

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長 殿
【提出日】	2021年12月15日提出
【計算期間】	第1期（自 2020年12月15日 至 2021年9月16日）
【ファンド名】	明治安田DC・TOPIXインデックスファンド
【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 西尾 友宏
【本店の所在の場所】	東京都千代田区大手町二丁目3番2号
【事務連絡者氏名】	植村 吉二
【連絡場所】	東京都千代田区大手町二丁目3番2号
【電話番号】	03-6700-4111
【縦覧に供する場所】	該当事項はありません。

## 第一部【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・TOPIXインデックスファンドは、明治安田TOPIXマザーファンドへの投資を通じて、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

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）	補足分類
単位型	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
		不動産投信	
追加型	内外	その他資産（ ）	特殊型
		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。

##### インデックス型

目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果をめざす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	対象インデックス
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 クレジット属性 ( )	年6回 (隔月)	欧州	ファミリー ファンド	日経225
	年12回 (毎月)	アジア		
		オセアニア		TOPIX
不動産投信	日々	中南米	ファンド・ オブ・ ファンズ	その他 ( )
その他資産 (投資信託証券 (株式 一般))	その他 ( )	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・ファンズのものを含みます。）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すべ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。

#### TOPIX

目論見書または投資信託約款において、TOPIX（東証株価指数）に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

(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 1,000億円

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

明治安田TOPIXマザーファンドへの投資を通じて、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

TOPIX（東証株価指数）とは、東京証券取引所市場第一部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。東京証券取引所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。

東京証券取引所は、2022年4月4日に現在の市場区分を「プライム市場」、「スタンダード市場」、「グロース市場」の3つの新しい市場区分に再編する予定です。当該再編に伴い、記載内容に変更が生じる場合があります。以下同じ。

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

東京証券取引所市場第一部上場銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し株式の組入れを行います。

運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を行う場合があります。

株式（株価指数先物取引を含みます。）の実質組入比率は、高位を保ちます。

対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。

非株式割合（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

**（２）【ファンドの沿革】**

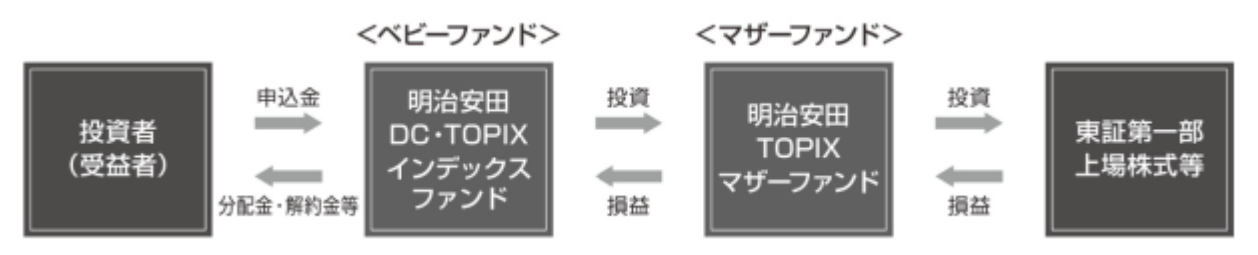
2020年12月15日 信託契約締結、ファンドの設定、ファンドの運用開始

**（３）【ファンドの仕組み】**

ファンドの仕組み

運用にあたってはファミリーファンド方式を採用し、主として、明治安田TOPIXマザーファンド受益証券に投資することにより、実質的な運用をマザーファンド（以下「親投資信託」ともいいます。）で行う仕組みになっています。

「ファミリーファンド方式」とは、お客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。

委託会社等およ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）および運用報告書の作成等を行います。

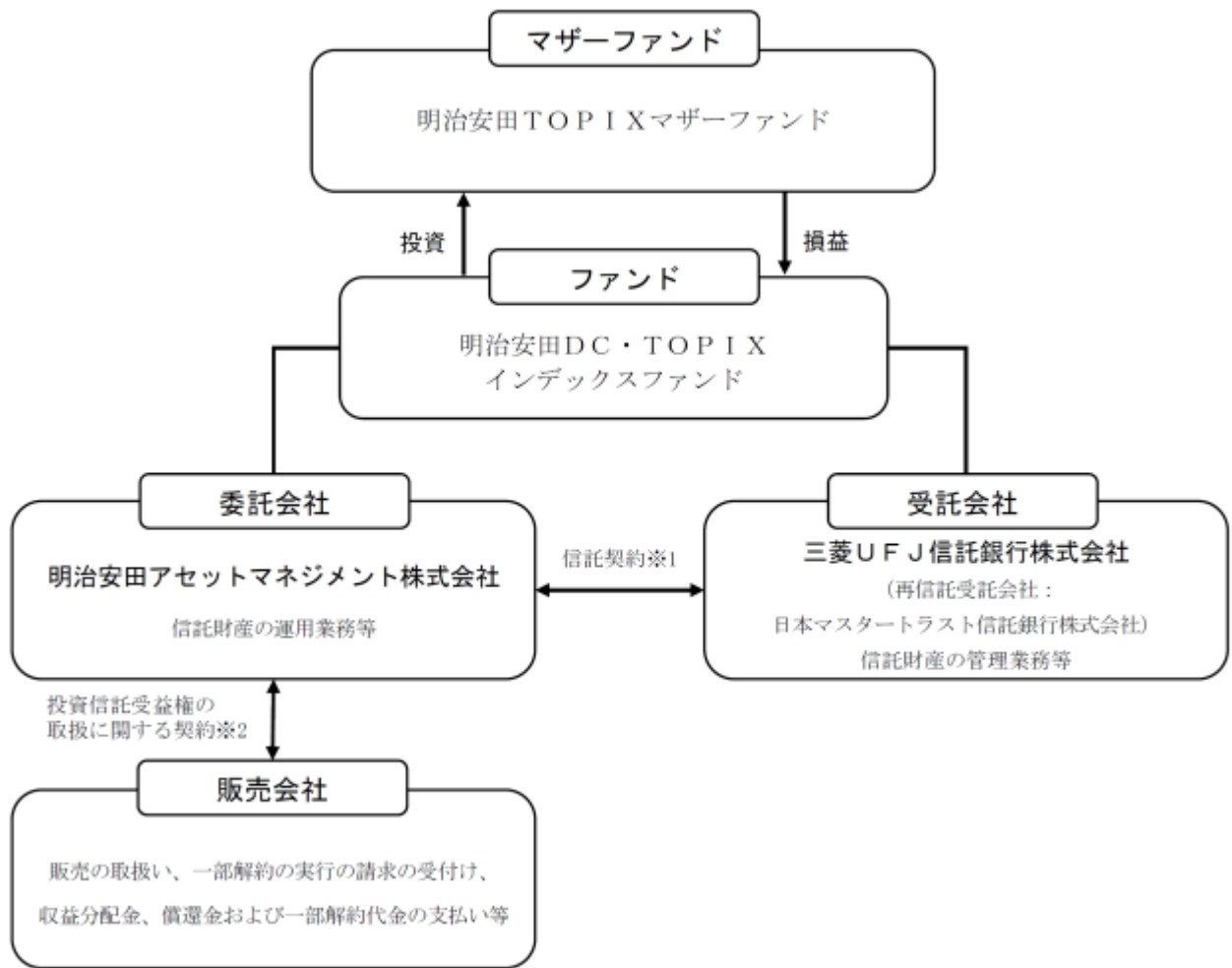
2. 受託会社（受託者）： 三菱UFJ信託銀行株式会社

信託財産の保管・管理業務等を行います。

（なお、受託者は信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。）

3. 販売会社

ファンドの販売会社として募集・販売の取扱い、一部解約実行の請求の受付、収益分配金、償還金等の支払い、運用報告書の交付などを行います。



### 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、委託会社および受託会社の業務、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、収益分配金および償還金の支払い、買取りおよ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】

#### 運用方針

「明治安田TOPIXマザーファンド」への投資を通じて、TOPIX（東証株価指数）の動きに連動する投資成果を目標として運用を行います。

#### 投資対象

明治安田TOPIXマザーファンド受益証券を主要投資対象とします。このほか、当ファンドにおいて直接、東京証券取引所市場第一部上場銘柄に投資を行い、TOPIX（東証株価指数）先物取引を行うことがあります。

#### 投資態度

1. 東京証券取引所市場第一部上場銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し株式の組入れを行います。
2. 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を行う場合があります。
3. 株式（株価指数先物取引を含みます）の実質組入比率は、高位を保ちます。
4. 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式の実質投資比率が100%を超える場合があります。
5. 運用にあたっては、当社の投資プロセスでポートフォリオの構築、リスクコントロールを行います。
6. 非株式割合（他の投資信託受益証券を通じて投資する場合は、当該他の投資信託の信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

資金動向、市況動向等によっては前記のような運用ができない場合があります。

#### （参考）親投資信託の概要

「明治安田TOPIXマザーファンド」

#### 投資の基本方針

##### 基本方針

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

##### 運用方法

#### 1. 投資対象

東京証券取引所市場第一部上場銘柄の株式およびTOPIX（東証株価指数）先物取引を主要投資対象とします。

#### 2. 投資態度

- a. 東京証券取引所市場第一部上場銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し株式の組入れを行います。
- b. 運用の効率化を図るため、株価指数先物取引を行う場合があります。
- c. 株式（株価指数先物取引を含みます）の組入比率は、高位を保ちます。
- d. 対象インデックスとの連動を維持するため、先物取引等を利用し、株式の投資比率が100%を超える場合があります。
- e. 運用にあたっては、当社の投資プロセスでポートフォリオの構築、リスクコントロールを行います。



## 〔投資対象ユニバースの決定〕

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

## 〔組入銘柄および株数の決定〕

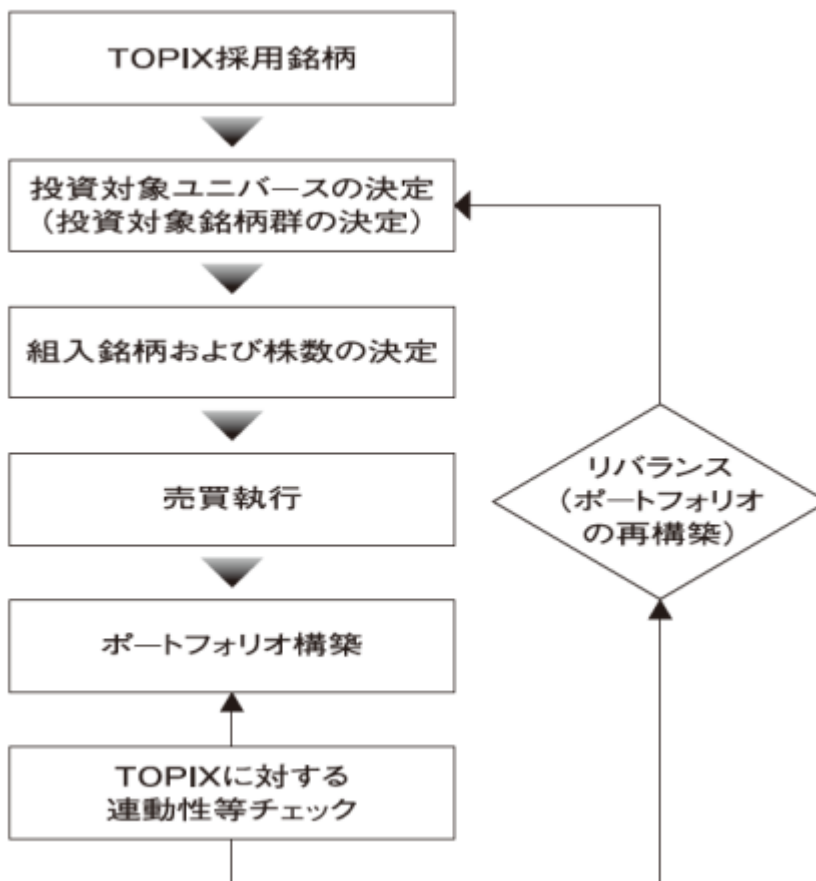
ファンドの純資産総額や個別銘柄の市場流動性、売買コスト等を勘案してTOPIXに近づくように一定の方法（最適化法）を用いて投資対象ユニバースの中から実際に買付けを行う銘柄のリストおよび株数を割り出します。

## 〔ポートフォリオ構築〕

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

## 〔リバランス〕

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



f. 非株式割合は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

ただし、資金動向、市況動向、残存信託期間等の事情によっては、前記のような運用が出来ない場合があります。

### 3. 投資制限

- a. 株式への投資割合には制限を設けません。
- b. 新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
- c. 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。
- d. 外貨建資産への投資は行いません。
- e. 信用取引は、約款所定の範囲で行います。
- f. 有価証券先物取引等は、約款所定の範囲で行います。
- g. スワップ取引は、約款所定の範囲で行います。
- h. 有価証券の貸付けおよび資金の借入れは、約款所定の範囲で行います。

## （２）【投資対象】

この信託において投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

1. 次に掲げる特定資産（「特定資産」とは、投資信託及び投資法人に関する法律第2条第1項で定めるものをいいます。以下同じ。）

イ．有価証券

ロ．デリバティブ取引に係る権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款に定めるものに限ります。）

ハ．約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）

ニ．金銭債権

2. 次に掲げる特定資産以外の資産

イ．為替手形

委託会社は、信託金を、主として「明治安田TOPIXマザーファンド」受益証券のほか、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。本邦通貨表示のものに限ります。）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. 投資法人債券（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。）または外国投資証券で投資法人債券に類する証券

8. 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。）

9. 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。）

10. 資産の流動化に関する法律に規定する優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）

11. コマーシャル・ペーパー

12. 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

13. 外国または外国の者の発行する証券または証書で、前各号（7. で定めるものを除きます。）の証券または証書の性質を有するもの

14. 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。）

15. 投資証券、新投資口予約権証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、7. で定めるものを除きます。）

16. 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。）

17. オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券に係るものに限ります。）

18. 預託証書(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
19. 外国法人が発行する譲渡性預金証書
20. 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいいます。)
21. 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。)
22. 外国の者に対する権利で20.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、13.ならびに18.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7.までの証券および13.ならびに18.の証券または証書のうち2.から7.までの証券の性質を有するものを以下「公社債」といい、14.および15.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、上記 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

### （３）【運用体制】

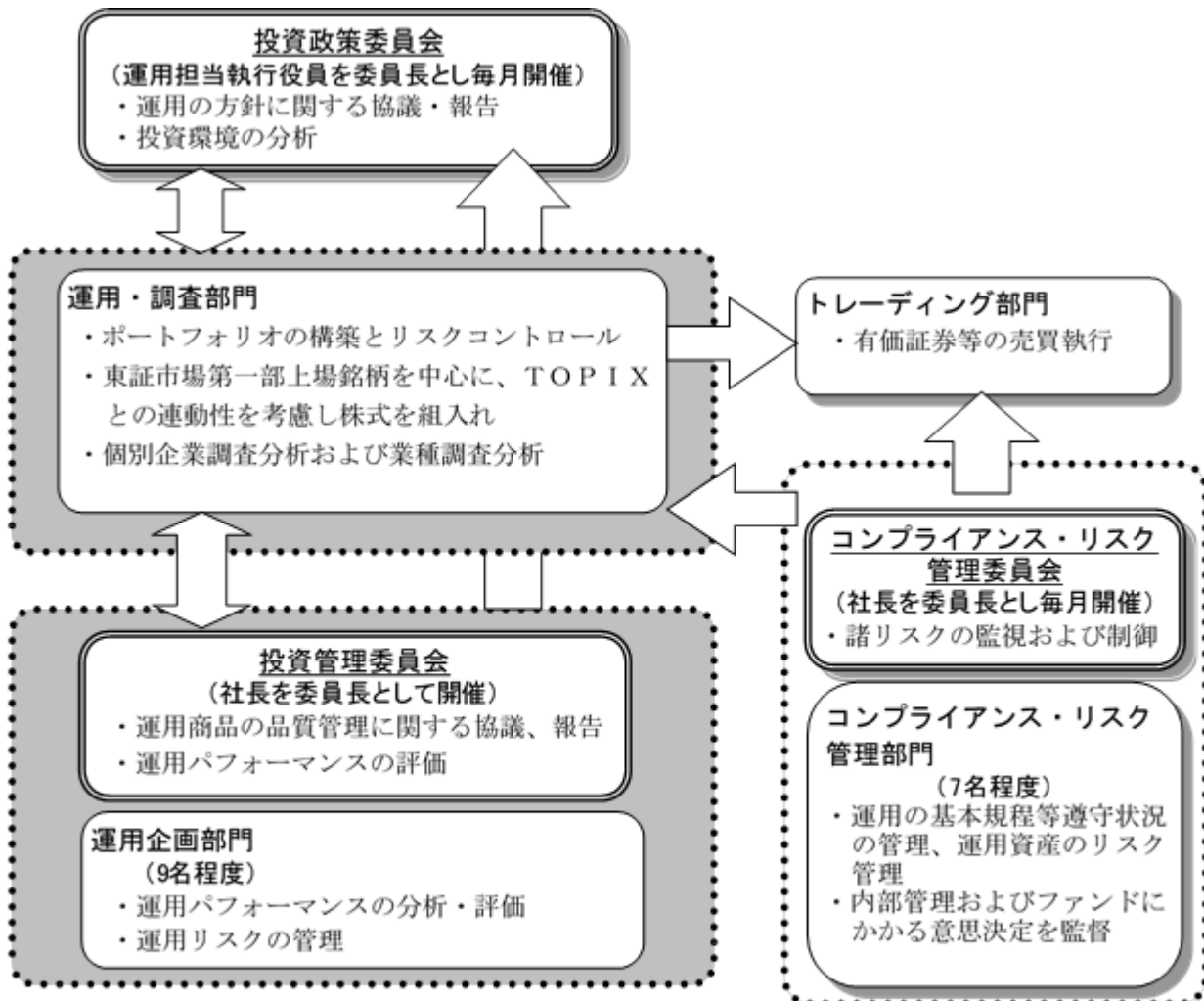
当ファンドの運用体制は以下のとおりです。

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、運用企画部が中心となって行います。

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」およ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 (<https://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。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】

