

**【表紙】**

【提出書類】	有価証券報告書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	平成29年6月20日
【計算期間】	第17期(自平成28年3月23日 至平成29年3月21日)
【ファンド名】	東京海上日本株TOPIXファンド
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	取締役社長 大庭 雅志
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	尾崎 正幸
【連絡場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【電話番号】	03-3212-8421
【縦覧に供する場所】	該当なし

## 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】

###### ファンドの目的

当ファンドは、東京証券取引所第一部の上場銘柄全体の値動きをあらわすTOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目標とし、同様の運用目標を持つ「TMA日本株TOPIXマザーファンド」（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券を主要投資対象として運用を行います。

「TMA」とは委託会社である「東京海上アセットマネジメント株式会社（TOKIO MARINE ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.）」の略称です。

###### 基本的性格

当ファンドは、追加型投信／国内／株式／インデックス型に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
追加型投信	海外	債券	
	内外	不動産投信	特殊型
		その他資産 ( )	
		資産複合	

属性区分表

投資対象資産	決算頻度	投資対象地域	投資形態	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		日経225
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	
	年12回 (毎月)	アジア		TOPIX
	日々	オセアニア		
不動産投信	日々	中南米	ファンド・オブ・ファンズ	
その他資産 (投資信託証券(株式(一般)))	その他 ( )	アフリカ		その他 ( )
		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		

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。  
投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。

## 商品分類の定義

単位型・ 追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型投信	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。
投資対象 地域	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。
	海外	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海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象 資産	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。
	債券	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債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信(リート)	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不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	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、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。

独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	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目指す旨の記載があるものをいいます。
	特殊型	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

商品分類の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

#### 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		社債	目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		その他債券	目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。
		格付等クレジットによる属性	目論見書または投資信託約款において、上記債券の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記債券に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記します。
	不動産投信		目論見書または投資信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。
	その他資産		目論見書または投資信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。
資産複合	資産配分固定型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。	
	資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。	
決算頻度	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。	
	年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	

	年12回(毎月)	目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	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。
	北米	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北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	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欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	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を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	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オセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	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中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	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アフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東(中東)	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中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	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エマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	投資形態	ファミリーファンド
ファンド・オブ・ファンズ		一般社団法人投資信託協会の「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定されるファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	目論見書または投資信託約款において、日経225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。
	TOPIX	目論見書または投資信託約款において、TOPIX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。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいいます。

条件付運用型	目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
ロング・ショート型 / 絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
その他型	目論見書または投資信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

属性区分の定義は、一般社団法人投資信託協会が定める「商品分類に関する指針」をもとに委託会社が作成しております。

### 信託金の限度額

当ファンドの信託金限度額は、信託約款の定めにより1兆円となっています。ただし、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

### ファンドの特色

## 1

### TOPIX(東証株価指数)に連動する投資成果の達成を目標とするインデックスファンドです。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」受益証券への投資を通じて、主として日本の企業(日本法人)の株式に投資します。

※TOPIX(東証株価指数)をベンチマークとします。

※インデックスファンドとは、主に特定の資産や市場等の全体の動きを表す指数(インデックス)に連動する投資成果を目標とする投資信託(ファンド)をいいます。

#### TOPIXについて

- ・TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。
- ・(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- ・(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- ・(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ・当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- ・(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスを義務を負いません。
- ・(株)東京証券取引所は、委託会社又は当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。
- ・以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

## 2

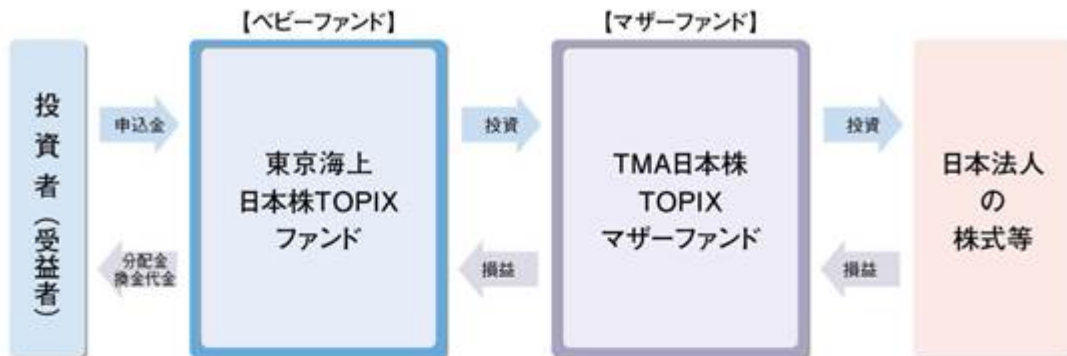
### 東証一部上場銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し組入れを行います。

組入れ銘柄の選択に際しては、流動性その他を考慮し、東証一部銘柄であっても組入れない、あるいは東証一部上場以外の銘柄を組入れることもあります。また、流動性、機動性、コスト等の観点から、株価指数先物取引を行うことがあります。

## 3

## ファミリーファンド方式で運用を行います。

原則として、マザーファンド受益証券の組入比率は高位に保ちます。ただし、投資環境等によっては弾力的に運用することがあります。



※「ファミリーファンド方式」とは、受益者の投資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（親投資信託）に投資することにより、実質的な運用をマザーファンドにて行う方式です。ベビーファンドがマザーファンドに投資するに際しての投資コストはかかりません。また、他のベビーファンドが、マザーファンドへ投資することがあります。

## 分配方針

原則として、毎決算時に収益分配を行います。分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みます。）等の全額とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

## 主な投資制限

株 式	株式への投資割合には、制限を設けません。
外 貨 建 資 産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

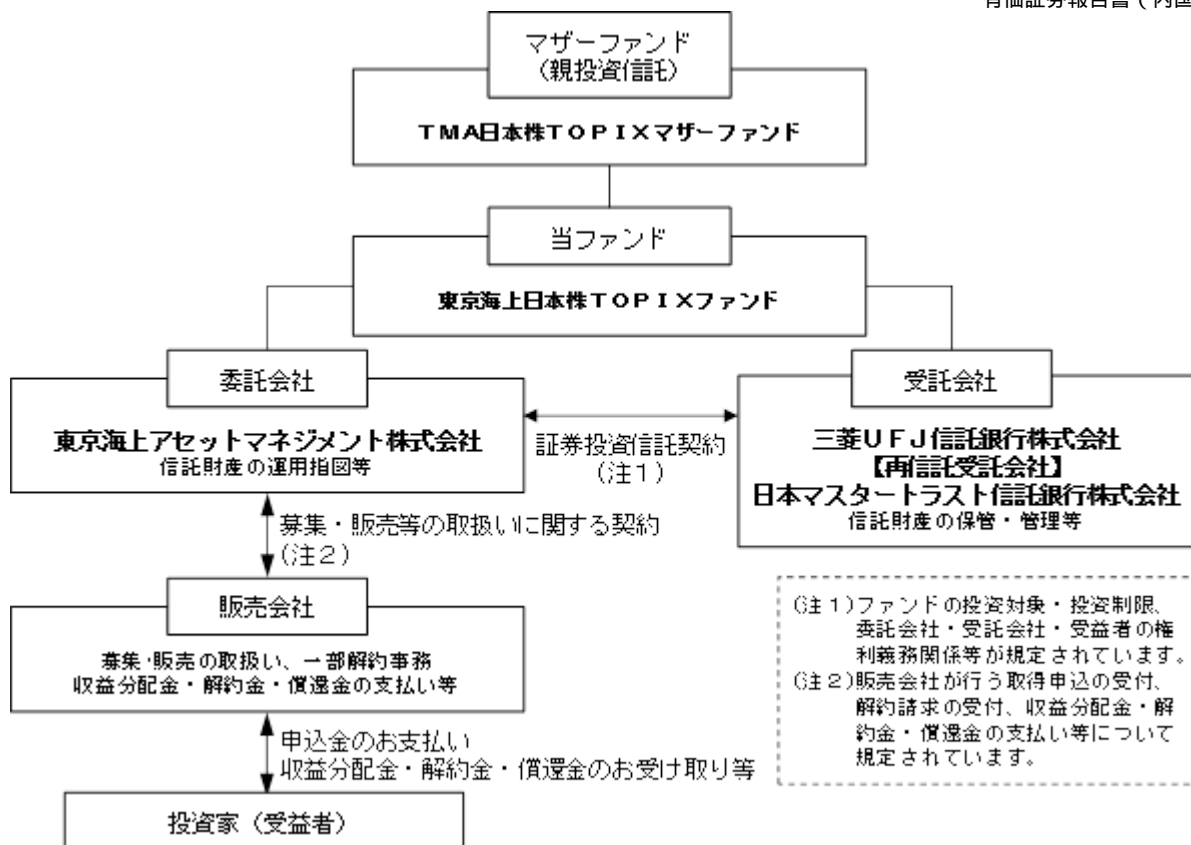
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (2) 【ファンドの沿革】

平成12年3月21日 ファンドの設定、運用開始  
平成28年2月18日 信託期間を無期限から平成32年3月19日までに変更

### (3) 【ファンドの仕組み】

ファンドの仕組み



### 委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（平成29年4月末日現在）
- ・会社の沿革

- 昭和60年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
- 昭和62年2月 投資顧問業者として登録
- 同年6月 投資一任業務認可取得
- 平成3年4月 国内および海外年金の運用受託を開始
- 平成10年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
- 平成19年9月 金融商品取引業者として登録
- 平成26年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更
- 平成28年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

### ・大株主の状況（平成29年4月末日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
東京海上ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目2番1号	38,300株	100.0%

## 2【投資方針】

### (1)【投資方針】

#### 1．基本方針

TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とし、主として同じ目標で運用を行う「TMA日本株TOPIXマザーファンド」受益証券に投資します。

#### 2．運用方法

##### (1) 主要投資対象



主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、このほか内外の株式等に直接投資することがあります。

## (2) 投資態度

主として東京証券取引所第一部に上場されている銘柄を主要投資対象として運用するマザーファンド受益証券に投資します。

当ファンドの運用は、ファミリーファンド方式により行います。したがって、実質的な運用は、マザーファンドで行うこととなります。

株式以外の資産(マザーファンド受益証券を通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、当ファンドの信託財産に属するとみなした部分を含みます。)への投資は、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、残存期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

## <参考情報> マザーファンドの投資方針、主な投資対象と投資制限(要約)

### TMA日本株TOPIXマザーファンド

<基本方針> TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

#### (1) 投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている銘柄を主要投資対象とします。

#### (2) 運用方針

東京証券取引所第一部に上場されている銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し組入を行います。組入銘柄の選択に際しては、流動性その他を考慮し、東京証券取引所第一部上場銘柄であっても組入れない、あるいは東京証券取引所第一部上場以外の銘柄を組入れることもあります。

流動性、機動性、コストなどの観点から、株価指数先物取引を行うことがあります。

基本的には株式への組入比率を高位に保ちますが、資金動向、市況動向によっては実質株式組入比率の調整を機動的に行います。

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、日本において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における日本の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことがあります。また、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(スワップ取引)を行うことがあります。

#### <投資制限>

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。

(3) 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。

(4) 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。

(5) 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割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

(6) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

大量の追加設定または解約が生じたとき、市況の急激な変化が予想されるとき、ならびに信託財産の規模によっては上記のような運用ができない場合があります。

運用にあたっては、東京証券取引所第一部の上場銘柄から時価総額・業種別構成比率等を勘案し、層化抽出法を用いてTOPIX(東証株価指数)に連動するようポートフォリオを構築します。

## (2) 【投資対象】

1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(1) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいい、以下同じ。)

有価証券

デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第21条(先物取引等の運用指図)、第22条(スワップ取引の運用指図)および第23条(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)に定めるものに限り、)

金銭債権( に掲げるものに該当するものを除きます。)

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。)

(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

2. 委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の受益証券および次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。

- (1) 株券または新株引受権証券
  - (2) 国債証券
  - (3) 地方債証券
  - (4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - (5) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
  - (6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - (7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  - (8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  - (9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  - (10) コマーシャル・ペーパー
  - (11) 新株引受権証券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)および新株予約権証券
  - (12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
  - (13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - (14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  - (15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - (16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
  - (17) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - (18) 外国法人が発行する譲渡性預金証券
  - (19) 指定金銭信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。)
  - (20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  - (21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - (22) 外国の者に対する権利で上記(21)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。

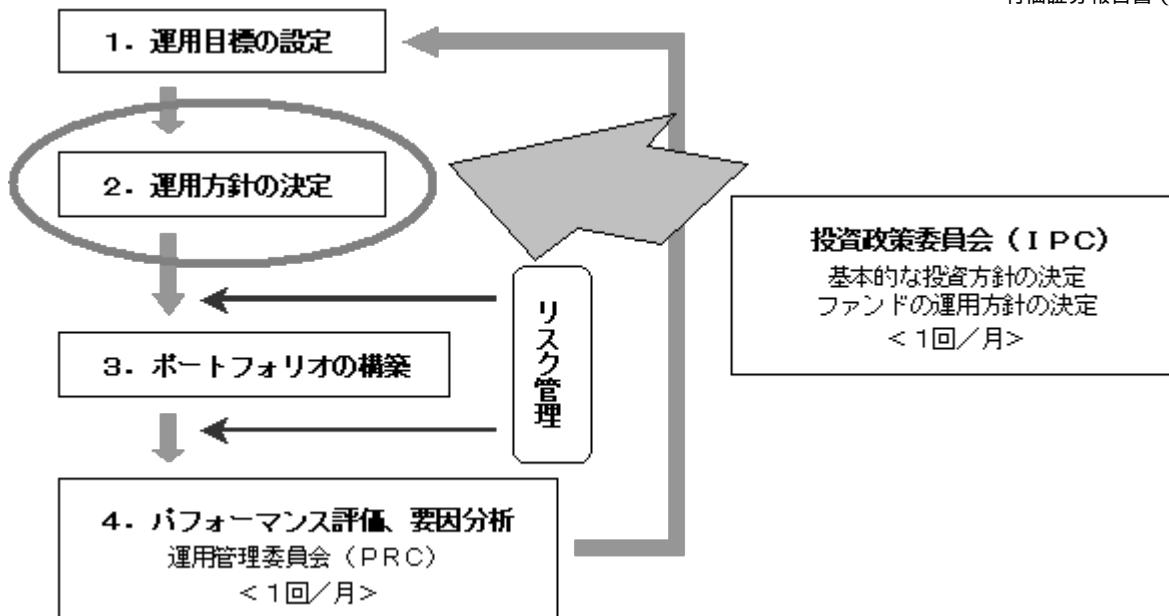
3. 委託会社は、信託金を、上記2.に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。

- (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上記(5)の権利の性質を有するもの

4. 上記2.の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (3)【運用体制】

当ファンドの運用は、投資方針に基づき日本法人の株式に投資します。実質的な運用は、マザーファンドで行います。マザーファンドの運用方針は、毎月開催される投資政策委員会において決定します。



当ファンドはクオンツ企画運用部（9名）が社内規則である「投資運用業に係る業務運営規程」に基づき運用を担当します。

運用におけるリスク管理は、運用管理部（6名）による法令・運用ガイドライン等の遵守状況のチェックや運用リスク項目のチェック等が随時実施され、担当運用部へフィードバックされるとともに、原則として月1回開催される運用管理委員会（管理本部長を委員長に、運用・営業・商品企画などファンド運用に関係する各部長が参加）において投資行動の評価が行われます。（リスク管理についての詳細は、「3 投資リスク」の「3.管理体制」をご参照ください）

この運用管理委員会での評価もふまえて、投資政策委員会（運用本部長を委員長とし、各運用部長が参加）において運用方針を決定し、より質の高い運用体制の維持・向上を目指します。

また、受託銀行等の管理については、関連部署において、受託銀行業務等に関する「内部統制の整備及び運用状況報告書」の入手・検証、現地モニタリング等を通じて実施しております。

（上記の体制や人員等については、平成29年5月1日現在）

#### (4)【配分方針】

年1回（原則として3月20日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、毎決算時に原則として以下の通り収益分配を行う方針です。

分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みません。）等の全額とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。ただし、分配対象収益が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。なお、収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、投資方針に基づいて運用を行います。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らに類する収益から支払利息を控除した額（「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および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残額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、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。

（ ）諸経費とは、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（消費税等相当額を含みます。）、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）ならびに受託会社の立替えた立替金の利息をいいます。

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から、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者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）に、お支払いします。なお、「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

**(5)【投資制限】**

運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

- a. 株式への投資割合には、制限を設けません。
- b. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。  
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の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。（以下同じ。）
- c. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- e. 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10を超えることとなる投資の指図をしません。
- f. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

投資する株式等の範囲（約款第18条）

- a. 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、証券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および証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券についてはこの限りではありません。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引（約款第20条）

- a. 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、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻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。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付にかかる建玉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範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額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売付の一部を決済するための指図をするものとします。

先物取引等（約款第21条）

- a. 委託会社は、日本国内の証券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。本書において同じ。）、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。本書において同じ。）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。本書において同じ。）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。）。
- b. 委託会社は、日本国内の取引所における通貨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通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 委託会社は、日本国内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（約款第22条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(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。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が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。
- c. 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行うものとします。
- d. 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が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。  
金利先渡取引および為替先渡取引(約款第23条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が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。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。  
デリバティブ取引等に係る投資制限(約款第23条の2)  
デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、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(約款第24条)
- a. 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範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - ・株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - ・公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a.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。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。  
公社債の空売(約款第25条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、公社債(信託財産において借入れた公社債を含みます。)の引渡または買戻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。
- b. 上記a.の売付の指図は、当該売付にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる公社債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の一部を決済するための指図をするものとします。  
公社債の借入(約款第26条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入の指図をすることができます。なお、当該公社債の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. 上記a.の借入の指図は、当該借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行えるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b.の借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. 上記a.の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。  
特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)  
外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。  
外国為替予約取引(約款第29条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。

- b. 上記a.の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第29条の2)

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したがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金の借入(約款第37条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資に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。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 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。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

### 3【投資リスク】

#### 1. 投資リスク

以下の記載は、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを組み入れることにより、当ファンドが間接的に受ける実質的なリスクを含みます。

##### (1) 価格変動リスク

当ファンドは、主に株式など値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。

委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

投資信託は預貯金や保険と異なります。

当ファンドへの投資には主に以下のリスクが想定され、これらの影響により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

##### 株価変動リスク

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります(発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります)。組入銘柄の株価が大きく下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 流動性リスク

受益者から短期間に相当金額の解約申込があった場合、ファンドは組入資産を売却することで解約金額の手当てを行います。組入資産の市場における流動性が低いときには直前の市場価格よりも大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。これに伴い基準価額が大きく下落することがあります。

##### (2) T O P I Xとの乖離リスク

当ファンドの投資成果はT O P I Xの動きに連動することを目標としますが、両者は正確に連動するものではなく、いくつかの要因により乖離が生じます。乖離が生じる主な要因は次の通りです。

- ・流動性の確保その他の理由で現預金等を保有すること
- ・東京証券取引所第一部上場銘柄を必ずしも全銘柄保有しないこと、あるいは、保有ウェイトがT O P I Xにおけるウェイトと異なること
- ・株式売買手数料等の取引コストを負担すること

- ・信託報酬等の管理報酬を負担すること

### (3) デリバティブ取引のリスク

当ファンドはデリバティブに投資することがあります。デリバティブの運用には、ヘッジする商品とヘッジされるべき資産との間の相関性を欠いてしまう可能性、流動性を欠く可能性、証拠金を積むことによるリスク等様々なリスクが伴います。これらの運用手法は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避する目的のみならず、効率的な運用に資する目的でも用いられることがあります。実際の価格変動が委託会社の見通しと異なった場合に当ファンドが損失を被るリスクを伴います。

