明治安田アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」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）に基づいて作成しております。

2．監査証明について

委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、事業年度（平成23年4月1日から平成24年3月31日まで）の財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人により監査を受けております。

(1) 【貸借対照表】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | 当事業年度 (平成24年3月31日) |
|------------|-----------------------|-----------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 現金・預金 | 7,654,615 | 7,798,082 |
| 前払費用 | 100,129 | 96,609 |
| 未収入金 | 2 | 1,594 |
| 未収委託者報酬 | 461,977 | 406,697 |
| 未収運用受託報酬 | ¹ 544,381 | ¹ 497,131 |
| 未収投資助言報酬 | ¹ 195,353 | ¹ 170,156 |
| 繰延税金資産 | 116,799 | - |
| その他 | 2,979 | 1,757 |
| 貸倒引当金 | 8,785 | - |
| 流動資産合計 | 9,067,453 | 8,972,029 |
| 固定資産 | | |
| 有形固定資産 | | |
| 建物 | ² 135,328 | ² 120,876 |
| 器具備品 | ² 178,423 | ² 132,336 |
| 有形固定資産合計 | 313,752 | 253,213 |
| 無形固定資産 | | |
| ソフトウェア | 33,466 | 22,377 |
| 電話加入権 | 6,662 | 6,662 |
| その他 | 586 | 8,170 |
| 無形固定資産合計 | 40,714 | 37,210 |
| 投資その他の資産 | | |
| 長期差入保証金 | ¹ 190,699 | ¹ 190,699 |
| 長期前払費用 | 275 | 185 |
| 繰延税金資産 | 25,824 | - |
| 施設利用権 | 49,000 | - |
| 貸倒引当金 | 48,000 | - |
| 投資その他の資産合計 | 217,799 | 190,884 |
| 固定資産合計 | 572,266 | 481,307 |
| 資産合計 | 9,639,719 | 9,453,336 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | 当事業年度 (平成24年3月31日) |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 預り金 | 13,180 | 18,168 |
| 未払金 | 516,160 | 339,611 |
| 未払収益分配金 | 146 | 158 |
| 未払償還金 | 7,315 | 7,315 |
| 未払手数料 | 193,778 | 163,484 |
| その他未払金 | 314,921 | 168,652 |
| 未払費用 | 94,353 | 32,463 |
| 未払法人税等 | 11,716 | 10,892 |
| 未払消費税等 | - | 36,590 |
| 賞与引当金 | 103,938 | 104,985 |
| 流動負債合計 | 739,349 | 542,711 |
| 固定負債 | | |
| 退職給付引当金 | 119,390 | 114,893 |
| 資産除去債務 | 54,977 | 55,470 |
| 固定負債合計 | 174,368 | 170,363 |
| 負債合計 | 913,718 | 713,075 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 1,000,000 | 1,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | 660,443 | 660,443 |
| その他資本剰余金 | 2,854,339 | 2,854,339 |
| 資本剰余金合計 | 3,514,783 | 3,514,783 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | 83,040 | 83,040 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | 3,092,001 | 3,092,001 |
| 繰越利益剰余金 | 1,036,176 | 1,050,436 |
| 利益剰余金合計 | 4,211,217 | 4,225,478 |
| 株主資本合計 | 8,726,001 | 8,740,261 |
| 純資産合計 | 8,726,001 | 8,740,261 |
| 負債・純資産合計 | 9,639,719 | 9,453,336 |

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) |
|-----------|--|--|
| 営業収益 | | |
| 委託者報酬 | 2,555,478 | 3,037,583 |
| 受入手数料 | 14,208 | 25,800 |
| 運用受託報酬 | 1,898,980 | 1,970,292 |
| 投資助言報酬 | 311,865 | 332,526 |
| 営業収益合計 | 4,780,534 | 5,366,202 |
| 営業費用 | | |
| 支払手数料 | 1,272,371 | 1,402,793 |
| 広告宣伝費 | 17,415 | 22,521 |
| 公告費 | 1,444 | 323 |
| 調査費 | 776,846 | 967,154 |
| 調査費 | 347,459 | 390,141 |
| 委託調査費 | 429,387 | 577,013 |
| 委託計算費 | 281,257 | 266,632 |
| 営業雑経費 | 101,333 | 96,076 |
| 通信費 | 18,324 | 19,416 |
| 印刷費 | 65,644 | 66,048 |
| 協会費 | 6,857 | 6,780 |
| 諸会費 | 2,662 | 3,346 |
| 営業雑費 | 7,844 | 484 |
| 営業費用合計 | 2,450,668 | 2,755,501 |
| 一般管理費 | | |
| 給料 | 1,406,694 | 1,532,277 |
| 役員報酬 | 63,577 | 70,098 |
| 給料・手当 | 1,140,380 | 1,219,741 |
| 賞与 | 202,737 | 242,437 |
| その他報酬 | 17,264 | 2,242 |
| 賞与引当金繰入 | 103,938 | 104,985 |
| 福利厚生費 | 228,532 | 246,627 |
| 交際費 | 1,641 | 1,974 |
| 寄付金 | 100 | 200 |
| 旅費交通費 | 27,287 | 32,460 |
| 租税公課 | 22,389 | 24,888 |
| 不動産賃借料 | 238,996 | 237,951 |
| 退職給付費用 | 54,668 | 53,431 |
| 固定資産減価償却費 | 79,928 | 85,762 |
| 諸経費 | 135,011 | 149,865 |
| 一般管理費合計 | 2,316,454 | 2,472,666 |
| 営業利益 | 13,410 | 138,034 |

