

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 平成27年3月20日

【発行者名】 東京海上アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 取締役社長 大場 昭義

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目3番1号

【事務連絡者氏名】 尾崎 正幸

【電話番号】 03 - 3212 - 8421

【届出の対象とした募集(売出)東京海上セレクション・日本株TOPIX  
内国投資信託受益証券に係るファ  
ンドの名称】

【届出の対象とした募集(売出)上限 1兆円  
内国投資信託受益証券の金額】

【縦覧に供する場所】 該当なし

## 1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

平成26年9月19日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、半期報告書の提出に伴う新たな情報の更新、および原届出書記載事項の一部について訂正すべき事項があるため、本訂正届出書を提出するものです。

## 2【訂正の内容】

<訂正前>および<訂正後>に記載している下線部\_\_\_\_\_は訂正部分を示し、<更新後>に記載している内容は、原届出書が更新されます。また<追加>の記載事項は原届出書に追加されます。

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1 ファンドの性格

##### (1) ファンドの目的及び基本的性格

<更新後>

(略)

ファンドの特色

#### 1. 主に東京証券取引所第一部に上場されている銘柄に投資します。

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。

#### 2. TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

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ることがあります。

#### 3. 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。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。

#### <マザーファンドが対象とするインデックスの著作権等について>

##### ・TOPIX

※TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「(株)東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。

※(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。

※(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。

※(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。

※当ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。

※(株)東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。

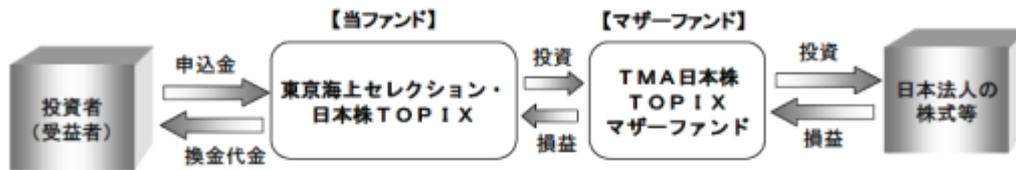
※(株)東京証券取引所は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。

※以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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。

## ファンドの仕組み

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。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	株式への実質投資割合には、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。

### (3) ファンドの仕組み

< 訂正前 >

(略)

#### 委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（平成26年7月末日現在）
- ・会社の沿革

昭和60年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立

昭和62年2月 投資顧問業者として登録

同年6月 投資一任業務認可取得

平成3年4月 国内および海外年金の運用受託を開始

平成10年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得

平成19年9月 金融商品取引業者として登録

平成26年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更

- ・大株主の状況（平成26年7月末日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
東京海上日動火災保険株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目2番1号	38,300株	100.0%

< 訂正後 >

(略)

## 委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（平成27年1月末日現在）
- ・会社の沿革

昭和60年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立

昭和62年2月 投資顧問業者として登録

同年6月 投資一任業務認可取得

平成3年4月 国内および海外年金の運用受託を開始

平成10年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得

平成19年9月 金融商品取引業者として登録

平成26年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更

- ・大株主の状況（平成27年1月末日現在）

株主名	住所	所有株数	所有比率
東京海上日動火災保険株式会社	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

## (3) 運用体制

&lt;訂正前&gt;

(略)

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、運用管理室（5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係る各部長が参加）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）

(略)

（上記の体制や人員等については、平成26年8月1日現在）

&lt;訂正後&gt;

(略)

当ファンドはクオンツ企画運用部（8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、運用管理室（5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係る各部長が参加）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）

(略)

（上記の体制や人員等については、平成27年2月1日現在）

## (5) 投資制限

&lt;追加&gt;

デリバティブ取引等に係る投資制限（約款第24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。

以下、項番 ~ を ~ に繰り下げます。

## 3 投資リスク

&lt;追加&gt;

(略)

## 2. その他の留意事項

(略)

## (3) その他の留意点

(略)

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が小さかった場合も同様です。

(略)

## 5 運用状況

&lt;更新後&gt;

以下は平成27年1月30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	16,244,722,264	100.07
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		11,586,638	0.07
合計（純資産総額）		16,233,135,626	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	135,955,872,590	98.65
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		1,855,499,115	1.34
合計（純資産総額）		137,811,371,705	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	1,782,270,000	1.29

(注) 株価指数先物取引・債券先物取引の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	15,384,716,606	0.9411	14,480,092,224	1.0559	16,244,722,264	100.07