## 2. その他の留意事項

### (1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

- ・投資信託は株式・公社債などの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。
- ・投資信託は金融機関の預金と異なり元金が保証されているものではありません。
- ・投資信託は保険契約および預金ではありません。
- ・投資信託は保険契約者保護機構の補償対象契約ではありません。
- ・投資信託は預金保険の対象ではありません。
- ・登録金融機関から購入した投資信託は投資者保護基金の補償対象ではありません。
- ・当ファンドは、主に国内株式を実質的な投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れた株式の値動きやそれらの株式の発行者の信用状況の変化等の影響により上下しますので、投資元本を割り込むことがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
- ・委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

### (2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

### (3) その他の留意点

取得申込者から販売会社に申込代金が支払われた場合であっても、販売会社より委託会社に対して申込代金の払込が現実になされるまでは、当ファンドも委託会社もいかなる責任も負わず、かつその後、受託会社に払込がなされるまでは、取得申込者は受益権および受益権に付随するいかなる権利も取得しません。

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用を善良なる管理者の注意をもって行う責任を負担し、販売会社は販売(申込代金の預り等を含みます。)について責任を負担しており、互いに他について責任を負担しません。

受託会社は、委託会社に収益分配金、一部解約金および償還金を委託会社の指定する預金口座等へ払い込んだ後は、受益者に対し、それらを支払う責任を負いません。

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。

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。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場合も同様です。

## 3. 管理体制

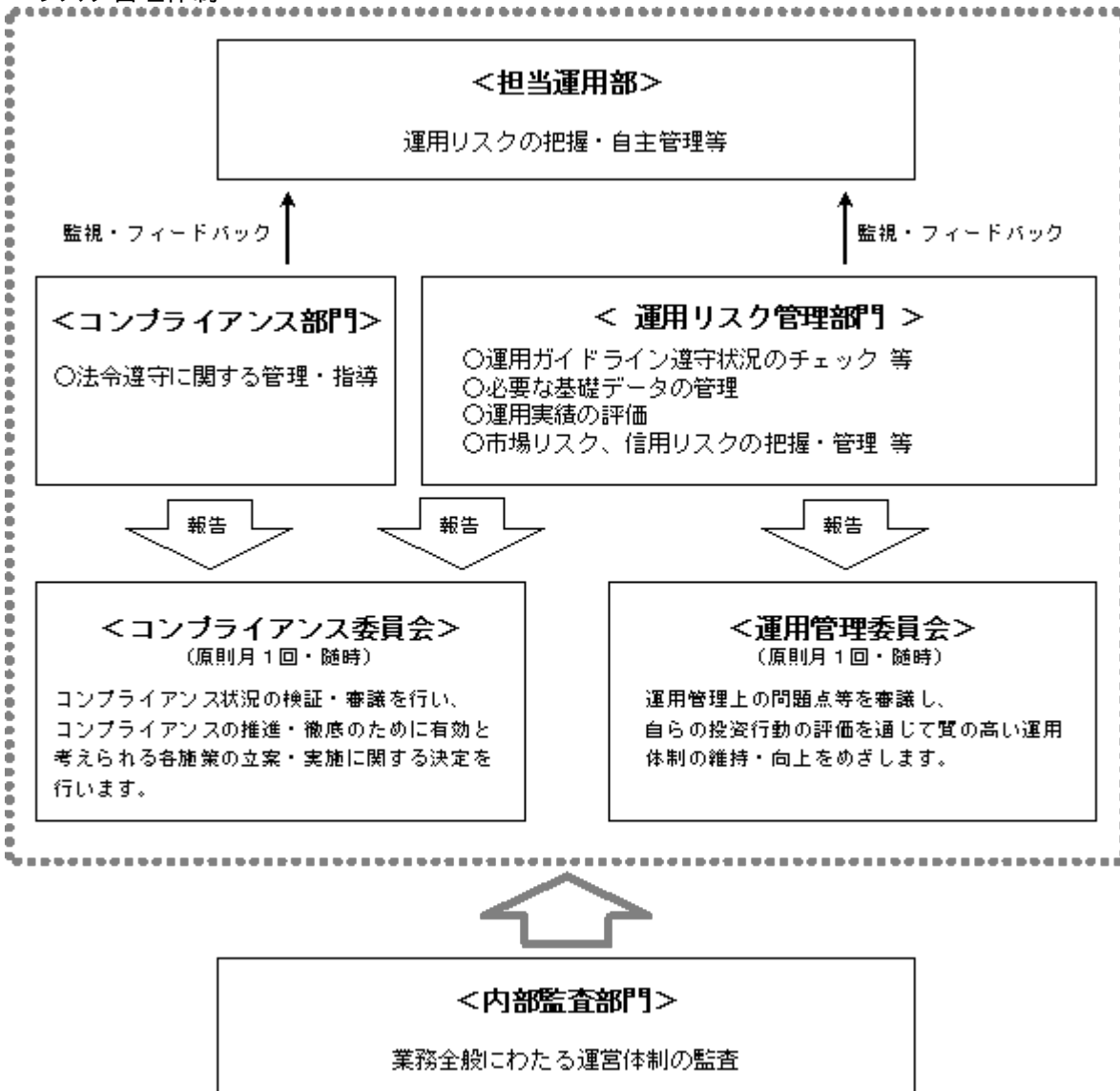
委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。

法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。



これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

<リスク管理体制>





## 参考情報

### ●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

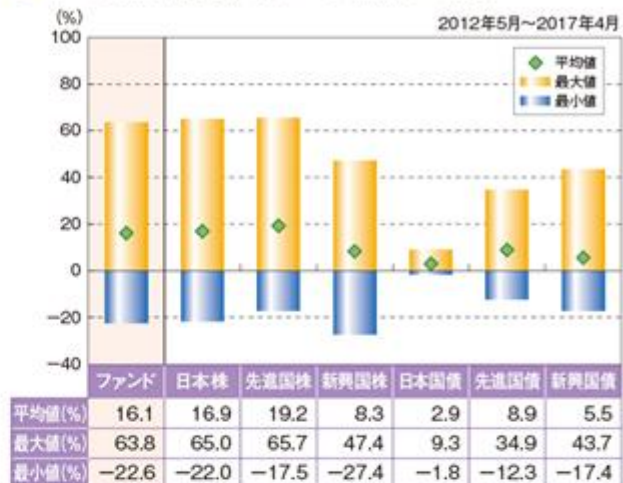


※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。

※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したのとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したのとして計算しているため、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。

### ●ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較



※ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。

なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。

※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したのとして計算しているため、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。

### ●代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

日本株：TOPIX(東証株価指数)(配当込み)

TOPIXは東京証券取引所が発表している東証市場第一部全銘柄の動きを捉える株価指数です。TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。

先進国株：MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

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、円ベース)

MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)は、MSCI社が発表している新興国の株式市場の動きを捉える代表的な指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。

日本国債：NOMURA-BPI(国債)

NOMURA-BPI(国債)は、野村証券が公表する日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI(国債)に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村証券に帰属します。

先進国債：シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

シティ世界国債インデックス(除く日本、円ベース)はCitigroup Index LLCにより開発、算出および公表されている、日本を除く世界主要国の国債の総合投資利回りを各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。

新興国債：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・ディバーシファイド(円ベース)

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・ディバーシファイド(円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、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・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしの指数を採用しています。

騰落率は、データソースが提供する各指数をもとに委託会社が計算しており、その内容について、信憑性、正確性、完全性、最新性、網羅性、適時性を含む一切の保証を行いません。また、当該騰落率に関連して資産運用または投資判断をした結果生じた損害等、当該騰落率の利用に起因する損害及び一切の問題について、何らの責任も負いません。

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

### (2)【換金(解約)手数料】

換金時(解約時)の手数料はありません。

**(3)【信託報酬等】**

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、年率0.648%（税抜0.60%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

の信託報酬（消費税等相当額を含みます。）は、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

純資産総額	委託会社 <sup>*1</sup>	販売会社 <sup>*2</sup>	受託会社 <sup>*3</sup>
250億円以下の部分	年率0.25%	年率0.26%	年率0.09%
250億円超の部分	年率0.26%	年率0.26%	年率0.08%

\*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

\*2 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および事務手続き等の対価

\*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

**(4)【その他の手数料等】**

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用であり、毎日、以下の1年当たりの金額の1日分相当額を計上し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

純資産総額	財務諸表の監査に要する費用
200億円以下の場合	純資産総額に年率0.0432%を乗じた金額（上限年43.2万円の1日分相当額）
200億円超の場合	年43.2万円の1日分相当額 + 純資産総額200億円超の部分に年率0.00324%を乗じた金額

信託財産に関する租税および信託事務等に要する諸費用（消費税等相当額を含みます。）ならびに受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用、外国における資産の保管等に要する費用等（全て消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

信託財産の一部解約に伴う支払資金の手当て、または再投資にかかる収益分配金の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、借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

監査費用を除くその他の手数料等については実際の取引等により変動するため、事前に料率、上限額等を表示することができません。

上記(1)から(4)の手数料等の合計額については、保有期間等に応じて異なりますので、あらかじめ表示することができません。

**(5)【課税上の取扱い】**

課税上は、株式投資信託として以下のような取扱いとなります。なお、税法が改正された場合は、以下の内容が変更になることがあります。また、以下は一般的な記載に過ぎませんので、課税上の取扱いの詳細につきましては、税務専門家等にご確認ください。

**<個人の受益者に対する課税>**

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315% および地方税5%）の税率による源泉徴収が行われます。申告不要制度の適用がありますが、総合課税または申告分離課税を選択することも可能です。配当控除は、総合課税を選択した場合には適用がありますが、申告不要制度の適用を受けた場合または申告分離課税を選択した場合には適用がありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（1）は課税されません。

平成49年12月31日までの間、復興特別所得税（所得税15%×2.1%）が付加されます。

解約時および償還時の差益（解約時および償還時の価額から取得費（申込手数料（税込）を含む）を控除した差額）は、その全額が譲渡所得等の金額とみなされ課税対象となります。譲渡所得等につい

ては、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）の税率による申告分離課税が適用されます（特定口座（源泉徴収選択口座）での取扱いも可能です。）。

普通分配金（申告分離課税を選択したものに限り、）ならびに解約時および償還時の損益については、確定申告により、上場株式等（特定公社債および公募公社債投信を含みます。）の利子所得および配当所得（申告分離課税を選択したものに限り、）ならびに譲渡所得等との間で損益通算を行うことができます。

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」および未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託や上場株式等から生じる配当所得および譲渡所得等が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

#### < 法人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の「各受益者の個別元本」（2）超過額については、15.315%（所得税15%および復興特別所得税0.315%）の税率による源泉徴収が行われます。地方税の源泉徴収はありません。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（1）は課税されません。

なお、益金不算入制度は適用されません。

- （1）「元本払戻金（特別分配金）」とは、収益分配金落ち後の基準価額が各受益者の個別元本を下回る場合、収益分配金のうち当該下回る部分に相当する額をさし、元本の一部払戻しに相当するものです。この場合、当該収益分配金から当該元本払戻金（特別分配金）を控除した額が普通分配金となります。
- （2）「各受益者の個別元本」とは、原則として各受益者の信託時の受益権の価額等（申込手数料および当該申込手数料にかかる消費税等相当額は含まれません。）をいい、追加信託のつど当該口数により加重平均され、元本払戻金（特別分配金）が支払われた際に調整されます。ただし、同一ファンドを複数の販売会社で取得する場合や、同一販売会社であっても複数の支店等で同一ファンドを取得する場合等は、個別元本の算出方法が異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

\* 上記は、平成29年4月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

## 5【運用状況】

以下は平成29年4月28日現在の運用状況です。

また、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。

### (1)【投資状況】

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
親投資信託受益証券	日本	428,182,539	100.07
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		324,699	0.07
合計（純資産総額）		427,857,840	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）

当ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

#### TMA日本株TOPIXマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
株式	日本	54,123,727,150	96.58
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		1,911,483,166	3.41
合計（純資産総額）		56,035,210,316	100.00

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（%）
株価指数先物取引	買建	日本	1,575,900,000	2.81

(注)時価については、原則として当該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います。このような時価が発表されていない場合には、当該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います。

## (2)【投資資産】

### 【投資有価証券の主要銘柄】

#### a. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	356,017,743	1.2141	432,276,683	1.2027	428,182,539	100.07

#### b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.07
合計	100.07

#### 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

#### 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(ご参考：親投資信託の投資資産)

### 投資有価証券の主要銘柄

#### a. 主要銘柄の明細

#### TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	294,800	6,373.00	1,878,760,400	6,035.00	1,779,118,000	3.17
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	1,812,500	745.70	1,351,581,250	709.20	1,285,425,000	2.29
3	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	192,100	4,946.00	950,126,600	4,769.00	916,124,900	1.63
4	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	107,700	8,274.00	891,109,800	8,442.00	909,203,400	1.62
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	191,700	4,266.00	817,792,200	4,124.00	790,570,800	1.41
6	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	218,100	3,542.00	772,510,200	3,232.00	704,899,200	1.25
7	KDDI	日本	情報・通信業	株式	236,800	3,040.00	719,872,000	2,955.50	699,862,400	1.24
8	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	3,249,600	211.00	685,665,600	203.60	661,618,560	1.18
9	ソニー	日本	電気機器	株式	171,300	3,627.00	621,305,100	3,759.00	643,916,700	1.14
10	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	150,700	3,856.00	581,099,200	3,706.00	558,494,200	0.99
11	ファナック	日本	電気機器	株式	24,600	23,005.00	565,923,000	22,655.00	557,313,000	0.99
12	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	95,100	5,315.00	505,456,500	5,342.00	508,024,200	0.90
13	キーエンス	日本	電気機器	株式	11,000	45,190.00	497,090,000	44,800.00	492,800,000	0.87

14	キヤノン	日本	電気機器	株式	130,500	3,535.00	461,317,500	3,696.00	482,328,000	0.86
15	NTTドコモ	日本	情報・通信業	株式	178,600	2,700.50	482,309,300	2,688.00	480,076,800	0.85
16	セブン & アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	100,200	4,421.00	442,984,200	4,710.00	471,942,000	0.84
17	東日本旅客鉄道	日本	陸運業	株式	46,800	9,913.00	463,928,400	9,954.00	465,847,200	0.83
18	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	97,000	5,062.00	491,014,000	4,692.00	455,124,000	0.81
19	信越化学工業	日本	化学	株式	45,500	9,698.00	441,259,000	9,684.00	440,622,000	0.78
20	三菱商事	日本	卸売業	株式	179,600	2,491.00	447,383,600	2,403.50	431,668,600	0.77
21	任天堂	日本	その他製品	株式	14,900	26,265.00	391,348,500	28,045.00	417,870,500	0.74
22	三菱電機	日本	電気機器	株式	257,900	1,688.50	435,464,150	1,554.00	400,776,600	0.71
23	ブリヂストン	日本	ゴム製品	株式	85,700	4,613.00	395,334,100	4,648.00	398,333,600	0.71
24	花王	日本	化学	株式	64,500	6,049.00	390,160,500	6,148.00	396,546,000	0.70
25	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	259,500	1,517.00	393,661,500	1,468.00	380,946,000	0.67
26	村田製作所	日本	電気機器	株式	25,400	15,930.00	404,622,000	14,945.00	379,603,000	0.67
27	三菱地所	日本	不動産業	株式	177,900	2,172.50	386,487,750	2,130.00	378,927,000	0.67
28	東海旅客鉄道	日本	陸運業	株式	20,100	18,545.00	372,754,500	18,685.00	375,568,500	0.67
29	パナソニック	日本	電気機器	株式	278,300	1,245.00	346,483,500	1,330.50	370,278,150	0.66
30	ダイキン工業	日本	機械	株式	33,100	11,095.00	367,244,500	10,825.00	358,307,500	0.63

## b. 投資有価証券の種類

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	国内 / 国外	業種	投資比率 (%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.31
		建設業	2.88
		食料品	4.41
		繊維製品	0.73
		パルプ・紙	0.27
		化学	6.56
		医薬品	4.57
		石油・石炭製品	0.51
		ゴム製品	0.96
		ガラス・土石製品	0.90
		鉄鋼	1.21
		非鉄金属	0.91
		金属製品	0.74
		機械	4.95
		電気機器	12.38
		輸送用機器	8.68
		精密機器	1.50
		その他製品	1.85
		電気・ガス業	1.76
陸運業	4.05		
海運業	0.22		

	空運業	0.54
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	7.64
	卸売業	4.40
	小売業	4.54
	銀行業	7.85
	証券、商品先物取引業	1.14
	保険業	2.51
	その他金融業	1.20
	不動産業	2.31
	サービス業	3.64
合 計		96.58

## 投資不動産物件

TMA日本株TOPIX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

TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量(枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	103	1,537,811,240.00	1,575,900,000	2.81

(注)時価については、原則として当該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います。このような時価が発表されていない場合には、当該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います。

## (3)【運用実績】

## 【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第8計算期間末	(平成20年 3月21日)	2,971	2,971	0.7456	0.7456
第9計算期間末	(平成21年 3月23日)	962	962	0.4912	0.4912
第10計算期間末	(平成22年 3月23日)	1,204	1,204	0.5954	0.5954
第11計算期間末	(平成23年 3月22日)	1,196	1,196	0.5522	0.5522
第12計算期間末	(平成24年 3月21日)	1,274	1,274	0.5555	0.5555
第13計算期間末	(平成25年 3月21日)	1,460	1,460	0.6958	0.6958
第14計算期間末	(平成26年 3月20日)	819	819	0.7638	0.7638
第15計算期間末	(平成27年 3月20日)	644	644	1.0681	1.0681
第16計算期間末	(平成28年 3月22日)	507	507	0.9368	0.9368
第17計算期間末	(平成29年 3月21日)	457	457	1.0856	1.0856
	平成28年 4月末日	492	-	0.9243	-
	5月末日	500	-	0.9510	-
	6月末日	446	-	0.8591	-
	7月末日	477	-	0.9120	-
	8月末日	474	-	0.9166	-
	9月末日	475	-	0.9186	-

10月末日	498	-	0.9670	-
11月末日	502	-	1.0201	-
12月末日	513	-	1.0552	-
平成29年 1月末日	494	-	1.0569	-
2月末日	481	-	1.0666	-
3月末日	446	-	1.0594	-
4月末日	427	-	1.0724	-

## 【分配の推移】

該当事項はありません。

## 【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第8計算期間	平成19年 3月21日～平成20年 3月21日	28.1
第9計算期間	平成20年 3月22日～平成21年 3月23日	34.1
第10計算期間	平成21年 3月24日～平成22年 3月23日	21.2
第11計算期間	平成22年 3月24日～平成23年 3月22日	7.3
第12計算期間	平成23年 3月23日～平成24年 3月21日	0.6
第13計算期間	平成24年 3月22日～平成25年 3月21日	25.3
第14計算期間	平成25年 3月22日～平成26年 3月20日	9.8
第15計算期間	平成26年 3月21日～平成27年 3月20日	39.8
第16計算期間	平成27年 3月21日～平成28年 3月22日	12.3
第17計算期間	平成28年 3月23日～平成29年 3月21日	15.9