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) |
|---------------------------|--|--|
| 営業外収益 | | |
| 受取利息 | 5,008 | 4,070 |
| 償還金等時効完成分 | 20,750 | 12 |
| 保険契約返戻金・配当金 | ¹ 2,265 | ¹ 2,275 |
| 貸倒引当金戻入額 | - | 15,785 |
| 雑益 | 467 | 3,513 |
| 営業外収益合計 | 28,491 | 25,657 |
| 営業外費用 | | |
| 為替差損 | - | 506 |
| 雑損 | 39 | - |
| 営業外費用合計 | 39 | 506 |
| 経常利益 | 41,862 | 163,185 |
| 特別利益 | - | - |
| 特別損失 | | |
| 固定資産除却損 | ² 13,467 | ² 611 |
| 合併関連費用 | ³ 465,874 | ³ 3,400 |
| 資産除去債務会計基準の適用に伴う 影響額 | 34,623 | - |
| 特別損失合計 | 513,965 | 4,011 |
| 税引前当期純利益又は 税引前当期純損失（ ） | 472,102 | 159,174 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 2,290 | 2,290 |
| 法人税等調整額 | 68,487 | 142,624 |
| 法人税等合計 | 66,197 | 144,914 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 405,904 | 14,260 |

(3) 【株主資本等変動計算書】

(単位：千円)

| | 前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) |
|-----------------|--|--|
| 株主資本 | | |
| 資本金 | | |
| 当期首残高 | 1,000,000 | 1,000,000 |
| 当期変動額 | - | - |
| 当期末残高 | 1,000,000 | 1,000,000 |
| 資本剰余金 | | |
| 資本準備金 | | |
| 当期首残高 | 660,443 | 660,443 |
| 当期変動額 | - | - |
| 当期末残高 | 660,443 | 660,443 |
| その他資本剰余金 | | |
| 当期首残高 | - | 2,854,339 |
| 当期変動額 | | |
| 合併による増加 | 2,854,339 | - |
| 当期変動額合計 | 2,854,339 | - |
| 当期末残高 | 2,854,339 | 2,854,339 |
| 資本剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 660,443 | 3,514,783 |
| 当期変動額 | | |
| 合併による増加 | 2,854,339 | - |
| 当期変動額合計 | 2,854,339 | - |
| 当期末残高 | 3,514,783 | 3,514,783 |
| 利益剰余金 | | |
| 利益準備金 | | |
| 当期首残高 | 83,040 | 83,040 |
| 当期変動額 | - | - |
| 当期末残高 | 83,040 | 83,040 |
| その他利益剰余金 | | |
| 別途積立金 | | |
| 当期首残高 | 3,092,001 | 3,092,001 |
| 当期変動額 | - | - |
| 当期末残高 | 3,092,001 | 3,092,001 |
| 繰越利益剰余金 | | |
| 当期首残高 | 1,448,381 | 1,036,176 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 6,300 | - |
| 当期純利益又は当期純損失() | 405,904 | 14,260 |
| 当期変動額合計 | 412,205 | 14,260 |
| 当期末残高 | 1,036,176 | 1,050,436 |
| 利益剰余金合計 | | |
| 当期首残高 | 4,623,423 | 4,211,217 |
| 当期変動額 | | |
| 剰余金の配当 | 6,300 | - |
| 当期純利益又は当期純損失() | 405,904 | 14,260 |
| 当期変動額合計 | 412,205 | 14,260 |
| 当期末残高 | 4,211,217 | 4,225,478 |
| 株主資本合計 | | |
| 当期首残高 | 6,283,866 | 8,726,001 |
| 当期変動額 | | |
| 合併による増加 | 2,854,339 | - |
| 剰余金の配当 | 6,300 | - |
| 当期純利益又は当期純損失() | 405,904 | 14,260 |
| 当期変動額合計 | 2,442,134 | 14,260 |
| 当期末残高 | 8,726,001 | 8,740,261 |

重要な会計方針

| |
|--|
| <p>1. 固定資産の減価償却方法</p> <p>(1) 有形固定資産 定額法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 3年～18年 器具備品 3年～20年</p> <p>(2) 無形固定資産 定額法 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。</p> |
| <p>2. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 貸倒引当金は、一般債権については貸倒実績率により、貸倒懸念債権等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。</p> <p>(2) 賞与引当金は、従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額を計上しております。</p> <p>(3) 退職給付引当金は、従業員に対する退職金の支払に備えるため、当事業年度末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当事業年度末において発生していると認められる額を、簡便法により計上しております。</p> |
| <p>3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜き方式によっております。</p> |

追加情報

当事業年度の期首以後に行われる会計上の変更及び過去の誤謬の訂正より、「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準」（企業会計基準第24号 平成21年12月4日）及び「会計上の変更及び誤謬の訂正に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第24号 平成21年12月4日）を適用しております。

注記事項

（貸借対照表関係）

1 各科目に含まれている関係会社に対するものは次のとおりであります。

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | 当事業年度 (平成24年3月31日) |
|----------|-----------------------|-----------------------|
| 未収運用受託報酬 | 9,887千円 | 8,944千円 |
| 未収投資助言報酬 | 181,486千円 | 164,758千円 |
| 長期差入保証金 | 190,313千円 | 190,313千円 |

2 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | 当事業年度 (平成24年3月31日) |
|------|-----------------------|-----------------------|
| 建物 | 118,809千円 | 133,261千円 |
| 器具備品 | 324,154千円 | 327,061千円 |

（損益計算書関係）

1 全て関係会社に対する金額であります。

2 前事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

固定資産除却損の内容は、器具備品1,075千円、ソフトウェア12,392千円であります。

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

固定資産除却損の内容は、主に器具備品611千円であります。

3 前事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

合併関連費用は、主に、会社合併に伴う資産運用システム統合に関する費用166,443千円、特別退職加算金等154,794千円、退職給付制度改定損75,717千円を計上しております。

