

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長 殿

【提出日】 平成28年12月22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 石川 昌秀

【本店の所在の場所】 東京都港区虎ノ門三丁目4番7号

【事務連絡者氏名】 植村 吉二

連絡場所 東京都港区虎ノ門三丁目4番7号

【電話番号】 03-6731-4721

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 明治安田DC先進国コアファンド

【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】 当初自己設定（平成28年3月25日）
100万円
継続申込期間（平成28年3月25日から平成29年5月19日まで）
上限 1,000億円

【縦覧に供する場所】 該当事項はありません。

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成28年3月9日付をもって提出した有価証券届出書(以下「原届出書」といいます。)について、平成28年12月22日に半期報告書を提出したことに伴う関係情報の更新等を行うため、本訂正届出書により訂正を行うものです。

2【訂正の内容】

原届出書の該当情報を以下のとおり訂正または更新します。_____の部分は訂正部分を示します。

第一部【証券情報】

(3)【発行(売出)価額の総額】

<訂正前>

_____当初自己設定：100万円とします。

_____継続申込期間：1,000億円を上限とします。

<訂正後>

_____継続申込期間：1,000億円を上限とします。

(4)【発行(売出)価格】

<訂正前>

_____当初自己設定：1口当たり1円とします。

_____継続申込期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

<訂正後>

_____継続申込期間：取得申込受付日の翌営業日の基準価額とします。

(7)【申込期間】

<訂正前>

_____当初自己設定：平成28年3月25日

_____継続申込期間：平成28年3月25日から平成29年5月19日まで

<訂正後>

_____継続申込期間：平成28年3月25日から平成29年5月19日まで

(9)【払込期日】

<訂正前>

_____当初自己設定

_____委託会社は、設定日(平成28年3月25日)に当初自己設定にかかる発行価額の総額を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みます。

_____継続申込期間

_____取得申込者は、申込代金(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)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)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。

<訂正後>

_____継続申込期間

_____取得申込者は、申込代金(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)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)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。

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】

(2)【ファンドの沿革】

<訂正前>

平成28年3月25日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始（予定）

<訂正後>

平成28年3月25日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

(3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

<訂正前>

損益は全て投資者である受益者に帰属します。

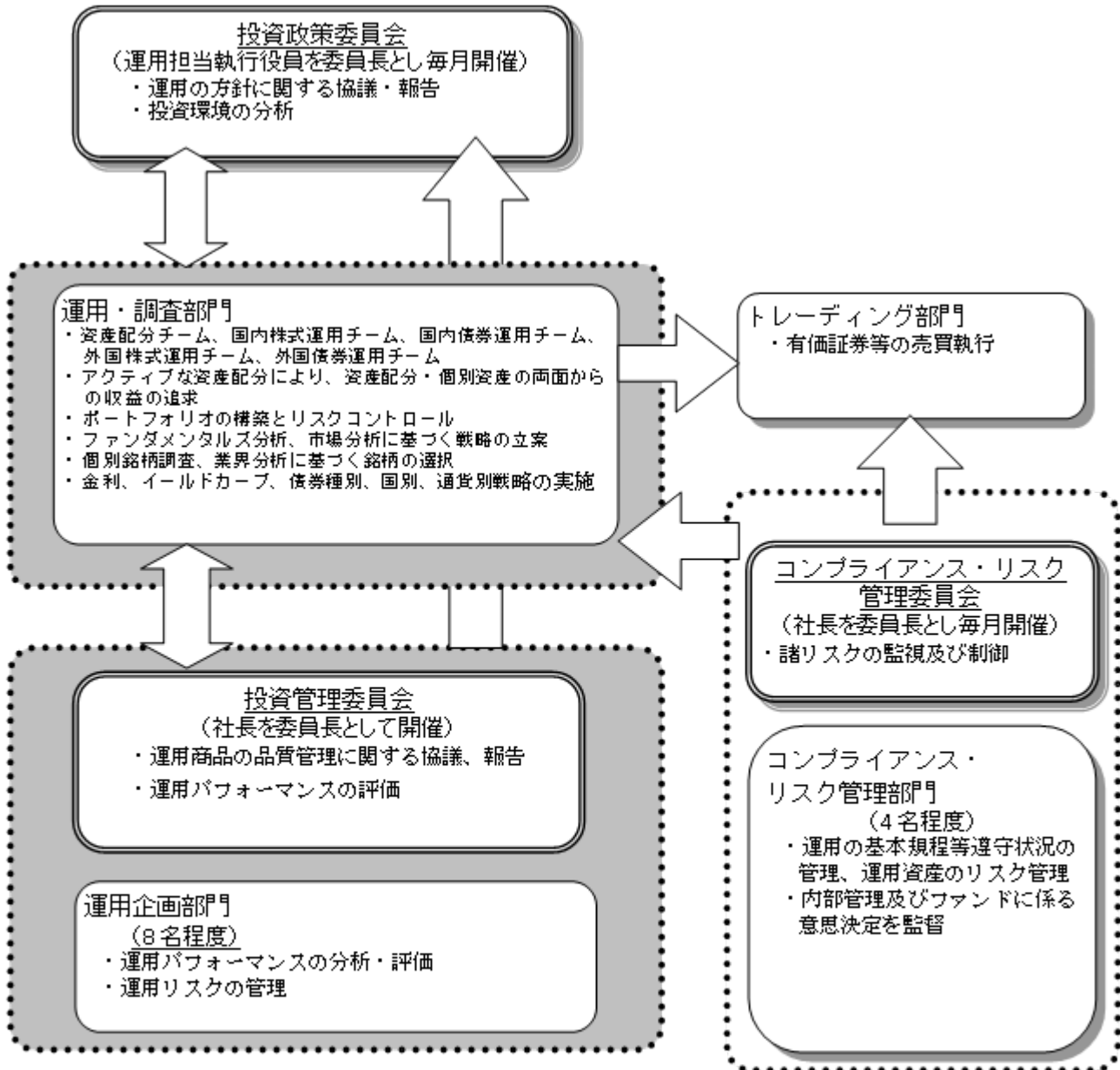
<訂正後>

損益はすべて投資者である受益者に帰属します。

2【投資方針】

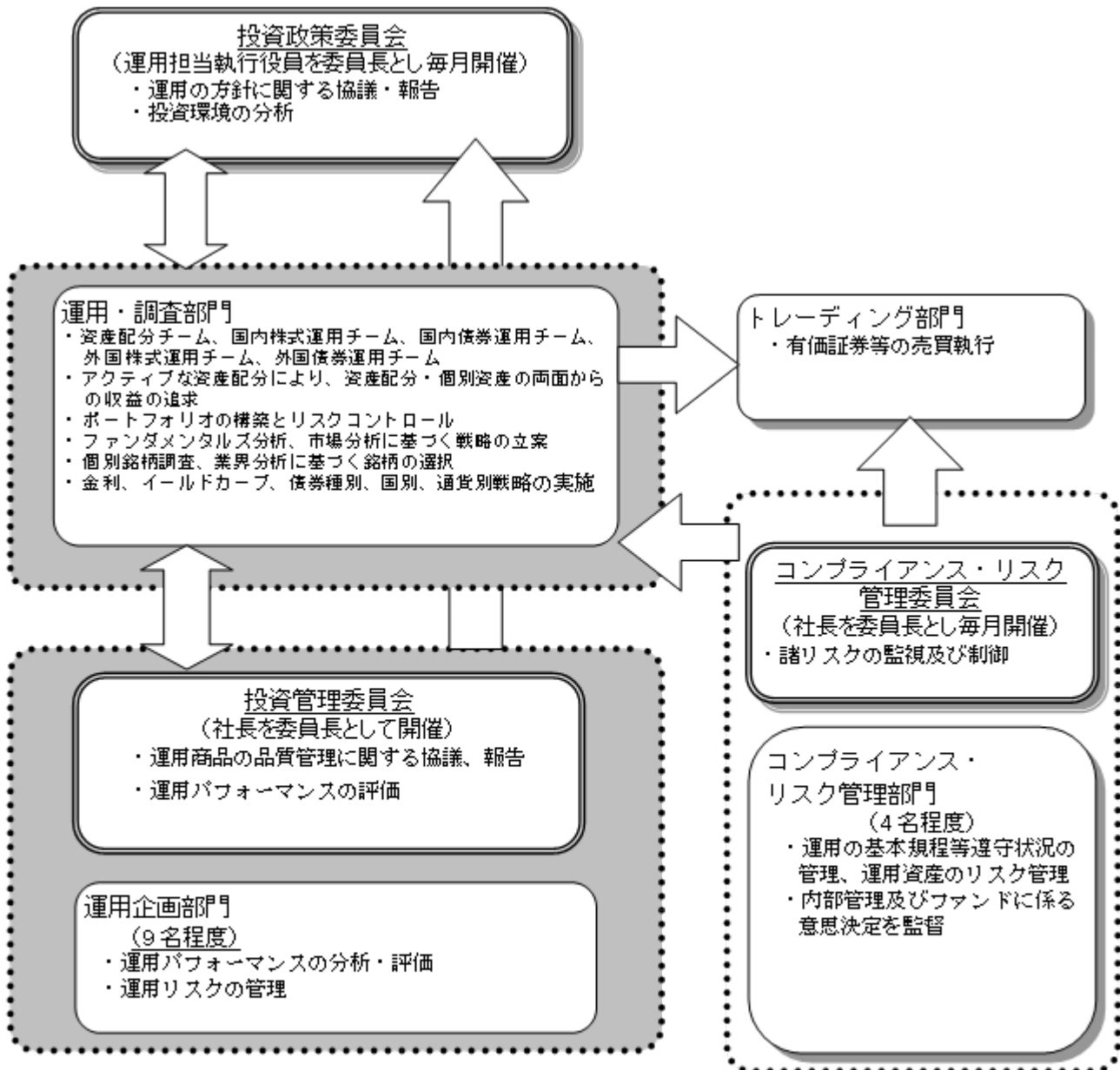
(3)【運用体制】

<訂正前>



- 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。

< 訂正後 >



● 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。

3【投資リスク】

(1) ファンドのリスクと留意点

<訂正前>

明治安田DC先進国コアファンドは、直接あるいはマザーファンドを通じて、株式および債券等、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、金融機関の預貯金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、全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は、以下の通りです。

<訂正後>

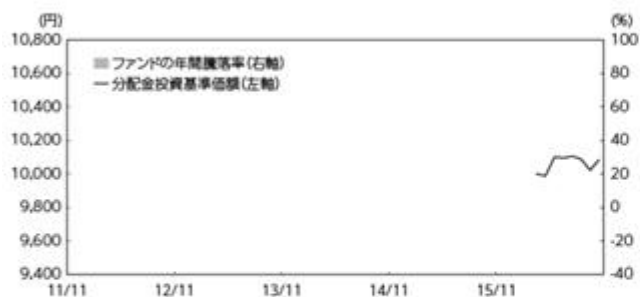
明治安田DC先進国コアファンドは、直接あるいはマザーファンドを通じて、株式および債券等、値動きのある証券に投資します（外貨建資産には為替変動リスクもあります。）ので、基準価額は変動します。