## b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.07
合計	100.07

投資不動産物件

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

該当事項はありません。

（ご参考：親投資信託の投資資産）

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	907,400	5,542.89	5,029,618,386	7,645.00	6,937,073,000	5.03
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	5,203,800	562.04	2,924,743,752	632.30	3,290,362,740	2.38
3	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	342,900	8,036.78	2,755,811,862	6,963.00	2,387,612,700	1.73
4	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	591,100	3,538.88	2,091,831,968	3,581.00	2,116,729,100	1.53
5	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	490,400	4,223.86	2,071,380,944	3,990.50	1,956,941,200	1.42
6	KDDI	日本	情報・通信業	株式	219,500	5,882.98	1,291,314,110	8,363.00	1,835,678,500	1.33
7	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	253,800	5,746.86	1,458,553,068	7,020.00	1,781,676,000	1.29
8	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	8,973,300	201.53	1,808,389,149	194.00	1,740,820,200	1.26
9	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	258,000	4,820.11	1,243,588,380	5,903.00	1,522,974,000	1.10
10	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	783,300	1,248.00	977,558,400	1,829.50	1,433,047,350	1.03
11	キヤノン	日本	電気機器	株式	380,500	3,098.40	1,178,941,200	3,740.50	1,423,260,250	1.03
12	日立製作所	日本	電気機器	株式	1,576,000	727.38	1,146,350,880	897.30	1,414,144,800	1.02
13	ファナック	日本	電気機器	株式	68,500	17,623.47	1,207,207,695	19,890.00	1,362,465,000	0.98
14	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	407,400	3,160.83	1,287,722,142	3,232.50	1,316,920,500	0.95
15	東海旅客鉄道	日本	陸運業	株式	58,900	11,769.34	693,214,126	20,320.00	1,196,848,000	0.86
16	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	271,000	3,816.67	1,034,317,570	4,337.50	1,175,462,500	0.85
17	ソニー	日本	電気機器	株式	423,300	1,771.12	749,715,096	2,774.00	1,174,234,200	0.85
18	三菱地所	日本	不動産業	株式	482,000	2,353.08	1,134,184,560	2,383.50	1,148,847,000	0.83
19	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	266,900	3,072.55	820,063,595	4,140.00	1,104,966,000	0.80
20	東日本旅客鉄道	日本	陸運業	株式	120,300	7,325.35	881,239,605	9,130.00	1,098,339,000	0.79
21	パナソニック	日本	電気機器	株式	799,700	1,146.54	916,888,038	1,352.00	1,081,194,400	0.78
22	NTTドコモ	日本	情報・通信業	株式	533,200	1,594.54	850,208,728	2,005.00	1,069,066,000	0.77
23	三井不動産	日本	不動産業	株式	343,000	3,090.84	1,060,158,120	3,000.50	1,029,171,500	0.74
24	三菱商事	日本	卸売業	株式	496,600	1,910.04	948,525,864	2,068.00	1,026,968,800	0.74
25	ブリヂストン	日本	ゴム製品	株式	215,600	3,548.14	764,978,984	4,738.00	1,021,512,800	0.74
26	花王	日本	化学	株式	189,100	3,548.53	671,027,023	5,181.00	979,727,100	0.71
27	信越化学工業	日本	化学	株式	123,400	5,544.31	684,167,854	7,848.00	968,443,200	0.70
28	富士重工業	日本	輸送用機器	株式	223,100	2,674.55	596,692,105	4,296.50	958,549,150	0.69

29	日産自動車	日本	輸送用機器	株式	920,600	886.08	815,725,248	1,016.50	935,789,900	0.67
30	三菱電機	日本	電気機器	株式	656,000	1,148.42	753,363,520	1,376.50	902,984,000	0.65

## 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	0.05
		鉱業	0.42
		建設業	2.57
		食料品	4.16
		繊維製品	0.81
		パルプ・紙	0.26
		化学	6.23
		医薬品	4.85
		石油・石炭製品	0.44
		ゴム製品	1.02
		ガラス・土石製品	0.94
		鉄鋼	1.53
		非鉄金属	0.92
		金属製品	0.67
		機械	5.01
		電気機器	12.60
		輸送用機器	11.74
		精密機器	1.45
		その他製品	1.32
		電気・ガス業	2.15
		陸運業	4.16
		海運業	0.32
		空運業	0.67
		倉庫・運輸関連業	0.25
		情報・通信業	6.89
		卸売業	3.93
小売業	4.12		
銀行業	8.63		
証券、商品先物取引業	1.25		
保険業	2.35		
その他金融業	1.10		
不動産業	2.80		
サービス業	2.86		
合 計			98.65

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	126	1,760,276,080.00	1,782,270,000	1.29