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

合併関連費用は、会社合併に伴う資産運用システム統合に関する費用を計上しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|-------|---------|--------|----|---------|
| 普通株式 | 12,601株 | 6,286株 | - | 18,887株 |

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 | 1株当たり配当額 | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|------------|----------|------------|------------|
| 平成22年6月25日 定時株主総会 | 普通株式 | 6,300,500円 | 500円00銭 | 平成22年3月31日 | 平成22年6月25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

該当事項はありません。

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

1. 発行済株式に関する事項

| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当事業年度末 |
|-------|---------|----|----|---------|
| 普通株式 | 18,887株 | - | - | 18,887株 |

2. 自己株式に関する事項

該当事項はありません。

3. 新株予約権等に関する事項

該当事項はありません。

4. 配当に関する事項

（1）配当金支払額

該当事項はありません。

（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

| 決議 | 株式の種類 | 配当の原資 | 配当金の総額 | 1株当たり配当額 | 基準日 | 効力発生日 |
|----------------------|-------|-------|------------|----------|------------|------------|
| 平成24年6月27日 定時株主総会 | 普通株式 | 利益剰余金 | 5,099,490円 | 270円00銭 | 平成24年3月31日 | 平成24年6月27日 |

（リース取引関係）

重要性が乏しいため、財務諸表等規則第8条の6の規定により注記を省略しております。

（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

当社は、資金運用について財務内容の健全性を損なうことのないよう、主に安全性の高い金融資産で運用しております。

(2) 金融商品の内容及びそのリスク並びに金融商品にかかるリスク管理体制

営業債権である未収委託者報酬、未収運用受託報酬は、主に当社が運用指図を行う信託財産より支弁され、当社は当該信託財産の内容を把握しており、当該営業債権の回収にかかるリスクは僅少であります。また、営業債権である未収投資助言報酬は、顧客の信用リスクに晒されており、投資助言先ごとに期日管理及び残高管理を行うとともに、四半期ごとに回収可能性を把握する体制としております。

営業債務である未払手数料、並びにその他未払金は、1年以内の支払期日です。

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。

前事業年度（平成23年3月31日）

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|----------------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金 | 7,654,615 | 7,654,615 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 461,977 | 461,977 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 544,381 | 544,381 | - |
| (4) 未収投資助言報酬 | 195,353 | | |
| 貸倒引当金 ⁽¹⁾ | 8,785 | | |
| | 186,568 | 186,568 | - |
| (5) 長期差入保証金 | 190,699 | 183,759 | 6,939 |
| 資産計 | 9,038,241 | 9,031,302 | 6,939 |
| (1) 未払手数料 | 193,778 | 193,778 | - |
| (2) その他未払金 | 314,921 | 314,921 | - |
| 負債計 | 508,699 | 508,699 | - |

(1) 未収投資助言報酬に対応する個別貸倒引当金を控除しております。

当事業年度（平成24年3月31日）

| | 貸借対照表計上額 (千円) | 時価 (千円) | 差額 (千円) |
|--------------|------------------|------------|------------|
| (1) 現金・預金 | 7,798,082 | 7,798,082 | - |
| (2) 未収委託者報酬 | 406,697 | 406,697 | - |
| (3) 未収運用受託報酬 | 497,131 | 497,131 | - |
| (4) 未収投資助言報酬 | 170,156 | 170,156 | - |
| (5) 長期差入保証金 | 190,699 | 187,683 | 3,015 |
| 資産計 | 9,062,766 | 9,059,750 | 3,015 |
| (1) 未払手数料 | 163,484 | 163,484 | - |
| (2) その他未払金 | 168,652 | 168,652 | - |
| 負債計 | 332,137 | 332,137 | - |

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収運用受託報酬

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。

(4) 未収投資助言報酬

未収投資助言報酬のうち一般債権については、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。また、未収投資助言報酬のうち貸倒懸念債権については、財務内容評価法による回収見込額等に基づいて貸倒見積高を算定しているため、時価は決算日における貸借対照表価額から現在の貸倒見積高を控除した金額に近似しており、当該価額をもって時価としております。

(5) 長期差入保証金

長期差入保証金の時価の算定は、その将来キャッシュフローを、国債の利回り等適切な指標で割り引いた現在価値により算定しております。

負債

(1) 未払手数料、(2) その他未払金

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) 金銭債権の決算日後の償還予定額

前事業年度（平成23年3月31日）

| | 1年以内 (千円) | 1年超 5年以内 (千円) | 5年超 10年以内 (千円) | 10年超 (千円) |
|----------|--------------|---------------------|----------------------|--------------|
| 現金・預金 | 7,654,389 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 461,977 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 544,381 | - | - | - |
| 未収投資助言報酬 | 186,568 | - | - | - |
| 長期差入保証金 | - | - | 190,313 | - |
| 合計 | 8,847,316 | - | 190,313 | - |

当事業年度（平成24年3月31日）

| | 1年以内 (千円) | 1年超 5年以内 (千円) | 5年超 10年以内 (千円) | 10年超 (千円) |
|----------|--------------|---------------------|----------------------|--------------|
| 現金・預金 | 7,797,986 | - | - | - |
| 未収委託者報酬 | 406,697 | - | - | - |
| 未収運用受託報酬 | 497,131 | - | - | - |
| 未収投資助言報酬 | 170,156 | - | - | - |
| 長期差入保証金 | - | 190,313 | - | - |
| 合計 | 8,871,971 | 190,313 | - | - |

(有価証券関係)

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

当社はデリバティブ取引を全く利用しておりませんので該当事項はありません。

(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及び退職一時金制度を併用しております。なお、前事業年度においては、確定拠出型の制度として企業型確定拠出年金制度を設けておりましたが、当事業年度より確定給付型の制度に一本化しました。