したがって、金融機関の預貯金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は、以下の通りです。

(3) 参考情報
 <更新・訂正後>

当ファンドの年間騰落率および
 分配金再投資基準価額の推移



※グラフは、ファンドの5年間の各月末における分配金再投資基準価額（税引前の分配金を再投資したものとして算出。以下同じ。）および各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

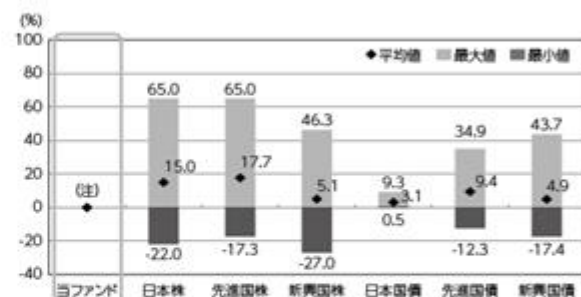
※分配金再投資基準価額は5年前の基準価額を起点として計算したものです。

※年間騰落率のデータは、各月末の分配金再投資基準価額をもとに計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

(注) 当ファンドは、設定日から1年を経過していないため、設定日以降のデータで表示しています。年間騰落率データはありません。

当ファンドと他の代表的な
 資産クラスとの騰落率の比較

対象期間：2011年11月～2016年10月



※グラフは、ファンドと他の代表的な資産クラスを定量的に比較できるように、5年間の各月末における直近1年間の騰落率データ（60個）を用いて、平均、最大、最小を表示したものです。

※ファンドの年間騰落率のデータは、各月末の分配金再投資基準価額（税引前の分配金を再投資したものとして算出）をもとに計算しており、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※全ての資産クラスが、当ファンドの投資対象とは限りません。

(注) 当ファンドは、設定日から1年を経過していないため、年間騰落率データがありません。

<各資産クラスの指数について>

資産クラス	指数名称	権利者
日本株	東証株価指数 (TOPIX) (配当込み)	株式会社東京証券取引所
先進国株	MSCI-KOKUSAI (配当込み・円換算ベース)	MSCI Inc.
新興国株	MSCI エマージング・マーケット・インデックス (配当込み・円換算ベース)	MSCI Inc.
日本国債	NOMURA-BPI (国債)	野村證券株式会社
先進国債	シティ世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース)	Citigroup Index LLC
新興国債	JP モルガン GBI-EM グローバル・ダイバーシファイド (円ベース)	J. P. Morgan Securities LLC

(注) 海外指数は、対円での為替ヘッジなしによる投資を想定して、各月末の指数値を円換算または円ベースにて表示。

※各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、上記に記載の各権利者に帰属します。

また、各権利者は当ファンドの運用成果等に関し一切責任を負いません。

各指数の内容について、詳しくは投資信託説明書（請求目論見書）をご覧ください。

< 代表的資産クラスの指数について >

< 訂正前 >

東証株価指数（TOPIX）とは、東京証券取引所 市場第一部（以下、東証市場第一部ということがあります。）の時価総額の動きをあらわす株価指数であり、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。）が算出、公表を行っています。東証市場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。

東証株価指数（TOPIX）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に関する全ての権利およびTOPIXの商標に関する全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または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の商標の使用若しくはTOPIXの指数の利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。

MSCI-KOKUSAIはMSCI Inc. が算出する日本を除く世界主要国の株式市場を捉える指数として広く認知されているものであり、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。MSCI Inc. 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。

MSCI エマージング・マーケット・インデックスはMSCI Inc. が算出する新興国の株価の動きを表す代表的な指数であり、MSCI エマージング・マーケット・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MSCI Inc. に帰属します。MSCI Inc. 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。

NOMURA - BPI（国債）は、日本国債の市場全体の動向を表す、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。

シティ世界国債インデックスは世界主要国の国債の総合投資収益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。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定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。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド）はJ.P.Morgan Securities LLC(JPモルガン)が公表している、エマージング諸国の国債を中心とした債券市場の合成パフォーマンスを表す指数として広く認知されているものであり、JPモルガンの知的財産です。JPモルガン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。

<訂正後>

東証株価指数（TOPIX）は、東京証券取引所 市場第一部（以下、東証市場第一部ということがあります。）の時価総額の動きをあらゆる株価指数であり、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。）が算出、公表を行っています。東証市場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。

東証株価指数（TOPIX）は東京証券取引所の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用などTOPIXに関する全ての権利およびTOPIXの商標に関する全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または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の商標の使用若しくはTOPIXの指数の利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。

MSCI-KOKUSAIは、MSCI Inc.が算出する日本を除く世界主要国の株式市場を捉える指数として広く認知されているものであり、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。MSCI Inc.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。

MSCI エマージング・マーケット・インデックスは、MSCI Inc.が算出する新興国の株価の動きを表す代表的な指数であり、MSCI エマージング・マーケット・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MSCI Inc.に帰属します。MSCI Inc.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。

NOMURA - BPI（国債）は、日本国債の市場全体の動向を表す、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。

シティ世界国債インデックスは、世界主要国の国債の総合投資収益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。同指数は、Citigroup Index LLCの知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用など同指数に関するすべての権利は、Citigroup Index LLCが有しています。なお、Citigroup Index LLCは、ファンドの設定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。

JPモルガンGBI-EMグローバル・ダイバーシファイド（JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ダイバーシファイド）は、J.P.Morgan Securities LLC(JPモルガン)が公表している、エマージング諸国の国債を中心とした債券市場の合成パフォーマンスを表す指数として広く認知されているものであり、JPモルガンの知的財産です。JPモルガン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。

5【運用状況】

原届出書の「第二部ファンド情報 第1ファンドの状況 5運用状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されま
す。

<更新・訂正後>

以下は平成28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。

マザーファンドの運用状況は、当ファンドの後に記載されます。

(1)【投資状況】

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	5,471,621	83.20
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,105,121	16.80
合計(純資産総額)		6,576,742	100.00

(2)【投資資産】**【投資有価証券の主要銘柄】**

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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	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	1,417,733	1.4119	2,001,718	1.4120	2,001,838	30.44
2	日本	親投資信託 受益証券	明治安田外国債券マザーファンド (為替ヘッジ型)	1,512,599	1.0096	1,527,245	1.0036	1,518,044	23.08
3	日本	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	553,040	1.6881	933,623	1.6983	939,227	14.28
4	日本	親投資信託 受益証券	明治安田日本株式アルファ・ マザーファンド	393,293	1.6640	654,468	1.7159	674,851	10.26
5	日本	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	164,296	2.0653	339,327	2.0552	337,661	5.13

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	83.20
合計	83.20

【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）
平成28年 3月末日	1,000,138		10,001	
4月末日	998,821		9,988	
5月末日	1,010,110		10,101	
6月末日	1,009,526		10,095	
7月末日	1,010,598		10,106	
8月末日	1,008,803		10,088	
9月末日	1,002,196		10,022	
10月末日	6,576,742		10,085	

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（％）
第1期中間計算期間	平成28年 3月25日～平成28年 9月24日	0.43

(注)各計算期間の収益率は、計算期間末の基準価額（分配落ち）に当該計算期間の分配金を加算し、当該計算期間の直前の計算期間末の基準価額（分配落ち。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。

（４）【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期中間計算期間	平成28年 3月25日～平成28年 9月24日	1,000,000	

(注)第1期中間計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

(参考)

・明治安田日本株式アルファ・マザーファンド

(1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	12,496,002,640	98.63
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		173,798,916	1.37
合計(純資産総額)		12,669,801,556	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	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	52,100	6,474.95	337,344,895	6,079.00	316,715,900	2.50
2	日本	株式	三菱UFJ フィナンシャル・グループ	銀行業	571,200	619.19	353,685,235	544.60	311,075,520	2.46
3	日本	株式	日本電信電話	情報・ 通信業	62,300	4,734.58	294,964,447	4,660.00	290,318,000	2.29
4	日本	株式	三井住友 フィナンシャルグループ	銀行業	71,400	3,875.56	276,714,984	3,653.00	260,824,200	2.06
5	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・ 通信業	38,400	6,194.76	237,879,082	6,602.00	253,516,800	2.00
6	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	79,700	3,089.07	246,199,056	3,144.00	250,576,800	1.98
7	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	40,400	5,319.17	214,894,468	4,700.00	189,880,000	1.50
8	日本	株式	日産自動車	輸送用機器	167,100	1,075.05	179,640,855	1,068.50	178,546,350	1.41
9	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	41,800	4,248.93	177,605,647	3,994.00	166,949,200	1.32
10	日本	株式	三菱電機	電気機器	111,400	1,268.56	141,317,584	1,422.50	158,466,500	1.25
11	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	8,800	19,719.49	173,531,512	17,865.00	157,212,000	1.24
12	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	16,300	10,276.12	167,500,756	9,257.00	150,889,100	1.19
13	日本	株式	花王	化学	27,700	5,786.16	160,276,731	5,405.00	149,718,500	1.18
14	日本	株式	N T T ドコモ	情報・ 通信業	53,800	2,524.47	135,816,486	2,640.50	142,058,900	1.12
15	日本	株式	ファナック	電気機器	6,900	17,932.47	123,734,043	19,680.00	135,792,000	1.07
16	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	86,500	1,646.35	142,409,275	1,559.50	134,896,750	1.06
17	日本	株式	第一生命ホールディングス	保険業	82,800	1,510.68	125,084,304	1,541.00	127,594,800	1.01
18	日本	株式	日立製作所	電気機器	227,000	528.42	119,951,340	559.20	126,938,400	1.00
19	日本	株式	パナソニック	電気機器	113,200	1,064.83	120,538,756	1,097.00	124,180,400	0.98
20	日本	株式	T D K	電気機器	16,900	6,805.44	115,011,936	7,260.00	122,694,000	0.97
21	日本	株式	大塚ホールディングス	医薬品	26,500	4,375.10	115,940,150	4,597.00	121,820,500	0.96
22	日本	株式	キヤノン	電気機器	39,600	3,319.74	131,461,704	3,017.00	119,473,200	0.94
23	日本	株式	小松製作所	機械	49,900	2,082.89	103,936,544	2,343.00	116,915,700	0.92
24	日本	株式	K D D I	情報・ 通信業	35,000	3,075.07	107,627,450	3,192.00	111,720,000	0.88
25	日本	株式	みずほ フィナンシャルグループ	銀行業	616,900	212.51	131,099,816	177.10	109,252,990	0.86
26	日本	株式	M S & A D インシュアラン ス グループホールディングス	保険業	33,500	2,804.00	93,934,000	3,122.00	104,587,000	0.83

27	日本	株式	ダイキン工業	機械	10,300	9,290.35	95,690,605	10,080.00	103,824,000	0.82
28	日本	株式	オリックス	その他金融業	62,200	1,628.16	101,271,694	1,665.50	103,594,100	0.82
29	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	75,300	1,391.29	104,764,464	1,328.50	100,036,050	0.79
30	日本	株式	三井物産	卸売業	68,300	1,339.41	91,481,703	1,458.00	99,581,400	0.79