##### 収益分配方針

毎年１回（原則９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き分配を行います。

1. 分配対象額の範囲は、経費控除後の繰越分を含めた利子・配当収入と売買益（評価益を含みます。）等の全額とします。
2. 収益分配金額は、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、必ず分配を行うものではありません。
3. 留保益の運用については、特に制限を設けず、委託会社の判断に基づき、元本部分と同一の運用を行います。

##### 収益の分配方式

1. 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。
  - a. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれ等に類する収益から支払利息を控除した額（以下「配当等収益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残金を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
  - b. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、分配準備積立金として積み立てることができます。
2. 毎計算期末において信託財産につき生じた損失は、次期に繰越します。

##### 収益分配金の再投資

決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）の収益分配金は、決算日の基準価額で翌営業日に自動的に再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

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

## （５）【投資制限】

### < 投資信託約款に基づく主な投資制限 >

#### 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。

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

#### 新株引受権証券等の投資制限

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

#### 投資信託証券の投資制限

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

#### 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。

#### 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、ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
2. 上記1.にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとし、

#### 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資制限

1. 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を超えることとなる投資の指図を行いません。
2. 上記1.において信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンド受益証券の時価総額にマザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。

## 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できます。なお、当該売付けの決済については、株券の引き渡しまたは買戻しにより行うことの指図をすることができるものとします。
2. 上記1.の信用取引の指図は、当該売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
3. 信託財産の一部解約等の事由により、上記2.の売付けにかかる建玉の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付けの一部を決済するための指図をすることとします。

## 先物取引等の運用指図・目的・範囲

1. 委託会社は、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るものとします（以下同じ。）。
2. 委託会社は、わが国の取引所における金利にかか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。

## スワップ取引の運用指図・目的・範囲

1. 委託会社は、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。
2. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、ファンドの信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が当該信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
3. スワップ取引の指図にあたっては、当該信託財産にかかるスワップ取引の想定元本の合計額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。なお、信託財産の一部解約等の事由により、上記純資産総額が減少して、スワップ取引の想定元本の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当するスワップ取引の一部の解約を指図するものとします。
4. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で評価するものとします。
5. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入れが必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入れの指図を行うものとします。

## デリバティブ取引等にかかる投資制限

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。

## 有価証券の貸付けの指図および範囲

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を次の各号の範囲内で貸付けの指図をすることができます。
  - a. 株式の貸付けは、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額の50%を超えないものとします。



- b. 公社債の貸付けは、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額の50%を超えないものとします。
2. 前項各号に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
  3. 委託会社は、有価証券の貸付けにあたって必要と認めるときは、担保の受入れの指図を行うものとします。

#### 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、および再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
2. 一部解約に伴う支払資金の手当てのための借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、有価証券等の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。ただし、資金の借入額は、借入れ指図を行う日における信託財産の純資産総額の10%を超えないこととします。
3. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は、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から支弁します。

#### < 法律等で規制される投資制限 >

##### 同一法人の発行する株式への投資制限

委託会社は、同一の法人の発行する株式を、その運用の指図を行うすべ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かかる議決権の総数が、当該株式にかかる議決権の総数に100分の50の率を乗じて得た数を超えることとなる場合においては、投資信託財産をもって取得することを受託会社に指図しないものとします。

##### デリバティブ取引にかかる投資制限

委託会社は、信託財産に関し、金利、通貨の価格、金融商品市場における相場その他の指標にかかる変動その他の理由により発生し得る危険に対応する額としてあらかじめ委託会社が定めた合理的方法により算出した額が当該信託財産の純資産額を超えることとなる場合において、デリバティブ取引(新株予約権証券またはオプションを表示する証券もしくは証書にかかる取引および選択権付債券売買を含みます。)を行い、または継続することを受託会社に指図しないものとします。

### 3【投資リスク】

#### (1) ファンドのリスクと留意点

明治安田DC・TOPIXインデックスファンドは、直接あるいはマザーファンドを通じて、株式など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等は、以下のとおりです。

#### 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。

#### その他のリスク・留意点

当ファンドは東証株価指数（TOPIX）に連動する投資成果を目指しますが、基準価額と指数が完全に一致するものではありません。また、投資成果が指数を連動または上回ることを保証するものではありません。

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。

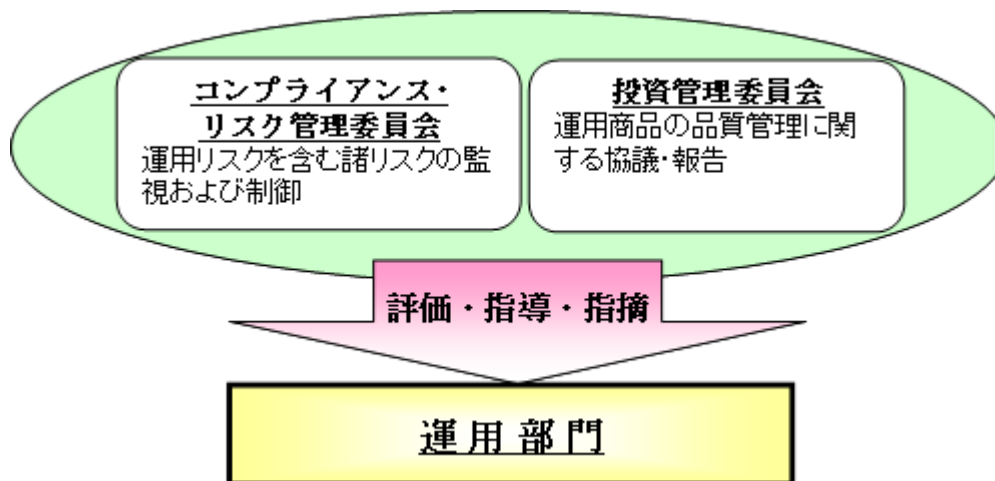
当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定（いわゆるクーリング・オフ）の適用はありません。

## （２）リスク管理体制

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

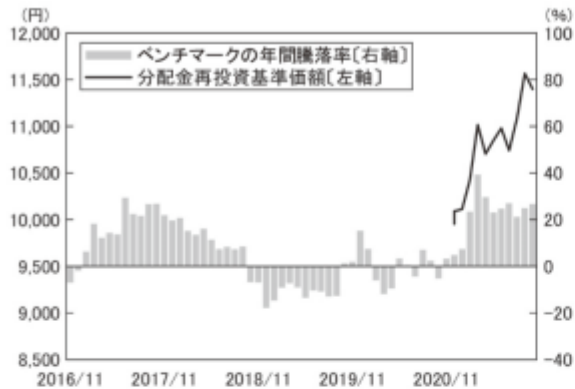
コンプライアンス・リスク管理委員会は、法令諸規則・社内規程等の遵守状況、運用資産のリスク管理状況等を把握・管理し、必要に応じて指示・指摘を行います。

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



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

## (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

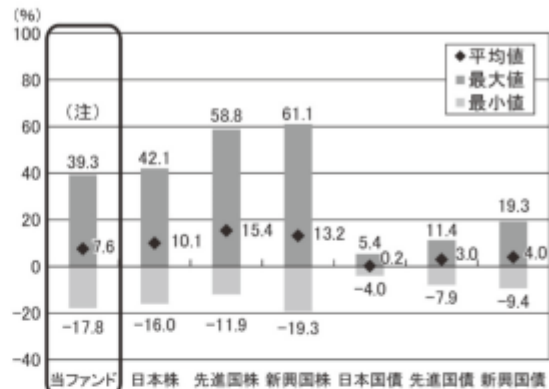
※グラフは、ファンドの5年間の各月末における分配金再投資基準価額（税引前の分配金を再投資したものとして算出しており、実際の基準価額と異なる場合があります。以下同じ。）および各月末における直近1年間の騰落率を表示しています。

※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。

(注)当ファンドは、設定日から1年を経過していないため、年間騰落率のデータがありません。年間騰落率はベンチマークのデータを表示しています。ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、当ファンドの運用実績ではありません。

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：2016年11月～2021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。

※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。

(注)当ファンドは、設定日から1年を経過していないため、年間騰落率のデータがありません。当ファンドの騰落率はベンチマークの年間騰落率データを用いて計算しています。ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、当ファンドの運用実績ではありません。

## &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。

東京証券取引所は、2022年4月4日に現在の市場区分を「プライム市場」、「スタンダード市場」、「グロース市場」の3つの新しい市場区分に再編する予定です。当該再編に伴い、記載内容に変更が生じる場合があります。以下同じ。

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。

自動継続投資契約（販売会社により名称が異なる場合があります。以下同じ。）に基づき、収益分配金を再投資する場合も、手数料はかかりません。

##### (2)【換金（解約）手数料】

解約手数料および信託財産留保額はありませぬ。

##### (3)【信託報酬等】

ファンドの純資産総額に対し、年0.154%（税抜0.14%）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。

運用管理費用（信託報酬）の実質的な配分は以下のとおりです。

< 内訳 >

配分	料率（年率）
委託会社	0.077%（税抜0.07%）
販売会社	0.055%（税抜0.05%）
受託会社	0.022%（税抜0.02%）
合計	0.154%（税抜0.14%）

< 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（目論見書、運用報告書、有価証券報告書・届出書等）の作成・印刷・交付および届出等にかかる費用の対価
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収受した後、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。

信託財産の監査にかかる費用（監査費用）として監査法人に年0.0055%（税抜0.005%）を支払う他、有価証券等の売買の際に売買仲介人に支払う売買委託手数料、先物取引・オプション取引等に要する費用、その他信託事務の処理に要する費用等がある場合には、信託財産でご負担いただきます。

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

その他の費用については、運用状況等により変動しますので、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等によって見直され、変更になる場合があります。

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】

このファンドは、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。

確定拠出年金制度に関する掛金、積立金および給付については、所得税法、法人税法、相続税法および地方税法ならびにこれらの法律に基づく命令で定めるところにより、所得税、法人税、相続税ならびに道府県民税（都民税を含む。）および市町村民税（特別区民税を含む。）の課税について必要な措置を講ずる（確定拠出年金法第86条）とされており、運用段階においては非課税となります。

したがって、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金制度に関する当該ファンドの期中収益分配金、一部解約による解約差益、償還時の差益のいずれも非課税となります。

<上記以外の受益者（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以外の法人）の場合の課税の取扱い>

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、下表の税率で源泉徴収され法人の受取額となります。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち所得税法上課税対象となるのは普通分配金のみであり、特別分配金は課税されません。源泉徴収された所得税は、法人税の額から控除できます。

税率
15.315%（所得税15.315%）

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

上記は2021年10月末現在のもので、税法または確定拠出型年金法が改正された場合等は、上記の内容が変更されることがあります。

**5【運用状況】**

以下は2021年10月29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、当ファンドの後に続きます。

**(1)【投資状況】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

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	463,787,709	99.90
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		470,173	0.10
合計(純資産総額)		464,257,882	100.00

**(2)【投資資産】****【投資有価証券の主要銘柄】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

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 TOPIXマザーファンド	135,246,620	3.5377	478,461,968	3.4292	463,787,709	99.90

**ロ. 種類別投資比率**

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.90
合計	99.90

**【投資不動産物件】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

該当事項はありません。

**【その他投資資産の主要なもの】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

該当事項はありません。



**(3) 【運用実績】****【純資産の推移】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

期別	純資産総額（円）		1万口当たり純資産額（円）	
	（分配落）	（分配付）	（分配落）	（分配付）
第1期計算期間末（2021年9月16日）	436,629,388	436,629,388	11,815	11,815
2020年12月末日	1,009,082		10,091	
2021年1月末日	1,011,086		10,111	
2月末日	1,042,695		10,427	
3月末日	1,101,352		11,014	
4月末日	24,720,350		10,703	
5月末日	68,527,555		10,849	
6月末日	209,845,794		10,979	
7月末日	273,368,762		10,741	
8月末日	393,399,823		11,083	
9月末日	443,917,025		11,564	
10月末日	464,257,882		11,399	

**【分配の推移】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

期	計算期間	1万口当たりの分配金（円）
第1期計算期間	2020年12月15日～2021年9月16日	0

**【収益率の推移】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

期	計算期間	収益率（％）
第1期計算期間	2020年12月15日～2021年9月16日	18.15

(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】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

期	計算期間	設定口数（口）	解約口数（口）
第1期計算期間	2020年12月15日～2021年9月16日	434,452,476	64,910,066

(注)第1期計算期間の設定口数には、当初設定口数を含みます。

## (参考)

## (1) 投資状況

## 明治安田TOPIXマザーファンド

資産の種類	国/地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	19,306,309,870	97.12
現金・預金・その他の資産(負債控除後)		572,300,823	2.88
合計(純資産総額)		19,878,610,693	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	557,900,000	2.80

(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

## 明治安田TOPIXマザーファンド

## 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	356,300	1,636.38	583,043,225	2,006.50	714,915,950	3.60
2	日本	株式	ソニーグループ	電気機器	44,100	10,918.29	481,496,904	13,140.00	579,474,000	2.92
3	日本	株式	キーエンス	電気機器	6,400	49,487.88	316,722,432	68,510.00	438,464,000	2.21
4	日本	株式	リクルートホールディングス	サービス業	52,000	5,107.06	265,567,442	7,572.00	393,744,000	1.98
5	日本	株式	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	442,100	592.01	261,727,621	622.50	275,207,250	1.38
6	日本	株式	日本電信電話	情報・通信業	80,600	2,826.66	227,829,378	3,188.00	256,952,800	1.29
7	日本	株式	ソフトバンクグループ	情報・通信業	41,600	10,004.69	416,195,104	6,164.00	256,422,400	1.29
8	日本	株式	信越化学工業	化学	11,800	17,517.47	206,706,146	20,255.00	239,009,000	1.20
9	日本	株式	東京エレクトロン	電気機器	4,500	42,212.09	189,954,436	52,850.00	237,825,000	1.20
10	日本	株式	日本電産	電気機器	18,300	12,431.08	227,488,767	12,570.00	230,031,000	1.16
11	日本	株式	HOYA	精密機器	13,700	12,002.90	164,439,730	16,725.00	229,132,500	1.15
12	日本	株式	ダイキン工業	機械	9,000	21,816.52	196,348,762	24,890.00	224,010,000	1.13
13	日本	株式	日立製作所	電気機器	33,800	5,252.72	177,542,030	6,554.00	221,525,200	1.11
14	日本	株式	任天堂	その他製品	4,000	59,336.10	237,344,400	50,200.00	200,800,000	1.01
15	日本	株式	三菱商事	卸売業	51,800	3,206.25	166,083,829	3,612.00	187,101,600	0.94
16	日本	株式	本田技研工業	輸送用機器	54,900	3,226.62	177,141,438	3,349.00	183,860,100	0.92
17	日本	株式	村田製作所	電気機器	20,700	8,926.18	184,771,979	8,653.00	179,117,100	0.90
18	日本	株式	KDDI	情報・通信業	50,300	3,476.40	174,862,920	3,528.00	177,458,400	0.89
19	日本	株式	武田薬品工業	医薬品	55,100	3,961.02	218,252,202	3,203.00	176,485,300	0.89
20	日本	株式	三井住友フィナンシャルグループ	銀行業	47,200	3,957.09	186,774,982	3,721.00	175,631,200	0.88

21	日本	株式	ソフトバンク	情報・通信業	105,000	1,480.94	155,499,687	1,554.50	163,222,500	0.82
22	日本	株式	第一三共	医薬品	55,500	3,141.89	174,375,122	2,867.00	159,118,500	0.80
23	日本	株式	伊藤忠商事	卸売業	48,200	3,424.98	165,084,036	3,242.00	156,264,400	0.79
24	日本	株式	S M C	機械	2,100	60,712.68	127,496,634	67,940.00	142,674,000	0.72
25	日本	株式	オリエンタルランド	サービス業	7,900	17,043.60	134,644,458	17,940.00	141,726,000	0.71
26	日本	株式	三井物産	卸売業	54,100	2,324.92	125,778,327	2,592.00	140,227,200	0.71
27	日本	株式	東京海上ホールディングス	保険業	22,800	5,608.29	127,869,012	5,998.00	136,754,400	0.69
28	日本	株式	ファナック	電気機器	6,100	26,080.06	159,088,370	22,310.00	136,091,000	0.68
29	日本	株式	みずほフィナンシャルグループ	銀行業	87,400	1,598.05	139,669,570	1,505.00	131,537,000	0.66
30	日本	株式	セブン&アイ・ホールディングス	小売業	27,000	4,411.90	119,121,381	4,782.00	129,114,000	0.65

