

**【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】	2019年6月20日
【計算期間】	第19期(自 2018年3月21日 至 2019年3月20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】	代表取締役社長 後藤 俊夫
【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
	海外	債券	
追加型投信	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、言及をすることはできません。
- ・(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、責任を負いません。

## 2

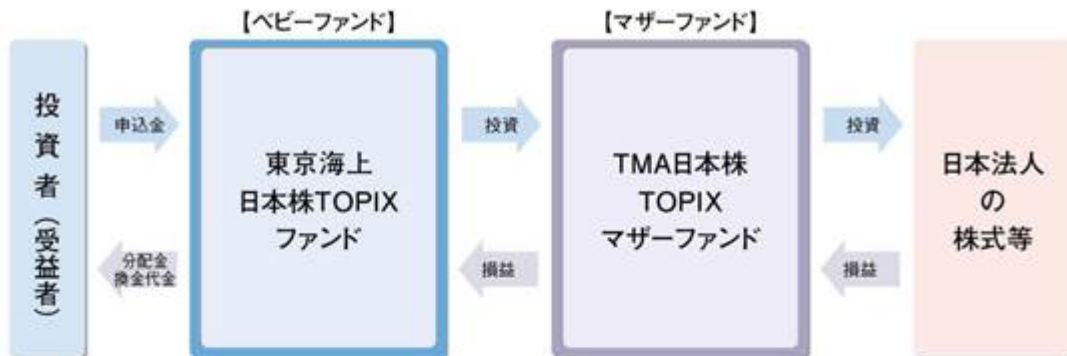
### 東証一部上場銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し組入れを行います。

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。

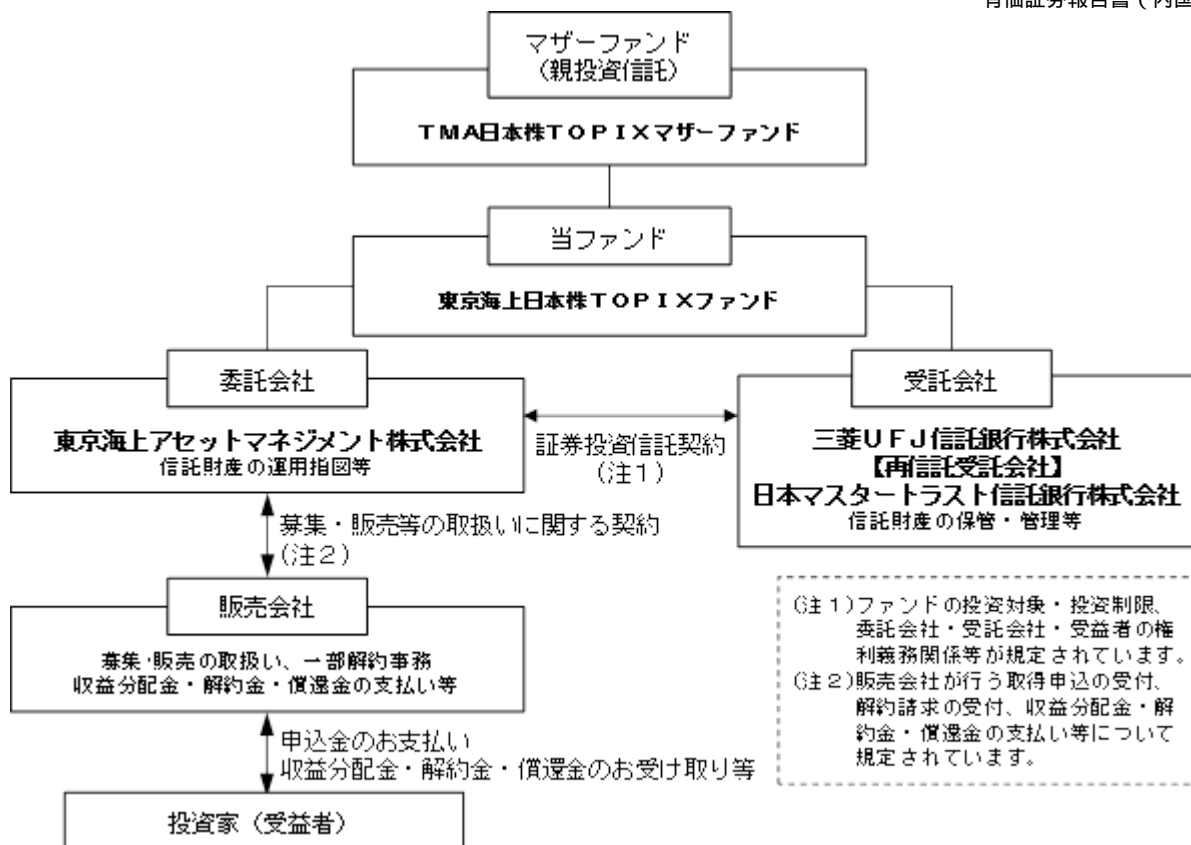
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

### (2) 【ファンドの沿革】

2000年3月21日 ファンドの設定、運用開始  
2016年2月18日 信託期間を無期限から2020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（2019年3月末日現在）
- ・会社の沿革
  - 1985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
  - 1987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
  - 1991年4月 国内および海外年金の運用受託を開始
  - 1998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
  - 2007年9月 金融商品取引業者として登録
  - 2014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
  - 2016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（2019年3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。

## &lt;参考情報&gt; 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。

## &lt;投資制限&gt;

(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。

(7) 約款第16条（先物取引等の運用指図）、第17条（スワップ取引の運用指図）および第18条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）に定めるデリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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ます。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ません。）

金銭債権（次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。）

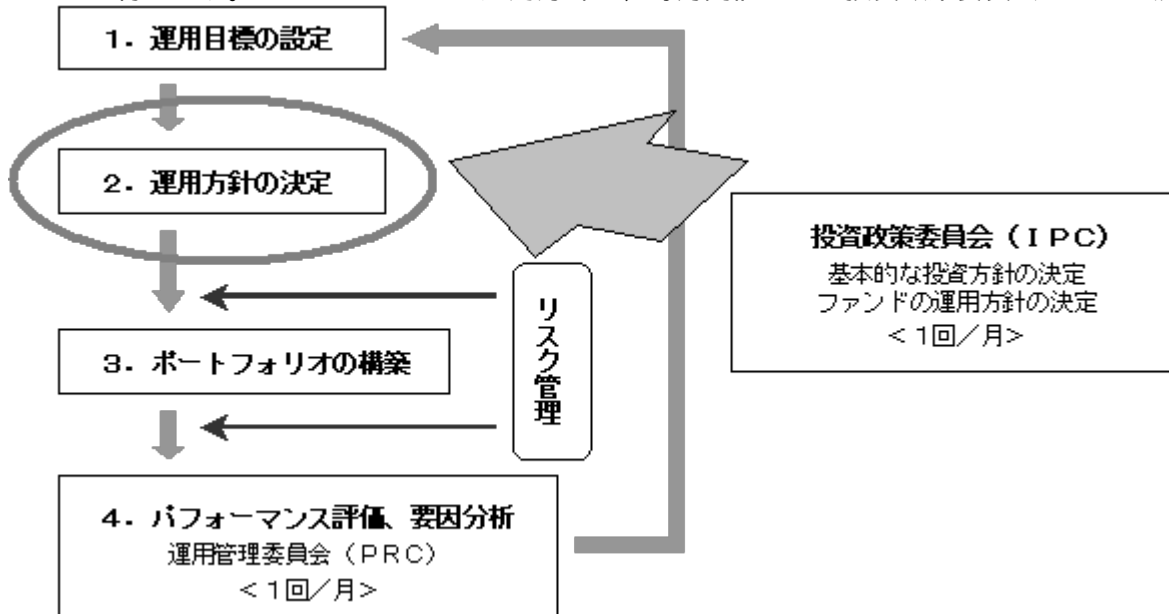
(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

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。)
  - (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。)
  - (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。)
  - (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、2019年4月1日現在）

#### (4)【分配方針】

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権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、）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) TOPIXとの乖離リスク

当ファンドの投資成果はTOPIX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TOPIX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。

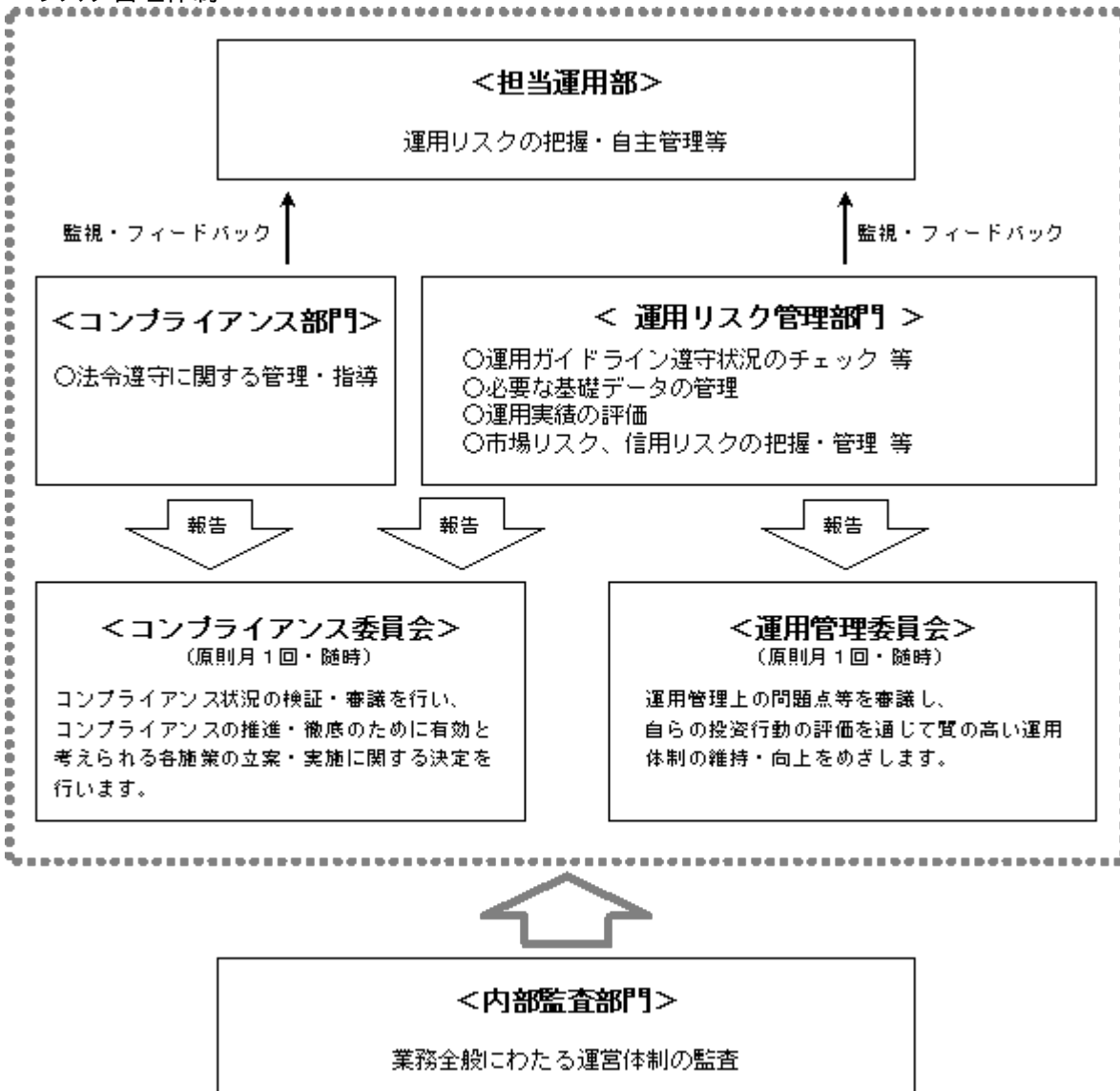
## 3. 管理体制

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

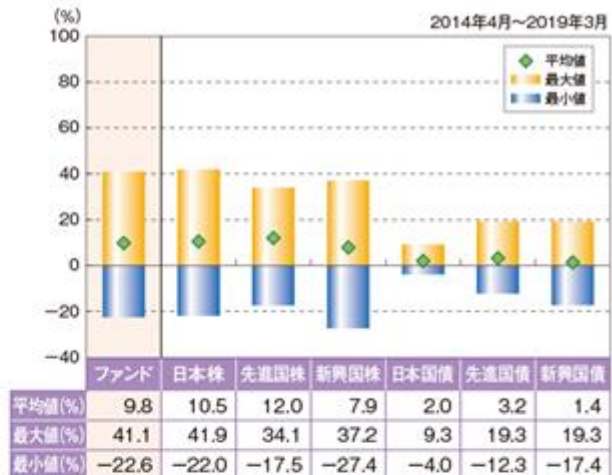


※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。

※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ています。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: FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

#### 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・ディバースファイド (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・ディバースファイド (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・ディバース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%<sup>\*</sup>（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。

<sup>\*</sup>消費税率が10%となった場合は、年率0.66%となります。

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%

<sup>\*1</sup> 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

<sup>\*2</sup> 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

<sup>\*3</sup> 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% <sup>*1</sup> を乗じた金額 （上限年43.2万円 <sup>*2</sup> の1日分相当額） 消費税率が10%となった場合は、 <sup>*1</sup> は年率0.044%、 <sup>*2</sup> は上限年44万円となります。
200億円超の場合	年43.2万円 <sup>*1</sup> の1日分相当額 + 純資産総額200億円超の部分に 年率0.00324% <sup>*2</sup> を乗じた金額 消費税率が10%となった場合は、 <sup>*1</sup> は年44万円、 <sup>*2</sup> は年率0.0033%となります。

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。

2037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ます。）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ます。）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、2019年3月末現在のもので、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2019年3月29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	376,379,596	100.01
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		64,054	0.01
合計（純資産総額）		376,315,542	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	35,725,231,630	93.66
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		2,415,357,498	6.33

合計(純資産総額)	38,140,589,128	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	2,419,840,000	6.34

(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	287,950,116	1.3113	377,617,781	1.3071	376,379,596	100.01

## 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	100.01
合計	100.01

## 【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	174,500	6,721.00	1,172,814,500	6,487.00	1,131,981,500	2.96
2	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	64,200	10,970.00	704,274,000	10,745.00	689,829,000	1.80
3	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	136,700	4,753.00	649,735,100	4,521.00	618,020,700	1.62
4	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	1,062,400	573.30	609,073,920	550.00	584,320,000	1.53
5	キーエンス	日本	電気機器	株式	7,700	68,090.00	524,293,000	68,970.00	531,069,000	1.39
6	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	105,100	4,778.00	502,167,800	4,703.00	494,285,300	1.29
7	ソニー	日本	電気機器	株式	105,000	4,951.00	519,855,000	4,645.00	487,725,000	1.27
8	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	108,900	4,042.00	440,173,800	3,876.00	422,096,400	1.10
9	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	132,100	3,090.00	408,189,000	2,995.00	395,639,500	1.03
10	東海旅客鉄道	日本	陸運業	株式	14,000	25,335.00	354,690,000	25,710.00	359,940,000	0.94