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内 / 外国	業種	投資比率 (%)
株式	国内	建設業	2.53
		食料品	4.37
		繊維製品	0.81
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.45
		医薬品	5.59
		石油・石炭製品	0.75
		ゴム製品	0.11
		鉄鋼	1.24
		非鉄金属	1.34
		金属製品	0.53
		機械	5.16
		電気機器	12.33
		輸送用機器	8.49
		精密機器	1.51
		その他製品	1.69
		電気・ガス業	1.51
		陸運業	3.09
		海運業	0.18
		空運業	0.57
		倉庫・運輸関連業	0.34
		情報・通信業	9.26
		卸売業	4.58
		小売業	5.38
		銀行業	7.83
		証券、商品先物取引業	1.02
保険業	2.26		
その他金融業	1.76		
不動産業	2.78		
サービス業	3.94		
合計			98.63

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。

. 明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド

(1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	日本	7,424,338,930	39.72
	メキシコ	704,975,000	3.77
	小計	8,129,313,930	43.49
特殊債券	日本	355,233,001	1.90
社債券	日本	9,283,145,800	49.67
	イギリス	599,733,000	3.21
	小計	9,882,878,800	52.88
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		323,123,357	1.73
合計(純資産総額)		18,690,549,088	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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344回 利付国債10年	1,791,000,000	101.49	1,817,687,960	101.54	1,818,581,400	0.1	2026/9/20	9.73
2	日本	国債証券	第158回 利付国債20年	1,370,000,000	102.28	1,401,236,000	102.31	1,401,674,400	0.5	2036/9/20	7.50
3	日本	社債券	住友生命保険 相互会社第2回 A号劣後債	900,000,000	100.00	900,000,000	99.69	897,262,200	0.84	2076/6/29	4.80
4	日本	社債券	第30回 ソニー無担保社債	700,000,000	100.00	700,000,000	99.95	699,706,000	0.05	2019/9/20	3.74
5	イギリス	社債券	第2回エイチエス ビーシー・ホール ディングス円貨社債	500,000,000	100.00	500,000,000	99.87	499,385,000	0.842	2023/9/26	2.67
6	日本	社債券	第13回 光通信無担保社債	500,000,000	100.00	500,000,000	99.19	495,965,000	1.1	2021/7/22	2.65
7	日本	国債証券	第157回 利付国債20年	511,000,000	95.78	489,471,920	96.80	494,648,000	0.2	2036/6/20	2.65
8	日本	国債証券	第149回 利付国債20年	341,000,000	124.42	424,299,470	121.31	413,673,920	1.5	2034/6/20	2.21
9	日本	社債券	第44回 ソフトバンク 無担保社債	400,000,000	101.69	406,795,000	101.55	406,224,000	1.689	2020/11/27	2.17
10	日本	社債券	第46回 ソフトバンク 無担保社債	400,000,000	100.77	403,117,000	100.60	402,400,000	1.26	2019/9/12	2.15

11	日本	社債券	第26回 ソニー無担保社債	300,000,000	105.60	316,818,000	104.88	314,649,000	2.068	2019/6/20	1.68
12	日本	国債 証券	第51回 利付国債30年	326,000,000	102.60	334,489,930	94.47	307,978,720	0.3	2046/6/20	1.65
13	日本	社債券	第66回 アコム無担保社債	300,000,000	101.94	305,839,000	101.94	305,832,000	0.9	2021/2/26	1.64
14	日本	社債券	第43回 ソフトバンク 無担保社債	300,000,000	101.80	305,428,000	101.54	304,623,000	1.74	2018/6/20	1.63
15	メキシコ	国債 証券	第18回 メキシコ合衆国 円貨債券	300,000,000	100.83	302,514,000	101.21	303,651,000	0.8	2019/7/24	1.62
16	メキシコ	国債 証券	第21回 メキシコ合衆国 円貨債券	300,000,000	100.00	300,000,000	100.11	300,351,000	0.4	2019/6/14	1.61
17	日本	社債券	第15回東京 センチュリー リース無担保社債	300,000,000	100.05	300,162,000	100.07	300,222,000	0.11	2019/4/12	1.61
18	日本	社債券	第9回みずほ フィナンシャル グループ無担保 社債（劣後特約付）	300,000,000	100.00	300,000,000	99.86	299,589,000	0.56	2026/6/19	1.60
19	日本	社債券	三菱商事株式会社 第5回劣後特約付	300,000,000	100.00	300,000,000	99.80	299,421,300	0.69	2076/9/13	1.60
20	日本	社債券	第104回 丸紅無担保社債	300,000,000	100.42	301,281,000	99.77	299,328,000	0.227	2019/12/25	1.60
21	日本	社債券	第9回オリエント コーポレーション 無担保社債	300,000,000	100.00	300,000,000	99.16	297,495,000	0.46	2023/7/21	1.59
22	日本	社債券	損害保険ジャパン 日本興亜第1回 劣後債	300,000,000	100.00	300,000,000	98.64	295,927,200	0.84	2046/8/8	1.58
23	日本	社債券	第35回相鉄ホール ディングス無担保 社債	300,000,000	100.00	300,000,000	98.60	295,809,000	0.733	2031/6/27	1.58
24	日本	社債券	第7回三井住友 フィナンシャル グループ無担保社債 （劣後特約付）	200,000,000	104.16	208,334,000	103.54	207,090,000	0.92	2025/10/15	1.11
25	日本	社債券	第68回 アコム無担保社債	200,000,000	102.43	204,876,000	102.28	204,562,000	0.95	2022/6/6	1.09
26	日本	社債券	第5回 J A三井リース 無担保社債	200,000,000	100.00	200,000,000	100.15	200,318,000	0.05	2019/9/9	1.07
27	日本	特殊 債券	第114回貸付債権 担保住宅金融支援 機構債券	200,000,000	100.00	200,000,000	99.95	199,914,000	0.34	2051/11/10	1.07

28	日本	社債 券	第17回 パナソニック 無担保社債	200,000,000	100.00	200,000,000	99.90	199,816,000	0.47	2026/9/18	1.07
29	日本	社債 券	第16回 パナソニック 無担保社債	200,000,000	100.00	200,000,000	99.70	199,408,000	0.3	2023/9/20	1.07
30	日本	社債 券	第8回オリエント コーポレーション 無担保社債	200,000,000	100.00	200,000,000	99.36	198,738,000	0.29	2021/7/22	1.06

□.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
国債証券	43.49
特殊債券	1.90
社債券	52.88
合計	98.27

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

(1) 投資状況

資産の種類	国 / 地域	時価合計 (円)	投資比率 (%)
株式	アメリカ	5,364,732,645	64.76
	イギリス	543,576,307	6.56
	フランス	436,435,503	5.27
	ドイツ	408,811,075	4.93
	スイス	295,489,294	3.57
	カナダ	200,314,500	2.42
	オーストラリア	173,005,340	2.09
	オランダ	131,601,553	1.59
	香港	103,961,228	1.25
	スペイン	95,010,373	1.15
	アイルランド	80,004,389	0.97
	イタリア	68,493,867	0.83
	スウェーデン	60,895,377	0.74
	中国	44,202,626	0.53
	ベルギー	41,391,999	0.50
小計		8,047,926,076	97.14
投資証券	アメリカ	111,914,351	1.35
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		124,818,328	1.51
合計(純資産総額)		8,284,658,755	100.00

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国 / 地域	種類	銘柄名	業種	数量又は 額面総額	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	MICROSOFT CORP	ソフトウェア・サービス	36,300	5,740.97	208,397,296	6,277.96	227,890,246	2.75
2	アメリカ	株式	ALPHABET INC-CL A	ソフトウェア・サービス	2,330	80,254.85	186,993,807	85,939.06	200,238,013	2.42
3	アメリカ	株式	NEXTERA ENERGY INC	公益事業	13,700	12,464.42	170,762,623	13,184.04	180,621,455	2.18
4	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	14,600	11,411.49	166,607,859	11,924.67	174,100,316	2.10
5	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	42,100	3,458.12	145,586,995	3,348.17	140,958,370	1.70
6	アメリカ	株式	VISA INC-CLASS A SHARES	ソフトウェア・サービス	16,100	8,250.59	132,834,551	8,621.58	138,807,586	1.68

7	アメリカ	株式	UNITEDHEALTH GROUP INC	ヘルスケア機器・サービス	9,300	13,543.34	125,953,113	14,717.10	136,869,039	1.65
8	アメリカ	株式	FACEBOOK INC-A	ソフトウェア・サービス	9,900	11,978.82	118,590,368	13,767.06	136,293,987	1.65
9	スイス	株式	NESTLE SA-REG	食品・飲料・タバコ	17,300	7,792.63	134,812,648	7,723.35	133,613,990	1.61
10	アメリカ	株式	EXXON MOBIL CORP	エネルギー	15,000	8,913.49	133,702,477	8,890.03	133,350,462	1.61
11	アメリカ	株式	US BANCORP	銀行	28,100	4,214.29	118,421,648	4,680.95	131,534,706	1.59
12	アメリカ	株式	PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	食品・飲料・タバコ	12,500	10,518.95	131,486,890	10,099.06	126,238,332	1.52
13	アメリカ	株式	PEPSICO INC	食品・飲料・タバコ	11,000	11,051.39	121,565,351	11,227.36	123,500,962	1.49
14	アメリカ	株式	VERIZON COMMUNICATIONS INC	電気通信サービス	24,000	5,475.02	131,400,485	5,055.30	121,327,214	1.46
15	アメリカ	株式	AMAZON.COM INC	小売	1,470	67,743.73	99,583,287	81,404.91	119,665,225	1.44
16	アメリカ	株式	GENERAL ELECTRIC CO	資本財	37,600	3,212.89	120,804,802	3,064.00	115,206,746	1.39
17	アメリカ	株式	CITIGROUP INC	銀行	21,900	4,473.95	97,979,654	5,196.86	113,811,269	1.37
18	アメリカ	株式	WALT DISNEY CO/THE	メディア	11,400	10,071.24	114,812,157	9,841.11	112,188,665	1.35
19	アメリカ	投資証券	CROWN CASTLE INTL CORP		11,700	9,400.37	109,984,403	9,565.32	111,914,351	1.35
20	イギリス	株式	RECKITT BENCKISER GROUP PLC	家庭用品・パーソナル用品	11,500	8,872.48	102,033,590	9,358.42	107,621,830	1.30
21	香港	株式	AIA GROUP LTD	保険	149,600	611.77	91,521,425	694.92	103,961,228	1.25
22	アメリカ	株式	ACCENTURE PLC-CL A	ソフトウェア・サービス	8,500	11,971.08	101,754,204	12,129.15	103,097,828	1.24
23	アメリカ	株式	WELLS FARGO & CO	銀行	21,200	4,929.43	104,504,105	4,847.67	102,770,769	1.24
24	アメリカ	株式	JPMORGAN CHASE & CO	銀行	14,100	6,441.43	90,824,233	7,246.87	102,180,932	1.23
25	アメリカ	株式	PRICELINE GROUP INC/THE	小売	660	139,298.99	91,937,339	154,649.62	102,068,753	1.23
26	イギリス	株式	COMPASS GROUP PLC	消費者サービス	52,500	1,685.67	88,498,004	1,883.18	98,867,076	1.19
27	アメリカ	株式	HOME DEPOT INC	小売	7,400	13,919.32	103,003,034	12,958.59	95,893,631	1.16
28	アメリカ	株式	S&P GLOBAL INC	各種金融	7,400	12,018.69	88,938,361	12,822.28	94,884,878	1.15