2. 退職給付債務に関する事項

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | 当事業年度 (平成24年3月31日) |
|----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| (1) 退職給付債務 (千円) | 375,538 | 427,062 |
| (2) 年金資産 (千円) | 256,147 | 312,169 |
| (3) 未積立退職給付債務 (1)+(2) (千円) | 119,390 | 114,893 |
| (4) 退職給付引当金 (3) (千円) | 119,390 | 114,893 |

3. 退職給付費用に関する事項

| | 前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) | 当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) |
|------------------|--------------------------------------|--------------------------------------|
| 退職給付費用 (千円) (注1) | 54,668 | 53,431 |

(注1) 前事業年度の退職給付費用には、勤務費用のほか、確定拠出年金への掛金支払額1,346千円が含まれております。

(注2) 前事業年度においては、上記の退職給付費用以外に特別退職金150,044千円、退職給付制度改定損75,717千円を特別損失「合併関連費用」に含めて計上しております。なお、退職給付制度改定損は、当社の退職金規程を、合併に伴い改定したことにより発生したものであります。

(ストック・オプション等関係)

該当事項はありません。

（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内訳

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | | 当事業年度 (平成24年3月31日) | |
|----------------|-----------------------|----|-----------------------|----|
| 繰延税金資産 | | | | |
| 税務上の繰越欠損金 | 468,586 | 千円 | 448,266 | 千円 |
| 税務上の繰延資産償却超過額 | 69,633 | " | 52,268 | " |
| 退職給付引当金繰入限度超過額 | 48,580 | " | 42,472 | " |
| 賞与引当金繰入限度超過額 | 42,292 | " | 39,904 | " |
| その他 | 106,485 | " | 38,408 | " |
| 繰延税金資産小計 | 735,577 | " | 621,320 | " |
| 評価性引当額 | 586,024 | " | 616,061 | " |
| 繰延税金資産合計 | 149,552 | " | 5,259 | " |
| 繰延税金負債 | | | | |
| 資産除去費用 | 6,928 | " | 5,259 | " |
| 繰延税金負債合計 | 6,928 | " | 5,259 | " |
| 繰延税金資産の純額 | 142,624 | " | - | " |

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

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | 当事業年度 (平成24年3月31日) |
|--------------------|-----------------------|-----------------------|
| 法定実効税率 | - | 40.69 % |
| （調整） | | |
| 交際費等永久に損金に算入されない項目 | - | 0.50 " |
| 評価性引当額の増減 | - | 48.41 " |
| 住民税均等割 | - | 1.44 " |
| 税効果会計適用後の法人税等の負担率 | - | 91.04 % |

（注）前事業年度は、税引前当期純損失を計上しているため、注記を省略しております。

3. 法定実効税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

経済社会の構造の変化に対応した税制の構築を図るための所得税法等の一部を改正する法律及び東日本大震災からの復興のための施策を実施するために必要な財源の確保に関する特別措置法が平成23年12月2日に公布されたことに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算（ただし、平成24年4月1日以降解消されるものに限る）に使用した法定実効税率は、前事業年度の40.69%から、回収または支払が見込まれる期間が平成24年4月1日から平成27年3月31日までのものは38.01%、平成27年4月1日以降のものについては35.64%にそれぞれ変更されております。

なお、この変更による財務諸表への影響はありません。

（企業結合等関係）

該当事項はありません。

（資産除去債務関係）

資産除去債務のうち貸借対照表に計上しているもの

(1) 当該資産除去債務の概要

本社施設の不動産賃貸借契約に伴う原状回復義務であります。

(2) 当該資産除去債務の金額の算定方法

使用見込期間を主たる資産の耐用年数満了時（16年）としており、割引率は0.896%を適用しております。

(3) 当該資産除去債務の総額の増減

| | 前事業年度 (自平成22年4月1日 至平成23年3月31日) | | 当事業年度 (自平成23年4月1日 至平成24年3月31日) | |
|-----------------|--------------------------------------|----|--------------------------------------|----|
| 期首残高（注） | 54,489 | 千円 | 54,977 | 千円 |
| 有形固定資産の取得に伴う増加額 | - | " | - | " |
| 時の経過による調整額 | 488 | " | 492 | " |
| 期末残高 | 54,977 | 千円 | 55,470 | 千円 |

（注）前事業年度の「期首残高」は「資産除去債務に関する会計基準」（企業会計基準第18号 平成20年3月31日）及び「資産除去債務に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第21号 平成20年3月31日）を適用したことによる残高であります。

（持分法損益等）
該当事項はありません。

（賃貸等不動産関係）
該当事項はありません。

（セグメント情報等）

〔セグメント情報〕

当社の事業は、資産運用サービスの提供を行う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〕

前事業年度（自平成22年4月1日 至 平成23年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

| | 投資信託 （運用業務） | 投資信託 （販売業務） | 投資顧問 （投資一任） | 投資顧問 （投資助言） | 合計 |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------|
| 外部顧客への売上高 | 2,555,478 | 14,208 | 1,898,980 | 311,865 | 4,780,534 |

2. 地域ごとの情報

（1）売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

| 顧客の名称又は氏名 | 売上高 |
|-----------------|---------|
| 年金積立金管理運用独立行政法人 | 621,584 |

当事業年度（自平成23年4月1日 至 平成24年3月31日）

1. 製品及びサービスごとの情報

（単位：千円）

| | 投資信託 （運用業務） | 投資信託 （販売業務） | 投資顧問 （投資一任） | 投資顧問 （投資助言） | 合計 |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------|
| 外部顧客への売上高 | 3,037,583 | 25,800 | 1,970,292 | 332,526 | 5,366,202 |