11	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	2,100,200	175.50	368,585,100	171.30	359,764,260	0.94
12	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	107,300	3,169.00	340,033,700	3,161.00	339,175,300	0.88
13	三菱商事	日本	卸売業	株式	108,200	3,222.00	348,620,400	3,074.00	332,606,800	0.87
14	花王	日本	化学	株式	38,000	8,843.00	336,034,000	8,718.00	331,284,000	0.86
15	KDDI	日本	情報・通信業	株式	135,500	2,483.00	336,446,500	2,385.00	323,167,500	0.84
16	任天堂	日本	その他製品	株式	9,600	30,480.00	292,608,000	31,560.00	302,976,000	0.79
17	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	56,000	5,487.00	307,272,000	5,362.00	300,272,000	0.78
18	東日本旅客鉄道	日本	陸運業	株式	27,800	10,710.00	297,738,000	10,680.00	296,904,000	0.77
19	ファナック	日本	電気機器	株式	14,900	19,280.00	287,272,000	18,880.00	281,312,000	0.73
20	ダイキン工業	日本	機械	株式	21,400	12,610.00	269,854,000	12,970.00	277,558,000	0.72
21	村田製作所	日本	電気機器	株式	49,200	5,533.33	272,240,000	5,512.00	271,190,400	0.71
22	キヤノン	日本	電気機器	株式	84,400	3,213.00	271,177,200	3,213.00	271,177,200	0.71
23	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	64,600	4,439.00	286,759,400	4,176.00	269,769,600	0.70
24	日本電産	日本	電気機器	株式	18,800	13,420.00	252,296,000	14,025.00	263,670,000	0.69
25	日立製作所	日本	電気機器	株式	70,600	3,610.00	254,866,000	3,585.00	253,101,000	0.66
26	信越化学工業	日本	化学	株式	27,000	9,233.00	249,291,000	9,280.00	250,560,000	0.65
27	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	90,900	2,794.00	253,974,600	2,745.00	249,520,500	0.65
28	資生堂	日本	化学	株式	31,100	7,937.00	246,840,700	7,987.00	248,395,700	0.65
29	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	144,700	1,757.00	254,237,900	1,658.50	239,984,950	0.62
30	NTTドコモ	日本	情報・通信業	株式	97,500	2,479.00	241,702,500	2,451.50	239,021,250	0.62

## 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	0.11
		鉱業	0.26
		建設業	2.78
		食料品	4.10
		繊維製品	0.61
		パルプ・紙	0.30
		化学	6.90
		医薬品	5.58
		石油・石炭製品	0.57
		ゴム製品	0.72
		ガラス・土石製品	0.79
		鉄鋼	0.93
		非鉄金属	0.71
		金属製品	0.56
		機械	4.55
電気機器	12.17		
輸送用機器	7.31		

	精密機器	1.88
	その他製品	1.92
	電気・ガス業	1.81
	陸運業	4.60
	海運業	0.13
	空運業	0.56
	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	7.74
	卸売業	4.72
	小売業	4.46
	銀行業	5.72
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	2.04
	その他金融業	1.06
	不動産業	2.30
	サービス業	4.65
合 計		93.66

## 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	152	2,427,579,160.00	2,419,840,000	6.34

(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10計算期間末	(2010年 3月23日)	1,204	1,204	0.5954	0.5954
第11計算期間末	(2011年 3月22日)	1,196	1,196	0.5522	0.5522
第12計算期間末	(2012年 3月21日)	1,274	1,274	0.5555	0.5555
第13計算期間末	(2013年 3月21日)	1,460	1,460	0.6958	0.6958
第14計算期間末	(2014年 3月20日)	819	819	0.7638	0.7638
第15計算期間末	(2015年 3月20日)	644	644	1.0681	1.0681
第16計算期間末	(2016年 3月22日)	507	507	0.9368	0.9368
第17計算期間末	(2017年 3月21日)	457	457	1.0856	1.0856
第18計算期間末	(2018年 3月20日)	434	434	1.2070	1.2070
第19計算期間末	(2019年 3月20日)	377	377	1.1545	1.1545
	2018年 3月末日	437	-	1.2174	-

4月末日	453	-	1.2611	-
5月末日	445	-	1.2395	-
6月末日	438	-	1.2292	-
7月末日	438	-	1.2446	-
8月末日	436	-	1.2313	-
9月末日	445	-	1.2994	-
10月末日	423	-	1.1770	-
11月末日	431	-	1.1919	-
12月末日	389	-	1.0698	-
2019年 1月末日	375	-	1.1214	-
2月末日	376	-	1.1498	-
3月末日	376	-	1.1504	-

## 【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10計算期間	2009年 3月24日～2010年 3月23日	21.2
第11計算期間	2010年 3月24日～2011年 3月22日	7.3
第12計算期間	2011年 3月23日～2012年 3月21日	0.6
第13計算期間	2012年 3月22日～2013年 3月21日	25.3
第14計算期間	2013年 3月22日～2014年 3月20日	9.8
第15計算期間	2014年 3月21日～2015年 3月20日	39.8
第16計算期間	2015年 3月21日～2016年 3月22日	12.3
第17計算期間	2016年 3月23日～2017年 3月21日	15.9
第18計算期間	2017年 3月22日～2018年 3月20日	11.2
第19計算期間	2018年 3月21日～2019年 3月20日	4.3

## (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10計算期間	2009年 3月24日～2010年 3月23日	1,089,311,554	1,025,856,594	2,023,682,159
第11計算期間	2010年 3月24日～2011年 3月22日	835,390,136	692,721,173	2,166,351,122
第12計算期間	2011年 3月23日～2012年 3月21日	1,341,147,957	1,213,356,337	2,294,142,742
第13計算期間	2012年 3月22日～2013年 3月21日	3,198,472,114	3,393,289,909	2,099,324,947
第14計算期間	2013年 3月22日～2014年 3月20日	1,014,995,803	2,041,337,723	1,072,983,027
第15計算期間	2014年 3月21日～2015年 3月20日	169,226,671	639,010,990	603,198,708
第16計算期間	2015年 3月21日～2016年 3月22日	477,679,201	538,779,461	542,098,448
第17計算期間	2016年 3月23日～2017年 3月21日	325,019,593	445,777,805	421,340,236
第18計算期間	2017年 3月22日～2018年 3月20日	80,319,640	141,310,637	360,349,239
第19計算期間	2018年 3月21日～2019年 3月20日	39,371,135	72,650,474	327,069,900

## &lt; 参考情報 &gt;

2019年3月29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	11,504円
純資産総額	376百万円

### ●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	+0.05	+7.53	-11.47	-5.50	+23.75	+15.04
ベンチマーク	-1.00	+6.53	-12.41	-7.26	+18.14	-4.84

※ファンドの騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、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
第18期	2018年3月20日	0円
第19期	2019年3月20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	93.7
株式先物	6.3
短期金融資産等	-0.0
合計	100.0
純資産総額	38,141百万円

### ●組入上位10業種

業種名	比率(%)
1 電気機器	12.2
2 情報・通信業	7.7
3 輸送用機器	7.3
4 化学	6.9
5 銀行業	5.7
6 医薬品	5.6
7 卸売業	4.7
8 サービス業	4.7
9 陸運業	4.6
10 機械	4.6

### ●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	3.0
2 ソフトバンクグループ	9984	情報・通信業	1.8
3 武田薬品工業	4502	医薬品	1.6
4 三菱UFJ FG	8306	銀行業	1.5
5 キーエンス	6861	電気機器	1.4
6 日本電信電話	9432	情報・通信業	1.3
7 ソニー	6758	電気機器	1.3
8 三井住友 FG	8316	銀行業	1.1
9 本田技研工業	7267	輸送用機器	1.0
10 東海旅客鉄道	9022	陸運業	0.9

組入銘柄数 1,084

※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ます。振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。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、2000年3月21日から2020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)

- a. 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。
- b. 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。
- 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.の信託契約の解約をしません。
- e. 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。
- f. 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。
- g. 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。
- h. 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。

- i. 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(<https://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(<https://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)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19期計算期間(2018年3月21日から2019年3月20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18期 [2018年 3月20日現在]	第19期 [2019年 3月20日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
親投資信託受益証券	434,943,471	377,607,780
未収入金	2,002,052	1,388,264
流動資産合計	436,945,523	378,996,044
資産合計	436,945,523	378,996,044
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	435,306	100
未払受託者報酬	220,347	195,234
未払委託者報酬	1,248,548	1,106,250
その他未払費用	97,851	86,680
流動負債合計	2,002,052	1,388,264
負債合計	2,002,052	1,388,264
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,360,349,239	1,327,069,900
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金( )	74,594,232	50,537,880
(分配準備積立金)	87,971,577	78,248,564
元本等合計	434,943,471	377,607,780
純資産合計	434,943,471	377,607,780
負債純資産合計	436,945,523	378,996,044

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期 自 2017年 3月22日 至 2018年 3月20日	第19期 自 2018年 3月21日 至 2019年 3月20日
<b>営業収益</b>		
有価証券売買等損益	50,724,283	16,146,340
<b>営業収益合計</b>	<b>50,724,283</b>	<b>16,146,340</b>
<b>営業費用</b>		
受託者報酬	435,031	411,486
委託者報酬	2,465,038	2,331,615
その他費用	193,177	182,703
<b>営業費用合計</b>	<b>3,093,246</b>	<b>2,925,804</b>
<b>営業利益又は営業損失( )</b>	<b>47,631,037</b>	<b>19,072,144</b>
<b>経常利益又は経常損失( )</b>	<b>47,631,037</b>	<b>19,072,144</b>
<b>当期純利益又は当期純損失( )</b>	<b>47,631,037</b>	<b>19,072,144</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( )	6,974,797	2,718,058
<b>期首剰余金又は期首欠損金( )</b>	<b>36,069,334</b>	<b>74,594,232</b>
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>10,103,310</b>	<b>7,240,226</b>
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	10,103,310	7,240,226
<b>剰余金減少額又は欠損金増加額</b>	<b>12,234,652</b>	<b>14,942,492</b>
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	12,234,652	14,942,492
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
<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>74,594,232</b>	<b>50,537,880</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19期 自 2018年 3月21日 至 2019年 3月20日
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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第18期 [2018年 3月20日現在]	第19期 [2019年 3月20日現在]
1. 1 期首元本額	421,340,236円	360,349,239円
期中追加設定元本額	80,319,640円	39,371,135円
期中一部解約元本額	141,310,637円	72,650,474円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	360,349,239口	327,069,900口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 2017年 3月22日 至 2018年 3月20日	第19期 自 2018年 3月21日 至 2019年 3月20日
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(8,046,757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(32,609,483円)、投資信託約款に規定される収益調整金(222,157,159円)及び分配準備積立金(47,315,337円)より、分配対象額は310,128,736円(1万口当たり8,606.32円)であります。分配を行っておりません。	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(6,785,482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(210,048,057円)及び分配準備積立金(71,463,082円)より、分配対象額は288,296,621円(1万口当たり8,814.51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18期 自 2017年 3月22日 至 2018年 3月20日	第19期 自 2018年 3月21日 至 2019年 3月20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18期 [2018年 3月20日現在]	第19期 [2019年 3月20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。  (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。	(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 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18期(自 2017年3月22日 至 2018年3月20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	44,104,324
合計	44,104,324

(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19期(自 2018年3月21日 至 2019年3月20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	12,437,212
合計	12,437,212

(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18期 [2018年 3月20日現在]		第19期 [2019年 3月20日現在]	
1口当たり純資産額	1.2070円	1口当たり純資産額	1.1545円
(1万口当たり純資産額)	12,070円)	(1万口当たり純資産額)	11,545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	287,898,582	377,607,780	
親投資信託受益証券 合計		287,898,582	377,607,780	
合計		287,898,582	377,607,780	

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

区 分	注記 番号	[2018年 3月20日現在]	[2019年 3月20日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		4,726,722,035	2,186,229,251
株式	2	64,231,024,980	38,530,201,180
派生商品評価勘定		249,680	
未収入金		124,600	
未収配当金		100,216,725	65,774,019
前払金		6,076,000	11,868,000
流動資産合計		69,064,414,020	40,794,072,450
資産合計		69,064,414,020	40,794,072,450
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		17,863,280	4,551,000
未払金			228,480
未払解約金		534,788,150	190,623,190
未払利息		12,273	4,739
流動負債合計		552,663,703	195,407,409
負債合計		552,663,703	195,407,409
純資産の部			
元本等			
元本	1	50,305,675,669	30,954,355,870
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		18,206,074,648	9,644,309,171
元本等合計		68,511,750,317	40,598,665,041
純資産合計		68,511,750,317	40,598,665,041
負債純資産合計		69,064,414,020	40,794,072,450

(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 2018年 3月21日 至 2019年 3月20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	[2018年 3月20日現在]	[2019年 3月20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	65,689,541,274円	50,305,675,669円
同期中における追加設定元本額	72,081,276,952円	17,392,230,268円
同期中における一部解約元本額	87,465,142,557円	36,743,550,067円
同期末における元本額	50,305,675,669円	30,954,355,870円
元本の内訳*		
円資産バランスファンド2018 - 09 <適格機関投資家限定>	円	293,283,030円
東京海上日本株T O P I Xファンド	319,365,204円	287,898,582円
東京海上セレクション・ 日本株T O P I X	16,001,528,785円	16,428,490,297円
L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)	4,092,515円	5,178,423円
L P S 4 資産分散ファンド (安定重視型)	9,158,590円	10,043,169円
L P S 4 資産分散ファンド (バランス型)	26,275,958円	33,233,386円
L P S 4 資産分散ファンド (成長重視型)	38,358,389円	45,571,189円
L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	52,493,654円	58,027,660円
東京海上・円資産インデックス バランスファンド	143,006円	1,054,753円
T M A 日本株式インデックスV A <適格機関投資家限定>	298,382,979円	248,889,352円
T M A 世界バランスファンド55 V A <適格機関投資家限定>	6,655,821円	円
T M A 世界バランスファンド35 V A <適格機関投資家限定>	3,207,399,681円	168,041,224円
東京海上・世界インデックス・ バランス40<適格機関投資家限定>	3,399,131円	24,502,095円
東京海上・世界インデックス・ バランス60<適格機関投資家限定>	29,465,020円	178,826,718円
東京海上・T O P I X インデクス ファンド<適格機関投資家限定>	30,308,956,936円	13,171,315,992円
計	50,305,675,669円	30,954,355,870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	50,305,675,669円	30,954,355,870円

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 869,245,000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 809,690,000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 2017年 3月22日 至 2018年 3月20日	自 2018年 3月21日 至 2019年 3月20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	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	[2018年 3月20日現在]	[2019年 3月20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 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 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。	(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 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。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 2017年3月22日 至 2018年3月20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	697,048,943
合計	697,048,943

