

【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2020年9月18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】	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
【電話番号】	03 - 3212 - 8421
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	東京海上セレクション・日本株TOPIX
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限 1兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

東京海上セレクション・日本株TOPIX（以下「当ファンド」ということがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

当ファンドの受益権は、社債、株式等の振替に関する法律（以下「社振法」といいます。）の規定に基づく投資信託の受益権であり、受益権の帰属は、後述の「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関及び当該振替機関の下位の口座管理機関（社振法第2条に規定する「口座管理機関」をいい、振替機関を含め、以下「振替機関等」といいます。）の振替口座簿に記載または記録されることにより定まります（以下、振替口座簿に記載または記録されることにより定まる受益権を「振替受益権」といいます。）。委託会社である東京海上アセットマネジメント株式会社（以下「委託会社」といいます。）は、やむを得ない事情等がある場合を除き、当該振替受益権を表示する受益証券を発行しません。なお、振替受益権には無記名式や記名式の形態はありません。

当初の1口当たり元本は1円です。

委託会社の依頼により、信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供された信用格付または信用格付業者から提供され、もしくは閲覧に供される予定の信用格付はありません。

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額

基準価額は、販売会社または委託会社に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（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）

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）

(5)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

(6)【申込単位】

1円以上1円単位となります。

上記にかかわらず、自動けいぞく（累積）投資に基づく収益分配金の再投資に際しては、1口の整数倍をもって取得できます。

(7)【申込期間】

2020年9月19日から2021年3月19日まで

上記申込期間中の毎営業日にお申込みを受け付けます。

申込期間は、上記期間満了前に委託会社が有価証券届出書を提出することにより更新されます。

(8)【申込取扱場所】

販売会社の本・支店のうち、確定拠出年金制度に基づいた受益権の取得申込を取扱う部店のみでの取扱いとなりますのでご注意ください。詳しくは販売会社の最寄りの本・支店等にお問い合わせください。なお、販売会社については、委託会社サービスデスクにお問い合わせください。

(9)【払込期日】

取得申込者は、申込金（発行価格に取得申込口数を乗じて得た申込時の支払総額をいいます。）を販売会社所定の期日までに販売会社に支払うものとします。

各取得申込日の発行価額の総額は各追加信託が行われる日に、販売会社から、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社である三菱UFJ信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の指定する当ファンドの口座に振込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

申込の方法

- a. 当ファンドの取得申込者は、原則として確定拠出年金法に定める加入者等の運用の指図に基づいて受益権の取得申込を行う資産管理機関および連合会等に限るものとします。ただし、ファンドの設定・維持のため委託会社またはその関係会社が自己の資金をもって取得する場合はこの限りではありません。
- b. 受益権の取得申込は、販売会社において申込期間中の毎営業日に受け付けます。
- c. 取得申込者は、申込金額相当額の申込金を販売会社に支払うものとします。ただし、当ファンドは上記「(9)払込期日」にしたがい受託会社に払込まれた時点で初めて設定がなされ、取得申込者はその時点から当ファンドの当該設定にかかる受益者となります。申込金には利息を付けません。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までの受付分を当日分とし、この受付時間を過ぎてからの申込分は翌営業日の受付分とします。
- e. 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。
（ ）金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第28条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます（以下、本書において同じ。）。
- f. 取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込を行うものとします。（ただし、既に取引口座をお持ちの場合を除きます。）
- g. 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を再投資する自動けいぞく（累積）投資専用ファンドです。このため申込の際、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく（累積）投資に関する契約を締結する必要があります。
上記の契約について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約等が用いられることがあります。この場合、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。）。

日本以外の地域における発行

該当ありません。

振替受益権について

当ファンドの受益権は、社振法の規定の適用を受け、上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の振替業にかかる業務規程等の規則にしたがって取り扱われるものとします。

ファンドの分配金、償還金、換金代金は、社振法および上記「(11) 振替機関に関する事項」に記載の振替機関の業務規程その他の規則にしたがって支払われます。

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

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	ファミリーファンド	日経225
	年2回	日本		
債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ()	年4回	北米	ファミリーファンド	TOPIX
	年6回 (隔月)	欧州		
不動産投信	年12回 (毎月)	アジア	ファミリーファンド	TOPIX
	日々	オセアニア		
その他資産 (投資信託証券(株 式(一般)))	その他 ()	中南米	ファミリーファンド	その他 ()
		アフリカ		
資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型		中近東 (中東)	ファミリーファンド	その他 ()
		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	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。
	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

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。

- 主に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「TMA日本株TOPIXマザーファンド」(以下「マザーファンド」といいます。))に投資します。
- 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を目標とします。

- TOPIXをベンチマークとします。
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指数について>

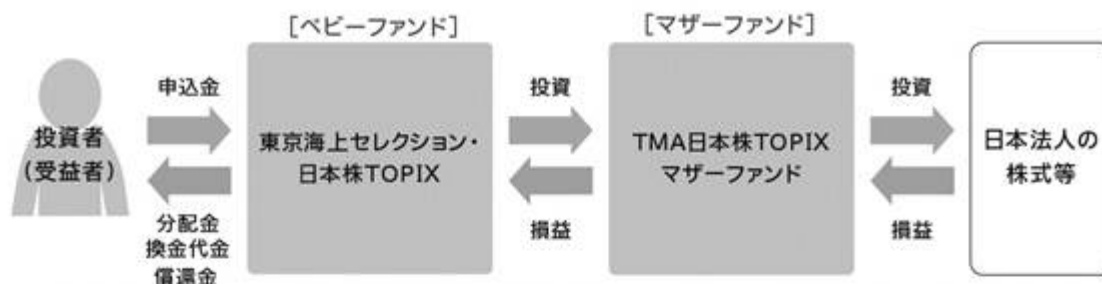
- TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。
- (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- 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、ファンドの購入者又は公衆に対し、ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- (株)東京証券取引所は、委託会社又はファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所はファンドの設定、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。

次ページへ続く

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

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



※「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。

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。

分配方針

◎年1回決算を行います。

- 6月20日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として次の方針に基づき分配を行います。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。)等の全額とします。収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。

《イメージ図》

決算	1月	2月	3月	4月	5月	6月	7月	8月	9月	10月	11月	12月
分配						👛						

① 上図はイメージ図であり、将来の分配金の支払いおよびその金額について、示唆・保証するものではありません。実際の分配金額は運用実績に応じて決定されます。

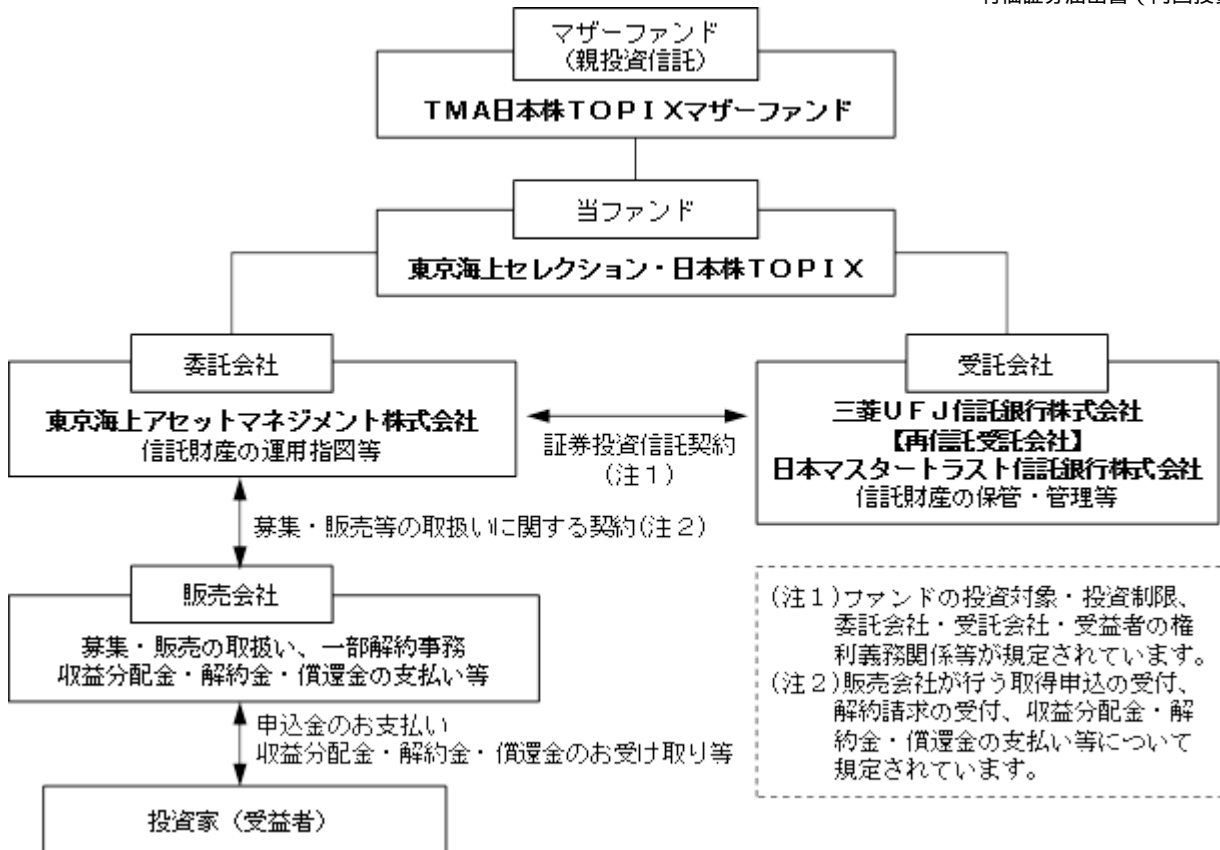
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2001年9月25日 ファンドの設定、運用開始

(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(2020年6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(2020年6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。

TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

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

株式以外の資産（マザーファンド受益証券を通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、当ファンドの信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

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

<基本方針> TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

(1)投資対象

東京証券取引所第一部に上場されている銘柄を主要投資対象とします。

(2)運用方針

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

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

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

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、日本において行われる有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における日本の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことがあります。また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（スワップ取引）を行うことがあります。

<投資制限>

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

(4) 投資信託証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(5) 同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券への投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

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

(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、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22条（先物取引等の運用指図）、第23条（スワップ取引の運用指図）および第24条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）に定めるものに限り、）

金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。 ）

約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。 ）

- (2) 次に掲げる特定資産以外の資産
為替手形

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

- (1) 株券または新株引受権証券
- (2) 国債証券
- (3) 地方債証券
- (4) 特別の法律により法人の発行する債券
- (5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
- (6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
- (7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
- (8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
- (9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
- (10) コマーシャル・ペーパー
- (11) 新株引受権証券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
- (12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
- (13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
- (14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
- (15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
- (16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限ります。）
- (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書
- (19) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限ります。）
- (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。