#### 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	0.10
		鉱業	0.22
		建設業	2.17
		食料品	3.29
		繊維製品	0.48
		パルプ・紙	0.21
		化学	6.76
		医薬品	4.82
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.68
		ガラス・土石製品	0.80
		鉄鋼	0.77
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.60
		機械	5.32
		電気機器	18.29
		輸送用機器	7.76
		精密機器	2.79
		その他製品	2.13
		電気・ガス業	1.02
		陸運業	3.03
		海運業	0.46
		空運業	0.41
		倉庫・運輸関連業	0.17
		情報・通信業	8.12
		卸売業	4.78
		小売業	4.25
		銀行業	4.52
		証券、商品先物取引業	0.75
		保険業	1.90
		その他金融業	1.13
不動産業	1.94		
サービス業	6.37		
合計		97.12	

## 投資不動産物件

明治安田T O P I Xマザーファンド

該当事項はありません。

## その他投資資産の主要なもの

明治安田T O P I Xマザーファンド

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	T O P I X先物	買建	28	日本円	572,469,640	557,900,000	2.80

(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。

2021年10月29日現在

## 基準価額・純資産の推移



※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。

## 分配の推移

分配金の推移	
2021年9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	11,399円
純資産総額	464百万円

## 主要な資産の状況

## 資産の組入比率

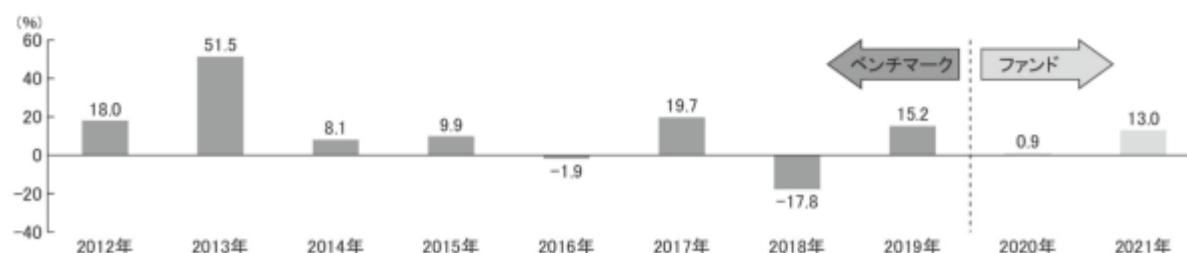
資産の種類	投資比率 (%)
明治安田TOPIXマザーファンド	99.90
その他の資産 (負債控除後)	0.10
合計 (純資産総額)	100.00

## 組入上位10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	3.60
2	ソニーグループ	電気機器	2.92
3	キーエンス	電気機器	2.21
4	リクルートホールディングス	サービス業	1.98
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.38
6	日本電信電話	情報・通信業	1.29
7	ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.29
8	信越化学工業	化学	1.20
9	東京エレクトロン	電気機器	1.20
10	日本電産	電気機器	1.16

※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。

※当ファンドのベンチマークは、TOPIX (東証株価指数) です。

※2019年まではベンチマークの年間収益率です。

※2020年は設定日 (2020年12月15日) から12月末まで、2021年は10月末までの収益率を表示しています。

※ベンチマークの情報はあくまでも参考情報であり、当ファンドの運用実績ではありません。

※ファンドの運用実績はあくまでも過去のものであり、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) ファンドの取得申込みは、確定拠出年金制度を利用する場合に限りです。
  - (2) 取得のお申込みの際には、販売会社取引口座を開設していただきます。
  - (3) 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたは予め当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。
  - (4) 申込単位は、1円以上1円単位とします。  
自動継続投資契約に基づく収益分配金の再投資については、1口単位とします。  
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、当該運営管理機関の取決めにしています。
  - (5) 申込手数料は、かかりません。  
販売会社との間で結んだ自動継続投資契約に基づいて収益分配金を再投資する場合も無手数料とします。
  - (6) 申込代金（取得申込受付日の基準価額に申込口数を乗じた額）を販売会社が別に定める所定の方法によりお支払いいただきます。  
基準価額につきましては、取扱販売会社または下記委託会社にてご確認いただけます。  
また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。
- 明治安田アセットマネジメント株式会社  
電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）  
ホームページアドレス <https://www.myam.co.jp/>
- (7) ファンドは、収益分配金を自動的に無手数料でファンドに再投資する自動継続投資専用ファンドです。取得申込者は、販売会社との間で自動継続投資契約に従い収益分配金再投資に関する契約を締結する必要があります。なお、販売会社によっては、上記の契約または規定について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約または規定を用いることがあります。
  - (8) 申込期間中における取得申込みの受付時間は、原則として午後3時まで取得申込みが行われ、かつ、当該取得申込みの受付にかかる販売会社所定の事務手続きが完了したものを当日の申込分とします。当該受付時間を過ぎた場合は翌営業日の受付として取扱います。
  - (9) 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、決済機能の停止その他やむを得ない事情があるときは、取得申込みの受付を中止することおよびすでに受付けた取得申込みの受付を取消することができます。

#### 受益権の取得申込者の制限について

受益権の申込みを行う投資者は、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受益権の取得の申込み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。）等による取得の申込みに限るものとします。

前記において「申込」を「取得申込」または「購入申込」ということがあります。

## 2【換金（解約）手続等】

### 信託の一部解約（解約請求制）

- (1) 受益者が一部解約の実行の請求をするときは、販売会社に対し、振替受益権をもって行うものとします。
- (2) 換金の請求を行う受益者は、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかるこの信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請を行うものとし、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。
- (3) 一部解約の価額（解約価額）は、解約請求受付日の基準価額とします。当該金額は請求を受付けた日から起算して、原則として4営業日目から受益者に支払います。  
基準価額につきましては、取扱販売会社または下記委託会社にてご確認いただけます。また、原則として、計算日の翌日付の日本経済新聞朝刊に掲載されます。

明治安田アセットマネジメント株式会社  
電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）  
ホームページアドレス <https://www.myam.co.jp/>
- (4) 一部解約の実行請求の受付時間は、原則として午後3時までに換金の請求が行われ、かつ、当該請求の受付にかかる販売会社所定の事務手続が完了したものを当日の申込分とします。当該受付時間を過ぎた場合は翌営業日の受付となります。
- (5) 委託会社は、金融商品取引所等における取引の停止、決済機能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ることができます。
- (6) 上記により、一部解約の実行の請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日の一部解約の実行の請求を撤回できます。ただし、受益者がその一部解約の実行の請求を撤回しない場合には、一部解約の価額は、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日に一部解約の実行の請求を受付けたものとして規定に準じて計算された価額とします。
- (7) 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。

確定拠出年金制度を利用して購入された加入者の解約の受付は、当該運営管理機関の取決めにしたがってください。

前記において「解約」を「換金」ということがあります。



### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

基準価額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則に従って時価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額（以下「純資産総額」といいます。）を、計算日における受益権口数で除した金額をいいます。便宜上1万口あたりに換算した価額で表示されます。

なお、ファンドの主な投資対象の評価方法は以下の通りです。

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。

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

明治安田アセットマネジメント株式会社  
 電話番号 0120-565787（受付時間は、営業日の午前9時～午後5時）  
 ホームページアドレス <https://www.myam.co.jp/>

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

この信託の期間は無期限です。

#### (4)【計算期間】

ファンドの計算期間は、毎年9月17日から翌年9月16日までとすることを原則とします。

ただし、第1計算期間は信託契約締結日から2021年9月16日までとします。

各計算期間終了日に該当する日（以下「該当日」といいます。）が休業日のとき、各計算期間終了日は、該当日の翌営業日とし、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】

信託の終了および繰上償還条項

- 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の口数が20億口を下回ることとなった場合、またはこの信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、もしくは対象インデックスが改廃された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け出ます。
- 委託会社は、前記1.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を發します。
- 前記2.の書面決議において、受益者（委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

4. 前記2. の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 前記2. から4. までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、この信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、前記2. から4. までの手続を行うことが困難な場合には適用しません。

#### 信託契約に関する監督官庁の命令

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

#### 委託会社の登録取消等に伴う取扱い

委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、この信託契約を解約し信託を終了させます。ただし、監督官庁が、この信託契約に関する委託会社の業務を他の委託会社に引き継ぐことを命じたときは、「信託約款の変更 4.」に該当する場合を除き、この信託は、その委託会社と受託会社との間において存続します。

#### 委託会社の事業譲渡および承継に伴う取扱い

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

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

#### 償還金について

償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日から(原則として償還日(償還日が休業日の場合は当該償還日の翌営業日)から起算して5営業日までに)、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。)に支払います。償還金の支払いは、販売会社の営業所等において行うものとします。

#### 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またはこの信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、この信託約款は本条に定める以外の方法によって変更することができないものとし、
2. 委託会社は、前記1. の事項(前記1. の変更事項にあつてはその変更の内容が重大なものに該当する場合に限り、併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除き、以下、合わせて「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。こ

の場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、この信託約款にかかる知っている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。

3. 前記2. の書面決議において、受益者(委託会社およびこの信託の信託財産にこの信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下本項において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行行使することができます。なお、知っている受益者が議決権を行行使しないときは、当該知っている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
4. 前記2. の書面決議は議決権を行行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
5. 書面決議の効力は、この信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
6. 前記2. から5. までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、この信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
7. 前記2. から6. の規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合であっても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### 反対受益者の受益権買取請求の不適用

この信託は、受益者が信託約款の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、前記「信託の終了および繰上償還条項」に規定する信託契約の解約または「信託約款の変更」に規定する重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

#### 運用報告書

委託会社は、決算時および償還時に作成のうえ、交付運用報告書は、販売会社を通じて信託財産にかかる知っている受益者に対して交付します。

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。

#### その他のディスクロージャー資料について

委託会社は、通常、月次の運用レポートを作成しており、販売会社にて入手可能です。

## 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。

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

2. 前項の電子公告による公告をすることができない事故その他やむを得ない事由が生じた場合の公告は、日本経済新聞に掲載します。

### 関係法人との契約の更改等に関する手続き

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

#### 4【受益者の権利等】

受益者の有する主な権利は次の通りです。

##### (1) 収益分配金に対する請求権

受益者は委託会社の決定した収益分配金を持分に応じて請求する権利を有します。

決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）の収益分配金は、販売会社を通じて、決算日の基準価額で翌営業日に無手数料で再投資され、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

##### (2) 償還金に対する請求権

受益者はファンドにかかる償還金を持分に応じて請求する権利を有します。

償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者としします。）の償還金は、信託終了日後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合は翌営業日）から起算して5営業日までに）から、販売会社を通じて、受益者に支払いを開始します。

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

##### (3) 換金(解約)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。

##### (4) 帳簿閲覧請求権

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

##### (5) 反対者の買取請求権

信託契約の解約、または重大な約款の変更等を行う場合には、書面決議において当該解約または重大な約款の変更等に反対した受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

ただし、この信託は、受益者が信託約款の規定による一部解約の実行の請求を行ったときは、委託会社が信託契約の一部の解約をすることにより当該請求に応じ、当該受益権の公正な価格が当該受益者に一部解約金として支払われることとなる委託者指図型投資信託に該当するため、信託約款に規定する信託契約の解約または重大な約款の変更等を行う場合において、投資信託及び投資法人に関する法律第18条第1項に定める反対受益者による受益権の買取請求の規定の適用を受けません。

### 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1期計算期間（2020年12月15日から2021年9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・TOPIXインデックスファンド

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

		第1期 (2021年9月16日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託		848,711
親投資信託受益証券		436,189,544
流動資産合計		437,038,255
資産合計		437,038,255
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金		285,652
未払受託者報酬		16,975
未払委託者報酬		101,823
その他未払費用		4,417
流動負債合計		408,867
負債合計		408,867
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本		369,542,410
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )		67,086,978
(分配準備積立金)		29,738,619
元本等合計		436,629,388
純資産合計		436,629,388
負債純資産合計		437,038,255

## ( 2 ) 【損益及び剰余金計算書】

( 単位：円 )

	第 1 期 ( 自 2020年12月15日 至 2021年 9月16日 )
営業収益	
有価証券売買等損益	31,482,744
営業収益合計	31,482,744
営業費用	
受託者報酬	19,122
委託者報酬	114,497
その他費用	5,339
営業費用合計	138,958
営業利益又は営業損失 ( )	31,343,786
経常利益又は経常損失 ( )	31,343,786
当期純利益又は当期純損失 ( )	31,343,786
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 ( )	1,605,167
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	43,443,586
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	43,443,586
剰余金減少額又は欠損金増加額	6,095,227
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	6,095,227
分配金	-
期末剰余金又は期末欠損金 ( )	67,086,978



**(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	(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	当ファンドの計算期間は、2020年12月15日(設定日)から2021年9月16日までとなっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はございません。

(貸借対照表に関する注記)

第1期 (2021年9月16日現在)	
1. 計算期間の末日における受益権の総数	369,542,410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	1.1815円
(10,000口当たり純資産額)	(11,815円)

## ( 損益及び剰余金計算書に関する注記 )

第 1 期 ( 自 2020年12月15日 至 2021年 9月16日 )		
分配金の計算過程		
計算期末における分配対象額は、67,086,978円(10,000口当たり1,815円40銭)であり、分配金額は0円としております。		
項目	A	金額または口数
配当等収益額(費用控除後)	A	435,695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	29,302,924円
収益調整金額	C	37,348,359円
分配準備積立金額	D	-円
分配対象額( A + B + C + D )	E	67,086,978円
期末受益権口数	F	369,542,410口
10,000口当たりの分配対象額 ( E ÷ F × 10,000 )	G	1,815円 40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

## （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 1 期 (自 2020年12月15日 至 2021年 9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。
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。
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。
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。

## 2．金融商品の時価等に関する事項

	第 1 期 (自 2020年12月15日 至 2021年 9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。
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。

## （関連当事者との取引に関する注記）

第 1 期（自 2020年12月15日 至 2021年 9月16日）

該当事項はございません。

## (その他の注記)

## 1. 元本の移動

	第1期 (自 2020年12月15日 至 2021年9月16日)
期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	433,452,476円
期中一部解約元本額	64,910,066円

## 2. 有価証券関係

## 売買目的有価証券

	第1期 (自 2020年12月15日 至 2021年9月16日)
種類	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	31,132,645
合計	31,132,645

## 3. デリバティブ取引関係

第1期(2021年9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(2021年9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

(2021年9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	明治安田TOPIXマザーファンド	122,735,458	436,189,544	
合計		122,735,458	436,189,544	

## 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「明治安田TOPIX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。

### 明治安田TOPIXマザーファンド

#### （１）貸借対照表

科目	(2021年9月16日現在)
	金額(円)
<b>資産の部</b>	
<b>流動資産</b>	
金銭信託	546,617,269
株式	20,162,244,820
派生商品評価勘定	5,106,240
未収入金	387,844
未収配当金	7,676,041
差入委託証拠金	16,470,000
<b>流動資産合計</b>	<b>20,738,502,214</b>
<b>資産合計</b>	<b>20,738,502,214</b>
<b>負債の部</b>	
<b>流動負債</b>	
未払解約金	8,500,000
その他未払費用	27,708
<b>流動負債合計</b>	<b>8,527,708</b>
<b>負債合計</b>	<b>8,527,708</b>
<b>純資産の部</b>	
<b>元本等</b>	
元本	5,832,949,878
<b>剰余金</b>	
剰余金又は欠損金( )	14,897,024,628
<b>元本等合計</b>	<b>20,729,974,506</b>
<b>純資産合計</b>	<b>20,729,974,506</b>
<b>負債純資産合計</b>	<b>20,738,502,214</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2021年9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、2021年3月11日から2022年3月10日までとなっております。</p>

(重要な会計上の見積りに関する注記)

該当事項はございません。

(その他の注記)

(2021年9月16日現在)	
1. 元本の移動	
対象期間（自 2020年12月15日 至 2021年9月16日）の元本状況	
期首（2020年12月15日）の元本額	6,010,848,955円
対象期間中の追加設定元本額	1,164,994,907円
対象期間中の一部解約元本額	1,342,893,984円
2021年9月16日現在の元本額の内訳	
明治安田DC・TOPIXインデックスファンド	122,735,458円
グローバル・インカム・プラス（毎月分配型）	140,195,280円
明治安田TOPIXオープン	43,489,536円
明治安田DC・TOPIXオープン	2,595,901,809円
明治安田日本株式パッシブPファンド（適格機関投資家私募）	2,930,627,795円
計	5,832,949,878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	3.5539円
（10,000口当たり純資産額）	(35,539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

(2021年9月16日現在)