(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(2017年3月22日から2018年3月20日まで)を指しております。

(自 2018年3月21日 至 2019年3月20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	2,378,654,439

合計	2,378,654,439
----	---------------

(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(2018年3月21日から2019年3月20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

(2018年3月20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	4,239,306,000		4,221,795,000	17,511,000
	東証株価指数先物	4,239,306,000		4,221,795,000	17,511,000
合計		4,239,306,000		4,221,795,000	17,511,000

(2019年3月20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	1,967,631,000		1,963,080,000	4,551,000
	東証株価指数先物	1,967,631,000		1,963,080,000	4,551,000
合計		1,967,631,000		1,963,080,000	4,551,000

(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)

[2018年 3月20日現在]		[2019年 3月20日現在]	
1口当たり純資産額	1.3619円	1口当たり純資産額	1.3116円
(1万口当たり純資産額	13,619円)	(1万口当たり純資産額	13,116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	21,900	800.00	17,520,000	
マルハニチロ	3,400	4,050.00	13,770,000	
サカタのタネ	2,700	3,990.00	10,773,000	
ホクト	2,400	1,999.00	4,797,600	
国際石油開発帝石	90,600	1,056.00	95,673,600	
石油資源開発	3,300	2,302.00	7,596,600	
K & Oエナジーグループ	3,000	1,565.00	4,695,000	
ショーボンドホールディングス	1,700	7,610.00	12,937,000	
ミライト・ホールディングス	5,900	1,593.00	9,398,700	
ベステラ	3,800	1,393.00	5,293,400	
安藤・間	14,100	767.00	10,814,700	
東急建設	7,900	861.00	6,801,900	
コムシスホールディングス	8,200	2,959.00	24,263,800	
ミサワホーム	6,600	787.00	5,194,200	
東建コーポレーション	1,000	7,020.00	7,020,000	
ヤマウラ	6,700	1,000.00	6,700,000	
大成建設	18,600	5,190.00	96,534,000	
大林組	56,500	1,114.00	62,941,000	
清水建設	57,700	966.00	55,738,200	
長谷工コーポレーション	22,900	1,447.00	33,136,300	
鹿島建設	43,400	1,649.00	71,566,600	
西松建設	4,000	2,552.00	10,208,000	
三井住友建設	13,700	772.00	10,576,400	
前田建設工業	13,500	1,145.00	15,457,500	
奥村組	3,000	3,635.00	10,905,000	
東鉄工業	2,800	3,020.00	8,456,000	
戸田建設	22,500	713.00	16,042,500	
熊谷組	2,700	3,470.00	9,369,000	
大東建託	6,600	15,685.00	103,521,000	
N I P P O	5,100	2,131.00	10,868,100	
前田道路	5,800	2,151.00	12,475,800	
東亜建設工業	4,800	1,600.00	7,680,000	
五洋建設	22,100	521.00	11,514,100	
住友林業	12,900	1,492.00	19,246,800	
日本基礎技術	14,500	375.00	5,437,500	
大和ハウス工業	51,600	3,519.00	181,580,400	
積水ハウス	57,100	1,821.00	103,979,100	
北陸電気工事	5,800	874.00	5,069,200	
中電工	3,400	2,298.00	7,813,200	
関電工	8,100	984.00	7,970,400	
きんでん	12,600	1,764.00	22,226,400	
日本電設工業	3,600	2,336.00	8,409,600	
協和エクシオ	7,200	2,978.00	21,441,600	



新日本空調	4,200	1,969.00	8,269,800	
九電工	3,700	3,525.00	13,042,500	
三機工業	6,800	1,232.00	8,377,600	
日揮	16,300	1,529.00	24,922,700	
中外炉工業	2,900	1,810.00	5,249,000	
ヤマト	7,800	486.00	3,790,800	
高砂熱学工業	4,900	1,783.00	8,736,700	
三晃金属工業	1,800	2,890.00	5,202,000	
大気社	2,500	3,280.00	8,200,000	
日比谷総合設備	4,500	1,881.00	8,464,500	
東芝プラントシステム	3,900	2,043.00	7,967,700	
OSJBホールディングス	25,700	269.00	6,913,300	
東洋エンジニアリング	8,000	639.00	5,112,000	
新興プランテック	5,900	1,231.00	7,262,900	
日本製粉	5,300	1,953.00	10,350,900	
日清製粉グループ本社	19,100	2,523.00	48,189,300	
鳥越製粉	6,000	769.00	4,614,000	
日本甜菜製糖	3,300	2,031.00	6,702,300	
三井製糖	2,200	2,935.00	6,457,000	
森永製菓	4,300	4,960.00	21,328,000	
江崎グリコ	5,000	5,760.00	28,800,000	
山崎製パン	13,700	1,838.00	25,180,600	
亀田製菓	1,600	5,430.00	8,688,000	
寿スピリッツ	1,800	4,380.00	7,884,000	
カルビー	7,500	3,020.00	22,650,000	
森永乳業	3,200	3,715.00	11,888,000	
ヤクルト本社	12,400	7,720.00	95,728,000	
明治ホールディングス	11,800	9,020.00	106,436,000	
雪印メグミルク	4,000	2,737.00	10,948,000	
プリマハム	2,800	2,097.00	5,871,600	
日本ハム	7,300	3,990.00	29,127,000	
丸大食品	2,800	1,934.00	5,415,200	
S Foods	1,700	4,100.00	6,970,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,600	696.00	8,073,600	
サッポロホールディングス	6,000	2,540.00	15,240,000	
アサヒグループホールディングス	35,000	4,832.00	169,120,000	
キリンホールディングス	75,500	2,582.50	194,978,750	
宝ホールディングス	12,800	1,322.00	16,921,600	
オエノンホールディングス	16,300	410.00	6,683,000	
コカ・コーラボトラーズジャパン ホールディングス	12,800	2,787.00	35,673,600	
サントリー食品インターナショナル	11,300	5,080.00	57,404,000	
ダイドーグループホールディングス	1,300	5,080.00	6,604,000	
伊藤園	5,500	5,520.00	30,360,000	

キーコーヒー	2,900	2,150.00	6,235,000	
ユニカフェ	4,000	995.00	3,980,000	
ジャパンフーズ	4,300	1,280.00	5,504,000	
日清オイリオグループ	2,400	3,410.00	8,184,000	
不二製油グループ本社	4,200	3,760.00	15,792,000	
J - オイルミルズ	1,300	4,140.00	5,382,000	
キッコーマン	11,100	5,490.00	60,939,000	
味の素	36,900	1,760.00	64,944,000	
キューピー	9,400	2,654.00	24,947,600	
ハウス食品グループ本社	6,300	4,395.00	27,688,500	
カゴメ	6,700	3,115.00	20,870,500	
アリアケジャパン	1,500	6,080.00	9,120,000	
ニチレイ	8,600	2,737.00	23,538,200	
東洋水産	8,600	4,130.00	35,518,000	
日清食品ホールディングス	7,200	7,570.00	54,504,000	
フジッコ	3,000	2,222.00	6,666,000	
ロック・フィールド	5,100	1,635.00	8,338,500	
日本たばこ産業	96,500	2,794.00	269,621,000	
ユーグレナ	10,500	698.00	7,329,000	
片倉工業	5,500	1,294.00	7,117,000	
グンゼ	1,500	4,760.00	7,140,000	
東洋紡	6,600	1,570.00	10,362,000	
倉敷紡績	2,700	2,140.00	5,778,000	
日本毛織	8,300	942.00	7,818,600	
帝国繊維	3,100	2,807.00	8,701,700	
帝人	13,600	1,907.00	25,935,200	
東レ	126,400	734.50	92,840,800	
日本フェルト	12,700	469.00	5,956,300	
セーレン	4,400	1,712.00	7,532,800	
小松マテーレ	8,000	795.00	6,360,000	
ワコールホールディングス	4,600	2,726.00	12,539,600	
ホギメディカル	2,400	3,895.00	9,348,000	
T S Iホールディングス	10,200	659.00	6,721,800	
三陽商会	2,800	1,663.00	4,656,400	
オンワードホールディングス	10,700	573.00	6,131,100	
ゴールドウイン	1,500	14,480.00	21,720,000	
デサント	3,900	2,555.00	9,964,500	
特種東海製紙	1,700	4,245.00	7,216,500	
王子ホールディングス	73,900	707.00	52,247,300	
日本製紙	7,800	2,313.00	18,041,400	
三菱製紙	8,800	543.00	4,778,400	
北越コーポレーション	12,600	651.00	8,202,600	
大王製紙	7,500	1,303.00	9,772,500	

レンゴー	17,200	1,017.00	17,492,400	
ザ・パック	1,900	3,400.00	6,460,000	
クラレ	27,800	1,437.00	39,948,600	
旭化成	116,100	1,189.00	138,042,900	
共和レザー	5,200	730.00	3,796,000	
昭和電工	10,900	3,915.00	42,673,500	
住友化学	129,400	537.00	69,487,800	
日産化学	10,100	5,200.00	52,520,000	
クレハ	1,600	6,530.00	10,448,000	
石原産業	5,800	1,132.00	6,565,600	
片倉コープアグリ	4,200	1,174.00	4,930,800	
日本曹達	3,000	2,974.00	8,922,000	
東ソー	25,500	1,754.00	44,727,000	
トクヤマ	4,700	2,641.00	12,412,700	
セントラル硝子	3,300	2,555.00	8,431,500	
東亜合成	10,500	1,179.00	12,379,500	
大阪ソーダ	2,500	2,801.00	7,002,500	
デンカ	6,300	3,215.00	20,254,500	
信越化学工業	28,700	9,233.00	264,987,100	
堺化学工業	3,600	2,455.00	8,838,000	
エア・ウォーター	13,600	1,643.00	22,344,800	
大陽日酸	13,700	1,632.00	22,358,400	
日本パーカライジング	8,700	1,450.00	12,615,000	
ステラ ケミファ	2,200	3,085.00	6,787,000	
日本触媒	2,800	7,490.00	20,972,000	
カネカ	4,300	4,310.00	18,533,000	
三菱瓦斯化学	16,500	1,669.00	27,538,500	
三井化学	15,000	2,785.00	41,775,000	
J S R	16,800	1,757.00	29,517,600	
東京応化工業	2,700	3,125.00	8,437,500	
三菱ケミカルホールディングス	109,100	818.20	89,265,620	
K Hネオケム	2,900	2,733.00	7,925,700	
ダイセル	25,500	1,192.00	30,396,000	
住友ベークライト	2,700	4,090.00	11,043,000	
積水化学工業	35,900	1,788.00	64,189,200	
日本ゼオン	15,000	1,129.00	16,935,000	
アイカ工業	4,900	3,610.00	17,689,000	
宇部興産	8,300	2,358.00	19,571,400	
旭有機材	3,500	1,686.00	5,901,000	
日立化成	8,000	2,525.00	20,200,000	
タイガースポリマー	5,800	594.00	3,445,200	
ミライアル	4,500	1,113.00	5,008,500	
日本化薬	10,900	1,340.00	14,606,000	

A D E K A	7,800	1,626.00	12,682,800	
日油	6,300	3,825.00	24,097,500	
ハリマ化成グループ	5,600	1,090.00	6,104,000	
花王	40,400	8,843.00	357,257,200	
ニイタカ	2,800	1,461.00	4,090,800	
三洋化成工業	1,100	5,320.00	5,852,000	
日本ペイントホールディングス	13,400	4,400.00	58,960,000	
関西ペイント	18,500	2,148.00	39,738,000	
中国塗料	7,600	975.00	7,410,000	
太陽ホールディングス	2,000	3,655.00	7,310,000	
D I C	7,400	3,335.00	24,679,000	
サカタインクス	4,700	1,040.00	4,888,000	
東洋インキ S C ホールディングス	3,300	2,529.00	8,345,700	
富士フイルムホールディングス	34,600	5,090.00	176,114,000	
資生堂	33,000	7,937.00	261,921,000	
ライオン	23,400	2,409.00	56,370,600	
高砂香料工業	1,800	3,310.00	5,958,000	
マンダム	3,600	2,927.00	10,537,200	
ミルボン	2,000	5,150.00	10,300,000	
ファンケル	7,200	2,871.00	20,671,200	
コーセー	2,800	19,220.00	53,816,000	
コタ	3,100	1,486.00	4,606,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	7,200	3,530.00	25,416,000	
ノエビアホールディングス	1,500	5,630.00	8,445,000	
エステー	3,300	1,922.00	6,342,600	
長谷川香料	3,600	1,845.00	6,642,000	
小林製薬	4,600	9,110.00	41,906,000	
荒川化学工業	4,400	1,265.00	5,566,000	
メック	5,000	1,011.00	5,055,000	
タカラバイオ	4,200	2,692.00	11,306,400	
アース製薬	1,400	5,200.00	7,280,000	
大成ラミック	1,400	2,812.00	3,936,800	
クミアイ化学工業	11,200	766.00	8,579,200	
日本農薬	10,600	467.00	4,950,200	
日東電工	12,500	5,977.00	74,712,500	
レック	2,400	1,515.00	3,636,000	
前澤化成工業	3,200	1,018.00	3,257,600	
エフピコ	1,300	6,570.00	8,541,000	
天馬	3,100	2,043.00	6,333,300	
信越ポリマー	9,600	827.00	7,939,200	
ニフコ	6,500	2,828.00	18,382,000	
バルカー	2,100	2,216.00	4,653,600	
ユニ・チャーム	35,300	3,695.00	130,433,500	

協和発酵キリン	21,000	2,352.00	49,392,000	
武田薬品工業	143,500	4,753.00	682,055,500	
アステラス製薬	153,500	1,757.00	269,699,500	
大日本住友製薬	12,400	2,771.00	34,360,400	
塩野義製薬	21,800	6,837.00	149,046,600	
田辺三菱製薬	17,500	1,590.00	27,825,000	
あすか製薬	6,100	1,229.00	7,496,900	
日本新薬	4,300	7,490.00	32,207,000	
中外製薬	17,400	7,640.00	132,936,000	
科研製薬	2,900	5,340.00	15,486,000	
エーザイ	19,900	9,065.00	180,393,500	
ロート製薬	8,500	2,931.00	24,913,500	
小野薬品工業	39,300	2,246.50	88,287,450	
久光製薬	4,900	5,180.00	25,382,000	
持田製薬	1,300	11,280.00	14,664,000	
参天製薬	31,900	1,640.00	52,316,000	
ツムラ	5,200	3,390.00	17,628,000	
日医工	5,000	1,562.00	7,810,000	
キッセイ薬品工業	2,800	2,919.00	8,173,200	
生化学工業	4,600	1,334.00	6,136,400	
栄研化学	2,900	2,730.00	7,917,000	
鳥居薬品	3,400	2,302.00	7,826,800	
JCRファーマ	1,300	6,500.00	8,450,000	
東和薬品	1,000	9,060.00	9,060,000	
沢井製薬	3,400	6,500.00	22,100,000	
ゼリア新薬工業	3,800	1,911.00	7,261,800	
第一三共	47,600	4,495.00	213,962,000	
キョーリン製薬ホールディングス	4,300	2,216.00	9,528,800	
大幸薬品	2,800	1,906.00	5,336,800	
大塚ホールディングス	31,700	4,623.00	146,549,100	
大正製薬ホールディングス	3,700	11,150.00	41,255,000	
ペプチドリーム	7,700	5,400.00	41,580,000	
昭和シェル石油	15,600	1,745.00	27,222,000	
ニチレキ	6,900	1,123.00	7,748,700	
出光興産	13,000	4,095.00	53,235,000	
JXTGホールディングス	282,600	542.90	153,423,540	
コスモエネルギーホールディングス	4,700	2,687.00	12,628,900	
横浜ゴム	9,600	2,057.00	19,747,200	
TOYO TIRE	8,400	1,304.00	10,953,600	
ブリヂストン	51,100	4,315.00	220,496,500	
住友ゴム工業	14,900	1,357.00	20,219,300	
オカモト	1,300	5,810.00	7,553,000	
ニッタ	2,100	3,660.00	7,686,000	