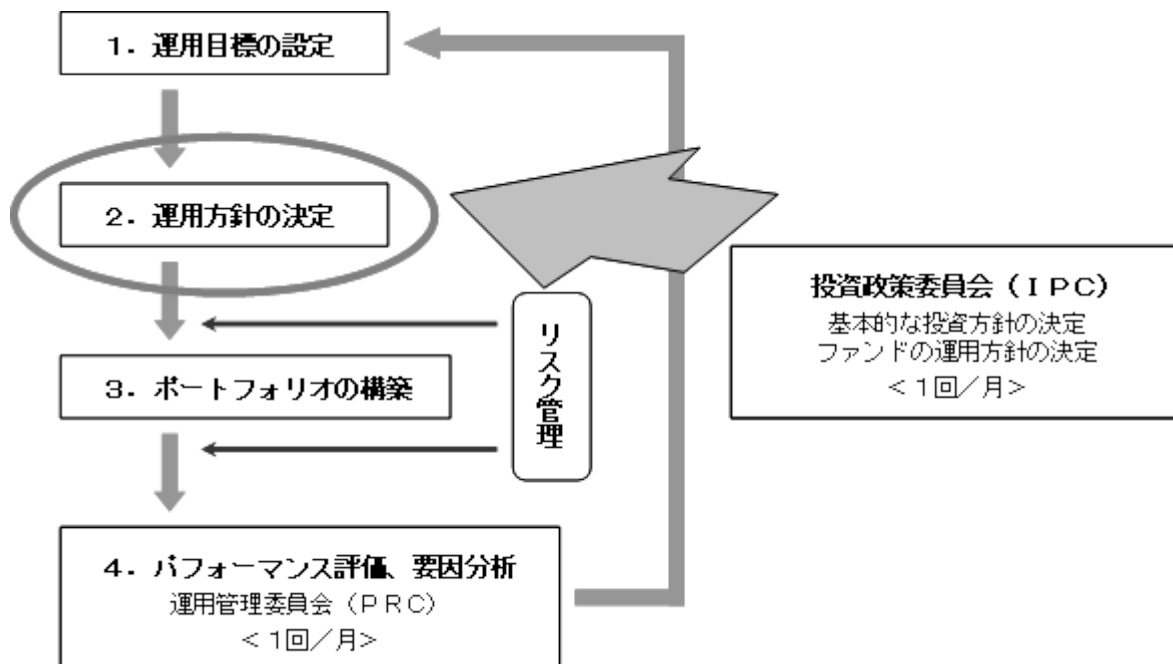
3. 委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。

- (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】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



ファンドの運用に関する社内規則として「投資運用業に係る業務運営規程」を設けております。

運用におけるリスク管理は、運用管理部（5～10名程度）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、2020年7月1日現在）

(4) 【配分方針】

年1回（原則として6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。

- 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。
- 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せん。）、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せん。）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、自動けいぞく（累積）投資に関する契約に基づき、自動的に無手数料で再投資されます。なお、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19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21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22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、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、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。
- 有価証券の貸付(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、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27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。

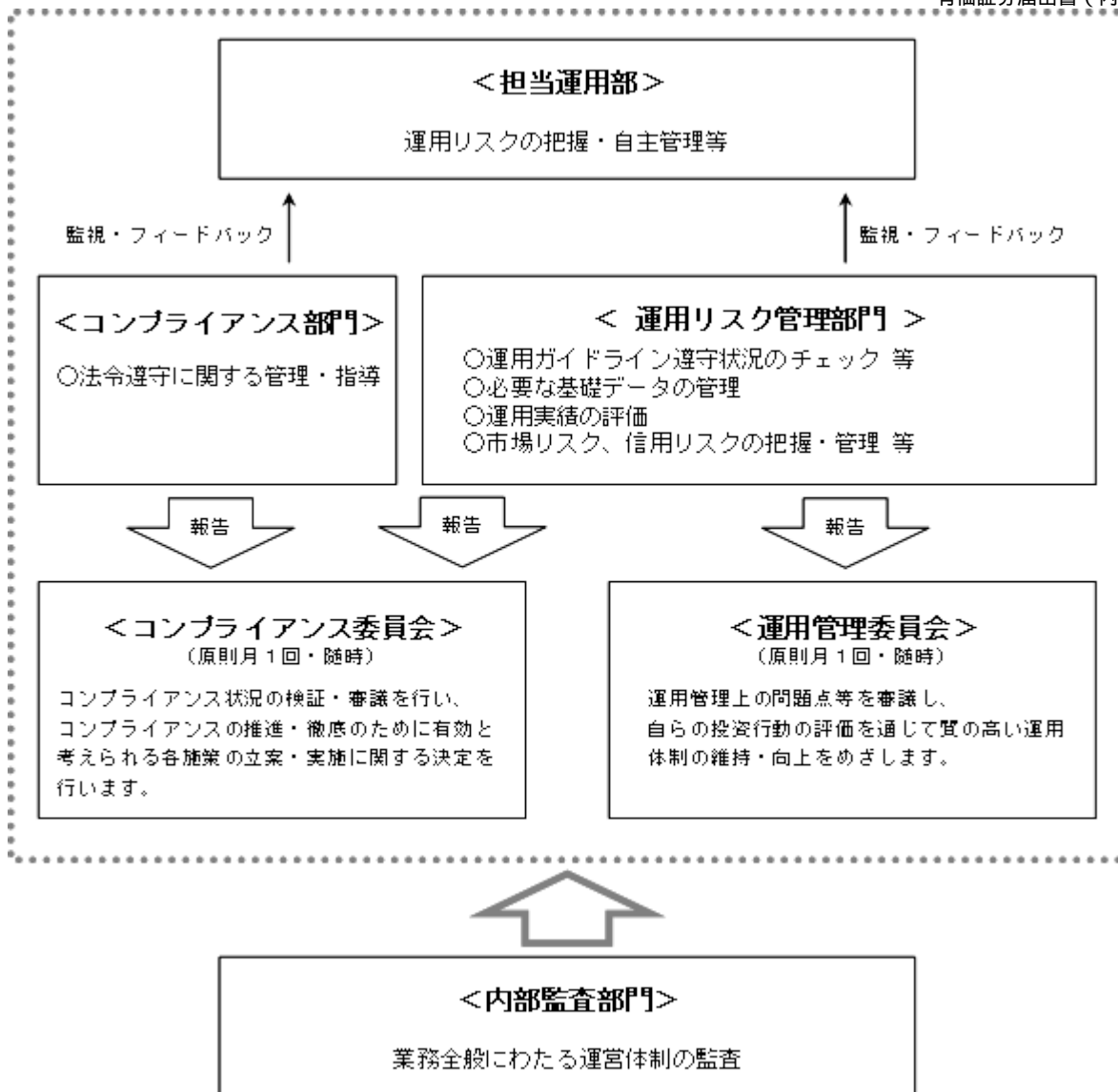
3. 管理体制

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

2015年7月～2020年6月

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。

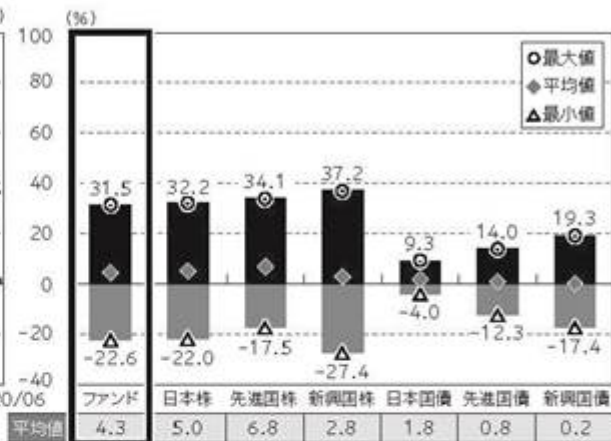


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したも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。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。



※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。

※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も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指数名

日本株	TOPIX (東証株価指数) (配当込み)
先進国株	MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)
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)
日本国債	NOMURA-BPI (国債)
先進国債	FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)
新興国債	JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)

指数について

●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。●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。両指数の著作権、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社は両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社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。●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。両指数の著作権、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社は両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社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。●NOMURA-BPI (国債) は、野村證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、野村證券に帰属します。●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及び完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース) は、J.P. Morgan Securities LLCが発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(注) 海外の指数は、為替ヘッジなしによる投資を想定して、円ベースとしています。

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。

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0.66%（税抜0.6%）^{*}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。

^{*} 2020年10月1日以降は、年率0.154%（税抜0.14%）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 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
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%

2020年10月1日以降は、以下のとおりとなります。

委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
年率0.06%	年率0.06%	年率0.02%

^{*} 1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

^{*} 2 購入後の情報提供、運用報告書等各種書類の送付、口座内でのファンドの管理および事務手続き等の対価

^{*} 3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

(4) 【その他の手数料等】

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用であり、毎日、純資産総額に対し、年率0.0055%（税抜0.005%）を乗じて得た金額（ただし、年49.5万円（税抜45万円）の1日分相当額を上限とします。）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。

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】

当ファンドは、課税上は株式投資信託として取扱われますが、受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、収益分配金および解約時・償還時の各受益者の個別元本（1）超過額に対する所得税、復興特別所得税および地方税はかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

上記によらない受益者に対する課税については、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、変更になることがあります。

< 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)(2)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、)ならびに解約時および償還時の損益については、確定申告により、上場株式等(特定公社債および公募公社債投信を含みます。)の利子所得および配当所得(申告分離課税を選択したものに限り、)ならびに譲渡所得等との間で損益通算を行うことができます。

外国税額控除の適用となった場合には、分配時の税金が上記とは異なる場合があります。

<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」(1)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)(2)は課税されません。

なお、益金不算入制度の適用はありません。

(1)「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。

(2)「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。

*上記は、2020年6月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

5【運用状況】

以下は2020年6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	20,981,059,663	100.01
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		3,065,232	0.01
合計(純資産総額)		20,977,994,431	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	27,504,955,680	95.43
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		1,315,418,184	4.56
合計(純資産総額)		28,820,373,864	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	1,371,480,000	4.75

(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	15,940,631,867	1.3308	21,214,202,729	1.3162	20,981,059,663	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	140,300	6,205.77	870,669,840	6,762.00	948,708,600	3.29
2	ソニー	日本	電気機器	株式	78,900	5,948.97	469,374,280	7,384.00	582,597,600	2.02
3	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	98,000	3,287.04	322,130,500	5,450.00	534,100,000	1.85
4	キーエンス	日本	電気機器	株式	11,400	33,031.25	376,556,250	45,030.00	513,342,000	1.78
5	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	165,100	2,499.97	412,745,080	2,515.50	415,309,050	1.44
6	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	104,900	3,063.30	321,340,440	3,848.00	403,655,200	1.40
7	任天堂	日本	その他製品	株式	7,700	38,326.78	295,116,280	48,010.00	369,677,000	1.28
8	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	847,700	399.45	338,618,140	421.60	357,390,320	1.24
9	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	86,200	2,645.80	228,067,980	3,682.00	317,388,400	1.10
10	第一三共	日本	医薬品	株式	36,000	6,820.67	245,544,300	8,806.00	317,016,000	1.09
11	KDDI	日本	情報・通信業	株式	90,200	2,931.86	264,453,772	3,234.00	291,706,800	1.01
12	ダイキン工業	日本	機械	株式	16,000	12,740.32	203,845,120	17,335.00	277,360,000	0.96
13	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	99,200	2,248.16	223,018,320	2,755.50	273,345,600	0.94
14	信越化学工業	日本	化学	株式	21,100	9,112.81	192,280,500	12,595.00	265,754,500	0.92

