

## 【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】	2019年8月15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 大崎 能正
【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トピックスプラス
【届出の対象とした募集内国投資信託受益証券の金額】	上限 5,000億円
【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DCトピックスプラス（以下「当ファンド」ということがあります。）

### （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ることとし、受益権の帰属は、後述の「（11）振替機関に関する事項」に記載の振替機関およ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。また、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

### （３）【発行（売出）価額の総額】

上限 5,000億円とします。

上記金額には、申込手数料および申込手数料に係る消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額は含まれていません。

### （４）【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額 とします。

取得申込の受付は、販売会社の営業日の午後3時までとします。なお、当該受付時間を過ぎてからの申込みは、翌営業日の取扱いとします。

基準価額は委託会社の営業日に日々計算されます。基準価額は販売会社または下記へお問い合わせください。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/>

「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。

### （５）【申込手数料】

かかりません。

自動継続投資契約に基づき、収益分配金を再投資する場合も、手数料はかかりません。

### （６）【申込単位】

1円以上1円単位

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。

確定拠出年金制度を利用して購入される加入者の申込単位は、該当運営管理機関の取決めにしたがいま

す。

**(7) 【申込期間】**

2019年8月16日から2020年2月14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】**

販売会社については、下記へお問い合わせください。

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）  
ホームページアドレス <http://www.myam.co.jp/>

**(9) 【払込期日】**

当ファンドの取得申込者は、販売会社が定める日までに申込代金を販売会社に支払うものとします。詳しくは販売会社へお問い合わせください。

なお、振替受益権に係る各取得申込日の発行価額の総額は、追加信託が行な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】**

申込みを受付けた販売会社とします。

**(11) 【振替機関に関する事項】**

振替機関は株式会社証券保管振替機構です。

**(12) 【その他】**

申込みの方法

当ファンドの申込みを行う投資者は、販売会社の定めた営業時間内に販売会社所定の方法で申込みを行うものとします。

お申込みをされる方は、当該販売会社との間で「自動けいぞく投資約款」 にしたがって契約（以下「自動けいぞく投資契約」といいます。）を締結します。

販売会社によっては、当該契約または規定については、同様の権利義務関係を規定する名称の異なる契約または規定を使用することがあり、この場合、当該別の名称に読み替えるものとします。

取得申込者の制限について

申込みを行う投資者は、原則として確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて取得申込を行う資産管理機関および国民年金基金連合会（以下「連合会」といいます。）等に限るものとします。ただし、ファンドの設定・維持のため委託会社またはその関係会社が自己の資金をもって取得する場合はこの限りではありません。

申込証拠金

該当事項はありません。

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

年1回（11月16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係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DCトピックスプラスは、信託財産の長期的な成長を目指して「日本株式エンハンストインデックスマザーファンド」（以下「マザーファンド」ということがあります。）を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

この信託は、信託財産に属する財産についての対抗要件に関する事項を除き、信託法（大正11年法律第62号）の適用を受けます。

当ファンドは一般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。

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
追加型	海外	不動産投信
	国内外	その他資産 ( )
		資産複合

（注）当ファンドが該当する商品分類を網掛け表示しています。

#### <商品分類表（網掛け表示部分）の定義>

##### 追加型

一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行なわれ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。

##### 国内

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

##### 株式

目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

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

(注) 当ファンドが該当する属性区分を網掛け表示しています。

#### <属性区分表（網掛け表示部分）の定義>

##### その他資産（投資信託証券（株式 一般））

目論見書または投資信託約款において、投資信託証券（投資形態がファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズのものをいいます。）を通じて主として株式のうち大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものに投資する旨の記載があるものをいいます。

##### 年1回

目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。

##### 日本

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日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

##### 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。

(注) 上記各表のうち網掛け表示のない商品分類および属性区分の定義については、一般社団法人投資信託協会のホームページ（アドレス：<https://www.toushin.or.jp/>）で閲覧が可能です。

信託金の限度額： 上限 5,000億円

委託会社は、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。

#### ファンドの特色

ベンチマークを東証株価指数（TOPIX）として運用を行います。

ベンチマークとの乖離を一定限度内に抑制しつつ、中長期的に安定した超過リターンの獲得を目指して運用を行います。

- 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（株）東京証券取引所という。）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（株）東京証券取引所が有する。
- （株）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る。

3. (株)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ない。
4. (株)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ない。また(株)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、責任を負わない。
5. 本ファンドは、TOPIXの指数値に連動した投資成果を目標として運用するものではなく、本ファンドの基準価額とTOPIXの指数値が著しく乖離することがある。
6. 本ファンドは、(株)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ない。
7. (株)東京証券取引所は、本件ファンドの購入者又は公衆に対し、本件ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を持たない。
8. (株)東京証券取引所は、当社又は本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ない。
9. 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は本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、責任を有しない。

独自の株式魅力度ランキング等、エンハンストインデックス運用 1 に適したクオンツ手法 2 (株式ランキングモデル) を用いて、ポートフォリオを構築します。

1 エンハンストインデックス運用のエンハンストとは、魅力や能力などが「高められた」「強化された」という意味です。当ファンドの運用手法が、クオンツ手法によってベンチマークと相対的に高い連動性を保ちながら、これに加えてベンチマークを上回る収益の獲得を目指すアクティブ運用の魅力も備わっているものである、ということを目指しております。

2 クオンツ手法とは、マーケットや個別銘柄の価格変動に影響を与える要素(ファクターといひます。)を分解・解析した上で数値化し、計量分析によってポートフォリオ(ファンドの組入銘柄群)を構築する手法です。運用にあたっては、その結果に忠実に従って運用します。

## (2)【ファンドの沿革】

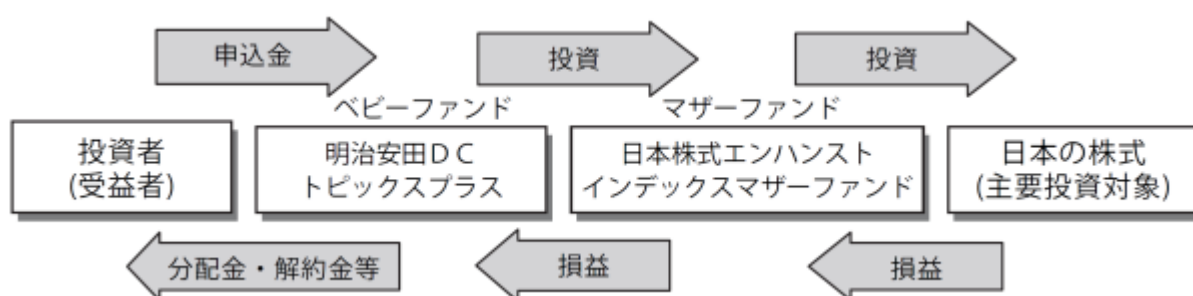
2006年2月8日	信託契約締結、信託財産の設定、運用開始
2007年10月1日	投資対象である日本株式エンハンストインデックスマザーファンドについて投資顧問会社のDSI インターナショナル マネジメント インクとの投資一任契約を解除
2010年10月1日	ファンドの委託会社としての業務を安田投信投資顧問株式会社から明治安田アセットマネジメント株式会社に承継 「DC安田トピックスプラス」から「明治安田DCトピックスプラス」へファンド名変更

当ファンドのマザーファンドである「日本株式エンハンストインデックスマザーファンド」については、2005年11月25日に信託契約が委託会社と受託会社の間で締結されています。

## (3)【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み

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とは、お客さま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。



損益はすべ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

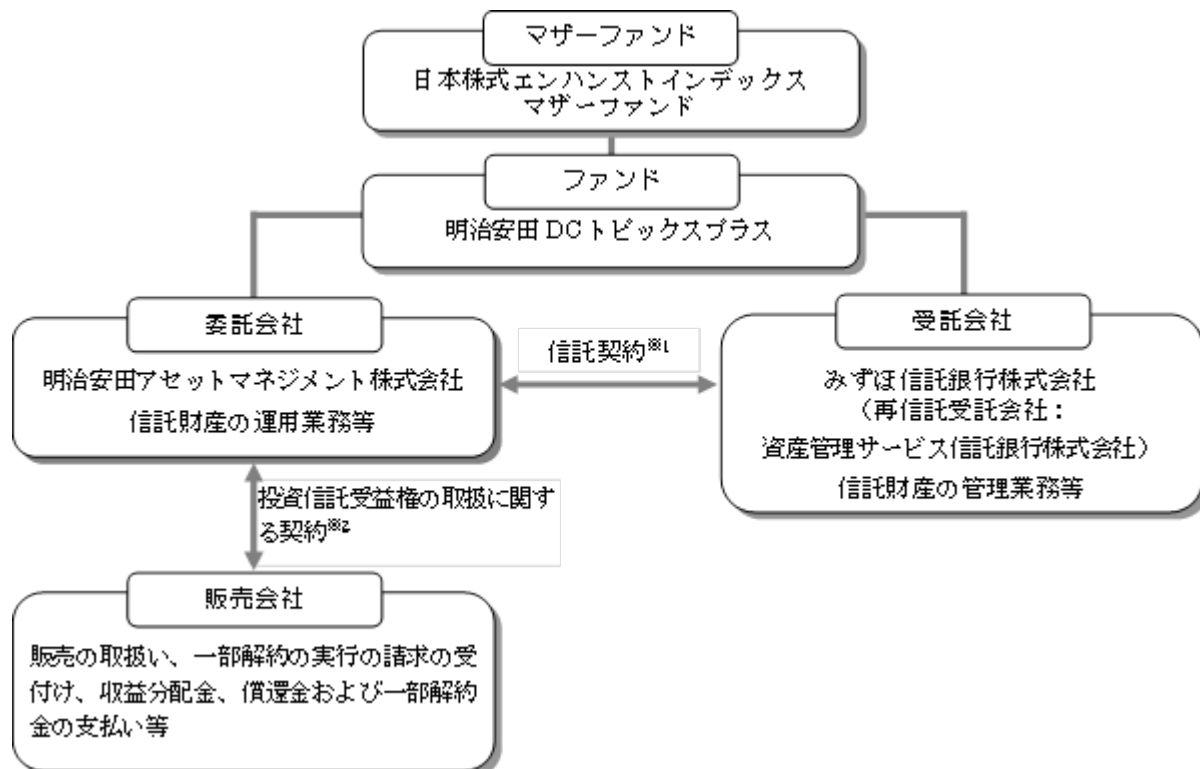
1. 委託会社(委託者): 明治安田アセットマネジメント株式会社  
信託財産の運用指図、投資信託説明書(目論見書)及び運用報告書の作成等を行います。
2. 受託会社(受託者): みずほ信託銀行株式会社

信託財産の保管・管理業務等を行います。

（受託者は信託事務の一部につき資産管理サービス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

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

1986年11月： コスモ投信株式会社設立

1998年10月： ディーアンドシーキャピタルマネー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

2000年2月： 商号を「明治ドレスナー投信株式会社」に変更

2000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

2009年4月： 商号を「MDAMアセットマネジメント株式会社」に変更

2010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・ゲー・エム・ベー・ハー	ドイツ, 60323 フランクフルト・アム・マイン, ボッケンハイマー・ラントシュトラッセ 42-44	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】

#### 基本方針

この投資信託は、我が国の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

#### 運用方法

##### 1. 投資対象

我が国の株式を主要投資対象とする「日本株式エンハンストインデックスマザーファンド」の受益証券(以下「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。なお、当該株式に直接投資する場合があります。

##### 2. 投資態度

- 主としてマザーファンド受益証券に投資し、ベンチマークとの乖離を一定限度内に抑制しつつ、中長期的に安定した超過リターンの獲得を目指して運用を行います。
- ベンチマークをTOPIX(東証株価指数)として運用を行います。
- マザーファンド受益証券の組入比率は原則として高位を維持します。ただし、市況動向等によっては、適宜変更を行う場合があります。
- ファンドの設定時、資金動向や市況動向等によっては、上記の運用と異なることがあります。

#### マザーファンドの投資方針

##### 基本方針

この投資信託は、我が国の株式を主要投資対象とし、信託財産の長期的な成長を目指して運用を行います。

##### 運用方法

##### 1. 投資対象

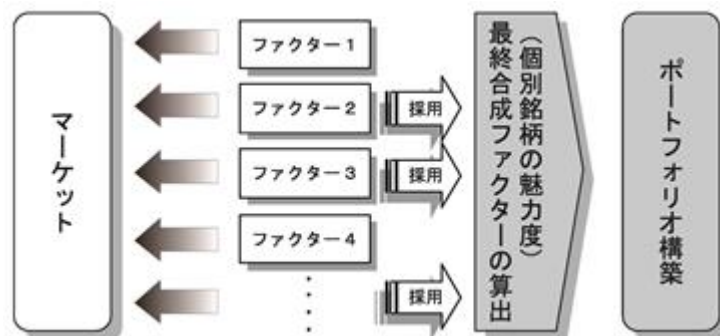
我が国の株式を主要投資対象とします。

##### 2. 投資態度

- 我が国の株式を主要投資対象とし、ベンチマークのTOPIXに対して、アクティブリスクを絞りつつ、中長期的に安定した超過リターンの獲得を目指して運用を行います。
- エンハンストインデックス手法である株式ランキングモデルによって、ポートフォリオ構築します。
- ファンドの設定時、資金動向や市況動向等によっては、上記の運用と異なる場合があります。