2. 地域ごとの情報

（1）売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

（2）有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

（単位：千円）

| 顧客の名称又は氏名 | 売上高 |
|-----------------|---------|
| 年金積立金管理運用独立行政法人 | 613,920 |

[報告セグメントごとの固定資産の減損損失に関する情報]
該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれん償却額及び未償却残高に関する情報]
該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]
該当事項はありません。

(関連当事者情報)

1. 関連当事者との取引

親会社及び法人主要株主等

前事業年度（自平成22年4月1日至平成23年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 (百万円) | 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 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-----|--------------|---------|-------------------|-------|-----------------|------------------------------------|--------|--------------|----------|--------------|
| 親会社 | 明治安田生命保険相互会社 | 東京都千代田区 | 60,000 | 生命保険業 | (被所有) 直接 92.86% | 資産運用サービスの提供、当社投信商品の販売、設備の賃借及び役員の兼任 | 運用受託報酬 | 35,471 | 未収運用受託報酬 | 9,887 |
| | | | | | | | 投資助言報酬 | 306,784 | 未収投資助言報酬 | 181,486 |
| | | | | | | | 支払手数料 | 112,478 | 未払手数料 | 43,228 |
| | | | | | | | 事務所家賃 | 234,107 | 前払家賃 | 19,655 |
| | | | | | | | | | 長期差入保証金 | 190,313 |

当事業年度（自平成23年4月1日至平成24年3月31日）

| 種類 | 会社等の名称 | 所在地 | 資本金又は出資金 (百万円) | 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 (千円) | 科目 | 期末残高 (千円) |
|-----|--------------|---------|-------------------|-------|-----------------|------------------------------------|--------|--------------|----------|--------------|
| 親会社 | 明治安田生命保険相互会社 | 東京都千代田区 | 110,000 | 生命保険業 | (被所有) 直接 92.86% | 資産運用サービスの提供、当社投信商品の販売、設備の賃借及び役員の兼任 | 運用受託報酬 | 34,961 | 未収運用受託報酬 | 8,944 |
| | | | | | | | 投資助言報酬 | 321,882 | 未収投資助言報酬 | 164,758 |
| | | | | | | | 支払手数料 | 133,324 | 未払手数料 | 41,430 |
| | | | | | | | 事務所家賃 | 232,739 | 前払家賃 | 19,655 |
| | | | | | | | | | 長期差入保証金 | 190,313 |

取引条件ないし取引条件の決定方針等

運用受託報酬および投資助言報酬並びに支払手数料については、契約に基づき決定しております。

事務所家賃については、近隣の取引情勢に基づいて、契約により所定金額を決定しております。

(注1) 上記取引金額には消費税等は含まれておらず、期末残高には消費税等が含まれております。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する注記

親会社情報

明治安田生命保険相互会社（非上場）

(1株当たり情報)

| | 前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) |
|---------------------------|--|--|
| 1株当たり純資産額 | 462,010円97銭 | 462,766円00銭 |
| 1株当たり当期純利益金額または当期純損失金額() | 25,796円30銭 | 755円02銭 |

- (注) 1. 当事業年度の潜在株式調整後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。また、前事業年度の潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、1株当たり当期純損失金額であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。
2. 算定上の基礎は、以下のとおりであります。

1株当たり純資産額

| | 前事業年度 (平成23年3月31日) | 当事業年度 (平成24年3月31日) |
|-----------------------------|-----------------------|-----------------------|
| 貸借対照表の純資産の部の合計額(千円) | 8,726,001 | 8,740,261 |
| 普通株式に係る純資産額(千円) | 8,726,001 | 8,740,261 |
| 差額の主な内訳 | - | - |
| 普通株式の発行済株式数(株) | 18,887 | 18,887 |
| 普通株式の自己株式数(株) | - | - |
| 1株当たり純資産額の算定に用いられた普通株式の数(株) | 18,887 | 18,887 |

1株当たり当期純利益金額

| | 前事業年度 (自 平成22年4月1日 至 平成23年3月31日) | 当事業年度 (自 平成23年4月1日 至 平成24年3月31日) |
|----------------------------|--|--|
| 当期純利益又は当期純損失()(千円) | 405,904 | 14,260 |
| 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又は当期純損失()(千円) | 405,904 | 14,260 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 15,735 | 18,887 |

(重要な後発事象)

・ 本社移転について

当社は、平成24年4月27日開催の取締役会において、本社移転について決議し、平成24年5月23日付で新社屋にかかる賃貸借契約を締結しました。この移転により、平成25年3月期において、移転費用（引越費用、除却損等）として約199百万円を特別損失へ計上する予定であります。今後の家賃等の経費削減効果を見込んでおります。

・ 投資一任契約の解除について

平成24年6月26日に、主要な顧客より、投資一任契約について解除する旨の通知（解約日は別途通知）がありました。

1. 中間財務諸表の作成方法について

委託会社である明治安田アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」という。）の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条・第57条の規定により、「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）に基づいて作成しております。

2. 監査証明について

委託会社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の中間財務諸表について、有限責任 あずさ監査法人の中間監査を受けております。