15	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	86,000	2,661.04	228,849,440	3,032.00	260,752,000	0.90
16	HOYA	日本	精密機器	株式	25,100	8,564.72	214,974,560	10,260.00	257,526,000	0.89
17	花王	日本	化学	株式	30,100	7,883.16	237,283,350	8,540.00	257,054,000	0.89
18	NTTドコモ	日本	情報・通信業	株式	88,400	3,198.11	282,713,600	2,882.00	254,768,800	0.88
19	村田製作所	日本	電気機器	株式	37,000	4,946.64	183,025,680	6,316.00	233,692,000	0.81
20	ファナック	日本	電気機器	株式	11,900	13,485.04	160,472,060	19,260.00	229,194,000	0.79
21	中外製薬	日本	医薬品	株式	39,600	4,111.27	162,806,410	5,765.00	228,294,000	0.79
22	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	1,679,300	122.62	205,915,961	132.20	222,003,460	0.77
23	日本電産	日本	電気機器	株式	30,300	5,212.85	157,949,550	7,196.00	218,038,800	0.75
24	S M C	日本	機械	株式	3,900	40,735.41	158,868,100	55,180.00	215,202,000	0.74
25	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	8,000	17,379.68	139,037,440	26,440.00	211,520,000	0.73
26	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	44,000	4,654.64	204,804,380	4,698.00	206,712,000	0.71
27	日立製作所	日本	電気機器	株式	60,600	2,678.10	162,293,100	3,403.00	206,221,800	0.71
28	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	86,800	2,111.19	183,251,770	2,321.50	201,506,200	0.69
29	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	109,300	1,467.07	160,350,860	1,799.50	196,685,350	0.68
30	三菱商事	日本	卸売業	株式	81,400	2,285.23	186,017,722	2,270.00	184,778,000	0.64

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	0.09
		鉱業	0.18
		建設業	2.40
		食料品	3.80
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.23
		化学	7.01
		医薬品	6.65
		石油・石炭製品	0.41
		ゴム製品	0.59
		ガラス・土石製品	0.67
		鉄鋼	0.56
		非鉄金属	0.62
		金属製品	0.55
		機械	4.92
		電気機器	14.46
		輸送用機器	6.97
		精密機器	2.51
		その他製品	2.41
		電気・ガス業	1.49
陸運業	3.83		
海運業	0.11		
空運業	0.32		

	倉庫・運輸関連業	0.21
	情報・通信業	9.31
	卸売業	4.38
	小売業	4.73
	銀行業	4.81
	証券、商品先物取引業	0.76
	保険業	1.89
	その他金融業	1.06
	不動産業	1.86
	サービス業	4.96
合 計		95.43

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	88	1,400,301,800.00	1,371,480,000	4.75

(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	(2011年 6月20日)	6,935	6,935	0.8584	0.8584
第11計算期間末	(2012年 6月20日)	7,655	7,655	0.8081	0.8081
第12計算期間末	(2013年 6月20日)	12,168	12,168	1.1995	1.1995
第13計算期間末	(2014年 6月20日)	14,692	14,692	1.4138	1.4138
第14計算期間末	(2015年 6月22日)	18,678	18,678	1.8608	1.8608
第15計算期間末	(2016年 6月20日)	16,163	16,163	1.4627	1.4627
第16計算期間末	(2017年 6月20日)	20,048	20,048	1.8792	1.8792
第17計算期間末	(2018年 6月20日)	22,536	22,536	2.0657	2.0657
第18計算期間末	(2019年 6月20日)	20,905	20,905	1.8718	1.8718
第19計算期間末	(2020年 6月22日)	21,221	21,221	1.9315	1.9315
	2019年 6月末日	20,798	-	1.8640	-
	7月末日	21,028	-	1.8794	-
	8月末日	20,418	-	1.8150	-
	9月末日	21,429	-	1.9242	-
	10月末日	22,477	-	2.0192	-
	11月末日	22,786	-	2.0568	-

12月末日	22,917	-	2.0858	-
2020年 1月末日	22,479	-	2.0412	-
2月末日	19,853	-	1.8308	-
3月末日	19,004	-	1.7217	-
4月末日	19,862	-	1.7934	-
5月末日	21,246	-	1.9141	-
6月末日	20,977	-	1.9094	-

【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	2010年 6月22日～2011年 6月20日	9.3
第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	5.9
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	48.4
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	17.9
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	31.6
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	21.4
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	28.5
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	9.9
第18計算期間	2018年 6月21日～2019年 6月20日	9.4
第19計算期間	2019年 6月21日～2020年 6月22日	3.2

(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	2010年 6月22日～2011年 6月20日	2,100,335,609	1,040,442,317	8,079,401,674
第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	2,442,001,879	1,047,853,864	9,473,549,689
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	3,297,692,954	2,626,632,560	10,144,610,083
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	2,996,270,753	2,748,858,351	10,392,022,485
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	3,281,969,577	3,636,319,417	10,037,672,645
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	3,329,100,805	2,315,993,314	11,050,780,136
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	2,809,980,837	3,191,761,975	10,668,998,998
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	2,645,609,805	2,404,774,151	10,909,834,652
第18計算期間	2018年 6月21日～2019年 6月20日	2,195,161,064	1,936,232,010	11,168,763,706
第19計算期間	2019年 6月21日～2020年 6月22日	2,536,213,271	2,717,849,918	10,987,127,059

< 参考情報 >

基準日：2020年6月30日

基準価額・純資産の推移



※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。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。※設定日は2001年9月25日です。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第15期	2016/06/20	0円
第16期	2017/06/20	0円
第17期	2018/06/20	0円
第18期	2019/06/20	0円
第19期	2020/06/22	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

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	95.4%
株式先物	4.8%
短期金融資産等	-0.2%
合計	100.0%

● 組入上位10業種

業種名	比率
1 電気機器	14.5%
2 情報・通信業	9.3%
3 化学	7.0%
4 輸送用機器	7.0%
5 医薬品	6.7%
6 サービス業	5.0%
7 機械	4.9%
8 銀行業	4.8%
9 小売業	4.7%
10 卸売業	4.4%

● 組入上位10銘柄

組入銘柄数：1,081銘柄

銘柄名	業種名	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.3%
2 ソニー	電気機器	2.0%
3 ソフトバンクグループ	情報・通信業	1.9%
4 キーエンス	電気機器	1.8%
5 日本電信電話	情報・通信業	1.4%
6 武田薬品工業	医薬品	1.4%
7 任天堂	その他製品	1.3%
8 三菱UFJ F G	銀行業	1.2%
9 リクルートHD	サービス業	1.1%
10 第一三共	医薬品	1.1%

※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。

・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。

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- a. 毎営業日にお申込みを受け付けます。
- b. 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を自動的に無手数料で再投資する自動けいぞく（累積）投資専用ファンドです。このため、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく（累積）投資に関する契約を締結する必要があります。
- c. 申込単位は1円以上1円単位です。
なお、自動けいぞく（累積）投資に基づく収益分配金の再投資に際しては、1口の整数倍をもって取得できます。
- 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、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。委託会社は、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。

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. 解約請求は、1口単位で行うことができます。
- 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。
信託財産留保額はありません。
確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、収益分配金および解約時・償還時の個別元本超過額に対する所得税、地方税はかかりません。
その他の受益者（法人）の場合は、収益分配金および解約時・償還時の個別元本超過額について、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。
- 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5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。ただし、確定拠出年金制度に基づく受益者である場合には制限はありません。
- 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】

- 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。
- 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するものとします。

- 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、2001年9月25日から無期限とします。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6月21日から翌年6月20日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日()を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

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

(5)【その他】

信託の終了(繰上償還)

- 委託会社は、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- 委託会社は、上記a.の事項について、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- 上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は、1ヵ月以上の一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。
- 上記c.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記a.の信託契約の解約をしません。
- 委託会社は、信託契約を解約しないこととしたときは、解約をしない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。

- 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。

収益分配金の請求権

収益分配金は、自動けいぞく(累積)投資に関する契約に基づき、自動的に無手数料で当ファンドに再投資されます。なお、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。

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。

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。

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(2019年6月21日から2020年6月22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】

【東京海上セレクション・日本株TOPIX】

(1)【貸借対照表】

(単位:円)

	第18期 [2019年 6月20日現在]	第19期 [2020年 6月22日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	20,905,863,640	21,221,434,727
未収入金	113,878,919	108,334,209
流動資産合計	21,019,742,559	21,329,768,936
資産合計	21,019,742,559	21,329,768,936
負債の部		
流動負債		
未払解約金	45,997,344	38,769,075
未払受託者報酬	10,145,791	10,397,655
未払委託者報酬	57,492,784	58,919,979
その他未払費用	243,000	247,500
流動負債合計	113,878,919	108,334,209
負債合計	113,878,919	108,334,209
純資産の部		
元本等		
元本	11,168,763,706	10,987,127,059
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()	9,737,099,934	10,234,307,668
(分配準備積立金)	4,883,762,251	4,227,252,875
元本等合計	20,905,863,640	21,221,434,727
純資産合計	20,905,863,640	21,221,434,727
負債純資産合計	21,019,742,559	21,329,768,936

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第18期 自 2018年 6月21日 至 2019年 6月20日	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,975,998,200	903,830,900
営業収益合計	1,975,998,200	903,830,900
営業費用		
受託者報酬	20,945,218	20,957,164
委託者報酬	118,689,511	118,757,170
その他費用	486,000	492,491
営業費用合計	140,120,729	140,206,825
営業利益又は営業損失（ ）	2,116,118,929	763,624,075
経常利益又は経常損失（ ）	2,116,118,929	763,624,075
当期純利益又は当期純損失（ ）	2,116,118,929	763,624,075
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（ ）	200,771,520	85,812,606
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	11,626,406,240	9,737,099,934
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,073,627,000	2,195,025,736
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	2,073,627,000	2,195,025,736
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,047,585,897	2,375,629,471
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,047,585,897	2,375,629,471
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	9,737,099,934	10,234,307,668