##### 3. 運用プロセス

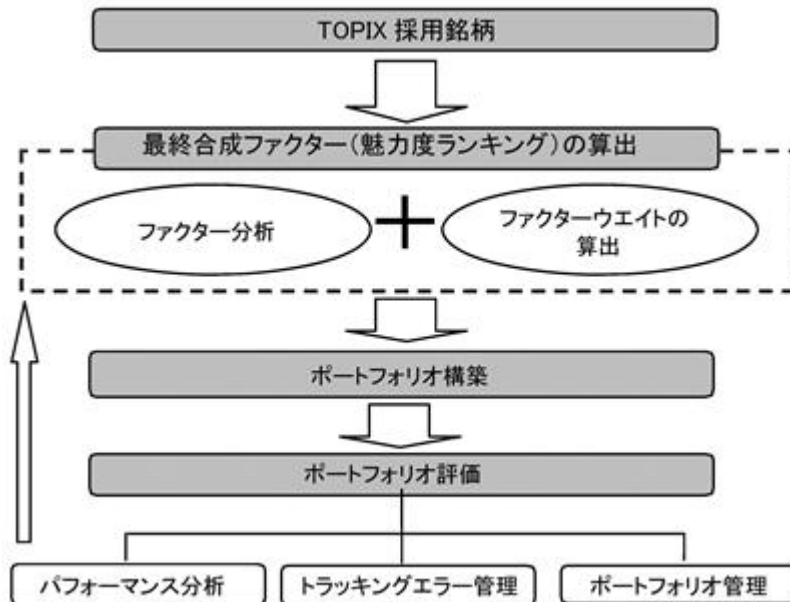
TOPIX採用銘柄を対象とした株式魅力度ランキング等のクオンツ手法を用いて、ポートフォリオを構築します。



投資対象および投資制限は、原則として「明治安田DCトピックスプラス」と実質的に同様です。

##### 4. 運用手法





- a. 次の2つの過程により最終合成ファクター（個別銘柄の魅力度ランキング）を算出し、ポートフォリオを構築します。
  - (a) モデルが採用するファクターに対し、TOPIXに採用されている銘柄のファクター値を作成します。
  - (b) ファクター間の組合せウエイトを統計学的手法によって算出し、最終合成ファクターを作成します。
- b. 各ファクター値の更新、およびウエイトの見直しを原則月に一回行い、マーケット環境に適合した運用を行います。
- c. 個別銘柄ならびに各セクターのウエイトは、TOPIXのウエイトから大きく逸脱させることのないように管理し、トラッキングエラーの発生を低位に抑制します。

運用手法等は、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。

## （２）【投資対象】

投資の対象とする資産の種類

当ファンド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、約款に定める取引に限りません。）
  - ハ．金銭債権
  - ニ．約束手形
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、主として明治安田アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、みずほ信託銀行株式会社を受託会社として締結されたマザーファンドの受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）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。）
6. 資産の流動化に関する法律に規定する特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
7. 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
8. 協同組織金融機関に係る優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
9. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券（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1. から11. 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せん。）
17. 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
18. 外国法人が発行する譲渡性預金証券
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せん。）
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21. 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. までの証券ならびに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. で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. （投資法人債券を除きます。）の証券を以下「投資信託証券」といいます。

委託会社は、信託金を、前 に掲げる有価証券のほか、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前5.の権利の性質を有するもの

前 の規定にかかわらず、この信託の設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときには、委託会社は、信託金を、前 に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### （３）【運用体制】

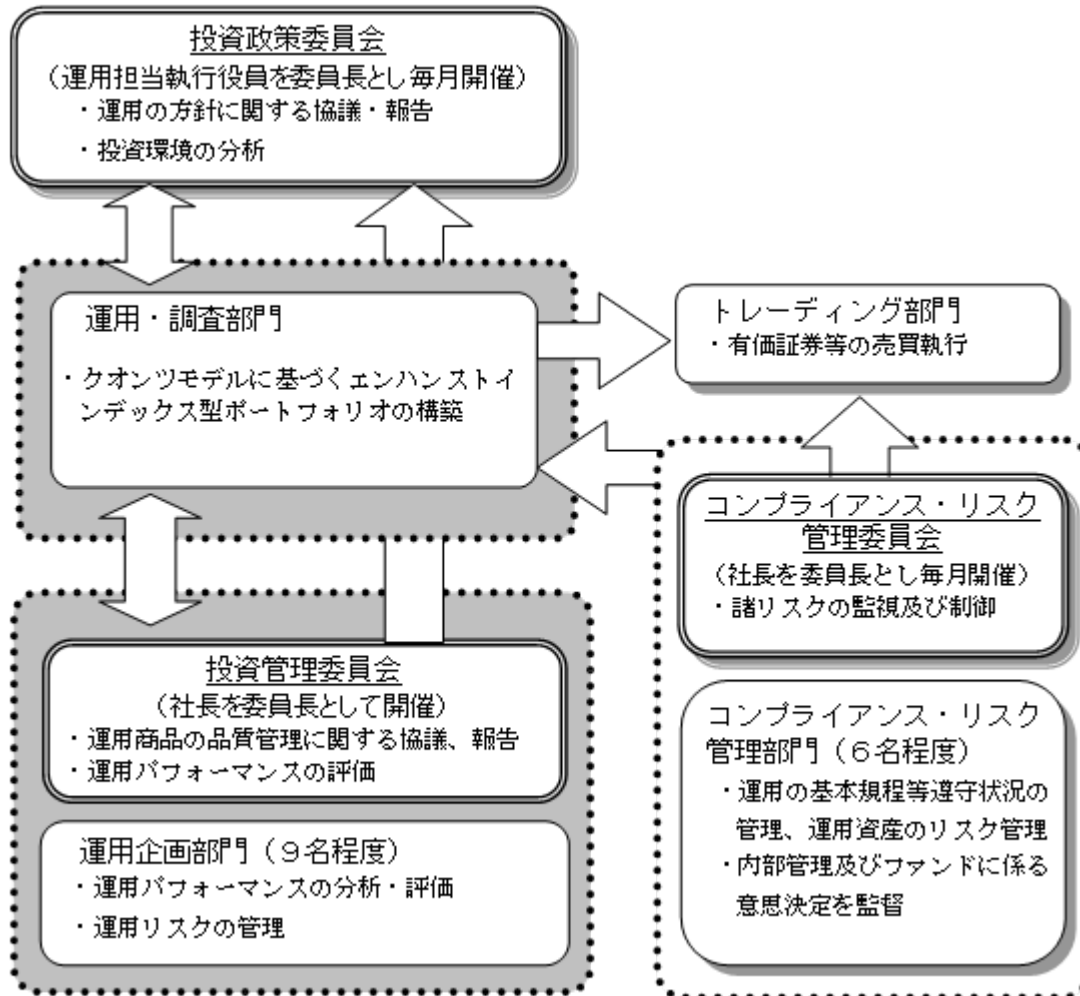
当ファンドの運用体制は以下の通りです。

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。

ファンドの運用体制等は、本書提出日現在のものであり、今後変更となることがあります。また、委託会社のホームページ (<http://www.myam.co.jp/>) の会社案内から、運用体制に関する情報がご覧いただけます。

**< 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、日々の純資産照合、月次の勘定残高照合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。

**（４）【分配方針】**

年１回（毎年11月16日。休業日の場合は翌営業日）決算を行い、原則として以下の方針に基づいて収益の分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、諸経費等控除後の利子・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、委託会社が基準価額水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合には分配を行わないこともあります。
3. 収益分配にあてず信託財産内に留保した利益については、運用の基本方針に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

**収益分配金の再投資**

収益分配金は、原則として自動的に再投資されます。委託会社は、原則として毎計算期間終了日の翌営業日に収益分配金を販売会社に交付します。この場合、販売会社は、受益者と別に定める契約に基づき受益者に遅滞なく収益分配金の再投資に係る受益権の売却を行います。なお、販売会社による自己設定に係る収益分配金は、再投資は行われずに販売会社に支払われます。

将来の収益分配金の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。

分配金は、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（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係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）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払いを開始します。なお、時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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。

**（５）【投資制限】**

投資信託約款に基づく投資制限

株式への投資制限

株式への実質投資割合には制限を設けません。

信用リスク集中回避のための投資制限

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

投資する株式等の範囲

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（金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」という場合があり、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行なう市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」という場合があります。以下同じ。）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. 前1.の規定にかかわらず、上場予定の株式、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されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができます。

新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限

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

投資信託証券への投資制限

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

同一銘柄の株式等への投資制限

1. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超える投資の指図をしません。
2. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超える投資の指図をしません。

信用取引の指図範囲

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出来ます。なお、当該売付けの決済については、株券の引渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることが出来るものとします。
2. 前1.の信用取引の指図は、次に掲げる有価証券の発行会社の発行する株券について行うことができるものとし、かつ次に掲げる株券数の合計数を超えないものとします。
  - a. 信託財産に属する株券および新株引受権証券の権利行使により取得する株券
  - b. 株式分割により取得する株券
  - c. 有償増資により取得する株券
  - d. 売出により取得する株券
  - e. 信託財産に属する新株引受権証券および新株引受権付社債券の新株引受権行使、または信託財産に属する新株予約権証券および新株予約権付社債券の新株予約権（前4.に定めるものを除きます。）の行使により取得可能な株券

先物取引等の運用指図・目的

1. 委託会社は、信託財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て取扱うものとします(以下同じ。)

2. 委託会社は、信託財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。

#### デリバティブ取引等に係る投資制限

デリバティブ取引等については、一般社団法人投資信託協会の規則に定める合理的な方法により算出した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。

#### 有価証券の貸付の指図および範囲

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について次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - b. 公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
2. 前1. 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。

#### 資金の借入れ

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、または再投資に係る収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入(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. 一部解約に伴う支払資金の手当てに係る借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および有価証券等の償還金の合計額を限度とします。
3. 収益分配金の再投資に係る借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
4. 借入金の利息は信託財産中より支弁します。

#### 外貨建資産への投資制限

外貨建資産への投資は、行いません。

#### 法律等で規制される投資制限

委託会社は、「投資信託及び投資法人に関する法律」等関係法令を遵守し、受益者のため忠実に、また受益者に対し善良な管理者の注意をもって、投資信託財産の運用の指図その他の業務を遂行しなければなりません。関係法令に定める主なものは以下の通りです。

##### < 同一株式の投資制限 >

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。

##### < 投資運用業に関する禁止行為 >

運用財産に関し、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運用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

明治安田DCトピックスプラスは、直接あるいはマザーファンドを通じて、国内の株式等、値動きのある証券に投資しますので、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。

値動きの主な要因

##### 1. 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。

##### 2. 信用リスク

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。

また、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。

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。

その他の留意点

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。

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、投資方針に沿う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。
---------------------------------------------------------

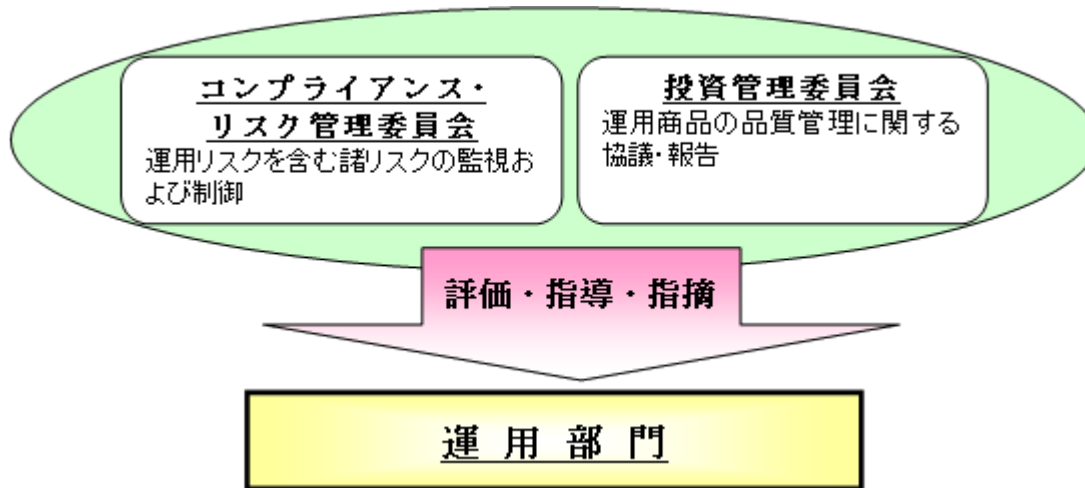


## （２）リスクに対する管理体制

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、必要に応じて指導・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。

## (3) 参考情報

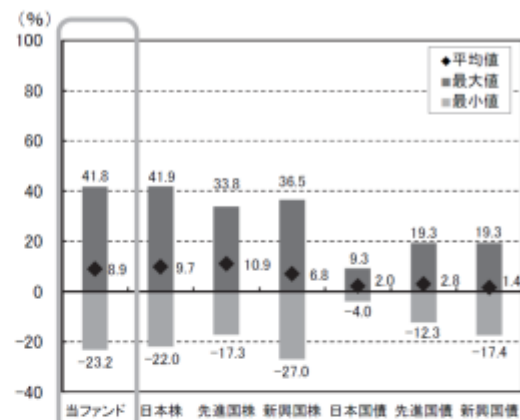
当ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移