中間財務諸表等
 中間財務諸表
 中間貸借対照表

(単位：千円)

| 当中間会計期間末 (平成24年9月30日) | |
|--------------------------|----------------------|
| 資産の部 | |
| 流動資産 | |
| 現金・預金 | 7,628,336 |
| 未収委託者報酬 | 390,720 |
| 未収運用受託報酬 | 579,086 |
| 未収投資助言報酬 | 192,856 |
| 短期差入保証金 | 190,313 |
| その他 | 135,493 |
| 流動資産合計 | 9,116,805 |
| 固定資産 | |
| 有形固定資産 | ¹ 243,087 |
| 無形固定資産 | 65,954 |
| 投資その他の資産 | 49,429 |
| 長期差入保証金 | 49,289 |
| その他 | 140 |
| 固定資産合計 | 358,472 |
| 資産合計 | 9,475,278 |
| 負債の部 | |
| 流動負債 | |
| 未払償還金 | 7,315 |
| 未払手数料 | 153,403 |
| 未払法人税等 | 8,916 |
| 賞与引当金 | 92,725 |
| 資産除去債務 | 55,718 |
| その他 | ² 355,970 |
| 流動負債合計 | 674,051 |
| 固定負債 | |
| 退職給付引当金 | 121,194 |
| 固定負債合計 | 121,194 |
| 負債合計 | 795,245 |
| 純資産の部 | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | 1,000,000 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | 660,443 |
| その他資本剰余金 | 2,854,339 |
| 資本剰余金合計 | 3,514,783 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | 83,040 |
| その他利益剰余金 | |
| 別途積立金 | 3,092,001 |
| 繰越利益剰余金 | 990,207 |
| 利益剰余金合計 | 4,165,248 |
| 株主資本合計 | 8,680,032 |
| 純資産合計 | 8,680,032 |
| 負債純資産合計 | 9,475,278 |

中間損益計算書

(単位：千円)

| | 当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日) |
|--------------|--|
| 営業収益 | |
| 委託者報酬 | 1,376,936 |
| 受入手数料 | 11,985 |
| 運用受託報酬 | 907,372 |
| 投資助言報酬 | 183,923 |
| 営業収益合計 | 2,480,217 |
| 営業費用 | |
| 支払手数料 | 614,627 |
| その他営業費用 | 686,967 |
| 営業費用合計 | 1,301,594 |
| 一般管理費 | ¹ 1,189,325 |
| 営業損失() | 10,702 |
| 営業外収益 | ² 3,668 |
| 営業外費用 | - |
| 経常損失() | 7,033 |
| 特別利益 | - |
| 特別損失 | ³ 46,951 |
| 税引前中間純損失() | 53,984 |
| 法人税、住民税及び事業税 | 1,145 |
| 法人税等調整額 | - |
| 法人税等合計 | 1,145 |
| 中間純損失() | 55,129 |

中間株主資本等変動計算書

(単位：千円)

| 当中間会計期間 | |
|-----------------|-----------|
| (自 平成24年4月1日 | |
| 至 平成24年9月30日) | |
| 株主資本 | |
| 資本金 | |
| 当期首残高 | 1,000,000 |
| 当中間期変動額 | - |
| 当中間期末残高 | 1,000,000 |
| 資本剰余金 | |
| 資本準備金 | |
| 当期首残高 | 660,443 |
| 当中間期変動額 | - |
| 当中間期末残高 | 660,443 |
| その他資本剰余金 | |
| 当期首残高 | 2,854,339 |
| 当中間期変動額 | - |
| 当中間期末残高 | 2,854,339 |
| 資本剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 3,514,783 |
| 当中間期変動額 | - |
| 当中間期末残高 | 3,514,783 |
| 利益剰余金 | |
| 利益準備金 | |
| 当期首残高 | 83,040 |
| 当中間期変動額 | - |
| 当中間期末残高 | 83,040 |
| その他利益剰余金 | |
| 別途積立金 | |
| 当期首残高 | 3,092,001 |
| 当中間期変動額 | - |
| 当中間期末残高 | 3,092,001 |
| 繰越利益剰余金 | |
| 当期首残高 | 1,050,436 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 5,099 |
| 中間純損失() | 55,129 |
| 当中間期変動額合計 | 60,229 |
| 当中間期末残高 | 990,207 |
| 利益剰余金合計 | |
| 当期首残高 | 4,225,478 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 5,099 |
| 中間純損失() | 55,129 |
| 当中間期変動額合計 | 60,229 |
| 当中間期末残高 | 4,165,248 |
| 株主資本合計 | |
| 当期首残高 | 8,740,261 |
| 当中間期変動額 | |
| 剰余金の配当 | 5,099 |
| 中間純損失() | 55,129 |
| 当中間期変動額合計 | 60,229 |
| 当中間期末残高 | 8,680,032 |

重要な会計方針

| 当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日) |
|---|
| <p>1. 固定資産の減価償却方法</p> <p>(1)有形固定資産 定額法 なお、主な耐用年数は次のとおりであります。 建物 3年～18年 器具備品 3年～20年</p> <p>(2)無形固定資産 定額法 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。</p> <p>2. 引当金の計上基準</p> <p>(1)賞与引当金は、従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額を計上しております。 (2)退職給付引当金は、従業員に対する退職金の支払に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務及び年金資産の見込額に基づき、当中間会計期間末において発生していると認められる額を、簡便法により計上しております。</p> <p>3. その他中間財務諸表作成のための基本となる重要な事項</p> <p>消費税等の会計処理方法 消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっております。</p> |

会計方針の変更

該当事項はありません。

追加情報

(本社移転について)

当社は、平成24年4月27日開催の取締役会において、本社移転について決議し、平成24年5月23日付で新社屋にかかる賃貸借契約を締結しました。この移転により、平成25年3月期において、移転費用（引越費用、除却損等）として232百万円を特別損失へ計上する予定であります。今後の家賃等の経費削減効果を見込んでおります。

注記事項

(中間貸借対照表関係)

| 当中間会計期間末 (平成24年9月30日) | |
|--|-----------|
| 1 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。 | |
| 建物 | 140,487千円 |
| 器具備品 | 329,678千円 |
| 2 仮払消費税等及び仮受消費税等は、相殺のうえ、金額的重要性が乏しいため、流動負債の「その他」に含めて表示しております。 | |