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第8計算期間	平成19年 3月21日～平成20年 3月21日	856,930,245	1,475,899,024	3,986,031,897
第9計算期間	平成20年 3月22日～平成21年 3月23日	879,247,696	2,905,052,394	1,960,227,199
第10計算期間	平成21年 3月24日～平成22年 3月23日	1,089,311,554	1,025,856,594	2,023,682,159
第11計算期間	平成22年 3月24日～平成23年 3月22日	835,390,136	692,721,173	2,166,351,122
第12計算期間	平成23年 3月23日～平成24年 3月21日	1,341,147,957	1,213,356,337	2,294,142,742
第13計算期間	平成24年 3月22日～平成25年 3月21日	3,198,472,114	3,393,289,909	2,099,324,947
第14計算期間	平成25年 3月22日～平成26年 3月20日	1,014,995,803	2,041,337,723	1,072,983,027
第15計算期間	平成26年 3月21日～平成27年 3月20日	169,226,671	639,010,990	603,198,708
第16計算期間	平成27年 3月21日～平成28年 3月22日	477,679,201	538,779,461	542,098,448
第17計算期間	平成28年 3月23日～平成29年 3月21日	325,019,593	445,777,805	421,340,236

## &lt; 参考情報 &gt;

(平成29年 4月28日現在)



## 基準価額、パフォーマンス等の状況

### ●基準価額・純資産総額の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。  
 ※ベンチマークは設定日を10,000円として指数化したもので、参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。(設定日:2000年3月21日)  
 ※基準価額は1万口当たりで表示しています。  
 ※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。  
 ※TOPIXは東京証券取引所が発表している東証市場第一部全銘柄の動きを捉える株価指数です。TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。

### ●基準価額・純資産総額

基準価額	10,724円
純資産総額	428百万円

### ●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	+1.23	+1.47	+10.90	+16.02	+37.17	+7.24
ベンチマーク	+1.27	+0.67	+9.96	+14.27	+31.77	-8.42

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の投資家利回りとは異なります。

### ●分配の推移(1万口当たり、税引前)

期	日	金額
第13期	2013年3月21日	0円
第14期	2014年3月20日	0円
第15期	2015年3月20日	0円
第16期	2016年3月22日	0円
第17期	2017年3月21日	0円
設定来累計		分配実績なし

※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

## 主要な資産の状況

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っており、マザーファンドの資産の状況を記載しています。

### ●資産構成

資産	比率(%)
株式	96.6
株式先物	2.8
短期金融資産等	0.6
合計	100.0
純資産総額	56,035百万円

### ●組入上位10業種

業種名	比率(%)
1 電気機器	12.4
2 輸送用機器	8.7
3 銀行業	7.9
4 情報・通信業	7.6
5 化学	6.6
6 機械	5.0
7 医薬品	4.6
8 小売業	4.5
9 食料品	4.4
10 卸売業	4.4

### ●組入上位10銘柄

銘柄名	コード	業種名	比率(%)
1 トヨタ自動車	7203	輸送用機器	3.2
2 三菱UFJ FG	8306	銀行業	2.3
3 日本電信電話	9432	情報・通信業	1.6
4 ソフトバンクグループ	9984	情報・通信業	1.6
5 三井住友 FG	8316	銀行業	1.4
6 本田技研工業	7267	輸送用機器	1.3
7 KDDI	9433	情報・通信業	1.2
8 みずほ FG	8411	銀行業	1.2
9 ソニー	6758	電気機器	1.1
10 日本たばこ産業	2914	食料品	1.0

組入銘柄数 1,108

※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。  
 ※比率は、純資産総額に占める割合です。  
 ※株式には、新株予約権証券を含む場合があります。

## 年間収益率の推移



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しています。  
 ※当年は昨年末と基準日の騰落率です。  
 ※上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

※最新の運用実績は、委託会社のホームページでご確認いただけます。  
 ※ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。  
 ※ベンチマークはあくまで参考情報であり、ファンドの運用実績ではありません。

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込(販売)手続等】

- 毎営業日にお申込みを受け付けます。
- 申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の2種類のコースがあります。

分配金受取りコース	分配金を受け取るコースです。
分配金再投資コース	分配金が税引き後、自動的に無手数料で再投資されるコースです。



- c. 販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、1口単位で取得することができます。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。
- e. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。  
取得申込受付日の基準価額  
基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。  
委託会社のお問い合わせ先(委託会社サービスデスク)  
東京海上アセットマネジメント サービスデスク  
0120-712-016(土日祝日・年末年始を除く9時~17時)
- f. 取得申込にかかる手数料はありません。
- g. 上記にかかわらず、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
- h. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ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。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとし、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。
- i. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 2【換金(解約)手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求(解約請求)の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取扱いします。
- f. 解約時の価額(解約価額)は、解約請求受付日の基準価額とします。  
信託財産留保額ははありません。
- g. 解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。
- h. 解約にかかる手数料はありません。
- i. 解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して4営業日目から、お支払いします。
- j. 委託会社は、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することができます。その場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、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その請求を受け付けたものとして取扱います。
- k. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。
  - l. 受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、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が行われ、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【資産管理等の概要】

### (1)【資産の評価】

- a. 基準価額とは、受益権1口当たりの純資産価額(純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額)をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。

- b. 純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原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をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

< 主要投資対象資産の評価方法 >

対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	原則として、当ファンドの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、上場されている取引所における計算日（外国株式の場合は、計算時に知り得る直近の日）の最終相場で評価します。
先物取引	国内取引所に上場されているものは、当該取引所が発表する計算日の清算値段または証拠金算定基準値段で評価します。 海外取引所に上場されているものは、当該海外取引所が発表する計算日に知りうる直近の日の清算価格または最終相場で評価します。

- c. 基準価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。

(2) 【保管】

該当事項はありません。

(3) 【信託期間】

原則として、平成12年3月21日から平成32年3月19日までとします。ただし、後記「(5) その他信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

(4) 【計算期間】

原則として、毎年3月21日から翌年3月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（ ）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

（ ）法令により、これと異なる日を計算期間の末日と定めている場合には、法令にしたがいます。

(5) 【その他】

信託の終了（繰上償還）

- 委託会社は、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、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、上記a.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は、1ヵ月以上の一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。
- 上記c.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記a.の信託契約の解約をしません。
- 委託会社は、信託契約を解約しないこととしたときは、解約をしない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 上記c.からe.の規定は、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記c.の一定の期間が1ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合は適用しません。
- 信託契約を解約する場合において、上記c.の一定の期間内に異議を申し出た受益者は、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。
- 委託会社は、監督官庁より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、監督官庁が信託契約に関する委託会社

の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、下記「信託約款の変更」d.に該当する場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。

- j. 委託会社は、受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した後、あるいは裁判所が受託会社を解任した後、委託会社が新受託会社を選任できないときは、あらかじめ、監督官庁に届出のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

- a. 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、あらかじめ監督官庁に届出ることにより、信託約款を変更することができます。
- b. 変更事項のうち、その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当するときは、内閣府令で定めるところにより、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつこれらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は、1ヵ月以上の一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。
- d. 上記c.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記a.の約款変更を行いません。その場合には、委託会社は、内閣府令で定めるところにより、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- e. その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当する信託約款の変更を行う場合において、上記c.の一定の期間内に異議を申し出た受益者は、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。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記b.からd.の規定にしたがいます。

#### 関係会社との契約の更改等

委託会社と販売会社との間の募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者の別段の意思表示がない限り、1年ごとに自動更新されます。募集・販売等の取扱いに関する契約は、当事者間の合意により変更することができます。

#### 運用報告書

- a. 毎決算時および償還時に、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容などを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、知っている受益者に対して、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。
- b. 委託会社は、運用報告書(全体版)を作成し、委託会社のホームページ(<http://www.tokiomarineam.co.jp/>)に掲載します。
- c. 上記b.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合は、交付します。

#### 公告

委託会社が受益者に対してする公告は、原則として電子公告の方法により行い、委託会社のホームページ(<http://www.tokiomarineam.co.jp/>)に掲載します。

なお、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。

## 4【受益者の権利等】

当ファンドの受益者の有する主な権利は以下の通りです。なお、議決権、受益者集会に関する権利は有しません。

### a. 収益分配金の請求権

収益分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)から、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ます。)に、お支払いします。ただし、受益者が収益分配金について、上記に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。なお、分配金再投資コースの収益分配金は、税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

### b. 償還金の請求権

償還金(信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額をいいます。以下同じ。)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には当該償還日の翌営業日)から起算して5営業日まで)から、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。)にお支払いします。ただし、受益者が償還金について、上記に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

c. 換金(解約)請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行請求の方法により、換金を請求することができます。詳細は上記「2 換金(解約)手続等」をご参照ください。

d. 買取請求権

信託契約を解約して信託を終了させるとき、および信託約款の変更を行う場合において、その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当するときは、委託会社によって定められた期間内に異議を述べた受益者は、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。

### 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項の規定に基づいて、第17期計算期間(平成28年3月23日から平成29年3月21日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【東京海上日本株TOPIXファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第16期 [平成28年 3月22日現在]	第17期 [平成29年 3月21日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	507,859,938	457,409,570
未収入金	1,961,786	12,096,786
流動資産合計	509,821,724	469,506,356
資産合計	509,821,724	469,506,356
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	98,418	10,404,264
未払受託者報酬	262,055	238,032
未払委託者報酬	1,484,935	1,348,779
その他未払費用	116,378	105,711
流動負債合計	1,961,786	12,096,786
負債合計	1,961,786	12,096,786
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 542,098,448	1 421,340,236
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	2 34,238,510	2 36,069,334
（分配準備積立金）	86,658,145	67,742,176
元本等合計	507,859,938	457,409,570
純資産合計	507,859,938	457,409,570
負債純資産合計	509,821,724	469,506,356

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第16期	第17期
	自 平成27年 3月21日 至 平成28年 3月22日	自 平成28年 3月23日 至 平成29年 3月21日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	61,486,126	77,487,739
<b>営業収益合計</b>	<b>61,486,126</b>	<b>77,487,739</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	565,426	474,402
委託者報酬	3,203,950	2,688,183
その他費用	251,112	210,678
<b>営業費用合計</b>	<b>4,020,488</b>	<b>3,373,263</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>65,506,614</b>	<b>74,114,476</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>65,506,614</b>	<b>74,114,476</b>
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>65,506,614</b>	<b>74,114,476</b>
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( )	12,422,191	17,177,488
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>41,053,499</b>	<b>34,238,510</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>11,657,458</b>	<b>28,582,498</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	28,582,498
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	11,657,458	-
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>33,865,044</b>	<b>15,211,642</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	33,865,044	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	15,211,642
<b>分配金</b>	<b>1 -</b>	<b>1 -</b>
<b>期末剰余金又は期末欠損金( )</b>	<b>34,238,510</b>	<b>36,069,334</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第17期	
	自 平成28年 3月23日 至 平成29年 3月21日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、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、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 平成28年3月20日とその翌日及び平成29年3月20日が休日のため、前計算期間末日を平成28年3月22日とし、当計算期間末日を平成29年3月21日としております。このため、当計算期間は、364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第16期	第17期
	[平成28年 3月22日現在]	[平成29年 3月21日現在]
1. 1 期首元本額	603,198,708円	542,098,448円
期中追加設定元本額	477,679,201円	325,019,593円
期中一部解約元本額	538,779,461円	445,777,805円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	542,098,448口	421,340,236口
3. 2 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は34,238,510円であります。	

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第16期	第17期
自 平成27年 3月21日 至 平成28年 3月22日	自 平成28年 3月23日 至 平成29年 3月21日
1 分配金の計算過程	1 分配金の計算過程
計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,373,813円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(0円)、投資信託約款に規定される収益調整金(276,583,325円)及び分配準備積立金(79,284,332円)より、分配対象額は363,241,470円(1万口当たり6,700.64円)であります。分配を行っておりません。	計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,481,415円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(23,521,817円)、投資信託約款に規定される収益調整金(247,217,587円)及び分配準備積立金(35,738,944円)より、分配対象額は314,959,763円(1万口当たり7,475.16円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第16期	第17期
	自 平成27年 3月21日 至 平成28年 3月22日	自 平成28年 3月23日 至 平成29年 3月21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」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第16期 [平成28年 3月22日現在]	第17期 [平成29年 3月21日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （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。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左

	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	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。	同左

(有価証券に関する注記)

第16期(自平成27年3月21日 至平成28年3月22日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	48,506,969
合計	48,506,969

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

第17期(自平成28年3月23日 至平成29年3月21日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	60,029,733
合計	60,029,733

(注)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(1口当たり情報に関する注記)

第16期 [平成28年 3月22日現在]		第17期 [平成29年 3月21日現在]	
1口当たり純資産額	0.9368円	1口当たり純資産額	1.0856円
(1万口当たり純資産額)	9,368円)	(1万口当たり純資産額)	10,856円)

## (4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位:円)

種類	銘柄	券面総額	評価額	備考
----	----	------	-----	----

親投資信託 受益証券	TMA日本株TOPIXマザーファンド	375,973,673	457,409,570	
親投資信託受益証券 合計		375,973,673	457,409,570	
合計		375,973,673	457,409,570	

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
該当事項はありません。

(ご参考)

当ファンドは、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」を主要な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」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[平成28年 3月22日現在]	[平成29年 3月21日現在]
区 分	注記 番号	金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託		3,345,533,477	
コール・ローン		158,785,971	2,375,639,958
株式	2	129,866,191,520	77,705,684,830
派生商品評価勘定		17,881,280	
未収入金			1,935,120
未収配当金		165,895,987	152,320,026
未収利息		4	
前払金		32,966,000	7,988,000
流動資産合計		133,587,254,239	80,243,567,934
資産合計			
		133,587,254,239	80,243,567,934
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,121,600	7,136,640
未払金		1,331,107,939	1,544,680
未払解約金		351,877,309	314,636,843
未払利息			4,986
流動負債合計		1,685,106,848	323,323,149
負債合計			
		1,685,106,848	323,323,149
純資産の部			
元本等			
元本	1	126,460,855,200	65,689,541,274
剰余金			

剰余金又は欠損金( )		5,441,292,191	14,230,703,511
元本等合計		131,902,147,391	79,920,244,785
純資産合計		131,902,147,391	79,920,244,785
負債純資産合計		133,587,254,239	80,243,567,934

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成28年 3月23日 至 平成29年 3月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、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又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成28年 3月22日現在]	[平成29年 3月21日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	136,898,858,294円	126,460,855,200円
同期中における追加設定元本額	58,023,385,786円	17,938,262,969円
同期中における一部解約元本額	68,461,388,880円	78,709,576,895円
同期末における元本額	126,460,855,200円	65,689,541,274円
元本の内訳*		
東京海上日本株TOPIXファンド	486,922,280円	375,973,673円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	16,424,835,433円	16,186,801,364円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	4,108,637円	4,352,539円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	6,152,284円	5,157,837円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	27,191,353円	25,613,043円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	35,780,161円	32,422,697円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	47,447,575円	45,488,971円
TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	52,452,832,887円	13,968,573,968円
TMA世界バランスファンド55VA<適格機関投資家限定>	2,706,739,898円	1,756,977,162円
TMA世界バランスファンド35VA<適格機関投資家限定>	11,874,144,849円	8,921,502,332円
TMA新興国重視型バランスVA(適格機関投資家限定)	243,181円	111,209円
TMA債券重視型バランスVA(適格機関投資家限定)	2,057,173円	269,285円

TMA資産分散型バランスVA (適格機関投資家限定)	9,541,928円	234,473円
東京海上・TOPIXインデックス ファンド<適格機関投資家限定>	42,382,857,561円	24,366,062,721円
計	126,460,855,200円	65,689,541,274円
2. 1 本書における開示対象ファンドの計算 期間末日における当該親投資信託の受 益権の総数	126,460,855,200口	65,689,541,274口
3. 2 担保資産	代用有価証券として、担 保に供している資産は次 のとおりであります。  株式 1,524,500,000円	代用有価証券として、担 保に供している資産は次 のとおりであります。  株式 1,593,250,000円

(注1) \*は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

(注2) 3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

## (金融商品に関する注記)

## 1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成27年 3月21日 至 平成28年 3月22日	自 平成28年 3月23日 至 平成29年 3月21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」(昭和 26年法律第198号)第2条第4項 に定める証券投資信託であり、 有価証券等の金融商品への投資 を信託約款に定める「運用の基 本方針」に基づき行なっており ます。	同左
2. 金融商品の内容及びその リスク	当ファンドが運用する主な金融 商品は「重要な会計方針に係る 事項に関する注記」の「有価証 券の評価基準及び評価方法」に 記載の有価証券及びデリバティ ブ取引であります。デリバティ ブ取引には、先物取引が含まれ ております。当該有価証券及び デリバティブ取引には、性質に 応じてそれぞれ価格変動リス ク、流動性リスク、信用リス ク等があります。	同左

3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。</p> <p>法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。</p> <p>これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。</p>	同左
-------------------	---	----

## ・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成28年 3月22日現在]	[平成29年 3月21日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （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。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左
----------------------------	--	----

(有価証券に関する注記)

(自 平成27年3月21日 至 平成28年3月22日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	14,282,276,260
合計	14,282,276,260

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(平成27年3月21日から平成28年3月22日まで)を指しております。

(自 平成28年3月23日 至 平成29年3月21日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	9,611,934,342
合計	9,611,934,342

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(平成28年3月23日から平成29年3月21日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(平成28年3月22日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,058,781,000		2,074,680,000	15,899,000
	東証株価指数先物	2,058,781,000		2,074,680,000	15,899,000

合計	2,058,781,000	2,074,680,000	15,899,000
----	---------------	---------------	------------

(平成29年3月21日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,679,940,000		1,672,920,000	7,020,000
	東証株価指数先物	1,679,940,000		1,672,920,000	7,020,000
合計		1,679,940,000		1,672,920,000	7,020,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。
3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報に関する注記)

[平成28年 3月22日現在]		[平成29年 3月21日現在]	
1口当たり純資産額	1.0430円	1口当たり純資産額	1.2166円
(1万口当たり純資産額	10,430円)	(1万口当たり純資産額	12,166円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位:円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
日本水産	49,000	568.00	27,832,000	
マルハニチロ	7,300	3,580.00	26,134,000	
サカタのタネ	5,400	3,395.00	18,333,000	
ホクト	7,700	2,166.00	16,678,200	
日鉄鉱業	100	5,840.00	584,000	
国際石油開発帝石	201,200	1,106.50	222,627,800	
石油資源開発	5,400	2,587.00	13,969,800	
K & Oエナジーグループ	12,200	1,836.00	22,399,200	
ショーボンドホールディングス	3,900	4,990.00	19,461,000	
ミライト・ホールディングス	14,700	1,177.00	17,301,900	
安藤・間	27,000	793.00	21,411,000	
東急建設	12,800	851.00	10,892,800	
コムシスホールディングス	15,800	2,087.00	32,974,600	
ミサワホーム	12,300	1,086.00	13,357,800	
東建コーポレーション	900	9,000.00	8,100,000	
ヤマウラ	24,600	624.00	15,350,400	