(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4計算期間末	(平成17年 6月20日)	1,088	1,088	1.1616	1.1616
第5計算期間末	(平成18年 6月20日)	2,589	2,589	1.5112	1.5112
第6計算期間末	(平成19年 6月20日)	4,359	4,359	1.7975	1.7975
第7計算期間末	(平成20年 6月20日)	6,269	6,269	1.3830	1.3830
第8計算期間末	(平成21年 6月22日)	5,780	5,780	0.9548	0.9548
第9計算期間末	(平成22年 6月21日)	6,642	6,642	0.9463	0.9463
第10計算期間末	(平成23年 6月20日)	6,935	6,935	0.8584	0.8584
第11計算期間末	(平成24年 6月20日)	7,655	7,655	0.8081	0.8081
第12計算期間末	(平成25年 6月20日)	12,168	12,168	1.1995	1.1995
第13計算期間末	(平成26年 6月20日)	14,692	14,692	1.4138	1.4138
	平成26年 1月末日	13,866	-	1.3493	-
	2月末日	13,812	-	1.3392	-
	3月末日	13,865	-	1.3412	-
	4月末日	13,501	-	1.2959	-
	5月末日	13,962	-	1.3393	-
	6月末日	14,582	-	1.4075	-
	7月末日	14,894	-	1.4364	-
	8月末日	14,784	-	1.4229	-
	9月末日	15,248	-	1.4866	-
	10月末日	15,686	-	1.4944	-
	11月末日	16,007	-	1.5794	-
	12月末日	15,924	-	1.5776	-
	平成27年 1月末日	16,233	-	1.5857	-

## 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4計算期間	平成16年 6月22日 ~ 平成17年 6月20日	1.4
第5計算期間	平成17年 6月21日 ~ 平成18年 6月20日	30.1
第6計算期間	平成18年 6月21日 ~ 平成19年 6月20日	18.9
第7計算期間	平成19年 6月21日 ~ 平成20年 6月20日	23.1

第8計算期間	平成20年 6月21日 ~ 平成21年 6月22日	31.0
第9計算期間	平成21年 6月23日 ~ 平成22年 6月21日	0.9
第10計算期間	平成22年 6月22日 ~ 平成23年 6月20日	9.3
第11計算期間	平成23年 6月21日 ~ 平成24年 6月20日	5.9
第12計算期間	平成24年 6月21日 ~ 平成25年 6月20日	48.4
第13計算期間	平成25年 6月21日 ~ 平成26年 6月20日	17.9
第14中間計算期間	平成26年 6月21日 ~ 平成26年12月20日	11.7

## (4) 設定及び解約の実績

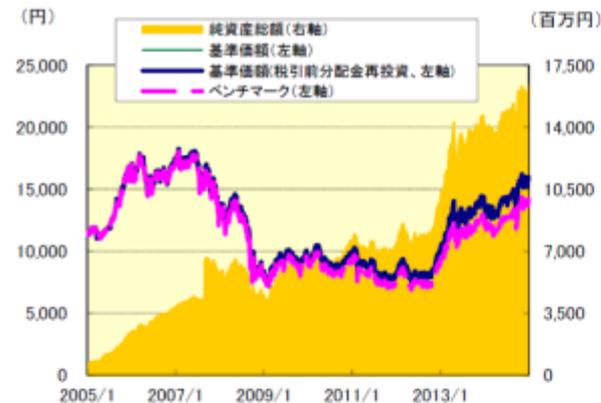
期	計算期間	設定口数 (口)	解約口数 (口)	発行済み口数 (口)
第4計算期間	平成16年 6月22日 ~ 平成17年 6月20日	656,975,453	172,255,297	936,934,733
第5計算期間	平成17年 6月21日 ~ 平成18年 6月20日	1,344,361,671	567,578,640	1,713,717,764
第6計算期間	平成18年 6月21日 ~ 平成19年 6月20日	1,462,025,964	750,598,261	2,425,145,467
第7計算期間	平成19年 6月21日 ~ 平成20年 6月20日	2,931,305,114	823,171,874	4,533,278,707
第8計算期間	平成20年 6月21日 ~ 平成21年 6月22日	2,485,548,407	965,221,439	6,053,605,675
第9計算期間	平成21年 6月23日 ~ 平成22年 6月21日	2,103,006,279	1,137,103,572	7,019,508,382
第10計算期間	平成22年 6月22日 ~ 平成23年 6月20日	2,100,335,609	1,040,442,317	8,079,401,674
第11計算期間	平成23年 6月21日 ~ 平成24年 6月20日	2,442,001,879	1,047,853,864	9,473,549,689
第12計算期間	平成24年 6月21日 ~ 平成25年 6月20日	3,297,692,954	2,626,632,560	10,144,610,083
第13計算期間	平成25年 6月21日 ~ 平成26年 6月20日	2,996,270,753	2,748,858,351	10,392,022,485
第14中間計算期間	平成26年 6月21日 ~ 平成26年12月20日	1,625,915,771	1,980,132,029	10,037,806,227