住友理工	8,600	943.00	8,109,800	
バンドー化学	4,400	1,158.00	5,095,200	
日東紡績	3,100	2,010.00	6,231,000	
A G C	16,800	3,935.00	66,108,000	
日本山村硝子	2,400	1,443.00	3,463,200	
日本電気硝子	7,200	2,973.00	21,405,600	
住友大阪セメント	3,400	4,420.00	15,028,000	
太平洋セメント	10,500	3,730.00	39,165,000	
日本ヒューム	5,800	752.00	4,361,600	
東海カーボン	15,100	1,406.00	21,230,600	
東洋炭素	2,700	2,108.00	5,691,600	
T O T O	12,900	4,460.00	57,534,000	
日本碍子	20,500	1,707.00	34,993,500	
日本特殊陶業	14,100	2,178.00	30,709,800	
ニチアス	4,400	2,202.00	9,688,800	
ニチハ	2,700	3,005.00	8,113,500	
新日鐵住金	76,500	1,994.50	152,579,250	
神戸製鋼所	30,200	860.00	25,972,000	
合同製鐵	2,300	1,743.00	4,008,900	
ジェイ エフ イー ホールディングス	44,500	1,966.00	87,487,000	
東京製鐵	9,300	923.00	8,583,900	
共英製鋼	2,200	1,635.00	3,597,000	
大和工業	3,400	3,055.00	10,387,000	
大阪製鐵	3,000	1,925.00	5,775,000	
淀川製鋼所	3,200	2,177.00	6,966,400	
丸一鋼管	5,800	3,290.00	19,082,000	
大同特殊鋼	2,700	4,450.00	12,015,000	
山陽特殊製鋼	3,000	2,300.00	6,900,000	
愛知製鋼	1,000	3,525.00	3,525,000	
日立金属	18,100	1,315.00	23,801,500	
大平洋金属	1,300	2,904.00	3,775,200	
新日本電工	26,800	228.00	6,110,400	
三菱製鋼	3,200	1,625.00	5,200,000	
シンニッタン	12,000	340.00	4,080,000	
日本軽金属ホールディングス	46,300	246.00	11,389,800	
三井金属鉱業	4,200	2,880.00	12,096,000	
東邦亜鉛	1,400	3,360.00	4,704,000	
三菱マテリアル	10,800	2,965.00	32,022,000	
住友金属鉱山	22,500	3,267.00	73,507,500	
D O W A ホールディングス	4,000	3,685.00	14,740,000	
古河機械金属	4,500	1,464.00	6,588,000	
U A C J	2,900	2,134.00	6,188,600	
古河電気工業	4,700	2,933.00	13,785,100	

住友電気工業	61,500	1,513.00	93,049,500	
フジクラ	19,000	434.00	8,246,000	
タツタ電線	11,600	459.00	5,324,400	
リョービ	2,900	2,495.00	7,235,500	
アサヒホールディングス	3,700	2,150.00	7,955,000	
トーカロ	6,400	866.00	5,542,400	
SUMCO	18,100	1,287.00	23,294,700	
東洋製罐グループホールディングス	10,400	2,391.00	24,866,400	
コロナ	4,100	1,104.00	4,526,400	
横河ブリッジホールディングス	4,400	1,943.00	8,549,200	
駒井ハルテック	1,800	1,887.00	3,396,600	
三和ホールディングス	16,500	1,285.00	21,202,500	
文化シャッター	7,700	823.00	6,337,100	
三協立山	6,000	1,551.00	9,306,000	
LIXILグループ	24,600	1,493.00	36,727,800	
ノーリツ	4,200	1,698.00	7,131,600	
長府製作所	2,800	2,288.00	6,406,400	
リンナイ	3,000	7,650.00	22,950,000	
日東精工	8,000	550.00	4,400,000	
東プレ	3,300	2,092.00	6,903,600	
高周波熱錬	7,800	911.00	7,105,800	
バイオラックス	2,800	2,188.00	6,126,400	
日本発條	16,800	976.00	16,396,800	
三益半導体工業	4,600	1,519.00	6,987,400	
日本製鋼所	5,200	2,017.00	10,488,400	
三浦工業	7,000	2,554.00	17,878,000	
タクマ	5,900	1,347.00	7,947,300	
オークマ	2,100	5,900.00	12,390,000	
東芝機械	3,000	2,223.00	6,669,000	
アマダホールディングス	26,000	1,104.00	28,704,000	
アイダエンジニアリング	7,600	816.00	6,201,600	
FUJ I	5,000	1,487.00	7,435,000	
牧野フライス製作所	1,900	4,190.00	7,961,000	
オーエスジー	8,100	2,066.00	16,734,600	
旭ダイヤモンド工業	9,200	739.00	6,798,800	
DMG森精機	10,300	1,428.00	14,708,400	
ディスコ	2,200	14,850.00	32,670,000	
日東工器	2,900	2,215.00	6,423,500	
島精機製作所	2,600	3,545.00	9,217,000	
日阪製作所	7,000	895.00	6,265,000	
ナブテスコ	8,900	3,130.00	27,857,000	
S M C	4,900	39,490.00	193,501,000	
ユニオンツール	1,800	2,861.00	5,149,800	

オイレス工業	3,200	1,914.00	6,124,800	
サトーホールディングス	2,900	2,526.00	7,325,400	
小松製作所	75,300	2,693.00	202,782,900	
住友重機械工業	9,400	3,675.00	34,545,000	
日立建機	6,600	3,015.00	19,899,000	
巴工業	2,600	2,534.00	6,588,400	
井関農機	3,300	1,694.00	5,590,200	
タカキタ	6,000	603.00	3,618,000	
クボタ	89,200	1,598.00	142,541,600	
月島機械	4,800	1,443.00	6,926,400	
帝国電機製作所	4,600	1,117.00	5,138,200	
新東工業	6,000	974.00	5,844,000	
小森コーポレーション	6,500	1,162.00	7,553,000	
鶴見製作所	4,100	2,119.00	8,687,900	
荏原製作所	7,200	3,040.00	21,888,000	
西島製作所	6,400	939.00	6,009,600	
ダイキン工業	22,700	12,610.00	286,247,000	
栗田工業	8,900	2,755.00	24,519,500	
椿本チエイン	2,100	3,995.00	8,389,500	
ダイフク	9,100	5,700.00	51,870,000	
タダノ	8,100	1,039.00	8,415,900	
フジテック	6,300	1,251.00	7,881,300	
C K D	5,100	1,015.00	5,176,500	
平和	4,700	2,238.00	10,518,600	
S A N K Y O	4,200	4,215.00	17,703,000	
日本金銭機械	5,800	1,089.00	6,316,200	
福島工業	1,400	3,725.00	5,215,000	
竹内製作所	4,000	1,967.00	7,868,000	
アマノ	4,800	2,490.00	11,952,000	
グローリー	4,700	2,674.00	12,567,800	
大和冷機工業	7,100	1,131.00	8,030,100	
セガサミーホールディングス	16,800	1,324.00	22,243,200	
リケン	1,200	5,160.00	6,192,000	
ホシザキ	4,900	6,860.00	33,614,000	
大豊工業	4,800	922.00	4,425,600	
日本精工	34,600	1,007.00	34,842,200	
N T N	38,400	341.00	13,094,400	
ジェイテクト	16,600	1,375.00	22,825,000	
不二越	1,500	4,590.00	6,885,000	
日本トムソン	9,500	513.00	4,873,500	
T H K	10,500	2,729.00	28,654,500	
ユーシン精機	5,200	1,050.00	5,460,000	
キッツ	7,800	781.00	6,091,800	



マキタ	20,200	3,700.00	74,740,000	
日立造船	16,000	338.00	5,408,000	
三菱重工業	27,900	4,644.00	129,567,600	
I H I	12,900	2,707.00	34,920,300	
スター精密	4,100	1,674.00	6,863,400	
日清紡ホールディングス	9,200	967.00	8,896,400	
イビデン	10,100	1,689.00	17,058,900	
コニカミノルタ	37,000	1,112.00	41,144,000	
ブラザー工業	21,400	2,022.00	43,270,800	
ミネベアミツミ	30,500	1,628.00	49,654,000	
日立製作所	74,900	3,610.00	270,389,000	
三菱電機	166,000	1,435.00	238,210,000	
富士電機	10,800	3,325.00	35,910,000	
安川電機	19,400	3,420.00	66,348,000	
明電舎	4,700	1,562.00	7,341,400	
東芝テック	3,100	3,280.00	10,168,000	
マブチモーター	4,500	3,895.00	17,527,500	
日本電産	20,000	13,420.00	268,400,000	
東光高岳	3,400	1,343.00	4,566,200	
ダイヘン	2,500	2,791.00	6,977,500	
日新電機	6,500	987.00	6,415,500	
オムロン	17,800	5,150.00	91,670,000	
日東工業	4,000	2,235.00	8,940,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,800	2,158.00	12,516,400	
メルコホールディングス	2,200	3,800.00	8,360,000	
テクノメディカ	2,500	2,122.00	5,305,000	
日本電気	21,700	3,765.00	81,700,500	
富士通	16,000	7,836.00	125,376,000	
沖電気工業	6,900	1,344.00	9,273,600	
サンケン電気	2,500	2,003.00	5,007,500	
アイホン	3,100	1,818.00	5,635,800	
ルネサスエレクトロニクス	17,100	566.00	9,678,600	
セイコーエプソン	21,000	1,682.00	35,322,000	
ワコム	16,700	449.00	7,498,300	
アルバック	3,700	3,150.00	11,655,000	
E I Z O	1,800	4,445.00	8,001,000	
日本信号	6,700	985.00	6,599,500	
能美防災	2,800	1,829.00	5,121,200	
ホーチキ	2,900	1,150.00	3,335,000	
パナソニック	190,200	950.80	180,842,160	
シャープ	16,500	1,233.00	20,344,500	
アンリツ	11,100	2,106.00	23,376,600	
富士通ゼネラル	5,800	1,469.00	8,520,200	

ソニー	111,500	4,951.00	552,036,500	
TDK	8,700	8,760.00	76,212,000	
アルプスアルパイン	17,900	2,264.00	40,525,600	
日本トリム	900	5,880.00	5,292,000	
フォスター電機	5,600	1,563.00	8,752,800	
ヨコオ	3,900	1,609.00	6,275,100	
ホシデン	6,700	886.00	5,936,200	
ヒロセ電機	2,400	11,600.00	27,840,000	
日本航空電子工業	5,200	1,528.00	7,945,600	
アイコム	2,600	2,266.00	5,891,600	
船井電機	8,300	716.00	5,942,800	
横河電機	16,900	2,215.00	37,433,500	
アズビル	10,500	2,567.00	26,953,500	
日本光電工業	7,200	3,600.00	25,920,000	
堀場製作所	3,200	5,950.00	19,040,000	
アドバンテスト	11,100	2,428.00	26,950,800	
キーエンス	8,200	68,090.00	558,338,000	
日置電機	2,200	4,605.00	10,131,000	
シスメックス	13,000	7,007.00	91,091,000	
OBARA GROUP	1,800	3,650.00	6,570,000	
コーセル	6,300	1,163.00	7,326,900	
イリソ電子工業	1,600	4,900.00	7,840,000	
オブテックスグループ	3,400	1,800.00	6,120,000	
千代田インテグレ	2,300	2,085.00	4,795,500	
レーザーテック	3,500	4,520.00	15,820,000	
スタンレー電気	11,600	3,010.00	34,916,000	
ウシオ電機	10,400	1,352.00	14,060,800	
日本セラミック	2,600	2,888.00	7,508,800	
図研	4,900	1,482.00	7,261,800	
カシオ計算機	14,500	1,470.00	21,315,000	
ファナック	15,800	19,280.00	304,624,000	
ローム	8,000	6,890.00	55,120,000	
浜松ホトニクス	12,000	4,205.00	50,460,000	
三井ハイテック	5,000	1,145.00	5,725,000	
新光電気工業	8,600	860.00	7,396,000	
京セラ	25,200	6,408.00	161,481,600	
太陽誘電	7,700	2,139.00	16,470,300	
村田製作所	17,400	16,600.00	288,840,000	
双葉電子工業	3,800	1,812.00	6,885,600	
ニチコン	6,300	1,008.00	6,350,400	
日本ケミコン	2,100	1,968.00	4,132,800	
KOA	4,100	1,529.00	6,268,900	
小糸製作所	10,000	6,260.00	62,600,000	

ミツバ	8,500	687.00	5,839,500	
S C R E E Nホールディングス	3,000	4,585.00	13,755,000	
キヤノン電子	4,300	1,766.00	7,593,800	
キヤノン	89,600	3,213.00	287,884,800	
リコー	50,600	1,167.00	59,050,200	
東京エレクトロン	11,100	15,700.00	174,270,000	
トヨタ紡織	5,500	1,733.00	9,531,500	
ユニプレス	3,700	1,739.00	6,434,300	
豊田自動織機	13,400	5,750.00	77,050,000	
モリタホールディングス	3,800	1,784.00	6,779,200	
デンソー	36,900	4,478.00	165,238,200	
東海理化電機製作所	4,500	1,927.00	8,671,500	
三井E & Sホールディングス	6,900	1,188.00	8,197,200	
川崎重工業	13,100	2,720.00	35,632,000	
日産自動車	196,400	951.40	186,854,960	
いすゞ自動車	52,300	1,484.50	77,639,350	
トヨタ自動車	185,400	6,721.00	1,246,073,400	70,000株
日野自動車	20,400	955.00	19,482,000	
三菱自動車工業	62,300	603.00	37,566,900	
武蔵精密工業	4,000	1,480.00	5,920,000	
日産車体	8,400	973.00	8,173,200	
新明和工業	7,600	1,361.00	10,343,600	
極東開発工業	4,800	1,550.00	7,440,000	
日信工業	4,900	1,456.00	7,134,400	
トピー工業	2,200	2,290.00	5,038,000	
ティラド	2,100	2,283.00	4,794,300	
N O K	8,800	1,771.00	15,584,800	
フタバ産業	11,700	522.00	6,107,400	
K Y B	2,700	2,772.00	7,484,400	
プレス工業	15,500	589.00	9,129,500	
ケーヒン	4,000	1,848.00	7,392,000	
アイシン精機	13,700	4,145.00	56,786,500	
マツダ	52,600	1,256.00	66,065,600	
今仙電機製作所	5,000	983.00	4,915,000	
本田技研工業	140,300	3,090.00	433,527,000	
スズキ	30,400	4,909.00	149,233,600	
S U B A R U	51,600	2,712.00	139,939,200	
ヤマハ発動機	23,700	2,180.00	51,666,000	
ショーワ	5,900	1,460.00	8,614,000	
エクセディ	2,100	2,509.00	5,268,900	
豊田合成	5,600	2,402.00	13,451,200	
愛三工業	8,400	694.00	5,829,600	
ヨロズ	4,100	1,600.00	6,560,000	