大成建設	195,000	822.00	160,290,000	
大林組	115,400	1,044.00	120,477,600	
清水建設	118,000	1,024.00	120,832,000	
長谷工コーポレーション	44,300	1,309.00	57,988,700	
鹿島建設	168,000	759.00	127,512,000	
西松建設	42,000	591.00	24,822,000	
三井住友建設	160,800	124.00	19,939,200	
前田建設工業	24,000	1,051.00	25,224,000	
奥村組	31,000	724.00	22,444,000	
東鉄工業	4,000	3,255.00	13,020,000	
戸田建設	43,000	713.00	30,659,000	
熊谷組	57,000	302.00	17,214,000	
大東建託	14,100	15,785.00	222,568,500	
N I P P O	8,000	2,199.00	17,592,000	
前田道路	12,000	2,057.00	24,684,000	
東亜建設工業	7,800	2,044.00	15,943,200	
五洋建設	44,800	565.00	25,312,000	
大林道路	16,600	686.00	11,387,600	
福田組	1,000	1,051.00	1,051,000	
住友林業	25,800	1,751.00	45,175,800	
日本基礎技術	30,400	363.00	11,035,200	
パナホーム	10,000	1,029.00	10,290,000	
大和ハウス工業	112,900	3,268.00	368,957,200	
積水ハウス	120,200	1,909.00	229,461,800	
北陸電気工事	1,700	924.00	1,570,800	
西部電気工業	2,700	2,294.00	6,193,800	
中電工	6,500	2,491.00	16,191,500	
関電工	13,000	1,026.00	13,338,000	
きんでん	25,700	1,588.00	40,811,600	
日本電設工業	6,000	2,045.00	12,270,000	
協和エクシオ	16,000	1,664.00	26,624,000	
新日本空調	15,500	1,385.00	21,467,500	
九電工	7,300	3,185.00	23,250,500	
三機工業	18,100	1,029.00	18,624,900	
日揮	35,500	2,075.00	73,662,500	
中外炉工業	54,000	232.00	12,528,000	
ヤマト	25,200	575.00	14,490,000	
高砂熱学工業	11,500	1,691.00	19,446,500	
三晃金属工業	2,000	3,360.00	6,720,000	
大気社	5,500	2,911.00	16,010,500	
日比谷総合設備	11,600	1,686.00	19,557,600	
東芝プラントシステム	6,200	1,564.00	9,696,800	
東洋エンジニアリング	34,000	278.00	9,452,000	

千代田化工建設	26,000	764.00	19,864,000	
新興プランテック	19,800	889.00	17,602,200	
日本製粉	11,000	1,724.00	18,964,000	
日清製粉グループ本社	42,600	1,761.00	75,018,600	
鳥越製粉	21,600	813.00	17,560,800	
日本甜菜製糖	7,700	2,500.00	19,250,000	
三井製糖	5,200	2,821.00	14,669,200	
森永製菓	7,400	5,370.00	39,738,000	
中村屋	500	5,290.00	2,645,000	
江崎グリコ	9,500	5,600.00	53,200,000	
山崎製パン	28,000	2,321.00	64,988,000	
亀田製菓	1,200	5,150.00	6,180,000	
カルビー	15,400	3,995.00	61,523,000	
森永乳業	34,000	986.00	33,524,000	
ヤクルト本社	20,400	6,020.00	122,808,000	
明治ホールディングス	22,600	9,350.00	211,310,000	
雪印メグミルク	8,200	3,110.00	25,502,000	
プリマハム	15,000	507.00	7,605,000	
日本ハム	26,000	3,095.00	80,470,000	
丸大食品	15,000	509.00	7,635,000	
S Foods	4,800	3,180.00	15,264,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	23,800	1,106.00	26,322,800	
サッポロホールディングス	12,500	2,984.00	37,300,000	
アサヒグループホールディングス	71,600	4,200.00	300,720,000	
キリンホールディングス	164,400	2,095.50	344,500,200	
宝ホールディングス	28,200	1,236.00	34,855,200	
オエノンホールディングス	39,000	248.00	9,672,000	
コカ・コーラウエスト	12,700	3,725.00	47,307,500	
コカ・コーライーストジャパン	14,900	2,770.00	41,273,000	
サントリー食品インターナショナル	26,400	4,715.00	124,476,000	
ダイドーグループホールディングス	1,200	5,460.00	6,552,000	
伊藤園	11,400	4,075.00	46,455,000	
キーコーヒー	9,800	2,332.00	22,853,600	
ユニカフェ	300	972.00	291,600	
ジャパンフーズ	12,100	1,447.00	17,508,700	
日清オイリオグループ	16,000	655.00	10,480,000	
不二製油グループ本社	10,000	2,679.00	26,790,000	
J - オイルミルズ	1,600	4,290.00	6,864,000	
キッコーマン	27,000	3,440.00	92,880,000	
味の素	78,700	2,271.00	178,727,700	
キューピー	19,500	3,250.00	63,375,000	
ハウス食品グループ本社	13,900	2,514.00	34,944,600	
カゴメ	13,700	2,994.00	41,017,800	

アリアケジャパン	3,000	6,890.00	20,670,000	
ニチレイ	19,200	2,823.00	54,201,600	
東洋水産	18,800	4,345.00	81,686,000	
日清食品ホールディングス	14,900	6,570.00	97,893,000	
フジッコ	7,500	2,525.00	18,937,500	
ロック・フィールド	9,500	1,922.00	18,259,000	
日本たばこ産業	211,600	3,856.00	815,929,600	
ユーグレナ	11,900	1,266.00	15,065,400	
片倉工業	9,000	1,477.00	13,293,000	
ゲンゼ	44,000	445.00	19,580,000	
東洋紡	138,000	202.00	27,876,000	
倉敷紡績	80,000	249.00	19,920,000	
日本毛織	11,100	898.00	9,967,800	
帝国繊維	7,600	1,659.00	12,608,400	
帝人	28,900	2,171.00	62,741,900	
東レ	259,000	1,001.00	259,259,000	
日本フェルト	32,100	527.00	16,916,700	
セーレン	9,100	1,650.00	15,015,000	
小松精練	23,500	740.00	17,390,000	
ワコールホールディングス	20,000	1,422.00	28,440,000	
ホギメディカル	2,200	6,880.00	15,136,000	
T S Iホールディングス	26,600	797.00	21,200,200	
三陽商会	58,000	166.00	9,628,000	
オンワードホールディングス	22,000	796.00	17,512,000	
デサント	11,600	1,363.00	15,810,800	
特種東海製紙	2,900	4,625.00	13,412,500	
王子ホールディングス	138,000	544.00	75,072,000	
日本製紙	15,700	2,111.00	33,142,700	
三菱製紙	23,300	774.00	18,034,200	
北越紀州製紙	23,300	778.00	18,127,400	
大王製紙	15,300	1,454.00	22,246,200	
レンゴー	33,000	648.00	21,384,000	
ザ・バック	5,900	3,190.00	18,821,000	
クラレ	59,700	1,725.00	102,982,500	
旭化成	223,000	1,106.50	246,749,500	
共和レザー	18,300	908.00	16,616,400	
昭和電工	24,000	1,937.00	46,488,000	
住友化学	263,000	656.00	172,528,000	
住友精化	500	4,750.00	2,375,000	
日産化学工業	19,600	3,450.00	67,620,000	
クレハ	2,100	4,980.00	10,458,000	
石原産業	9,500	1,162.00	11,039,000	
片倉コープアグリ	41,000	257.00	10,537,000	

日本曹達	14,000	650.00	9,100,000	
東ソー	105,000	1,000.00	105,000,000	
トクヤマ	55,000	547.00	30,085,000	
セントラル硝子	34,000	510.00	17,340,000	
東亜合成	22,200	1,294.00	28,726,800	
大阪ソーダ	17,000	507.00	8,619,000	
デンカ	73,000	610.00	44,530,000	
信越化学工業	64,000	9,698.00	620,672,000	
堺化学工業	13,000	415.00	5,395,000	
エア・ウォーター	29,300	2,110.00	61,823,000	
大陽日酸	28,000	1,353.00	37,884,000	
日本パーカライジング	18,300	1,413.00	25,857,900	
ステラ ケミファ	900	3,225.00	2,902,500	
日本触媒	5,700	7,850.00	44,745,000	
カネカ	48,000	879.00	42,192,000	
三菱瓦斯化学	33,400	2,440.00	81,496,000	
三井化学	165,000	570.00	94,050,000	
J S R	35,800	1,958.00	70,096,400	
東京応化工業	7,000	3,685.00	25,795,000	
三菱ケミカルホールディングス	240,400	882.70	212,201,080	
ダイセル	48,600	1,360.00	66,096,000	
住友ベークライト	31,000	684.00	21,204,000	
積水化学工業	81,600	1,964.00	160,262,400	
日本ゼオン	30,000	1,235.00	37,050,000	
アイカ工業	11,300	3,055.00	34,521,500	
宇部興産	182,000	273.00	49,686,000	
旭有機材	46,000	250.00	11,500,000	
日立化成	19,900	3,185.00	63,381,500	
群栄化学工業	300	3,685.00	1,105,500	
タイガースポリマー	18,900	742.00	14,023,800	
ミライアル	9,300	1,057.00	9,830,100	
日本化薬	23,000	1,562.00	35,926,000	
A D E K A	15,400	1,608.00	24,763,200	
日油	28,000	1,185.00	33,180,000	
ハリマ化成グループ	28,600	813.00	23,251,800	
花王	90,700	6,049.00	548,644,300	
ニイタカ	300	1,718.00	515,400	
三洋化成工業	1,300	4,685.00	6,090,500	
日本ペイントホールディングス	27,600	3,980.00	109,848,000	
関西ペイント	37,400	2,331.00	87,179,400	
中国塗料	8,100	839.00	6,795,900	
太陽ホールディングス	3,000	5,090.00	15,270,000	
D I C	14,000	4,195.00	58,730,000	

サカタインクス	8,500	1,571.00	13,353,500	
東洋インキSCホールディングス	35,000	571.00	19,985,000	
富士フィルムホールディングス	70,800	4,520.00	320,016,000	
資生堂	67,700	2,988.50	202,321,450	
ライオン	44,000	2,071.00	91,124,000	
高砂香料工業	4,400	3,590.00	15,796,000	
マンダム	3,500	5,440.00	19,040,000	
ファンケル	8,300	1,686.00	13,993,800	
コーセー	5,700	10,310.00	58,767,000	
コタ	800	1,487.00	1,189,600	
シーズ・ホールディングス	4,100	3,505.00	14,370,500	
ポーラ・オルビスホールディングス	3,600	10,780.00	38,808,000	
エステー	13,200	1,838.00	24,261,600	
長谷川香料	10,400	2,136.00	22,214,400	
小林製薬	9,700	5,500.00	53,350,000	
荒川化学工業	10,100	2,064.00	20,846,400	
メック	11,400	1,210.00	13,794,000	
アース製薬	1,700	6,010.00	10,217,000	
イハラケミカル工業	15,500	1,033.00	16,011,500	
大成ラミック	2,000	2,900.00	5,800,000	
クミアイ化学工業	11,000	653.00	7,183,000	
日本農薬	12,100	708.00	8,566,800	
日東電工	25,800	8,739.00	225,466,200	
レック	6,200	4,985.00	30,907,000	
前澤化成工業	10,400	1,202.00	12,500,800	
エフピコ	3,100	5,020.00	15,562,000	
天馬	8,800	2,126.00	18,708,800	
信越ポリマー	14,000	816.00	11,424,000	
ニフコ	6,200	5,710.00	35,402,000	
日本バルカー工業	10,000	1,953.00	19,530,000	
ユニ・チャーム	72,400	2,661.50	192,692,600	
協和発酵キリン	42,400	1,717.00	72,800,800	
武田薬品工業	133,800	5,315.00	711,147,000	
アステラス製薬	364,400	1,517.00	552,794,800	
大日本住友製薬	25,000	1,954.00	48,850,000	
塩野義製薬	45,300	5,635.00	255,265,500	
田辺三菱製薬	41,700	2,352.00	98,078,400	
あすか製薬	6,800	1,711.00	11,634,800	
日本新薬	8,200	5,860.00	48,052,000	
中外製薬	35,300	3,860.00	136,258,000	
科研製薬	6,600	6,430.00	42,438,000	
エーザイ	44,000	6,059.00	266,596,000	
ロート製薬	17,400	2,188.00	38,071,200	

小野薬品工業	81,000	2,400.00	194,400,000	
久光製薬	10,000	6,310.00	63,100,000	
持田製薬	2,400	8,740.00	20,976,000	
参天製薬	65,300	1,678.00	109,573,400	
ツムラ	11,800	3,485.00	41,123,000	
日医工	8,300	1,688.00	14,010,400	
キッセイ薬品工業	6,100	3,055.00	18,635,500	
生化学工業	8,100	1,913.00	15,495,300	
鳥居薬品	6,700	2,956.00	19,805,200	
JCRファーマ	2,200	2,540.00	5,588,000	
東和薬品	1,100	5,460.00	6,006,000	
沢井製薬	6,000	6,100.00	36,600,000	
ゼリア新薬工業	8,400	1,801.00	15,128,400	
第一三共	105,100	2,602.50	273,522,750	
キョーリン製薬ホールディングス	9,100	2,439.00	22,194,900	
大幸薬品	1,200	1,886.00	2,263,200	
大塚ホールディングス	76,800	5,113.00	392,678,400	
大正製薬ホールディングス	7,700	9,080.00	69,916,000	
ペプチドリーム	6,500	5,360.00	34,840,000	
昭和シェル石油	31,600	1,131.00	35,739,600	
ニチレキ	15,900	932.00	14,818,800	
東燃ゼネラル石油	58,000	1,346.00	78,068,000	
出光興産	16,900	3,855.00	65,149,500	
JXホールディングス	395,600	538.80	213,149,280	
コスモエネルギーホールディングス	12,100	1,956.00	23,667,600	
横浜ゴム	21,700	2,315.00	50,235,500	
東洋ゴム工業	19,000	1,948.00	37,012,000	
ブリヂストン	120,400	4,613.00	555,405,200	
住友ゴム工業	33,600	1,925.00	64,680,000	
オカモト	7,000	1,119.00	7,833,000	
ニッタ	4,900	3,290.00	16,121,000	
住友理工	13,600	1,198.00	16,292,800	
三ツ星ベルト	4,000	1,092.00	4,368,000	
バンドー化学	11,400	1,039.00	11,844,600	
日東紡績	30,000	546.00	16,380,000	
旭硝子	175,000	931.00	162,925,000	
日本山村硝子	48,000	204.00	9,792,000	
日本電気硝子	73,000	710.00	51,830,000	
住友大阪セメント	64,000	476.00	30,464,000	
太平洋セメント	215,000	395.00	84,925,000	
日本ヒューム	14,400	704.00	10,137,600	
東海カーボン	32,800	497.00	16,301,600	
東洋炭素	4,300	1,890.00	8,127,000	

ノリタケカンパニーリミテド	1,100	2,978.00	3,275,800	
TOTO	26,100	4,435.00	115,753,500	
日本碍子	44,600	2,509.00	111,901,400	
日本特殊陶業	30,700	2,642.00	81,109,400	
ニチアス	19,000	1,121.00	21,299,000	
ニチハ	6,900	3,355.00	23,149,500	
新日鐵住金	161,000	2,653.50	427,213,500	
神戸製鋼所	63,200	1,060.00	66,992,000	
合同製鐵	3,100	1,813.00	5,620,300	
ジェイ エフ イー ホールディングス	97,600	1,990.00	194,224,000	
日新製鋼	15,500	1,481.00	22,955,500	
東京製鐵	18,500	953.00	17,630,500	
共英製鋼	5,000	2,102.00	10,510,000	
大和工業	6,800	3,085.00	20,978,000	
大阪製鐵	6,600	2,138.00	14,110,800	
淀川製鋼所	4,800	3,200.00	15,360,000	
東洋鋼鈑	40,300	439.00	17,691,700	
丸一鋼管	11,700	3,410.00	39,897,000	
モリ工業	600	2,290.00	1,374,000	
大同特殊鋼	59,000	531.00	31,329,000	
山陽特殊製鋼	14,000	620.00	8,680,000	
愛知製鋼	1,200	4,705.00	5,646,000	
日立金属	35,800	1,588.00	56,850,400	
大平洋金属	28,000	408.00	11,424,000	
新日本電工	33,800	333.00	11,255,400	
三菱製鋼	51,000	252.00	12,852,000	
シンニッタン	25,600	712.00	18,227,200	
日本軽金属ホールディングス	86,600	258.00	22,342,800	
三井金属鉱業	94,000	388.00	36,472,000	
東邦亜鉛	19,000	583.00	11,077,000	
三菱マテリアル	22,500	3,570.00	80,325,000	
住友金属鉱山	92,000	1,603.50	147,522,000	
DOWAホールディングス	38,000	854.00	32,452,000	
古河機械金属	45,000	224.00	10,080,000	
UACJ	45,000	289.00	13,005,000	
古河電気工業	11,700	4,265.00	49,900,500	
住友電気工業	134,400	1,887.50	253,680,000	
フジクラ	46,700	812.00	37,920,400	
タツタ電線	28,000	503.00	14,084,000	
リョービ	27,000	499.00	13,473,000	
アサヒホールディングス	11,700	1,986.00	23,236,200	
トーカロ	4,000	2,686.00	10,744,000	
SUMCO	37,500	1,690.00	63,375,000	

東洋製罐グループホールディングス	25,200	1,921.00	48,409,200	
ホッカンホールディングス	2,000	535.00	1,070,000	
コロナ	14,200	1,189.00	16,883,800	
横河ブリッジホールディングス	11,600	1,357.00	15,741,200	
駒井ハルテック	4,300	2,322.00	9,984,600	
三和ホールディングス	34,600	1,080.00	37,368,000	
文化シャッター	11,900	844.00	10,043,600	
三協立山	8,500	1,729.00	14,696,500	
LIXILグループ	49,400	2,954.00	145,927,600	
ノーリツ	6,500	2,135.00	13,877,500	
長府製作所	5,800	2,776.00	16,100,800	
リンナイ	6,100	9,530.00	58,133,000	
日東精工	32,300	484.00	15,633,200	
東プレ	6,900	2,990.00	20,631,000	
高周波熱錬	19,700	935.00	18,419,500	
パイオラックス	1,200	7,950.00	9,540,000	
日本発條	35,200	1,303.00	45,865,600	
三益半導体工業	10,500	1,693.00	17,776,500	
日本製鋼所	11,700	1,907.00	22,311,900	
三浦工業	15,300	1,824.00	27,907,200	
タクマ	7,000	1,050.00	7,350,000	
ツガミ	2,000	753.00	1,506,000	
オークマ	23,000	1,342.00	30,866,000	
東芝機械	34,000	490.00	16,660,000	
アマダホールディングス	48,200	1,295.00	62,419,000	
アイダエンジニアリング	9,300	1,100.00	10,230,000	
富士機械製造	12,400	1,503.00	18,637,200	
牧野フライス製作所	17,000	1,066.00	18,122,000	
オーエスジー	16,300	2,432.00	39,641,600	
旭ダイヤモンド工業	9,600	888.00	8,524,800	
D M G 森精機	21,300	1,853.00	39,468,900	
ディスコ	4,100	16,900.00	69,290,000	
日東工器	6,900	2,618.00	18,064,200	
島精機製作所	4,700	4,320.00	20,304,000	
N C ホールディングス	700	928.00	649,600	
日阪製作所	20,400	962.00	19,624,800	
ナブテスコ	18,600	3,140.00	58,404,000	
S M C	10,700	33,270.00	355,989,000	
新川	20,600	786.00	16,191,600	
ユニオンツール	3,500	3,605.00	12,617,500	
オイレス工業	4,100	2,159.00	8,851,900	
サトーホールディングス	5,700	2,461.00	14,027,700	
小松製作所	164,700	3,009.00	495,582,300	