## &lt; 参考情報 &gt;

(平成27年 1月30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:2001年9月25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。

## 基準価額・純資産総額

基準価額	15,857円
純資産総額	16,233百万円

## 騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1か月	3か月	6か月	1年	3年	設定来
ファンド	+0.51	+6.11	+10.39	+17.52	+95.86	+58.57
ベンチマーク	+0.54	+6.11	+9.74	+15.93	+87.36	+40.20

※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9期	2010年6月21日	0円
第10期	2011年6月20日	0円
第11期	2012年6月20日	0円
第12期	2013年6月20日	0円
第13期	2014年6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	98.7
株式先物	1.3
短期金融資産等	0.1
合計	100.0

純資産総額 137,811百万円

## 組入上位10業種

業種名	比率(%)
1 電気機器	12.6
2 輸送用機器	11.7
3 銀行業	8.6
4 情報・通信業	6.9
5 化学	6.2
6 機械	5.0
7 医薬品	4.9
8 陸運業	4.2
9 食料品	4.2
10 小売業	4.1

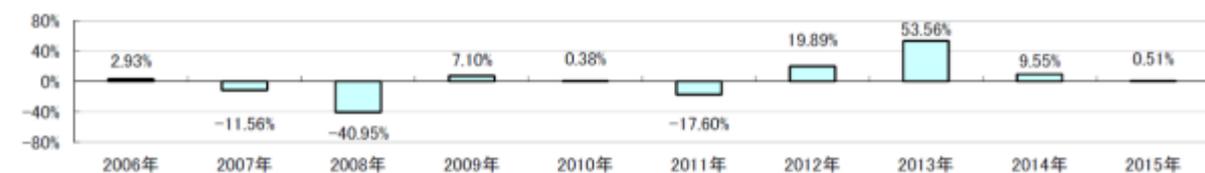
## 組入上位10銘柄

銘柄名	業種名	比率(%)
1 トヨタ自動車	輸送用機器	5.0
2 三菱UFJ FG	銀行業	2.4
3 ソフトバンク	情報・通信業	1.7
4 本田技研工業	輸送用機器	1.5
5 三井住友 FG	銀行業	1.4
6 KDDI	情報・通信業	1.3
7 日本電信電話	情報・通信業	1.3
8 みずほ FG	銀行業	1.3
9 武田薬品工業	医薬品	1.1
10 アステラス製薬	医薬品	1.0

組入銘柄数 1,027

※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。

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】

## 3 資産管理等の概要

## (5) その他

<更新後>

(略)

## 運用報告書

- 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。
- 委託会社は、運用報告書(全体版)を作成し、委託会社のホームページ(<http://www.tokiomarineam.co.jp/>)に掲載します。

c.上記b.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書(全体版)の交付の請求があった場合は、交付します。

(略)

### 第3【ファンドの経理状況】

#### 1 財務諸表

<追加>

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当中間計算期間(平成26年6月21日から平成26年12月20日まで)の中間財務諸表について、あらた監査法人により中間監査を受けております。

#### 中間財務諸表

##### 東京海上セレクション・日本株TOPIX

#### (1) 中間貸借対照表

区 分	注記 番号	前期	当中間計算期間末
		平成26年 6月20日現在	平成26年12月20日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
金銭信託			46,285,851
親投資信託受益証券		14,692,124,979	15,851,509,260
未収入金		81,399,366	55,432,262
流動資産合計		14,773,524,345	15,953,227,373
資産合計		14,773,524,345	15,953,227,373
負債の部			
流動負債			
未払解約金		37,087,134	58,514,102
未払受託者報酬		6,610,955	7,324,178
未払委託者報酬		37,462,023	41,503,601
その他未払費用		239,254	243,000
流動負債合計		81,399,366	107,584,881
負債合計		81,399,366	107,584,881
純資産の部			
元本等			
元本	1	10,392,022,485	10,037,806,227
剰余金			
中間剰余金又は中間欠損金( )		4,300,102,494	5,807,836,265
(分配準備積立金)		2,977,728,876	2,455,177,007
元本等合計		14,692,124,979	15,845,642,492
純資産合計		14,692,124,979	15,845,642,492