(中間損益計算書関係)

| 当中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日) | |
|--|----------|
| 1 当中間会計期間末の減価償却実施額は次のとおりであります。 | |
| 有形固定資産 | 33,840千円 |
| 無形固定資産 | 4,966千円 |
| 2 営業外収益のうち主なもの | |
| 受取利息 | 1,901千円 |
| 保険契約返戻金・配当金 | 1,192千円 |
| 3 特別損失のうち主なもの | |
| 特別退職金 | 46,603千円 |

(中間株主資本等変動計算書関係)

| 当中間会計期間 (自平成24年4月1日 至平成24年9月30日) | | | | | |
|--|---------|------------|----------|------------|------------|
| 1. 発行済株式に関する事項 | | | | | |
| 株式の種類 | 当事業年度期首 | 増加 | 減少 | 当中間会計期間末 | |
| 普通株式 | 18,887株 | - | - | 18,887株 | |
| 2. 自己株式に関する事項 該当事項はありません。 | | | | | |
| 3. 新株予約権等に関する事項 該当事項はありません。 | | | | | |
| 4. 配当に関する事項 | | | | | |
| (1) 配当金支払額 | | | | | |
| 決議 | 株式の種類 | 配当金の総額 | 1株当たり配当額 | 基準日 | 効力発生日 |
| 平成24年6月27日 定時株主総会 | 普通株式 | 5,099,490円 | 270円00銭 | 平成24年3月31日 | 平成24年6月27日 |
| (2) 基準日が当中間会計期間に属する配当のうち、配当の効力発生日が当中間会計期間後となるもの 該当事項はありません。 | | | | | |

(リース取引関係)

当中間会計期間（自平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

重要性が乏しいため、注記を省略しております。

(金融商品関係)

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

金融商品の時価等に関する事項

平成24年9月30日における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

| | 中間貸借対照表計上額 | 時価 | 差額 |
|-------------|------------|-----------|----|
| (1)現金・預金 | 7,628,336 | 7,628,336 | - |
| (2)未収委託者報酬 | 390,720 | 390,720 | - |
| (3)未収運用受託報酬 | 579,086 | 579,086 | - |
| (4)未収投資助言報酬 | 192,856 | 192,856 | - |
| (5)短期差入保証金 | 190,313 | 190,313 | - |
| 資産計 | 8,981,312 | 8,981,312 | - |
| (1)未払手数料 | 153,403 | 153,403 | - |
| 負債計 | 153,403 | 153,403 | - |

(注1) 金融商品の時価の算定方法

資産

(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収運用受託報酬、(4)未収投資助言報酬、(5)短期差入保証金

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。

負債

(1)未払手数料

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。

(有価証券関係)

当中間会計期間末（平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(デリバティブ取引関係)

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(ストック・オプション等関係)

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(企業結合等関係)

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(持分法損益等)

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(資産除去債務関係)

当中間会計期間末（平成24年9月30日）

資産除去債務のうち中間貸借対照表に計上しているもの

当中間会計期間における当該資産除去債務の総額の増減は次のとおりであります。

| | |
|-----------------|-----------------|
| 期首残高 | 55,470千円 |
| 有形固定資産の取得に伴う増加額 | - |
| 時の経過による調整額 | 248千円 |
| 当中間会計期間末残高 | <u>55,718千円</u> |

(賃貸等不動産関係)

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

当社の事業は、資産運用サービスの提供を行う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]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

1. 製品及びサービスごとの情報

(単位：千円)

| | 投資信託 (運用業務) | 投資信託 (販売業務) | 投資顧問 (投資一任) | 投資顧問 (投資助言) | 合計 |
|-----------|----------------|----------------|----------------|----------------|-----------|
| 外部顧客への売上高 | 1,376,936 | 11,985 | 907,372 | 183,923 | 2,480,217 |

2. 地域ごとの情報

(1) 売上高

本邦の外部顧客への売上高に区分した金額が中間損益計算書の売上高の90%を超えるため、地域ごとの売上高の記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

本邦に所在している有形固定資産の金額が中間貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、地域ごとの有形固定資産の記載を省略しております。

3. 主要な顧客ごとの情報

(単位：千円)

| 顧客の名称又は氏名 | 売上高 |
|-----------------|---------|
| 年金積立金管理運用独立行政法人 | 276,652 |

[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]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとののれん償却額及び未償却残高に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

[報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

該当事項はありません。

(1株当たり情報)

| | 当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日) |
|--------------|--|
| 1株当たり純資産額 | 459,577円08銭 |
| 1株当たり中間純損失金額 | 2,918円92銭 |

(注) 1. 潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、1株当たり中間純損失であり、また、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 1株当たり中間純損失金額の算定上の基礎は、以下のとおりであります。

| | 当中間会計期間 (自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日) |
|--------------------|--|
| 中間純損失金額(千円) | 55,129 |
| 普通株主に帰属しない金額(千円) | - |
| 普通株式に係る中間純損失金額(千円) | 55,129 |
| 普通株式の期中平均株式数(株) | 18,887 |

(重要な後発事象)

当中間会計期間（自 平成24年4月1日 至 平成24年9月30日）

(希望退職制度の実施)

当社は、平成24年10月18日開催の取締役会において、希望退職制度の実施を決議いたしました。その概要は以下のとおりであります。

(1)実施理由

当社は、会社収支改善の一環として固定費の一層の削減を推進するため、希望退職制度を実施することとしました。

(2)制度概要

対象者 全社員

募集人員 17名

募集期間 平成24年11月19日から12月7日の間

退職日 原則として平成25年3月31日

優遇措置 通常の会社都合退職金に加え、特別退職金を支給するとともに、希望者に対しては再就職支援会社を通じた再就職支援を行います。

(3)損失見込額

募集期間中であるため、中間財務諸表作成時点において当該募集による損失を合理的に見積ることは困難であります。平成25年3月期において特別退職金等を特別損失として計上する予定です。