(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 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 2020年6月20日とその翌日が休日のため、当計算期間末日を2020年6月22日としております。このため当計算期間は、368日となっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第18期 [2019年 6月20日現在]	第19期 [2020年 6月22日現在]
1. 1 期首元本額	10,909,834,652円	11,168,763,706円
期中追加設定元本額	2,195,161,064円	2,536,213,271円
期中一部解約元本額	1,936,232,010円	2,717,849,918円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	11,168,763,706口	10,987,127,059口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第18期 自 2018年 6月21日 至 2019年 6月20日	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22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（342,647,527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（11,715,224,635円）及び分配準備積立金（4,541,114,724円）より、分配対象額は16,598,986,886円（1万口当たり14,861.96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（409,044,475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（12,520,786,637円）及び分配準備積立金（3,818,208,400円）より、分配対象額は16,748,039,512円（1万口当たり15,243.31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 2018年 6月21日 至 2019年 6月20日	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22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 [2019年 6月20日現在]	第19期 [2020年 6月22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 2018年6月21日 至 2019年6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	1,545,576,941
合計	1,545,576,941

(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 2019年6月21日 至 2020年6月22日)

売買目的有価証券

(単位:円)

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	946,620,299
合計	946,620,299

(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 [2019年 6月20日現在]		第19期 [2020年 6月22日現在]	
1口当たり純資産額	1.8718円	1口当たり純資産額	1.9315円
(1万口当たり純資産額)	18,718円)	(1万口当たり純資産額)	19,315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	15,941,582,578	21,221,434,727	
親投資信託受益証券 合計		15,941,582,578	21,221,434,727	
合計		15,941,582,578	21,221,434,727	

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	[2019年 6月20日現在]	[2020年 6月22日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,281,580,435	1,249,529,057
株式	2	36,032,414,510	27,869,403,190
派生商品評価勘定			1,404,100
未収配当金		258,965,957	167,944,303
前払金		11,925,000	7,815,000
流動資産合計		38,584,885,902	29,296,095,650
資産合計		38,584,885,902	29,296,095,650
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		5,175,000	20,651,500
未払解約金		237,943,936	108,453,816
未払利息		5,131	2,198
流動負債合計		243,124,067	129,107,514
負債合計		243,124,067	129,107,514
純資産の部			
元本等			
元本	1	29,907,678,072	21,910,325,926
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		8,434,083,763	7,256,662,210
元本等合計		38,341,761,835	29,166,988,136
純資産合計		38,341,761,835	29,166,988,136
負債純資産合計		38,584,885,902	29,296,095,650

(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 2019年 6月21日 至 2020年 6月22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	[2019年 6月20日現在]	[2020年 6月22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	36,672,998,982円	29,907,678,072円
同期中における追加設定元本額	15,701,509,228円	9,164,075,846円
同期中における一部解約元本額	22,466,830,138円	17,161,427,992円
同期末における元本額	29,907,678,072円	21,910,325,926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>	186,466,560円	59,846,229円
円資産バランスファンド2019 - 05 <適格機関投資家限定>	708,860,454円	205,638,623円
円資産バランスファンド2019 - 09 <適格機関投資家限定>	円	166,535,938円
円資産バランスファンド2019 - 12 <適格機関投資家限定>	円	231,894,907円
東京海上日本株TOPIXファンド	276,135,165円	円
東京海上セレクション・日本株 TOPIX	16,307,225,929円	15,941,582,578円
L P S 4 資産分散ファンド(慎重 型)	5,773,824円	6,977,985円
L P S 4 資産分散ファンド (安定重視型)	10,989,611円	12,444,571円
L P S 4 資産分散ファンド (バランス型)	35,264,324円	38,681,000円
L P S 4 資産分散ファンド (成長重視型)	47,202,705円	54,074,609円
L P S 4 資産分散ファンド(積極 型)	54,445,672円	58,417,005円
東京海上・円資産インデックス バランスファンド	2,004,785円	1,348,680円
東京海上ターゲット・イヤー・ ファンド2035	円	9,260,925円
東京海上ターゲット・イヤー・ ファンド2045	円	2,709,111円
東京海上ターゲット・イヤー・ ファンド2055	円	2,467,641円
東京海上ターゲット・イヤー・ ファンド2065	円	4,064,833円

TMA日本株式インデックスVA ＜適格機関投資家限定＞	252,518,899円	390,934,495円
TMA世界バランスファンド35VA ＜適格機関投資家限定＞	81,744,465円	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＞	35,800,160円	95,742,617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＞	248,131,325円	633,611,439円
東京海上・TOPIXインデックス ファンド＜適格機関投資家限定＞	11,655,114,194円	3,960,294,944円
円資産バランスオープン ＜適格機関投資家限定＞	円	33,797,796円
計	29,907,678,072円	21,910,325,926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	29,907,678,072口	21,910,325,926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 800,145,000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 608,510,000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 2018年 6月21日 至 2019年 6月20日	自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2019年 6月20日現在]	[2020年 6月22日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

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

(有価証券に関する注記)

(自 2018年6月21日 至 2019年6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	1,218,429,761
合計	1,218,429,761

(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(2019年3月21日から2019年6月20日まで)を指しております。

(自 2019年6月21日 至 2020年6月22日)

売買目的有価証券

(単位：円)

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	4,754,823,510
合計	4,754,823,510

(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(2020年3月24日から2020年6月22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

(2019年6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	2,335,425,000		2,330,250,000	5,175,000
	東証株価指数先物	2,335,425,000		2,330,250,000	5,175,000

合計	2,335,425,000	2,330,250,000	5,175,000
----	---------------	---------------	-----------

(2020年6月22日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等	うち1年超	時価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,340,055,000		1,320,900,000	19,155,000
	東証株価指数先物	1,340,055,000		1,320,900,000	19,155,000
合計		1,340,055,000		1,320,900,000	19,155,000

(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)

[2019年 6月20日現在]		[2020年 6月22日現在]	
1口当たり純資産額	1.2820円	1口当たり純資産額	1.3312円
(1万口当たり純資産額	12,820円)	(1万口当たり純資産額	13,312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	16,600	485.00	8,051,000	
マルハニチロ	3,000	2,216.00	6,648,000	
サカタのタネ	2,000	3,435.00	6,870,000	
ホクト	2,900	2,030.00	5,887,000	
国際石油開発帝石	68,600	705.00	48,363,000	
石油資源開発	2,200	1,904.00	4,188,800	
K&Oエナジーグループ	2,800	1,517.00	4,247,600	
ショーボンドホールディングス	2,400	4,880.00	11,712,000	
ミライト・ホールディングス	4,400	1,602.00	7,048,800	
ベステラ	3,000	1,014.00	3,042,000	
安藤・間	10,600	649.00	6,879,400	
東急建設	5,300	565.00	2,994,500	
コムシスホールディングス	6,000	3,065.00	18,390,000	
東建コーポレーション	700	7,420.00	5,194,000	
ヤマウラ	4,800	825.00	3,960,000	
大成建設	13,200	3,925.00	51,810,000	

大林組	39,900	1,024.00	40,857,600	
清水建設	40,600	890.00	36,134,000	
長谷工コーポレーション	16,000	1,382.00	22,112,000	
鹿島建設	31,400	1,253.00	39,344,200	
西松建設	2,700	2,171.00	5,861,700	
三井住友建設	10,800	483.00	5,216,400	
前田建設工業	10,200	852.00	8,690,400	
奥村組	2,600	2,479.00	6,445,400	
東鉄工業	2,000	2,705.00	5,410,000	
戸田建設	18,100	690.00	12,489,000	
熊谷組	2,800	2,607.00	7,299,600	
大東建託	4,300	10,750.00	46,225,000	
N I P P O	3,700	2,620.00	9,694,000	
前田道路	4,000	2,036.00	8,144,000	
東亜建設工業	3,800	1,586.00	6,026,800	
五洋建設	17,000	574.00	9,758,000	
住友林業	9,600	1,301.00	12,489,600	
日本基礎技術	500	421.00	210,500	
大和ハウス工業	38,800	2,654.50	102,994,600	
積水ハウス	42,900	2,056.00	88,202,400	
北陸電気工事	4,000	956.00	3,824,000	
中電工	2,400	2,260.00	5,424,000	
関電工	6,300	942.00	5,934,600	
きんでん	9,400	1,765.00	16,591,000	
日本電設工業	2,700	2,303.00	6,218,100	
協和エクシオ	5,400	2,574.00	13,899,600	
新日本空調	1,700	2,444.00	4,154,800	
九電工	2,500	3,010.00	7,525,000	
三機工業	4,100	1,295.00	5,309,500	
日揮ホールディングス	12,300	1,173.00	14,427,900	
中外炉工業	2,300	1,573.00	3,617,900	
ヤマト	6,500	661.00	4,296,500	
高砂熱学工業	3,700	1,685.00	6,234,500	
三晃金属工業	700	2,101.00	1,470,700	
大気社	1,800	3,090.00	5,562,000	
日比谷総合設備	3,500	1,894.00	6,629,000	
OSJBホールディングス	12,800	237.00	3,033,600	
東洋エンジニアリング	2,600	378.00	982,800	
レイズネクスト	3,300	1,223.00	4,035,900	
日本製粉	3,600	1,603.00	5,770,800	
日清製粉グループ本社	14,200	1,652.00	23,458,400	
鳥越製粉	6,300	896.00	5,644,800	
日本甜菜製糖	3,000	1,684.00	5,052,000	

三井製糖	2,000	2,076.00	4,152,000	
森永製菓	3,000	4,430.00	13,290,000	
江崎グリコ	3,600	5,160.00	18,576,000	
山崎製パン	9,900	1,863.00	18,443,700	
亀田製菓	1,100	5,160.00	5,676,000	
寿スピリッツ	1,200	4,895.00	5,874,000	
カルビー	5,700	2,922.00	16,655,400	
森永乳業	2,500	4,895.00	12,237,500	
ヤクルト本社	8,700	6,700.00	58,290,000	
明治ホールディングス	8,300	8,540.00	70,882,000	
雪印メグミルク	2,700	2,517.00	6,795,900	
プリマハム	2,300	2,763.00	6,354,900	
日本ハム	4,900	4,315.00	21,143,500	
丸大食品	3,200	1,914.00	6,124,800	
S Foods	3,100	2,666.00	8,264,600	
伊藤ハム米久ホールディングス	9,400	656.00	6,166,400	
サッポロホールディングス	4,400	2,052.00	9,028,800	
アサヒグループホールディングス	26,600	3,999.00	106,373,400	
キリンホールディングス	53,800	2,321.50	124,896,700	
宝ホールディングス	9,600	1,001.00	9,609,600	
オエノンホールディングス	10,400	403.00	4,191,200	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	9,200	2,069.00	19,034,800	
サントリー食品インターナショナル	8,500	4,360.00	37,060,000	
ダイドーグループホールディングス	900	4,965.00	4,468,500	
伊藤園	3,800	6,190.00	23,522,000	
キーコーヒー	1,900	2,305.00	4,379,500	
ユニカフェ	3,600	972.00	3,499,200	
ジャパンフーズ	3,800	1,202.00	4,567,600	
日清オイリオグループ	1,700	3,410.00	5,797,000	
不二製油グループ本社	2,900	2,881.00	8,354,900	
J - オイルミルズ	900	4,090.00	3,681,000	
キッコーマン	9,100	5,190.00	47,229,000	
味の素	28,200	1,840.50	51,902,100	
キューピー	7,000	2,109.00	14,763,000	
ハウス食品グループ本社	4,400	3,625.00	15,950,000	
カゴメ	4,800	3,195.00	15,336,000	
アリアケジャパン	1,000	6,930.00	6,930,000	
ニチレイ	6,400	3,115.00	19,936,000	
東洋水産	6,500	5,790.00	37,635,000	
日清食品ホールディングス	5,400	9,210.00	49,734,000	
フジッコ	3,700	1,958.00	7,244,600	
ロック・フィールド	4,200	1,330.00	5,586,000	
日本たばこ産業	73,100	2,174.50	158,955,950	