29	カナダ	株式	SUNCOR ENERGY INC	エネルギー	28,900	2,822.83	81,580,037	3,225.16	93,207,179	1.13
30	アメリカ	株式	UNION PACIFIC CORP	運輸	10,000	8,791.70	87,917,036	9,266.47	92,664,782	1.12

ロ.種類別及び業種別の投資比率

種類	国内/外国	業種	投資比率(%)
株式	外国	エネルギー	7.26
		素材	6.51
		資本財	6.18
		商業・専門サービス	1.82
		運輸	1.98
		自動車・自動車部品	0.30
		耐久消費財・アパレル	2.06
		消費者サービス	2.31
		メディア	1.35
		小売	4.27
		食品・生活必需品小売り	1.86
		食品・飲料・タバコ	6.19
		家庭用品・パーソナル用品	3.37
		ヘルスケア機器・サービス	4.38
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.69
		銀行	7.38
		各種金融	3.83
		保険	3.75
		ソフトウェア・サービス	12.29
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	2.59
電気通信サービス	2.79		
公益事業	3.70		
半導体・半導体製造装置	2.25		
投資証券			1.35
合計			98.49

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

(1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	9,295,973,087	37.11
	フランス	3,389,985,296	13.53
	イタリア	3,226,932,640	12.88
	スペイン	1,886,356,866	7.53
	イギリス	1,722,717,130	6.88
	アイルランド	666,159,749	2.66
	メキシコ	363,178,153	1.45
	オーストリア	343,195,070	1.37
	ポーランド	265,780,399	1.06
	デンマーク	171,487,131	0.68
	南アフリカ	123,015,006	0.49
	スウェーデン	118,266,644	0.47
	オランダ	108,694,638	0.43
	シンガポール	92,895,525	0.37
	スイス	63,351,749	0.25
	ドイツ	53,852,144	0.21
	オーストラリア	49,896,562	0.20
小計		21,941,737,789	87.59
地方債証券	カナダ	750,630,574	3.00
特殊債券	オランダ	603,934,979	2.41
	国際機関	382,949,068	1.53
	オーストラリア	192,448,620	0.77
小計		1,179,332,667	4.71
社債券	フランス	652,111,756	2.60
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		525,950,540	2.10
合計(純資産総額)		25,049,763,326	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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 8%	42,370,000	14,228.27	6,028,522,213	13,871.83	5,877,494,851	8	2021/11/15	23.46
2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3%	14,610,000	11,697.41	1,708,992,535	11,321.60	1,654,086,216	3	2045/5/15	6.60
3	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5%	9,210,000	15,295.44	1,408,710,039	14,864.46	1,369,016,766	3.5	2026/4/25	5.47

4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375%	12,560,000	10,388.57	1,304,804,602	10,319.69	1,296,154,149	1.375	2023/8/31	5.17
5	イタリア	国債証券	BTPS 3.5%	10,680,000	12,268.03	1,310,226,009	12,127.42	1,295,208,510	3.5	2018/6/1	5.17
6	イギリス	国債証券	TREASURY 4.5%	6,445,000	18,044.82	1,162,988,804	18,208.61	1,173,544,961	4.5	2034/9/7	4.68
7	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25%	8,200,000	12,109.29	992,962,553	12,062.99	989,165,385	4.25	2017/10/25	3.95
8	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.6%	7,105,000	13,152.51	934,486,262	12,941.97	919,527,288	4.6	2019/7/30	3.67
9	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 5.9%	4,000,000	16,785.82	671,432,836	16,480.91	659,236,500	5.9	2026/7/30	2.63
10	フランス	社債券	DEXIA CRED SA NY 2.25%	6,150,000	10,668.45	656,110,068	10,603.44	652,111,756	2.25	2019/1/30	2.60
11	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.5%	2,940,000	19,348.16	568,836,008	19,642.48	577,489,103	4.5	2041/4/25	2.31
12	オランダ	特殊債券	NED WATERSCHAPB K 1.875%	5,000,000	10,682.08	534,104,410	10,616.02	530,801,320	1.875	2019/3/13	2.12
13	イタリア	国債証券	BTPS 9%	2,800,000	18,202.06	509,657,694	17,650.97	494,227,188	9	2023/11/1	1.97
14	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4%	2,520,000	19,083.59	480,906,469	18,028.33	454,314,042	4	2038/10/25	1.81
15	アイルランド	国債証券	IRISH GOVT 3.9%	3,110,000	14,241.80	442,920,273	14,317.97	445,288,945	3.9	2023/3/20	1.78
16	イタリア	国債証券	BTPS 7.25%	2,500,000	18,110.94	452,773,522	17,519.81	437,995,350	7.25	2026/11/1	1.75
17	イタリア	国債証券	BTPS 5%	2,830,000	14,411.16	407,835,913	14,067.16	398,100,727	5	2022/3/1	1.59
18	カナダ	地方債証券	ONTARIO PROVINCE 4%	3,300,000	11,364.20	375,018,682	11,227.36	370,502,886	4	2019/10/7	1.48
19	イタリア	国債証券	BTPS 5%	2,230,000	17,822.08	397,432,502	16,431.44	366,421,134	5	2040/9/1	1.46
20	オーストリア	国債証券	REP OF AUSTRIA 4.15%	1,840,000	19,612.68	360,873,469	18,651.90	343,195,070	4.15	2037/3/15	1.37
21	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.5%	3,075,000	10,976.74	337,534,903	10,850.55	333,654,486	3.5	2018/2/15	1.33
22	イギリス	国債証券	TREASURY 4.25%	1,490,000	19,531.69	291,022,230	18,448.79	274,887,113	4.25	2039/9/7	1.10
23	イタリア	国債証券	BTPS 4.25%	1,870,000	12,856.83	240,422,862	12,565.76	234,979,731	4.25	2019/2/1	0.94
24	カナダ	地方債証券	ONTARIO PROVINCE 4%	2,620,000	8,802.21	230,618,056	8,748.71	229,216,216	4	2021/6/2	0.92
25	アイルランド	国債証券	IRISH GOVT 5.4%	1,370,000	16,348.80	223,978,627	16,121.95	220,870,804	5.4	2025/3/13	0.88
26	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.5%	1,610,000	12,227.85	196,868,532	12,174.59	196,010,915	4.5	2018/1/31	0.78
27	オーストラリア	特殊債券	QUEENSLAND TREAS 4.75%	2,080,000	9,179.91	190,942,141	9,252.33	192,448,620	4.75	2025/7/21	0.77

28	国際機関	特殊債券	EUROPEAN INVT BK 6.25%	1,950,000	9,357.42	182,469,824	9,193.44	179,272,097	6.25	2021/6/8	0.72
29	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS 8.5%	30,600,000	590.14	180,583,807	585.28	179,097,393	8.5	2018/12/13	0.71
30	デンマーク	国債証券	DENMARK - BULLET 1.75%	9,780,000	1,749.03	171,055,936	1,753.44	171,487,131	1.75	2025/11/15	0.68

□.種類別投資比率

種類	投資比率(%)
国債証券	87.59
地方債証券	3.00
特殊債券	4.71
社債券	2.60
合計	97.90

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。

・明治安田外国債券マザーファンド(為替ヘッジ型)

(1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
国債証券	アメリカ	3,011,318,524	43.54
	イタリア	938,334,916	13.57
	フランス	662,890,833	9.58
	イギリス	491,919,696	7.11
	スペイン	484,309,646	7.00
	メキシコ	231,914,669	3.35
	カナダ	208,012,256	3.01
	アイルランド	156,382,978	2.26
	スウェーデン	152,235,473	2.20
	オーストラリア	133,776,622	1.93
	ベルギー	96,918,120	1.40
	ポーランド	60,251,142	0.87
	デンマーク	48,745,830	0.70
	ドイツ	42,936,223	0.62
	オランダ	41,666,278	0.60
	オーストリア	27,977,859	0.40
	シンガポール	17,037,607	0.25
南アフリカ	5,482,396	0.08	
	小計	6,812,111,068	98.49
特殊債券	国際機関	56,527,516	0.82
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		48,172,750	0.70
合計(純資産総額)		6,916,811,334	100.00

その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
為替予約取引	売建		7,022,302,777	101.52

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

(2) 投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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 8%	8,050,000	14,164.63	1,140,252,960	13,871.83	1,116,682,403	8	2021/11/15	16.14

2	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 1.375%	7,440,000	10,399.14	773,696,136	10,319.69	767,785,577	1.375	2023/8/31	11.10
3	イタリア	国債証券	BTPS 4.25%	4,650,000	12,679.69	589,605,709	12,565.76	584,307,887	4.25	2019/2/1	8.45
4	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3%	3,590,000	11,755.39	422,018,757	11,321.60	406,445,549	3	2045/5/15	5.88
5	イギリス	国債証券	TREASURY 4.5%	2,000,000	18,402.73	368,054,662	18,208.61	364,172,214	4.5	2034/9/7	5.27
6	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 3.5%	3,040,000	10,982.10	333,856,107	10,850.55	329,856,792	3.5	2018/2/15	4.77
7	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 3.5%	1,980,000	15,207.24	301,103,395	14,864.46	294,316,308	3.5	2026/4/25	4.26
8	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4%	1,100,000	19,069.01	209,759,218	18,028.33	198,311,685	4	2038/10/25	2.87
9	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.25%	1,770,000	10,908.01	193,071,902	10,866.93	192,344,779	4.25	2017/11/15	2.78
10	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 5.9%	1,110,000	16,740.04	185,814,540	16,480.91	182,938,129	5.9	2026/7/30	2.64
11	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.5%	1,370,000	12,222.15	167,443,528	12,174.59	166,791,896	4.5	2018/1/31	2.41
12	カナダ	国債証券	CANADA- GOV'T 2.75%	1,850,000	8,708.11	161,100,087	8,641.30	159,864,222	2.75	2022/6/1	2.31
13	メキシコ	国債証券	MEXICAN BONOS 8.5%	27,090,000	589.29	159,638,691	585.28	158,553,869	8.5	2018/12/13	2.29
14	アイルランド	国債証券	IRISH GOVT 5.4%	970,000	16,244.79	157,574,491	16,121.95	156,382,978	5.4	2025/3/13	2.26
15	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 2%	1,400,000	10,977.53	153,685,438	10,778.46	150,898,456	2	2022/7/31	2.18
16	フランス	国債証券	FRANCE O.A.T. 4.25%	1,060,000	12,105.68	128,320,212	12,062.99	127,867,720	4.25	2017/10/25	1.85
17	イタリア	国債証券	BTPS 7.25%	690,000	18,039.25	124,470,858	17,519.81	120,886,717	7.25	2026/11/1	1.75
18	オーストラリア	国債証券	AUSTRALIAN GOVT. 2.75%	1,394,000	8,325.98	116,064,290	8,261.44	115,164,501	2.75	2024/4/21	1.66
19	イタリア	国債証券	BTPS 9%	575,000	18,114.47	104,158,250	17,650.97	101,493,083	9	2023/11/1	1.47