通貨	銘柄	株式数	評価額		備考
			単価	金額	
日本円	極洋	700	3,120.00	2,184,000	
	日本水産	9,500	644.00	6,118,000	
	マルハニチロ	1,500	2,700.00	4,050,000	
	サカタのタネ	1,200	3,660.00	4,392,000	
	ホクト	1,000	2,003.00	2,003,000	
	日鉄鉱業	300	6,900.00	2,070,000	
	三井松島ホールディングス	3,000	1,407.00	4,221,000	
	I N P E X	37,100	789.00	29,271,900	
	石油資源開発	1,500	1,958.00	2,937,000	
	ショーボンドホールディングス	1,400	5,130.00	7,182,000	
	ミライト・ホールディングス	3,200	2,327.00	7,446,400	
	スペースバリューホールディングス	2,400	829.00	1,989,600	
	安藤・間	6,500	846.00	5,499,000	
	東急建設	4,500	812.00	3,654,000	
	コムシスホールディングス	3,400	3,035.00	10,319,000	
	高松コンストラクショングループ	300	2,095.00	628,500	
	東建コーポレーション	300	10,360.00	3,108,000	
	大成建設	6,700	3,710.00	24,857,000	
	大林組	20,900	977.00	20,419,300	
	清水建設	19,500	863.00	16,828,500	
	飛鳥建設	1,900	1,150.00	2,185,000	
	長谷工コーポレーション	7,200	1,561.00	11,239,200	
	鹿島建設	15,400	1,531.00	23,577,400	
	不動テトラ	1,400	1,811.00	2,535,400	
	大末建設	3,100	1,008.00	3,124,800	
	鉄建建設	800	1,853.00	1,482,400	
	西松建設	1,800	3,635.00	6,543,000	
	三井住友建設	6,100	503.00	3,068,300	
	大豊建設	800	3,935.00	3,148,000	
	前田建設工業	5,600	882.00	4,939,200	
	奥村組	700	3,175.00	2,222,500	
	東鉄工業	800	2,510.00	2,008,000	
	戸田建設	8,200	841.00	6,896,200	
	熊谷組	1,000	2,844.00	2,844,000	
	北野建設	500	2,183.00	1,091,500	
	矢作建設工業	2,200	839.00	1,845,800	
	大東建託	2,400	13,790.00	33,096,000	
	N I P P O	1,500	3,985.00	5,977,500	
	東亜道路工業	500	4,685.00	2,342,500	
	前田道路	1,400	2,005.00	2,807,000	
	日本道路	200	8,550.00	1,710,000	
	東亜建設工業	800	2,469.00	1,975,200	
	若築建設	2,100	2,153.00	4,521,300	
	東洋建設	4,000	577.00	2,308,000	
	五洋建設	9,900	767.00	7,593,300	



世紀東急工業	2,000	889.00	1,778,000
福田組	300	5,200.00	1,560,000
住友林業	5,800	2,251.00	13,055,800
巴コーポレーション	4,100	496.00	2,033,600
大和ハウス工業	20,200	3,856.00	77,891,200
ライト工業	1,600	1,992.00	3,187,200
積水ハウス	23,300	2,420.50	56,397,650
関電工	1,700	966.00	1,642,200
きんでん	3,600	1,967.00	7,081,200
住友電設	700	2,402.00	1,681,400
日本電設工業	900	1,895.00	1,705,500
協和エクシオ	3,300	2,880.00	9,504,000
九電工	1,500	4,115.00	6,172,500
三機工業	1,600	1,571.00	2,513,600
日揮ホールディングス	7,000	999.00	6,993,000
中外炉工業	800	1,878.00	1,502,400
太平電業	700	2,958.00	2,070,600
高砂熱学工業	1,800	2,213.00	3,983,400
明星工業	2,300	789.00	1,814,700
大気社	900	3,495.00	3,145,500
日比谷総合設備	800	1,994.00	1,595,200
レイズネクスト	1,000	1,256.00	1,256,000
ニッポン	1,800	1,675.00	3,015,000
日清製粉グループ本社	7,800	1,941.00	15,139,800
昭和産業	700	2,844.00	1,990,800
東洋精糖	1,800	1,199.00	2,158,200
日本甜菜製糖	800	1,679.00	1,343,200
D M三井製糖ホールディングス	300	2,028.00	608,400
森永製菓	1,700	4,270.00	7,259,000
中村屋	600	3,945.00	2,367,000
江崎グリコ	1,900	4,375.00	8,312,500
不二家	700	2,442.00	1,709,400
山崎製パン	5,600	1,979.00	11,082,400
亀田製菓	500	4,650.00	2,325,000
寿スピリッツ	800	7,060.00	5,648,000
カルビー	3,200	2,945.00	9,424,000
森永乳業	1,400	7,340.00	10,276,000
ヤクルト本社	5,000	5,770.00	28,850,000
明治ホールディングス	4,500	7,470.00	33,615,000
雪印メグミルク	1,700	2,355.00	4,003,500
プリマハム	1,000	3,080.00	3,080,000
日本ハム	2,600	4,505.00	11,713,000
丸大食品	700	1,828.00	1,279,600
S Foods	800	3,210.00	2,568,000
伊藤ハム米久ホールディングス	3,000	766.00	2,298,000
サッポロホールディングス	2,400	2,552.00	6,124,800
アサヒグループホールディングス	16,500	5,512.00	90,948,000
麒麟ホールディングス	26,300	2,080.00	54,704,000
宝ホールディングス	5,600	1,609.00	9,010,400

コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	4,900	1,625.00	7,962,500	
サントリー食品インターナショナル	4,500	4,800.00	21,600,000	
ダイドーグループホールディングス	600	6,020.00	3,612,000	
伊藤園	2,300	7,640.00	17,572,000	
キーコーヒー	1,100	2,275.00	2,502,500	
ジャパンフーズ	1,600	1,260.00	2,016,000	
日清オイリオグループ	800	3,160.00	2,528,000	
不二製油グループ本社	1,900	2,712.00	5,152,800	
J・オイルミルズ	900	1,865.00	1,678,500	
キッコーマン	5,100	9,410.00	47,991,000	
味の素	16,900	3,548.00	59,961,200	
キュービー	3,900	2,792.00	10,888,800	
ハウス食品グループ本社	2,700	3,720.00	10,044,000	
カゴメ	2,900	3,035.00	8,801,500	
アリアケジャパン	700	6,820.00	4,774,000	
ニチレイ	3,500	2,975.00	10,412,500	
東洋水産	3,700	5,210.00	19,277,000	
日清食品ホールディングス	2,800	9,260.00	25,928,000	
フジッコ	800	1,946.00	1,556,800	
ロック・フィールド	1,600	1,713.00	2,740,800	
日本たばこ産業	37,100	2,193.50	81,378,850	
わらべや日洋ホールディングス	900	2,600.00	2,340,000	
ユーグレナ	4,400	876.00	3,854,400	
ミヨシ油脂	1,600	1,348.00	2,156,800	
片倉工業	1,400	1,590.00	2,226,000	
グンゼ	500	4,455.00	2,227,500	
東洋紡	2,500	1,430.00	3,575,000	
富士紡ホールディングス	500	4,515.00	2,257,500	
倉敷紡績	700	2,061.00	1,442,700	
シキボウ	1,400	949.00	1,328,600	
日本毛織	1,400	1,064.00	1,489,600	
ダイドーリミテッド	6,200	172.00	1,066,400	
帝国繊維	1,000	2,146.00	2,146,000	
帝人	5,900	1,663.00	9,811,700	
東レ	49,000	734.00	35,966,000	
住江織物	800	1,888.00	1,510,400	
アツギ	1,900	649.00	1,233,100	
セーレン	1,900	2,164.00	4,111,600	
小松マテーレ	2,600	1,033.00	2,685,800	
ワコールホールディングス	1,500	2,363.00	3,544,500	
ホギメディカル	800	3,405.00	2,724,000	
T S Iホールディングス	3,700	339.00	1,254,300	
ワールド	1,400	1,491.00	2,087,400	
オンワードホールディングス	5,200	326.00	1,695,200	
ルックホールディングス	1,100	1,400.00	1,540,000	
ゴールドウイン	1,200	7,380.00	8,856,000	
デザート	1,400	4,190.00	5,866,000	
特種東海製紙	600	4,695.00	2,817,000	
王子ホールディングス	31,000	592.00	18,352,000	

日本製紙	1,600	1,254.00	2,006,400
三菱製紙	3,500	386.00	1,351,000
北越コーポレーション	3,300	670.00	2,211,000
中越パルプ工業	900	1,270.00	1,143,000
大王製紙	3,500	2,214.00	7,749,000
レンゴー	6,800	942.00	6,405,600
トモク	600	2,008.00	1,204,800
ザ・パックス	700	3,195.00	2,236,500
クラレ	9,800	1,082.00	10,603,600
旭化成	45,300	1,259.00	57,032,700
昭和電工	6,100	2,769.00	16,890,900
住友化学	54,200	604.00	32,736,800
住友精化	500	3,825.00	1,912,500
日産化学	3,900	6,910.00	26,949,000
ラサ工業	900	2,024.00	1,821,600
クレハ	600	8,380.00	5,028,000
石原産業	2,000	1,360.00	2,720,000
日本曹達	900	3,755.00	3,379,500
東ソー	10,400	2,167.00	22,536,800
トクヤマ	2,200	2,286.00	5,029,200
セントラル硝子	800	2,200.00	1,760,000
東亜合成	3,800	1,369.00	5,202,200
大阪ソーダ	800	2,899.00	2,319,200
関東電化工業	2,400	1,124.00	2,697,600
デンカ	2,600	4,165.00	10,829,000
信越化学工業	12,700	21,055.00	267,398,500
日本カーバイド工業	1,600	1,486.00	2,377,600
堺化学工業	1,000	2,379.00	2,379,000
エア・ウォーター	7,000	1,869.00	13,083,000
日本酸素ホールディングス	5,900	2,906.00	17,145,400
日本化学工業	600	3,465.00	2,079,000
日本パーカライジング	3,300	1,258.00	4,151,400
四国化成工業	1,200	1,449.00	1,738,800
ステラ ケミファ	700	3,110.00	2,177,000
保土谷化学工業	400	5,210.00	2,084,000
日本触媒	1,000	6,100.00	6,100,000
大日精化工業	500	2,811.00	1,405,500
カネカ	1,600	4,905.00	7,848,000
三菱瓦斯化学	6,700	2,441.00	16,354,700
三井化学	5,800	4,020.00	23,316,000
J S R	7,000	4,270.00	29,890,000
東京応化工業	1,200	7,970.00	9,564,000
三菱ケミカルホールディングス	44,700	1,048.00	46,845,600
K Hネオケム	1,400	3,230.00	4,522,000
ダイセル	8,900	912.00	8,116,800
住友ベークライト	1,100	5,570.00	6,127,000
積水化学工業	13,700	2,078.00	28,468,600
日本ゼオン	6,400	1,630.00	10,432,000
アイカ工業	1,900	3,950.00	7,505,000
宇部興産	2,600	2,341.00	6,086,600

積水樹脂	1,100	2,295.00	2,524,500
タキロンシーアイ	3,200	676.00	2,163,200
旭有機材	1,400	1,565.00	2,191,000
リケンテクノス	3,400	599.00	2,036,600
大倉工業	700	2,322.00	1,625,400
群栄化学工業	300	3,195.00	958,500
ダイキョーニシカワ	1,500	680.00	1,020,000
日本化薬	3,700	1,284.00	4,750,800
扶桑化学工業	700	5,180.00	3,626,000
A D E K A	3,000	2,721.00	8,163,000
日油	2,700	6,690.00	18,063,000
花王	15,500	6,743.00	104,516,500
第一工業製薬	500	3,440.00	1,720,000
三洋化成工業	300	6,030.00	1,809,000
大日本塗料	1,700	900.00	1,530,000
日本ペイントホールディングス	27,000	1,427.00	38,529,000
関西ペイント	7,800	3,020.00	23,556,000
中国塗料	2,200	936.00	2,059,200
藤倉化成	3,600	573.00	2,062,800
太陽ホールディングス	600	6,130.00	3,678,000
D I C	2,400	3,305.00	7,932,000
サカタインクス	1,500	1,232.00	1,848,000
東洋インキ S C ホールディングス	300	2,156.00	646,800
T & K T O K A	1,800	887.00	1,596,600
富士フイルムホールディングス	12,300	9,889.00	121,634,700
資生堂	13,300	7,995.00	106,333,500
ライオン	8,800	1,862.00	16,385,600
高砂香料工業	700	3,110.00	2,177,000
マンダム	1,500	1,612.00	2,418,000
ミルボン	1,000	6,970.00	6,970,000
ファンケル	2,700	3,810.00	10,287,000
コーセー	1,400	13,160.00	18,424,000
ポーラ・オルビスホールディングス	3,100	2,626.00	8,140,600
ノエビアホールディングス	500	6,020.00	3,010,000
コニシ	1,600	1,840.00	2,944,000
長谷川香料	1,100	3,030.00	3,333,000
星光 P M C	2,400	904.00	2,169,600
小林製薬	2,000	8,910.00	17,820,000
メック	800	3,715.00	2,972,000
日本高純度化学	1,100	3,100.00	3,410,000
タカラバイオ	2,200	3,315.00	7,293,000
J C U	1,000	4,710.00	4,710,000
新田ゼラチン	2,700	669.00	1,806,300
デクセリアルズ	2,300	2,358.00	5,423,400
アース製薬	600	7,050.00	4,230,000
大成ラミック	700	2,966.00	2,076,200
クミアイ化学工業	3,300	924.00	3,049,200
日本農薬	2,300	572.00	1,315,600
アキレス	800	1,380.00	1,104,000
有沢製作所	1,600	902.00	1,443,200

日東電工	4,200	8,640.00	36,288,000
きもと	8,200	256.00	2,099,200
藤森工業	700	5,050.00	3,535,000
前澤化成工業	1,700	1,306.00	2,220,200
J S P	300	1,709.00	512,700
エフピコ	1,400	4,425.00	6,195,000
天馬	600	3,080.00	1,848,000
ニフコ	2,700	3,660.00	9,882,000
バルカー	1,000	2,305.00	2,305,000
ユニ・チャーム	13,600	4,942.00	67,211,200
協和キリン	8,100	4,080.00	33,048,000
武田薬品工業	58,100	3,780.00	219,618,000
アステラス製薬	60,500	1,882.50	113,891,250
大日本住友製薬	5,700	2,080.00	11,856,000
塩野義製薬	8,900	7,523.00	66,954,700
日本新薬	2,000	9,610.00	19,220,000
中外製薬	22,100	4,127.00	91,206,700
科研製薬	1,100	4,890.00	5,379,000
エーザイ	7,900	8,343.00	65,909,700
ロート製薬	3,400	3,535.00	12,019,000
小野薬品工業	16,100	2,694.50	43,381,450
久光製薬	1,900	4,395.00	8,350,500
持田製薬	900	3,625.00	3,262,500
参天製薬	12,400	1,678.00	20,807,200
扶桑薬品工業	800	2,631.00	2,104,800
日本ケミファ	700	2,320.00	1,624,000
ツムラ	2,400	3,920.00	9,408,000
日医工	2,800	919.00	2,573,200
キッセイ薬品工業	800	2,600.00	2,080,000
生化学工業	1,700	1,140.00	1,938,000
栄研化学	1,700	2,289.00	3,891,300
鳥居薬品	500	3,035.00	1,517,500
J C R ファーマ	2,300	2,940.00	6,762,000
東和薬品	1,200	3,380.00	4,056,000
ゼリア新薬工業	1,400	2,207.00	3,089,800
第一三共	55,300	2,769.00	153,125,700
キョーリン製薬ホールディングス	1,600	1,887.00	3,019,200
大幸薬品	1,900	936.00	1,778,400
ダイト	700	3,605.00	2,523,500
大塚ホールディングス	14,300	4,931.00	70,513,300
大正製薬ホールディングス	1,500	6,720.00	10,080,000
ペプチドリーム	3,900	3,830.00	14,937,000
あすか製薬ホールディングス	1,600	1,101.00	1,761,600
サワイグループホールディングス	1,500	5,300.00	7,950,000
日本コークス工業	17,100	131.00	2,240,100
ニチレキ	1,400	1,363.00	1,908,200
ビーピー・カストロール	900	1,390.00	1,251,000
富士石油	11,600	262.00	3,039,200
出光興産	7,200	2,890.00	20,808,000
E N E O S ホールディングス	99,900	465.00	46,453,500

コスモエネルギーホールディングス	2,500	2,429.00	6,072,500
横浜ゴム	4,100	2,011.00	8,245,100
TOYO TIRE	3,900	2,017.00	7,866,300
ブリヂストン	20,000	5,315.00	106,300,000
住友ゴム工業	6,400	1,414.00	9,049,600
藤倉コンポジット	3,600	800.00	2,880,000
オカモト	500	4,490.00	2,245,000
ニッタ	800	2,864.00	2,291,200
住友理工	700	757.00	529,900
三ツ星ベルト	1,000	2,106.00	2,106,000
パンドー化学	1,800	992.00	1,785,600
日東紡績	1,200	3,750.00	4,500,000
A G C	6,200	5,720.00	35,464,000
日本板硝子	4,500	586.00	2,637,000
日本山村硝子	600	929.00	557,400
日本電気硝子	2,200	2,436.00	5,359,200
住友大阪セメント	1,100	3,200.00	3,520,000
太平洋セメント	4,000	2,514.00	10,056,000
日本ヒューム	1,800	765.00	1,377,000
日本コンクリート工業	4,900	319.00	1,563,100
三谷セキサン	500	6,810.00	3,405,000
アジアパイルホールディングス	2,400	508.00	1,219,200
東海カーボン	6,600	1,620.00	10,692,000
日本カーボン	700	4,405.00	3,083,500
東洋炭素	700	3,205.00	2,243,500
ノリタケカンパニーリミテド	500	4,665.00	2,332,500
TOTO	5,000	6,170.00	30,850,000
日本碍子	7,400	1,934.00	14,311,600
日本特殊陶業	5,400	1,798.00	9,709,200
MARUWA	300	11,990.00	3,597,000
品川リフラクトリーズ	500	4,130.00	2,065,000
黒崎播磨	300	5,190.00	1,557,000
フジインコーポレーテッド	800	6,680.00	5,344,000
ニチアス	1,800	2,989.00	5,380,200
ニチハ	1,100	3,490.00	3,839,000
日本製鉄	32,900	2,289.50	75,324,550
神戸製鋼所	12,600	738.00	9,298,800
合同製鐵	600	1,596.00	957,600
ジェイ エフ イー ホールディングス	19,600	1,878.00	36,808,800
東京製鐵	3,300	1,277.00	4,214,100
共英製鋼	800	1,467.00	1,173,600
大和工業	1,400	4,070.00	5,698,000
東京鐵鋼	900	1,663.00	1,496,700
淀川製鋼所	700	2,586.00	1,810,200
丸一鋼管	1,900	2,877.00	5,466,300
大同特殊鋼	1,100	5,170.00	5,687,000
日本冶金工業	1,300	2,834.00	3,684,200
愛知製鋼	200	2,859.00	571,800
日立金属	6,500	2,149.00	13,968,500
大平洋金属	900	2,002.00	1,801,800