負債純資産合計		14,773,524,345	15,953,227,373
---------	--	----------------	----------------

## (2) 中間損益及び剰余金計算書

区 分	注記 番号	前中間計算期間	当中間計算期間
		自 平成25年 6月21日 至 平成25年12月20日	自 平成26年 6月21日 至 平成26年12月20日
		金額(円)	金額(円)
営業収益			
有価証券売買等損益		2,040,763,017	1,780,565,011
営業収益合計		2,040,763,017	1,780,565,011
営業費用			
受託者報酬		6,326,327	7,324,178
委託者報酬		35,849,139	41,503,601
その他費用		236,250	243,000
営業費用合計		42,411,716	49,070,779
営業利益又は営業損失( )		1,998,351,301	1,731,494,232
経常利益又は経常損失( )		1,998,351,301	1,731,494,232
中間純利益又は中間純損失( )		1,998,351,301	1,731,494,232
一部解約に伴う中間純利益金額の分配 額又は一部解約に伴う中間純損失金額 の分配額( )		188,874,612	153,289,723
期首剰余金又は期首欠損金( )		2,024,264,715	4,300,102,494
剰余金増加額又は欠損金減少額		507,187,142	751,825,916
中間一部解約に伴う剰余金増加額又 は欠損金減少額			
中間追加信託に伴う剰余金増加額又 は欠損金減少額		507,187,142	751,825,916
剰余金減少額又は欠損金増加額		354,849,046	822,296,654
中間一部解約に伴う剰余金減少額又 は欠損金増加額		354,849,046	822,296,654
中間追加信託に伴う剰余金減少額又 は欠損金増加額			
中間剰余金又は中間欠損金( )		3,986,079,500	5,807,836,265

## (3) 中間注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 平成26年 6月21日 至 平成26年12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。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 平成26年 6月20日現在	当中間計算期間末 平成26年12月20日現在
1. 1 期首元本額	10,144,610,083円	10,392,022,485円

期中追加設定元本額	2,996,270,753円	1,625,915,771円
期中一部解約元本額	2,748,858,351円	1,980,132,029円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	10,392,022,485口	10,037,806,227口

## (中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 平成25年 6月21日 至 平成25年12月20日	当中間計算期間 自 平成26年 6月21日 至 平成26年12月20日
該当事項はありません。	同 左

## (金融商品に関する注記)

## 金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 平成26年 6月20日現在	当中間計算期間末 平成26年12月20日現在
1. 中間貸借対照表計上額、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

## (1口当たり情報に関する注記)

前期 平成26年 6月20日現在		当中間計算期間末 平成26年12月20日現在	
1口当たり純資産額	1.4138円	1口当たり純資産額	1.5786円
(1万口当たり純資産額)	14,138円)	(1万口当たり純資産額)	15,786円)

## (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、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同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	平成26年 6月20日現在	平成26年12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		5,711,993,714	3,628,531,629
株式	2	198,511,162,200	138,197,050,300
派生商品評価勘定		205,141,800	12,852,000
未収入金			8,811,239,110
未収配当金		944,691,091	12,458,125
未収利息		7,129	4,538
前払金			127,788,000
流動資産合計		205,372,995,934	150,789,923,702
資産合計		205,372,995,934	150,789,923,702
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定			52,977,880
前受金		197,685,000	
未払金			3,433,760
未払解約金		221,815,143	8,971,992,814
流動負債合計		419,500,143	9,028,404,454
負債合計		419,500,143	9,028,404,454
純資産の部			
元本等			
元本	1	218,520,403,177	134,955,667,691
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）	3	13,566,907,386	6,805,851,557
元本等合計		204,953,495,791	141,761,519,248
純資産合計		204,953,495,791	141,761,519,248
負債純資産合計		205,372,995,934	150,789,923,702