エフ・シー・シー	2,800	2,401.00	6,722,800	
シマノ	6,700	17,000.00	113,900,000	
テイ・エス テック	3,900	3,230.00	12,597,000	
テルモ	23,500	6,940.00	163,090,000	
クリエートメディック	4,400	952.00	4,188,800	
島津製作所	21,200	3,075.00	65,190,000	
ブイ・テクノロジー	500	13,830.00	6,915,000	
東京精密	2,900	2,807.00	8,140,300	
マニー	2,000	5,410.00	10,820,000	
ニコン	29,300	1,585.00	46,440,500	
トプコン	8,600	1,442.00	12,401,200	
オリンパス	24,900	4,855.00	120,889,500	
理研計器	2,700	2,191.00	5,915,700	
タムロン	4,800	2,110.00	10,128,000	
HOYA	33,500	7,317.00	245,119,500	
朝日インテック	6,100	5,100.00	31,110,000	
シチズン時計	19,400	623.00	12,086,200	
セイコーホールディングス	3,100	2,740.00	8,494,000	
ニプロ	11,900	1,442.00	17,159,800	
パラマウントベッドホールディングス	2,000	5,060.00	10,120,000	
バンダイナムコホールディングス	17,300	4,975.00	86,067,500	
アイフィスジャパン	6,100	577.00	3,519,700	
パイロットコーポレーション	2,800	4,515.00	12,642,000	
トッパン・フォームズ	6,700	966.00	6,472,200	
フジシールインターナショナル	3,800	3,975.00	15,105,000	
タカラトミー	7,600	1,197.00	9,097,200	
タカノ	4,900	856.00	4,194,400	
大建工業	4,100	2,185.00	8,958,500	
凸版印刷	23,600	1,698.00	40,072,800	
大日本印刷	23,300	2,499.00	58,226,700	
N I S S H A	4,500	1,187.00	5,341,500	
アシックス	16,400	1,432.00	23,484,800	
小松ウオール工業	2,300	1,920.00	4,416,000	
ヤマハ	9,800	5,540.00	54,292,000	
クリナップ	6,800	587.00	3,991,600	
ビジョン	10,100	4,625.00	46,712,500	
キングジム	5,800	855.00	4,959,000	
リンテック	3,800	2,474.00	9,401,200	
イトーキ	9,900	531.00	5,256,900	
任天堂	10,200	30,480.00	310,896,000	
三菱鉛筆	2,900	2,206.00	6,397,400	
タカラスタANDARD	4,100	1,700.00	6,970,000	
コクヨ	7,600	1,640.00	12,464,000	

オカムラ	5,800	1,139.00	6,606,200	
美津濃	2,500	2,633.00	6,582,500	
東京電力ホールディングス	132,400	696.00	92,150,400	
中部電力	50,700	1,759.50	89,206,650	
関西電力	67,800	1,703.50	115,497,300	
中国電力	22,900	1,446.00	33,113,400	
北陸電力	16,500	887.00	14,635,500	
東北電力	38,600	1,450.00	55,970,000	
四国電力	15,300	1,371.00	20,976,300	
九州電力	34,300	1,334.00	45,756,200	
北海道電力	16,100	657.00	10,577,700	
沖縄電力	3,200	2,022.00	6,470,400	
電源開発	13,300	2,734.00	36,362,200	
東京瓦斯	32,600	3,074.00	100,212,400	
大阪瓦斯	32,500	2,285.00	74,262,500	
東邦瓦斯	8,200	5,040.00	41,328,000	
北海道瓦斯	2,700	1,460.00	3,942,000	
西部瓦斯	2,800	2,526.00	7,072,800	
静岡ガス	7,900	938.00	7,410,200	
東武鉄道	17,700	3,225.00	57,082,500	
相鉄ホールディングス	5,700	3,390.00	19,323,000	
東京急行電鉄	45,500	1,937.00	88,133,500	
京浜急行電鉄	22,900	1,859.00	42,571,100	
小田急電鉄	26,900	2,645.00	71,150,500	
京王電鉄	9,300	6,990.00	65,007,000	
京成電鉄	12,400	3,970.00	49,228,000	
富士急行	2,300	4,185.00	9,625,500	
東日本旅客鉄道	29,600	10,710.00	317,016,000	
西日本旅客鉄道	14,900	8,369.00	124,698,100	
東海旅客鉄道	14,900	25,335.00	377,491,500	
西武ホールディングス	21,500	1,872.00	40,248,000	
西日本鉄道	4,500	2,721.00	12,244,500	
近鉄グループホールディングス	15,800	5,160.00	81,528,000	
阪急阪神ホールディングス	21,100	4,115.00	86,826,500	
南海電気鉄道	7,000	3,120.00	21,840,000	
京阪ホールディングス	7,100	4,455.00	31,630,500	
名古屋鉄道	12,600	3,030.00	38,178,000	
日本通運	6,200	6,280.00	38,936,000	
ヤマトホールディングス	27,800	2,924.00	81,287,200	
山九	4,400	5,500.00	24,200,000	
丸運	17,500	284.00	4,970,000	
センコーグループホールディングス	9,600	938.00	9,004,800	
トナミホールディングス	1,000	5,990.00	5,990,000	

ニッコンホールディングス	5,800	2,709.00	15,712,200	
日本石油輸送	1,600	2,886.00	4,617,600	
福山通運	2,200	4,330.00	9,526,000	
セイノーホールディングス	11,900	1,572.00	18,706,800	
日立物流	3,500	3,380.00	11,830,000	
C & F ロジホールディングス	5,000	1,308.00	6,540,000	
九州旅客鉄道	13,300	3,645.00	48,478,500	
S Gホールディングス	15,100	3,235.00	48,848,500	
日本郵船	13,400	1,638.00	21,949,200	
商船三井	9,400	2,414.00	22,691,600	
川崎汽船	6,100	1,234.00	7,527,400	
飯野海運	13,500	393.00	5,305,500	
日本航空	28,900	3,875.00	111,987,500	
A N Aホールディングス	28,800	4,048.00	116,582,400	
三菱倉庫	5,300	2,986.00	15,825,800	
三井倉庫ホールディングス	2,800	1,804.00	5,051,200	
住友倉庫	5,800	1,425.00	8,265,000	
東陽倉庫	16,700	323.00	5,394,100	
安田倉庫	6,000	922.00	5,532,000	
上組	9,800	2,535.00	24,843,000	
キムラユニティー	3,900	1,107.00	4,317,300	
キューソー流通システム	1,900	2,020.00	3,838,000	
近鉄エクスプレス	4,300	1,700.00	7,310,000	
エーアイティー	5,300	1,152.00	6,105,600	
NEC ネットエスアイ	3,700	2,726.00	10,086,200	
システナ	5,800	1,144.00	6,635,200	
デジタルアーツ	900	8,830.00	7,947,000	
新日鉄住金ソリューションズ	3,500	2,945.00	10,307,500	
T I S	5,500	5,090.00	27,995,000	
ネオス	4,900	1,014.00	4,968,600	
電算システム	3,200	3,340.00	10,688,000	
グリー	11,900	471.00	5,604,900	
コーエーテクモホールディングス	4,100	2,058.00	8,437,800	
ブレインパッド	1,200	6,080.00	7,296,000	
K L a b	6,900	864.00	5,961,600	
ネクソン	41,900	1,687.00	70,685,300	
エイチーム	3,100	1,796.00	5,567,600	
コロブラ	7,700	692.00	5,328,400	
サイバーリンクス	2,800	1,036.00	2,900,800	
C A R T A H O L D I N G S	3,500	972.00	3,402,000	
ティーガイア	2,500	1,919.00	4,797,500	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	42,300	405.00	17,131,500	
G M O ペイメントゲートウェイ	2,600	7,620.00	19,812,000	

ザッパラス	11,600	404.00	4,686,400	
インターネットイニシアティブ	3,100	2,275.00	7,052,500	
L I N E	4,900	3,850.00	18,865,000	
フェイス	3,000	833.00	2,499,000	
野村総合研究所	10,500	5,000.00	52,500,000	
C E ホールディングス	7,200	740.00	5,328,000	
インテージホールディングス	7,200	850.00	6,120,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ ホールディングス	3,900	1,680.00	6,552,000	
フジ・メディア・ホールディングス	17,200	1,556.00	26,763,200	
オービック	5,600	11,050.00	61,880,000	
ヤフー	108,200	277.00	29,971,400	
トレンドマイクロ	8,700	5,270.00	45,849,000	
日本オラクル	2,700	8,400.00	22,680,000	
フューチャー	4,700	1,701.00	7,994,700	
C A C H o l d i n g s	7,300	1,364.00	9,957,200	
ソフトバンク・テクノロジー	3,000	2,358.00	7,074,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,600	4,285.00	6,856,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,500	2,587.00	19,402,500	
大塚商会	8,800	3,995.00	35,156,000	
サイボウズ	12,800	768.00	9,830,400	
電通国際情報サービス	2,900	3,675.00	10,657,500	
デジタルガレージ	3,200	3,110.00	9,952,000	
ウェザーニューズ	1,500	3,185.00	4,777,500	
日本エンタープライズ	18,900	170.00	3,213,000	
ネットワンシステムズ	5,600	2,708.00	15,164,800	
アルゴグラフィックス	2,100	4,620.00	9,702,000	
エイベックス	4,400	1,471.00	6,472,400	
日本ユニシス	5,100	2,868.00	14,626,800	
兼松エレクトロニクス	2,400	3,390.00	8,136,000	
東京放送ホールディングス	10,800	2,076.00	22,420,800	
日本テレビホールディングス	15,200	1,737.00	26,402,400	
テレビ朝日ホールディングス	4,200	2,020.00	8,484,000	
スカパー J S A T ホールディングス	13,400	484.00	6,485,600	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,468.00	3,455,200	
日本電信電話	111,700	4,778.00	533,702,600	35,000株
K D D I	143,800	2,483.00	357,055,400	
ソフトバンク	128,500	1,322.00	169,877,000	
光通信	1,900	21,230.00	40,337,000	
N T T ドコモ	117,200	2,479.00	290,538,800	
G M O インターネット	5,500	1,924.00	10,582,000	
カドカワ	5,000	1,166.00	5,830,000	
ゼンリン	3,300	2,957.00	9,758,100	
松竹	1,100	11,720.00	12,892,000	

東宝	10,800	4,230.00	45,684,000	
東映	700	15,000.00	10,500,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	44,000	1,229.00	54,076,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	1,881.00	4,514,400	
D T S	2,400	4,190.00	10,056,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,600	3,705.00	28,158,000	
カプコン	7,100	2,451.00	17,402,100	
S C S K	4,200	4,915.00	20,643,000	
アイネス	7,300	1,301.00	9,497,300	
T K C	2,200	4,180.00	9,196,000	
富士ソフト	2,400	4,165.00	9,996,000	
N S D	3,800	2,549.00	9,686,200	
コナミホールディングス	6,700	4,810.00	32,227,000	
ソフトバンクグループ	68,300	10,970.00	749,251,000	
伊藤忠食品	1,200	4,930.00	5,916,000	
エレマテック	2,100	1,662.00	3,490,200	
J A L U X	1,700	2,623.00	4,459,100	
双日	92,500	399.00	36,907,500	
アルフレッサ ホールディングス	18,400	3,305.00	60,812,000	
横浜冷凍	7,000	908.00	6,356,000	
神戸物産	2,400	3,990.00	9,576,000	
あい ホールディングス	4,000	1,867.00	7,468,000	
ダイワボウホールディングス	1,500	6,540.00	9,810,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	5,300	1,539.00	8,156,700	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,900	1,093.00	5,355,700	
U K C ホールディングス	3,100	1,939.00	6,010,900	
O C H I ホールディングス	3,700	1,299.00	4,806,300	
T O K A I ホールディングス	8,700	860.00	7,482,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,500	4,540.00	15,890,000	
明治電機工業	2,800	1,723.00	4,824,400	
コメダホールディングス	3,600	2,154.00	7,754,400	
エコトレーディング	8,700	553.00	4,811,100	
ナガイレーベン	2,500	2,448.00	6,120,000	
三菱食品	2,900	2,860.00	8,294,000	
松田産業	3,900	1,440.00	5,616,000	
第一興商	2,400	5,620.00	13,488,000	
メディパルホールディングス	17,500	2,674.00	46,795,000	
アズワン	1,200	8,900.00	10,680,000	
尾家産業	3,300	1,292.00	4,263,600	
ドウシヤ	4,700	1,815.00	8,530,500	
丸文	8,200	661.00	5,420,200	
橋本総業ホールディングス	3,100	1,602.00	4,966,200	



日本ライフライン	4,900	1,841.00	9,020,900	
進和	3,300	2,183.00	7,203,900	
オーハシテクニカ	3,400	1,452.00	4,936,800	
白銅	3,000	1,673.00	5,019,000	
伊藤忠商事	114,700	2,056.00	235,823,200	
丸紅	161,900	792.70	128,338,130	
長瀬産業	9,600	1,619.00	15,542,400	
豊田通商	18,400	3,705.00	68,172,000	
兼松	6,800	1,349.00	9,173,200	
三井物産	135,200	1,807.50	244,374,000	
日本紙パルプ商事	1,600	4,410.00	7,056,000	
日立ハイテクノロジーズ	5,100	4,585.00	23,383,500	
山善	7,600	1,206.00	9,165,600	
住友商事	97,000	1,606.00	155,782,000	
内田洋行	2,400	3,345.00	8,028,000	
三菱商事	115,000	3,222.00	370,530,000	
キャノンマーケティングジャパン	4,500	2,183.00	9,823,500	
西華産業	3,600	1,467.00	5,281,200	
菱洋エレクトロ	5,300	1,662.00	8,808,600	
東京産業	7,600	518.00	3,936,800	
阪和興業	2,900	3,325.00	9,642,500	
岩谷産業	3,500	3,695.00	12,932,500	
イワキ	8,600	394.00	3,388,400	
三愛石油	6,600	995.00	6,567,000	
稲畑産業	4,800	1,525.00	7,320,000	
ワキタ	6,600	1,129.00	7,451,400	
東邦ホールディングス	4,800	2,845.00	13,656,000	
サンゲツ	5,300	2,099.00	11,124,700	
シナネンホールディングス	2,300	2,194.00	5,046,200	
伊藤忠エネクス	6,700	939.00	6,291,300	
サンリオ	5,000	2,521.00	12,605,000	
リョーサン	2,700	3,085.00	8,329,500	
三信電気	4,800	1,860.00	8,928,000	
モスフードサービス	2,800	2,798.00	7,834,400	
加賀電子	3,400	2,150.00	7,310,000	
立花エレテック	3,700	1,706.00	6,312,200	
フォーバル	6,800	839.00	5,705,200	
PALTA C	2,900	6,040.00	17,516,000	
日鉄住金物産	1,400	4,755.00	6,657,000	
トラスコ中山	3,500	2,992.00	10,472,000	
オートバックスセブン	6,300	1,886.00	11,881,800	
加藤産業	2,500	3,765.00	9,412,500	
イノテック	5,600	970.00	5,432,000	