新日本電工	7,800	344.00	2,683,200
栗本鐵工所	700	1,712.00	1,198,400
三菱製鋼	1,400	1,430.00	2,002,000
日本軽金属ホールディングス	1,600	2,093.00	3,348,800
三井金属鉱業	1,900	3,435.00	6,526,500
東邦亜鉛	800	3,045.00	2,436,000
三菱マテリアル	4,200	2,332.00	9,794,400
住友金属鉱山	8,900	4,340.00	38,626,000
DOWAホールディングス	1,800	4,865.00	8,757,000
古河機械金属	800	1,312.00	1,049,600
大阪チタニウムテクノロジーズ	2,000	812.00	1,624,000
東邦チタニウム	2,300	1,229.00	2,826,700
UACJ	1,100	3,010.00	3,311,000
古河電気工業	2,100	2,423.00	5,088,300
住友電気工業	23,500	1,529.50	35,943,250
フジクラ	8,300	712.00	5,909,600
タツタ電線	3,000	556.00	1,668,000
リョービ	800	1,330.00	1,064,000
アサヒホールディングス	3,200	2,180.00	6,976,000
宮地エンジニアリンググループ	1,000	2,740.00	2,740,000
トーカロ	2,000	1,472.00	2,944,000
SUMCO	9,100	2,505.00	22,795,500
川田テクノロジーズ	400	3,825.00	1,530,000
東洋製罐グループホールディングス	4,100	1,366.00	5,600,600
横河ブリッジホールディングス	1,100	2,479.00	2,726,900
駒井ハルテック	800	1,789.00	1,431,200
三和ホールディングス	6,700	1,546.00	10,358,200
文化シャッター	2,800	1,175.00	3,290,000
三協立山	1,300	804.00	1,045,200
LIXIL	9,500	3,290.00	31,255,000
ノーリツ	1,200	1,964.00	2,356,800
長府製作所	700	2,204.00	1,542,800
リンナイ	1,400	13,340.00	18,676,000
岡部	1,900	707.00	1,343,300
東プレ	1,500	1,426.00	2,139,000
高周波熱錬	2,300	694.00	1,596,200
東京製鋼	1,200	1,016.00	1,219,200
パイオラックス	1,500	1,600.00	2,400,000
日本発條	6,400	831.00	5,318,400
三益半導体工業	700	2,633.00	1,843,100
日本製鋼所	2,400	3,055.00	7,332,000
三浦工業	3,100	5,220.00	16,182,000
タクマ	2,600	1,724.00	4,482,400
ツガミ	1,800	1,967.00	3,540,600
オークマ	700	5,850.00	4,095,000
芝浦機械	800	2,791.00	2,232,800
アマダ	9,300	1,242.00	11,550,600
アイダエンジニアリング	1,600	1,160.00	1,856,000
FUJI	2,700	3,175.00	8,572,500
牧野フライス製作所	800	4,600.00	3,680,000

オーエスジー	3,200	2,158.00	6,905,600
旭ダイヤモンド工業	2,000	555.00	1,110,000
D M G 森精機	4,700	2,214.00	10,405,800
ソディック	1,400	958.00	1,341,200
ディスコ	900	33,650.00	30,285,000
日東工器	700	2,087.00	1,460,900
島精機製作所	800	2,460.00	1,968,000
オプトラン	1,200	2,281.00	2,737,200
日阪製作所	1,600	931.00	1,489,600
やまびこ	1,700	1,335.00	2,269,500
平田機工	300	7,220.00	2,166,000
ナブテスコ	4,100	4,835.00	19,823,500
三井海洋開発	900	1,765.00	1,588,500
レオン自動車	1,300	1,600.00	2,080,000
S M C	2,000	78,220.00	156,440,000
ホソカワミクロン	300	7,290.00	2,187,000
ユニオンツール	200	4,095.00	819,000
オイレス工業	1,100	1,759.00	1,934,900
日精エー・エス・ビー機械	200	4,320.00	864,000
サトーホールディングス	1,000	2,903.00	2,903,000
技研製作所	800	4,945.00	3,956,000
小松製作所	31,500	2,847.50	89,696,250
住友重機械工業	4,000	3,155.00	12,620,000
日立建機	3,300	3,385.00	11,170,500
日工	1,800	687.00	1,236,600
井関農機	900	1,777.00	1,599,300
北川鉄工所	1,400	1,679.00	2,350,600
クボタ	34,500	2,492.00	85,974,000
三菱化工機	700	2,562.00	1,793,400
月島機械	1,600	1,244.00	1,990,400
帝国電機製作所	1,200	1,411.00	1,693,200
新東工業	1,200	808.00	969,600
澁谷工業	700	3,310.00	2,317,000
小森コーポレーション	900	907.00	816,300
鶴見製作所	800	1,875.00	1,500,000
酒井重工業	500	2,589.00	1,294,500
荏原製作所	2,900	6,060.00	17,574,000
西島製作所	1,600	946.00	1,513,600
ダイキン工業	9,000	28,340.00	255,060,000
オルガノ	300	7,100.00	2,130,000
トーヨーカネツ	700	2,730.00	1,911,000
栗田工業	3,900	5,980.00	23,322,000
椿本チエイン	800	3,710.00	2,968,000
大同工業	1,100	1,154.00	1,269,400
アネスト岩田	1,700	1,010.00	1,717,000
ダイフク	4,000	11,340.00	45,360,000
加藤製作所	1,000	918.00	918,000
タダノ	3,700	1,235.00	4,569,500
フジテック	2,600	2,928.00	7,612,800
C K D	1,700	2,557.00	4,346,900



キトー	1,200	1,906.00	2,287,200
平和	1,000	2,064.00	2,064,000
理想科学工業	800	2,595.00	2,076,000
SANKYO	1,200	2,830.00	3,396,000
日本金銭機械	3,200	602.00	1,926,400
フクシマガリレイ	600	5,320.00	3,192,000
ダイコク電機	800	1,282.00	1,025,600
竹内製作所	1,300	2,655.00	3,451,500
アマノ	1,800	2,994.00	5,389,200
JUKI	1,800	858.00	1,544,400
蛇の目ミシン工業	1,700	759.00	1,290,300
マックス	800	1,999.00	1,599,200
グローリー	1,500	2,515.00	3,772,500
新晃工業	900	2,299.00	2,069,100
大和冷機工業	2,000	1,324.00	2,648,000
セガサミーホールディングス	6,100	1,586.00	9,674,600
日本ピストンリング	2,000	1,526.00	3,052,000
リケン	600	2,933.00	1,759,800
T P R	1,100	1,555.00	1,710,500
ツバキ・ナカシマ	2,000	1,601.00	3,202,000
ホシザキ	2,100	10,880.00	22,848,000
大豊工業	2,100	880.00	1,848,000
日本精工	14,100	776.00	10,941,600
NTN	16,300	262.00	4,270,600
ジェイテクト	6,600	990.00	6,534,000
不二越	600	4,740.00	2,844,000
日本トムソン	3,800	572.00	2,173,600
T H K	4,200	2,662.00	11,180,400
ユーシン精機	1,400	860.00	1,204,000
イーグル工業	300	1,312.00	393,600
日本ピラー工業	1,400	2,914.00	4,079,600
キッツ	2,700	863.00	2,330,100
マキタ	9,100	6,850.00	62,335,000
日立造船	6,400	959.00	6,137,600
三菱重工業	10,900	3,053.00	33,277,700
I H I	4,900	2,638.00	12,926,200
スター精密	800	1,610.00	1,288,000
日清紡ホールディングス	2,600	839.00	2,181,400
イビデン	3,500	6,600.00	23,100,000
コニカミノルタ	14,300	603.00	8,622,900
ブラザー工業	8,300	2,601.00	21,588,300
ミネベアミツミ	12,100	3,000.00	36,300,000
日立製作所	33,700	6,545.00	220,566,500
東芝	14,000	4,720.00	66,080,000
三菱電機	68,500	1,588.50	108,812,250
富士電機	4,200	5,160.00	21,672,000
東洋電機製造	1,100	1,126.00	1,238,600
安川電機	7,500	6,040.00	45,300,000
シンフォニアテクノロジー	1,600	1,259.00	2,014,400
明電舎	1,500	2,575.00	3,862,500

山洋電気	400	7,560.00	3,024,000
デンヨー	1,000	2,291.00	2,291,000
東芝テック	800	4,860.00	3,888,000
マブチモーター	1,700	4,005.00	6,808,500
日本電産	16,900	13,865.00	234,318,500
東光高岳	900	1,538.00	1,384,200
ダイヘン	800	5,140.00	4,112,000
JVCケンウッド	9,800	209.00	2,048,200
日新電機	1,600	1,431.00	2,289,600
大崎電気工業	1,900	565.00	1,073,500
オムロン	5,700	11,630.00	66,291,000
日東工業	1,100	1,811.00	1,992,100
I D E C	1,400	2,343.00	3,280,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	2,700	2,632.00	7,106,400
メルコホールディングス	400	5,120.00	2,048,000
日本電気	9,100	6,320.00	57,512,000
富士通	6,400	21,575.00	138,080,000
沖電気工業	3,000	998.00	2,994,000
電気興業	600	2,333.00	1,399,800
サンケン電気	900	6,650.00	5,985,000
アイホン	1,100	2,369.00	2,605,900
ルネサスエレクトロニクス	38,300	1,389.00	53,198,700
セイコーエプソン	8,600	2,332.00	20,055,200
ワコム	6,100	750.00	4,575,000
アルバック	1,400	6,700.00	9,380,000
アクセル	1,700	781.00	1,327,700
日本信号	1,500	1,000.00	1,500,000
京三製作所	2,900	512.00	1,484,800
能美防災	900	2,150.00	1,935,000
エレコム	1,800	1,888.00	3,398,400
パナソニック	74,600	1,431.00	106,752,600
シャープ	9,300	1,424.00	13,243,200
アンリツ	4,400	2,023.00	8,901,200
富士通ゼネラル	2,300	2,936.00	6,752,800
ソニーグループ	44,100	12,270.00	541,107,000
T D K	3,400	12,750.00	43,350,000
タムラ製作所	4,000	751.00	3,004,000
アルプスアルパイン	5,800	1,248.00	7,238,400
日本トリム	300	3,850.00	1,155,000
ローランド ディー・ジー	800	3,335.00	2,668,000
フォスター電機	900	943.00	848,700
S M K	500	2,499.00	1,249,500
ホシデン	2,600	950.00	2,470,000
ヒロセ電機	1,000	19,820.00	19,820,000
日本航空電子工業	1,800	1,722.00	3,099,600
T O A	1,400	864.00	1,209,600
マクセルホールディングス	1,700	1,348.00	2,291,600
古野電気	1,700	1,168.00	1,985,600
アイコム	600	2,475.00	1,485,000
横河電機	6,900	2,011.00	13,875,900

新電元工業	500	4,290.00	2,145,000
アズビル	4,900	5,150.00	25,235,000
日本光電工業	3,100	3,985.00	12,353,500
共和電業	4,900	403.00	1,974,700
堀場製作所	1,400	8,190.00	11,466,000
アドバンテスト	5,300	11,080.00	58,724,000
エスベック	800	2,401.00	1,920,800
キーエンス	6,900	73,080.00	504,252,000
日置電機	500	9,800.00	4,900,000
シスメックス	5,500	14,585.00	80,217,500
日本マイクロニクス	1,700	1,536.00	2,611,200
メガチップス	900	3,595.00	3,235,500
OBARA GROUP	300	4,250.00	1,275,000
コーセル	1,700	998.00	1,696,600
イリソ電子工業	700	5,020.00	3,514,000
オブテックスグループ	1,400	1,592.00	2,228,800
千代田インテグレ	900	2,200.00	1,980,000
レーザーテック	3,200	28,220.00	90,304,000
スタンレー電気	4,800	2,971.00	14,260,800
岩崎電気	900	2,064.00	1,857,600
ウシオ電機	3,600	2,175.00	7,830,000
日本セラミック	800	3,130.00	2,504,000
遠藤照明	2,000	1,086.00	2,172,000
古河電池	800	1,602.00	1,281,600
日本電子	1,500	8,990.00	13,485,000
カシオ計算機	5,800	1,855.00	10,759,000
ファナック	6,100	26,295.00	160,399,500
エンプラス	600	3,315.00	1,989,000
大真空	500	4,055.00	2,027,500
ローム	3,000	11,290.00	33,870,000
浜松ホトニクス	5,000	7,080.00	35,400,000
三井ハイテック	800	8,220.00	6,576,000
新光電気工業	2,600	3,985.00	10,361,000
京セラ	10,300	7,246.00	74,633,800
太陽誘電	3,300	7,520.00	24,816,000
村田製作所	20,700	10,200.00	211,140,000
双葉電子工業	1,100	827.00	909,700
北陸電気工業	1,400	1,056.00	1,478,400
ニチコン	3,100	1,145.00	3,549,500
日本ケミコン	1,200	2,246.00	2,695,200
KOA	1,600	1,840.00	2,944,000
小糸製作所	4,300	7,030.00	30,229,000
ミツバ	2,500	690.00	1,725,000
SCREENホールディングス	1,200	10,310.00	12,372,000
キャノン電子	300	1,673.00	501,900
キャノン	34,600	2,711.00	93,800,600
リコー	18,200	1,117.00	20,329,400
象印マホービン	1,800	1,895.00	3,411,000
東京エレクトロン	4,200	54,750.00	229,950,000
トヨタ紡織	1,900	2,041.00	3,877,900

	ユニプレス	1,200	938.00	1,125,600	
	豊田自動織機	5,600	9,740.00	54,544,000	
	モリタホールディングス	1,100	1,652.00	1,817,200	
	三櫻工業	1,800	1,100.00	1,980,000	
	デンソー	15,400	7,848.00	120,859,200	
	東海理化電機製作所	1,600	1,673.00	2,676,800	
	川崎重工業	5,700	2,507.00	14,289,900	
	名村造船所	8,600	255.00	2,193,000	
	三菱ロジスネクスト	1,300	1,146.00	1,489,800	
	近畿車輛	700	1,165.00	815,500	
	日産自動車	82,800	571.30	47,303,640	
	いすゞ自動車	19,800	1,474.00	29,185,200	
	トヨタ自動車	71,000	9,940.00	705,740,000	
	日野自動車	9,400	1,011.00	9,503,400	
	三菱自動車工業	27,400	285.00	7,809,000	
	武蔵精密工業	2,000	2,010.00	4,020,000	
	日産車体	1,100	807.00	887,700	
	新明和工業	2,800	977.00	2,735,600	
	極東開発工業	1,200	1,782.00	2,138,400	
	トビー工業	900	1,285.00	1,156,500	
	ティラド	700	3,490.00	2,443,000	
	タチエス	1,400	1,351.00	1,891,400	
	N O K	3,200	1,394.00	4,460,800	
	フタバ産業	2,400	489.00	1,173,600	
	大同メタル工業	3,000	629.00	1,887,000	
	プレス工業	4,900	350.00	1,715,000	
	太平洋工業	2,200	1,250.00	2,750,000	
	河西工業	3,200	394.00	1,260,800	
	アイシン	5,000	4,270.00	21,350,000	
	マツダ	22,400	957.00	21,436,800	
	今仙電機製作所	1,500	730.00	1,095,000	
	本田技研工業	55,000	3,414.00	187,770,000	
	スズキ	14,000	5,133.00	71,862,000	
	S U B A R U	20,000	2,087.00	41,740,000	
	ヤマハ発動機	9,300	3,105.00	28,876,500	
	T B K	3,600	422.00	1,519,200	
	エクセディ	1,000	1,764.00	1,764,000	
	豊田合成	2,400	2,341.00	5,618,400	
	愛三工業	2,300	873.00	2,007,900	
	ヨロズ	1,000	1,290.00	1,290,000	
	エフ・シー・シー	1,200	1,599.00	1,918,800	
	シマノ	2,800	34,960.00	97,888,000	
	テイ・エス テック	2,700	1,511.00	4,079,700	
	ジャムコ	1,600	1,011.00	1,617,600	
	テルモ	21,500	5,372.00	115,498,000	
	クリエートメディック	1,900	999.00	1,898,100	
	日機装	2,600	983.00	2,555,800	
	島津製作所	9,100	5,400.00	49,140,000	
	ブイ・テクノロジー	500	4,755.00	2,377,500	
	東京計器	1,800	1,072.00	1,929,600	