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成26年 6月21日 至 平成26年12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	平成26年 6月20日現在	平成26年12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 同期中における追加設定元本額 同期中における一部解約元本額 同中間期末における元本額  元本の内訳* 東京海上日本株 T O P I X フア ン ド 東京海上セレクション・日本株 T O P I X L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド ( 慎 重 型 ) L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド ( 安 定 重 視 型 ) L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド ( バ ラ ン ス 型 ) L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド ( 成 長 重 視 型 ) L P S 4 資 産 分 散 フ ァ ン ド ( 積 極 型 ) T M A 日 本 株 式 イ ン デ ッ ク ス V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 > T M A 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 5 5 V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 > T M A 世 界 バ ラ ン ス フ ァ ン ド 3 5 V A < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 > T M A 新 興 国 重 視 型 バ ラ ン ス V A ( 適 格 機 関 投 資 家 限 定 ) T M A 債 券 重 視 型 バ ラ ン ス V A ( 適 格 機 関 投 資 家 限 定 ) T M A 資 産 分 散 型 バ ラ ン ス V A ( 適 格 機 関 投 資 家 限 定 ) 東 京 海 上 ・ T O P I X イ ン デ ッ ク ス フ ァ ン ド < 適 格 機 関 投 資 家 限 定 > 計	176,954,325,898円 89,643,783,880円 48,077,706,601円 218,520,403,177円  764,475,081円 15,664,916,281円 800,449円 1,296,617円 7,252,495円 6,009,525円 11,092,136円 105,257,913,922円 5,288,634,914円 35,403,084,307円 895,760円 2,866,528円 10,444,069円 56,100,721,093円 218,520,403,177円	218,520,403,177円 22,934,378,364円 106,499,113,850円 134,955,667,691円  591,114,662円 15,090,926,562円 818,243円 1,794,690円 9,462,624円 11,072,802円 21,134,836円 87,553,322,118円 3,856,216,969円 17,317,449,091円 651,759円 2,063,588円 10,074,101円 10,489,565,646円 134,955,667,691円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	218,520,403,177口	134,955,667,691口
3. 2 担保資産	代用有価証券として、担保に供している資産は次のとおりであります。  株式 1,507,500,000円	代用有価証券として、担保に供している資産は次のとおりであります。  株式 1,890,500,000円
4. 3 元本の欠損	純資産額が元本総額を下回っており、その差額は13,566,907,386円であります。	

(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）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	平成26年 6月20日現在	平成26年12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	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>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。</p>	同左

（デリバティブ取引等に関する注記）

取引の時価等に関する事項

株式関連

（平成26年6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	6,147,315,000		6,352,500,000	205,185,000
	東証株価指数先物	6,147,315,000		6,352,500,000	205,185,000
	合計	6,147,315,000		6,352,500,000	205,185,000

（平成26年12月20日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,537,418,000		3,497,520,000	39,898,000
	東証株価指数先物	3,537,418,000		3,497,520,000	39,898,000
合計		3,537,418,000		3,497,520,000	39,898,000

(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中間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、同中間計算期間末日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しております。

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

(1口当たり情報に関する注記)

平成26年 6月20日現在		平成26年12月20日現在	
1口当たり純資産額	0.9379円	1口当たり純資産額	1.0504円
(1万口当たり純資産額)	9,379円)	(1万口当たり純資産額)	10,504円)

## 2 ファンドの現況

&lt;更新後&gt;

純資産額計算書

平成27年1月30日現在

種類	金額
資産総額	16,285,237,437 円
負債総額	52,101,811 円
純資産総額 ( - )	16,233,135,626 円
発行済数量	10,237,090,936 口
1 単位当たり純資産額 ( / )	1.5857 円

(ご参考：親投資信託の現況)

TMA日本株TOPIXマザーファンド

平成27年1月30日現在

種類	金額
資産総額	141,085,212,656 円
負債総額	3,273,840,951 円
純資産総額 ( - )	137,811,371,705 円
発行済数量	130,519,843,735 口
1 単位当たり純資産額 ( / )	1.0559 円

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1 委託会社等の概況

<訂正前>

平成26年7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。

(略)

<訂正後>

平成27年1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。

(略)

#### 2 事業の内容及び営業の概況

<訂正前>

(略)

平成26年7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	<u>1</u>	<u>2,389</u>
追加型株式投資信託	<u>133</u>	<u>1,914,423</u>
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>13</u>	<u>60,906</u>
合計	<u>147</u>	<u>1,977,719</u>

<訂正後>

(略)

平成27年1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	<u>0</u>	<u>0</u>
追加型株式投資信託	<u>142</u>	<u>1,843,453</u>
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	<u>14</u>	<u>68,524</u>
合計	<u>156</u>	<u>1,911,978</u>

[次へ](#)

### 3 委託会社等の経理状況

#### <訂正前>

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。

なお、第29期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則並びに同規則第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。

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29期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

#### <訂正後>

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。

なお、第29期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表に含まれる比較情報については、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則等の一部を改正する内閣府令」（平成24年9月21日内閣府令第61号）附則第2条第2項により、改正前の財務諸表等規則並びに同規則第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29期事業年度（平成25年4月1日から平成26年3月31日まで）の財務諸表について、あらた監査法人により監査を受けております。

また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間（平成26年4月1日から平成26年9月30日まで）の中間財務諸表について、あらた監査法人による中間監査を受けております。