杉本商事	3,100	1,728.00	5,356,800	
因幡電機産業	2,500	4,445.00	11,112,500	
ミスミグループ本社	20,300	2,707.00	54,952,100	
スズケン	7,500	6,410.00	48,075,000	
ジェコス	4,800	1,029.00	4,939,200	
ローソン	4,200	6,230.00	26,166,000	
サンエー	1,300	4,340.00	5,642,000	
エービーシー・マート	2,500	6,580.00	16,450,000	
ハードオフコーポレーション	4,500	828.00	3,726,000	
アスクル	2,000	2,787.00	5,574,000	
ゲオホールディングス	3,600	1,565.00	5,634,000	
アダストリア	3,800	2,443.00	9,283,400	
ジーフット	5,200	657.00	3,416,400	
エディオン	7,000	1,009.00	7,063,000	
あみやき亭	1,700	3,730.00	6,341,000	
ハニーズホールディングス	5,600	1,105.00	6,188,000	
ジンス	1,200	5,830.00	6,996,000	
ビックカメラ	8,700	1,220.00	10,614,000	
D C Mホールディングス	8,900	1,040.00	9,256,000	
MonotaRO	10,300	2,362.00	24,328,600	
J.フロント リテイリング	21,000	1,262.00	26,502,000	
ドトール・日レスホールディングス	3,800	2,129.00	8,090,200	
マツモトキヨシホールディングス	6,600	3,710.00	24,486,000	
Z O Z O	17,600	2,025.00	35,640,000	
トレジャー・ファクトリー	3,800	743.00	2,823,400	
ココカラファイン	1,900	4,630.00	8,797,000	
三越伊勢丹ホールディングス	30,600	1,114.00	34,088,400	
ウエルシアホールディングス	4,300	3,685.00	15,845,500	
クリエイトSDホールディングス	2,600	2,745.00	7,137,000	
シュッピン	4,100	807.00	3,308,700	
ジョイフル本田	5,000	1,405.00	7,025,000	
すかいらーくホールディングス	15,300	1,771.00	27,096,300	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,500	1,126.00	6,193,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	7,200	627.00	4,514,400	
あさひ	4,000	1,507.00	6,028,000	
コスモス薬品	800	18,690.00	14,952,000	
トーエル	3,600	785.00	2,826,000	
セブン&アイ・ホールディングス	68,600	4,439.00	304,515,400	
薬王堂	1,500	2,660.00	3,990,000	
ツルハホールディングス	3,500	8,930.00	31,255,000	
サンマルクホールディングス	3,100	2,584.00	8,010,400	
トリドールホールディングス	3,100	2,265.00	7,021,500	
クスリのアオキホールディングス	1,300	7,420.00	9,646,000	

スシローグローバルホールディングス	1,800	7,450.00	13,410,000	
カップ・クリエイト	5,900	1,513.00	8,926,700	
ライトオン	5,400	744.00	4,017,600	
良品計画	2,300	26,360.00	60,628,000	
三城ホールディングス	10,300	401.00	4,130,300	
アドヴァン	6,800	1,077.00	7,323,600	
G - 7ホールディングス	1,800	2,252.00	4,053,600	
エコス	2,100	1,550.00	3,255,000	
マルシェ	5,200	803.00	4,175,600	
パン・パシフィック・ インターナショナルホールディングス	10,700	7,000.00	74,900,000	
西松屋チェーン	5,100	954.00	4,865,400	
ゼンショーホールディングス	7,900	2,614.00	20,650,600	
サイゼリヤ	4,400	2,119.00	9,323,600	
魚力	2,900	1,472.00	4,268,800	
ユナイテッドアローズ	1,800	3,750.00	6,750,000	
ハイデイ日高	3,600	2,142.00	7,711,200	
京都きもの友禅	4,900	407.00	1,994,300	
コロワイド	5,400	2,418.00	13,057,200	
壱番屋	1,800	4,795.00	8,631,000	
スギホールディングス	3,500	4,910.00	17,185,000	
スクロール	9,000	384.00	3,456,000	
ユニー・ファミリーマート ホールディングス	18,400	2,970.00	54,648,000	
木曽路	3,200	2,659.00	8,508,800	
千趣会	12,800	231.00	2,956,800	
ケーヨー	10,400	514.00	5,345,600	
上新電機	2,900	2,704.00	7,841,600	
日本瓦斯	2,900	3,480.00	10,092,000	
ロイヤルホールディングス	3,200	2,725.00	8,720,000	
いなげや	4,300	1,325.00	5,697,500	
島忠	3,500	2,932.00	10,262,000	
チヨダ	2,600	1,826.00	4,747,600	
ライフコーポレーション	2,100	2,340.00	4,914,000	
AOKIホールディングス	4,600	1,223.00	5,625,800	
コメリ	2,700	2,738.00	7,392,600	
青山商事	3,000	2,570.00	7,710,000	
しまむら	1,900	9,240.00	17,556,000	
高島屋	12,900	1,480.00	19,092,000	
松屋	4,400	1,005.00	4,422,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	8,100	1,533.00	12,417,300	
バルコ	5,000	1,026.00	5,130,000	
丸井グループ	13,900	2,204.00	30,635,600	
アクシアル リテイリング	1,800	3,440.00	6,192,000	

イオン	63,000	2,340.50	147,451,500	
イズミ	3,300	5,070.00	16,731,000	
平和堂	3,200	2,420.00	7,744,000	
フジ	2,900	1,919.00	5,565,100	
ヤオコー	1,800	5,780.00	10,404,000	
ゼビオホールディングス	4,900	1,272.00	6,232,800	
ケーズホールディングス	16,600	1,013.00	16,815,800	
Genky DrugStores	1,700	2,436.00	4,141,200	
ブックオフグループホールディングス	4,500	838.00	3,771,000	
アインホールディングス	2,200	8,130.00	17,886,000	
ヤマダ電機	50,000	557.00	27,850,000	
ニトリホールディングス	7,100	13,255.00	94,110,500	
吉野家ホールディングス	5,700	1,756.00	10,009,200	
王将フードサービス	1,200	7,400.00	8,880,000	
プレナス	4,600	1,750.00	8,050,000	
ミニストップ	3,000	1,719.00	5,157,000	
アークス	2,900	2,437.00	7,067,300	
パローホールディングス	3,400	2,742.00	9,322,800	
ファーストリテイリング	2,200	54,320.00	119,504,000	
サンドラッグ	6,000	3,220.00	19,320,000	
ヤマザワ	2,900	1,689.00	4,898,100	
ベルーナ	5,800	903.00	5,237,400	
めぶきフィナンシャルグループ	86,300	298.00	25,717,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,800	1,707.00	4,779,600	
九州フィナンシャルグループ	26,500	496.00	13,144,000	
ゆうちょ銀行	46,700	1,250.00	58,375,000	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	103,100	436.00	44,951,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	10,100	983.00	9,928,300	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,500	889.00	6,667,500	
三十三フィナンシャルグループ	2,500	1,574.00	3,935,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,700	3,245.00	8,761,500	
新生銀行	12,100	1,608.00	19,456,800	
あおぞら銀行	9,100	3,130.00	28,483,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,124,200	573.30	644,503,860	300,000株
りそなホールディングス	180,100	499.80	90,013,980	
三井住友トラスト・ホールディングス	32,300	4,196.00	135,530,800	
三井住友フィナンシャルグループ	115,700	4,042.00	467,659,400	
千葉銀行	58,600	621.00	36,390,600	
群馬銀行	33,600	475.00	15,960,000	
武蔵野銀行	2,500	2,288.00	5,720,000	
千葉興業銀行	7,400	304.00	2,249,600	
七十七銀行	4,900	1,576.00	7,722,400	
青森銀行	1,000	3,065.00	3,065,000	

秋田銀行	1,800	2,270.00	4,086,000	
山形銀行	2,300	2,051.00	4,717,300	
岩手銀行	1,500	3,385.00	5,077,500	
東邦銀行	17,400	307.00	5,341,800	
東北銀行	1,300	1,101.00	1,431,300	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,200	2,557.00	33,752,400	
静岡銀行	41,600	873.00	36,316,800	
十六銀行	2,700	2,390.00	6,453,000	
八十二銀行	29,100	470.00	13,677,000	
山梨中央銀行	2,500	1,450.00	3,625,000	
大垣共立銀行	2,700	2,359.00	6,369,300	
福井銀行	2,500	1,724.00	4,310,000	
北國銀行	1,800	3,550.00	6,390,000	
滋賀銀行	3,100	2,696.00	8,357,600	
南都銀行	2,400	2,173.00	5,215,200	
百五銀行	16,000	371.00	5,936,000	
京都銀行	5,900	5,070.00	29,913,000	
紀陽銀行	5,700	1,614.00	9,199,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,800	1,249.00	13,489,200	
広島銀行	24,100	593.00	14,291,300	
山陰合同銀行	9,000	858.00	7,722,000	
中国銀行	10,800	1,162.00	12,549,600	
鳥取銀行	900	1,446.00	1,301,400	
伊予銀行	22,400	618.00	13,843,200	
百十四銀行	2,200	2,399.00	5,277,800	
四国銀行	3,600	1,095.00	3,942,000	
阿波銀行	2,500	2,941.00	7,352,500	
大分銀行	900	3,545.00	3,190,500	
宮崎銀行	1,600	2,756.00	4,409,600	
佐賀銀行	1,500	1,947.00	2,920,500	
十八銀行	1,300	2,849.00	3,703,700	
沖縄銀行	1,900	3,745.00	7,115,500	
琉球銀行	4,100	1,226.00	5,026,600	
セブン銀行	56,900	333.00	18,947,700	
みずほフィナンシャルグループ	2,231,100	175.50	391,558,050	
山口フィナンシャルグループ	20,400	1,011.00	20,624,400	
長野銀行	900	1,646.00	1,481,400	
名古屋銀行	1,800	3,610.00	6,498,000	
北洋銀行	24,100	300.00	7,230,000	
中京銀行	1,000	2,282.00	2,282,000	
愛媛銀行	3,800	1,175.00	4,465,000	
トマト銀行	1,700	1,057.00	1,796,900	
京葉銀行	8,800	695.00	6,116,000	

栃木銀行	17,000	239.00	4,063,000	
トモニホールディングス	14,200	440.00	6,248,000	
フィデアホールディングス	27,900	131.00	3,654,900	
池田泉州ホールディングス	20,100	306.00	6,150,600	
F P G	6,100	949.00	5,788,900	
S B Iホールディングス	19,400	2,446.00	47,452,400	
ジャフコ	2,700	4,080.00	11,016,000	
大和証券グループ本社	132,500	574.80	76,161,000	
野村ホールディングス	300,700	409.90	123,256,930	
岡三証券グループ	15,000	457.00	6,855,000	
丸三証券	6,300	697.00	4,391,100	
東海東京フィナンシャル・ ホールディングス	18,800	439.00	8,253,200	
水戸証券	9,600	218.00	2,092,800	
いちよし証券	5,100	812.00	4,141,200	
松井証券	8,000	1,219.00	9,752,000	
だいこう証券ビジネス	7,700	409.00	3,149,300	
マネックスグループ	17,100	411.00	7,028,100	
カブドットコム証券	14,800	561.00	8,302,800	
極東証券	4,400	1,108.00	4,875,200	
藍澤證券	5,600	683.00	3,824,800	
かんぽ生命保険	6,100	2,497.00	15,231,700	
S O M P Oホールディングス	29,000	4,046.00	117,334,000	
M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	42,900	3,367.00	144,444,300	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,500	2,061.00	27,823,500	
第一生命ホールディングス	92,800	1,623.50	150,660,800	
東京海上ホールディングス	59,500	5,487.00	326,476,500	
T & Dホールディングス	51,100	1,183.00	60,451,300	
全国保証	4,500	4,090.00	18,405,000	
クレディセゾン	11,200	1,562.00	17,494,400	
芙蓉総合リース	1,800	5,800.00	10,440,000	
興銀リース	3,000	2,705.00	8,115,000	
東京センチュリー	3,200	4,825.00	15,440,000	
日本証券金融	9,000	635.00	5,715,000	
アイフル	28,400	292.00	8,292,800	
リコーリース	1,700	3,590.00	6,103,000	
イオンフィナンシャルサービス	10,700	2,346.00	25,102,200	
アコム	33,900	400.00	13,560,000	
オリエントコーポレーション	51,000	120.00	6,120,000	
日立キャピタル	3,900	2,698.00	10,522,200	
オリックス	109,500	1,586.50	173,721,750	
三菱UFJリース	37,600	567.00	21,319,200	
日本取引所グループ	44,300	1,979.00	87,669,700	