ユーグレナ	8,100	797.00	6,455,700	
片倉工業	4,600	1,194.00	5,492,400	
グンゼ	500	3,880.00	1,940,000	
東洋紡	5,100	1,505.00	7,675,500	
倉敷紡績	1,900	2,307.00	4,383,300	
日本毛織	6,400	1,025.00	6,560,000	
帝国繊維	2,100	2,282.00	4,792,200	
帝人	9,700	1,761.00	17,081,700	
東レ	88,200	516.00	45,511,200	
日本フェルト	8,000	472.00	3,776,000	
セーレン	3,900	1,392.00	5,428,800	
小松マテーレ	6,400	747.00	4,780,800	
ワコールホールディングス	3,200	2,087.00	6,678,400	
ホギメディカル	1,400	3,380.00	4,732,000	
T S Iホールディングス	6,500	476.00	3,094,000	
三陽商会	2,800	836.00	2,340,800	
オンワードホールディングス	8,400	349.00	2,931,600	
ゴールドウイン	2,100	7,120.00	14,952,000	
デサント	3,500	1,521.00	5,323,500	
特種東海製紙	1,200	4,655.00	5,586,000	
王子ホールディングス	53,200	522.00	27,770,400	
日本製紙	5,600	1,610.00	9,016,000	
三菱製紙	2,600	362.00	941,200	
北越コーポレーション	7,500	393.00	2,947,500	
大王製紙	5,600	1,464.00	8,198,400	
レンゴー	12,800	903.00	11,558,400	
ザ・パック	1,300	3,170.00	4,121,000	
クラレ	20,000	1,191.00	23,820,000	
旭化成	82,200	881.00	72,418,200	
共和レザー	4,200	675.00	2,835,000	
昭和電工	9,000	2,580.00	23,220,000	
住友化学	93,500	337.00	31,509,500	
日産化学	6,900	5,570.00	38,433,000	
クレハ	1,500	4,800.00	7,200,000	
石原産業	600	720.00	432,000	
片倉コープアグリ	3,600	1,230.00	4,428,000	
日本曹達	2,000	2,866.00	5,732,000	
東ソー	19,300	1,506.00	29,065,800	
トクヤマ	3,200	2,517.00	8,054,400	
セントラル硝子	2,900	1,923.00	5,576,700	
東亜合成	7,900	1,060.00	8,374,000	
大阪ソーダ	1,900	2,467.00	4,687,300	
デンカ	4,600	2,669.00	12,277,400	

信越化学工業	21,100	12,345.00	260,479,500	
堺化学工業	2,100	2,033.00	4,269,300	
エア・ウォーター	10,600	1,540.00	16,324,000	
大陽日酸	11,400	1,841.00	20,987,400	
日本パーカライジング	6,400	1,105.00	7,072,000	
ステラ ケミファ	1,400	2,469.00	3,456,600	
日本触媒	2,100	5,830.00	12,243,000	
カネカ	3,000	2,898.00	8,694,000	
三菱瓦斯化学	11,900	1,657.00	19,718,300	
三井化学	11,400	2,316.00	26,402,400	
J S R	11,900	2,030.00	24,157,000	
東京応化工業	1,900	5,100.00	9,690,000	
三菱ケミカルホールディングス	82,700	646.70	53,482,090	
K Hネオケム	2,100	2,058.00	4,321,800	
ダイセル	17,200	855.00	14,706,000	
住友ベークライト	1,800	3,030.00	5,454,000	
積水化学工業	26,700	1,545.00	41,251,500	
日本ゼオン	11,300	1,014.00	11,458,200	
アイカ工業	3,400	3,435.00	11,679,000	
宇部興産	6,100	1,893.00	11,547,300	
旭有機材	2,800	1,483.00	4,152,400	
タイガースポリマー	4,100	487.00	1,996,700	
ミライアル	2,800	1,067.00	2,987,600	
日本化薬	7,400	1,090.00	8,066,000	
A D E K A	5,700	1,443.00	8,225,100	
日油	4,700	3,725.00	17,507,500	
ハリマ化成グループ	4,700	997.00	4,685,900	
花王	30,100	8,650.00	260,365,000	
ニイタカ	2,700	6,160.00	16,632,000	
三洋化成工業	2,800	4,850.00	13,580,000	
日本ペイントホールディングス	10,100	7,940.00	80,194,000	
関西ペイント	14,000	2,212.00	30,968,000	
中国塗料	4,200	767.00	3,221,400	
太陽ホールディングス	1,800	4,890.00	8,802,000	
D I C	5,400	2,751.00	14,855,400	
サカタインクス	3,800	1,012.00	3,845,600	
東洋インキ S C ホールディングス	2,900	2,065.00	5,988,500	
富士フイルムホールディングス	24,100	4,770.00	114,957,000	
資生堂	25,000	6,973.00	174,325,000	
ライオン	16,600	2,541.00	42,180,600	
高砂香料工業	1,500	2,230.00	3,345,000	
マンダム	2,800	2,061.00	5,770,800	
ミルボン	1,500	5,160.00	7,740,000	

ファンケル	5,300	3,110.00	16,483,000	
コーセー	2,300	14,220.00	32,706,000	
コタ	4,600	1,211.00	5,570,600	
ポーラ・オルビスホールディングス	5,100	1,933.00	9,858,300	
ノエビアホールディングス	1,300	4,660.00	6,058,000	
エステー	2,900	1,708.00	4,953,200	
長谷川香料	2,800	2,386.00	6,680,800	
小林製薬	3,500	9,970.00	34,895,000	
荒川化学工業	4,000	1,239.00	4,956,000	
メック	4,100	2,000.00	8,200,000	
タカラバイオ	3,100	3,255.00	10,090,500	
アース製薬	900	7,520.00	6,768,000	
大成ラミック	1,600	2,693.00	4,308,800	
クミアイ化学工業	7,600	1,003.00	7,622,800	
日本農薬	6,300	465.00	2,929,500	
日東電工	8,700	5,900.00	51,330,000	
レック	2,200	1,611.00	3,544,200	
前澤化成工業	3,800	1,000.00	3,800,000	
エフピコ	1,200	8,220.00	9,864,000	
天馬	2,700	1,674.00	4,519,800	
信越ポリマー	5,200	896.00	4,659,200	
ニフコ	4,800	2,300.00	11,040,000	
バルカー	1,800	1,870.00	3,366,000	
ユニ・チャーム	24,100	4,334.00	104,449,400	
協和キリン	12,800	2,889.00	36,979,200	
武田薬品工業	104,900	4,031.00	422,851,900	
アステラス製薬	109,300	1,799.00	196,630,700	
大日本住友製薬	9,300	1,480.00	13,764,000	
塩野義製薬	15,800	7,087.00	111,974,600	
あすか製薬	3,700	1,192.00	4,410,400	
日本新薬	3,300	8,940.00	29,502,000	
中外製薬	13,200	17,320.00	228,624,000	
科研製薬	2,200	5,670.00	12,474,000	
エーザイ	15,000	8,519.00	127,785,000	
ロート製薬	6,200	3,430.00	21,266,000	
小野薬品工業	29,000	3,129.00	90,741,000	
久光製薬	3,400	5,710.00	19,414,000	
持田製薬	1,600	4,140.00	6,624,000	
参天製薬	23,600	2,030.00	47,908,000	
ツムラ	3,800	2,899.00	11,016,200	
日医工	4,000	1,371.00	5,484,000	
キッセイ薬品工業	2,100	2,629.00	5,520,900	
生化学工業	4,100	1,182.00	4,846,200	

栄研化学	2,200	1,808.00	3,977,600	
鳥居薬品	1,400	3,000.00	4,200,000	
JCRファーマ	800	12,060.00	9,648,000	
東和薬品	1,900	2,100.00	3,990,000	
沢井製薬	2,400	5,680.00	13,632,000	
ゼリア新薬工業	3,000	2,027.00	6,081,000	
第一三共	36,000	8,974.00	323,064,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	2,228.00	6,684,000	
大幸薬品	8,500	2,521.00	21,428,500	
大塚ホールディングス	24,000	4,887.00	117,288,000	
大正製薬ホールディングス	2,600	6,720.00	17,472,000	
ペプチドリーム	6,400	5,160.00	33,024,000	
ニチレキ	5,600	1,562.00	8,747,200	
出光興産	14,100	2,339.00	32,979,900	
JXTGホールディングス	188,300	392.00	73,813,600	
コスモエネルギーホールディングス	3,500	1,628.00	5,698,000	
横浜ゴム	7,000	1,539.00	10,773,000	
TOYO TIRE	6,800	1,468.00	9,982,400	
ブリヂストン	36,300	3,516.00	127,630,800	
住友ゴム工業	11,200	1,083.00	12,129,600	
オカモト	1,100	3,890.00	4,279,000	
ニッタ	1,900	2,239.00	4,254,100	
住友理工	4,300	635.00	2,730,500	
バンドー化学	3,700	638.00	2,360,600	
日東紡績	1,700	5,290.00	8,993,000	
AGC	12,500	3,275.00	40,937,500	
日本山村硝子	3,200	863.00	2,761,600	
日本電気硝子	5,200	1,805.00	9,386,000	
住友大阪セメント	2,300	3,740.00	8,602,000	
太平洋セメント	7,800	2,513.00	19,601,400	
日本ヒューム	6,400	755.00	4,832,000	
東海カーボン	12,100	1,059.00	12,813,900	
東洋炭素	2,600	1,684.00	4,378,400	
TOTO	9,000	4,270.00	38,430,000	
日本碍子	15,300	1,534.00	23,470,200	
日本特殊陶業	10,100	1,595.00	16,109,500	
ニチアス	3,200	2,260.00	7,232,000	
ニチハ	1,500	2,283.00	3,424,500	
日本製鉄	55,500	1,077.00	59,773,500	
神戸製鋼所	23,200	414.00	9,604,800	
ジェイ エフ イー ホールディングス	34,200	827.00	28,283,400	
東京製鐵	4,100	654.00	2,681,400	
共英製鋼	3,400	1,312.00	4,460,800	