原届出書の 第三部 委託会社等の情報 第1 委託会社等の概況 3 委託会社等の経理状況 につきましては、前記の訂正のほか、「中間財務諸表」として以下の内容が追加されます。

#### 中間財務諸表

##### (イ)中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (平成26年9月30日現在)	
資産の部	
流動資産	
現金・預金	8,929,625
前払費用	125,585
未収委託者報酬	1,864,341
未収収益	2,798,840
未収入金	31,466
繰延税金資産	355,439
その他の流動資産	14,017
流動資産計	14,119,316
固定資産	
有形固定資産	* 1
建物	97,867

器具備品		79,705
無形固定資産		3,144
電話加入権		3,144
投資その他の資産		751,451
投資有価証券		31,309
関係会社株式		254,342
その他の関係会社有価証券		31,200
長期前払費用		26,517
敷金		282,806
繰延税金資産		125,275
固定資産計		932,167
資産合計		15,051,484
負債の部		
流動負債		
預り金		38,511
未払金		1,555,346
未払手数料		559,534
その他未払金		995,811
未払費用		165,527
未払消費税等	* 2	217,486
未払法人税等		869,000
前受収益		181,306
賞与引当金		394,109
その他の流動負債		3,240
流動負債計		3,424,527
固定負債		
退職給付引当金		170,525
役員退職慰労引当金		16,630
固定負債計		187,155
負債合計		3,611,682
純資産の部		
株主資本		11,436,661
資本金		2,000,000
利益剰余金		9,436,661
利益準備金		500,000
その他利益剰余金		8,936,661
繰越利益剰余金		8,936,661
評価・換算差額等		3,139
その他有価証券評価差額金		3,139
純資産合計		11,439,801
負債・純資産合計		15,051,484

## (口)中間損益計算書

(単位：千円)

当中間会計期間  
(自 平成26年4月1日  
至 平成26年9月30日)

営業収益		
委託者報酬		4,574,151
運用受託報酬		3,925,933
投資助言報酬		17,103
その他営業収益		736
営業収益計		8,517,926
営業費用		
支払手数料		1,898,804
広告宣伝費		51,166
公告費		533
調査費		2,462,761
調査費		679,250
委託調査費		1,783,510
委託計算費		40,037
営業雑経費		81,027
通信費		14,823
印刷費		45,225
協会費		12,909
諸会費		3,368
図書費		4,700
営業費用計		4,534,330
一般管理費		
給料		957,081
役員報酬		40,531
給料・手当		835,102
賞与		81,448
交際費		3,078
旅費交通費		44,936
租税公課		23,932
不動産賃借料		129,195
役員退職慰労引当金繰入		1,580
退職給付費用		31,539
賞与引当金繰入		394,109
固定資産減価償却費	* 1	29,736
法定福利費		192,378
福利厚生費		5,886
諸経費		173,569
一般管理費計		1,987,025
営業利益		1,996,570
営業外収益		
受取利息		779
受取配当金		51,954
雑益		3,940
営業外収益計		56,674
営業外費用		
雑損		62,176
営業外費用計		62,176
経常利益		1,991,068
税引前中間純利益		1,991,068
法人税、住民税及び事業税		849,031
法人税等調整額		148,516

法人税等合計	700,514
中間純利益	1,290,554

## (八)中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間(自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)

(単位:千円)

	株主資本				株主資本合計
	資本金	利益剰余金		利益剰余金 合計	
		利益準備金	その他利益 剰余金 繰越利益 剰余金		
当期首残高	2,000,000	500,000	8,450,867	8,950,867	10,950,867
当中間期変動額					
剰余金の配当			804,759	804,759	804,759
中間純利益			1,290,554	1,290,554	1,290,554
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	-	-	485,794	485,794	485,794
当中間期末残高	2,000,000	500,000	8,936,661	9,436,661	11,436,661

	評価・換算差額等		純資産合計
	その他有価証券 評価差額金	評価・換算差額等合計	
当期首残高	1,809	1,809	10,952,676
当中間期変動額			
剰余金の配当			804,759
中間純利益			1,290,554
株主資本以外の項目の当中間期変動額(純額)	1,330	1,330	1,330
当中間期変動額合計	1,330	1,330	487,124
当中間期末残高	3,139	3,139	11,439,801

## (二)重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
1. 資産の評価基準及び評価方法	有価証券 (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