東京精密	1,400	4,930.00	6,902,000
マニー	2,800	2,296.00	6,428,800
ニコン	10,600	1,304.00	13,822,400
トプコン	4,000	1,994.00	7,976,000
オリンパス	37,200	2,397.50	89,187,000
理研計器	900	3,070.00	2,763,000
タムロン	700	2,821.00	1,974,700
H O Y A	13,800	19,000.00	262,200,000
朝日インテック	7,600	3,300.00	25,080,000
シチズン時計	8,700	540.00	4,698,000
大研医器	3,000	610.00	1,830,000
メニコン	1,200	9,440.00	11,328,000
セイコーホールディングス	1,200	2,229.00	2,674,800
ニプロ	5,000	1,199.00	5,995,000
パラマウントベッドホールディングス	1,100	2,279.00	2,506,900
前田工織	1,000	3,580.00	3,580,000
永大産業	3,700	317.00	1,172,900
アートネイチャー	2,600	750.00	1,950,000
バンダイナムコホールディングス	5,900	8,828.00	52,085,200
フランスベッドホールディングス	1,400	968.00	1,355,200
パイロットコーポレーション	1,200	4,440.00	5,328,000
トッパン・フォームズ	1,400	1,037.00	1,451,800
フジシールインターナショナル	1,700	2,657.00	4,516,900
タカラトミー	3,300	1,191.00	3,930,300
プロネクス	1,800	1,132.00	2,037,600
ウッドワン	1,200	1,178.00	1,413,600
大建工業	800	2,483.00	1,986,400
凸版印刷	10,200	2,040.00	20,808,000
大日本印刷	7,900	2,806.00	22,167,400
共同印刷	600	2,789.00	1,673,400
N I S S H A	1,800	1,855.00	3,339,000
アシックス	6,500	2,624.00	17,056,000
ツツミ	500	2,375.00	1,187,500
ヤマハ	4,200	7,420.00	31,164,000
河合楽器製作所	600	4,130.00	2,478,000
クリナップ	1,600	589.00	942,400
ピジョン	4,500	2,902.00	13,059,000
リンテック	800	2,729.00	2,183,200
イトーキ	2,600	384.00	998,400
任天堂	4,100	52,500.00	215,250,000
三菱鉛筆	1,100	1,556.00	1,711,600
タカラスタンダード	1,600	1,690.00	2,704,000
コクヨ	2,800	2,033.00	5,692,400
グローブライド	600	9,430.00	5,658,000
オカムラ	2,400	1,766.00	4,238,400
美津濃	600	2,712.00	1,627,200
東京電力ホールディングス	62,200	304.00	18,908,800
中部電力	20,500	1,358.00	27,839,000
関西電力	25,800	1,130.00	29,154,000
中国電力	9,900	1,067.00	10,563,300

北陸電力	6,800	605.00	4,114,000
東北電力	14,800	860.00	12,728,000
四国電力	4,100	809.00	3,316,900
九州電力	15,700	868.00	13,627,600
北海道電力	8,400	539.00	4,527,600
沖縄電力	1,300	1,481.00	1,925,300
電源開発	5,700	1,679.00	9,570,300
レノバ	1,500	5,650.00	8,475,000
東京瓦斯	13,600	2,179.50	29,641,200
大阪瓦斯	12,600	2,160.00	27,216,000
東邦瓦斯	3,600	5,270.00	18,972,000
北海道瓦斯	1,200	1,636.00	1,963,200
西部ガスホールディングス	1,200	2,529.00	3,034,800
静岡ガス	2,800	1,318.00	3,690,400
メタウォーター	900	1,968.00	1,771,200
東武鉄道	7,400	2,905.00	21,497,000
相鉄ホールディングス	2,500	2,169.00	5,422,500
東急	17,700	1,561.00	27,629,700
京浜急行電鉄	9,100	1,313.00	11,948,300
小田急電鉄	11,500	2,505.00	28,807,500
京王電鉄	4,000	5,860.00	23,440,000
京成電鉄	5,200	3,500.00	18,200,000
富士急行	1,100	4,435.00	4,878,500
東日本旅客鉄道	12,300	6,912.00	85,017,600
西日本旅客鉄道	6,300	5,125.00	32,287,500
東海旅客鉄道	5,800	15,720.00	91,176,000
西武ホールディングス	9,300	1,306.00	12,145,800
鴻池運輸	900	1,418.00	1,276,200
西日本鉄道	1,900	2,808.00	5,335,200
ハマキョウレックス	800	3,530.00	2,824,000
サカイ引越センター	500	5,040.00	2,520,000
近鉄グループホールディングス	6,800	3,635.00	24,718,000
阪急阪神ホールディングス	8,300	3,440.00	28,552,000
南海電気鉄道	3,000	2,346.00	7,038,000
京阪ホールディングス	3,000	3,045.00	9,135,000
神戸電鉄	600	3,635.00	2,181,000
名古屋鉄道	4,800	1,989.00	9,547,200
山陽電気鉄道	900	2,087.00	1,878,300
日本通運	2,300	8,180.00	18,814,000
ヤマトホールディングス	9,400	2,933.00	27,570,200
山九	1,600	5,440.00	8,704,000
丸全昭和運輸	800	3,745.00	2,996,000
センコーグループホールディングス	4,100	1,052.00	4,313,200
ニッコンホールディングス	1,700	2,473.00	4,204,100
福山通運	800	5,030.00	4,024,000
セイノーホールディングス	4,700	1,420.00	6,674,000
神奈川中央交通	100	3,635.00	363,500
日立物流	1,400	4,895.00	6,853,000
丸和運輸機関	1,800	1,694.00	3,049,200
九州旅客鉄道	5,200	2,441.00	12,693,200

S Gホールディングス	13,100	3,330.00	43,623,000
日本郵船	5,700	10,060.00	57,342,000
商船三井	4,000	9,210.00	36,840,000
川崎汽船	2,400	7,310.00	17,544,000
N Sユナイテッド海運	700	5,040.00	3,528,000
飯野海運	4,400	580.00	2,552,000
日本航空	16,600	2,363.00	39,225,800
A N Aホールディングス	18,300	2,590.50	47,406,150
トランコム	300	8,990.00	2,697,000
日新	800	1,680.00	1,344,000
三菱倉庫	2,300	3,380.00	7,774,000
三井倉庫ホールディングス	1,100	2,752.00	3,027,200
住友倉庫	1,600	2,004.00	3,206,400
澁澤倉庫	1,000	2,488.00	2,488,000
安田倉庫	1,200	1,012.00	1,214,400
東洋埠頭	1,100	1,573.00	1,730,300
上組	3,200	2,465.00	7,888,000
近鉄エクスプレス	1,400	3,110.00	4,354,000
N E C ネットエスアイ	3,100	2,235.00	6,928,500
システナ	3,000	2,449.00	7,347,000
デジタルアーツ	500	9,030.00	4,515,000
日鉄ソリューションズ	1,300	4,030.00	5,239,000
T I S	7,400	3,205.00	23,717,000
グリー	8,200	657.00	5,387,400
コーエーテクモホールディングス	2,000	5,830.00	11,660,000
K L a b	2,000	617.00	1,234,000
ポルトゥウィン・ピットクルーホールディングス	2,200	1,052.00	2,314,400
ネクソン	16,000	1,868.00	29,888,000
コロプラ	2,300	828.00	1,904,400
ブロードリーフ	6,200	562.00	3,484,400
デジタルハーツホールディングス	1,400	2,280.00	3,192,000
S H I F T	500	27,850.00	13,925,000
ティーガイア	900	2,048.00	1,843,200
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	1,800	2,204.00	3,967,200
G M O ペイメントゲートウェイ	1,500	15,600.00	23,400,000
インターネットイニシアティブ	2,400	4,045.00	9,708,000
ラクス	2,400	4,555.00	10,932,000
チェンジ	1,700	2,273.00	3,864,100
マネーフォワード	1,100	8,790.00	9,669,000
野村総合研究所	12,500	4,450.00	55,625,000
インテージホールディングス	2,300	1,573.00	3,617,900
インフォコム	1,100	2,561.00	2,817,100
S a n s a n	700	12,570.00	8,799,000
フジ・メディア・ホールディングス	6,100	1,197.00	7,301,700
オービック	2,300	23,620.00	54,326,000
ジャストシステム	1,100	7,180.00	7,898,000
T D C ソフト	2,500	1,439.00	3,597,500
Zホールディングス	98,000	735.70	72,098,600
トレンドマイクロ	3,700	6,320.00	23,384,000

日本オラクル	1,500	9,550.00	14,325,000
フューチャー	1,500	2,810.00	4,215,000
オービックビジネスコンサルタント	800	5,790.00	4,632,000
伊藤忠テクノソリューションズ	3,500	3,810.00	13,335,000
大塚商会	4,000	6,090.00	24,360,000
サイボウズ	1,400	2,546.00	3,564,400
電通国際情報サービス	1,100	4,620.00	5,082,000
デジタルガレージ	1,400	5,150.00	7,210,000
ウェザーニューズ	500	6,840.00	3,420,000
WOWOW	600	2,523.00	1,513,800
ネットワンシステムズ	3,100	3,925.00	12,167,500
アルゴグラフィックス	800	3,435.00	2,748,000
マーベラス	2,200	707.00	1,555,400
エイベックス	1,800	1,504.00	2,707,200
日本ユニシス	2,700	3,070.00	8,289,000
兼松エレクトロニクス	700	4,080.00	2,856,000
TBSホールディングス	4,700	1,741.00	8,182,700
日本テレビホールディングス	5,600	1,253.00	7,016,800
テレビ朝日ホールディングス	2,200	1,773.00	3,900,600
スカパーJ S A Tホールディングス	4,200	439.00	1,843,800
テレビ東京ホールディングス	800	2,194.00	1,755,200
コネクシオ	700	1,617.00	1,131,900
日本通信	11,100	232.00	2,575,200
日本電信電話	80,200	3,239.00	259,767,800
KDDI	55,200	3,827.00	211,250,400
ソフトバンク	63,400	1,595.50	101,154,700
光通信	800	20,240.00	16,192,000
GMOインターネット	3,200	3,065.00	9,808,000
KADOKAWA	2,000	5,610.00	11,220,000
学研ホールディングス	1,600	1,233.00	1,972,800
ゼンリン	2,000	1,093.00	2,186,000
松竹	500	12,900.00	6,450,000
東宝	4,200	5,310.00	22,302,000
東映	200	21,820.00	4,364,000
エヌ・ティ・ティ・データ	18,800	2,204.00	41,435,200
DTS	1,900	2,726.00	5,179,400
スクウェア・エニックス・ホールディングス	3,100	6,620.00	20,522,000
カプコン	6,100	3,365.00	20,526,500
SCSK	1,700	7,600.00	12,920,000
日本システムウエア	1,000	2,510.00	2,510,000
アイネス	1,600	1,614.00	2,582,400
TKC	1,600	3,760.00	6,016,000
富士ソフト	900	5,870.00	5,283,000
NSD	2,700	2,129.00	5,748,300
コナミホールディングス	2,500	6,920.00	17,300,000
JBCホールディングス	1,500	1,665.00	2,497,500
ソフトバンクグループ	54,900	6,542.00	359,155,800
エレマテック	900	1,210.00	1,089,000
あらた	600	4,630.00	2,778,000
フィールズ	1,900	536.00	1,018,400



双日	34,200	361.00	12,346,200
アルフレッサ ホールディングス	6,900	1,788.00	12,337,200
横浜冷凍	1,000	924.00	924,000
アルコニックス	1,500	1,788.00	2,682,000
神戸物産	5,700	4,080.00	23,256,000
あい ホールディングス	1,000	2,464.00	2,464,000
ダイワボウホールディングス	3,400	2,060.00	7,004,000
マクニカ・富士エレホールディングス	1,500	2,849.00	4,273,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	1,000	849.00	849,000
レスターホールディングス	600	1,971.00	1,182,600
TOKAIホールディングス	3,500	924.00	3,234,000
シップヘルスケアホールディングス	2,700	2,969.00	8,016,300
コメダホールディングス	2,300	2,134.00	4,908,200
小野建	700	1,767.00	1,236,900
エコートレーディング	2,400	660.00	1,584,000
ナガイレーベン	800	2,770.00	2,216,000
三菱食品	500	3,065.00	1,532,500
松田産業	1,100	3,145.00	3,459,500
第一興商	1,200	3,855.00	4,626,000
メディバルホールディングス	6,400	2,249.00	14,393,600
アズワン	600	17,870.00	10,722,000
ドウシシャ	900	1,818.00	1,636,200
高速	1,000	1,617.00	1,617,000
日本ライフライン	2,500	1,399.00	3,497,500
IDOM	3,300	999.00	3,296,700
シークス	1,100	1,267.00	1,393,700
伊藤忠商事	48,400	3,547.00	171,674,800
丸紅	67,600	956.80	64,679,680
長瀬産業	3,100	1,978.00	6,131,800
豊田通商	6,800	4,920.00	33,456,000
兼松	3,000	1,462.00	4,386,000
三井物産	55,400	2,555.50	141,574,700
日本紙パルプ商事	300	3,885.00	1,165,500
カメイ	1,100	1,256.00	1,381,600
スターゼン	700	2,313.00	1,619,100
山善	2,800	1,148.00	3,214,400
住友商事	41,800	1,630.00	68,134,000
内田洋行	400	5,810.00	2,324,000
三菱商事	41,800	3,623.00	151,441,400
第一実業	800	5,010.00	4,008,000
キヤノンマーケティングジャパン	1,400	2,603.00	3,644,200
菱洋エレクトロ	700	2,409.00	1,686,300
ユアサ商事	900	3,155.00	2,839,500
阪和興業	1,600	3,745.00	5,992,000
正栄食品工業	600	4,420.00	2,652,000
菱電商事	900	1,869.00	1,682,100
岩谷産業	2,000	6,640.00	13,280,000
三愛石油	2,000	1,525.00	3,050,000
稲畑産業	1,900	1,822.00	3,461,800
ワキタ	1,600	1,088.00	1,740,800

東邦ホールディングス	1,900	1,923.00	3,653,700
サンゲツ	1,700	1,658.00	2,818,600
伊藤忠エネクス	500	1,053.00	526,500
サンリオ	2,200	2,508.00	5,517,600
リョーサン	700	2,352.00	1,646,400
新光商事	1,600	903.00	1,444,800
三信電気	800	1,721.00	1,376,800
東陽テクニカ	1,600	1,302.00	2,083,200
モスフードサービス	1,000	3,310.00	3,310,000
加賀電子	800	3,210.00	2,568,000
立花エレテック	800	1,584.00	1,267,200
PALTAC	1,100	5,120.00	5,632,000
ヤマタネ	1,500	1,659.00	2,488,500
日鉄物産	300	5,440.00	1,632,000
トラスコ中山	1,700	3,065.00	5,210,500
オートバックスセブン	2,300	1,534.00	3,528,200
加藤産業	1,000	3,530.00	3,530,000
イエローハット	1,700	1,985.00	3,374,500
日伝	800	2,553.00	2,042,400
因幡電機産業	1,500	2,878.00	4,317,000
ミスミグループ本社	8,700	4,800.00	41,760,000
スズケン	2,800	3,345.00	9,366,000
ローソン	1,600	5,840.00	9,344,000
サンエー	500	4,125.00	2,062,500
カワチ薬品	600	2,360.00	1,416,000
エービーシー・マート	1,100	5,900.00	6,490,000
アスクル	1,600	1,743.00	2,788,800
ゲオホールディングス	1,600	1,232.00	1,971,200
アダストリア	1,200	1,992.00	2,390,400
くら寿司	900	3,930.00	3,537,000
キャンドウ	1,000	1,914.00	1,914,000
パルグループホールディングス	1,200	1,788.00	2,145,600
エディオン	2,300	1,084.00	2,493,200
サーラコーポレーション	2,800	650.00	1,820,000
ハニーズホールディングス	1,400	1,138.00	1,593,200
アルペン	1,100	3,445.00	3,789,500
クオールホールディングス	1,600	1,624.00	2,598,400
ジーンズホールディングス	500	7,990.00	3,995,000
ビックカメラ	4,100	1,086.00	4,452,600
DCMホールディングス	4,500	1,133.00	5,098,500
Monotaro	9,700	2,535.00	24,589,500
J.フロント リテイリング	8,500	1,014.00	8,619,000
ドトール・日レスホールディングス	1,000	1,694.00	1,694,000
マツモトキヨシホールディングス	3,000	5,360.00	16,080,000
ブロンコビリー	1,100	2,567.00	2,823,700
ZOZO	4,400	4,180.00	18,392,000
物語コーポレーション	600	7,300.00	4,380,000
ココカラファイン	700	9,070.00	6,349,000
三越伊勢丹ホールディングス	12,600	816.00	10,281,600
ウエルシアホールディングス	4,000	4,090.00	16,360,000