※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。

※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。

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：2014年7月～2019年6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。

※すべての資産クラスが、当ファンドの投資対象とは限りません。

## &lt;各資産クラスの指数について&gt;

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	FTSE世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）	FTSE Fixed Income 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としています。

※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。

## < 代表的な資産クラスの指数について >

**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。

**FTSE世界国債インデックス**は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

**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。

**4【手数料等及び税金】****(1)【申込手数料】**

かかりません。

自動けいぞく投資契約に基づき、収益分配金を再投資する場合も、手数料はかかりません。

**(2)【換金（解約）手数料】**

解約手数料、信託財産留保額はありせん。

**(3)【信託報酬等】**

ファンドの純資産総額に対し、年0.702%（税抜0.65%）\*の率を乗じて得た額がファンドの計算期間を通じて毎日計上され、ファンドの日々の基準価額に反映されます。なお、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日（該当日が休業日の場合は翌営業日）および毎計算期末または信託終了のとき、信託財産中から支払われます。委託会社、販売会社、受託会社間の配分については、次の通りとします。

\*消費税率が10%となった場合は年0.715%（税抜0.65%）となります。

<内訳>

配分	料率（年率）
委託会社	0.4104%（税抜0.38%）
販売会社	0.2268%（税抜0.21%）
受託会社	0.0648%（税抜0.06%）
合計	0.702%（税抜0.65%）

消費税率が10%となった場合

配分	料率（年率）
委託会社	0.418%（税抜0.38%）
販売会社	0.231%（税抜0.21%）
受託会社	0.066%（税抜0.06%）
合計	0.715%（税抜0.65%）

<内容>

支払い先	役務の内容
委託会社	ファンドの運用、基準価額の算出、法定書類の作成等の対価
販売会社	購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理等の対価
受託会社	ファンド財産の管理、委託会社からの指図の実行等の対価
合計	運用管理費用（信託報酬）＝運用期間中の日々の基準価額×信託報酬率

販売会社への配分については、委託会社が委託者報酬として信託財産から一旦收受した後、販売会社が行う業務に対する代行手数料として販売会社に支払われます。

**（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。

信託財産にかかる費用（監査費用）として監査法人に年0.00432%（税抜0.004%）\*を支払う他、有価証券の売買の際に売買仲介人に支払う売買委託手数料、先物・オプション取引等に要する費用、その他信託財産事務の処理に要する費用等がある場合には、信託財産から支弁します。

\*消費税率が10%となった場合は年0.0044%（税抜0.004%）となります。

信託財産に関する租税、受託会社の立替えた立替金の利息ならびに資金の借入れを行った際の当該借入金の利息等がある場合には、その実費を信託財産から支弁します。

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。また、監査費用は監査法人によって見直され、変更される場合があります。

当該手数料等の合計額については、投資者の皆さま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】**

当ファンドは、確定拠出年金法に基づく確定拠出年金制度専用ファンドです。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、所得税および地方税はかかりません。なお、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用に係る税制が適用されます。

上記以外の場合における受益者（法人）の課税上の取扱いは、以下の通りです。

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。なお、地方税の源泉徴収はありません。

税率
15.315%（所得税のみ）

税法が改正された場合等には、上記の内容が変更されることがあります。税金の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認されることをお勧めいたします。

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および国民年金基金連合会等の場合は、所得税および地方税がかかりません。

**5【運用状況】**

以下は2019年6月28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ています。

**(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	296,110,509	99.47
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		1,580,930	0.53
合計(純資産総額)		297,691,439	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	日本株式エンハンスインデックス マザーファンド	220,156,513	1.4007	308,376,174	1.3450	296,110,509	99.47

## ロ. 種類別投資比率

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.47
合計	99.47

**【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4期計算期間末（2009年11月16日）	57,805,812	57,805,812	5,327	5,327
第5期計算期間末（2010年11月16日）	68,315,722	68,315,722	5,379	5,379
第6期計算期間末（2011年11月16日）	59,326,023	59,326,023	4,656	4,656
第7期計算期間末（2012年11月16日）	77,852,380	77,852,380	4,856	4,856
第8期計算期間末（2013年11月18日）	153,016,358	153,016,358	8,097	8,097
第9期計算期間末（2014年11月17日）	194,749,678	194,749,678	9,023	9,023
第10期計算期間末（2015年11月16日）	262,216,018	262,216,018	10,594	10,594
第11期計算期間末（2016年11月16日）	238,937,687	238,937,687	9,759	9,759
第12期計算期間末（2017年11月16日）	338,361,931	338,361,931	12,303	12,303
第13期計算期間末（2018年11月16日）	323,860,879	323,860,879	11,394	11,394
2018年 6月末日	329,293,334		11,957	
7月末日	336,138,244		12,136	
8月末日	333,672,056		12,021	
9月末日	353,769,404		12,645	
10月末日	324,603,954		11,515	
11月末日	332,276,458		11,643	
12月末日	295,472,637		10,442	
2019年 1月末日	312,913,819		10,973	
2月末日	319,159,755		11,201	
3月末日	304,429,876		11,154	
4月末日	306,620,123		11,320	
5月末日	287,705,813		10,581	
6月末日	297,691,439		10,866	

## 【分配の推移】

期	計算期間	1万口当たりの分配金（円）
第4期計算期間	2008年11月18日～2009年11月16日	0
第5期計算期間	2009年11月17日～2010年11月16日	0
第6期計算期間	2010年11月17日～2011年11月16日	0
第7期計算期間	2011年11月17日～2012年11月16日	0
第8期計算期間	2012年11月17日～2013年11月18日	0
第9期計算期間	2013年11月19日～2014年11月17日	0
第10期計算期間	2014年11月18日～2015年11月16日	0
第11期計算期間	2015年11月17日～2016年11月16日	0
第12期計算期間	2016年11月17日～2017年11月16日	0
第13期計算期間	2017年11月17日～2018年11月16日	0





## 【収益率の推移】

期	計算期間	収益率（％）
第4期計算期間	2008年11月18日～2009年11月16日	4.08
第5期計算期間	2009年11月17日～2010年11月16日	0.98
第6期計算期間	2010年11月17日～2011年11月16日	13.44
第7期計算期間	2011年11月17日～2012年11月16日	4.30
第8期計算期間	2012年11月17日～2013年11月18日	66.74
第9期計算期間	2013年11月19日～2014年11月17日	11.44
第10期計算期間	2014年11月18日～2015年11月16日	17.41
第11期計算期間	2015年11月17日～2016年11月16日	7.88
第12期計算期間	2016年11月17日～2017年11月16日	26.07
第13期計算期間	2017年11月17日～2018年11月16日	7.39
第14期中間計算期間	2018年11月17日～2019年 5月16日	5.56

(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4期計算期間	2008年11月18日～2009年11月16日	66,601,885	7,507,221
第5期計算期間	2009年11月17日～2010年11月16日	47,022,702	28,518,342
第6期計算期間	2010年11月17日～2011年11月16日	58,358,866	57,964,263
第7期計算期間	2011年11月17日～2012年11月16日	47,633,044	14,733,940
第8期計算期間	2012年11月17日～2013年11月18日	92,085,358	63,416,572
第9期計算期間	2013年11月19日～2014年11月17日	66,072,611	39,218,109
第10期計算期間	2014年11月18日～2015年11月16日	85,228,564	53,549,439
第11期計算期間	2015年11月17日～2016年11月16日	64,833,741	67,494,285
第12期計算期間	2016年11月17日～2017年11月16日	76,812,595	46,639,655
第13期計算期間	2017年11月17日～2018年11月16日	46,645,619	37,439,206
第14期中間計算期間	2018年11月17日～2019年 5月16日	18,288,946	28,851,338

(参考)

## 日本株式エンハンストインデックスマザーファンド

## (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	4,004,780,090	97.55
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		100,576,770	2.45
合計(純資産総額)		4,105,356,860	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(%)
株価指数先物取引	買建	日本	93,060,000	2.26

(注)先物取引は、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。

## (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	20,800	6,583.96	136,946,435	6,688.00	139,110,400	3.39
2	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	14,800	4,446.18	65,803,490	5,165.00	76,442,000	1.86
3	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	14,000	4,643.08	65,003,243	5,017.00	70,238,000	1.71
4	日本	株式	ソニー	電気機器	11,500	5,648.13	64,953,495	5,648.00	64,952,000	1.58
5	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	124,500	632.07	78,693,700	512.00	63,744,000	1.55
6	日本	株式	キーエンス	電気機器	900	60,480.00	54,432,000	66,130.00	59,517,000	1.45
7	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	14,800	4,185.00	61,938,123	3,806.00	56,328,800	1.37
8	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	14,600	4,363.31	63,704,326	3,823.00	55,815,800	1.36
9	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	16,800	3,096.41	52,019,810	2,785.00	46,788,000	1.14
10	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	12,700	3,017.14	38,317,678	3,594.00	45,643,800	1.11
11	日本	株式	KDDI	情報・通信業	15,600	2,529.59	39,461,604	2,743.50	42,798,600	1.04
12	日本	株式	東日本旅客鉄道	陸運業	4,200	10,218.97	42,919,715	10,080.00	42,336,000	1.03
13	日本	株式	三菱商事	卸売業	14,600	3,000.91	43,813,401	2,840.00	41,464,000	1.01
14	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	250,100	192.00	48,019,200	156.10	39,040,610	0.95
15	日本	株式	HOYA	精密機器	4,600	6,765.17	31,119,782	8,254.00	37,968,400	0.92
16	日本	株式	花王	化学	4,500	8,026.69	36,120,105	8,210.00	36,945,000	0.90
17	日本	株式	東海旅客鉄道	陸運業	1,700	22,131.82	37,624,094	21,580.00	36,686,000	0.89
18	日本	株式	日立製作所	電気機器	9,200	3,359.84	30,910,528	3,949.00	36,330,800	0.88

19	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	9,900	4,655.81	46,092,595	3,648.00	36,115,200	0.88
20	日本	株式	ファナック	電気機器	1,800	18,610.04	33,498,077	19,930.00	35,874,000	0.87
21	日本	株式	キヤノン	電気機器	10,800	3,189.12	34,442,596	3,146.00	33,976,800	0.83
22	日本	株式	三井物産	卸売業	19,200	1,766.91	33,924,847	1,754.00	33,676,800	0.82
23	日本	株式	NTTドコモ	情報・通信業	13,100	2,542.29	33,303,999	2,512.50	32,913,750	0.80
24	日本	株式	日本電産	電気機器	2,200	14,205.07	31,251,171	14,725.00	32,395,000	0.79
25	日本	株式	日本たばこ産業	食料品	13,500	2,749.91	37,123,915	2,379.50	32,123,250	0.78
26	日本	株式	アステラス製薬	医薬品	20,900	1,651.56	34,517,604	1,535.00	32,081,500	0.78
27	日本	株式	任天堂	その他製品	800	31,765.09	25,412,072	39,490.00	31,592,000	0.77
28	日本	株式	資生堂	化学	3,700	7,276.44	26,922,828	8,121.00	30,047,700	0.73
29	日本	株式	村田製作所	電気機器	5,900	5,241.53	30,925,059	4,840.00	28,556,000	0.70
30	日本	株式	ダイキン工業	機械	2,000	11,864.72	23,729,442	14,065.00	28,130,000	0.69

#### 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	水産・農林業	0.11
		鉱業	0.20
		建設業	2.75
		食料品	4.57
		繊維製品	0.66
		パルプ・紙	0.62
		化学	6.50
		医薬品	5.43
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	0.60
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	0.87
		非鉄金属	0.64
		金属製品	0.71
		機械	5.33
		電気機器	13.41
		輸送用機器	6.91
		精密機器	1.93
		その他製品	2.21
		電気・ガス業	1.36
		陸運業	4.38
		海運業	0.06
		空運業	0.55
		倉庫・運輸関連業	0.16
		情報・通信業	9.53
		卸売業	4.08
		小売業	4.88
		銀行業	5.20
		証券、商品先物取引業	1.10
		保険業	1.96
		その他金融業	1.46
不動産業	2.74		
サービス業	5.40		
合計		97.55	

## 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	取引所	資産の名称	買建/ 売建	数量	通貨	帳簿価額 (円)	評価額 (円)	投資比率 (%)
株価指数先物取引	大阪取引所	TOPIX先物	買建	6	日本円	93,119,684	93,060,000	2.26