アサックス	7,400	555.00	4,107,000	
NECキャピタルソリューション	3,200	1,803.00	5,769,600	
いちご	23,700	381.00	9,029,700	
ヒューリック	34,800	1,083.00	37,688,400	
野村不動産ホールディングス	11,000	2,167.00	23,837,000	
オープンハウス	2,700	4,030.00	10,881,000	
東急不動産ホールディングス	43,400	658.00	28,557,200	
飯田グループホールディングス	13,600	2,059.00	28,002,400	
パーク24	9,500	2,519.00	23,930,500	
三井不動産	87,000	2,770.00	240,990,000	
三菱地所	115,100	2,011.50	231,523,650	
平和不動産	3,700	2,155.00	7,973,500	
東京建物	18,300	1,316.00	24,082,800	
ダイビル	6,200	1,081.00	6,702,200	
京阪神ビルディング	8,100	981.00	7,946,100	
住友不動産	36,900	4,680.00	172,692,000	
テーオーシー	9,600	771.00	7,401,600	
スターツコーポレーション	2,600	2,377.00	6,180,200	
空港施設	8,000	570.00	4,560,000	
ゴールドクレスト	3,800	1,552.00	5,897,600	
日本エスリード	3,600	1,676.00	6,033,600	
サンヨーハウジング名古屋	5,200	901.00	4,685,200	
イオンモール	8,600	1,806.00	15,531,600	
カチタス	2,800	3,715.00	10,402,000	
日本空港ビルデング	5,300	4,920.00	26,076,000	
日本M&Aセンター	11,700	3,070.00	35,919,000	
パソナグループ	4,400	1,551.00	6,824,400	
GCA	6,200	830.00	5,146,000	
エス・エム・エス	5,800	1,901.00	11,025,800	
パーソルホールディングス	15,700	1,884.00	29,578,800	
クックパッド	15,300	274.00	4,192,200	
学情	2,800	1,255.00	3,514,000	
スタジオアリス	2,900	2,279.00	6,609,100	
シミックホールディングス	2,900	1,597.00	4,631,300	
NJS	3,300	1,422.00	4,692,600	
総合警備保障	6,400	4,710.00	30,144,000	
カカクコム	12,200	2,000.00	24,400,000	
アイロムグループ	3,100	1,493.00	4,628,300	
ディップ	4,100	1,866.00	7,650,600	
キャリアデザインセンター	2,400	1,290.00	3,096,000	
ベネフィット・ワン	4,400	2,029.00	8,927,600	
エムスリー	33,800	1,804.00	60,975,200	
アウトソーシング	8,000	1,404.00	11,232,000	

ディー・エヌ・エー	8,300	1,708.00	14,176,400	
博報堂D Yホールディングス	22,400	1,794.00	40,185,600	
ぐるなび	9,200	726.00	6,679,200	
ファンコミュニケーションズ	11,800	590.00	6,962,000	
WDBホールディングス	2,500	3,070.00	7,675,000	
インフォマート	8,200	1,358.00	11,135,600	
E P Sホールディングス	3,400	1,928.00	6,555,200	
クイック	4,500	1,806.00	8,127,000	
ケネディクス	16,900	552.00	9,328,800	
電通	19,300	4,730.00	91,289,000	
みらかホールディングス	4,600	2,894.00	13,312,400	
ダイオーズ	4,400	1,406.00	6,186,400	
日本空調サービス	7,700	690.00	5,313,000	
オリエンタルランド	18,800	12,330.00	231,804,000	
ダスキン	4,200	2,659.00	11,167,800	
ラウンドワン	6,700	1,456.00	9,755,200	
リゾートトラスト	6,700	1,508.00	10,103,600	
ビー・エム・エル	2,500	3,305.00	8,262,500	
りらいあコミュニケーションズ	6,300	989.00	6,230,700	
リソー教育	20,800	514.00	10,691,200	
早稲田アカデミー	3,000	1,418.00	4,254,000	
ユー・エス・エス	19,700	2,038.00	40,148,600	
サイバーエージェント	9,800	4,090.00	40,082,000	
楽天	74,400	1,011.00	75,218,400	
テー・オー・ダブリュー	6,700	722.00	4,837,400	
テクノプロ・ホールディングス	2,900	6,560.00	19,024,000	
インターワークス	4,000	725.00	2,900,000	
キャリアリンク	9,100	404.00	3,676,400	
ライドオンエクスプレス ホールディングス	4,400	1,220.00	5,368,000	
リクルートホールディングス	113,900	3,169.00	360,949,100	
エラン	4,600	1,360.00	6,256,000	
日本郵政	130,500	1,312.00	171,216,000	
M S - J a p a n	2,900	1,676.00	4,860,400	
リログループ	8,500	3,085.00	26,222,500	
エイチ・アイ・エス	2,700	3,980.00	10,746,000	
共立メンテナンス	2,400	5,800.00	13,920,000	
建設技術研究所	3,900	1,552.00	6,052,800	
よみうりランド	1,700	4,500.00	7,650,000	
東京都競馬	2,200	3,475.00	7,645,000	
カナモト	2,700	2,706.00	7,306,200	
東京ドーム	8,100	1,083.00	8,772,300	
トランス・コスモス	3,800	2,251.00	8,553,800	
乃村工藝社	3,900	3,085.00	12,031,500	



日本管財	2,200	1,947.00	4,283,400	
白洋舎	1,600	2,910.00	4,656,000	
セコム	16,900	9,600.00	162,240,000	
セントラル警備保障	1,500	4,580.00	6,870,000	
メイテック	2,200	5,010.00	11,022,000	
応用地質	5,600	1,134.00	6,350,400	
船井総研ホールディングス	3,300	2,642.00	8,718,600	
ベネッセホールディングス	5,700	2,906.00	16,564,200	
イオンディライト	2,000	4,135.00	8,270,000	
ニチイ学館	7,200	1,302.00	9,374,400	
ダイセキ	3,400	2,696.00	9,166,400	
ステップ	3,700	1,435.00	5,309,500	
合 計	19,188,900		38,530,201,180	

(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】

2019年3月29日現在

種類	金額
資産総額	376,379,699 円
負債総額	64,157 円
純資産総額( - )	376,315,542 円
発行済数量	327,128,450 口
1単位あたり純資産額( / )	1.1504 円

(ご参考: 親投資信託の現況)

TMA日本株TOPIXマザーファンド

2019年3月29日現在

種類	金額
資産総額	39,055,086,334 円
負債総額	914,497,206 円
純資産総額( - )	38,140,589,128 円
発行済数量	29,179,655,810 口
1単位あたり純資産額( / )	1.3071 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】

2019年3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。

2019年3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	178	2,619,059
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	2	5,786
合計	180	2,624,846

### 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33期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31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。  
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30年4月1日から平成30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。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金・預金	13,325,797	16,828,496
前払費用	132,260	150,894
未収委託者報酬	1,578,384	1,524,731
未収収益	2,534,825	2,530,730
未収入金	1,207	1,919
繰延税金資産	287,816	291,045
その他の流動資産	28,360	23,613
流動資産計	17,888,652	21,351,430
固定資産		
有形固定資産	* 1 552,561	* 1 547,215
建物	439,621	409,858
器具備品	111,633	136,834
リース資産	1,306	522
無形固定資産	13,204	34,467
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア仮勘定	9,409	30,672
投資その他の資産	2,418,251	2,415,723
投資有価証券	54,270	43,545
関係会社株式	1,672,490	1,673,049
その他の関係会社有価証券	31,200	31,200
長期前払費用	9,298	10,541
敷金	450,632	450,632
その他長期差入保証金	20,912	10,865
繰延税金資産	179,447	195,889
固定資産計	2,984,017	2,997,406
資産合計	20,872,669	24,348,837
<b>負債の部</b>		
流動負債		
リース債務	822	548
未払金	1,958,922	2,563,951
未払手数料	634,930	634,789
その他未払金	1,323,992	1,929,162
未払費用	445,613	530,106
未払消費税等	108,541	262,100
未払法人税等	735,000	960,000
預り金	41,371	43,264
前受収益	3,027	3,156
賞与引当金	274,382	282,443
流動負債計	3,567,681	4,645,570
固定負債		
リース債務	548	-
退職給付引当金	393,213	386,552
役員退職慰労引当金	24,180	-
固定負債計	417,941	386,552
負債合計	3,985,623	5,032,123
<b>純資産の部</b>		
株主資本	16,885,034	19,314,136
資本金	2,000,000	2,000,000
資本剰余金	400,000	400,000
その他資本剰余金	400,000	400,000
利益剰余金	14,485,034	16,914,136
利益準備金	500,000	500,000

その他利益剰余金	13,985,034	16,414,136
特別償却準備金	79	38
繰越利益剰余金	13,984,954	16,414,098
評価・換算差額等	2,011	2,577
その他有価証券評価差額金	2,011	2,577
純資産合計	16,887,045	19,316,713
負債・純資産合計	20,872,669	24,348,837

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第32期 (自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)	第33期 (自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)
営業収益		
委託者報酬	11,342,811	11,741,085
運用受託報酬	9,089,602	11,384,860
投資助言報酬	74,767	68,541
その他営業収益	64,158	215,481
営業収益計	20,571,339	23,409,968
営業費用		
支払手数料	5,363,864	5,463,460
広告宣伝費	251,016	176,289
公告費	313	-
調査費	5,401,672	6,331,477
調査費	1,635,494	2,359,989
委託調査費	3,766,178	3,971,487
委託計算費	109,429	110,708
営業雑経費	239,192	226,401
通信費	33,787	30,555
印刷費	173,307	160,440
協会費	17,533	21,276
諸会費	7,478	6,349
図書費	7,084	7,778
営業費用計	11,365,489	12,308,336
一般管理費		
給料	2,670,059	3,103,124
役員報酬	119,133	132,792
給料・手当	1,897,712	2,139,811
賞与	653,214	830,521
交際費	16,226	16,511
寄付金	3,598	3,384
旅費交通費	136,737	181,123
租税公課	115,360	142,241
不動産賃借料	316,801	375,691
役員退職慰労引当金繰入	2,910	-
役員退職慰労金	-	6,710
退職給付費用	87,275	114,711
賞与引当金繰入	209,007	282,443
固定資産減価償却費	63,467	76,622
法定福利費	424,721	499,149
福利厚生費	8,100	8,917
諸経費	469,957	437,854
一般管理費計	4,524,223	5,248,487
営業利益	4,681,627	5,853,144
営業外収益		
受取利息	459	472
受取配当金	* 1 45,776	* 1 107,891
匿名組合投資利益	* 1 77,298	* 1 50,146
為替差益	8,924	-

雑益	10,134	11,209
営業外収益計	142,593	169,720
営業外費用		
為替差損	-	19,974
雑損	6,661	2,653
営業外費用計	6,661	22,628
経常利益	4,817,559	6,000,236
特別損失		
器具備品除却損	4,685	257
本社移転費用	229,113	-
特別損失計	233,799	257
税引前当期純利益	4,583,760	5,999,979
法人税、住民税及び事業税	1,455,944	1,806,783
法人税等調整額	25,233	19,919
法人税等合計	1,430,711	1,786,863
当期純利益	3,153,048	4,213,116

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計		その他利益剰余金	
				特別償却準備金	繰越利益剰余金	
当期首残高	2,000,000	-	-	500,000	-	7,585,959
当期変動額						
剰余金の配当						791,278
合併による増加		400,000	400,000		103	4,037,200
特別償却準備金の取崩					24	24
当期純利益						3,153,048
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	400,000	400,000	-	79	6,398,995
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	79	13,984,954

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	8,085,959	10,085,959	1,567	1,567	10,087,527
当期変動額					
剰余金の配当	791,278	791,278			791,278
合併による増加	4,037,304	4,437,304			4,437,304
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	3,153,048	3,153,048			3,153,048
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			443	443	443



当期変動額合計	6,399,074	6,799,074	443	443	6,799,518
当期末残高	14,485,034	16,885,034	2,011	2,011	16,887,045

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本剰余金	資本剰余金合計		特別償却準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	79	13,984,954
当期変動額						
剰余金の配当						1,784,014
特別償却準備金の取崩					41	41
当期純利益						4,213,116
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	41	2,429,143
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	38	16,414,098

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	14,485,034	16,885,034	2,011	2,011	16,887,045
当期変動額					
剰余金の配当	1,784,014	1,784,014			1,784,014
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,213,116	4,213,116			4,213,116
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			565	565	565
当期変動額合計	2,429,102	2,429,102	565	565	2,429,667
当期末残高	16,914,136	19,314,136	2,577	2,577	19,316,713

## 注記事項

## 重要な会計方針

## 第33期

自 平成29年4月1日

至 平成30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(リース資産を除く)

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。

### (2) リース資産

所有権移転外ファイナンス・リースに係る有形固定資産中のリース資産は、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額法を採用しております。

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

従業員賞与と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。

### (未適用の会計基準等)

#### 第33期

自 平成29年4月1日  
至 平成30年3月31日

- ・「収益認識に関する会計基準」(企業会計基準第29号 平成30年3月30日)
- ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第30号 平成30年3月30日)

### (1) 概要

収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の5つのステップを適用し認識されます。

- ステップ1：顧客との契約を識別する。
- ステップ2：契約における履行義務を識別する。
- ステップ3：取引価格を算定する。
- ステップ4：契約における履行義務に取引価格を配分する。
- ステップ5：履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。

### (2) 適用予定日

平成34年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

### (貸借対照表関係)

第32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30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> <tr><td>建物</td><td>20,366千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>453,412千円</td></tr> <tr><td>リース資産</td><td>2,612千円</td></tr> </table>	建物	20,366千円	器具備品	453,412千円	リース資産	2,612千円	<table> <tr><td>建物</td><td>51,080千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>424,930千円</td></tr> <tr><td>リース資産</td><td>3,395千円</td></tr> </table>	建物	51,080千円	器具備品	424,930千円	リース資産	3,395千円
建物	20,366千円												
器具備品	453,412千円												
リース資産	2,612千円												
建物	51,080千円												
器具備品	424,930千円												
リース資産	3,395千円												

## (損益計算書関係)

<p style="text-align: center;">第32期</p> <p style="text-align: center;">自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日</p>	<p style="text-align: center;">第33期</p> <p style="text-align: center;">自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日</p>								
* 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> <tr><td>関係会社からの受取配当金</td><td>45,377千円</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>77,298千円</td></tr> </table>	関係会社からの受取配当金	45,377千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	77,298千円	<table> <tr><td>関係会社からの受取配当金</td><td>104,224千円</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>50,146千円</td></tr> </table>	関係会社からの受取配当金	104,224千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	50,146千円
関係会社からの受取配当金	45,377千円								
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	77,298千円								
関係会社からの受取配当金	104,224千円								
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	50,146千円								

## (株主資本等変動計算書関係)

第32期(自 平成28年 4月 1日 至 平成29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28年 4月 1日 現在	増加	減少	平成29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

(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29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	1,784,014千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	46,580円
(ニ) 基準日	平成29年 3月31日
(ホ) 効力発生日	平成29年 6月30日

第33期(自 平成29年 4月 1日 至 平成30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29年 4月 1日 現在	増加	減少	平成30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29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	1,784,014千円
------------	-------------

(口) 1株当たり配当額	46,580円
(ハ) 基準日	平成29年3月31日
(二) 効力発生日	平成29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30年6月29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	1,901,595千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	49,650円
(二) 基準日	平成30年3月31日
(ホ) 効力発生日	平成30年6月29日

(リース取引関係)

第32期（自平成28年4月1日 至平成29年3月31日）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

1. リース資産の内容

事務機器の一部については、所有権移転外ファイナンス・リース契約により使用しております。

2. リース資産の減価償却の方法

「重要な会計方針」の「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載の通りであります。

第33期（自平成29年4月1日 至平成30年3月31日）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

1. リース資産の内容

事務機器の一部については、所有権移転外ファイナンス・リース契約により使用しております。

2. リース資産の減価償却の方法

「重要な会計方針」の「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載の通りであります。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第32期 自平成28年4月1日 至平成29年3月31日	第33期 自平成29年4月1日 至平成30年3月31日
(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。	(1) 金融商品に対する取組方針 同左
(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。  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。	(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左
(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。	(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左