クリエイトSDホールディングス	1,100	3,870.00	4,257,000	
チムニー	1,500	1,505.00	2,257,500	
ジョイフル本田	2,000	1,527.00	3,054,000	
すかいらくホールディングス	8,400	1,578.00	13,255,200	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	1,700	1,162.00	1,975,400	
あさひ	1,500	1,418.00	2,127,000	
コスモス薬品	800	19,970.00	15,976,000	
セブン&アイ・ホールディングス	27,000	5,266.00	142,182,000	
ツルハホールディングス	1,500	14,090.00	21,135,000	
サンマルクホールディングス	1,100	1,580.00	1,738,000	
トリドールホールディングス	2,200	2,547.00	5,603,400	
クスリのアオキホールディングス	800	8,390.00	6,712,000	
FOOD & LIFE COMPANIE	4,300	4,920.00	21,156,000	
ノジマ	1,500	2,918.00	4,377,000	
カッパ・クリエイト	1,700	1,399.00	2,378,300	
良品計画	8,100	2,550.00	20,655,000	
コナカ	4,100	373.00	1,529,300	
コーナン商事	1,300	3,765.00	4,894,500	
エコス	1,200	2,025.00	2,430,000	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	14,300	1,975.00	28,242,500	
西松屋チェーン	2,200	1,428.00	3,141,600	
ゼンショーホールディングス	4,000	2,810.00	11,240,000	
サイゼリヤ	1,200	2,757.00	3,308,400	
VTホールディングス	4,300	581.00	2,498,300	
ユナイテッドアローズ	1,400	1,927.00	2,697,800	
ハイデイ日高	1,500	1,724.00	2,586,000	
コロワイド	2,700	1,739.00	4,695,300	
壱番屋	500	4,765.00	2,382,500	
スギホールディングス	1,500	8,660.00	12,990,000	
ヨンドシーホールディングス	1,000	1,853.00	1,853,000	
木曽路	1,400	2,462.00	3,446,800	
SRSホールディングス	2,700	843.00	2,276,100	
ケーヨー	2,500	859.00	2,147,500	
上新電機	800	2,639.00	2,111,200	
日本瓦斯	3,900	1,683.00	6,563,700	
ロイヤルホールディングス	1,800	2,063.00	3,713,400	
チヨダ	600	821.00	492,600	
ライフコーポレーション	600	4,860.00	2,916,000	
リンガーハット	1,400	2,341.00	3,277,400	
AOKIホールディングス	2,200	695.00	1,529,000	
オークワ	1,200	1,227.00	1,472,400	
コメリ	1,100	2,695.00	2,964,500	
青山商事	2,500	810.00	2,025,000	
しまむら	800	10,050.00	8,040,000	
高島屋	4,700	1,165.00	5,475,500	
松屋	2,400	1,169.00	2,805,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	2,800	955.00	2,674,000	
近鉄百貨店	200	2,672.00	534,400	

丸井グループ	6,200	2,125.00	13,175,000
アクシアル リテイリング	700	4,205.00	2,943,500
イオン	26,500	3,075.00	81,487,500
イズミ	1,400	3,615.00	5,061,000
平和堂	500	2,363.00	1,181,500
フジ	800	2,273.00	1,818,400
ヤオコー	900	7,430.00	6,687,000
ゼビオホールディングス	300	1,168.00	350,400
ケーズホールディングス	6,000	1,204.00	7,224,000
アインホールディングス	1,100	7,560.00	8,316,000
ヤマダホールディングス	22,000	483.00	10,626,000
アーランドサカモト	1,500	1,793.00	2,689,500
ニトリホールディングス	2,700	21,940.00	59,238,000
吉野家ホールディングス	2,600	2,208.00	5,740,800
サガミホールディングス	2,300	1,039.00	2,389,700
王将フードサービス	500	6,040.00	3,020,000
ミニストップ	200	1,522.00	304,400
アークス	1,100	2,399.00	2,638,900
パローホールディングス	1,200	2,583.00	3,099,600
ベルク	500	6,180.00	3,090,000
ファーストリテイリング	900	76,660.00	68,994,000
サンドラッグ	2,600	3,660.00	9,516,000
サックスパー ホールディングス	2,800	564.00	1,579,200
ベルーナ	2,000	873.00	1,746,000
じもとホールディングス	2,200	721.00	1,586,200
めぶきフィナンシャルグループ	31,500	261.00	8,221,500
東京きらぼしフィナンシャルグループ	1,400	1,659.00	2,322,600
九州フィナンシャルグループ	12,700	434.00	5,511,800
ゆうちょ銀行	17,100	983.00	16,809,300
コンコルディア・フィナンシャルグループ	37,900	454.00	17,206,600
西日本フィナンシャルホールディングス	4,500	736.00	3,312,000
三十三フィナンシャルグループ	1,000	1,505.00	1,505,000
第四北越フィナンシャルグループ	900	2,730.00	2,457,000
ひろぎんホールディングス	9,300	667.00	6,203,100
新生銀行	5,800	1,905.00	11,049,000
あおぞら銀行	4,100	2,795.00	11,459,500
三菱UFJフィナンシャル・グループ	471,100	634.00	298,677,400
りそなホールディングス	82,500	450.30	37,149,750
三井住友トラスト・ホールディングス	13,100	3,892.00	50,985,200
三井住友フィナンシャルグループ	47,200	3,958.00	186,817,600
千葉銀行	21,800	733.00	15,979,400
群馬銀行	12,100	369.00	4,464,900
武蔵野銀行	800	1,910.00	1,528,000
筑波銀行	13,500	187.00	2,524,500
七十七銀行	1,600	1,308.00	2,092,800
青森銀行	1,000	2,235.00	2,235,000
秋田銀行	900	1,504.00	1,353,600
山形銀行	1,500	900.00	1,350,000
岩手銀行	800	1,792.00	1,433,600
東邦銀行	7,800	218.00	1,700,400

東北銀行	2,000	1,058.00	2,116,000
みちのく銀行	1,900	893.00	1,696,700
ふくおかフィナンシャルグループ	5,600	2,091.00	11,709,600
静岡銀行	14,200	943.00	13,390,600
十六銀行	700	2,327.00	1,628,900
スルガ銀行	6,400	399.00	2,553,600
八十二銀行	11,200	406.00	4,547,200
山梨中央銀行	1,600	862.00	1,379,200
大垣共立銀行	1,200	2,001.00	2,401,200
福井銀行	800	1,688.00	1,350,400
北國銀行	800	2,238.00	1,790,400
清水銀行	1,200	1,691.00	2,029,200
滋賀銀行	1,400	1,935.00	2,709,000
南都銀行	800	2,086.00	1,668,800
百五銀行	5,300	338.00	1,791,400
京都銀行	2,300	5,310.00	12,213,000
紀陽銀行	2,400	1,628.00	3,907,200
ほくほくフィナンシャルグループ	4,100	878.00	3,599,800
山陰合同銀行	4,400	592.00	2,604,800
中国銀行	4,800	925.00	4,440,000
伊予銀行	7,500	606.00	4,545,000
百十四銀行	700	1,622.00	1,135,400
四国銀行	1,600	768.00	1,228,800
阿波銀行	800	2,302.00	1,841,600
大分銀行	700	1,904.00	1,332,800
宮崎銀行	1,000	2,195.00	2,195,000
佐賀銀行	1,000	1,510.00	1,510,000
沖縄銀行	600	2,880.00	1,728,000
琉球銀行	2,200	819.00	1,801,800
セブン銀行	21,000	264.00	5,544,000
みずほフィナンシャルグループ	92,500	1,613.50	149,248,750
山口フィナンシャルグループ	6,700	683.00	4,576,100
名古屋銀行	700	2,829.00	1,980,300
北洋銀行	9,800	271.00	2,655,800
愛知銀行	600	3,760.00	2,256,000
愛媛銀行	1,600	806.00	1,289,600
京葉銀行	2,400	467.00	1,120,800
栃木銀行	15,100	187.00	2,823,700
北日本銀行	1,300	1,635.00	2,125,500
東和銀行	3,000	552.00	1,656,000
福島銀行	5,300	257.00	1,362,100
大東銀行	3,000	690.00	2,070,000
トモニホールディングス	6,500	337.00	2,190,500
フィデアホールディングス	18,400	132.00	2,428,800
池田泉州ホールディングス	11,600	172.00	1,995,200
F P G	4,300	725.00	3,117,500
S B Iホールディングス	8,900	2,823.00	25,124,700
ジャフコ グループ	1,100	7,240.00	7,964,000
大和証券グループ本社	49,200	678.80	33,396,960
野村ホールディングス	106,200	566.80	60,194,160

岡三証券グループ	4,100	430.00	1,763,000
丸三証券	3,400	664.00	2,257,600
東洋証券	10,100	171.00	1,727,100
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	7,800	437.00	3,408,600
水戸証券	4,700	323.00	1,518,100
いちよし証券	3,600	737.00	2,653,200
松井証券	2,500	857.00	2,142,500
マネックスグループ	7,300	591.00	4,314,300
極東証券	1,800	893.00	1,607,400
岩井コスモホールディングス	1,900	1,474.00	2,800,600
かんば生命保険	8,600	2,097.00	18,034,200
S O M P Oホールディングス	12,100	5,157.00	62,399,700
アニコム ホールディングス	3,700	931.00	3,444,700
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	16,200	3,900.00	63,180,000
第一生命ホールディングス	34,300	2,460.50	84,395,150
東京海上ホールディングス	22,900	6,006.00	137,537,400
T & Dホールディングス	21,100	1,532.00	32,325,200
全国保証	1,900	5,650.00	10,735,000
クレディセゾン	4,400	1,379.00	6,067,600
芙蓉総合リース	700	8,150.00	5,705,000
みずほリース	1,100	3,785.00	4,163,500
東京センチュリー	1,700	6,650.00	11,305,000
日本証券金融	4,400	933.00	4,105,200
アイフル	15,300	371.00	5,676,300
リコーリース	500	3,850.00	1,925,000
イオンフィナンシャルサービス	4,400	1,334.00	5,869,600
アコム	15,200	428.00	6,505,600
ジャックス	1,200	2,888.00	3,465,600
オリエントコーポレーション	24,000	155.00	3,720,000
オリックス	42,200	2,170.50	91,595,100
三菱H Cキャピタル	22,900	598.00	13,694,200
日本取引所グループ	19,000	3,003.00	57,057,000
イー・ギャランティ	1,300	2,597.00	3,376,100
N E Cキャピタルソリューション	300	2,194.00	658,200
いちご	9,300	364.00	3,385,200
日本駐車場開発	16,200	163.00	2,640,600
ヒューリック	15,300	1,350.00	20,655,000
野村不動産ホールディングス	4,400	2,953.00	12,993,200
フージャースホールディングス	3,000	711.00	2,133,000
オープンハウス	2,400	6,300.00	15,120,000
東急不動産ホールディングス	19,900	664.00	13,213,600
飯田グループホールディングス	5,800	2,960.00	17,168,000
パーク24	4,300	1,795.00	7,718,500
三井不動産	32,000	2,562.00	81,984,000
三菱地所	45,400	1,785.00	81,039,000
平和不動産	1,400	4,275.00	5,985,000
東京建物	7,300	1,753.00	12,796,900
ダイビル	2,000	1,590.00	3,180,000
京阪神ビルディング	1,800	1,512.00	2,721,600

住友不動産	15,800	3,900.00	61,620,000
テーオーシー	1,900	678.00	1,288,200
東京楽天地	300	4,175.00	1,252,500
スターツコーポレーション	900	2,935.00	2,641,500
空港施設	2,500	604.00	1,510,000
ゴールドクレスト	1,100	1,762.00	1,938,200
タカラレーベン	7,900	321.00	2,535,900
イオンモール	3,500	1,702.00	5,957,000
カチタス	2,000	4,155.00	8,310,000
トーセイ	2,000	1,192.00	2,384,000
サンフロンティア不動産	2,400	1,193.00	2,863,200
日本空港ビルデング	2,500	4,825.00	12,062,500
日本工営	700	3,470.00	2,429,000
L I F U L L	5,100	368.00	1,876,800
ミクシィ	1,900	2,726.00	5,179,400
日本M&Aセンター	11,600	3,655.00	42,398,000
UTグループ	1,200	3,125.00	3,750,000
タケエイ	1,600	1,827.00	2,923,200
G C A	2,800	1,395.00	3,906,000
エス・エム・エス	2,800	4,390.00	12,292,000
パーソルホールディングス	7,200	2,772.00	19,958,400
クックパッド	7,900	234.00	1,848,600
シミックホールディングス	1,400	1,521.00	2,129,400
総合警備保障	2,700	5,110.00	13,797,000
カカクコム	5,400	3,730.00	20,142,000
ディップ	1,500	4,190.00	6,285,000
ベネフィット・ワン	2,800	5,520.00	15,456,000
エムスリー	12,300	8,481.00	104,316,300
アウトソーシング	4,500	2,010.00	9,045,000
ディー・エヌ・エー	3,500	2,037.00	7,129,500
博報堂DYホールディングス	9,800	1,926.00	18,874,800
ぐるなび	2,500	501.00	1,252,500
ジャパンベストレスキューシステム	1,700	1,261.00	2,143,700
ファンコミュニケーションズ	3,600	444.00	1,598,400
バリューコマース	1,100	4,855.00	5,340,500
インフォマート	8,000	1,098.00	8,784,000
J Pホールディングス	9,200	279.00	2,566,800
プレステージ・インターナショナル	4,000	792.00	3,168,000
電通グループ	7,300	4,285.00	31,280,500
テイクアンドギヴ・ニーズ	2,000	1,030.00	2,060,000
H . U . グループホールディングス	1,900	3,280.00	6,232,000
オリエンタルランド	7,200	16,950.00	122,040,000
ダスキン	1,400	2,709.00	3,792,600
明光ネットワークジャパン	3,500	631.00	2,208,500
ファルコホールディングス	1,000	1,786.00	1,786,000
ラウンドワン	3,400	1,344.00	4,569,600
リゾートトラスト	3,600	2,033.00	7,318,800
ビー・エム・エル	1,100	4,495.00	4,944,500
りらいあコミュニケーションズ	1,800	1,266.00	2,278,800
ユー・エス・エス	7,600	1,998.00	15,184,800

	サイバーエージェント	17,700	2,194.00	38,833,800	
	楽天グループ	35,900	1,129.00	40,531,100	
	エン・ジャパン	1,500	4,220.00	6,330,000	
	テクノプロ・ホールディングス	4,500	3,445.00	15,502,500	
	アイ・アールジャパンホールディングス	400	14,760.00	5,904,000	
	ジャパンマテリアル	2,600	1,351.00	3,512,600	
	リクルートホールディングス	48,300	6,953.00	335,829,900	
	日本郵政	47,700	987.40	47,098,980	
	ベルシステム24ホールディングス	1,700	1,689.00	2,871,300	
	ソラスト	2,400	1,572.00	3,772,800	
	ペイカレント・コンサルティング	500	57,900.00	28,950,000	
	ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,700	2,680.00	7,236,000	
	リログループ	4,100	2,255.00	9,245,500	
	エイチ・アイ・エス	2,000	2,284.00	4,568,000	
	共立メンテナンス	1,400	3,915.00	5,481,000	
	イチネンホールディングス	1,400	1,351.00	1,891,400	
	建設技術研究所	1,100	2,713.00	2,984,300	
	スバル興業	200	8,270.00	1,654,000	
	東京テアトル	2,800	1,299.00	3,637,200	
	東京都競馬	600	4,170.00	2,502,000	
	カナモト	900	2,684.00	2,415,600	
	西尾レントオール	500	3,010.00	1,505,000	
	トランス・コスモス	900	3,780.00	3,402,000	
	乃村工藝社	4,300	1,007.00	4,330,100	
	日本管財	1,000	2,698.00	2,698,000	
	トーカイ	1,000	2,415.00	2,415,000	
	セコム	6,600	8,511.00	56,172,600	
	丹青社	2,800	848.00	2,374,400	
	メイテック	1,100	6,770.00	7,447,000	
	応用地質	1,400	1,481.00	2,073,400	
	船井総研ホールディングス	1,700	2,935.00	4,989,500	
	ベネッセホールディングス	2,500	2,443.00	6,107,500	
	イオンディライト	900	3,605.00	3,244,500	
	ダイセキ	1,600	4,645.00	7,432,000	
小計		7,405,500		20,162,244,820	
合計				20,162,244,820	

## (2) 株式以外の有価証券(2021年9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

(2021年9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	556,493,760	-	561,600,000	5,106,240



合計	-	-	-	5,106,240
----	---	---	---	-----------

## (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。

**2【ファンドの現況】**

(2021年10月29日現在)

**【純資産額計算書】**

明治安田DC・TOPIXインデックスファンド

資産総額	469,321,386 円
負債総額	5,063,504 円
純資産総額( - )	464,257,882 円
発行済口数	407,273,630 口
1口当たり純資産額( / )	1.1399 円
(1万口当たり純資産額)	(11,399 円)

(参考)

明治安田TOPIXマザーファンド

純資産額計算書

資産総額	20,434,249,160 円
負債総額	555,638,467 円
純資産総額( - )	19,878,610,693 円
発行済口数	5,796,798,974 口
1口当たり純資産額( / )	3.4292 円
(1万口当たり純資産額)	(34,292 円)