(注)先物取引は、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。

## &lt;参考情報&gt;

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。

2019年6月28日現在

## 基準価額・純資産の推移



## 分配の推移

分配金の推移	
2018年11月	0円
2017年11月	0円
2016年11月	0円
2015年11月	0円
2014年11月	0円

設定来累計	0円
-------	----

※分配金は、10,000口あたりの税引前の金額

基準価額	10,866円
純資産総額	297百万円

※分配金再投資基準価額は信託報酬控除後のものであり、分配金実績があった場合に税引前分配金を再投資したものととして算出しています。

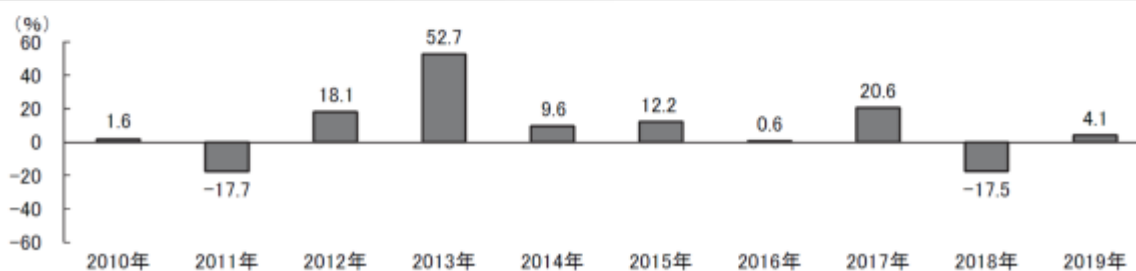
## 主要な資産の状況

## 組入上位銘柄（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	3.39
2 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.86
3 日本電信電話	情報・通信業	1.71
4 ソニー	電気機器	1.58
5 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.55
6 キーエンス	電気機器	1.45
7 三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	1.37
8 武田薬品工業	医薬品	1.36
9 本田技研工業	輸送用機器	1.14
10 リクルートホールディングス	サービス業	1.11

※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。

※2019年は6月末までの収益率を表示しています。

※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2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

#### （1）申込受付

取得申込の受付は、原則として確定拠出年金制度による取得申込となります。ただし、ファンドの設定・維持のため委託会社またはその関係会社が自己の資金をもって取得する場合はこの限りではありません。金融商品取引所における取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、取得申込の受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込の受付を取消すことがあります。

#### （2）申込単位

1円以上1円単位

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。

確定拠出年金制度を利用して購入される加入者の申込単位は、該当運営管理機関の取決めにいたします。

#### （3）申込価額

取得申込受付日の基準価額とします。受益者が、別に定める契約に基づいて収益分配金を再投資する場合の価額は、毎計算期間の末日の基準価額とします。

基準価額は販売会社または下記へお問合わせください。

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）

ホームページアドレス <http://www.myam.co.jp/>

#### （4）申込手数料

かかりません。

受益権の帰属は、振替機関等の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります。したがって、保護預りの形態はありません。取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ、自己のために開設されたファンドの受益権の振替を行なうための振替機関等の口座を示すものとし、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なわれます。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なうことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関への通知を行なうものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関への通知があった場合、社振法の規定にしたいがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行ないます。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関の定める方法により、振替機関へ当該受益権に係る信託を設定した旨の通知を行ないます。

## 2【換金（解約）手続等】

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。

### （1）解約方法

一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し行うものとします。

### （2）解約受付

解約申込の受付は、確定拠出年金制度による解約請求によります。

### （3）解約単位

1口単位

### （4）解約価額

解約請求受付日の基準価額とします。

基準価額は販売会社または下記へお問合わせください。

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）

ホームページアドレス <http://www.myam.co.jp/>

### （5）信託財産留保額

ありません。

### （6）解約代金支払

原則として、解約請求受付日から起算して4営業日目以降、販売会社の営業所等で行います。

### （7）解約に関する留意点

金融商品取引所における取引の停止、その他やむを得ない事情があるときは、一部解約の実行の請求の受付を中止することおよびすでに受付けた一部解約の実行の請求の受付を取消すことがあります。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、当該受益権の一部解約の価額は、当該受け付け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け付けたものとして計算された価額とします。

解約の請求を行なう受益者は、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なうのと引き換えに、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なうものとし、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なわれます。

なお、解約の請求を受益者がするときは、振替受益権をもって行なうものとします。

受益証券をお手許で保有されている方で、引き続き保有される場合は、解約のお申し込みに際して、個別に振替受益権とするための所要の手続きが必要であり、この手続きには時間を要しますので、ご注意ください。

買取請求については、販売会社へお問合わせください。



### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

##### 基準価額の算出

基準価額は、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価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て得た金額をいいます。当ファンドは、便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されます。

##### 組入資産の評価

主な資産の種類	評価方法
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。
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。

基準価額は委託会社の営業日に日々計算されます。

基準価額は販売会社または下記へお問合わせください。

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）

ホームページアドレス <http://www.myam.co.jp/>

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

原則として無期限です。

ただし、信託約款の規定に該当する場合は償還となることがあります。

#### (4)【計算期間】

ファンドの計算期間は、原則として毎年11月17日から翌年11月16日までとします。

各計算期間終了日に該当する日が休業日のとき、各計算期間終了日は当該日の翌営業日とし、その翌日より次の計算期間が開始されるものとします。また、最終計算期間の終了日は、ファンドの信託期間終了日とします。

#### (5)【その他】

##### 信託の終了

##### 1. 信託契約の解約

委託会社は、信託終了前に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、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出ます。

また、委託会社は、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が、10億口を下回った場合には、受託会社と合意のうえこの信託を解約し、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。

この場合、委託会社は、あらかじめ解約しようとする旨を公告し、かつその旨を記載した書面をこの信託契約に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託契約に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

前記公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。当該一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、信託契約を解約しません。委託会社は、この信託契約を解約しないこととしたときは、解約しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対し交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

ただし、前段落は、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、前記一定の期間が一月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合には適用しません。

##### 2. 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。また、委託会社は監督官庁の命令に基づいてこの信託契約を変更しようとするときは、信託約款の規定に従います。

### 3. 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委託会社に引継ぐことを命じたときは、この信託は、異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えた場合を除き、業務を引継いだ委託会社と受託会社との間において存続します。

### 4. 委託会社の事業の譲渡および承継に伴う取扱い

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

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

### 5. 受託会社の辞任および解任に伴う取扱い

受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に背いた場合、その他重要な事由が生じたときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を請求することができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は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。

### 信託約款の変更

#### 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ができるものとし、あらかじめ、変更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。

委託会社は、信託約款の変更事項のうち、その内容が重大なものについて、あらかじめ、変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面をこの信託約款に係る知られたる受益者に対して交付します。ただし、この信託約款に係る全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

前記公告および書面には、受益者で異議のある者は一定の期間内に委託会社に対して異議を述べるべき旨を付記します。なお、一定の期間は一月を下らないものとします。当該一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、信託約款の変更をしません。委託会社は、当該信託約款の変更をしないこととしたときは、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として、公告を行いません。

#### 2. 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、前記1.第2および第3段落記載の手続きに従います。

### 関係法人との契約等

委託会社と販売会社の間で締結された販売契約は、原則として契約期間満了の3ヵ月前までに委託会社、販売会社いずれかより別段の意思表示がない限り、1年毎に自動更新されます。

### 運用に係る報告

委託会社は、決算時および償還時に運用報告書を作成し、交付運用報告書は、知っている受益者に販売会社を通じて交付します。

委託会社は、投資信託及び投資法人に関する法律第14条第1項に定める運用報告書の交付に代えて、運用報告書に記載すべき事項を電磁的方法により受益者に提供することができます。この場合において、委託会社は、運用報告書を交付したものとみなします。

ただし、委託会社は、受益者から運用報告書の交付の請求があった場合には、これを交付するものとします。

### 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い、次のアドレスに掲載します。

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

#### 2. 前1.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。

### 信託事務処理の再信託

受託会社は、当ファンドに係る信託事務処理の一部について、資産管理サービス信託銀行株式会社と再信託契約を締結し、これを委託することがあります。その場合には、再信託に係る契約書類に基づいて所定の事務を行います。

### 信託約款に関する疑義の取扱い

この信託約款の解釈について疑義を生じたときは、委託会社と受託会社との協議により定めます。

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### 収益分配金・償還金の請求権

受益者は、ファンドの収益分配金・償還金を自己に帰属する受益権の口数に応じて委託会社に請求する権利を有します。収益分配金の請求権は支払開始日から5年間、償還金の請求権は支払開始日から10年間、その支払いを請求しないときはその権利を失い、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。

収益分配金または償還金の支払いは、原則としてファンドの決算日または償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日。）から起算して5営業日までに開始するものとします。

分配金は、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（当該収益分配金に係る決算日以前において一部解約が行なわれた受益権に係る受益者を除きます。また、当該収益分配金に係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て）に、原則として決算日から起算して5営業日までにお支払を開始します。なお、時効前の収益分配金に係る収益分配金交付票は、なおその効力を有するものとし、その収益分配金交付票と引き換えに受益者にお支払いします。「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税引き後無手数料で再投資されますが、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。

##### 換金（解約）の実行請求権

受益者は、販売会社を通じて委託会社に換金（解約）請求する権利を有します。

##### 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ファンドの信託財産に関する帳簿書類の閲覧・謄写を請求することができます。

##### 反対者の買取請求権

投資信託約款の変更の内容が重大なものに該当するとき、または投資信託契約の解約が行われる場合、所定の期間内に異議を述べた受益者は委託会社の指定する販売会社を通じ受託会社に対し、その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。

### 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) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第13期計算期間（2017年11月17日から2018年11月16日まで）の財務諸表について、EY新日本有限責任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DCトピックスプラス】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第12期 (2017年11月16日現在)	第13期 (2018年11月16日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	3,028,285	2,858,213
親投資信託受益証券	336,662,580	322,285,096
未収入金	600,000	-
流動資産合計	340,290,865	325,143,309
資産合計		
	340,290,865	325,143,309
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	816,324	97,179
未払受託者報酬	102,074	108,740
未払委託者報酬	1,003,674	1,069,189
その他未払費用	6,862	7,322
流動負債合計	1,928,934	1,282,430
負債合計		
	1,928,934	1,282,430
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	275,021,550	284,227,963
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	63,340,381	39,632,916
(分配準備積立金)	95,756,519	89,241,753
元本等合計	338,361,931	323,860,879
純資産合計		
	338,361,931	323,860,879
負債純資産合計		
	340,290,865	325,143,309

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位 : 円 )

	第12期 ( 自 2016年11月17日 至 2017年11月16日 )	第13期 ( 自 2017年11月17日 至 2018年11月16日 )
営業収益		
有価証券売買等損益	68,863,028	23,607,484
営業収益合計	68,863,028	23,607,484
営業費用		
受託者報酬	189,243	219,643
委託者報酬	1,860,756	2,159,683
その他費用	14,595	17,078
営業費用合計	2,064,594	2,396,404
営業利益又は営業損失 ( )	66,798,434	26,003,888
経常利益又は経常損失 ( )	66,798,434	26,003,888
当期純利益又は当期純損失 ( )	66,798,434	26,003,888
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 ( )	4,975,231	446,155
期首剰余金又は期首欠損金 ( )	5,910,923	63,340,381
剰余金増加額又は欠損金減少額	7,428,101	10,522,445
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	480,746	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	6,947,355	10,522,445
剰余金減少額又は欠損金増加額	-	8,672,177
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	8,672,177
分配金	-	-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	63,340,381	39,632,916

**（ 3 ）【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、2017年11月17日から2018年11月16日までとなっております。

（貸借対照表に関する注記）

第12期 (2017年11月16日現在)	第13期 (2018年11月16日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数 275,021,550口	1. 計算期間の末日における受益権の総数 284,227,963口
2. 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 1.2303円 (10,000口当たり純資産額) (12,303円)	2. 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 1.1394円 (10,000口当たり純資産額) (11,394円)

## （損益及び剰余金計算書に関する注記）

第12期 （自 2016年11月17日 至 2017年11月16日）			第13期 （自 2017年11月17日 至 2018年11月16日）		
分配金の計算過程 計算期間末における分配対象額は、175,731,837円 (10,000口当たり6,389円72銭)であり、分配金額は0円 としております。			分配金の計算過程 計算期間末における分配対象額は、187,270,611円 (10,000口当たり6,588円73銭)であり、分配金額は0円 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	6,354,612円	配当等収益額（費用控除後）	A	5,556,302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	41,825,995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	79,975,318円	収益調整金額	C	98,028,858円
分配準備積立金額	D	47,575,912円	分配準備積立金額	D	83,685,451円
分配対象額（A + B + C + D）	E	175,731,837円	分配対象額（A + B + C + D）	E	187,270,611円
期末受益権口数	F	275,021,550口	期末受益権口数	F	284,227,963口
10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000）	G	6,389円 72銭	10,000口当たりの分配対象額 （E ÷ F × 10,000）	G	6,588円 73銭
10,000口当たりの分配金額	H	-円 -銭	10,000口当たりの分配金額	H	-円 -銭
分配金額（F × H ÷ 10,000）	I	-円	分配金額（F × H ÷ 10,000）	I	-円



## （金融商品に関する注記）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

	第12期 (自 2016年11月17日 至 2017年11月16日)	第13期 (自 2017年11月17日 至 2018年11月16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、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。	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、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「（その他の注記）」の「2.有価証券関係」に記載しております。これらは価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスクに晒されております。	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「（その他の注記）」の「2.有価証券関係」に記載しております。これらは価格変動リスクなどの市場リスク、信用リスク、及び流動性リスクに晒されております。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社においては運用部門から独立したリスク管理に関する委員会を設け投資リスクの管理を行っております。信託約款の遵守状況、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスク等モニターしており、ガイドラインに沿った運用を行っているかにつき定期的なフォロー及びチェックを実施しております。市場リスクについてはファンド運用状況の継続モニタリングを実施し、各種委員会においてパフォーマンス動向や業種配分等のポートフォリオ特性分析などファンドの運用状況を報告します。信用リスクについては格付けその他発行体等に関する情報を収集、分析のうえファンドの商品特性に照らして組入れ銘柄の信用リスク管理をしております。また、流動性リスクについては市場流動性の状況を把握し流動性リスクを管理しております。	委託会社においては運用部門から独立したリスク管理に関する委員会を設け投資リスクの管理を行っております。信託約款の遵守状況、市場リスク、信用リスクおよび流動性リスク等モニターしており、ガイドラインに沿った運用を行っているかにつき定期的なフォロー及びチェックを実施しております。市場リスクについてはファンド運用状況の継続モニタリングを実施し、各種委員会においてパフォーマンス動向や業種配分等のポートフォリオ特性分析などファンドの運用状況を報告します。信用リスクについては格付けその他発行体等に関する情報を収集、分析のうえファンドの商品特性に照らして組入れ銘柄の信用リスク管理をしております。また、流動性リスクについては市場流動性の状況を把握し流動性リスクを管理しております。
4. 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。	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。