	<p>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）</p> <p>時価を把握することが極めて困難と認められるもの</p> <p>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 定率法</p> <p>ただし、平成10年4月1日以降に取得した建物（建物附属設備を除く）については定額法、少額固定資産（取得価格が10万円以上20万円未満の資産）については、3年間で均等償却する方法を採用しております。</p> <p>(2) 長期前払費用 定額法</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金</p> <p>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> <p>(3) 役員退職慰労引当金</p> <p>役員の退職慰労金の支出に備えるため、内規に基づく中間期末要支給額を計上しております。</p>
4. 消費税等の会計処理方法	<p>消費税及び地方消費税の会計処理は税抜方式によっており、控除対象外消費税及び地方消費税は、当中間会計期間の費用として処理しております。</p>

## 注記事項

(中間貸借対照表関係)

	<p>当中間会計期間 (平成26年9月30日現在)</p>
--	-----------------------------------

1 有形固定資産の減価償却累計額	建物 器具備品	128,400千円 488,793千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。	

## (中間損益計算書関係)

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)	
1 減価償却実施額	有形固定資産	29,736千円

## (中間株主資本等変動計算書関係)

当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)				
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2. 配当に関する事項				
(1) 配当金支払額				
平成26年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。				
・普通株式の配当に関する事項				
(イ) 配当金総額・・・・・・・・・・804,759千円				
(ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・21,012円				
(ハ) 基準日・・・・・・・・・・平成26年3月31日				
(ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・平成26年6月30日				

## (金融商品関係)

当中間会計期間（平成26年9月30日現在）

金融商品の時価等に関する事項

平成26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	8,929,625	8,929,625	
(2)未収委託者報酬	1,864,341	1,864,341	
(3)未収収益	2,798,840	2,798,840	
(4)未収入金	31,466	31,466	
(5)投資有価証券 その他有価証券	31,309	31,309	
(6)敷金	282,806	221,970	60,835
(7)未払金	(1,555,346)	(1,555,346)	

(\*) 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) 未収収益並びに(4) 未収入金及び(7) 未払金

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

(5) 投資有価証券

時価の算定方法につきましては「(二)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。

(6) 敷金

当社では、敷金の時価の算定は、その将来キャッシュ・フローを国債の利回り等適切な指標に当該建物の残存耐用年数を加味した利率で割り引いた現在価値より算定しております。

(注2) 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221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(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ため、上表には含めておりません。

(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

金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては変動要因を織り込んでいるため、異なる前提条件等を採用することにより、当該価額が変動することがあります。

(有価証券関係)

当中間会計期間(平成26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221,595千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額31,200千円)は、市場価格がなく、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

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	29,609	24,431	5,178
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	1,700	2,000	300
合計		31,309	26,431	4,878

(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26年4月1日 至 平成26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26年4月1日 至 平成26年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

本邦の外部顧客への営業収益が中間損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。

(2) 有形固定資産

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

### 3. 主要な顧客ごとの情報

当社は、外部顧客からの収益のうち、中間損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。

#### (1 株当たり情報)

	当中間会計期間 (自 平成26年4月1日 至 平成26年9月30日)
1株当たり純資産額	298,689円33銭
1株当たり中間純利益金額	33,695円93銭
	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株当たり中間純利益金額の算定上の基礎は以下のとおりであります。

中間純利益	1,290,554千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式にかかる中間純利益	1,290,554千円
期中平均株式数	38,300株

## 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

<訂正前>

#### (1) 受託会社

- ・名称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・資本金の額 324,279百万円(平成26年3月末日現在)
- ・事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・資本金の額 10,000百万円(平成26年3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
株式会社八十二銀行	52,243百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

( )平成26年3月末日現在。

<訂正後>

#### (1) 受託会社

- ・名称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・資本金の額 324,279百万円(平成26年9月末日現在)
- ・事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・資本金の額 10,000百万円(平成26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
株式会社八十二銀行	52,243百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

( )平成26年9月末日現在。

## 独立監査人の中間監査報告書

平成26年12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

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 荒川 進  
業務執行社員

指定社員 公認会計士 和田 渉  
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26年4月1日から平成27年3月31日までの第30期事業年度の中間会計期間（平成26年4月1日から平成26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な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26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26年4月1日から平成26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. X B R L データは監査の対象には含まれていません。

[次へ](#)

## 独立監査人の中間監査報告書

平成27年2月12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

### あらた監査法人

指定社員 公認会計士 和田 渉  
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セレクション・日本株TOPIXの平成26年6月21日から平成26年12月20日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

#### 中間財務諸表に対する経営者の責任

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

#### 監査人の責任

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

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

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

#### 中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上セレクション・日本株TOPIXの平成26年12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中間計算期間（平成26年6月21日から平成26年12月20日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

#### 利害関係

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、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データは監査の対象には含まれていません。