大和工業	2,300	2,223.00	5,112,900	
大阪製鐵	3,200	1,232.00	3,942,400	
淀川製鋼所	2,300	1,871.00	4,303,300	
丸一鋼管	4,300	2,766.00	11,893,800	
大同特殊鋼	2,000	3,500.00	7,000,000	
山陽特殊製鋼	5,100	985.00	5,023,500	
愛知製鋼	1,500	3,200.00	4,800,000	
日立金属	13,400	1,309.00	17,540,600	
大平洋金属	900	1,678.00	1,510,200	
新日本電工	14,600	174.00	2,540,400	
三菱製鋼	3,400	699.00	2,376,600	
シンニッタン	6,700	252.00	1,688,400	
日本軽金属ホールディングス	38,300	188.00	7,200,400	
三井金属鉱業	3,400	2,268.00	7,711,200	
東邦亜鉛	1,900	1,496.00	2,842,400	
三菱マテリアル	8,000	2,343.00	18,744,000	
住友金属鉱山	16,000	3,009.00	48,144,000	
DOWAホールディングス	2,700	3,300.00	8,910,000	
古河機械金属	3,600	1,108.00	3,988,800	
UACJ	2,500	1,999.00	4,997,500	
古河電気工業	3,400	2,744.00	9,329,600	
住友電気工業	46,900	1,274.00	59,750,600	
フジクラ	13,800	326.00	4,498,800	
タツタ電線	7,100	592.00	4,203,200	
リョービ	2,700	1,285.00	3,469,500	
トーカロ	3,200	1,145.00	3,664,000	
SUMCO	14,400	1,620.00	23,328,000	
東洋製罐グループホールディングス	7,700	1,264.00	9,732,800	
コロナ	3,400	1,002.00	3,406,800	
横河ブリッジホールディングス	2,900	2,208.00	6,403,200	
駒井ハルテック	1,800	1,476.00	2,656,800	
三和ホールディングス	12,500	975.00	12,187,500	
文化シャッター	4,600	750.00	3,450,000	
三協立山	4,700	1,020.00	4,794,000	
LIXILグループ	18,600	1,630.00	30,318,000	
ノーリツ	4,900	1,302.00	6,379,800	
長府製作所	2,200	2,248.00	4,945,600	
リンナイ	2,300	9,020.00	20,746,000	
日東精工	9,100	471.00	4,286,100	
東プレ	3,400	1,347.00	4,579,800	
高周波熱錬	3,800	551.00	2,093,800	
パイオラックス	2,800	1,616.00	4,524,800	
日本発條	12,700	717.00	9,105,900	

三益半導体工業	3,200	2,222.00	7,110,400	
日本製鋼所	3,800	1,601.00	6,083,800	
三浦工業	5,300	4,465.00	23,664,500	
タクマ	4,700	1,496.00	7,031,200	
オークマ	1,100	4,775.00	5,252,500	
芝浦機械	1,800	2,362.00	4,251,600	
アマダ	16,500	916.00	15,114,000	
アイダエンジニアリング	5,700	749.00	4,269,300	
F U J I	4,600	1,873.00	8,615,800	
牧野フライス製作所	1,700	3,430.00	5,831,000	
オーエスジー	6,000	1,640.00	9,840,000	
旭ダイヤモンド工業	4,800	504.00	2,419,200	
D M G 森精機	7,600	1,335.00	10,146,000	
ディスコ	1,700	25,300.00	43,010,000	
日東工器	2,600	1,854.00	4,820,400	
島精機製作所	2,500	1,565.00	3,912,500	
日阪製作所	4,600	739.00	3,399,400	
ナブテスコ	7,500	3,345.00	25,087,500	
S M C	3,900	55,630.00	216,957,000	
ユニオンツール	1,800	2,683.00	4,829,400	
オイレス工業	2,500	1,420.00	3,550,000	
サトーホールディングス	700	2,400.00	1,680,000	
小松製作所	57,200	2,202.00	125,954,400	
住友重機械工業	6,900	2,442.00	16,849,800	
日立建機	4,700	2,908.00	13,667,600	
巴工業	2,400	1,935.00	4,644,000	
井関農機	2,800	1,167.00	3,267,600	
タカキタ	5,500	584.00	3,212,000	
クボタ	66,900	1,598.50	106,939,650	
月島機械	4,100	1,204.00	4,936,400	
帝国電機製作所	3,900	1,251.00	4,878,900	
新東工業	4,900	798.00	3,910,200	
小森コーポレーション	4,900	750.00	3,675,000	
鶴見製作所	3,200	1,847.00	5,910,400	
荏原製作所	5,300	2,535.00	13,435,500	
西島製作所	5,900	807.00	4,761,300	
ダイキン工業	16,000	16,625.00	266,000,000	
栗田工業	6,500	2,989.00	19,428,500	
椿本チエイン	2,200	2,710.00	5,962,000	
ダイフク	6,500	9,060.00	58,890,000	
タダノ	6,600	904.00	5,966,400	
フジテック	5,100	1,840.00	9,384,000	
C K D	3,800	1,887.00	7,170,600	

平和	3,400	1,825.00	6,205,000	
SANKYO	3,000	2,718.00	8,154,000	
日本金銭機械	4,300	616.00	2,648,800	
フクシマガリレイ	1,100	3,585.00	3,943,500	
竹内製作所	1,300	1,784.00	2,319,200	
アマノ	3,400	2,336.00	7,942,400	
グローリー	3,800	2,506.00	9,522,800	
大和冷機工業	4,700	975.00	4,582,500	
セガサミーホールディングス	12,700	1,294.00	16,433,800	
リケン	700	2,818.00	1,972,600	
ホシザキ	3,700	9,280.00	34,336,000	
大豊工業	600	567.00	340,200	
日本精工	24,700	814.00	20,105,800	
NTN	31,500	227.00	7,150,500	
ジェイテクト	12,500	846.00	10,575,000	
不二越	1,100	3,370.00	3,707,000	
日本トムソン	5,000	356.00	1,780,000	
THK	7,500	2,749.00	20,617,500	
ユーシン精機	3,600	719.00	2,588,400	
キッツ	7,100	713.00	5,062,300	
マキタ	16,400	3,900.00	63,960,000	
日立造船	10,700	396.00	4,237,200	
三菱重工業	21,300	2,660.50	56,668,650	
IHI	9,700	1,602.00	15,539,400	
スター精密	5,200	1,248.00	6,489,600	
日清紡ホールディングス	7,300	813.00	5,934,900	
イビデン	7,500	2,993.00	22,447,500	
コニカミノルタ	28,400	397.00	11,274,800	
ブラザー工業	15,500	1,994.00	30,907,000	
ミネベアミツミ	23,500	1,990.00	46,765,000	
日立製作所	60,600	3,460.00	209,676,000	
三菱電機	126,400	1,394.50	176,264,800	
富士電機	7,700	2,812.00	21,652,400	
安川電機	13,600	3,710.00	50,456,000	
明電舎	3,300	1,751.00	5,778,300	
東芝テック	1,300	4,260.00	5,538,000	
マブチモーター	3,400	3,485.00	11,849,000	
日本電産	30,300	6,797.00	205,949,100	
東光高岳	3,200	1,021.00	3,267,200	
ダイヘン	1,500	3,735.00	5,602,500	
日新電機	3,700	1,049.00	3,881,300	
オムロン	11,200	7,090.00	79,408,000	
日東工業	2,500	1,871.00	4,677,500	

ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,500	1,843.00	8,293,500	
メルコホールディングス	1,600	2,845.00	4,552,000	
テクノメディカ	1,800	1,821.00	3,277,800	
日本電気	15,200	5,050.00	76,760,000	
富士通	12,100	12,110.00	146,531,000	
沖電気工業	5,200	1,058.00	5,501,600	
サンケン電気	2,400	2,197.00	5,272,800	
アイホン	2,800	1,562.00	4,373,600	
ルネサスエレクトロニクス	60,200	624.00	37,564,800	
セイコーエプソン	16,000	1,299.00	20,784,000	
ワコム	5,700	558.00	3,180,600	
アルバック	2,600	3,305.00	8,593,000	
E I Z O	1,200	4,105.00	4,926,000	
日本信号	5,300	1,154.00	6,116,200	
能美防災	2,100	2,054.00	4,313,400	
ホーチキ	3,500	1,291.00	4,518,500	
エレコム	1,200	5,240.00	6,288,000	
パナソニック	144,000	958.00	137,952,000	
シャープ	15,100	1,178.00	17,787,800	
アンリツ	8,300	2,506.00	20,799,800	
富士通ゼネラル	3,900	2,154.00	8,400,600	
ソニー	78,900	7,607.00	600,192,300	
T D K	6,000	10,700.00	64,200,000	
アルプスアルパイン	11,100	1,417.00	15,728,700	
日本トリム	100	3,070.00	307,000	
フォスター電機	3,400	1,126.00	3,828,400	
ヨコオ	2,300	2,585.00	5,945,500	
ホシデン	4,200	978.00	4,107,600	
ヒロセ電機	2,000	11,890.00	23,780,000	
日本航空電子工業	3,500	1,480.00	5,180,000	
アイコム	2,100	3,080.00	6,468,000	
船井電機	5,600	512.00	2,867,200	
横河電機	12,200	1,670.00	20,374,000	
アズビル	8,200	3,230.00	26,486,000	
日本光電工業	5,400	3,555.00	19,197,000	
堀場製作所	2,400	5,530.00	13,272,000	
アドバンテスト	9,300	5,990.00	55,707,000	
キーエンス	11,400	44,570.00	508,098,000	
日置電機	1,100	2,991.00	3,290,100	
シスメックス	9,000	7,975.00	71,775,000	
O B A R A G R O U P	1,200	3,250.00	3,900,000	
コーセル	3,600	924.00	3,326,400	
イリソ電子工業	1,100	3,480.00	3,828,000	

オプテックスグループ	3,500	1,258.00	4,403,000	
千代田インテグレ	2,600	1,748.00	4,544,800	
レーザーテック	5,500	10,450.00	57,475,000	
スタンレー電気	8,600	2,590.00	22,274,000	
ウシオ電機	7,300	1,348.00	9,840,400	
日本セラミック	2,200	2,313.00	5,088,600	
図研	2,300	2,750.00	6,325,000	
日本電子	2,500	3,030.00	7,575,000	
カシオ計算機	10,800	1,903.00	20,552,400	
ファナック	11,900	19,380.00	230,622,000	
ローム	5,600	7,340.00	41,104,000	
浜松ホトニクス	9,100	4,795.00	43,634,500	
三井ハイテック	3,500	1,569.00	5,491,500	
新光電気工業	5,100	1,500.00	7,650,000	
京セラ	17,800	6,073.00	108,099,400	
太陽誘電	5,300	3,275.00	17,357,500	
村田製作所	37,000	6,396.00	236,652,000	
双葉電子工業	3,400	994.00	3,379,600	
ニチコン	4,200	758.00	3,183,600	
日本ケミコン	1,700	1,731.00	2,942,700	
K O A	3,300	1,023.00	3,375,900	
小糸製作所	7,600	4,325.00	32,870,000	
ミツバ	7,800	475.00	3,705,000	
S C R E E Nホールディングス	2,100	5,200.00	10,920,000	
キヤノン電子	2,600	1,652.00	4,295,200	
キヤノン	67,700	2,242.50	151,817,250	
リコー	33,400	839.00	28,022,600	
象印マホービン	3,700	1,576.00	5,831,200	
東京エレクトロン	8,000	25,085.00	200,680,000	
トヨタ紡織	3,900	1,389.00	5,417,100	
ユニプレス	3,200	975.00	3,120,000	
豊田自動織機	10,200	5,740.00	58,548,000	
モリタホールディングス	2,600	1,868.00	4,856,800	
デンソー	27,700	4,010.00	111,077,000	
東海理化電機製作所	3,500	1,581.00	5,533,500	
川崎重工業	9,800	1,700.00	16,660,000	
日産自動車	148,300	415.90	61,677,970	
いすゞ自動車	36,900	974.40	35,955,360	
トヨタ自動車	140,300	6,818.00	956,565,400	70,000株
日野自動車	15,400	717.00	11,041,800	
三菱自動車工業	47,400	300.00	14,220,000	
武蔵精密工業	3,600	959.00	3,452,400	
日産車体	3,600	914.00	3,290,400	