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

	第12期 (自 2016年11月17日 至 2017年11月16日)	第13期 (自 2017年11月17日 至 2018年11月16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ぬ。	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ぬ。
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。	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。

( 関連当事者との取引に関する注記 )

第12期 ( 自 2016年11月17日 至 2017年11月16日 )

該当事項はございませぬ。

第13期 ( 自 2017年11月17日 至 2018年11月16日 )

該当事項はございませぬ。

( その他の注記 )

## 1. 元本の移動

	第12期 (自 2016年11月17日 至 2017年11月16日)	第13期 (自 2017年11月17日 至 2018年11月16日)
期首元本額	244,848,610円	275,021,550円
期中追加設定元本額	76,812,595円	46,645,619円
期中一部解約元本額	46,639,655円	37,439,206円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

	第12期 (自 2016年11月17日 至 2017年11月16日)	第13期 (自 2017年11月17日 至 2018年11月16日)
種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)	当計算期間の損益に含まれた評価差額(円)
親投資信託受益証券	64,821,008	22,992,714
合計	64,821,008	22,992,714

## 3. デリバティブ取引関係

第12期(2017年11月16日現在)

該当事項はございません。

第13期(2018年11月16日現在)

該当事項はございません。

## (4) 【附属明細表】

## 第1 有価証券明細表

(1) 株式(2018年11月16日現在)

該当事項はございません。

(2) 株式以外の有価証券

(2018年11月16日現在)

種類	銘柄	総口数(口)	評価額(円)	備考
親投資信託受益証券	日本株式エンハンスインデックスマ ザーファンド	229,433,400	322,285,096	
合計		229,433,400	322,285,096	

## 第2 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

該当事項はございません。

（参考）

当ファンドは「日本株式エンハンスインデックスマザーファンド」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。

同親投資信託の状況は次の通りです。

また、以下に記載した情報は、監査の対象外であります。

日本株式エンハンスインデックスマザーファンド

（１）貸借対照表

	（2018年11月16日現在）
科目	金額（円）
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
金銭信託	65,450,855
株式	4,289,152,840
未収配当金	41,304,863
差入委託証拠金	10,807,500
<b>流動資産合計</b>	<b>4,406,716,058</b>
<b>資産合計</b>	<b>4,406,716,058</b>
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	8,470,092
その他未払費用	3,021
<b>流動負債合計</b>	<b>8,473,113</b>
<b>負債合計</b>	<b>8,473,113</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	3,131,159,435
<b>剰余金</b>	
剰余金又は欠損金（ ）	1,267,083,510
<b>元本等合計</b>	<b>4,398,242,945</b>
<b>純資産合計</b>	<b>4,398,242,945</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>4,406,716,058</b>

## (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) 先物取引 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、原則として、計算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または最終相場に基づいて評価しております。</p>
2. 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。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
3. その他	<p>貸借対照表は、ファンドの計算期間末の2018年11月16日現在であります。</p> <p>なお、当親投資信託の計算期間は、2017年11月17日から2018年11月16日までとなっております。</p>

(その他の注記)

(2018年11月16日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間（自 2017年11月17日 至 2018年11月16日）の元本状況	
期首（2017年11月17日）の元本額	3,871,068,440円
対象期間中の追加設定元本額	502,800,344円
対象期間中の一部解約元本額	1,242,709,349円
2018年11月16日現在の元本額の内訳	
明治安田DCトピックスプラス	229,433,400円
日本株式私募エンハンスインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,901,726,035円
計	3,131,159,435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	1.4047円
(10,000口当たり純資産額)	(14,047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

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

(2018年11月16日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	日本水産	2,300	706.00	1,623,800	
	マルハニチロ	400	4,280.00	1,712,000	
	サカタのタネ	300	3,720.00	1,116,000	
	ホクト	2,500	2,010.00	5,025,000	
	国際石油開発帝石	9,900	1,263.50	12,508,650	
	ミライト・ホールディングス	1,400	1,583.00	2,216,200	
	東急建設	800	1,123.00	898,400	
	大成建設	2,000	4,805.00	9,610,000	
	大林組	5,400	1,088.00	5,875,200	
	清水建設	4,900	916.00	4,488,400	
	長谷工コーポレーション	1,700	1,285.00	2,184,500	
	鹿島建設	4,000	1,501.00	6,004,000	
	大東建託	1,200	14,615.00	17,538,000	
	大和ハウス工業	8,700	3,431.00	29,849,700	
	ライト工業	800	1,457.00	1,165,600	
	積水ハウス	7,300	1,696.50	12,384,450	
	東芝プラントシステム	700	2,388.00	1,671,600	
	日清製粉グループ本社	2,100	2,283.00	4,794,300	
	三井製糖	2,700	3,075.00	8,302,500	
	江崎グリコ	600	5,270.00	3,162,000	
	山崎製パン	1,500	2,350.00	3,525,000	
	カルビー	800	3,740.00	2,992,000	
	森永乳業	200	3,310.00	662,000	
	ヤクルト本社	1,400	8,090.00	11,326,000	
	明治ホールディングス	1,200	8,710.00	10,452,000	
	日本ハム	700	4,165.00	2,915,500	
	サッポロホールディングス	300	2,450.00	735,000	
	アサヒグループホールディングス	3,900	5,027.00	19,605,300	
	キリンホールディングス	8,700	2,562.00	22,289,400	
	コカ・コーラ ボトラーズジャパンディン グス	1,300	3,285.00	4,270,500	
	サントリー食品インターナショナル	1,400	4,525.00	6,335,000	
	伊藤園	600	5,220.00	3,132,000	
	キッコーマン	1,200	6,040.00	7,248,000	
	味の素	4,300	1,926.50	8,283,950	
	キューピー	400	2,727.00	1,090,800	
	東洋水産	1,000	3,805.00	3,805,000	
	日清食品ホールディングス	700	7,140.00	4,998,000	
	日本たばこ産業	11,100	2,818.00	31,279,800	
	東洋紡	5,400	1,601.00	8,645,400	
	帝人	6,500	1,922.00	12,493,000	
	東レ	12,000	897.10	10,765,200	
	王子ホールディングス	17,900	684.00	12,243,600	
	レンゴー	6,500	903.00	5,869,500	

ザ・パック	1,000	3,330.00	3,330,000
クラレ	8,500	1,726.00	14,671,000
旭化成	11,200	1,225.50	13,725,600
昭和電工	2,700	4,245.00	11,461,500
住友化学	30,000	587.00	17,610,000
東ソー	2,500	1,573.00	3,932,500
トクヤマ	400	2,678.00	1,071,200
デンカ	2,700	3,435.00	9,274,500
信越化学工業	2,900	9,430.00	27,347,000
エア・ウォーター	5,300	1,821.00	9,651,300
日本触媒	700	7,080.00	4,956,000
三菱瓦斯化学	3,400	1,797.00	6,109,800
三井化学	2,800	2,860.00	8,008,000
J S R	6,400	1,727.00	11,052,800
三菱ケミカルホールディングス	22,100	922.00	20,376,200
K Hネオケム	1,300	3,225.00	4,192,500
ダイセル	6,300	1,246.00	7,849,800
積水化学工業	1,800	1,838.00	3,308,400
宇部興産	4,800	2,542.00	12,201,600
日立化成	4,200	1,757.00	7,379,400
花王	4,500	8,015.00	36,067,500
関西ペイント	400	1,739.00	695,600
D I C	600	3,460.00	2,076,000
富士フイルムホールディングス	2,200	4,562.00	10,036,400
資生堂	4,100	7,290.00	29,889,000
ライオン	1,000	2,053.00	2,053,000
コーセー	300	18,660.00	5,598,000
ポーラ・オルビスホールディングス	300	3,150.00	945,000
日東電工	2,200	6,027.00	13,259,400
ニフコ	200	2,832.00	566,400
ユニ・チャーム	3,900	3,352.00	13,072,800
協和発酵キリン	1,500	2,273.00	3,409,500
武田薬品工業	9,200	4,293.00	39,495,600
アステラス製薬	22,600	1,664.00	37,606,400
大日本住友製薬	2,000	2,938.00	5,876,000
塩野義製薬	2,400	7,547.00	18,112,800
田辺三菱製薬	6,600	1,669.00	11,015,400
中外製薬	1,900	7,080.00	13,452,000
科研製薬	1,700	5,520.00	9,384,000
エーザイ	2,800	10,050.00	28,140,000
小野薬品工業	6,800	2,674.50	18,186,600
参天製薬	1,700	1,859.00	3,160,300
日医工	4,900	1,701.00	8,334,900
東和薬品	400	8,170.00	3,268,000
沢井製薬	2,200	5,620.00	12,364,000
ゼリア新薬工業	2,800	2,079.00	5,821,200
第一三共	3,000	4,064.00	12,192,000
大塚ホールディングス	3,500	5,195.00	18,182,500

ペプチドリーム	800	4,275.00	3,420,000
昭和シェル石油	3,800	1,824.00	6,931,200
出光興産	700	4,290.00	3,003,000
J X T Gホールディングス	44,500	684.60	30,464,700
横浜ゴム	5,400	2,343.00	12,652,200
ブリヂストン	7,000	4,312.00	30,184,000
住友ゴム工業	6,000	1,561.00	9,366,000
A G C	4,100	3,810.00	15,621,000
日本電気硝子	1,200	2,895.00	3,474,000
太平洋セメント	700	3,775.00	2,642,500
日本カーボン	1,200	5,500.00	6,600,000
日本碍子	300	1,650.00	495,000
日本特殊陶業	3,000	2,421.00	7,263,000
新日鐵住金	7,000	2,143.50	15,004,500
神戸製鋼所	2,900	954.00	2,766,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	8,100	2,104.50	17,046,450
日本冶金工業	34,100	287.00	9,786,700
三井金属鉱業	300	2,409.00	722,700
住友金属鉱山	1,100	3,251.00	3,576,100
古河電気工業	300	3,150.00	945,000
住友電気工業	4,600	1,555.00	7,153,000
フジクラ	2,200	474.00	1,042,800
S U M C O	2,000	1,515.00	3,030,000
東プレ	300	2,353.00	705,900
日本製鋼所	4,200	2,164.00	9,088,800
オークマ	1,600	5,360.00	8,576,000
オーエスジー	2,400	2,192.00	5,260,800
D M G 森精機	6,800	1,459.00	9,921,200
ナブテスコ	400	2,758.00	1,103,200
S M C	500	36,700.00	18,350,000
小松製作所	8,200	2,927.00	24,001,400
住友重機械工業	3,000	3,635.00	10,905,000
クボタ	7,500	1,906.00	14,295,000
ダイキン工業	2,000	11,715.00	23,430,000
栗田工業	200	2,880.00	576,000
理想科学工業	200	1,963.00	392,600
S A N K Y O	800	4,510.00	3,608,000
ホシザキ	100	8,400.00	840,000
日本精工	9,000	1,049.00	9,441,000
N T N	23,400	369.00	8,634,600
ジェイテクト	3,500	1,347.00	4,714,500
不二越	200	4,545.00	909,000
T H K	700	2,409.00	1,686,300
マキタ	1,000	4,410.00	4,410,000
三菱重工業	5,100	4,298.00	21,919,800
I H I	700	3,810.00	2,667,000
スター精密	5,100	1,533.00	7,818,300
コニカミノルタ	900	1,064.00	957,600