20	ベルギー	国債証券	BELGIAN 0291 5.5%	540,000	18,159.58	98,061,752	17,947.80	96,918,120	5.5	2028/3/28	1.40
21	イタリア	国債証券	BTPS 5%	570,000	17,790.11	101,403,644	16,431.44	93,659,214	5	2040/9/1	1.35
22	スペイン	国債証券	SPANISH GOV'T 4.6%	590,000	13,112.28	77,362,473	12,941.97	76,357,649	4.6	2019/7/30	1.10
23	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 3.5%	4,010,000	1,704.65	68,356,745	1,701.67	68,237,300	3.5	2039/3/30	0.99
24	スウェーデン	国債証券	SWEDISH GOVRNMNT 5%	4,740,000	1,442.50	68,374,804	1,430.74	67,817,354	5	2020/12/1	0.98
25	イギリス	国債証券	TREASURY 4.25%	336,000	20,128.58	67,632,055	18,448.79	61,987,966	4.25	2039/9/7	0.90
26	国際機関	特殊債券	EU 3.375%	350,000	16,188.45	56,659,593	16,150.71	56,527,516	3.375	2032/4/4	0.82
27	イギリス	国債証券	TREASURY 5%	360,000	13,703.21	49,331,560	13,574.50	48,868,200	5	2018/3/7	0.71
28	デンマーク	国債証券	DENMARK - BULLET 1.75%	2,780,000	1,759.99	48,927,821	1,753.44	48,745,830	1.75	2025/11/15	0.70
29	カナダ	国債証券	CANADA- GOV'T 5%	401,000	12,235.52	49,064,467	12,006.99	48,148,034	5	2037/6/1	0.70
30	アメリカ	国債証券	US TREASURY N/B 4.75%	320,000	15,430.14	49,376,477	14,782.80	47,304,968	4.75	2041/2/15	0.68

ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率 (%)
国債証券	98.49
特殊債券	0.82
合計	99.30

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

資産の種類	通貨	買建 / 売建	数量	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
-------	----	---------	----	-------------	------------	-------------

為替予約取引	ドル	売建	29,299,000.00	2,979,321,026	3,071,414,170	44.40
	カナダドル	売建	2,707,000.00	209,364,043	211,389,630	3.05
	メキシコペソ	売建	43,217,614.46	234,887,470	236,832,527	3.42
	ユーロ	売建	22,375,000.00	2,545,315,252	2,574,243,750	37.21
	ポンド	売建	3,938,000.00	514,018,723	503,040,120	7.27
	スウェーデンクローナ	売建	13,519,000.00	159,389,980	157,225,970	2.27
	デンマーククローネ	売建	3,227,000.00	49,297,425	49,921,690	0.72
	ポーランドズロチ	売建	2,305,000.00	60,899,011	61,105,550	0.88
	オーストラリアドル	売建	1,691,000.00	131,274,427	134,519,050	1.94
	シンガポールドル	売建	227,000.00	16,848,722	17,090,830	0.24
	南アフリカランド	売建	733,000.00	5,030,945	5,519,490	0.07

(注)為替予約取引は、わが国における対顧客先物相場の仲値で評価しています。

. 明治安田マネープール・マザーファンド

(1) 投資状況

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
特殊債券	日本	1,934,814,930	99.21
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		15,432,894	0.79
合計(純資産総額)		1,950,247,824	100.00

投資資産

投資有価証券の主要銘柄

イ. 評価額上位銘柄明細

順位	国/地域	種類	銘柄名	数量又は 額面総額	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	特殊債券	政府保証第872回 公営企業債券	500,000,000	100.63	503,180,000	100.56	502,825,000	1.8	2017/2/20	25.78
2	日本	特殊債券	政府保証第195回 預金保険機構債	300,000,000	100.30	300,912,000	100.30	300,900,000	0.2	2018/1/23	15.43
3	日本	特殊債券	政府保証第4回 首都高速道路株式会社	169,000,000	101.63	171,769,910	101.57	171,658,370	1.7	2017/9/25	8.80
4	日本	特殊債券	政府保証第882回 公営企業債券	101,000,000	102.20	103,224,020	102.14	103,167,460	1.6	2018/2/19	5.29
5	日本	特殊債券	政府保証第54回 日本高速道路保有・ 債務返済機構債券	100,000,000	102.05	102,050,000	102.01	102,012,000	1.4	2018/3/23	5.23
6	日本	特殊債券	政府保証第17回 中日本高速道路債券	100,000,000	101.59	101,591,000	101.52	101,525,000	1.7	2017/9/15	5.21
7	日本	特殊債券	政府保証第15回 西日本高速道路債券	98,000,000	103.04	100,984,100	102.99	100,934,120	1.8	2018/6/15	5.18
8	日本	特殊債券	第870回 政府保証公営企業債券	100,000,000	100.31	100,310,000	100.24	100,243,000	1.7	2016/12/21	5.14
9	日本	特殊債券	政府保証第194回 預金保険機構債	100,000,000	100.16	100,162,000	100.16	100,161,000	0.1	2017/12/15	5.14
10	日本	特殊債券	政府保証第41回 日本高速道路保有・ 債務返済機構債券	90,000,000	101.65	91,487,700	101.58	91,428,300	1.7	2017/9/28	4.69
11	日本	特殊債券	政府保証第37回 日本高速道路保有・ 債務返済機構債券	90,000,000	101.52	91,376,100	101.45	91,308,600	1.9	2017/7/31	4.68
12	日本	特殊債券	政府保証第2回 阪神高速道路債券	85,000,000	100.71	85,608,600	100.64	85,551,650	1.7	2017/3/16	4.39
13	日本	特殊債券	政府保証第6回 東日本高速道路債券	83,000,000	100.19	83,157,700	100.12	83,100,430	1.8	2016/11/24	4.26

□.種類別投資比率

種類	投資比率（％）
特殊債券	99.21
合計	99.21

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。

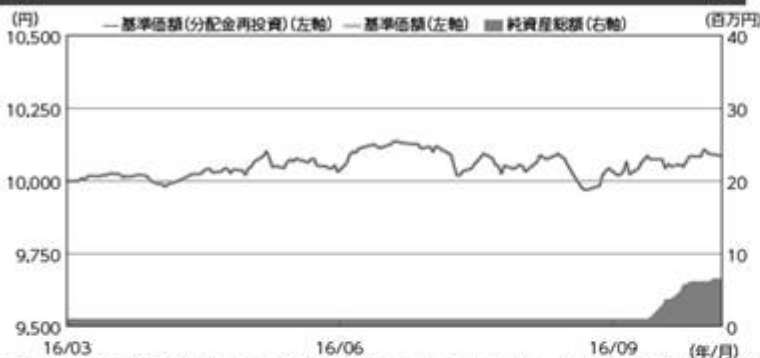
[次へ](#)

<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。

2016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、当ファンドの設定時を10,000円として分配金（税引前）再投資ベースで算出しています。

分配の推移

該当事項はありません。

基準価額	10.085円
純資産総額	6百万円

主要な資産の状況

資産の組入比率

資産の種類	投資比率(%)
明治安田日本株式アルファ・マザーファンド	10.26
明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド	30.44
明治安田外国株式ポートフォリオ・マザーファンド	14.28
明治安田外国債券ポートフォリオ・マザーファンド	5.13
明治安田外国債券マザーファンド（為替ヘッジ型）	23.08
明治安田マネーボール・マザーファンド	-
その他の資産（負債控除後）	16.80
合計（純資産総額）	100

組入上位銘柄（各マザーファンド）

【明治安田日本債券ポートフォリオ・マザーファンド】

銘柄名	利率%	償還期限	種類	投資比率(%)
1 第344回利付国債10年	0.1	2026年9月20日	国債証券	9.73
2 第158回利付国債20年	0.5	2036年9月20日	国債証券	7.50
3 住友生命保険相互会社2回A号社債	0.84	2021年6月29日	社債券	4.80
4 第30回ソニー無担保社債	0.05	2019年9月20日	社債券	3.74
5 東武エフエムエフエフエフエフエフエフ	0.842	2023年9月26日	社債券	2.67

【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 MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	2.75
2 ALPHABET INC-CL A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	2.42
3 NEXTERA ENERGY INC	アメリカ	公益事業	2.18
4 APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェア及び機器	2.10
5 PFIZER INC	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー/ファーマス	1.70

【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	国/地域	種類	投資比率%
1 US TREASURY N/B 8%	8	2021年11月15日	アメリカ	国債証券	23.46
2 US TREASURY N/B 3%	3	2045年5月15日	アメリカ	国債証券	6.60
3 FRANCE O.A.T. 3.5%	3.5	2026年4月25日	フランス	国債証券	5.47
4 US TREASURY N/B 1.375%	1.375	2023年8月31日	アメリカ	国債証券	5.17
5 BTIPS 3.5%	3.5	2018年6月1日	イタリア	国債証券	5.17

【明治安田外国債券マザーファンド（為替ヘッジ型）】

銘柄名	利率%	償還期限	国/地域	種類	投資比率%
1 US TREASURY N/B 8%	8	2021年11月15日	アメリカ	国債証券	16.14
2 US TREASURY N/B 1.375%	1.375	2023年8月31日	アメリカ	国債証券	11.10
3 BTIPS 4.25%	4.25	2019年2月1日	イタリア	国債証券	8.45
4 US TREASURY N/B 3%	3	2045年5月15日	アメリカ	国債証券	5.88
5 TREASURY 4.5%	4.5	2034年9月7日	イタリア	国債証券	5.27

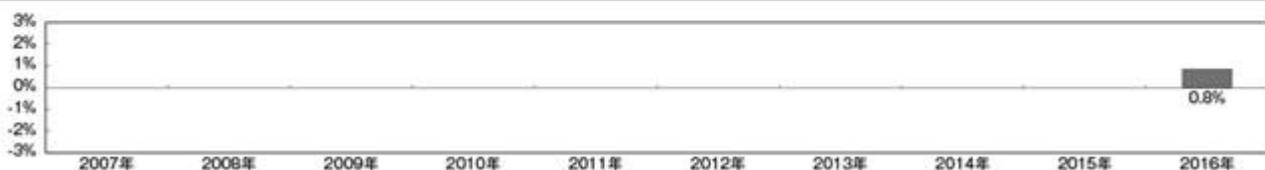
【明治安田マネーボール・マザーファンド】

銘柄名	利率%	償還期限	国/地域	種類	投資比率%
1 政府保証第872回公営企業債券	1.8	2017年2月20日	日本	特殊債券	25.78
2 政府保証第195回預金保険機構債	0.2	2018年1月23日	日本	特殊債券	15.43
3 政府保証第4回首都圏高速道路株式会社	1.7	2017年9月25日	日本	特殊債券	8.80
4 政府保証第882回公営企業債券	1.6	2018年2月19日	日本	特殊債券	5.29
5 政府保証第4回首都圏高速道路株式会社	1.4	2018年3月23日	日本	特殊債券	5.23

※投資比率は各マザーファンドの対純資産総額比

※期限前償還条件が付与されている銘柄の償還日は、最初の繰上償還可能日を表示しています。

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。

※2016年は設定日（2016年3月25日）から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。

※最新の運用状況は委託会社のホームページでご確認することができます。

※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。

第3【ファンドの経理状況】

原届出書の「第二部ファンド情報 第3 ファンドの経理状況 1 財務諸表」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「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条の3及び第57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、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第1期中間計算期間（平成28年3月25日から平成28年9月24日まで）の中間財務諸表について、新日本有限責任監査法人による中間監査を受けております。