新明和工業	5,000	1,015.00	5,075,000	
極東開発工業	3,000	1,320.00	3,960,000	
日信工業	3,000	2,186.00	6,558,000	
トピー工業	1,300	1,294.00	1,682,200	
ティラド	2,400	1,410.00	3,384,000	
NOK	6,400	1,356.00	8,678,400	
フタバ産業	5,900	446.00	2,631,400	
KYB	1,800	2,111.00	3,799,800	
プレス工業	9,400	273.00	2,566,200	
ケーヒン	2,900	2,522.00	7,313,800	
アイシン精機	10,400	3,225.00	33,540,000	
マツダ	37,700	700.00	26,390,000	
今仙電機製作所	6,000	756.00	4,536,000	
本田技研工業	99,200	2,850.50	282,769,600	
スズキ	25,100	3,617.00	90,786,700	
SUBARU	38,900	2,347.50	91,317,750	
ヤマハ発動機	16,800	1,653.00	27,770,400	
ショーワ	3,400	2,223.00	7,558,200	
エクセディ	4,600	1,629.00	7,493,400	
豊田合成	3,900	2,245.00	8,755,500	
愛三工業	7,200	544.00	3,916,800	
ヨロズ	3,000	1,082.00	3,246,000	
エフ・シー・シー	2,400	1,835.00	4,404,000	
シマノ	4,700	20,690.00	97,243,000	
テイ・エス テック	2,700	2,992.00	8,078,400	
テルモ	35,700	4,094.00	146,155,800	
クリエートメディック	4,000	963.00	3,852,000	
島津製作所	15,100	2,847.00	42,989,700	
ブイ・テクノロジー	1,000	3,815.00	3,815,000	
東京精密	2,200	3,425.00	7,535,000	
マニー	4,700	2,859.00	13,437,300	
ニコン	20,400	952.00	19,420,800	
トプコン	6,200	871.00	5,400,200	
オリンパス	69,700	1,895.50	132,116,350	
理研計器	3,000	2,462.00	7,386,000	
タムロン	1,700	1,854.00	3,151,800	
HOYA	25,100	10,375.00	260,412,500	
朝日インテック	14,200	3,100.00	44,020,000	
シチズン時計	16,200	369.00	5,977,800	
メニコン	1,600	5,390.00	8,624,000	
セイコーホールディングス	2,600	1,788.00	4,648,800	
ニプロ	8,600	1,204.00	10,354,400	
パラマウントベッドホールディングス	1,700	4,355.00	7,403,500	

バンダイナムコホールディングス	13,000	5,778.00	75,114,000	
アイフィスジャパン	4,400	714.00	3,141,600	
パイロットコーポレーション	1,900	3,260.00	6,194,000	
トッパン・フォームズ	5,200	1,072.00	5,574,400	
フジシールインターナショナル	2,800	2,060.00	5,768,000	
タカラトミー	6,200	869.00	5,387,800	
タカノ	4,100	691.00	2,833,100	
大建工業	4,800	1,819.00	8,731,200	
凸版印刷	18,100	1,856.00	33,593,600	
大日本印刷	16,600	2,475.00	41,085,000	
N I S S H A	4,000	1,007.00	4,028,000	
アシックス	10,800	1,212.00	13,089,600	
小松ウオール工業	2,200	1,811.00	3,984,200	
ヤマハ	7,500	5,160.00	38,700,000	
クリナップ	5,100	533.00	2,718,300	
ビジョン	7,700	4,190.00	32,263,000	
キングジム	5,800	910.00	5,278,000	
リンテック	2,500	2,523.00	6,307,500	
イトーキ	9,700	368.00	3,569,600	
任天堂	7,700	50,150.00	386,155,000	
三菱鉛筆	3,000	1,331.00	3,993,000	
タカラスタANDARD	3,200	1,513.00	4,841,600	
コクヨ	5,600	1,268.00	7,100,800	
オカムラ	4,200	786.00	3,301,200	
美津濃	2,400	2,246.00	5,390,400	
東京電力ホールディングス	100,700	344.00	34,640,800	
中部電力	38,100	1,394.00	53,111,400	
関西電力	48,000	1,041.50	49,992,000	
中国電力	18,300	1,440.00	26,352,000	
北陸電力	12,600	676.00	8,517,600	
東北電力	31,600	1,020.00	32,232,000	
四国電力	11,600	791.00	9,175,600	
九州電力	26,400	883.00	23,311,200	
北海道電力	13,400	417.00	5,587,800	
沖縄電力	2,200	1,791.00	3,940,200	
電源開発	10,000	2,061.00	20,610,000	
東京瓦斯	24,300	2,500.50	60,762,150	
大阪瓦斯	24,700	2,126.00	52,512,200	
東邦瓦斯	6,100	5,350.00	32,635,000	
北海道瓦斯	3,500	1,601.00	5,603,500	
西部瓦斯	2,200	2,580.00	5,676,000	
静岡ガス	5,900	982.00	5,793,800	
東武鉄道	13,000	3,650.00	47,450,000	

相鉄ホールディングス	4,200	2,868.00	12,045,600	
東急	31,800	1,565.00	49,767,000	
京浜急行電鉄	16,400	1,682.00	27,584,800	
小田急電鉄	18,700	2,611.00	48,825,700	
京王電鉄	6,600	6,120.00	40,392,000	
京成電鉄	8,800	3,330.00	29,304,000	
富士急行	2,200	3,180.00	6,996,000	
東日本旅客鉄道	22,100	7,899.00	174,567,900	
西日本旅客鉄道	11,200	6,200.00	69,440,000	
東海旅客鉄道	10,400	17,080.00	177,632,000	
西武ホールディングス	16,800	1,225.00	20,580,000	
西日本鉄道	3,100	2,875.00	8,912,500	
近鉄グループホールディングス	11,900	4,840.00	57,596,000	
阪急阪神ホールディングス	15,900	3,660.00	58,194,000	
南海電気鉄道	5,300	2,447.00	12,969,100	
京阪ホールディングス	5,300	4,830.00	25,599,000	
名古屋鉄道	9,900	3,050.00	30,195,000	
日本通運	4,300	5,580.00	23,994,000	
ヤマトホールディングス	21,000	2,386.00	50,106,000	
山九	3,300	4,090.00	13,497,000	
丸運	12,500	232.00	2,900,000	
センコーグループホールディングス	7,700	803.00	6,183,100	
トナミホールディングス	1,600	5,950.00	9,520,000	
ニッコンホールディングス	4,300	2,156.00	9,270,800	
日本石油輸送	900	3,080.00	2,772,000	
福山通運	2,400	3,645.00	8,748,000	
セイノーホールディングス	8,900	1,445.00	12,860,500	
日立物流	2,500	2,881.00	7,202,500	
C & F ロジホールディングス	4,000	1,545.00	6,180,000	
九州旅客鉄道	10,600	2,895.00	30,687,000	
S Gホールディングス	12,600	3,500.00	44,100,000	
日本郵船	10,100	1,559.00	15,745,900	
商船三井	7,000	2,000.00	14,000,000	
川崎汽船	1,500	1,140.00	1,710,000	
飯野海運	9,300	347.00	3,227,100	
日本航空	21,000	2,085.00	43,785,000	
A N Aホールディングス	21,800	2,620.00	57,116,000	
三菱倉庫	3,900	2,737.00	10,674,300	
三井倉庫ホールディングス	2,300	1,528.00	3,514,400	
住友倉庫	4,600	1,294.00	5,952,400	
東陽倉庫	13,800	330.00	4,554,000	
安田倉庫	5,800	885.00	5,133,000	
上組	6,900	2,074.00	14,310,600	

キムラユニティー	3,500	1,026.00	3,591,000	
キューソー流通システム	1,800	1,630.00	2,934,000	
近鉄エクスプレス	3,500	1,823.00	6,380,500	
エーアイティー	4,400	791.00	3,480,400	
NEC ネットエスアイ	3,900	2,057.00	8,022,300	
システナ	4,800	1,515.00	7,272,000	
デジタルアーツ	1,000	8,720.00	8,720,000	
日鉄ソリューションズ	2,100	2,945.00	6,184,500	
T I S	12,400	2,217.00	27,490,800	
ネオス	900	739.00	665,100	
電算システム	900	3,830.00	3,447,000	
グリー	9,100	455.00	4,140,500	
コーエーテクモホールディングス	2,800	3,430.00	9,604,000	
ブレインパッド	700	4,810.00	3,367,000	
K L a b	3,500	760.00	2,660,000	
ネクソン	34,300	2,433.00	83,451,900	
エイチーム	900	860.00	774,000	
コロプラ	4,400	1,016.00	4,470,400	
サイバーリンクス	3,100	2,007.00	6,221,700	
CARTA HOLDINGS	300	1,322.00	396,600	
ティーガイア	2,100	2,106.00	4,422,600	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,600	1,935.00	6,966,000	
GMOペイメントゲートウェイ	2,600	11,390.00	29,614,000	
ザッパラス	6,800	399.00	2,713,200	
インターネットイニシアティブ	2,100	3,780.00	7,938,000	
L I N E	2,600	5,370.00	13,962,000	
フェイス	3,000	700.00	2,100,000	
野村総合研究所	17,600	2,916.00	51,321,600	
CEホールディングス	6,800	621.00	4,222,800	
インテージホールディングス	6,200	860.00	5,332,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,051.00	2,942,800	
フジ・メディア・ホールディングス	12,500	1,050.00	13,125,000	
オービック	4,300	18,980.00	81,614,000	
ジャストシステム	2,000	7,510.00	15,020,000	
Zホールディングス	169,500	539.00	91,360,500	
トレンドマイクロ	5,500	5,960.00	32,780,000	
日本オラクル	2,500	12,160.00	30,400,000	
フューチャー	4,300	1,759.00	7,563,700	
CAC Holdings	6,600	1,292.00	8,527,200	
SBテクノロジー	2,000	3,175.00	6,350,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,000	5,860.00	5,860,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	5,400	3,895.00	21,033,000	