ブラザー工業	4,700	1,871.00	8,793,700
ミネベアミツミ	2,100	1,616.00	3,393,600
日立製作所	11,200	3,366.00	37,699,200
三菱電機	21,400	1,440.00	30,816,000
富士電機	1,400	3,375.00	4,725,000
安川電機	1,000	3,285.00	3,285,000
日本電産	2,000	14,355.00	28,710,000
ヤーマン	2,200	2,192.00	4,822,400
オムロン	1,200	4,705.00	5,646,000
日本電気	1,400	3,370.00	4,718,000
富士通	500	6,947.00	3,473,500
サンケン電気	1,200	2,484.00	2,980,800
ルネサスエレクトロニクス	3,300	568.00	1,874,400
ワコム	12,200	554.00	6,758,800
能美防災	400	2,332.00	932,800
パナソニック	21,500	1,111.00	23,886,500
シャープ	700	1,689.00	1,182,300
アンリツ	2,100	1,721.00	3,614,100
ソニー	12,700	5,690.00	72,263,000
アルプス電気	900	2,473.00	2,225,700
フォスター電機	1,200	1,507.00	1,808,400
ホシデン	6,500	849.00	5,518,500
ヒロセ電機	900	11,700.00	10,530,000
日本航空電子工業	4,500	1,406.00	6,327,000
堀場製作所	300	4,960.00	1,488,000
アドバンテスト	5,800	2,164.00	12,551,200
キーエンス	1,100	60,480.00	66,528,000
シスメックス	1,000	6,460.00	6,460,000
レーザーテック	400	3,060.00	1,224,000
スタンレー電気	3,700	3,320.00	12,284,000
日本電子	900	1,924.00	1,731,600
ファナック	2,000	18,640.00	37,280,000
ローム	400	7,700.00	3,080,000
浜松ホトニクス	600	3,755.00	2,253,000
京セラ	1,900	5,809.00	11,037,100
村田製作所	1,400	16,075.00	22,505,000
小糸製作所	700	5,840.00	4,088,000
キャノン電子	2,800	2,066.00	5,784,800
キャノン	9,400	3,217.00	30,239,800
東京エレクトロン	1,800	14,400.00	25,920,000
ユニプレス	4,400	2,098.00	9,231,200
豊田自動織機	800	5,640.00	4,512,000
デンソー	4,300	5,110.00	21,973,000
三井E & Sホールディングス	2,200	1,076.00	2,367,200
日産自動車	18,600	1,010.00	18,786,000
いすゞ自動車	2,100	1,574.00	3,305,400
トヨタ自動車	21,800	6,591.00	143,683,800
三菱自動車工業	1,900	731.00	1,388,900

NOK	6,100	1,624.00	9,906,400
アイシン精機	1,100	4,370.00	4,807,000
マツダ	3,000	1,186.50	3,559,500
本田技研工業	14,800	3,184.00	47,123,200
スズキ	3,200	5,322.00	17,030,400
SUBARU	2,900	2,532.50	7,344,250
ヤマハ発動機	700	2,285.00	1,599,500
ショーワ	3,800	1,507.00	5,726,600
エクセディ	300	2,834.00	850,200
シマノ	200	15,840.00	3,168,000
テルモ	1,300	6,164.00	8,013,200
日機装	1,500	1,123.00	1,684,500
島津製作所	2,900	2,453.00	7,113,700
マニー	1,000	4,940.00	4,940,000
ニコン	6,500	1,811.00	11,771,500
オリンパス	200	3,660.00	732,000
HOYA	5,300	6,777.00	35,918,100
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,490.00	5,837,000
パンダイナムコホールディングス	800	4,800.00	3,840,000
タカラトミー	6,600	1,269.00	8,375,400
凸版印刷	700	1,774.00	1,241,800
大日本印刷	1,000	2,559.00	2,559,000
NISSHA	3,900	1,842.00	7,183,800
アシックス	700	1,588.00	1,111,600
ピジョン	300	5,140.00	1,542,000
リンテック	4,100	2,604.00	10,676,400
任天堂	1,300	31,860.00	41,418,000
東京電力ホールディングス	14,200	641.00	9,102,200
中部電力	2,600	1,659.00	4,313,400
関西電力	4,600	1,830.50	8,420,300
九州電力	8,300	1,356.00	11,254,800
北海道電力	16,600	726.00	12,051,600
電源開発	3,800	2,971.00	11,289,800
東京瓦斯	7,300	2,834.50	20,691,850
大阪瓦斯	800	2,134.00	1,707,200
西部瓦斯	1,100	2,300.00	2,530,000
相鉄ホールディングス	1,400	3,405.00	4,767,000
東京急行電鉄	1,600	1,877.00	3,003,200
京浜急行電鉄	2,800	1,740.00	4,872,000
小田急電鉄	3,200	2,443.00	7,817,600
京成電鉄	300	3,560.00	1,068,000
東日本旅客鉄道	4,200	10,215.00	42,903,000
西日本旅客鉄道	2,600	7,988.00	20,768,800
東海旅客鉄道	2,000	22,055.00	44,110,000
西武ホールディングス	4,900	2,179.00	10,677,100
ハマキョウレックス	300	3,895.00	1,168,500
近鉄グループホールディングス	1,100	4,545.00	4,999,500
阪急阪神ホールディングス	4,500	3,780.00	17,010,000

南海電気鉄道	4,500	2,736.00	12,312,000
日本通運	300	7,260.00	2,178,000
ヤマトホールディングス	1,800	2,856.00	5,140,800
センコーグループホールディングス	2,400	839.00	2,013,600
ニッコンホールディングス	3,800	2,935.00	11,153,000
福山通運	700	4,815.00	3,370,500
セイノーホールディングス	400	1,648.00	659,200
九州旅客鉄道	3,200	3,570.00	11,424,000
S Gホールディングス	400	2,824.00	1,129,600
商船三井	500	2,631.00	1,315,500
飯野海運	20,600	465.00	9,579,000
日本航空	5,700	4,204.00	23,962,800
A N Aホールディングス	700	4,058.00	2,840,600
住友倉庫	3,900	1,406.00	5,483,400
近鉄エクスプレス	5,200	1,823.00	9,479,600
N E C ネットエスアイ	3,000	2,511.00	7,533,000
コーエーテックホールディングス	5,000	1,743.00	8,715,000
ネクソン	2,000	1,114.00	2,228,000
コロプラ	10,100	858.00	8,665,800
ブロードリーフ	10,500	615.00	6,457,500
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	43,200	240.00	10,368,000
野村総合研究所	2,000	5,010.00	10,020,000
フジ・メディア・ホールディングス	4,100	1,754.00	7,191,400
ヤフー	39,700	305.00	12,108,500
トレンドマイクロ	1,600	6,300.00	10,080,000
日本オラクル	1,500	7,180.00	10,770,000
オービックビジネスコンサルタント	100	9,310.00	931,000
大塚商会	2,800	3,755.00	10,514,000
東京放送ホールディングス	500	2,008.00	1,004,000
日本テレビホールディングス	2,900	1,813.00	5,257,700
テレビ朝日ホールディングス	4,200	2,239.00	9,403,800
スカパーJ S A Tホールディングス	6,600	535.00	3,531,000
テレビ東京ホールディングス	2,900	2,513.00	7,287,700
日本電信電話	12,500	4,594.00	57,425,000
K D D I	19,500	2,527.50	49,286,250
光通信	300	18,860.00	5,658,000
N T T ドコモ	11,900	2,567.50	30,553,250
東宝	300	3,655.00	1,096,500
D T S	200	4,010.00	802,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	400	3,600.00	1,440,000
T K C	2,400	4,040.00	9,696,000
コナミホールディングス	300	4,870.00	1,461,000
ソフトバンクグループ	7,300	8,802.00	64,254,600
双日	10,500	405.00	4,252,500
アルフレッサ ホールディングス	1,900	3,075.00	5,842,500
あい ホールディングス	2,300	2,107.00	4,846,100
T O K A Iホールディングス	3,400	942.00	3,202,800
シップヘルスケアホールディングス	1,300	4,065.00	5,284,500

コメダホールディングス	1,000	2,292.00	2,292,000
メディパルホールディングス	1,700	2,580.00	4,386,000
伊藤忠商事	13,500	2,017.00	27,229,500
丸紅	18,100	860.10	15,567,810
長瀬産業	6,100	1,617.00	9,863,700
豊田通商	2,000	3,925.00	7,850,000
三井物産	15,500	1,790.50	27,752,750
山善	2,800	1,134.00	3,175,200
住友商事	11,500	1,747.50	20,096,250
三菱商事	13,100	3,020.00	39,562,000
阪和興業	200	3,185.00	637,000
東邦ホールディングス	1,000	3,140.00	3,140,000
伊藤忠エネクス	1,600	1,053.00	1,684,800
オートバックスセブン	3,500	1,736.00	6,076,000
イエローハット	2,500	2,855.00	7,137,500
因幡電機産業	1,300	4,645.00	6,038,500
ミスミグループ本社	1,900	2,251.00	4,276,900
スズケン	800	5,940.00	4,752,000
ローソン	600	7,140.00	4,284,000
ゲオホールディングス	5,700	1,890.00	10,773,000
ジンス	1,600	6,790.00	10,864,000
MonotaRO	1,200	2,713.00	3,255,600
J.フロント リテイリング	2,200	1,609.00	3,539,800
マツモトキヨシホールディングス	700	4,220.00	2,954,000
ZOZO	2,000	2,299.00	4,598,000
ココカラファイン	1,700	6,310.00	10,727,000
三越伊勢丹ホールディングス	3,400	1,327.00	4,511,800
セブン&アイ・ホールディングス	7,700	5,001.00	38,507,700
ツルハホールディングス	300	11,400.00	3,420,000
サンマルクホールディングス	900	2,910.00	2,619,000
トリドールホールディングス	3,100	1,766.00	5,474,600
クスリのアオキホールディングス	200	8,300.00	1,660,000
スシローグローバルホールディングス	1,000	6,330.00	6,330,000
良品計画	200	29,370.00	5,874,000
コーナン商事	300	2,704.00	811,200
ドンキホーテホールディングス	1,000	6,970.00	6,970,000
サイゼリヤ	1,200	2,227.00	2,672,400
ユナイテッドアローズ	300	3,985.00	1,195,500
スギホールディングス	900	5,240.00	4,716,000
ユニー・ファミリーマートホールディングス	500	15,270.00	7,635,000
木曽路	2,200	2,582.00	5,680,400
上新電機	700	2,688.00	1,881,600
島忠	1,200	2,962.00	3,554,400
コメリ	1,800	2,853.00	5,135,400
しまむら	400	9,430.00	3,772,000
高島屋	6,700	1,892.00	12,676,400
松屋	5,600	1,109.00	6,210,400
エイチ・ツー・オー リテイリング	4,700	1,930.00	9,071,000

丸井グループ	1,700	2,537.00	4,312,900
イオン	7,300	2,684.50	19,596,850
フジ	4,200	2,142.00	8,996,400
ケーズホールディングス	2,000	1,232.00	2,464,000
ヤマダ電機	6,100	537.00	3,275,700
ニトリホールディングス	700	14,495.00	10,146,500
ファーストリテイリング	300	59,850.00	17,955,000
サンドラッグ	700	4,015.00	2,810,500
めぶきフィナンシャルグループ	4,600	341.00	1,568,600
九州フィナンシャルグループ	16,800	514.00	8,635,200
ゆうちょ銀行	6,200	1,330.00	8,246,000
コンコルディア・フィナンシャルグループ	1,700	526.00	894,200
西日本フィナンシャルホールディングス	3,300	1,191.00	3,930,300
あおぞら銀行	2,200	3,845.00	8,459,000
三菱UFJフィナンシャル・グループ	119,400	651.80	77,824,920
りそなホールディングス	10,800	575.30	6,213,240
三井住友トラスト・ホールディングス	2,800	4,540.00	12,712,000
三井住友フィナンシャルグループ	12,700	4,273.00	54,267,100
千葉銀行	1,400	733.00	1,026,200
静岡銀行	9,600	1,064.00	10,214,400
十六銀行	3,500	2,600.00	9,100,000
八十二銀行	21,400	505.00	10,807,000
北國銀行	2,500	4,095.00	10,237,500
滋賀銀行	2,500	2,770.00	6,925,000
ほくほくフィナンシャルグループ	8,200	1,467.00	12,029,400
伊予銀行	14,100	672.00	9,475,200
宮崎銀行	900	3,265.00	2,938,500
みずほフィナンシャルグループ	263,700	192.60	50,788,620
SBIホールディングス	400	2,846.00	1,138,400
ジャフコ	2,100	4,365.00	9,166,500
大和証券グループ本社	9,900	625.80	6,195,420
野村ホールディングス	25,200	511.40	12,887,280
岡三証券グループ	8,800	545.00	4,796,000
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,000	578.00	10,982,000
カブドットコム証券	15,800	416.00	6,572,800
かんぽ生命保険	1,200	2,799.00	3,358,800
SOMPOホールディングス	2,100	4,557.00	9,569,700
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	7,700	3,417.00	26,310,900
ソニーフィナンシャルホールディングス	2,600	2,440.00	6,344,000
第一生命ホールディングス	8,200	2,061.50	16,904,300
東京海上ホールディングス	8,000	5,401.00	43,208,000
T&Dホールディングス	8,700	1,743.00	15,164,100
イオンフィナンシャルサービス	1,300	2,276.00	2,958,800
ジャックス	4,800	2,165.00	10,392,000
オリックス	12,300	1,797.00	22,103,100
三菱UFJリース	4,600	592.00	2,723,200
日本取引所グループ	5,000	2,033.00	10,165,000
ヒューリック	11,500	1,056.00	12,144,000