1【中間財務諸表】

【明治安田DC先進国コアファンド】

(1)【中間貸借対照表】

	第1期中間計算期間末 (平成28年9月24日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
金銭信託	80,946
親投資信託受益証券	926,451
流動資産合計	1,007,397
資産合計	1,007,397
負債の部	
流動負債	
未払受託者報酬	183
未払委託者報酬	2,933
流動負債合計	3,116
負債合計	3,116
純資産の部	
元本等	
元本	1,000,000
剰余金	
中間剰余金又は中間欠損金()	4,281
(分配準備積立金)	-
元本等合計	1,004,281
純資産合計	1,004,281
負債純資産合計	1,007,397

（２）【中間損益及び剰余金計算書】

	第1期中間計算期間 (自 平成28年3月25日 至 平成28年9月24日)
科目	金額(円)
営業収益	
有価証券売買等損益	7,445
その他収益	33
営業収益合計	7,478
営業費用	
受託者報酬	183
委託者報酬	2,933
その他費用	81
営業費用合計	3,197
営業利益又は営業損失()	4,281
経常利益又は経常損失()	4,281
中間純利益又は中間純損失()	4,281
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額()	-
期首剰余金又は期首欠損金()	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	-
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
分配金	-
中間剰余金又は中間欠損金()	4,281

（３）【中間注記表】

（重要な会計方針に係る事項に関する注記）

1. 運用資産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、親投資信託受益証券の基準価額で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他	当ファンドの計算期間は、当期末が休日のため、平成28年3月25日（設定日）から平成29年2月21日までとなっております。 なお、当該中間計算期間は、平成28年3月25日から平成28年9月24日までとなっております。

（中間貸借対照表に関する注記）

第1期中間計算期間末 （平成28年9月24日現在）	
1. 中間計算期間の末日における受益権の総数	1,000,000円
2. 中間計算期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0043円
（10,000口当たり純資産額）	（10,043円）

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第1期中間計算期間（自 平成28年3月25日 至 平成28年9月24日）

該当事項はございません。

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の時価等に関する事項

第1期中間計算期間 （自 平成28年3月25日 至 平成28年9月24日）	
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、帳簿価額は時価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。

（その他の注記）

1．元本の移動

	第1期中間計算期間 (自 平成28年3月25日 至 平成28年9月24日)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	-円
期中一部解約元本額	-円

2．デリバティブ取引関係

第1期中間計算期間末（平成28年9月24日現在）

該当事項はございません。

[次へ](#)

（参考）

当ファンドは「明治安田日本株式アルファ・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、明治安田外国債券マザーファンド（為替ヘッジ型）」受益証券を主要投資対象としており、中間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。

同親投資信託の状況は次の通りです。

なお、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

明治安田日本株式アルファ・マザーファンド

（１）貸借対照表

科目	（平成28年9月24日現在）	
	金額（円）	
資産の部		
流動資産		
金銭信託	89,202,025	
株式	12,115,565,630	
未収入金	100,230,147	
未収配当金	4,529,950	
流動資産合計	12,309,527,752	
資産合計	12,309,527,752	
負債の部		
流動負債		
未払金	99,291,028	
未払解約金	4,290,000	
その他未払費用	8,213	
流動負債合計	103,589,241	
負債合計	103,589,241	
純資産の部		
元本等		
元本	7,396,636,720	
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）	4,809,301,791	
元本等合計	12,205,938,511	
純資産合計	12,205,938,511	
負債純資産合計	12,309,527,752	

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産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. 費用・収益の計上基準	(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式の配当落ち日において、確定配当金額又は予想配当金額を計上しております。 (2) 有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他	貸借対照表は、ファンドの計算期間末の平成28年9月24日現在であります。 なお、当親投資信託の計算期間は、平成27年11月26日から平成28年11月25日までとなっております。

(その他の注記)

(平成28年9月24日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間（自平成28年3月25日 至 平成28年9月24日）の元本状況	
期首（平成28年3月25日）の元本額	8,763,666,634円
対象期間中の追加設定元本額	2,341,750,189円
対象期間中の一部解約元本額	3,708,780,103円
平成28年9月24日現在の元本額の内訳	
明治安田先進国コアファンド（年1回決算型）	40,453,163円
明治安田先進国コアファンド（年2回決算型）	22,663,026円
明治安田DC先進国コアファンド	87,110円
明治安田DC日本株式アルファオープン	537,807,963円
明治安田日本株式アルファオープン（3ヵ月決算型）	171,629,391円
明治安田日本株式アルファPファンド（適格機関投資家私募）	5,726,906,132円
明治安田ダウンサイドリスク抑制型グローバル・バランスPファンド（適格機関投資家私募）	897,089,935円
計	7,396,636,720円
2. 対象期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6502円
（10,000口当たり純資産額）	(16,502円)

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](#)

（参考）

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

	（平成28年 9月24日現在）
科目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
金銭信託	279,380,884
国債証券	9,436,387,940
特殊債券	159,237,013
社債券	10,972,807,700
未収入金	2,212,925,960
未収利息	25,148,145
前払費用	1,274,615
流動資産合計	23,087,162,257
資産合計	23,087,162,257
負債の部	
流動負債	
未払金	2,283,680,130
未払解約金	16,650,000
その他未払費用	158,014
流動負債合計	2,300,488,144
負債合計	2,300,488,144
純資産の部	
元本等	
元本	14,715,745,846
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	6,070,928,267
元本等合計	20,786,674,113
純資産合計	20,786,674,113
負債純資産合計	23,087,162,257

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	国債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。
2. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
3. その他	貸借対照表は、ファンドの中間計算期間末の平成28年9月24日現在であります。 なお、当親投資信託の計算期間は、前期末が休日のため、平成28年4月12日から平成29年4月10日までとなっております。

(その他の注記)

(平成28年9月24日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間(自平成28年3月25日 至 平成28年9月24日)の元本状況	
期首(平成28年3月25日)の元本額	10,324,284,164円
対象期間中の追加設定元本額	6,062,263,518円
対象期間中の一部解約元本額	1,670,801,836円
平成28年9月24日現在の元本額の内訳	
明治安田先進国コアファンド(年1回決算型)	123,947,412円
明治安田先進国コアファンド(年2回決算型)	69,430,723円
明治安田DC先進国コアファンド	266,970円
明治安田DCハートフルライフ(プラン70)	228,804,929円
明治安田グローバルバランスオープン	40,210,983円
明治安田DCグローバルバランスオープン	263,589,424円
明治安田日本債券オープン(毎月決算型)	1,063,162,995円
明治安田DCハートフルライフ(プラン30)	678,666,968円
明治安田DCハートフルライフ(プラン50)	685,008,255円
明治安田DC日本債券オープン	6,364,542,323円
明治安田VAハートフルライフ30(適格機関投資家私募)	32,705,096円
明治安田VAハートフルライフ50(適格機関投資家私募)	30,965,931円
明治安田ダウンスайдリスク抑制型グローバル・バランスPファンド(適格機関投資家私募)	5,134,443,837円
計	14,715,745,846円
2. 対象期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.4125円
(10,000口当たり純資産額)	(14,125円)

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

[前へ](#) [次へ](#)

（参考）

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

科目	(平成28年9月24日現在)
	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	37,651,534
金銭信託	90,123,531
株式	6,723,026,589
投資証券	94,876,846
未収配当金	7,849,542
流動資産合計	6,953,528,042
資産合計	6,953,528,042
負債の部	
流動負債	
未払解約金	330,000
その他未払費用	5,699
流動負債合計	335,699
負債合計	335,699
純資産の部	
元本等	
元本	4,157,598,852
剰余金	
剰余金又は欠損金()	2,795,593,491
元本等合計	6,953,192,343
純資産合計	6,953,192,343
負債純資産合計	6,953,528,042

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	<p>(1) 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。</p> <p>(2) 投資証券 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）、金融商品取引業者等から提示される気配相場、または運用会社等が公表する基準価額に基づいて評価しております。</p> <p>(3) 為替予約取引 個別法に基づき、計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。</p>
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	<p>信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産計算規則」第60条及び第61条に基づいております。</p>
3. 費用・収益の計上基準	<p>(1) 受取配当金の計上基準 受取配当金は原則として、株式及び投資証券の配当落ち日において、その金額が確定している場合には当該金額、未だ確定していない場合には入金時に計上しております。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益及び為替予約による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
4. その他	<p>貸借対照表は、ファンドの中間計算期間末の平成28年9月24日現在であります。 なお、当親投資信託の計算期間は、前期末が休日のため、平成28年4月12日から平成29年4月10日までとなっております。</p>

(その他の注記)

(平成28年9月24日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間(自平成28年3月25日 至 平成28年9月24日)の元本状況	
期首(平成28年3月25日)の元本額	4,436,197,653円
対象期間中の追加設定元本額	1,011,874,744円
対象期間中の一部解約元本額	1,290,473,545円
平成28年9月24日現在の元本額の内訳	
明治安田先進国コアファンド(年1回決算型)	22,425,490円
明治安田先進国コアファンド(年2回決算型)	12,566,178円
明治安田DC先進国コアファンド	48,319円
明治安田DCハートフルライフ(プラン70)	246,423,709円
明治安田グローバルバランスオープン	23,858,426円
明治安田DCグローバルバランスオープン	156,120,489円
明治安田DC外国株式リサーチオープン	3,288,081,320円
明治安田DCハートフルライフ(プラン30)	95,970,674円
明治安田DCハートフルライフ(プラン50)	293,986,860円
明治安田VAハートフルライフ30(適格機関投資家私募)	4,557,658円
明治安田VAハートフルライフ50(適格機関投資家私募)	13,559,729円
計	4,157,598,852円
2. 対象期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.6724円
(10,000口当たり純資産額)	(16,724円)

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

[前へ](#) [次へ](#)

（参考）

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

	(平成28年9月24日現在)
科目	金額(円)
資産の部	
流動資産	
預金	4,649,948
金銭信託	190,176,597
国債証券	21,925,497,000
地方債証券	867,046,264
特殊債券	1,279,939,274
社債券	630,033,810
未収入金	1,413,835,007
未収利息	227,851,784
前払費用	62,404,430
流動資産合計	26,601,434,114
資産合計	26,601,434,114
負債の部	
流動負債	
未払金	1,410,592,756
未払解約金	32,470,000
その他未払費用	16,137
流動負債合計	1,443,078,893
負債合計	1,443,078,893
純資産の部	
元本等	
元本	12,294,387,618
剰余金	
剰余金又は欠損金()	12,863,967,603
元本等合計	25,158,355,221
純資産合計	25,158,355,221
負債純資産合計	26,601,434,114

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1 . 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 国債証券、地方債証券、特殊債券、社債券 個別法に基づき、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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
2 . 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産計算規則」第60条及び第61条に基づいております。
3 . 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4 . その他	貸借対照表は、ファンドの中間計算期間末の平成28年9月24日現在であります。 なお、当親投資信託の計算期間は、前期末が休日のため、平成28年4月12日から平成29年4月10日までとなっております。

(その他の注記)