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。

- (1)自己又はその取締役若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、若しくは取引の公正を害し、又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。)
- (2)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、若しくは取引の公正を害し、又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。)
- (3)通常の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(4)(5)において同じ。）又は子法人等（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又は店頭デリバティブ取引を行うこと。
- (4)委託会社の親法人等又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、運用財産の額若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。
- (5)上記(3)(4)に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又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、若しくは取引の公正を害し、又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】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要となります。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

(平成24年3月31日現在)

| (A)名称 | (B)資本金の額(百万円) | (C)事業の内容 |
|---------------|---------------|--|
| 三菱UFJ信託銀行株式会社 | 324,279 | 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。 |

(2)販売会社

(平成24年3月31日現在)

| (A)名称 | (B)資本金の額(百万円) | (C)事業の内容 |
|-------------|---------------|-----------------------------------|
| 株式会社但馬銀行 | 5,481 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 全国信用協同組合連合会 | 53,855 | 協同組合による金融事業に関する法律に基づき金融事業を営んでいます。 |

全国信用協同組合連合会の資本金の額は「出資金」の総額です。

2【関係業務の概要】

(1)受託会社

受託銀行として、ファンドの信託財産の保管・管理・計算、外国証券を保管・管理する外国の保管銀行への指図・連絡、その他付随する業務等を行います。なお、受託会社は、信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。

(2)販売会社

ファンドの販売会社として、募集・販売の取扱い、受益者に対する運用報告書の交付、信託契約の一部解約に関する事務、収益分配金の再投資に関する事務、一部解約金・収益分配金・償還金の支払いに関する事務等を行います。

3【資本関係】

(1)受託会社

該当事項はありません。

(2)販売会社

該当事項はありません。

〔参考情報：再信託受託会社の概要〕

1. 名称、資本金の額及び事業の内容

- (A) 名称 : 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- (B) 資本金の額 : 平成24年3月31日現在、10,000百万円
- (C) 事業の内容 : 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

2. 関係業務の概要

受託会社との信託契約(再信託契約)に基づき、当ファンドの信託事務の一部(信託財産の管理)を委託され、その事務を行うことがあります。

3. 資本関係

該当ありません。

第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙に委託会社のロゴ・マーク、図案、キャッチ・コピー等を採用し、ファンドの形態等の記載をすることがあります。
- (2) 交付目論見書表紙に、その使用開始日及び委託会社等の情報として、金融商品取引業者登録番号、設立年月日、委託会社の投資信託財産の合計純資産総額を掲載します。
- (3) 届出書本文第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主要内容を要約し、「1．ファンドの目的・特色」、「2．投資リスク」、「4．手続・手数料等」として、交付目論見書に記載します。
- (4) 交付目論見書に商品分類および属性区分の一覧表を掲載します。
- (5) 請求目論見書に約款を掲載し、届出書本文第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の詳細な内容については、当該約款を参照する旨を記載することで、届出書の内容の記載とすることがあります。
- (6) 届出書本文第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の記載内容については、投資家の理解を助けるため、当該内容を説明した図表等を付加して、交付目論見書の当該内容に関連する箇所に記載することがあります。
- (7) 目論見書は電子媒体等として使用されるほかインターネットなどに掲載される場合があります。
- (8) 目論見書の別称として、次を用いることがあります。
 - 「投資信託説明書（目論見書）」
 - 「投資信託説明書（交付目論見書）」
 - 「投資信託説明書（請求目論見書）」
- (9) 交付目論見書に金融商品取引法第37条の3の規定に基づく契約締結前書面に関する事項を記載することがあります。

独立監査人の監査報告書

平成24年10月31日

明治安田アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 壁谷 恵嗣
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 辻前 正紀
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている明治安田資産形成サポートファンド（隔月決算型）の平成24年3月13日から平成24年9月12日までの特定期間の財務諸表、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、明治安田資産形成サポートファンド（隔月決算型）の平成24年9月12日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する特定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

明治安田アセットマネジメント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)1. 上記は、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、その原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

平成24年6月27日

明治安田アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 壁谷 恵嗣指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 辻前 正紀

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、「委託会社等の経営状況」に掲げられている明治安田アセットマネジメント株式会社の平成23年4月1日から平成24年3月31日までの第26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、明治安田アセットマネジメント株式会社の平成24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。

強調事項

- 重要な後発事象の「本社移転について」に記載されているとおり、会社は平成24年4月27日開催の取締役会において、本社移転について決議し、平成24年5月23日付で新社屋にかかる賃貸借契約を締結した。
 - 重要な後発事象の「投資一任契約の解除について」に記載されているとおり、会社は平成24年6月26日に、主要な顧客より、投資一任契約について解除する旨の通知（解約日は別途通知）を受領した。
- 当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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) 1. 上記は、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、その原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。

2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成24年11月21日

明治安田アセットマネジメント株式会社
取締役会 御中

有限責任 あずさ監査法人

指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 壁谷 恵嗣指定有限責任社員
業務執行社員 公認会計士 辻前 正紀

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」に掲げられている明治安田アセットマネジメント株式会社の平成24年4月1日から平成25年3月31日までの第27期事業年度の中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、明治安田アセットマネジメント株式会社の平成24年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（平成24年4月1日から平成24年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

強調事項

1. 重要な後発事象の「希望退職制度の実施」に記載されているとおり、会社は平成24年10月18日開催の取締役会において、希望退職制度の実施を決議した。
 2. 追加情報の「本社移転について」に記載されているとおり、会社は平成24年4月27日開催の取締役会において、本社移転について決議し、平成24年5月23日付で新社屋に係る賃貸借契約を締結した。
- 当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

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) 1. 上記は、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、その原本は当社（有価証券報告書提出会社）が別途保管しております。
2. 財務諸表の範囲にはXBRLデータ自体は含まれておりません。

[前へ](#)