<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>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32期(平成29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	13,325,797	13,325,797	-
(2)未収委託者報酬	1,578,384	1,578,384	-
(3)未収収益	2,534,825	2,534,825	-
(4)未収入金	1,207	1,207	-
(5)投資有価証券 其他有価証券	54,270	54,270	-
(6)預り金	(41,371)	(41,371)	-
(7)未払金	(1,958,922)	(1,958,922)	-
(8)未払費用	(445,613)	(445,613)	-
(9)未払消費税等	(108,541)	(108,541)	-
(10)未払法人税等	(735,000)	(735,000)	-

(\*)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33期(平成30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	16,828,496	16,828,496	-
(2)未収委託者報酬	1,524,731	1,524,731	-
(3)未収収益	2,530,730	2,530,730	-
(4)未収入金	1,919	1,919	-
(5)投資有価証券 其他有価証券	43,545	43,545	-
(6)預り金	(43,264)	(43,264)	-
(7)未払金	(2,563,951)	(2,563,951)	-
(8)未払費用	(530,106)	(530,106)	-
(9)未払消費税等	(262,100)	(262,100)	-
(10)未払法人税等	(960,000)	(960,000)	-

(\*)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32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30年3月31日現在
(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) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等	(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) 未払消費税等及び(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。	同左
(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。	(5) 投資有価証券 同左

## (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32期 平成29年3月31日現在		第33期 平成30年3月31日現在	
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。		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。	
(単位：千円)		(単位：千円)	
	貸借対照表計上額		貸借対照表計上額
子会社株式	1,639,743	子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747	関連会社株式	32,747
その他の関係会社 有価証券	31,200	その他の関係会社 有価証券	31,200
敷金	450,632	敷金	450,632
その他長期差入保証金	20,912	その他長期差入保証金	10,865

## (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32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30年3月31日現在
該当事項はありません。	同左

## (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32期(平成29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	13,325,573	-	-	-
未収委託者報酬	1,578,384	-	-	-
未収収益	2,534,825	-	-	-
未収入金	1,207	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6,000	21,783	6,000	-
合計	17,445,990	21,783	6,000	-

第33期(平成30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	16,827,976	-	-	-
未収委託者報酬	1,524,731	-	-	-
未収収益	2,530,730	-	-	-
未収入金	1,919	-	-	-

投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	-	19,743	5,000	-
合計	20,885,358	19,743	5,000	-

## (有価証券関係)

第32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30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1,639,743千円、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、記載しておりません。</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1,640,302千円、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、記載しておりません。</p>																																
<p>2. その他有価証券 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>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</td> <td>33,725</td> <td>27,289</td> <td>6,435</td> </tr> <tr> <td>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</td> <td>20,545</td> <td>24,081</td> <td>3,536</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>54,270</td> <td>51,371</td> <td>2,899</td> </tr> </tbody> </table>	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	33,725	27,289	6,435	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	20,545	24,081	3,536	合計	54,270	51,371	2,899	<p>2. その他有価証券 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>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</td> <td>27,151</td> <td>21,652</td> <td>5,498</td> </tr> <tr> <td>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</td> <td>16,394</td> <td>18,178</td> <td>1,783</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>43,545</td> <td>39,831</td> <td>3,714</td> </tr> </tbody> </table>	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	27,151	21,652	5,498	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	16,394	18,178	1,783	合計	43,545	39,831	3,714
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	33,725	27,289	6,435																														
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	20,545	24,081	3,536																														
合計	54,270	51,371	2,899																														
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	27,151	21,652	5,498																														
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	16,394	18,178	1,783																														
合計	43,545	39,831	3,714																														
<p>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。</p>	<p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左</p>																																

## (退職給付関係)

<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
<p>2. 確定給付制度</p>

## (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32期		第33期	
	自	平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	自	平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
退職給付引当金の期首残高		197,784千円		393,213千円
退職給付費用		31,281千円		46,223千円
退職給付の支払額		6,251千円		43,667千円
合併による増加		179,615千円		-
確定拠出年金制度への移管額		9,217千円		9,217千円
退職給付引当金の期末残高		393,213千円		386,552千円

## (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32期		第33期	
	平成29年3月31日現在		平成30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		393,213千円		386,552千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		393,213千円		386,552千円
退職給付引当金		393,213千円		386,552千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		393,213千円		386,552千円

## (3) 退職給付費用

	第32期		第33期	
	自	平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	自	平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
簡便法で計算した退職給付費用		22,064千円		37,006千円

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第32期(自平成28年4月1日至平成29年3月31日)46,034千円、第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)54,764千円であります。

## (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的主要原因別の内訳

	第32期	第33期
	(平成29年3月31日現在)	(平成30年3月31日現在)
繰延税金資産		
役員退職慰労引当金	7,403千円	-
退職給付引当金	120,401千円	118,362千円
未払金	3,507千円	4,251千円
賞与引当金	84,674千円	86,484千円
未払法定福利費	12,005千円	10,538千円
未払事業所税	3,291千円	3,288千円
未払事業税	35,145千円	50,364千円
未払調査費	45,734千円	44,622千円
減価償却超過額	52,565千円	78,443千円
繰延資産超過額	-	237千円



未払確定拠出年金	1,236千円	1,519千円
未払費用	102,221千円	89,977千円
繰延税金資産小計	468,187千円	488,088千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	468,187千円	488,088千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	35千円	16千円
その他有価証券評価差額金	887千円	1,137千円
繰延税金負債合計	923千円	1,154千円
繰延税金資産の純額	467,264千円	486,934千円

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32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30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

(セグメント情報等)

第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	第33期 自 平成29年4月1日 至 平成30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>

[関連情報]	[関連情報]
<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>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 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型） (2) 委託者報酬 2,915,606千円 (3) 関連するセグメント名 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</p>

## (関連当事者情報)

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29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	投資運用業 投資助言業	(所有) 直接50%	運用の 再委任	委託 調査費 の支払	917,507	未払金	200,874
						役員 の 派遣			未払費用	14,636

(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。

## (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

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)
----	----------------	-----	------------------	-----------------------	------------------	-------------------	-----------	--------------	----	--------------

同一の親会社をもつ会社	東京海上日動火災保険株式会社	東京都千代田区	101,994,694千円	損害保険業	なし	運用の一任	運用受託報酬の受取	1,247,159	未収収益	285,970
						役員の兼任				
同一の親会社をもつ会社	Delphi Capital Management, Inc.	米国・ニューヨーク	USD 1千	資産運用業	なし	運用の再委託	委託調査費の支払	763,120	未払金	225,715

(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。

(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)

(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33期(自平成29年4月1日至平成30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重要な取引はありません。

(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

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)
同一の親会社をもつ会社	東京海上日動火災保険株式会社	東京都千代田区	101,994,694千円	損害保険業	なし	運用の一任	運用受託報酬の受取	1,518,481	未収収益	386,279
						役員の兼任				
同一の親会社をもつ会社	Delphi Capital Management, Inc.	米国・ニューヨーク	USD 1千	資産運用業	なし	運用の再委託	委託調査費の支払	936,716	未払金	288,919

(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。

(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)

(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32期 ( 自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日 )	
1 株当たり純資産額	440,915円03銭
1 株当たり当期純利益金額	82,325円02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いません。	
( 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	16,887,045千円
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	16,887,045千円
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	3,153,048千円
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	3,153,048千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第33期 ( 自 平成29年 4 月 1 日 至 平成30年 3 月31日 )	
1 株当たり純資産額	504,352円83銭
1 株当たり当期純利益金額	110,003円02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いません。	
( 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	19,316,713千円
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	19,316,713千円
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	4,213,116千円
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	4,213,116千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

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30年9月30日現在)		
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金・預金		15,126,277
前払費用		154,617
未収委託者報酬		1,680,394
未収収益		2,651,942
未収入金		5,094
その他の流動資産		16,835
流動資産計		19,635,161
固定資産		
有形固定資産	* 1	519,494
建物		394,786
器具備品		124,577
リース資産		130
無形固定資産		19,884
電話加入権		3,795
ソフトウェア仮勘定		16,089
投資その他の資産		2,957,084
投資有価証券		45,761
関係会社株式		1,673,049
その他の関係会社有価証券		31,200
長期前払費用		10,974
敷金		450,632
その他長期差入保証金		10,041
繰延税金資産		735,425
固定資産計		3,496,463
資産合計		23,131,625
<b>負債の部</b>		
流動負債		
リース債務		137
未払金		1,762,594
未払手数料		720,029
その他未払金		1,042,565
未払費用		545,708
未払消費税等	* 2	89,361
未払法人税等		930,000
預り金		50,351
前受収益		14,126
賞与引当金		563,759
流動負債計		3,956,039
固定負債		
退職給付引当金		396,749
固定負債計		396,749
負債合計		4,352,788
<b>純資産の部</b>		
株主資本		18,774,855
資本金		2,000,000

資本剰余金	400,000
その他資本剰余金	400,000
利益剰余金	16,374,855
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	15,874,855
特別償却準備金	27
繰越利益剰余金	15,874,827
評価・換算差額等	3,981
その他有価証券評価差額金	3,981
純資産合計	18,778,836
負債・純資産合計	23,131,625

## 中間損益計算書

(単位：千円)

	当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)
営業収益	
委託者報酬	6,132,231
運用受託報酬	4,641,565
投資助言報酬	34,631
その他営業収益	152,377
営業収益計	10,960,805
営業費用	
支払手数料	2,827,682
広告宣伝費	98,650
調査費	2,925,394
調査費	1,292,525
委託調査費	1,632,868
委託計算費	58,436
営業雑経費	123,684
通信費	16,674
印刷費	81,768
協会費	12,247
諸会費	6,347
図書費	6,647
営業費用計	6,033,848
一般管理費	
給料	1,372,499
役員報酬	63,057
給料・手当	1,168,770
賞与	140,672
交際費	8,371
寄付金	32
旅費交通費	100,092
租税公課	70,448
不動産賃借料	189,825
退職給付費用	53,821
賞与引当金繰入	563,759
固定資産減価償却費	* 1 44,351
法定福利費	281,061
福利厚生費	9,108
諸経費	234,474

一般管理費計	2,927,845
営業利益	1,999,110
営業外収益	
受取利息	55
受取配当金	89
雑益	6,427
営業外収益計	6,571
営業外費用	
為替差損	23,262
雑損	975
営業外費用計	24,237
経常利益	1,981,444
税引前中間純利益	1,981,444
法人税、住民税及び事業税	868,241
法人税等調整額	249,110
法人税等合計	619,130
中間純利益	1,362,313

## 中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金	
					特別償却 準備金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	38	16,414,098
当中間期変動額						
剰余金の配当						1,901,595
特別償却準備金の取崩					10	10
中間純利益						1,362,313
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	-	-	-	-	10	539,270
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	27	15,874,827

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	16,914,136	19,314,136	2,577	2,577	19,316,713
当中間期変動額					
剰余金の配当	1,901,595	1,901,595			1,901,595
特別償却準備金の取崩	-	-			-
中間純利益	1,362,313	1,362,313			1,362,313
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			1,404	1,404	1,404
当中間期変動額合計	539,281	539,281	1,404	1,404	537,877

当中間期末残高	16,374,855	18,774,855	3,981	3,981	18,778,836
---------	------------	------------	-------	-------	------------

## 注記事項

## 重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30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>(1) 有形固定資産(リース資産を除く) 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> <p>(2) リース資産 所有権移転外ファイナンス・リースに係る有形固定資産中のリース資産は、リース期間を耐用年数とし、残存価額を零とする定額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</p>



	<p>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。</p> <p>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>
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。

## (表示方法の変更)

<p>当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)</p>
<p>(「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更)</p> <p>「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」(企業会計基準第28号 平成30年2月16日)を当中間会計期間の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。</p>

## (中間貸借対照表関係)

	<p>当中間会計期間 (平成30年9月30日現在)</p>
1 有形固定資産の減価償却累計額	<p>建物 66,435千円</p> <p>器具備品 452,836千円</p> <p>リース資産 3,787千円</p>
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)

	<p>当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)</p>
1 減価償却実施額	有形固定資産 44,351千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

	<p>当中間会計期間 (自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日)</p>			
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30年6月29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・・・・・・・・・・1,901,595千円
- (ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・49,650円
- (ハ) 基準日・・・・・・・・・・平成30年3月31日
- (ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・平成30年6月29日

## (リース取引関係)

当中間会計期間(自平成30年4月1日 至平成30年9月30日)

## 所有権移転外ファイナンス・リース取引

## 1. リース資産の内容

事務機器の一部については、所有権移転外ファイナンス・リース契約により使用しております。

## 2. リース資産の減価償却の方法

「重要な会計方針」の「2. 固定資産の減価償却の方法」に記載の通りであります。

## (金融商品関係)

当中間会計期間(平成30年9月30日現在)

## 金融商品の時価等に関する事項

平成30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	15,126,277	15,126,277	-
(2)未収委託者報酬	1,680,394	1,680,394	-
(3)未収収益	2,651,942	2,651,942	-
(4)未収入金	5,094	5,094	-
(5)投資有価証券			
その他有価証券	45,761	45,761	-
(6)預り金	(50,351)	(50,351)	-
(7)未払金	(1,762,594)	(1,762,594)	-
(8)未払費用	(545,708)	(545,708)	-
(9)未払消費税等	(89,361)	(89,361)	-
(10)未払法人税等	(930,000)	(930,000)	-

(＊)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 1,640,302千円)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)及び敷金(中間貸借対照表計上額 450,632千円)並びにその他長期差入保証金(中間貸借対照表計上額 10,041千円)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30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1,640,302千円、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	37,371	30,297	7,074
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	8,390	9,726	1,335
合計		45,761	40,023	5,738

（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30年4月1日 至 平成30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30年4月1日 至 平成30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

投資信託の名称	委託者報酬 （単位：千円）	関連するセグメント名
東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）	1,652,029	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

（1株当たり情報）

当中間会計期間 （自 平成30年4月1日 至 平成30年9月30日）	
1株当たり純資産額	490,309円04銭
1株当たり中間純利益金額	35,569円54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	18,778,836千円
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	18,778,836千円
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	1,362,313千円
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	1,362,313千円
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。)

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)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(2018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(2018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	48,323百万円	
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	

( ) 2018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	2018年6月20日
	2018年12月20日
有価証券報告書	2018年6月20日
半期報告書	2018年12月20日

# 独立監査人の監査報告書

平成30年6月4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  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅  
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29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の平成30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。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。



# 独立監査人の監査報告書

2019年5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  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅  
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2018年3月21日から2019年3月20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2019年3月20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30年12月3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  
業務執行社員 公認会計士 荒川 進指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅

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30年4月1日から平成31年3月31日までの第34期事業年度の中間会計期間(平成30年4月1日から平成30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30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30年4月1日から平成30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。

**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。