(平成28年9月24日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間(自平成28年3月25日 至 平成28年9月24日)の元本状況	
期首(平成28年3月25日)の元本額	12,529,420,879円
対象期間中の追加設定元本額	451,340,728円
対象期間中の一部解約元本額	686,373,989円
平成28年9月24日現在の元本額の内訳	
明治安田先進国コアファンド(年1回決算型)	20,579,644円
明治安田先進国コアファンド(年2回決算型)	11,531,212円
明治安田DC先進国コアファンド	44,341円
明治安田DCハートフルライフ(プラン70)	80,262,650円
明治安田グローバルバランスオープン	14,482,348円
明治安田DCグローバルバランスオープン	94,742,028円
明治安田外国債券オープン	359,544,068円
明治安田DCハートフルライフ(プラン30)	77,973,668円
明治安田DCハートフルライフ(プラン50)	118,526,926円
明治安田DC外国債券オープン	2,975,143,102円
明治安田外国債券オープン(毎月分配型)	7,238,628,482円
グローバル・インカム・プラス(毎月分配型)	707,471,958円
明治安田VAハートフルライフ30(適格機関投資家私募)	3,724,528円
明治安田VAハートフルライフ50(適格機関投資家私募)	5,480,292円
明治安田VA外国債券オープン(適格機関投資家私募)	26,405,834円
明治安田ダウンサイドリスク抑制型グローバル・バランスPファンド(適格機関投資家私募)	559,846,537円
計	12,294,387,618円
2. 対象期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	2.0463円
(10,000口当たり純資産額)	(20,463円)

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

[前へ](#) [次へ](#)

（参考）

以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

明治安田外国債券マザーファンド（為替ヘッジ型）

（１）貸借対照表

	（平成28年9月24日現在）
科目	金額（円）
資産の部	
流動資産	
預金	499,663
金銭信託	23,238,246
国債証券	6,609,178,753
特殊債券	96,677,321
派生商品評価勘定	140,199,546
未収入金	433,090,499
未収利息	53,597,103
前払費用	31,194,025
流動資産合計	7,386,675,830
資産合計	7,386,675,830
負債の部	
流動負債	
派生商品評価勘定	494,329
未払金	434,790,556
その他未払費用	2,036
流動負債合計	435,286,921
負債合計	435,286,921
純資産の部	
元本等	
元本	6,802,077,022
剰余金	
剰余金又は欠損金（ ）	149,311,887
元本等合計	6,951,388,909
純資産合計	6,951,388,909
負債純資産合計	7,386,675,830

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

1. 運用資産の評価基準及び評価方法	(1) 国債証券、特殊債券 個別法に基づき、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、価格情報会社の提供する価額等で評価しております。 (2) 為替予約取引 個別法に基づき、計算日において予約為替の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値で評価しております。
2. 外貨建資産・負債の本邦通貨への換算基準	信託財産に属する外貨建資産・負債の円換算は、原則として、わが国における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算しております。 なお、外貨建資産等の会計処理は「投資信託財産計算規則」第60条及び第61条に基づいております。
3. 費用・収益の計上基準	有価証券売買等損益及び為替予約による為替差損益の計上基準 約定日基準で計上しております。
4. その他	貸借対照表は、ファンドの中間計算期間末の平成28年9月24日現在であります。 なお、当親投資信託の計算期間は、前期末及び当期末が休日のため、平成28年2月23日から平成29年2月22日までとなっております。

(その他の注記)

(平成28年9月24日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間（自 平成28年3月25日 至 平成28年9月24日）の元本状況	
期首（平成28年3月25日）の元本額	4,986,388,110円
対象期間中の追加設定元本額	3,905,668,391円
対象期間中の一部解約元本額	2,089,979,479円
平成28年9月24日現在の元本額の内訳	
明治安田先進国コアファンド（年1回決算型）	106,316,221円
明治安田先進国コアファンド（年2回決算型）	59,561,828円
明治安田DC先進国コアファンド	229,028円
明治安田ダウンサイドリスク抑制型グローバル・バランスPファンド （適格機関投資家私募）	6,635,969,945円
計	6,802,077,022円
2. 対象期間の末日における1単位当たりの純資産の額	
1口当たり純資産額	1.0220円
（10,000口当たり純資産額）	(10,220円)

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

[前へ](#)

原届出書の「第二部ファンド情報 第3ファンドの経理状況 2ファンドの現況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

2【ファンドの現況】

<更新、訂正後>

（平成28年10月31日現在）

【純資産額計算書】

資産総額	6,578,879 円
負債総額	2,137 円
純資産総額（ - ）	6,576,742 円
発行済口数	6,521,317 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0085 円
（1万口当たり純資産額）	（10,085 円）

（参考）

・明治安田日本株式アルファ・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	13,478,929,474 円
負債総額	809,127,918 円
純資産総額（ - ）	12,669,801,556 円
発行済口数	7,383,962,468 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.7159 円
（1万口当たり純資産額）	（17,159 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

資産総額	20,194,469,486 円
負債総額	1,503,920,398 円
純資産総額（ - ）	18,690,549,088 円
発行済口数	13,237,319,457 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.4120 円
（1万口当たり純資産額）	（14,120 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

資産総額	8,284,725,885 円
負債総額	67,130 円
純資産総額（ - ）	8,284,658,755 円
発行済口数	4,878,114,016 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.6983 円
（1万口当たり純資産額）	（16,983 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

資産総額	25,072,002,984 円
負債総額	22,239,658 円
純資産総額（ - ）	25,049,763,326 円
発行済口数	12,188,250,768 口
1口当たり純資産額（ / ）	2.0552 円
（1万口当たり純資産額）	（20,552 円）

．明治安田外国債券マザーファンド（為替ヘッジ型）

純資産額計算書

資産総額	13,822,549,342 円
負債総額	6,905,738,008 円
純資産総額（ - ）	6,916,811,334 円
発行済口数	6,892,008,598 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0036 円
（1万口当たり純資産額）	（10,036 円）

．明治安田マネープール・マザーファンド

純資産額計算書

資産総額	1,950,255,254 円
負債総額	7,430 円
純資産総額（ - ）	1,950,247,824 円
発行済口数	1,945,025,219 口
1口当たり純資産額（ / ）	1.0027 円
（1万口当たり純資産額）	（10,027 円）

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

2【事業の内容及び営業の概況】

<訂正前>

「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27年12月30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	144 本	1,042,422,461,954 円
単位型株式投資信託	4 本	8,769,879,139 円
合 計	148 本	1,051,192,341,093 円

<訂正後>

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）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28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	142 本	1,131,561,420,213 円
単位型株式投資信託	4 本	8,298,475,476 円
合 計	146 本	1,139,859,895,689 円

3【委託会社等の経理状況】

原届出書の「第三部委託会社等の情報 第1委託会社等の概況 3委託会社等の経理状況」につきましては、以下の内容に更新・訂正されます。

<更新・訂正後>

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27年4月1日から平成28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27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	8,891,362	8,954,092
前払費用	88,667	113,438
未収入金	1,188	-
未収委託者報酬	872,124	756,595
未収運用受託報酬	136,002	130,048
未収投資助言報酬	224,622	221,366
その他	516	176
流動資産合計	10,214,483	10,175,717
固定資産		
有形固定資産		
建物	¹ 78,235	¹ 76,958
器具備品	¹ 86,756	¹ 80,915
有形固定資産合計	164,992	157,874
無形固定資産		
ソフトウェア	45,875	40,629
電話加入権	6,662	6,662
その他	174	90
無形固定資産合計	52,711	47,383
投資その他の資産		
投資有価証券	386	1,334
長期差入保証金	96,907	106,597
長期前払費用	799	1,596
前払年金費用	11,517	13,563
投資その他の資産合計	109,610	123,093
固定資産合計	327,314	328,350
資産合計	10,541,798	10,504,067

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
負債の部		
流動負債		
預り金	41,277	13,239
未払金	588,289	476,548
未払収益分配金	118	120
未払償還金	7,315	7,137
未払手数料	351,231	269,575
その他未払金	229,623	199,713
未払費用	19,574	25,383
未払法人税等	70,786	178,703
未払消費税等	150,196	60,179
賞与引当金	60,075	96,974
流動負債合計	930,198	851,028
固定負債		
繰延税金負債	11,290	10,751
資産除去債務	28,100	28,469
固定負債合計	39,390	39,221
負債合計	969,589	890,249
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	1,882,406	1,924,067
利益剰余金合計	5,057,448	5,099,109
株主資本合計	9,572,231	9,613,892
評価・換算差額等		
その他有価証券評価差額金	23	74
評価・換算差額等合計	23	74
純資産合計	9,572,208	9,613,818
負債・純資産合計	10,541,798	10,504,067

(2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度		当事業年度	
	(自	平成26年4月1日	(自	平成27年4月1日
	至	平成27年3月31日)	至	平成28年3月31日)
営業収益				
委託者報酬		5,175,093		5,069,760
受入手数料		9,348		7,113
運用受託報酬		1,456,016		1,568,398
投資助言報酬		412,351		424,417
営業収益合計		7,052,810		7,069,689
営業費用				
支払手数料		2,397,134		2,175,264
広告宣伝費		22,821		34,668
公告費		288		129
調査費		1,248,205		1,202,427
調査費		366,281		475,403
委託調査費		881,923		727,023
委託計算費		311,665		320,967
営業雑経費		93,202		102,440
通信費		14,531		14,199
印刷費		68,243		77,321
協会費		7,253		7,844
諸会費		3,164		3,022
営業雑費		9		52
営業費用合計		4,073,318		3,835,897
一般管理費				
給料		1,175,647		1,300,274
役員報酬		53,295		54,210
給料・手当		992,115		1,014,214
賞与		130,236		231,849
その他報酬		1,117		6,583
賞与引当金繰入		60,075		96,974
法定福利費		174,211		200,082
福利厚生費		30,225		40,843
交際費		611		1,371
寄付金		200		200
旅費交通費		30,564		35,542
租税公課		25,456		35,014
不動産賃借料		110,515		113,302
退職給付費用		7,316		68,167
固定資産減価償却費		50,850		55,021
諸経費		168,133		179,502
一般管理費合計		1,834,926		2,132,880
営業利益		1,144,566		1,100,911

（単位：千円）

	前事業年度		当事業年度	
	（自	平成26年4月1日	（自	平成27年4月1日
	至	平成27年3月31日）	至	平成28年3月31日）
営業外収益				
受取利息		2,360		2,098
受取配当金		11		-
投資有価証券売却益		1		0
償還金等時効完成分		34		207
保険契約返戻金・配当金		¹ 1,130		¹ 1,109
為替差益		363		572
雑益		575		498
営業外収益合計		4,477		4,486
営業外費用				
雑損		254		132
営業外費用合計		254		132
経常利益		1,148,789		1,105,266
特別利益		-		-
特別損失				
固定資産除却損		² 2,277		² 233
特別損失合計		2,277		233
税引前当期純利益		1,146,512		1,105,033
法人税、住民税及び事業税		82,312		200,775
法人税等調整額		11,290		538
法人税等合計		93,602		200,236
当期純利益		1,052,910		904,796

(3) 【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	1,000,000	660,443	2,854,339	3,514,783
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				
当期変動額合計	-	-	-	-
当期末残高	1,000,000	660,443	2,854,339	3,514,783