住友重機械工業	104,000	849.00	88,296,000	
日立建機	15,900	2,902.00	46,141,800	
巴工業	6,500	1,837.00	11,940,500	
井関農機	57,000	240.00	13,680,000	
タカキタ	700	560.00	392,000	
クボタ	171,000	1,769.00	302,499,000	
月島機械	11,800	1,212.00	14,301,600	
帝国電機製作所	15,100	1,124.00	16,972,400	
新東工業	14,200	1,020.00	14,484,000	
小森コーポレーション	7,900	1,529.00	12,079,100	
鶴見製作所	900	1,613.00	1,451,700	
住友精密工業	10,000	368.00	3,680,000	
荏原製作所	16,200	3,580.00	57,996,000	
西島製作所	18,300	1,124.00	20,569,200	
ダイキン工業	46,600	11,095.00	517,027,000	
栗田工業	20,600	2,789.00	57,453,400	
椿本チエイン	20,000	1,018.00	20,360,000	
ダイフク	17,400	2,876.00	50,042,400	
タダノ	17,700	1,460.00	25,842,000	
フジテック	10,300	1,300.00	13,390,000	
C K D	12,300	1,409.00	17,330,700	
平和	10,500	3,030.00	31,815,000	
SANKYO	9,500	3,935.00	37,382,500	
日本金銭機械	8,600	1,522.00	13,089,200	
福島工業	5,800	3,980.00	23,084,000	
竹内製作所	6,600	2,276.00	15,021,600	
アマノ	10,600	2,280.00	24,168,000	
サンデンホールディングス	25,000	368.00	9,200,000	
グローリー	10,800	3,950.00	42,660,000	
大和冷機工業	18,600	1,144.00	21,278,400	
セガサミーホールディングス	34,300	1,653.00	56,697,900	
リケン	1,600	5,270.00	8,432,000	
ホシザキ	7,500	9,130.00	68,475,000	
大豊工業	11,400	1,613.00	18,388,200	
日本精工	71,500	1,704.00	121,836,000	
NTN	79,000	602.00	47,558,000	
ジェイテクト	36,900	1,876.00	69,224,400	
不二越	34,000	611.00	20,774,000	
日本トムソン	26,500	605.00	16,032,500	
THK	24,400	3,015.00	73,566,000	
ユーシン精機	1,900	3,110.00	5,909,000	
キッツ	18,600	780.00	14,508,000	
マキタ	22,200	7,740.00	171,828,000	

日立造船	30,700	662.00	20,323,400	
三菱重工業	571,000	479.10	273,566,100	
I H I	262,000	358.00	93,796,000	
スター精密	5,800	1,758.00	10,196,400	
日清紡ホールディングス	18,800	1,183.00	22,240,400	
イビデン	23,400	1,795.00	42,003,000	
コニカミノルタ	80,700	1,075.00	86,752,500	
ブラザー工業	43,900	2,400.00	105,360,000	
ミネベアミツミ	62,900	1,576.00	99,130,400	
日立製作所	818,000	627.90	513,622,200	
東芝	760,000	196.50	149,340,000	
三菱電機	363,500	1,688.50	613,769,750	
富士電機	101,000	647.00	65,347,000	
東洋電機製造	4,400	1,768.00	7,779,200	
安川電機	39,200	2,289.00	89,728,800	
明電舎	20,000	406.00	8,120,000	
山洋電気	2,000	866.00	1,732,000	
東芝テック	23,000	641.00	14,743,000	
マブチモーター	9,400	6,440.00	60,536,000	
日本電産	44,200	10,735.00	474,487,000	
東光高岳	6,400	2,135.00	13,664,000	
ダブル・スコープ	3,600	1,645.00	5,922,000	
ダイヘン	14,000	765.00	10,710,000	
日新電機	9,000	1,262.00	11,358,000	
オムロン	36,300	5,040.00	182,952,000	
日東工業	4,900	1,634.00	8,006,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	65,000	533.00	34,645,000	
メルコホールディングス	3,500	3,420.00	11,970,000	
テクノメディカ	500	2,309.00	1,154,500	
日本電気	465,000	287.00	133,455,000	
富士通	328,000	674.70	221,301,600	
沖電気工業	14,100	1,710.00	24,111,000	
サンケン電気	11,000	491.00	5,401,000	
アイホン	7,900	1,843.00	14,559,700	
ルネサスエレクトロニクス	18,600	1,094.00	20,348,400	
セイコーエプソン	50,700	2,519.00	127,713,300	
ワコム	50,700	433.00	21,953,100	
アルバック	5,700	5,380.00	30,666,000	
E I Z O	6,100	3,385.00	20,648,500	
ジャパンディスプレイ	68,600	266.00	18,247,600	
日本信号	18,600	1,046.00	19,455,600	
能美防災	9,300	1,547.00	14,387,100	
ホーチキ	6,800	1,440.00	9,792,000	

パナソニック	389,600	1,245.00	485,052,000	
アンリツ	26,800	908.00	24,334,400	
富士通ゼネラル	11,000	2,258.00	24,838,000	
日立国際電気	8,300	2,546.00	21,131,800	
ソニー	240,800	3,627.00	873,381,600	
T D K	19,100	7,340.00	140,194,000	
タムラ製作所	5,000	485.00	2,425,000	
アルプス電気	31,400	3,440.00	108,016,000	
パイオニア	56,500	237.00	13,390,500	
日本電波工業	7,500	831.00	6,232,500	
日本トリム	1,200	3,985.00	4,782,000	
フォスター電機	7,900	1,905.00	15,049,500	
ヨコオ	18,700	1,536.00	28,723,200	
ホシデン	10,700	1,099.00	11,759,300	
ヒロセ電機	5,500	16,000.00	88,000,000	
日本航空電子工業	8,000	1,511.00	12,088,000	
アルパイン	8,500	1,670.00	14,195,000	
アイコム	4,800	2,553.00	12,254,400	
船井電機	13,400	990.00	13,266,000	
横河電機	36,600	1,821.00	66,648,600	
アズビル	10,800	3,835.00	41,418,000	
日本光電工業	14,400	2,583.00	37,195,200	
堀場製作所	6,600	6,350.00	41,910,000	
アドバンテスト	22,900	1,946.00	44,563,400	
キーエンス	15,500	45,190.00	700,445,000	
日置電機	7,000	2,360.00	16,520,000	
シスメックス	26,400	6,800.00	179,520,000	
O B A R A G R O U P	1,800	5,100.00	9,180,000	
コーセル	9,500	1,438.00	13,661,000	
オプテックスグループ	3,900	3,230.00	12,597,000	
千代田インテグレ	4,700	2,456.00	11,543,200	
スタンレー電気	24,200	3,250.00	78,650,000	
ウシオ電機	20,000	1,476.00	29,520,000	
日本セラミック	2,700	2,510.00	6,777,000	
双信電機	33,000	308.00	10,164,000	
図研	10,500	1,350.00	14,175,000	
日本電子	3,000	585.00	1,755,000	
カシオ計算機	27,900	1,636.00	45,644,400	
ファナック	34,600	23,005.00	795,973,000	
エンプラス	600	3,205.00	1,923,000	
ローム	16,600	7,500.00	124,500,000	
浜松ホトニクス	26,800	3,345.00	89,646,000	
三井ハイテック	18,600	1,160.00	21,576,000	

新光電気工業	12,800	784.00	10,035,200	
京セラ	56,000	6,338.00	354,928,000	
太陽誘電	17,100	1,461.00	24,983,100	
村田製作所	35,800	15,930.00	570,294,000	
双葉電子工業	8,500	2,105.00	17,892,500	
ニチコン	10,900	1,136.00	12,382,400	
日本ケミコン	48,000	384.00	18,432,000	
K O A	10,400	1,527.00	15,880,800	
小糸製作所	20,600	5,880.00	121,128,000	
ミツバ	7,500	2,167.00	16,252,500	
S C R E E Nホールディングス	6,900	7,750.00	53,475,000	
キヤノン電子	9,600	1,816.00	17,433,600	
キヤノン	183,700	3,535.00	649,379,500	
リコー	101,600	982.00	99,771,200	
東京エレクトロン	22,700	11,610.00	263,547,000	
トヨタ紡織	12,100	2,656.00	32,137,600	
ユニプレス	7,100	2,432.00	17,267,200	
豊田自動織機	31,200	5,730.00	178,776,000	
モリタホールディングス	7,900	1,734.00	13,698,600	
デンソー	84,100	5,218.00	438,833,800	
東海理化電機製作所	9,300	2,338.00	21,743,400	
三井造船	129,000	185.00	23,865,000	
川崎重工業	262,000	357.00	93,534,000	
日本車輛製造	35,000	315.00	11,025,000	
近畿車輛	3,500	2,532.00	8,862,000	
日産自動車	402,200	1,138.00	457,703,600	
いすゞ自動車	97,700	1,573.50	153,730,950	
トヨタ自動車	414,700	6,373.00	2,642,883,100	250,000株
日野自動車	47,800	1,414.00	67,589,200	
三菱自動車工業	126,300	703.00	88,788,900	
武蔵精密工業	4,900	2,987.00	14,636,300	
日産車体	16,400	1,095.00	17,958,000	
新明和工業	14,000	1,177.00	16,478,000	
極東開発工業	11,900	1,937.00	23,050,300	
日信工業	8,200	2,055.00	16,851,000	
トピー工業	6,700	3,080.00	20,636,000	
ティラド	54,000	347.00	18,738,000	
曙ブレーキ工業	24,100	381.00	9,182,100	
N O K	16,300	2,662.00	43,390,600	
フタバ産業	31,300	829.00	25,947,700	
K Y B	38,000	608.00	23,104,000	
プレス工業	33,800	576.00	19,468,800	
ケーヒン	8,400	1,883.00	15,817,200	

アイシン精機	31,200	5,580.00	174,096,000	
マツダ	107,700	1,622.50	174,743,250	
今仙電機製作所	12,900	1,028.00	13,261,200	
本田技研工業	306,700	3,542.00	1,086,331,400	
スズキ	67,500	4,781.00	322,717,500	
富士重工業	105,900	4,312.00	456,640,800	
ヤマハ発動機	47,900	2,714.00	130,000,600	
ショーワ	12,600	984.00	12,398,400	
エクセディ	4,700	3,350.00	15,745,000	
豊田合成	11,100	2,987.00	33,155,700	
愛三工業	15,200	994.00	15,108,800	
ヨロズ	5,400	1,799.00	9,714,600	
エフ・シー・シー	5,400	2,311.00	12,479,400	
シマノ	13,700	17,220.00	235,914,000	
テイ・エス テック	7,900	3,075.00	24,292,500	
テルモ	52,300	3,975.00	207,892,500	
クリエートメディック	16,700	970.00	16,199,000	
日機装	12,700	1,236.00	15,697,200	
島津製作所	44,200	1,823.00	80,576,600	
クボテック	1,700	554.00	941,800	
東京精密	6,300	3,600.00	22,680,000	
ニコン	59,000	1,684.00	99,356,000	
トプコン	16,800	2,150.00	36,120,000	
オリンパス	54,700	4,330.00	236,851,000	
理研計器	13,300	1,705.00	22,676,500	
タムロン	3,800	2,081.00	7,907,800	
HOYA	70,200	5,481.00	384,766,200	
シチズン時計	39,300	778.00	30,575,400	
松風	400	1,365.00	546,000	
セイコーホールディングス	18,000	506.00	9,108,000	
ニプロ	25,200	1,640.00	41,328,000	
スノーピーク	300	3,075.00	922,500	
パラマウントベッドホールディングス	3,100	4,595.00	14,244,500	
バンダイナムコホールディングス	37,400	3,530.00	132,022,000	
アイフィスジャパン	4,200	431.00	1,810,200	
パイロットコーポレーション	5,700	4,665.00	26,590,500	
トッパン・フォームズ	16,200	1,121.00	18,160,200	
フジシールインターナショナル	7,400	2,421.00	17,915,400	
タカラトミー	12,700	1,167.00	14,820,900	
タカノ	20,700	1,007.00	20,844,900	
プロネクサス	500	1,310.00	655,000	
大建工業	4,100	2,142.00	8,782,200	
凸版印刷	96,000	1,192.00	114,432,000	

大日本印刷	99,000	1,242.00	122,958,000	
日本写真印刷	5,300	3,035.00	16,085,500	
アシックス	34,300	1,882.00	64,552,600	
小松ウオール工業	4,500	1,936.00	8,712,000	
ヤマハ	23,100	3,235.00	74,728,500	
クリナップ	16,100	874.00	14,071,400	
ビジョン	20,500	3,675.00	75,337,500	
キングジム	21,000	874.00	18,354,000	
リンテック	8,000	2,489.00	19,912,000	
T A S A K I	4,800	1,586.00	7,612,800	
イトーキ	22,700	728.00	16,525,600	
任天堂	21,000	26,265.00	551,565,000	
三菱鉛筆	2,600	5,670.00	14,742,000	
タカラスタANDARD	4,800	1,860.00	8,928,000	
コクヨ	18,100	1,486.00	26,896,600	
岡村製作所	12,500	1,033.00	12,912,500	
美津濃	11,000	611.00	6,721,000	
東京電力ホールディングス	290,800	417.00	121,263,600	
中部電力	111,400	1,483.50	165,261,900	
関西電力	139,500	1,230.50	171,654,750	
中国電力	47,300	1,257.00	59,456,100	
北陸電力	32,500	1,090.00	35,425,000	
東北電力	84,400	1,466.00	123,730,400	
四国電力	30,200	1,150.00	34,730,000	
九州電力	74,900	1,177.00	88,157,300	
北海道電力	31,200	801.00	24,991,200	
沖縄電力	6,100	2,580.00	15,738,000	
電源開発	27,000	2,607.00	70,389,000	
東京瓦斯	366,000	513.40	187,904,400	
大阪瓦斯	330,000	434.10	143,253,000	
東邦瓦斯	86,000	793.00	68,198,000	
北海道瓦斯	35,000	280.00	9,800,000	
西部瓦斯	65,000	258.00	16,770,000	
静岡ガス	14,700	742.00	10,907,400	
東武鉄道	183,000	587.00	107,421,000	
相鉄ホールディングス	54,000	536.00	28,944,000	
東京急行電鉄	185,000	820.00	151,700,000	
京浜急行電鉄	93,000	1,274.00	118,482,000	
小田急電鉄	54,400	2,228.00	121,203,200	
京王電鉄	95,000	914.00	86,830,000	
京成電鉄	25,500	2,647.00	67,498,500	
富士急行	5,000	1,036.00	5,180,000	
東日本旅客鉄道	66,000	9,913.00	654,258,000	

西日本旅客鉄道	32,900	7,427.00	244,348,300	
東海旅客鉄道	28,300	18,545.00	524,823,500	
西武ホールディングス	46,900	1,914.00	89,766,600	
西日本鉄道	40,000	500.00	20,000,000	
近鉄グループホールディングス	343,000	419.00	143,717,000	
阪急阪神ホールディングス	43,100	3,770.00	162,487,000	
南海電気鉄道	72,000	568.00	40,896,000	
京阪ホールディングス	77,000	710.00	54,670,000	
名古屋鉄道	124,000	519.00	64,356,000	
日本通運	132,000	609.00	80,388,000	
ヤマトホールディングス	60,700	2,437.50	147,956,250	
山九	45,000	730.00	32,850,000	
丸運	27,800	260.00	7,228,000	
センコー	27,400	762.00	20,878,800	
トナミホールディングス	24,000	421.00	10,104,000	
ニッコンホールディングス	11,500	2,512.00	28,888,000	
日本石油輸送	2,000	2,605.00	5,210,000	
福山通運	14,000	721.00	10,094,000	
セイノーホールディングス	24,500	1,310.00	32,095,000	
日立物流	7,000	2,448.00	17,136,000	
C & F ロジホールディングス	11,700	1,555.00	18,193,500	
九州旅客鉄道	25,500	3,700.00	94,350,000	
日本郵船	290,000	258.00	74,820,000	
商船三井	178,000	374.00	66,572,000	
川崎汽船	128,000	313.00	40,064,000	
飯野海運	24,100	515.00	12,411,500	
日本航空	61,500	3,701.00	227,611,500	
A N A ホールディングス	632,000	351.50	222,148,000	
三菱倉庫	22,000	1,644.00	36,168,000	
三井倉庫ホールディングス	32,000	341.00	10,912,000	
住友倉庫	23,000	664.00	15,272,000	
東陽倉庫	58,800	312.00	18,345,600	
安田倉庫	10,200	791.00	8,068,200	
上組	41,000	1,037.00	42,517,000	
キムラユニティー	7,700	1,196.00	9,209,200	
キューソー流通システム	2,700	2,751.00	7,427,700	
郵船ロジスティクス	12,200	1,188.00	14,493,600	
近鉄エクスプレス	7,900	1,764.00	13,935,600	
エーアイティー	1,300	1,016.00	1,320,800	
NEC ネットエスアイ	7,400	2,223.00	16,450,200	
新日鉄住金ソリューションズ	7,600	2,396.00	18,209,600	
T I S	11,100	2,953.00	32,778,300	
ネオス	9,700	471.00	4,568,700	

電算システム	1,200	1,651.00	1,981,200	
グリー	22,300	741.00	16,524,300	
コーエーテクモホールディングス	7,400	2,321.00	17,175,400	
ヒト・コミュニケーションズ	2,200	1,880.00	4,136,000	
ブレインパッド	6,800	1,112.00	7,561,600	
K L a b	6,700	1,034.00	6,927,800	
ネクソン	36,700	1,776.00	65,179,200	
エムアップ	4,800	894.00	4,291,200	
エイチーム	4,300	2,637.00	11,339,100	
e n i s h	6,800	622.00	4,229,600	
コロプラ	9,100	1,106.00	10,064,600	
サイバーリンクス	3,900	1,023.00	3,989,700	
VOYAGE GROUP	4,800	1,783.00	8,558,400	
ベリサーブ	1,800	2,841.00	5,113,800	
ティーガイア	8,800	2,016.00	17,740,800	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	75,000	251.00	18,825,000	
GMOペイメントゲートウェイ	2,800	5,660.00	15,848,000	
ザッパラス	27,200	521.00	14,171,200	
インターネットイニシアティブ	8,700	2,027.00	17,634,900	
L I N E	5,400	4,175.00	22,545,000	
フェイス	400	1,310.00	524,000	
野村総合研究所	24,900	4,150.00	103,335,000	
C Eホールディングス	400	1,118.00	447,200	
インテージホールディングス	1,300	2,120.00	2,756,000	
フジ・メディア・ホールディングス	35,300	1,580.00	55,774,000	
オービック	11,600	5,390.00	62,524,000	
ヤフー	240,400	541.00	130,056,400	
トレンドマイクロ	17,600	4,865.00	85,624,000	
日本オラクル	5,300	6,620.00	35,086,000	
アルファシステムズ	700	2,009.00	1,406,300	
フューチャー	21,200	884.00	18,740,800	
C A C Holdings	12,600	1,114.00	14,036,400	
ソフトバンク・テクノロジー	3,600	3,905.00	14,058,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,400	3,275.00	24,235,000	
大塚商会	8,800	5,900.00	51,920,000	
サイボウズ	43,300	442.00	19,138,600	
電通国際情報サービス	9,200	2,482.00	22,834,400	
ウェザーニューズ	1,200	3,735.00	4,482,000	
日本エンタープライズ	19,500	273.00	5,323,500	
ネットワンシステムズ	16,800	960.00	16,128,000	
アルゴグラフィックス	5,800	2,497.00	14,482,600	
エイベックス・グループ・ホールディングス	12,300	1,658.00	20,393,400	
日本ユニシス	10,300	1,569.00	16,160,700	