	野村不動産ホールディングス	300	2,180.00	654,000	
	ユニゾホールディングス	4,900	2,363.00	11,578,700	
	パーク24	1,100	3,000.00	3,300,000	
	三井不動産	7,700	2,743.00	21,121,100	
	三菱地所	16,800	1,789.00	30,055,200	
	住友不動産	3,000	4,137.00	12,411,000	
	イオンモール	4,000	2,107.00	8,428,000	
	コシダカホールディングス	2,700	1,364.00	3,682,800	
	パーソルホールディングス	300	1,993.00	597,900	
	カカクコム	2,900	2,017.00	5,849,300	
	エムスリー	2,300	1,720.00	3,956,000	
	博報堂DYホールディングス	300	1,742.00	522,600	
	ケネディクス	18,300	524.00	9,589,200	
	電通	3,700	5,060.00	18,722,000	
	みらかホールディングス	3,800	2,753.00	10,461,400	
	オリエンタルランド	1,600	10,815.00	17,304,000	
	ダスキン	2,900	2,388.00	6,925,200	
	ラウンドワン	7,600	1,206.00	9,165,600	
	リゾートトラスト	4,500	1,796.00	8,082,000	
	ビー・エム・エル	700	2,754.00	1,927,800	
	ユー・エス・エス	700	1,914.00	1,339,800	
	楽天	17,500	940.00	16,450,000	
	テクノプロ・ホールディングス	700	5,460.00	3,822,000	
	ジャパンマテリアル	500	1,090.00	545,000	
	リクルートホールディングス	13,400	3,021.00	40,481,400	
	日本郵政	10,100	1,388.00	14,018,800	
	ベルシステム24ホールディングス	1,900	1,469.00	2,791,100	
	東京都競馬	2,000	3,300.00	6,600,000	
	カナモト	2,000	3,475.00	6,950,000	
	東京ドーム	10,200	1,001.00	10,210,200	
	西尾レントオール	1,400	3,945.00	5,523,000	
	セコム	1,300	9,000.00	11,700,000	
	ベネッセホールディングス	3,800	3,210.00	12,198,000	
	ダイセキ	600	2,674.00	1,604,400	
小計		2,241,100		4,289,152,840	
合計				4,289,152,840	

(2) 株式以外の有価証券(2018年11月16日現在)

該当事項はございません。

## 第2 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

(2018年11月16日現在)

区分	種類	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	106,060,092	-	97,590,000	8,470,092

合計	-	-	-	8,470,092
----	---	---	---	-----------

## (注) 時価の算定方法

## 株価指数先物取引

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また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。

\* 上記取引で、ヘッジ会計が適用されているものはありません。

**【中間財務諸表】**

（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14期中間計算期間（2018年11月17日から2019年5月16日まで）の中間財務諸表について、EY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。



## 中間財務諸表

## 【明治安田DCトピックスプラス】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	第13期計算期間末 (2018年11月16日現在)	第14期中間計算期間末 (2019年5月16日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	2,858,213	2,610,540
親投資信託受益証券	322,285,096	292,932,599
流動資産合計	325,143,309	295,543,139
資産合計	325,143,309	295,543,139
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	97,179	-
未払受託者報酬	108,740	99,433
未払委託者報酬	1,069,189	977,657
その他未払費用	7,322	6,692
流動負債合計	1,282,430	1,083,782
負債合計	1,282,430	1,083,782
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	284,227,963	273,665,571
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	39,632,916	20,793,786
(分配準備積立金)	89,241,753	80,490,286
元本等合計	323,860,879	294,459,357
純資産合計	323,860,879	294,459,357
負債純資産合計	325,143,309	295,543,139

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第13期中間計算期間 (自 2017年11月17日 至 2018年5月16日)	第14期中間計算期間 (自 2018年11月17日 至 2019年5月16日)
営業収益		
有価証券売買等損益	6,668,448	16,682,497
営業収益合計	6,668,448	16,682,497
営業費用		
受託者報酬	110,903	99,433
委託者報酬	1,090,494	977,657
その他費用	8,656	7,699
営業費用合計	1,210,053	1,084,789
営業利益又は営業損失( )	5,458,395	17,767,286
経常利益又は経常損失( )	5,458,395	17,767,286
中間純利益又は中間純損失( )	5,458,395	17,767,286
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( )	36,417	1,106,381
期首剰余金又は期首欠損金( )	63,340,381	39,632,916
剰余金増加額又は欠損金減少額	5,660,639	1,803,423
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	5,660,639	1,803,423
剰余金減少額又は欠損金増加額	5,169,646	3,981,648
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	5,169,646	3,981,648
分配金	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	69,326,186	20,793,786

**（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、2018年11月17日から2019年11月18日までとなっております。 なお、当該中間計算期間は、2018年11月17日から2019年5月16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13期計算期間末 (2018年11月16日現在)	第14期中間計算期間末 (2019年5月16日現在)
1. 計算期間の末日における受益権の総数 284,227,963口	1. 中間計算期間の末日における受益権の総数 273,665,571口
2. 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 1.1394円 (10,000口当たり純資産額) (11,394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 1.0760円 (10,000口当たり純資産額) (10,760円)

（中間損益及び剰余金計算書に関する注記）

第13期中間計算期間（自 2017年11月17日 至 2018年5月16日）  
該当事項はございません。

第14期中間計算期間（自 2018年11月17日 至 2019年5月16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13期計算期間 (自 2017年11月17日 至 2018年11月16日)	第14期中間計算期間 (自 2018年11月17日 至 2019年5月16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。	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。	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13期計算期間 (自 2017年11月17日 至 2018年11月16日)	第14期中間計算期間 (自 2018年11月17日 至 2019年5月16日)
期首元本額	275,021,550円	284,227,963円
期中追加設定元本額	46,645,619円	18,288,946円
期中一部解約元本額	37,439,206円	28,851,338円

## 2. デリバティブ取引関係

第13期計算期間末(2018年11月16日現在)

該当事項はございません。

第14期中間計算期間末(2019年5月16日現在)

該当事項はございません。

（参考）

当ファンドは「日本株式エンハンスインデックスマザーファンド」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。

日本株式エンハンスインデックスマザーファンド

（１）貸借対照表

(2019年5月16日現在)	
科目	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
金銭信託	34,827,811
株式	3,973,919,720
未収配当金	50,686,012
差入委託証拠金	4,957,900
<b>流動資産合計</b>	<b>4,064,391,443</b>
<b>資産合計</b>	<b>4,064,391,443</b>
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
派生商品評価勘定	2,662,220
その他未払費用	1,543
<b>流動負債合計</b>	<b>2,663,763</b>
<b>負債合計</b>	<b>2,663,763</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	3,052,391,052
<b>剰余金</b>	
剰余金又は欠損金( )	1,009,336,628
<b>元本等合計</b>	<b>4,061,727,680</b>
<b>純資産合計</b>	<b>4,061,727,680</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>4,064,391,443</b>

## (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) 先物取引 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、原則として、計算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または最終相場に基づいて評価しております。</p>
2. 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。</p> <p>(2) 有価証券売買等損益及び派生商品取引等損益の計上基準 約定日基準で計上しております。</p>
3. その他	<p>貸借対照表は、ファンドの中間計算期間末の2019年5月16日現在であります。</p> <p>なお、当親投資信託の計算期間は、当期末が休日のため、2018年11月17日から2019年11月18日までとなっております。</p>

(その他の注記)

(2019年5月16日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間（自 2018年11月17日 至 2019年5月16日）の元本状況	
期首（2018年11月17日）の元本額	3,131,159,435円
対象期間中の追加設定元本額	42,852,595円
対象期間中の一部解約元本額	121,620,978円
2019年5月16日現在の元本額の内訳	
明治安田DCトピックスプラス	220,134,215円
日本株式私募エンハンスインデックスファンド（適格機関投資家専用）	2,832,256,837円
計	3,052,391,052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	1.3307円
(10,000口当たり純資産額)	(13,307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

**2【ファンドの現況】**

(2019年6月28日現在)

**【純資産額計算書】**

資産総額	297,994,179 円
負債総額	302,740 円
純資産総額 ( - )	297,691,439 円
発行済口数	273,971,315 口
1口当たり純資産額 ( / )	1.0866 円
(1万口当たり純資産額)	(10,866 円)

(参考)

日本株式エンハンスインデックスマザーファンド

## 純資産額計算書

資産総額	4,198,480,936 円
負債総額	93,124,076 円
純資産総額 ( - )	4,105,356,860 円
発行済口数	3,052,413,350 口
1口当たり純資産額 ( / )	1.3450 円
(1万口当たり純資産額)	(13,450 円)

#### 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

- (1) 名義書換についてその手続、取扱場所、取次所、代理人の名称および住所並びに手数料  
該当事項はありません。
- (2) 受益者等に対する特典  
該当事項はありません。
- (3) 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容  
該当事項はありません。
- (4) その他内国投資信託受益証券事務に関し投資者に示すことが必要な事項  
該当事項はありません。
- (5) 振替受益権

##### 受益証券の不発行

委託会社は、この信託の受益権を取扱う振替機関が社振法の規定により主務大臣の指定を取消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

なお、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、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なわないものとします。

##### 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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に係る譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。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な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得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

##### 受益権の譲渡の対抗要件

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

##### 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。

##### 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なわれた受益権に係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。

##### 質権口記載または記録の受益権の取扱いについて

振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権に係る収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金・償還金の支払い等については、約款の規定による他、民法その他の法令等にしたがって取扱われます。



## 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

1. 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。
2. 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。
3. 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。
4. 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。

2019年6月28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	146 本	1,660,952,094,629 円
単位型株式投資信託	5 本	20,617,245,327 円
合計	151 本	1,681,569,339,956 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。）並びに同規則第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（2018年4月1日から2019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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	8,848,374	8,783,641
前払費用	120,943	166,084
未収委託者報酬	1,195,215	1,653,543
未収運用受託報酬	121,276	124,755
未収投資助言報酬	241,655	256,406
その他	171	186
流動資産合計	10,527,636	10,984,617
固定資産		
有形固定資産		
建物	<sup>1</sup> 183,994	<sup>1</sup> 167,904
器具備品	<sup>1</sup> 171,123	<sup>1</sup> 153,164
建設仮勘定	258	35,501
有形固定資産合計	355,375	356,569
無形固定資産		
ソフトウェア	72,467	60,361
電話加入権	6,662	6,662
その他	26	3
ソフトウェア仮勘定	-	13,000
無形固定資産合計	79,156	80,028
投資その他の資産		
投資有価証券	-	2,022
長期差入保証金	181,690	181,690
長期前払費用	5,381	4,920
前払年金費用	65,364	45,606
繰延税金資産	23,583	43,576
投資その他の資産合計	276,019	277,816
固定資産合計	710,552	714,413
資産合計	11,238,188	11,699,031

	前事業年度 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	66,282	87,372
未払金	947,328	917,223
未払収益分配金	132	134
未払償還金	7,137	-
未払手数料	411,569	600,682
その他未払金	528,489	316,406
未払費用	34,681	40,858
未払法人税等	237,896	398,894
未払消費税等	59,288	93,070
賞与引当金	111,465	125,179
流動負債合計	1,456,943	1,662,600
<b>固定負債</b>		
資産除去債務	58,490	58,882
固定負債合計	58,490	58,882
負債合計	1,515,433	1,721,483
<b>純資産の部</b>		
<b>株主資本</b>		
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	2,032,929	2,287,707
利益剰余金合計	5,207,971	5,462,748
株主資本合計	9,722,754	9,977,532
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	-	15
評価・換算差額等合計	-	15
純資産合計	9,722,754	9,977,548
負債・純資産合計	11,238,188	11,699,031

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	4,855,026	6,438,402
受入手数料	5,274	4,468
運用受託報酬	1,999,074	1,821,257
投資助言報酬	435,317	581,193
営業収益合計	7,294,693	8,845,322
営業費用		
支払手数料	1,675,008	2,241,473
広告宣伝費	70,117	43,065
公告費	-	375
調査費	1,378,602	1,580,451
調査費	574,087	584,064
委託調査費	804,514	996,386
委託計算費	341,672	365,866
営業雑経費	98,265	157,569
通信費	14,032	22,936
印刷費	70,234	118,976
協会費	8,466	9,325
諸会費	5,531	5,804
営業雑費	0	525
営業費用合計	3,563,665	4,388,800
一般管理費		
給料	1,504,298	1,657,528
役員報酬	64,993	76,585
給料・手当	1,163,033	1,269,478
賞与	276,272	311,465
賞与引当金繰入	111,465	125,179
法定福利費	229,143	251,898
福利厚生費	37,638	31,313
交際費	1,309	2,071
寄付金	200	200
旅費交通費	29,907	34,359
租税公課	61,257	71,711
不動産賃借料	157,238	202,713
退職給付費用	43,818	84,659
固定資産減価償却費	75,829	88,029
事務委託費	97,645	98,081
諸経費	78,926	99,121
一般管理費合計	2,428,681	2,746,868
営業利益	1,302,346	1,709,653

（単位：千円）

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
営業外収益		
受取利息	179	179
受取配当金	9	-
投資有価証券売却益	98	-
償還金等時効完成分	28	7,169
保険契約返戻金・配当金	<sup>1</sup> 1,164	<sup>1</sup> 1,332
為替差益	631	-
雑益	663	691
営業外収益合計	2,775	9,373
営業外費用		
為替差損	-	48
雑損失	663	1,547
時効成立後支払償還金	1,564	-
営業外費用合計	2,228	1,596
経常利益	1,302,892	1,717,430
特別損失		
固定資産除却損	<sup>2</sup> 10,559	-
移設関連費用	30,245	-
特別損失合計	40,805	-
税引前当期純利益	1,262,087	1,717,430
法人税、住民税及び事業税	372,601	548,652
法人税等調整額	44,522	19,999
法人税等合計	328,078	528,652
当期純利益	934,008	1,188,777

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本 合計
		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	1,789,505	4,964,546	9,479,330
当期変動額					
剰余金の配当			690,584	690,584	690,584
当期純利益			934,008	934,008	934,008
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	243,424	243,424	243,424
当期末残高	83,040	3,092,001	2,032,929	5,207,971	9,722,754