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

### （1）名義書換の事務等

該当事項はありません。

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

したがって、受益者は、委託会社がやむを得ない事情等により受益証券を発行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

### （2）受益者に対する特典

該当事項はありません。

### （3）受益権の譲渡

受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。

前項の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等（当該他の振替機関等の上位機関を含みます。）に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。

上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかか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、委託者が必要と認めるときまたはやむをえない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

### （4）受益権の譲渡制限および譲渡の対抗要件

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

### （5）受益権の再分割

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

### （6）質権口記載又は記録の受益権の取扱いについて

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

### （7）償還金

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

## 第二部【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、運用企画部が中心となって行います。
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。

2021年10月29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とおりです（ただし、親投資信託を除きます。）。

種類		本数	純資産総額
株式投資信託	追加型	157 本	1,779,421,459,987 円
	単体型	16 本	331,553,050,444 円
公社債投資信託	単体型	13 本	46,514,295,378 円
合計		186 本	2,157,488,805,809 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、「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（2020年4月1日から2021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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	8,487,669	7,648,171
前払費用	149,996	200,486
未収入金	-	113,842
未収委託者報酬	1,573,822	1,490,727
未収運用受託報酬	130,905	130,764
未収投資助言報酬	261,532	258,067
差入保証金	181,690	-
その他	38	5,074
流動資産合計	10,785,656	9,847,134
固定資産		
有形固定資産		
建物	1,405,7	1,707,678
器具備品	1,123,677	1,345,634
建設仮勘定	6,336	1,354
有形固定資産合計	134,071	1,054,667
無形固定資産		
ソフトウェア	95,476	125,943
電話加入権	6,662	-
ソフトウェア仮勘定	-	22,934
無形固定資産合計	102,138	148,878
投資その他の資産		
投資有価証券	-	4,362
長期差入保証金	300,000	300,000
長期前払費用	2,889	13,175
前払年金費用	9,979	223,189
繰延税金資産	122,271	15,044
投資その他の資産合計	435,140	555,772
固定資産合計	671,350	1,759,319
資産合計	11,457,007	11,606,453

(単位:千円)

	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
<b>負債の部</b>		
<b>流動負債</b>		
預り金	55,062	288,719
未払金	869,140	940,511
未払収益分配金	143	149
未払手数料	539,255	461,104
その他未払金	329,741	479,258
未払費用	34,549	38,371
未払法人税等	247,148	145,252
未払消費税等	140,907	26,255
賞与引当金	130,550	155,393
前受収益	-	3,666
資産除去債務	62,571	-
流動負債合計	1,539,930	1,598,171
<b>固定負債</b>		
長期未払金	-	138,492
資産除去債務	-	227,552
固定負債合計	-	366,045
負債合計	1,539,930	1,964,216
<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	2,227,250	1,952,160
利益剰余金合計	5,402,292	5,127,202
株主資本合計	9,917,076	9,641,986
<b>評価・換算差額等</b>		
その他有価証券評価差額金	-	251
評価・換算差額等合計	-	251
純資産合計	9,917,076	9,642,237
負債・純資産合計	11,457,007	11,606,453

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	前事業年度 (自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	6,850,468	6,334,125
受入手数料	1,793	11,877
運用受託報酬	1,919,226	1,871,659
投資助言報酬	555,313	550,486
その他収益	-	6,666
営業収益合計	9,326,801	8,774,814
営業費用		
支払手数料	2,330,306	1,908,970
広告宣伝費	62,095	54,081
公告費	750	250
調査費	1,683,927	1,629,740
調査費	661,179	694,741
委託調査費	1,022,747	934,999
委託計算費	363,070	382,749
営業雑経費	143,974	138,454
通信費	20,446	21,821
印刷費	106,638	97,182
協会費	12,628	13,023
諸会費	4,261	6,147
営業雑費	0	279
営業費用合計	4,584,125	4,114,246
一般管理費		
給料	1,846,336	2,035,031
役員報酬	76,381	65,817
給料・手当	1,413,822	1,535,188
賞与	356,133	411,987
その他報酬給与	3,878	22,038
賞与引当金繰入	130,550	155,393
法定福利費	276,448	303,647
福利厚生費	33,441	40,150
交際費	3,232	1,508
寄付金	200	8,669
旅費交通費	32,621	9,202
租税公課	71,876	68,896
不動産賃借料	207,615	275,188
退職給付費用	110,387	145,682
固定資産減価償却費	104,847	128,728
事務委託費	139,713	98,607
諸経費	72,766	167,863
一般管理費合計	3,033,916	3,147,203
営業利益	1,708,759	1,513,364



（単位：千円）

	前事業年度 （自 2019年4月 1日 至 2020年3月31日）	当事業年度 （自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日）
営業外収益		
受取利息	208	100
受取配当金	2	30
投資有価証券売却益	37	12
償還金等時効完成分	31	-
保険契約返戻金・配当金	<sup>1</sup> 1,389	<sup>1</sup> 1,496
為替差益	473	327
雑益	1,400	3,001
営業外収益合計	3,543	4,967
営業外費用		
投資有価証券売却損	8	-
時効成立後支払償還金	2,312	-
雑損失	997	645
営業外費用合計	3,317	645
経常利益	1,708,985	1,517,687
特別損失		
移転関連費用	<sup>2</sup> 168,847	<sup>2</sup> 222,760
特別損失合計	168,847	222,760
税引前当期純利益	1,540,137	1,294,926
法人税、住民税及び事業税	490,515	334,591
法人税等調整額	78,687	107,115
法人税等合計	411,827	441,707
当期純利益	1,128,310	853,219

## （３）【株主資本等変動計算書】

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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	2,287,707	5,462,748	9,977,532
当期変動額					
剰余金の配当			1,188,766	1,188,766	1,188,766
当期純利益			1,128,310	1,128,310	1,128,310
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）					
当期変動額合計	-	-	60,456	60,456	60,456
当期末残高	83,040	3,092,001	2,227,250	5,402,292	9,917,076

	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	15	15	9,977,548
当期変動額			
剰余金の配当			1,188,766
当期純利益			1,128,310
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	60,472
当期末残高	-	-	9,917,076

当事業年度 (自 2020年4月1日 至 2021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	2,227,250	5,402,292	9,917,076
当期変動額					
剰余金の配当			1,128,309	1,128,309	1,128,309
当期純利益			853,219	853,219	853,219
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)					
当期変動額合計	-	-	275,090	275,090	275,090
当期末残高	83,040	3,092,001	1,952,160	5,127,202	9,641,986

	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	-	-	9,917,076
当期変動額			
剰余金の配当			1,128,309
当期純利益			853,219
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)	251	251	251
当期変動額合計	251	251	274,838
当期末残高	251	251	9,642,237

## [注記事項]

## (重要な会計方針)

1. 有価証券の評価基準及び評価方法 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。）
2. 固定資産の減価償却方法 (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 6年～18年 器具備品 3年～20年 (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。
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。
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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
建物	68,745千円	17,690千円
器具備品	342,079千円	327,329千円

## (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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
保険契約返戻金・配当金	1,389千円	1,496千円

## 2 移転関連費用

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当社は次の資産グループについて減損損失を計上しました。

建物付属設備	149,274千円
システム関係	9,877千円
什器備品	9,319千円
少額資産	376千円

当社はすべての資産を一体としてグルーピングをしておりますが、2019年11月28日の取締役会における現在の虎ノ門36森ビルから大手町プレイスへの移転の決議に伴い、新オフィスへの移転が不可能な資産については、別途グルーピングを実施しております。

当該資産グループは新オフィスへの移転が決定したことに伴い、除去が決定していることから、帳簿価額を回収可能価額まで減額し、減損損失を移設関連費用として計上しております。当該資産グループの回収可能価額は他の転用や売却が困難であることから0円としております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

新オフィスへの移転に伴う、移転費用（引越費用、原状回復工事費用）並びに内装工事期間及び原状回復期間等に係る賃借料を計上しております。

（株主資本等変動計算書関係）

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020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
2019年6月20日 定時株主総会	普通株式	1,188,766,667円	62,941円00銭	2019年3月31日	2019年6月20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
2020年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	1,128,309,380円	59,740円00銭	2020年3月31日	2020年6月30日

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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
2020年6月30日 定時株主総会	普通株式	1,128,309,380円	59,740円00銭	2020年3月31日	2020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
2021年6月30日 定時株主総会	普通株式	利益剰余金	853,201,338円	45,174円00銭	2021年3月31日	2021年6月30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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1年内	8,789	476,805
1年超	11,718	1,562,983
合計	20,507	2,039,788

## (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。

未収入金は、取引先の信用リスクに晒されており、取引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。

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、基準価額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。

差入保証金は、賃貸借契約先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ます。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。

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。また、長期未払金は、本社家賃のフリーレント期間分のうち1年超の支払期日分です。

## 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。

なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは含んでおりません(注2)参照)。

## 前事業年度 (2020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	8,487,669	8,487,669	-
(2)未収委託者報酬	1,573,822	1,573,822	-
(3)未収運用受託報酬	130,905	130,905	-
(4)未収投資助言報酬	261,532	261,532	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	-	-	-
(6)差入保証金	181,690	181,690	-
(7)長期差入保証金	300,000	287,008	12,991
資産計	10,935,620	10,922,629	12,991
(1)未払手数料	539,255	539,255	-
(2)その他未払金	329,741	329,741	-
負債計	868,997	868,997	-

## 当事業年度 (2021年3月31日)

	貸借対照表計上額 (千円)	時価 (千円)	差額 (千円)
(1)現金・預金	7,648,171	7,648,171	-
(2)未収委託者報酬	1,490,727	1,490,727	-
(3)未収運用受託報酬	130,764	130,764	-
(4)未収投資助言報酬	258,067	258,067	-
(5)未収入金	113,842	113,842	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	4,362	4,362	-
(7)長期差入保証金	300,000	287,140	12,859

資産計	9,945,937	9,933,077	12,859
(1) 未払手数料	461,104	461,104	-
(2) その他未払金	479,258	479,258	-
負債計	940,362	940,362	-

## (注1) 金融商品の時価の算定方法

## 資産

現金・預金、未収委託者報酬、未収運用受託報酬、未収投資助言報酬、差入保証金、未収入金

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。

## 投資有価証券

投資信託は基準価額によっております。

## 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

## 未払手数料、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) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

区分	前事業年度 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
長期未払金	-千円	138,492千円

長期未払金については、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、上表には含めておりません。

## (注3) 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 (2020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	8,487,669	-	-	-
未収委託者報酬	1,573,822	-	-	-
未収運用受託報酬	130,905	-	-	-
未収投資助言報酬	261,532	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの	-	-	-	-
差入保証金	181,690	-	-	-
長期差入保証金	-	-	300,000	-
合計	10,635,620	-	300,000	-

当事業年度 (2021年3月31日)

	1年以内 (千円)	1年超 5年以内 (千円)	5年超 10年以内 (千円)	10年超 (千円)
現金・預金	7,648,171	-	-	-
未収委託者報酬	1,490,727	-	-	-
未収運用受託報酬	130,764	-	-	-
未収投資助言報酬	258,067	-	-	-
未収入金	113,842	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち 満期のあるもの	-	-	3,261	-
長期差入保証金	-	300,000	-	-
合計	9,641,574	300,000	3,261	-

## (有価証券関係)

## 1. その他有価証券

前事業年度（2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（2021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)	4,362	4,000	362
小計	4,362	4,000	362
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	4,362	4,000	362

## 2. 事業年度中に売却したその他有価証券

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他(投資信託)	2,028	37	8

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

区分	売却額 (千円)	売却益の合計額 (千円)	売却損の合計額 (千円)
その他(投資信託)	1,012	12	-

## 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 2019年4月1日 至 2020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	45,606	千円
退職給付費用	110,387	"
退職給付の支払額	-	"
制度への拠出額	74,761	"
前払年金費用の期末残高	9,979	"

## (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	742,154	千円
年金資産	752,407	"
	10,252	"
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	9,979	"



前払年金費用	9,979	〃
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	9,979	〃

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	110,387	千円
----------------	---------	----

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	9,979	千円
退職給付費用	145,682	〃
退職給付の支払額	-	〃
制度への拠出額	67,527	〃
前払年金費用の期末残高	223,189	〃

## (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	695,521	千円
年金資産	918,984	〃
	223,462	〃
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	223,189	〃
前払年金費用	223,189	〃
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	223,189	〃

## (3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	145,682	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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
繰延税金資産				
賞与引当金繰入限度超過額	39,974	千円	47,581	千円
未払事業税	18,922	〃	13,802	〃
資産除去債務	19,159	〃	69,676	〃
減損損失	51,701	〃	-	〃
未払賃借料	-	〃	58,313	〃
その他	9,384	〃	31,870	〃
繰延税金資産小計	139,142	〃	221,244	〃
評価性引当額	1,494	〃	69,676	〃
繰延税金資産合計	137,647	〃	151,567	〃
繰延税金負債				
資産除去費用	12,321	〃	68,071	〃
前払年金費用	3,055	〃	68,340	〃
その他有価証券評価差額金	-	〃	111	〃
繰延税金負債合計	15,376	〃	136,523	〃
繰延税金資産の純額	122,271	〃	15,044	〃

## 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 (2020年3月31日)		当事業年度 (2021年3月31日)	
法定実効税率 (調整)	30.62	%	30.62	%
交際費等永久に損金に算入されない項目	0.04	"	0.03	"
評価性引当額の増減	-1.18	"	5.27	"
雇用拡大促進税制の特別控除	-2.90	"	-1.90	"
住民税均等割	0.15	"	0.09	"
税効果会計適用後の法人税等の負担率	26.73	%	34.11	%

(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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)		当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)	
期首残高	58,882	千円	62,571	千円
有形固定資産の取得に伴う増加額	-	"	227,390	"
時の経過による調整額	396	"	162	"
見積もりの変更による増加額	3,291	"	-	"
資産除去債務の履行による減少額	-		62,571	"
期末残高	62,571	千円	227,552	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 2019年4月1日 至 2020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	6,850,468	1,793	1,919,226	555,313	9,326,801

## 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 2020年4月1日 至 2021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)	その他収益	合計
外部顧客への 営業収益	6,334,125	11,877	1,871,659	550,486	6,666	8,774,814

## 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]

前事業年度（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

当社は単一セグメントであるため、記載を省略しております。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

当社は単一セグメントであるため、記載を省略しております。

## [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]

前事業年度自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

該当事項はありません。

## [報告セグメントごとの負ののれん発生益に関する情報]

前事業年度自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

該当事項はありません。

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021年3月31日）

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 2019年4月1日 至 2020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	250,000	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	410,511	未収投 資助言 報酬	229,693
							支払 手数料	470,663	未払 手数料	143,178

当事業年度（自 2020年4月1日 至 2021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	250,000	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	409,787	未収投 資助言 報酬	223,460
							支払 手数料	484,387	未払 手数料	154,440

（注1）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2）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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
1株当たり純資産額	525,074円18銭	510,522円46銭
1株当たり当期純利益金額	59,740円05銭	45,174円95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 (2020年3月31日)	当事業年度 (2021年3月31日)
貸借対照表の純資産の部の合計額(千円)	9,917,076	9,642,237
普通株式に係る純資産額(千円)	9,917,076	9,642,237
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 2019年4月 1日 至 2020年3月31日)	当事業年度 (自 2020年4月 1日 至 2021年3月31日)
当期純利益(千円)	1,128,310	853,219
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)	1,128,310	853,219
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**

(2021年3月31日現在)

名称	資本金の額 (百万円)	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**

(2021年3月31日現在)

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	980,000	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。

**2【関係業務の概要】****(1) 受託会社**

ファンドの受託銀行として、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日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。

**(2) 販売会社**

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

### 3【資本関係】

#### (1) 受託会社

該当事項はありません。

#### (2) 販売会社

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〕

名称、資本金の額および事業の内容

（2021年3月31日現在）

名称	資本金の額 (百万円)	事業の内容
日本マスタートラスト信託銀行株式会社	10,000	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。

#### 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。

#### 資本関係

該当事項はありません。



### 第3【参考情報】

当計算期間において、ファンドの書類は以下の通り提出されております。

2021年 9月13日 半期報告書、訂正有価証券届出書

**独立監査人の監査報告書**

2021年6月4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

東京事務所

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 小 林 広 樹**監査意見**

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、「委託会社等の経理の状況」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2020年4月1日から2021年3月31日までの第35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。

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2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全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。

**監査意見の根拠**

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

**財務諸表に対する経営者及び監査等委員会の責任**

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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

監査等委員会の責任は、財務報告プロセスの整備及び運用における取締役の職務の執行を監視することにある。

**財務諸表監査における監査人の責任**

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、監査等委員会に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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

2021年11月5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

東京事務所

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

## 監査意見

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・TOPIXインデックスファンドの2020年12月15日から2021年9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。

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・TOPIXインデックスファンドの2021年9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、全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。

## 監査意見の根拠

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。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、明治安田アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。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。

## 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。

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、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基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

## 財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による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て、監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、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従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- ・ 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- ・ 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、監査人は、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、監査に関連する内部統制を検討する。
- ・ 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- ・ 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、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いるかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

監査人は、経営者に対して、計画した監査の範囲とその実施時期、監査の実施過程で識別した内部統制の重要な不備を含む監査上の重要な発見事項、及び監査の基準で求められているその他の事項について報告を行う。

#### 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。