兼松エレクトロニクス	7,200	2,826.00	20,347,200	
東京放送ホールディングス	21,900	2,036.00	44,588,400	
日本テレビホールディングス	30,700	1,982.00	60,847,400	
テレビ朝日ホールディングス	9,000	2,253.00	20,277,000	
スカパーJ S A Tホールディングス	30,500	493.00	15,036,500	
テレビ東京ホールディングス	7,200	2,635.00	18,972,000	
日本通信	45,800	200.00	9,160,000	
日本電信電話	270,100	4,946.00	1,335,914,600	
K D D I	332,700	3,040.00	1,011,408,000	
光通信	4,100	11,200.00	45,920,000	
N T T ドコモ	251,500	2,700.50	679,175,750	
G M O インターネット	11,900	1,338.00	15,922,200	
カドカワ	10,300	1,655.00	17,046,500	
ゼンリン	8,700	2,285.00	19,879,500	
松竹	21,000	1,310.00	27,510,000	
東宝	21,900	3,085.00	67,561,500	
東映	8,000	993.00	7,944,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	20,500	5,330.00	109,265,000	
ビジネスブレイン太田昭和	1,700	1,046.00	1,778,200	
D T S	7,400	2,853.00	21,112,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	12,900	3,510.00	45,279,000	
カプコン	7,800	2,404.00	18,751,200	
S C S K	9,100	4,430.00	40,313,000	
アイネス	13,200	1,134.00	14,968,800	
T K C	5,100	3,270.00	16,677,000	
富士ソフト	5,100	2,927.00	14,927,700	
N S D	7,300	1,688.00	12,322,400	
コナミホールディングス	15,400	5,050.00	77,770,000	
ソフトバンクグループ	151,600	8,274.00	1,254,338,400	
伊藤忠食品	1,000	4,825.00	4,825,000	
エレマテック	3,400	2,002.00	6,806,800	
J A L U X	2,000	2,721.00	5,442,000	
双日	202,700	292.00	59,188,400	
アルフレッサ ホールディングス	39,500	1,960.00	77,420,000	
横浜冷凍	17,900	1,140.00	20,406,000	
あい ホールディングス	5,800	2,679.00	15,538,200	
マクニカ・富士エレホールディングス	14,500	1,661.00	24,084,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	12,600	1,057.00	13,318,200	
U K C ホールディングス	6,200	2,130.00	13,206,000	
O C H I ホールディングス	700	1,464.00	1,024,800	
T O K A I ホールディングス	16,100	883.00	14,216,300	
シップヘルスケアホールディングス	6,300	3,150.00	19,845,000	
明治電機工業	400	1,308.00	523,200	

エコートレーディング	13,600	666.00	9,057,600	
ナガイレーベン	6,800	2,365.00	16,082,000	
三菱食品	5,100	3,575.00	18,232,500	
松田産業	13,400	1,579.00	21,158,600	
第一興商	5,400	4,675.00	25,245,000	
メディopalホールディングス	34,200	1,766.00	60,397,200	
アズワン	1,600	5,030.00	8,048,000	
尾家産業	300	1,256.00	376,800	
ドウシシャ	6,700	2,093.00	14,023,100	
黒田電気	9,700	2,558.00	24,812,600	
丸文	18,500	734.00	13,579,000	
橋本総業ホールディングス	800	1,499.00	1,199,200	
I D O M	20,900	726.00	15,173,400	
進和	6,500	1,970.00	12,805,000	
オーハシテクニカ	12,000	1,432.00	17,184,000	
白銅	8,900	1,805.00	16,064,500	
伊藤忠商事	246,300	1,660.00	408,858,000	
丸紅	331,000	721.10	238,684,100	
長瀬産業	20,800	1,596.00	33,196,800	
豊田通商	37,800	3,410.00	128,898,000	
兼松	104,000	201.00	20,904,000	
三井物産	304,200	1,679.00	510,751,800	
日本紙パルプ商事	30,000	394.00	11,820,000	
日立ハイテクノロジーズ	11,600	4,740.00	54,984,000	
山善	19,600	1,054.00	20,658,400	
住友商事	211,700	1,510.50	319,772,850	
内田洋行	2,000	2,637.00	5,274,000	
三菱商事	252,300	2,491.00	628,479,300	
キャノンマーケティングジャパン	9,400	2,250.00	21,150,000	
西華産業	36,000	376.00	13,536,000	
菱洋エレクトロ	13,200	1,769.00	23,350,800	
東京産業	37,500	480.00	18,000,000	
阪和興業	33,000	837.00	27,621,000	
フルサト工業	200	1,814.00	362,800	
岩谷産業	38,000	668.00	25,384,000	
イワキ	65,000	301.00	19,565,000	
三愛石油	16,200	981.00	15,892,200	
稲畑産業	14,900	1,479.00	22,037,100	
ワキタ	7,100	1,097.00	7,788,700	
東邦ホールディングス	10,700	2,425.00	25,947,500	
サンゲツ	12,400	1,961.00	24,316,400	
シナネンホールディングス	2,500	2,310.00	5,775,000	
伊藤忠エネクス	16,700	953.00	15,915,100	

サンリオ	10,200	2,190.00	22,338,000	
リョーサン	4,700	3,615.00	16,990,500	
新光商事	500	1,308.00	654,000	
三信電気	1,900	1,427.00	2,711,300	
モスフードサービス	3,900	3,390.00	13,221,000	
加賀電子	9,400	2,037.00	19,147,800	
立花エレテック	12,000	1,383.00	16,596,000	
フォーバル	1,200	690.00	828,000	
PALTA C	5,100	3,225.00	16,447,500	
日鉄住金物産	2,000	4,720.00	9,440,000	
トラスコ中山	7,500	2,560.00	19,200,000	
オートバックスセブン	12,900	1,723.00	22,226,700	
加藤産業	5,600	2,998.00	16,788,800	
イノテック	26,900	685.00	18,426,500	
杉本商事	8,500	1,611.00	13,693,500	
因幡電機産業	4,800	4,200.00	20,160,000	
ミスミグループ本社	38,400	2,015.00	77,376,000	
スズケン	15,300	3,685.00	56,380,500	
ジェコス	9,900	1,125.00	11,137,500	
ローソン	10,800	7,670.00	82,836,000	
サンエー	2,000	5,100.00	10,200,000	
エービーシー・マート	6,000	6,780.00	40,680,000	
ハードオフコーポレーション	5,500	1,179.00	6,484,500	
アスクル	4,000	3,210.00	12,840,000	
ゲオホールディングス	9,100	1,311.00	11,930,100	
アダストリア	4,700	2,965.00	13,935,500	
ジーフット	1,200	765.00	918,000	
エディオン	23,700	1,078.00	25,548,600	
ハローズ	800	2,294.00	1,835,200	
あみやき亭	1,600	4,430.00	7,088,000	
ハニーズホールディングス	10,400	1,144.00	11,897,600	
ジェイアイエヌ	2,200	6,010.00	13,222,000	
ビックカメラ	19,100	1,091.00	20,838,100	
DCMホールディングス	20,100	1,034.00	20,783,400	
MonotaRO	11,900	3,320.00	39,508,000	
J.フロント リテイリング	42,200	1,792.00	75,622,400	
ドトール・日レスホールディングス	9,900	2,257.00	22,344,300	
マツモトキヨシホールディングス	6,400	5,500.00	35,200,000	
スタートトゥデイ	30,500	2,330.00	71,065,000	
ココカラファイン	3,400	4,840.00	16,456,000	
三越伊勢丹ホールディングス	66,500	1,320.00	87,780,000	
ウエルシアホールディングス	6,600	3,305.00	21,813,000	
クリエイトSDホールディングス	4,500	2,733.00	12,298,500	

シュッピン	1,700	1,756.00	2,985,200	
ジョイフル本田	5,200	3,735.00	19,422,000	
すかいらーく	14,600	1,779.00	25,973,400	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	17,800	1,041.00	18,529,800	
ブックオフコーポレーション	11,600	814.00	9,442,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	815.00	3,667,500	
あさひ	7,100	1,330.00	9,443,000	
コスモス薬品	1,700	22,170.00	37,689,000	
トーエル	1,600	948.00	1,516,800	
セブン&アイ・ホールディングス	140,800	4,421.00	622,476,800	
ツルハホールディングス	7,800	10,830.00	84,474,000	
サンマルクホールディングス	4,400	3,455.00	15,202,000	
トリドールホールディングス	4,000	2,404.00	9,616,000	
クスリのアオキホールディングス	3,000	5,190.00	15,570,000	
総合メディカル	800	4,230.00	3,384,000	
カップ・クリエイト	7,300	1,306.00	9,533,800	
ライトオン	9,900	1,008.00	9,979,200	
良品計画	4,400	24,390.00	107,316,000	
三城ホールディングス	29,700	491.00	14,582,700	
アドヴァン	16,400	1,208.00	19,811,200	
G - 7ホールディングス	800	2,578.00	2,062,400	
エコス	100	1,208.00	120,800	
マルシェ	2,000	847.00	1,694,000	
ドンキホーテホールディングス	22,100	3,940.00	87,074,000	
西松屋チェーン	8,200	1,296.00	10,627,200	
ゼンショーホールディングス	17,300	1,947.00	33,683,100	
サイゼリヤ	5,300	2,853.00	15,120,900	
魚力	200	1,331.00	266,200	
ユナイテッドアローズ	4,100	3,390.00	13,899,000	
ハイデイ日高	3,200	2,462.00	7,878,400	
京都きもの友禅	14,300	1,010.00	14,443,000	
コロワイド	11,200	1,945.00	21,784,000	
壱番屋	3,700	3,860.00	14,282,000	
スギホールディングス	7,300	5,260.00	38,398,000	
スクロール	27,800	366.00	10,174,800	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	14,700	6,820.00	100,254,000	
木曽路	7,500	2,594.00	19,455,000	
千趣会	22,100	829.00	18,320,900	
ケーヨー	24,200	584.00	14,132,800	
上新電機	4,000	1,161.00	4,644,000	
日本瓦斯	6,200	3,235.00	20,057,000	
ロイヤルホールディングス	7,800	2,275.00	17,745,000	
いなげや	800	1,602.00	1,281,600	

島忠	8,500	2,827.00	24,029,500	
チヨダ	6,000	2,755.00	16,530,000	
ライフコーポレーション	2,900	3,285.00	9,526,500	
A O K Iホールディングス	13,400	1,380.00	18,492,000	
コメリ	5,300	2,881.00	15,269,300	
青山商事	7,100	4,255.00	30,210,500	
しまむら	3,900	15,170.00	59,163,000	
高島屋	55,000	1,026.00	56,430,000	
松屋	13,500	1,053.00	14,215,500	
エイチ・ツー・オー リテイリング	18,000	1,907.00	34,326,000	
パルコ	10,600	1,267.00	13,430,200	
丸井グループ	35,400	1,600.00	56,640,000	
アクシアル リテイリング	1,200	4,425.00	5,310,000	
イオン	138,300	1,636.50	226,327,950	
イズミ	6,600	5,160.00	34,056,000	
平和堂	7,000	2,802.00	19,614,000	
フジ	6,000	2,442.00	14,652,000	
ヤオコー	3,600	4,455.00	16,038,000	
ゼビオホールディングス	7,900	1,814.00	14,330,600	
ケーズホールディングス	15,300	2,071.00	31,686,300	
アインホールディングス	4,200	7,820.00	32,844,000	
ヤマダ電機	112,200	584.00	65,524,800	
ニトリホールディングス	14,500	13,480.00	195,460,000	
吉野家ホールディングス	12,400	1,646.00	20,410,400	
王将フードサービス	3,100	4,365.00	13,531,500	
プレナス	5,200	2,592.00	13,478,400	
アークス	6,100	2,653.00	16,183,300	
パローホールディングス	7,100	2,736.00	19,425,600	
ファーストリテイリング	5,600	35,850.00	200,760,000	
サンドラッグ	6,400	7,580.00	48,512,000	
ヤマザワ	5,200	1,824.00	9,484,800	
ベルーナ	22,000	853.00	18,766,000	
めぶきフィナンシャルグループ	165,200	472.00	77,974,400	
東京ＴＹフィナンシャルグループ	4,900	3,840.00	18,816,000	
九州フィナンシャルグループ	55,000	745.00	40,975,000	
ゆうちょ銀行	94,900	1,434.00	136,086,600	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	219,900	565.20	124,287,480	
西日本フィナンシャルホールディングス	22,500	1,199.00	26,977,500	
新生銀行	315,000	202.00	63,630,000	
あおぞら銀行	212,000	422.00	89,464,000	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	2,549,900	745.70	1,901,460,430	
りそなホールディングス	393,200	641.00	252,041,200	
三井住友トラスト・ホールディングス	70,300	3,999.00	281,129,700	

三井住友フィナンシャルグループ	269,500	4,266.00	1,149,687,000	
第四銀行	41,000	486.00	19,926,000	
北越銀行	3,300	2,890.00	9,537,000	
千葉銀行	132,000	759.00	100,188,000	
群馬銀行	74,600	626.00	46,699,600	
武蔵野銀行	5,300	3,550.00	18,815,000	
千葉興業銀行	24,200	647.00	15,657,400	
七十七銀行	52,000	517.00	26,884,000	
青森銀行	18,000	401.00	7,218,000	
秋田銀行	23,000	361.00	8,303,000	
山形銀行	9,000	504.00	4,536,000	
岩手銀行	1,500	4,815.00	7,222,500	
東邦銀行	23,000	434.00	9,982,000	
東北銀行	54,000	160.00	8,640,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	136,000	491.00	66,776,000	
静岡銀行	93,000	953.00	88,629,000	
十六銀行	44,000	388.00	17,072,000	
スルガ銀行	35,100	2,485.00	87,223,500	
八十二銀行	65,500	683.00	44,736,500	
山梨中央銀行	14,000	529.00	7,406,000	
大垣共立銀行	45,000	344.00	15,480,000	
福井銀行	33,000	273.00	9,009,000	
北國銀行	33,000	451.00	14,883,000	
滋賀銀行	31,000	601.00	18,631,000	
南都銀行	3,200	4,355.00	13,936,000	
百五銀行	30,000	477.00	14,310,000	
京都銀行	60,000	886.00	53,160,000	
紀陽銀行	12,700	1,825.00	23,177,500	
三重銀行	5,700	2,561.00	14,597,700	
ほくほくフィナンシャルグループ	22,600	1,875.00	42,375,000	
広島銀行	101,000	507.00	51,207,000	
山陰合同銀行	20,900	971.00	20,293,900	
中国銀行	24,000	1,709.00	41,016,000	
鳥取銀行	5,200	1,864.00	9,692,800	
伊予銀行	36,400	804.00	29,265,600	
百十四銀行	35,000	396.00	13,860,000	
四国銀行	50,000	311.00	15,550,000	
阿波銀行	29,000	774.00	22,446,000	
大分銀行	13,000	459.00	5,967,000	
宮崎銀行	26,000	372.00	9,672,000	
佐賀銀行	37,000	324.00	11,988,000	
十八銀行	34,000	386.00	13,124,000	
沖縄銀行	3,100	4,480.00	13,888,000	

琉球銀行	6,400	1,665.00	10,656,000	
セブン銀行	128,000	371.00	47,488,000	
みずほフィナンシャルグループ	4,566,400	211.00	963,510,400	
山口フィナンシャルグループ	32,000	1,279.00	40,928,000	
長野銀行	3,400	2,029.00	6,898,600	
名古屋銀行	1,900	4,265.00	8,103,500	
北洋銀行	55,000	461.00	25,355,000	
愛知銀行	400	6,600.00	2,640,000	
第三銀行	2,600	1,755.00	4,563,000	
中京銀行	4,900	2,354.00	11,534,600	
愛媛銀行	10,500	1,426.00	14,973,000	
トマト銀行	5,700	1,630.00	9,291,000	
京葉銀行	28,000	512.00	14,336,000	
関西アーバン銀行	7,000	1,515.00	10,605,000	
栃木銀行	16,200	556.00	9,007,200	
トモニホールディングス	30,000	628.00	18,840,000	
フィデアホールディングス	42,800	219.00	9,373,200	
池田泉州ホールディングス	38,400	493.00	18,931,200	
F P G	12,000	1,051.00	12,612,000	
S B Iホールディングス	39,000	1,673.00	65,247,000	
ジャフコ	5,500	4,100.00	22,550,000	
大和証券グループ本社	314,000	741.80	232,925,200	
野村ホールディングス	687,700	745.80	512,886,660	
岡三証券グループ	27,000	754.00	20,358,000	
丸三証券	7,700	1,018.00	7,838,600	
東洋証券	8,000	283.00	2,264,000	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	40,700	640.00	26,048,000	
水戸証券	14,500	324.00	4,698,000	
いちよし証券	14,200	900.00	12,780,000	
松井証券	18,100	948.00	17,158,800	
だいこう証券ビジネス	3,800	638.00	2,424,400	
マネックスグループ	65,400	311.00	20,339,400	
カブドットコム証券	44,700	392.00	17,522,400	
極東証券	7,300	1,786.00	13,037,800	
藍澤證券	2,500	671.00	1,677,500	
かんぽ生命保険	12,900	2,731.00	35,229,900	
S O M P Oホールディングス	70,500	4,358.00	307,239,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	100,600	3,869.00	389,221,400	
ソニーフィナンシャルホールディングス	32,200	1,956.00	62,983,200	
第一生命ホールディングス	202,800	2,191.00	444,334,800	
東京海上ホールディングス	136,400	5,062.00	690,456,800	
T & Dホールディングス	122,700	1,772.00	217,424,400	
全国保証	9,400	3,610.00	33,934,000	

クレディセゾン	25,400	2,083.00	52,908,200	
芙蓉総合リース	3,800	5,360.00	20,368,000	
興銀リース	6,800	2,550.00	17,340,000	
東京センチュリー	6,800	4,000.00	27,200,000	
日本証券金融	31,200	635.00	19,812,000	
アイフル	56,200	330.00	18,546,000	
リコーリース	3,100	3,770.00	11,687,000	
イオンフィナンシャルサービス	21,800	2,246.00	48,962,800	
アコム	68,500	461.00	31,578,500	
オリエントコーポレーション	75,900	209.00	15,863,100	
日立キャピタル	7,800	2,840.00	22,152,000	
オリックス	238,300	1,717.00	409,161,100	
三菱UFJリース	86,100	591.00	50,885,100	
日本取引所グループ	104,000	1,618.00	168,272,000	
アサックス	200	1,666.00	333,200	
NECキャピタルソリューション	6,900	1,811.00	12,495,900	
いちご	37,100	344.00	12,762,400	
ヒューリック	70,200	1,057.00	74,201,400	
野村不動産ホールディングス	22,200	1,891.00	41,980,200	
オープンハウス	4,600	2,786.00	12,815,600	
東急不動産ホールディングス	80,900	625.00	50,562,500	
飯田グループホールディングス	28,100	1,825.00	51,282,500	
パーク24	17,100	3,015.00	51,556,500	
三井不動産	178,000	2,475.50	440,639,000	
三菱地所	250,000	2,172.50	543,125,000	
平和不動産	9,700	1,586.00	15,384,200	
東京建物	39,300	1,520.00	59,736,000	
ダイビル	10,600	1,027.00	10,886,200	
京阪神ビルディング	27,800	642.00	17,847,600	
住友不動産	81,000	3,015.00	244,215,000	
大京	65,000	235.00	15,275,000	
テーオーシー	16,900	970.00	16,393,000	
レオパレス21	40,700	595.00	24,216,500	
スターツコーポレーション	6,000	2,459.00	14,754,000	
空港施設	23,100	589.00	13,605,900	
住友不動産販売	2,700	3,405.00	9,193,500	
ゴールドクレスト	4,200	2,062.00	8,660,400	
日本エスリード	11,300	1,607.00	18,159,100	
サンヨーハウジング名古屋	13,000	989.00	12,857,000	
イオンモール	21,100	1,751.00	36,946,100	
エヌ・ティ・ティ都市開発	20,400	1,011.00	20,624,400	
日本空港ビルデング	10,900	4,340.00	47,306,000	
日本M&Aセンター	10,400	3,650.00	37,960,000	