	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	36	36	9,479,367
当期変動額			
剰余金の配当			690,584
当期純利益			934,008
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	36	36	36
当期変動額合計	36	36	243,387
当期末残高	-	-	9,722,754

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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				
	利益準備金	利益剰余金			株主資本 合計
		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	2,032,929	5,207,971	9,722,754
当期変動額					
剰余金の配当			933,999	933,999	933,999
当期純利益			1,188,777	1,188,777	1,188,777
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	254,777	254,777	254,777
当期末残高	83,040	3,092,001	2,287,707	5,462,748	9,977,532

	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	-	-	9,722,754
当期変動額			
剰余金の配当			933,999
当期純利益			1,188,777
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）	15	15	15
当期変動額合計	15	15	254,793
当期末残高	15	15	9,977,548

[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<br/>時価のあるもの<br/>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</p> <p>定額法<br/>なお、主な耐用年数は次のとおりであります。</p> <p>建物 6年～18年<br/>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 (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。 (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>
<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。</p>

(表示方法の変更)

(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)

「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号 平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しております。

この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」57,561千円は「固定負債」の「繰延税金負債」33,978千円と相殺して、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」23,583千円として表示しており、変更前と比べ資産合計が33,978千円、負債合計が33,978千円減少しております。

(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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
建物	33,110千円	50,882千円
器具備品	233,830千円	283,070千円

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
保険契約返戻金・配当金	1,164千円	1,332千円

2 前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

固定資産除却損の内容は、主に建物付属設備6,108千円、システム関係3,084千円、什器備品1,362千円であります。

(株主資本等変動計算書関係)

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018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
2017年6月28日 定時株主総会	普通株式	690,584,268円	36,564円00銭	2017年3月31日	2017年6月28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
2018年6月27日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	933,999,924円	49,452円00銭	2018年3月31日	2018年6月27日

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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
2018年6月27日 定時株主総会	普通株式	933,999,924円	49,452円00銭	2018年3月31日	2018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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,188,766,667円	62,941円00銭	2019年3月31日	2019年6月20日

## (リース取引関係)

オペレーティング・リース取引のうち解約不能のものに係る未経過リース料

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1年内	8,789	8,789
1年超	29,296	20,507
合計	38,085	29,296

## (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。差入保証金は、賃貸借契約先の森ビルに対する敷金であり、差入先の信用リスクに晒されており、差入先の信用リスクについては、資産の自己査定及び償却引当規程に従い、定期的に管理をしております。投資有価証券は全て事業推進目的で保有している証券投資信託であり、基準価格の変動リスクにさらされております。価格変動リスクについては、定期的に時価の把握を行い管理をしております。

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（2018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	8,848,374	8,848,374	-
(2) 未収委託者報酬	1,195,215	1,195,215	-
(3) 未収運用受託報酬	121,276	121,276	-
(4) 未収投資助言報酬	241,655	241,655	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	-	-	-
(6) 長期差入保証金	181,690	181,208	481
資産計	10,588,211	10,587,730	481
(1) 未払手数料	411,569	411,569	-
(2) その他未払金	528,489	528,489	-
負債計	940,058	940,058	-

当事業年度（2019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	8,783,641	8,783,641	-
(2) 未収委託者報酬	1,653,543	1,653,543	-
(3) 未収運用受託報酬	124,755	124,755	-
(4) 未収投資助言報酬	256,406	256,406	-
(5) 投資有価証券 其他有価証券	2,022	2,022	-
(6) 長期差入保証金	181,690	184,263	2,572
資産計	11,002,059	11,004,632	2,572
(1) 未払手数料	600,682	600,682	-
(2) その他未払金	316,406	316,406	-
負債計	917,089	917,089	-

## (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（2018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	8,848,087	-	-	-
未収委託者報酬	1,195,215	-	-	-
未収運用受託報酬	121,276	-	-	-
未収投資助言報酬	241,655	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券のうち 満期のあるもの	-	-	-	-
長期差入保証金	-	-	181,690	-
合計	10,406,234	-	181,690	-

当事業年度（2019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	8,783,536	-	-	-
未収委託者報酬	1,653,543	-	-	-
未収運用受託報酬	124,755	-	-	-
未収投資助言報酬	256,406	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの	-	1,004	-	-
長期差入保証金	-	-	181,690	-
合計	10,818,241	1,004	181,690	-

(有価証券関係)

## 1. その他有価証券

前事業年度（2018年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2019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)	2,022	2,000	22
小計	2,022	2,000	22
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)	-	-	-
小計	-	-	-
合計	2,022	2,000	22

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2017年4月1日 至 2018年3月31日）

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)	1,198	98	-

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

該当事項はありません。

## 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 2017年4月1日 至 2018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（前払年金費用）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、前払年金費用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	48,679	千円
退職給付費用	43,818	"
退職給付の支払額	-	"
制度への拠出額	60,503	"
前払年金費用の期末残高	65,364	"

## (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前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	618,696	千円
年金資産	684,333	"
	65,637	"
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	65,364	"
前払年金費用	65,364	"
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	65,364	"

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	43,818	千円
----------------	--------	----

当事業年度（自 2018年4月1日 至 2019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（前払年金費用）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、前払年金費用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	65,364	千円
退職給付費用	84,659	"
退職給付の支払額	-	"
制度への拠出額	64,901	"
前払年金費用の期末残高	45,606	"

## (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前払年金費用の調整表

積立型制度の退職給付債務	702,199	千円
年金資産	748,078	"
	45,879	"
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	45,606	"
前払年金費用	45,606	"
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	45,606	"

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	84,659	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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
繰延税金資産				
賞与引当金繰入限度超過額	34,130	千円	38,330	千円
未払事業税	16,621	"	24,142	"
資産除去債務	17,909	"	18,029	"
その他	8,629	"	9,379	"
繰延税金資産小計	77,291	"	89,882	"
評価性引当額	19,484	"	19,573	"
繰延税金資産合計	57,806	"	70,308	"
繰延税金負債				
その他有価証券評価差額金	-	"	7	"
資産除去費用	14,208	"	12,760	"
前払年金費用	20,014	"	13,964	"
繰延税金負債合計	34,222	"	26,732	"
繰延税金資産の純額	23,583	"	43,576	"

## 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 (2018年3月31日)		当事業年度 (2019年3月31日)	
法定実効税率	30.86	%	-	%
（調整）				
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.02	"	-	"
評価性引当額の増減	4.08	"	-	"
雇用拡大促進税制の特別控除	1.03	"	-	"
住民税均等割	0.18	"	-	"
その他	0.04	"	-	"
税効果会計適用後の法人税等の負担率	25.99	%	-	%

（注）当事業年度は、法定実効税率と税効果適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しています。

## （持分法損益等）

該当事項はありません。

## （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取得から耐用年数満了時（15年）としており、割引率は0.027%～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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)		当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	
期首残高	28,843	千円	58,490	千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	29,266	"	-	"
時の経過による調整額	380	"	391	"
期末残高	58,490	千円	58,882	千円

## （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 2017年4月1日 至 2018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
外部顧客への営業収益	4,855,026	5,274	1,999,074	435,317	7,294,693

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益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

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の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 2018年4月1日 至 2019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
外部顧客への営業収益	6,438,402	4,468	1,821,257	581,193	8,845,322

2. 地域ごとの情報

（1）営業収益

本邦の外部顧客への営業収益に区分した金額が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、地域ごとの営業収益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

外部顧客への営業収益のうち、損益計算書の営業収益の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

財務諸表提出会社の親会社及び法人主要株主等

前事業年度 (自 2017年4月1日 至 2018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	東京都千代田区丸の内2-1-1	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	396,472	未収投資助言報酬	221,851
							支払手数料料	351,238	未払手数料料	114,770

当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019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	東京都千代田区丸の内2-1-1	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	406,364	未収投資助言報酬	215,154
							支払手数料料	438,123	未払手数料料	126,032

取引条件ないし取引条件の決定方針等

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。

(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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
1株当たり純資産額	514,785円55銭	528,275円96銭
1株当たり当期純利益金額	49,452円47銭	62,941円57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 (2018年3月31日)	当事業年度 (2019年3月31日)
貸借対照表の純資産の部の合計額(千円)	9,722,754	9,977,548
普通株式に係る純資産額(千円)	9,722,754	9,977,548
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 2017年4月1日 至 2018年3月31日)	当事業年度 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)
当期純利益(千円)	934,008	1,188,777
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)	934,008	1,188,777
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。

#### 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) 通常の見積り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**

(2019年3月末現在)

名称	資本金の額 (百万円)	事業の内容
みずほ信託銀行株式会社	247,369	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**

(2019年3月末現在)

名称	資本金の額 (百万円)	事業の内容
明治安田生命保険相互会社	930,000	日本において、保険業法に基づき、生命保険業を営んでいます。

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。

**2【関係業務の概要】****(1) 受託会社**

ファンドの受託者として、ファンドの信託財産の保管・管理・計算、その他付随する業務等を行います。なお、受託者は、信託事務の一部につき再信託受託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】**

販売会社である明治安田生命保険相互会社は、委託会社の株主であり、その保有株は17,539株（持株比率92.86%）です。

**(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**

(2019年3月末現在)

名称	資本金の額 (百万円)	事業の内容
資産管理サービス信託銀行株式会社	50,000	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**

該当事項はありません。

### 第3【その他】

- (1) 目論見書の表紙等に委託会社のロゴ・マーク、図案、キャッチ・コピー、投資家あるいは受益者向けメッセージ等を採用し、ファンドの形態等の記載をすることがあります。
- (2) 交付目論見書の表紙に、以下の内容を記載することがあります。
  - ・ 金融商品取引法第13条の規定に基づく目論見書である旨
  - ・ 目論見書の使用開始日
  - ・ 委託会社の金融商品取引業者登録番号、設立年月日、資本金、委託会社の投資信託財産の合計純資産総額
  - ・ 詳細情報の入手方法
    - 委託会社のホームページアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）、電話番号および受付時間等
    - 請求目論見書の入手方法および投資信託約款（以下「約款」という。）が請求目論見書に掲載されている旨
  - ・ 届出の効力に関する事項について、次に掲げるいずれかの内容を記載することがあります。
    - 届出をした日および当該届出の効力の発生の有無を確認する方法
    - 届出をした日、届出が効力を生じている旨および効力発生日
  - ・ 商品内容に関して重大な変更を行う場合には、投資信託及び投資法人に関する法律（昭和26年法律第198号）に基づき事前に受益者の意向を確認する旨
  - ・ 投資信託の財産は受託会社において信託法に基づき分別管理されている旨
  - ・ 請求目論見書は投資者の請求により販売会社から交付される旨および当該請求を行った場合にはその旨の記録をしておくべきである旨
  - ・ 「ご購入に際しては、本書の内容を十分にお読みください。」との趣旨を示す記載
- (3) 届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の主たる内容を要約し、「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) 交付目論見書の「3. 運用実績」に委託会社のホームページアドレス（当該アドレスをコード化した図形等も含みます。）を掲載することがあります。またこれらのアドレスにアクセスすることにより最新の運用状況を入手できる旨を記載することがあります。
- (6) 請求目論見書に約款を掲載し、届出書第一部「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とすることがあります。
- (7) 届出書第一部「証券情報」、第二部「ファンド情報」の記載内容については、投資家の理解に資するため、当該内容を説明した図表等を付加し、交付目論見書に記載することがあります。
- (8) 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ことがあります。
- (9) 投信評価機関、投信評価会社等からファンドに対するレーティングを取得し、当該レーティングを使用することがあります。
- (10) 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）」
- (11) 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

2019年6月7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 熊 木 幸 雄

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 蓑 輪 康 喜

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2018年4月1日から2019年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

### 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、明治安田アセットマネジメント株式会社の2019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。

## 独立監査人の監査報告書

2019年1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

EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 蒲谷 剛史 印指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 福村 寛 印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている明治安田DCトピックスプラスの2017年11月17日から2018年11月16日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

経営者の責任は、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して財務諸表を作成し適正に表示することにある。これには、不正又は誤謬による重要な虚偽表示のない財務諸表を作成し適正に表示するために経営者が必要と判断した内部統制を整備及び運用することが含まれる。

## 監査人の責任

当監査法人の責任は、当監査法人が実施した監査に基づいて、独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準は、当監査法人に財務諸表に重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得るために、監査計画を策定し、これに基づき監査を実施することを求めている。

監査においては、財務諸表の金額及び開示について監査証拠を入手するための手続が実施される。監査手続は、当監査法人の判断により、不正又は誤謬による財務諸表の重要な虚偽表示のリスクの評価に基づいて選択及び適用される。財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、当監査法人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、財務諸表の作成と適正な表示に関連する内部統制を検討する。また、監査には、経営者が採用した会計方針及びその適用方法並びに経営者によって行われた見積りの評価も含め全体としての財務諸表の表示を検討することが含まれる。

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、明治安田DCトピックスプラスの2018年11月16日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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。

## 独立監査人の中間監査報告書

2019年6月28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

### EY新日本有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	森重 俊寛	印
指定有限責任社員 業務執行社員	公認会計士	福村 寛	印

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている明治安田DCトピックスプラスの2018年11月17日から2019年5月16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トピックスプラスの2019年5月16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（2018年11月17日から2019年5月16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. XBR Lデータは中間監査の対象には含まれていません。