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本 合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
別途積立金		繰越利益 剰余金			
当期首残高	83,040	3,092,001	1,137,921	4,312,963	8,827,746
当期変動額					
剰余金の配当			308,424	308,424	308,424
当期純利益			1,052,910	1,052,910	1,052,910
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	744,485	744,485	744,485
当期末残高	83,040	3,092,001	1,882,406	5,057,448	9,572,231

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	0	0	8,827,746
当期変動額			
剰余金の配当			308,447
当期純利益			1,052,910
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	23	23	23
当期変動額合計	23	23	744,461
当期末残高	23	23	9,572,208

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本			
	資本金	資本剰余金		
		資本準備金	その他資本剰余金	資本剰余金合計
当期首残高	1,000,000	660,443	2,854,339	3,514,783
当期変動額				
剰余金の配当				
当期純利益				
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）				

当期変動額合計	-	-	-	-
当期末残高	1,000,000	660,443	2,854,339	3,514,783

	株主資本				
	利益剰余金				株主資本 合計
	利益準備金	その他利益剰余金		利益剰余金 合計	
		別途積立金	繰越利益 剰余金		
当期首残高	83,040	3,092,001	1,882,406	5,057,448	9,572,231
当期変動額					
剰余金の配当			863,135	863,135	863,135
当期純利益			904,796	904,796	904,796
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	41,661	41,661	41,661
当期末残高	83,040	3,092,001	1,924,067	5,099,109	9,613,892

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等 合計	
当期首残高	23	23	9,572,208
当期変動額			
剰余金の配当			863,135
当期純利益			904,796
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	51	51	51
当期変動額合計	51	51	41,609
当期末残高	74	74	9,613,818

[注記事項]

（重要な会計方針）

<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>その他有価証券 時価のあるもの 決算期末日の市場価格等に基づく時価法（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定しております。）</p>
<p>2. 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 8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>3. 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、当事業年度に見合う支給見込額に基づき計上しております。</p> <p>(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>

4. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項

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。

(貸借対照表関係)

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。

	前事業年度 (平成27年3月31日)	当事業年度 (平成28年3月31日)
建物	13,680千円	20,399千円
器具備品	229,540千円	250,057千円

(損益計算書関係)

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 (自平成26年4月1日 至平成27年3月31日)	当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)
保険契約返戻金・配当金	1,130千円	1,109千円

2 前事業年度（自平成26年4月1日至平成27年3月31日）

固定資産除却損の内容は、ソフトウェア1,736千円、器具備品540千円であります。

当事業年度（自平成27年4月1日至平成28年3月31日）

固定資産除却損の内容は、器具備品233千円であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自平成26年4月1日至平成27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

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26年6月27日 定時株主総会	普通株式	308,424,710円	16,330円00銭	平成26年3月31日	平成26年6月27日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの

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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	863,135,900円	45,700円00銭	平成27年3月31日	平成27年6月30日

当事業年度（自平成27年4月1日至平成28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

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27年6月30日 定時株主総会	普通株式	863,135,900円	45,700円00銭	平成27年3月31日	平成27年6月30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

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28年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	861,492,731円	45,613円00銭	平成28年3月31日	平成28年6月30日

(リース取引関係)

該当事項はありません。

(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27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	8,891,362	8,891,362	-
(2) 未収委託者報酬	872,124	872,124	-
(3) 未収運用受託報酬	136,002	136,002	-
(4) 未収投資助言報酬	224,622	224,622	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	386	386	-
(6) 長期差入保証金	96,907	90,238	6,668
資産計	10,221,404	10,214,735	6,668
(1) 未払手数料	351,231	351,231	-
(2) その他未払金	229,623	229,623	-
負債計	580,855	580,855	-

当事業年度（平成28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	8,954,092	8,954,092	-
(2) 未収委託者報酬	756,595	756,595	-
(3) 未収運用受託報酬	130,048	130,048	-
(4) 未収投資助言報酬	221,366	221,366	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	1,334	1,334	-
(6) 長期差入保証金	106,597	106,320	277
資産計	10,170,034	10,169,757	277
(1) 未払手数料	269,575	269,575	-
(2) その他未払金	199,713	199,713	-
負債計	469,289	469,289	-

(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

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。

- (5) 投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

- (6) 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) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

前事業年度 (平成27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	8,890,928	-	-	-
未収委託者報酬	872,124	-	-	-
未収運用受託報酬	136,002	-	-	-
未収投資助言報酬	224,622	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの	-	386	-	-
長期差入保証金	-	-	-	96,907
合計	10,123,677	386	-	96,907

当事業年度 (平成28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	8,953,925	-	-	-
未収委託者報酬	756,595	-	-	-
未収運用受託報酬	130,048	-	-	-
未収投資助言報酬	221,366	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの	334	-	-	-
長期差入保証金	-	-	-	106,597
合計	10,062,270	-	-	106,597

(有価証券関係)

1. その他有価証券

前事業年度 (平成27年3月31日)

区分	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原 価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	100	100	0
小計	100	100	0
貸借対照表計上額が取得原 価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	286	309	23
小計	286	309	23

合計	386	409	23
----	-----	-----	----

当事業年度（平成28年3月31日）

区分	貸借対照表計上額 (千円)	取得原価 (千円)	差額 (千円)
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	1,100	1,100	0
小計	1,100	1,100	0
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの			
株式	-	-	-
債券	-	-	-
その他(投資信託)	234	309	74
小計	234	309	74
合計	1,334	1,409	74

2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

(円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他(投資信託)	101,920	1,920	-

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

(円)

区分	売却額	売却益の合計額	売却損の合計額
その他(投資信託)	100,120	120	-

3. 減損処理を行った有価証券

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)

前事業年度（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

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、当社が有する確定給付企業年金制度及び退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	47,801	千円
退職給付費用	7,316	"
退職給付の支払額	-	"
制度への拠出額	66,636	"
前払年金費用の期末残高	11,517	"

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	490,985	千円
年金資産	502,776	"
	11,790	"
非積立型制度の退職給付債務	273	"
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	11,517	"
前払年金費用	11,517	"

貸借対照表に計上された負債と資産の純額	11,517	＼
(3) 退職給付費用		
簡便法で計算した退職給付費用	7,316	千円

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

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、当社が有する確定給付企業年金制度及び退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

2. 簡便法を適用した確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

前払年金費用の期首残高	11,517	千円
退職給付費用	68,167	"
退職給付の支払額	-	"
制度への拠出額	70,213	"
前払年金費用の期末残高	13,563	"

(2) 退職給付債務及び年金資産の期末残高と貸借対照表に計上された退職給付引当金及び前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	525,902	千円
年金資産	539,738	"
	13,836	"
非積立型制度の退職給付債務	273	"
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	13,563	"
前払年金費用	13,563	"
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	13,563	"

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	68,167	千円
----------------	--------	----

(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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
繰延税金資産				
税務上の繰越欠損金	176,300	千円	-	千円
税務上の繰延資産償却超過額	15,376	"	2,764	"
賞与引当金繰入限度超過額	19,884	"	29,926	"
未払事業税	5,284	"	13,850	"
その他	18,069	"	18,825	"
繰延税金資産小計	234,915	"	65,366	"
評価性引当額	234,915	"	65,366	"
繰延税金資産合計	-	"	-	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	-	"	-	"
資産除去費用	7,565	"	6,598	"
前払年金費用	3,724	"	4,153	"
繰延税金負債合計	11,290	"	10,751	"
繰延税金負債の純額	11,290	"	10,751	"

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27年3月31日)		当事業年度 (平成28年3月31日)	
法定実効税率 (調整)	35.64	%	33.06%	%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.01	"	0.03	"
評価性引当額の増減	27.58	"	15.11	"
住民税均等割	0.20	"	0.21	"
税率変更による期末繰延税金負債の減額修正	0.10	"	0.08	"
その他	0.01	"	0.01	"
税効果会計適用後の法人税等の負担率	8.16	%	18.12	%

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

「所得税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第15号）及び「地方税法等の一部を改正する法律」（平成28年法律第13号）が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、当事業年度の繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は、前事業年度の33.06%から、平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については30.62%となります。この税率変更により繰延税金負債は847千円減少し、法人税等調整額は847千円減少しております。

（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（15年）としており、割引率は1.314%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26年4月1日 至平成27年3月31日)		当事業年度 (自平成27年4月1日 至平成28年3月31日)	
期首残高	27,735	千円	28,100	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	364	"	369	"
資産除去債務の履行による減少額	-	"	-	"
期末残高	28,100	千円	28,469	千円

（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26年4月1日 至 平成27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	5,175,093	9,348	1,456,016	412,351	7,052,810

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

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	5,069,760	7,113	1,568,398	424,417	7,069,689

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

外部顧客への売上高のうち、損益計算書の売上高の10%以上を占める相手先がないため、記載はありません。

[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26年4月1日 至 平成27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	260,000	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、及び役員の兼任	投資助言報酬	380,457	未収投資助言報酬	207,235

当事業年度（自 平成27年4月1日 至 平成28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	260,000	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、及び役員の兼任	投資助言 報酬	387,032	未収投資 助言報酬	203,706
-----	----------------------	-------------	---------	-------	----------------------	-------------------------------	------------	---------	--------------	---------

取引条件ないし取引条件の決定方針等

投資助言報酬については、契約に基づき決定しております。

(注) 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26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
1株当たり純資産額	506,814円66銭	509,017円74銭
1株当たり当期純利益金額	55,747円86銭	47,905円80銭

（注）1. 潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

2. 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27年3月31日）	当事業年度 （平成28年3月31日）
貸借対照表の純資産の部の合計額（千円）	9,572,208	9,613,818
普通株式に係る純資産額（千円）	9,572,208	9,613,818
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26年4月1日 至 平成27年3月31日）	当事業年度 （自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）
当期純利益（千円）	1,052,910	904,796
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（千円）	1,052,910	904,796
普通株式の期中平均株式数（株）	18,887	18,887

（重要な後発事象）

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

< 訂正前 >

(平成27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。

< 訂正後 >

(平成28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

< 訂正前 >

(平成27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
明治安田生命保険相互会社	730,000	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
明治安田アセットマネジメント株式会社	1,000	「金融商品取引法」に基づき、投資運用業、投資助言業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

明治安田生命保険相互会社の資本金の額は「基金」および「基金償却積立金」の合計額です。

< 訂正後 >

(平成28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
明治安田生命保険相互会社	730,000	保険業法に基づき生命保険業を営んでいます。
明治安田アセットマネジメント株式会社	1,000	「金融商品取引法」に基づき、投資運用業、投資助言業および第二種金融商品取引業を営んでいます。

明治安田生命保険相互会社の資本金の額は「基金」および「基金償却積立金」の合計額です。

3【資本関係】

〔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

< 訂正前 >

- (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27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。

< 訂正後 >

- (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28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。

独立監査人の監査報告書

平成28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 公認会計士 壁 谷 惠 嗣
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 蓑 輪 康 喜
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、「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27年4月1日から平成28年3月31日までの第30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、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28年3月31日現在の財政状態並びに同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

会社と当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以 上

(注) 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、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

平成28年11月11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

新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 蒲谷 剛史
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 伊藤 雅人
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DC先進国コアファンドの平成28年3月25日から平成28年9月24日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表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に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DC先進国コアファンドの平成28年9月24日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（平成28年3月25日から平成28年9月24日まで）の損益の状況に関する有用な情報を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. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。