パソナグループ	17,600	795.00	13,992,000	
G C A	12,400	992.00	12,300,800	
エス・エム・エス	4,100	2,721.00	11,156,100	
テンプホールディングス	27,600	2,072.00	57,187,200	
クックパッド	8,800	966.00	8,500,800	
学情	5,300	1,229.00	6,513,700	
スタジオアリス	5,800	2,413.00	13,995,400	
シミックホールディングス	9,400	1,442.00	13,554,800	
N J S	5,000	1,367.00	6,835,000	
総合警備保障	13,200	4,335.00	57,222,000	
カカココム	25,100	1,625.00	40,787,500	
アイロムグループ	3,800	1,372.00	5,213,600	
ディップ	3,300	2,465.00	8,134,500	
キャリアデザインセンター	5,600	1,157.00	6,479,200	
エムスリー	30,700	2,785.00	85,499,500	
ディー・エヌ・エー	15,800	2,535.00	40,053,000	
博報堂D Yホールディングス	49,300	1,383.00	68,181,900	
ぐるなび	4,500	2,328.00	10,476,000	
ファンコミュニケーションズ	20,900	845.00	17,660,500	
W D Bホールディングス	6,400	1,268.00	8,115,200	
E P Sホールディングス	13,000	1,557.00	20,241,000	
ドリームインキュベータ	5,800	2,166.00	12,562,800	
クイック	5,800	1,173.00	6,803,400	
ケネディクス	48,200	471.00	22,702,200	
電通	39,700	6,180.00	245,346,000	
みらかホールディングス	9,000	5,440.00	48,960,000	
アルプス技研	500	3,515.00	1,757,500	
ダイオーズ	2,300	1,083.00	2,490,900	
日本空調サービス	26,900	662.00	17,807,800	
オリエンタルランド	38,500	6,321.00	243,358,500	
ダスキン	9,000	2,579.00	23,211,000	
リゾートトラスト	14,300	2,027.00	28,986,100	
ビー・エム・エル	5,800	2,497.00	14,482,600	
りらいあコミュニケーションズ	18,000	1,111.00	19,998,000	
早稲田アカデミー	2,000	1,305.00	2,610,000	
ユー・エス・エス	43,200	1,943.00	83,937,600	
サイバーエージェント	18,900	3,465.00	65,488,500	
楽天	181,700	1,127.00	204,775,900	
テー・オー・ダブリュー	10,200	699.00	7,129,800	
テクノプロ・ホールディングス	5,800	4,280.00	24,824,000	
ファーストロジック	1,600	2,499.00	3,998,400	
キャリアリンク	4,700	714.00	3,355,800	
ライドオン・エクスプレス	5,600	915.00	5,124,000	

リクルートホールディングス	77,900	5,610.00	437,019,000	
エラン	700	1,885.00	1,319,500	
日本郵政	93,300	1,473.00	137,430,900	
リログループ	1,300	17,800.00	23,140,000	
エイチ・アイ・エス	5,800	2,779.00	16,118,200	
共立メンテナンス	2,900	6,640.00	19,256,000	
建設技術研究所	12,000	1,144.00	13,728,000	
燦ホールディングス	1,900	1,671.00	3,174,900	
よみうりランド	11,000	461.00	5,071,000	
東京都競馬	65,000	262.00	17,030,000	
カナモト	4,700	3,115.00	14,640,500	
東京ドーム	15,200	1,076.00	16,355,200	
トランス・コスモス	2,700	2,711.00	7,319,700	
乃村工藝社	8,200	1,965.00	16,113,000	
日本管財	8,400	1,892.00	15,892,800	
白洋舎	5,100	2,849.00	14,529,900	
セコム	37,100	8,209.00	304,553,900	
セントラル警備保障	6,600	1,804.00	11,906,400	
メイテック	4,300	4,650.00	19,995,000	
アサツー ディ・ケイ	5,600	3,000.00	16,800,000	
応用地質	12,200	1,436.00	17,519,200	
船井総研ホールディングス	4,900	2,080.00	10,192,000	
ベネッセホールディングス	12,100	3,660.00	44,286,000	
イオンディライト	2,800	3,510.00	9,828,000	
ニチイ学館	19,100	870.00	16,617,000	
ダイセキ	6,900	2,347.00	16,194,300	
ステップ	4,500	1,498.00	6,741,000	
合 計	50,627,700		77,705,684,830	

(注) 備考欄の数値は、差入委託証拠金代用有価証券としての担保差入れ株式数です。

(2) 株式以外の有価証券  
該当事項はありません。

第2 信用取引契約残高明細表  
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表  
「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

平成29年4月28日現在

種類	金額
資産総額	453,557,528 円
負債総額	25,699,688 円
純資産総額( - )	427,857,840 円
発行済数量	398,954,333 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0724 円

(ご参考：親投資信託の現況)

TMA日本株TOPIXマザーファンド

平成29年4月28日現在

種類	金額
資産総額	57,589,930,500 円
負債総額	1,554,720,184 円
純資産総額( - )	56,035,210,316 円
発行済数量	46,592,351,120 口
1単位当たり純資産額( / )	1.2027 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

ファンドの受益権は、振替受益権となり、委託会社は、この信託の受益権を取り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り消された場合または当該指定が効力を失った場合であって、当該振替機関の振替業を承継する者が存在しない場合その他やむを得ない事情がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。

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

1. 名義書換  
該当事項はありません。
2. 受益者に対する特典  
特典はありません。
3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。
4. 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。

上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡に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、委託会社が必要と認めたとときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。

5. 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
6. 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、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。
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します。）にお支払いします。
8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて  
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り扱われます。

## 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】

平成29年4月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

委託会社業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役の選任は株主総会において、議決権を行使することができる株主の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。取締役の任期は、選任後1年内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役中より代表取締役を選任します。

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

運用の基本方針は、運用本部長を委員長とする投資政策委員会で投資環境見通し等をふまえて決定されます。

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

運用部門とは独立した管理部門にて運用評価、ガイドライン遵守状況のチェックを行い、管理本部長を委員長とし運用管理部を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。

運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

#### 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）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

平成29年4月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	166	1,803,311
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
合計	166	1,803,311

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は「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。

また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条により、「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. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第31期事業年度(平成27年4月1日から平成28年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

なお、従来、当社が監査証明を受けているPwCあらた監査法人は、平成28年7月1日に名称を変更し、PwCあらた有限責任監査法人となりました。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金・預金	11,141,499	6,701,500
前払費用	138,645	154,914
未収委託者報酬	1,838,877	1,571,495
未収収益	2,613,524	2,099,418
未収入金	144,239	166,601
繰延税金資産	178,975	173,700
1年内回収予定の敷金	-	315,033
その他の流動資産	7,312	12,650
流動資産計	16,063,074	11,195,315
固定資産		
有形固定資産	* 1 125,305	* 1 74,211
建物	56,587	2,187
器具備品	68,717	72,024
無形固定資産	3,475	5,254
電話加入権	3,144	3,144
ソフトウェア仮勘定	330	2,110
投資その他の資産	766,343	2,366,401
投資有価証券	35,337	43,761
関係会社株式	254,342	1,669,990
その他の関係会社有価証券	31,200	31,200
長期前払費用	11,425	9,018
敷金	315,033	450,152
その他長期差入保証金	-	10,852
繰延税金資産	119,005	151,427
固定資産計	895,124	2,445,867
資産合計	16,958,198	13,641,183
<b>負債の部</b>		
流動負債		
預り金	35,761	39,072
未払金	1,882,737	* 2 2,119,086
未払手数料	641,688	592,624
その他未払金	1,241,048	1,526,461
未払費用	226,407	147,843
未払消費税等	381,984	93,340
未払法人税等	777,000	736,000
前受収益	121,685	3,021
賞与引当金	189,738	196,236
その他の流動負債	1,080	-
流動負債計	3,616,395	3,334,601
固定負債		
退職給付引当金	179,872	197,784
役員退職慰労引当金	18,220	21,270
固定負債計	198,092	219,054
負債合計	3,814,487	3,553,655
<b>純資産の部</b>		
株主資本	13,138,296	10,085,959
資本金	2,000,000	2,000,000
利益剰余金	11,138,296	8,085,959
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	10,638,296	7,585,959
繰越利益剰余金	10,638,296	7,585,959
評価・換算差額等	5,414	1,567

その他有価証券評価差額金	5,414	1,567
純資産合計	13,143,710	10,087,527
負債・純資産合計	16,958,198	13,641,183

## (2) 【損益計算書】

(単位：千円)

	第30期 (自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)	第31期 (自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	9,360,564	9,967,549
運用受託報酬	8,312,953	8,310,269
投資助言報酬	54,626	90,084
その他営業収益	2,156	1,114
営業収益計	17,730,301	18,369,017
営業費用		
支払手数料	3,990,900	4,535,693
広告宣伝費	120,842	160,685
公告費	533	150
調査費	5,028,540	5,212,764
調査費	1,359,014	1,906,774
委託調査費	3,669,525	3,305,989
委託計算費	79,315	116,997
営業雑経費	158,665	202,379
通信費	28,778	30,626
印刷費	100,532	143,441
協会費	17,727	17,642
諸会費	5,136	4,682
図書費	6,491	5,986
営業費用計	9,378,797	10,228,671
一般管理費		
給料	2,415,481	2,468,628
役員報酬	76,933	57,936
給料・手当	1,680,443	1,761,103
賞与	658,104	649,589
交際費	8,098	21,912
寄付金	1,064	-
旅費交通費	86,899	97,774
租税公課	48,943	68,294
不動産賃借料	258,391	258,391
役員退職慰労引当金繰入	3,170	3,050
退職給付費用	70,058	86,602
賞与引当金繰入	189,738	196,236
固定資産減価償却費	95,208	98,697
法定福利費	407,477	419,863
福利厚生費	6,193	7,908
諸経費	389,985	416,706
一般管理費計	3,980,710	4,144,067
営業利益	4,370,792	3,996,279
営業外収益		
受取利息	1,803	1,844
受取配当金	* 1 227,154	* 1 145,859
匿名組合投資利益	11,498	* 1 164,645
雑益	14,179	13,905
営業外収益計	254,634	326,255
営業外費用		
為替差損	-	13,297
雑損	82,709	19,880
営業外費用計	82,709	33,178



経常利益	4,542,717	4,289,355
特別利益		
資産除去債務戻入益	34,769	-
特別利益計	34,769	-
特別損失		
器具備品除却損	912	-
特別損失計	912	-
税引前当期純利益	4,576,574	4,289,355
法人税、住民税及び事業税	1,551,017	1,425,847
法人税等調整額	33,368	25,250
法人税等合計	1,584,385	1,400,596
当期純利益	2,992,189	2,888,759

**(3)【株主資本等変動計算書】**

第30期(自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	500,000	8,450,867	8,950,867	10,950,867
当期変動額					
剰余金の配当			804,759	804,759	804,759
当期純利益			2,992,189	2,992,189	2,992,189
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	-	-	2,187,429	2,187,429	2,187,429
当期末残高	2,000,000	500,000	10,638,296	11,138,296	13,138,296

	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	1,809	1,809	10,952,676
当期変動額			
剰余金の配当			804,759
当期純利益			2,992,189
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	3,604	3,604	3,604
当期変動額合計	3,604	3,604	2,191,034
当期末残高	5,414	5,414	13,143,710

第31期(自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益剰余金 繰越利益剰余金	利益剰余金 合計	
当期首残高	2,000,000	500,000	10,638,296	11,138,296	13,138,296
当期変動額					
剰余金の配当			5,941,096	5,941,096	5,941,096
当期純利益			2,888,759	2,888,759	2,888,759
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)					
当期変動額合計	-	-	3,052,336	3,052,336	3,052,336
当期末残高	2,000,000	500,000	7,585,959	8,085,959	10,085,959

	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	5,414	5,414	13,143,710
当期変動額			
剰余金の配当			5,941,096
当期純利益			2,888,759
株主資本以外の項目 の当期変動額(純額)	3,846	3,846	3,846
当期変動額合計	3,846	3,846	3,056,183
当期末残高	1,567	1,567	10,087,527

## 注記事項

## 重要な会計方針

第31期 自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	
(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券	移動平均法による原価法
(2) その他有価証券	時価のあるもの 決算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) 時価を把握することが極めて困難と認められるもの 移動平均法による原価法
2. 固定資産の減価償却の方法	
(1) 有形固定資産	定率法 ただし、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として3年間で均等償却する方法を採用しております。
(2) 長期前払費用	

## 定額法

## 3. 引当金の計上基準

## (1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

## (2) 退職給付引当金

従業員の退職給付に備えるため、当事業年度末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。

退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。

## (3) 役員退職慰労引当金

役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく期末要支給額を計上しております。

## 4. 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)

第30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28年3月31日現在								
* 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。	* 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。								
<table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>170,125千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>476,137千円</td> </tr> </table>	建物	170,125千円	器具備品	476,137千円	<table border="0"> <tr> <td>建物</td> <td>226,926千円</td> </tr> <tr> <td>器具備品</td> <td>496,441千円</td> </tr> </table>	建物	226,926千円	器具備品	496,441千円
建物	170,125千円								
器具備品	476,137千円								
建物	226,926千円								
器具備品	496,441千円								
* 2. 関係会社に対する主な資産・負債	* 2. 関係会社に対する主な資産・負債は次のとおりであります。								
<p>当事業年度において、関係会社に対する負債の合計額が負債及び純資産の合計額の100分の5を超えており、その金額は850,899千円であります。</p>	<table border="0"> <tr> <td>関係会社に対する未払金</td> <td>732,363千円</td> </tr> </table>	関係会社に対する未払金	732,363千円						
関係会社に対する未払金	732,363千円								

## (損益計算書関係)

第30期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日	第31期 自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日						
* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。	* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。						
<table border="0"> <tr> <td>関係会社からの受取配当金</td> <td>226,798千円</td> </tr> </table> <p>当事業年度において、関係会社に対する営業費用及び一般管理費の合計額が営業費用及び一般管理費の合計額の100分の20を超えており、その金額は3,400,300千円であります。</p>	関係会社からの受取配当金	226,798千円	<table border="0"> <tr> <td>関係会社からの受取配当金</td> <td>142,429千円</td> </tr> <tr> <td>関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配</td> <td>164,645千円</td> </tr> </table> <p>当事業年度において、関係会社に対する営業費用及び一般管理費の合計額が営業費用及び一般管理費の合計額の100分の20を超えており、その金額は3,142,828千円であります。</p>	関係会社からの受取配当金	142,429千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	164,645千円
関係会社からの受取配当金	226,798千円						
関係会社からの受取配当金	142,429千円						
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	164,645千円						

## (株主資本等変動計算書関係)

第30期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位：株)

株式の種類	平成26年4月1日 現在	増加	減少	平成27年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成26年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	804,759千円
(ロ) 1株当たり配当額	21,012円
(ハ) 基準日	平成26年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成26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

平成27年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	939,116千円
(ロ) 配当の原資	利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	24,520円
(ニ) 基準日	平成27年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成27年6月30日

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 発行済株式に関する事項

（単位：株）

株式の種類	平成27年4月1日 現在	増加	減少	平成28年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成27年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	939,116千円
(ロ) 1株当たり配当額	24,520円
(ハ) 基準日	平成27年3月31日
(ニ) 効力発生日	平成27年6月30日

平成27年11月24日の臨時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	5,001,980千円
(ロ) 1株当たり配当額	130,600円
(ハ) 効力発生日	平成27年11月30日

（注）基準日は設定しておりません。配当の効力発生日時点の株主へ配当を実施しております。

## (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

平成28年6月28日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	791,278千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	20,660円
(ニ) 基準日	平成28年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成28年6月28日

## （金融商品関係）

## 1. 金融商品の状況に関する事項

第30期	第31期
自 平成26年4月1日	自 平成27年4月1日
至 平成27年3月31日	至 平成28年3月31日

<p>(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。</p> <p>営業債務である未払金は、ほとんど1年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。</p> <p>市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。</p> <p>投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。</p> <p>流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。</p>	<p>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左</p> <p>市場リスク 同左</p> <p>流動性リスク 同左</p>
---	---

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

第30期(平成27年3月31日現在)における貸借対照表計上額、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次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金・預金	11,141,499	11,141,499	-
(2)未収委託者報酬	1,838,877	1,838,877	-
(3)未収収益	2,613,524	2,613,524	-
(4)未収入金	144,239	144,239	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	35,337	35,337	-
(6)敷金	315,033	315,033	-
(7)預り金	(35,761)	(35,761)	-
(8)未払金	(1,882,737)	(1,882,737)	-
(9)未払費用	(226,407)	(226,407)	-
(10)未払消費税等	(381,984)	(381,984)	-
(11)未払法人税等	(777,000)	(777,000)	-

(\*)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

第31期(平成28年3月31日現在)における貸借対照表計上額、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次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
(1)現金・預金	6,701,500	6,701,500	-
(2)未収委託者報酬	1,571,495	1,571,495	-
(3)未収収益	2,099,418	2,099,418	-
(4)未収入金	166,601	166,601	-
(5)1年内回収予定の敷金	315,033	315,033	-
(6)投資有価証券 その他有価証券	43,761	43,761	-
(7)預り金	(39,072)	(39,072)	-
(8)未払金	(2,119,086)	(2,119,086)	-
(9)未払費用	(147,843)	(147,843)	-
(10)未払消費税等	(93,340)	(93,340)	-
(11)未払法人税等	(736,000)	(736,000)	-

(＊)負債に計上されているものについては、( )で示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

第30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28年3月31日現在
<p>(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(7)預り金、(8)未払金、(9)未払費用並びに(10)未払消費税等及び(11)未払法人税等</p> <p>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。</p> <p>(5)投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1.有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。</p> <p>(6)敷金 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。</p>	<p>(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(5)1年内回収予定の敷金、(7)預り金、(8)未払金、(9)未払費用、(10)未払消費税等及び(11)未払法人税等</p> <p>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。</p> <p>(6)投資有価証券 同左</p>

(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

第30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28年3月31日現在																				
<p>以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。</p> <p>(単位:千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>子会社株式</td> <td>221,595</td> </tr> <tr> <td>関連会社株式</td> <td>32,747</td> </tr> <tr> <td>その他の関係会社 有価証券</td> <td>31,200</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額	子会社株式	221,595	関連会社株式	32,747	その他の関係会社 有価証券	31,200	<p>以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。</p> <p>(単位:千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th></th> <th>貸借対照表計上額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>子会社株式</td> <td>1,637,243</td> </tr> <tr> <td>関連会社株式</td> <td>32,747</td> </tr> <tr> <td>その他の関係会社 有価証券</td> <td>31,200</td> </tr> <tr> <td>敷金</td> <td>450,152</td> </tr> <tr> <td>その他長期差入保証金</td> <td>10,852</td> </tr> </tbody> </table>		貸借対照表計上額	子会社株式	1,637,243	関連会社株式	32,747	その他の関係会社 有価証券	31,200	敷金	450,152	その他長期差入保証金	10,852
	貸借対照表計上額																				
子会社株式	221,595																				
関連会社株式	32,747																				
その他の関係会社 有価証券	31,200																				
	貸借対照表計上額																				
子会社株式	1,637,243																				
関連会社株式	32,747																				
その他の関係会社 有価証券	31,200																				
敷金	450,152																				
その他長期差入保証金	10,852																				

(注3)金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28年3月31日現在
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変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。	該当事項はありません。

(注4) 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

第30期（平成27年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	11,141,470	-	-	-
未収委託者報酬	1,838,877	-	-	-
未収収益	2,613,524	-	-	-
未収入金	144,239	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	1,000	4,903	-
敷金	-	315,033	-	-
合計	15,738,111	316,033	4,903	-

第31期（平成28年3月31日現在）

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	6,701,448	-	-	-
未収委託者報酬	1,571,495	-	-	-
未収収益	2,099,418	-	-	-
未収入金	166,601	-	-	-
1年内回収予定の敷金	315,033	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	-	17,460	3,952	-
合計	10,853,997	17,460	3,952	-

(有価証券関係)

第30期 平成27年3月31日現在	第31期 平成28年3月31日現在
<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 子会社株式221,595千円、関連会社株式32,747千円）並びにその他の関係会社有価証券（貸借対照表計上額 31,200千円）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、記載していません。</p> <p>2. その他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>	<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 子会社株式1,637,243千円、関連会社株式32,747千円）並びにその他の関係会社有価証券（貸借対照表計上額 31,200千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、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、記載していません。</p> <p>2. その他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	33,921	25,426	8,495	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	26,436	21,324	5,111
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	1,415	1,908	492	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	17,324	20,176	2,851
合計	35,337	27,335	8,002	合計	43,761	41,501	2,259

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券  
該当事項はありません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券  
同左

## (退職給付関係)

## 1. 採用している退職給付制度の概要

当社は、従業員の退職給付に備えるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出年金制度を採用しております。

退職一時金制度(非積立型制度であります。)では、当社従業員を制度対象として、給与と勤続年数に基づき算出した一時金を支給しております。受入出向者については退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。貸借対照表上は出向期間3年以下の出向者に係る金額が退職給付引当金に、出向期間3年超の出向者に係る金額がその他未払金にそれぞれ含まれております。

なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。

## 2. 確定給付制度



## (1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	第30期		第31期	
	自	平成26年4月1日	自	平成27年4月1日
	至	平成27年3月31日	至	平成28年3月31日
退職給付引当金の期首残高		141,238千円		179,872千円
退職給付費用		51,674千円		33,702千円
退職給付の支払額		13,040千円		15,789千円
制度への拠出額		-		-
退職給付引当金の期末残高		179,872千円		197,784千円

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

	第30期		第31期	
	平成27年3月31日現在		平成28年3月31日現在	
積立型制度の退職給付債務		-		-
年金資産		-		-
		-		-
非積立型制度の退職給付債務		179,872千円		197,784千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		179,872千円		197,784千円
退職給付引当金		179,872千円		197,784千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		179,872千円		197,784千円

## (3) 退職給付費用

	第30期		第31期	
	自	平成26年4月1日	自	平成27年4月1日
	至	平成27年3月31日	至	平成28年3月31日
簡便法で計算した退職給付費用		51,674千円		33,702千円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第30期(自平成26年4月1日至平成27年3月31日)41,147千円、第31期(自平成27年4月1日至平成28年3月31日)43,203千円であります。

## (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の内訳

	第30期	第31期
	(平成27年3月31日現在)	(平成28年3月31日現在)
繰延税金資産		
役員退職慰労引当金	5,892千円	6,512千円
退職給付引当金	58,170千円	60,561千円
未払金	1,846千円	2,992千円
賞与引当金	62,803千円	60,558千円
未払法定福利費	8,288千円	7,858千円
未払事業所税	2,781千円	2,632千円
未払事業税	54,175千円	45,510千円
未払調査費	43,152千円	45,270千円
減価償却超過額	57,530千円	85,044千円
未払確定拠出年金	1,155千円	1,112千円

未払費用	4,771千円	7,764千円
繰延税金資産小計	300,569千円	325,819千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	300,569千円	325,819千円
繰延税金負債		
其他有価証券評価差額金	2,587千円	691千円
繰延税金負債合計	2,587千円	691千円
繰延税金資産の純額	297,981千円	325,127千円

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

第30期 (平成27年3月31日現在)	第31期 (平成28年3月31日現在)
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間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。	同左

3. 法人税等の税率の変更による繰延税金資産及び繰延税金負債の金額の修正

「所得税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第15号)及び「地方税法等の一部を改正する法律」(平成28年法律第13号)が平成28年3月29日に国会で成立し、平成28年4月1日以後に開始する事業年度から法人税率等の引下げ等が行われることとなりました。これに伴い、繰延税金資産及び繰延税金負債の計算に使用する法定実効税率は従来の32.26%から平成28年4月1日に開始する事業年度及び平成29年4月1日に開始する事業年度に解消が見込まれる一時差異については30.86%に、平成30年4月1日に開始する事業年度以降に解消が見込まれる一時差異については、30.62%となります。

この税率変更により、繰延税金資産の金額(繰延税金負債の金額を控除した金額)は15,504千円減少し、法人税等調整額が15,541千円、其他有価証券評価差額金が37千円、それぞれ増加しております。

(セグメント情報等)

第30期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日	第31期 自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日
<p>[セグメント情報]</p> <p>当社は「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り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運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。</p> <p>当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p>

<p>[関連情報]</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報 単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>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が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、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、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 当社は、外部顧客からの収益のうち、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、記載を省略しております。</p>	<p>[関連情報]</p> <p>1. 製品及びサービスごとの情報 同左</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 同左 (2) 有形固定資産 同左</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 同左</p>
--	--

## (関連当事者情報)

第30期（自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等重要な取引はありません。

## (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 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)
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ ロンドン	GBP 300千	金融商品 取引業	(所有) 直接50%	運用の 再委任	委託 調査費 の支払	1,849,352	未払金	376,465
						役員の 派遣			未払費用	36,012

(注) \* 取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

\* 取引金額及び期末残高には、免税取引のため消費税等は含まれておりません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等重要な取引はありません。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等重要な取引はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

## (1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）  
東京海上日動火災保険株式会社（非上場）

## (2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

第31期（自 平成27年4月1日 至 平成28年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金 (千円)	事業の 内容 又は 職業	議決権の 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	東京海上日動火災 保険株式会社	東京都 千代田区	101,994,694	損害保険業	(被所有) 直接100%	投資信託 の取扱 役員 の兼任	投資信託 に係る事 務代行手 数料の 支払	587,292	未払手数料	162,226

(注) \* 取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

\* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

## (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 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)
子会社	TOKIO MARINE ASSET MANAGEMENT INTERNATIONAL PTE.LTD.	シンガポール・ シンガポール	SGD 17,400千	投資運用業 投資助言業	(所有) 直接100%	投資助言 の受入 役員 の兼任	増資の 引受	1,415,648	-	-
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ ロンドン	GBP 300千	投資運用業 投資助言業	(所有) 直接50%	運用の 再委任 役員 の派遣	委託 調査費 の支払	1,250,497	未払金 未払費用	255,308 4,855

(注) \* 取引価格については、市場実勢等を勘案し、交渉の上決定しております。

\* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

\* 増資の引き受けは、子会社が行った増資を引き受けたものであります。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等重要な取引はありません。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主(個人の場合に限る。)等重要な取引はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

### (1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所に上場)

東京海上日動火災保険株式会社(非上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

### (1株当たり情報)

	第30期 自 平成26年4月1日 至 平成27年3月31日
1株当たり純資産額	343,177円83銭
1株当たり当期純利益 金額	78,125円04銭

(注) 1 . 潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益については、潜在株式がないため記載しておりません。	
(注) 2 . 1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。	
当期純利益	2,992,189千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益	2,992,189千円
期中平均株式数	38,300株

第31期 (自 平成27年 4月 1日 至 平成28年 3月31日)	
1 株当たり純資産額	263,381円91銭
1 株当たり当期純利益金額	75,424円51銭
なお、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。	
(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	10,087,527千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	10,087,527千円
1 株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	2,888,759千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	2,888,759千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

## (追加情報)

## [共通支配下の取引等]

当社は、関係当局の許認可等を前提に平成28年10月1日(予定)を合併の効力発生日として東京海上不動産投資顧問株式会社と合併契約を平成28年3月9日に締結いたしました。

## 1. 取引の概要

## (1) 被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 東京海上不動産投資顧問株式会社  
事業の内容 不動産を対象とした投資運用業、投資助言葉等

## (2) 企業結合日

平成28年10月1日

## (3) 企業結合の法的形式

東京海上アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、東京海上不動産投資顧問株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併

## (4) 結合後企業の名称

東京海上アセットマネジメント株式会社

## (5) 企業結合の目的

東京海上グループのアセットマネジメント会社である2社を統合することでのシナジー効果を追求いたします。具体的には、商品のラインアップを拡大することで多様なニーズを有する投資家への訴求力を高めること、コーポレート部門の統合による効率化と機能強化を図ることを目的として行うものであります。

## 2. 実施予定の会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分)に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

中間財務諸表  
中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間  
(平成28年9月30日現在)

## 資産の部

## 流動資産

現金・預金		6,257,850
前払費用		90,468
未収委託者報酬		1,633,466
未収収益		2,735,888
未収入金		318,790
繰延税金資産		378,074
その他の流動資産		14,598
流動資産計		11,429,138

## 固定資産

有形固定資産	* 1	559,396
建物		445,053
器具備品		101,420
建設仮勘定		12,922
無形固定資産		8,977
電話加入権		3,358
ソフトウェア仮勘定		5,618
投資その他の資産		2,375,357
投資有価証券		53,361
関係会社株式		1,669,990
その他の関係会社有価証券		31,200
長期前払費用		8,023
敷金		450,152
その他長期差入保証金		10,882
繰延税金資産		151,748

固定資産計		2,943,731
-------	--	-----------

資産合計		14,372,869
------	--	------------

## 負債の部

## 流動負債

預り金		42,927
未払金		1,960,004
未払手数料		635,703
その他未払金		1,324,300
未払費用		367,178
未払消費税等	* 2	87,761
未払法人税等		764,000
前受収益		15,540
賞与引当金		372,134
流動負債計		3,609,546

## 固定負債

退職給付引当金		209,122
役員退職慰労引当金		22,750
固定負債計		231,872

負債合計		3,841,418
------	--	-----------

## 純資産の部

株主資本		10,531,155
------	--	------------

資本金	2,000,000
利益剰余金	8,531,155
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	8,031,155
繰越利益剰余金	8,031,155
評価・換算差額等	295
その他有価証券評価差額金	295
純資産合計	10,531,450
負債・純資産合計	14,372,869

## 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
営業収益	
委託者報酬	5,406,190
運用受託報酬	4,157,307
投資助言報酬	45,273
その他営業収益	96
営業収益計	9,608,868
営業費用	
支払手数料	2,558,056
広告宣伝費	121,736
調査費	2,630,271
調査費	857,357
委託調査費	1,772,913
委託計算費	53,729
営業雑経費	128,863
通信費	18,045
印刷費	90,857
協会費	8,840
諸会費	5,855
図書費	5,263
営業費用計	5,492,656
一般管理費	
給料	1,033,613
役員報酬	50,343
給料・手当	895,917
賞与	87,352
交際費	5,804
寄付金	1,695
旅費交通費	61,514
租税公課	58,098
不動産賃借料	129,195
役員退職慰労引当金繰入	1,480
退職給付費用	41,802
賞与引当金繰入	372,134
固定資産減価償却費	* 1 19,227
法定福利費	198,916
福利厚生費	3,735
諸経費	236,669
一般管理費計	2,163,887
営業利益	1,952,324
営業外収益	
受取利息	25
受取配当金	27,380
為替差益	21,128



雑益	5,266
営業外収益計	53,799
営業外費用	
雑損	3,663
営業外費用計	3,663
経常利益	2,002,460
特別損失	
本社移転費用	222,585
特別損失計	222,585
税引前中間純利益	1,779,875
法人税、住民税及び事業税	747,534
法人税等調整額	204,133
法人税等合計	543,401
中間純利益	1,236,473

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益準備金	利益剰余金		
			その他利益剰余金	利益剰余金合計	
当期首残高	2,000,000	500,000	7,585,959	8,085,959	10,085,959
当中間期変動額					
剰余金の配当			791,278	791,278	791,278
中間純利益			1,236,473	1,236,473	1,236,473
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）					
当中間期変動額合計	-	-	445,195	445,195	445,195
当中間期末残高	2,000,000	500,000	8,031,155	8,531,155	10,531,155

	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	1,567	1,567	10,087,527
当中間期変動額			
剰余金の配当			791,278
中間純利益			1,236,473
株主資本以外の項目の当中間期変動額（純額）	1,272	1,272	1,272
当中間期変動額合計	1,272	1,272	443,923
当中間期末残高	295	295	10,531,450

## 注記事項

## 重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	<p>有価証券</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 中間会計期間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） 時価を把握することが極めて困難と認められるもの 移動平均法による原価法</p>
2. 固定資産の減価償却 の方法	<p>有形固定資産</p> <p>定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として3年間で均等償却する方法を採用しております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。退職給付引当金及び退職給付費用の計算に、退職給付に係る中間期末自己都合要支給額を退職給付債務とする方法を用いた簡便法を適用しております。</p> <p>(3) 役員退職慰労引当金 役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。</p>
4. 消費税等の会計処理 方法	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。</p>

（会計方針の変更）

<b>当中間会計期間</b> (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
法人税法の改正に伴い、「平成28年度税制改正に係る減価償却方法の変更に関する実務上の取り扱い」(実務対応報告第32号 平成28年 6月17日)を当中間会計期間に適用し、平成28年 4月 1日以後に取得した建物附属設備に係る減価償却方法を定率法から定額法に変更しております。これにより、従来の方法と比べて、当中間会計期間の減価償却費が4,591千円減少し、営業利益、経常利益および税引前中間純利益がそれぞれ4,591千円増加しております。

## (中間貸借対照表関係)

	<b>当中間会計期間</b> (平成28年 9月30日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額	建物 231,727千円 器具備品 475,804千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

## (中間損益計算書関係)

	<b>当中間会計期間</b> (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)
1 減価償却実施額	有形固定資産 19,227千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

<b>当中間会計期間</b> (自 平成28年 4月 1日 至 平成28年 9月30日)				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2. 配当に関する事項				
配当金支払額 平成28年 6月28日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。				
・普通株式の配当に関する事項				
(イ) 配当金の総額・・・・・・・・・・791,278千円				
(ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・20,660円				
(ハ) 基準日・・・・・・・・・・平成28年 3月31日				
(ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・平成28年 6月28日				

## (金融商品関係)

当中間会計期間(平成28年 9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成28年 9月30日現在における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。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次表には含まれておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

	中間貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
--	---------------	-------	----

(1)現金・預金	6,257,850	6,257,850	-
(2)未収委託者報酬	1,633,466	1,633,466	-
(3)未収収益	2,735,888	2,735,888	-
(4)未収入金	318,790	318,790	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	53,361	53,361	-
(6)預り金	(42,927)	(42,927)	-
(7)未払金	(1,960,004)	(1,960,004)	-
(8)未払費用	(367,178)	(367,178)	-
(9)未払消費税等	(87,761)	(87,761)	-
(10)未払法人税等	(764,000)	(764,000)	-

(\*)負債で計上されているものについては、( )で示しております。

(注1)金融商品の時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項

(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(6)預り金、(7)未払金、  
(8)未払費用、(9)未払消費税等並びに(10)未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。

(5)投資有価証券

時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1.資産の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)子会社株式(中間貸借対照表計上額 1,637,243千円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 32,747千円)及びその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額 31,200千円)並びに敷金(中間貸借対照表計上額 450,152千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成28年9月30日現在)

1.子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 子会社株式1,637,243千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、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、記載しておりません。

2.その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	証券投資信託	33,320	28,721	4,598
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	証券投資信託	20,041	24,214	4,172
合計		53,361	52,936	425

(企業結合等関係)

企業結合に関する重要な後発事象

当社は、平成28年3月9日付け合併契約に基づき、東京海上不動産投資顧問株式会社と、平成28年10月1日付けで合併いたしました。

1.取引の概要

(1)被取得企業の名称及びその事業の内容

被取得企業の名称 東京海上不動産投資顧問株式会社  
事業の内容 不動産を対象とした投資運用業、投資助言業等

(2)企業結合日

平成28年10月1日

(3)企業結合の法的形式

東京海上アセットマネジメント株式会社を吸収合併存続会社、東京海上不動産投資顧問株式会社を吸収合併消滅会社とする吸収合併

## (4) 結合後企業の名称

東京海上アセットマネジメント株式会社

## (5) 企業結合の目的

東京海上グループのアセットマネジメント会社である2社を統合することでのシナジー効果を追求いたします。具体的には、商品のラインアップを拡大することで多様なニーズを有する投資家への訴求力を高めること、コーポレート部門の統合による効率化と機能強化を図ることを目的として行うものであります。

## 2. 実施予定の会計処理の概要

「企業結合に関する会計基準」(企業会計基準第21号 平成25年9月13日公表分)及び「企業結合会計基準及び事業分離等会計基準に関する適用指針」(企業会計基準適用指針第10号 平成25年9月13日公表分)に基づき、共通支配下の取引として処理する予定です。

## (セグメント情報等)

## [セグメント情報]

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

当社は「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り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運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

## [関連情報]

当中間会計期間(自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)

## 1. 製品及びサービスごとの情報

単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## 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が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

## (2) 有形固定資産

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

## 3. 主要な顧客ごとの情報

当社は、外部顧客からの収益のうち、中間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、記載を省略しております。

## (1 株当たり情報)

当中間会計期間 (自 平成28年4月1日 至 平成28年9月30日)	
1 株当たり純資産額	274,972円59銭
1 株当たり中間純利益金額	32,283円90銭

なお、潜在株式調整後1株当たり中間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。

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎

中間貸借対照表の純資産の部の合計額	10,531,450千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	10,531,450千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株

1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎

中間損益計算書上の中間純利益金額	1,236,473千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	1,236,473千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

#### 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。

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。)

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。)

通常の利用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金融デリバティブ取引を行うこと。

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。

上記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です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

提出日現在、訴訟事件その他委託会社等に重要な影響を及ぼした事実、及び重要な影響を与えることが予想される事実はありません。

## 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

- ・名称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・資本金の額 324,279百万円（平成28年9月末日現在）
- ・事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律（兼営法）に基づき信託業務を営んでいます。

#### <参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・資本金の額 10,000百万円（平成28年9月末日現在）
- ・事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額（ ）	事業の内容
S M B C日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社S B I証券	47,937百万円	
みずほ証券株式会社	125,167百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	

( ) 平成28年9月末日現在。

### 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託財産の保管・管理等を行います。また、当ファンドにかかる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。

販売会社は、募集・販売の取扱い、一部解約事務および収益分配金・解約金・償還金の支払い等を行います。

### 3【資本関係】

資本関係はありません。



### 第3【参考情報】

当計算期間において、当ファンドに係る以下の書類を関東財務局長宛に提出しております。

書類名	提出年月日
有価証券届出書	平成28年6月20日
	平成28年12月20日
有価証券報告書	平成28年6月20日
半期報告書	平成28年12月20日

# 独立監査人の監査報告書

平成28年6月8日

東京海上アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

PwCあらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の平成27年4月1日から平成28年3月31日までの第31期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の平成28年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 強調事項

追加情報に記載されているとおり、会社は平成28年10月1日を合併の効力発生日として東京海上不動産投資顧問株式会社と合併契約を平成28年3月9日に締結した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以上

(注) 1. 上記は、監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBR L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

平成29年5月10日

東京海上アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上日本株TOPIXファンドの平成28年3月23日から平成29年3月21日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上日本株TOPIXファンドの平成29年3月21日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドと当監査法人又は業務執行社員との間には、公認会計士法の規定により記載すべき利害関係はない。

以上

(注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

# 独立監査人の中間監査報告書

平成28年12月6日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

P w C あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の平成28年4月1日から平成29年3月31日までの第32期事業年度の中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

## 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の平成28年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(平成28年4月1日から平成28年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 強調事項

企業結合等関係に記載されているとおり、会社は平成28年10月1日に東京海上不動産投資顧問株式会社と合併した。

当該事項は、当監査法人の意見に影響を及ぼすものではない。

## 利害関係

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

以 上

(注) 1. 上記は中間監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。