大塚商会	6,700	5,700.00	38,190,000	
サイボウズ	1,300	3,340.00	4,342,000	
電通国際情報サービス	1,400	4,995.00	6,993,000	
デジタルガレージ	2,200	3,560.00	7,832,000	
ウェザーニューズ	1,300	3,870.00	5,031,000	
日本エンタープライズ	100	272.00	27,200	
ネットワンシステムズ	4,400	3,495.00	15,378,000	
アルゴグラフィックス	1,500	3,565.00	5,347,500	
エイベックス	4,000	872.00	3,488,000	
日本ユニシス	3,800	3,390.00	12,882,000	
兼松エレクトロニクス	2,300	3,630.00	8,349,000	
東京放送ホールディングス	8,000	1,765.00	14,120,000	
日本テレビホールディングス	11,000	1,221.00	13,431,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,619.00	6,152,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	12,200	446.00	5,441,200	
テレビ東京ホールディングス	2,800	2,436.00	6,820,800	
日本電信電話	165,100	2,496.00	412,089,600	
K D D I	92,100	3,167.00	291,680,700	
ソフトバンク	111,600	1,381.00	154,119,600	
光通信	1,200	24,090.00	28,908,000	
N T T ドコモ	88,400	2,901.50	256,492,600	
G M O インターネット	4,700	2,915.00	13,700,500	
K A D O K A W A	3,700	1,892.00	7,000,400	
ゼンリン	3,400	1,255.00	4,267,000	
松竹	600	14,520.00	8,712,000	
東宝	7,400	3,920.00	29,008,000	
東映	400	14,550.00	5,820,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	33,200	1,237.00	41,068,400	
ビジネスブレイン太田昭和	1,200	2,569.00	3,082,800	
D T S	3,000	2,308.00	6,924,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,300	5,610.00	29,733,000	
カプコン	5,500	3,930.00	21,615,000	
S C S K	3,100	5,220.00	16,182,000	
アイネス	6,100	1,343.00	8,192,300	
T K C	1,000	5,660.00	5,660,000	
富士ソフト	1,800	4,335.00	7,803,000	
N S D	4,200	1,835.00	7,707,000	
コナミホールディングス	4,800	3,605.00	17,304,000	
ソフトバンクグループ	98,000	5,512.00	540,176,000	
伊藤忠食品	900	4,870.00	4,383,000	
エレマテック	4,800	870.00	4,176,000	
J A L U X	2,000	1,780.00	3,560,000	
双日	70,700	239.00	16,897,300	

アルフレッサ ホールディングス	13,900	2,273.00	31,594,700	
横浜冷凍	8,900	915.00	8,143,500	
神戸物産	4,200	6,050.00	25,410,000	
あい ホールディングス	3,000	1,596.00	4,788,000	
ダイワボウホールディングス	900	7,820.00	7,038,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,700	1,536.00	5,683,200	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,700	1,032.00	3,818,400	
レスターホールディングス	2,300	2,044.00	4,701,200	
OCHIホールディングス	3,100	1,470.00	4,557,000	
TOKAIホールディングス	7,100	1,017.00	7,220,700	
シップヘルスケアホールディングス	2,300	4,460.00	10,258,000	
明治電機工業	2,800	1,449.00	4,057,200	
コメダホールディングス	3,300	1,856.00	6,124,800	
エコートレーディング	7,400	527.00	3,899,800	
ナガイレーベン	1,800	2,711.00	4,879,800	
三菱食品	2,100	2,786.00	5,850,600	
松田産業	3,700	1,365.00	5,050,500	
第一興商	1,800	3,405.00	6,129,000	
メディパルホールディングス	13,500	2,129.00	28,741,500	
アズワン	700	11,820.00	8,274,000	
尾家産業	3,200	1,518.00	4,857,600	
ドウシシャ	3,200	1,555.00	4,976,000	
丸文	4,600	494.00	2,272,400	
橋本総業ホールディングス	2,700	2,083.00	5,624,100	
日本ライフライン	3,700	1,412.00	5,224,400	
進和	2,700	1,984.00	5,356,800	
オーハシテクニカ	2,300	1,593.00	3,663,900	
白銅	2,400	1,373.00	3,295,200	
伊藤忠商事	86,800	2,331.00	202,330,800	
丸紅	129,200	506.10	65,388,120	
長瀬産業	7,200	1,327.00	9,554,400	
豊田通商	13,900	2,807.00	39,017,300	
兼松	5,500	1,253.00	6,891,500	
三井物産	107,500	1,654.50	177,858,750	
日本紙パルプ商事	1,100	3,995.00	4,394,500	
山善	5,000	890.00	4,450,000	
住友商事	78,500	1,265.00	99,302,500	
内田洋行	1,000	6,250.00	6,250,000	
三菱商事	87,000	2,317.50	201,622,500	
キヤノンマーケティングジャパン	2,900	2,236.00	6,484,400	
西華産業	3,900	1,233.00	4,808,700	
菱洋エレクトロ	2,100	2,740.00	5,754,000	
東京産業	2,400	530.00	1,272,000	

阪和興業	1,700	1,962.00	3,335,400	
岩谷産業	2,600	3,770.00	9,802,000	
イワキ	9,200	512.00	4,710,400	
三愛石油	5,500	1,016.00	5,588,000	
稲畑産業	3,900	1,250.00	4,875,000	
ワキタ	3,900	947.00	3,693,300	
東邦ホールディングス	3,400	2,045.00	6,953,000	
サンゲツ	4,100	1,493.00	6,121,300	
シナネンホールディングス	1,900	2,752.00	5,228,800	
伊藤忠エネクス	5,400	877.00	4,735,800	
サンリオ	3,800	1,682.00	6,391,600	
リョーサン	1,900	2,280.00	4,332,000	
三信電気	2,300	1,446.00	3,325,800	
モスフードサービス	2,200	2,954.00	6,498,800	
加賀電子	2,800	2,002.00	5,605,600	
立花エレテック	2,500	1,735.00	4,337,500	
フォーバル	4,600	1,011.00	4,650,600	
PALTA C	2,000	4,940.00	9,880,000	
日鉄物産	1,300	3,525.00	4,582,500	
トラスコ中山	2,600	2,721.00	7,074,600	
オートバックスセブン	5,000	1,395.00	6,975,000	
加藤産業	1,700	3,610.00	6,137,000	
イノテック	4,300	975.00	4,192,500	
杉本商事	2,700	1,884.00	5,086,800	
因幡電機産業	3,300	2,416.00	7,972,800	
ミスミグループ本社	15,600	2,784.00	43,430,400	
スズケン	5,500	4,010.00	22,055,000	
ジェコス	5,300	935.00	4,955,500	
ローソン	2,900	5,850.00	16,965,000	
サンエー	1,900	4,020.00	7,638,000	
エービーシー・マート	1,900	6,440.00	12,236,000	
ハードオフコーポレーション	4,200	713.00	2,994,600	
アスクル	2,200	3,705.00	8,151,000	
ゲオホールディングス	2,900	1,330.00	3,857,000	
アダストリア	2,300	1,655.00	3,806,500	
ジーフット	1,500	484.00	726,000	
エディオン	5,400	1,064.00	5,745,600	
あみやき亭	1,500	3,205.00	4,807,500	
ハニーズホールディングス	200	1,048.00	209,600	
ジンスホールディングス	400	6,680.00	2,672,000	
ビックカメラ	6,800	1,175.00	7,990,000	
DCMホールディングス	6,600	1,170.00	7,722,000	
Monotaro	8,900	4,275.00	38,047,500	

J・フロント リテイリング	16,100	859.00	13,829,900	
ドトール・日レスホールディングス	2,900	1,718.00	4,982,200	
マツモトキヨシホールディングス	5,000	4,035.00	20,175,000	
ZOZO	9,000	2,328.00	20,952,000	
トレジャー・ファクトリー	100	827.00	82,700	
ココカラファイン	1,000	5,680.00	5,680,000	
三越伊勢丹ホールディングス	22,400	683.00	15,299,200	
ウエルシアホールディングス	3,700	8,880.00	32,856,000	
クリエイトSDホールディングス	2,000	3,350.00	6,700,000	
シュッピン	3,600	744.00	2,678,400	
ジョイフル本田	4,100	1,351.00	5,539,100	
すかいらーくホールディングス	14,200	1,809.00	25,687,800	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,800	1,121.00	4,259,800	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,000	558.00	2,790,000	
あさひ	3,300	1,450.00	4,785,000	
コスモス薬品	1,000	16,620.00	16,620,000	
トーエル	2,900	709.00	2,056,100	
セブン&アイ・ホールディングス	48,600	3,708.00	180,208,800	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	7,300	756.00	5,518,800	
ツルハホールディングス	2,700	15,950.00	43,065,000	
サンマルクホールディングス	2,300	1,732.00	3,983,600	
トリドールホールディングス	3,600	1,302.00	4,687,200	
クスリのアオキホールディングス	1,000	9,180.00	9,180,000	
スシローグローバルホールディングス	6,600	2,478.00	16,354,800	
カップ・クリエイト	4,600	1,496.00	6,881,600	
ライトオン	200	581.00	116,200	
良品計画	17,100	1,563.00	26,727,300	
三城ホールディングス	6,000	305.00	1,830,000	
アドヴァン	3,900	1,359.00	5,300,100	
G-7ホールディングス	2,100	2,465.00	5,176,500	
エコス	2,100	1,942.00	4,078,200	
マルシェ	3,800	608.00	2,310,400	
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	27,400	2,345.00	64,253,000	
西松屋チェーン	4,200	1,120.00	4,704,000	
ゼンショーホールディングス	5,900	2,241.00	13,221,900	
サイゼリヤ	3,300	2,107.00	6,953,100	
魚力	2,900	1,598.00	4,634,200	
ユナイテッドアローズ	1,800	1,778.00	3,200,400	
ハイデイ日高	2,300	1,821.00	4,188,300	
京都きもの友禅	2,700	250.00	675,000	
コロナイド	4,000	1,595.00	6,380,000	

吉番屋	1,100	5,080.00	5,588,000	
スギホールディングス	2,500	7,170.00	17,925,000	
薬王堂ホールディングス	1,300	2,536.00	3,296,800	
スクロール	5,800	464.00	2,691,200	
ファミリーマート	9,900	1,912.00	18,928,800	
木曽路	2,200	2,530.00	5,566,000	
千趣会	15,600	392.00	6,115,200	
ケーヨー	7,800	685.00	5,343,000	
上新電機	2,000	2,095.00	4,190,000	
日本瓦斯	1,900	4,570.00	8,683,000	
ロイヤルホールディングス	1,700	1,968.00	3,345,600	
いなげや	2,600	1,716.00	4,461,600	
島忠	2,400	2,856.00	6,854,400	
チヨダ	1,900	1,124.00	2,135,600	
ライフコーポレーション	1,500	3,390.00	5,085,000	
AOKIホールディングス	7,500	637.00	4,777,500	
コメリ	2,300	2,743.00	6,308,900	
青山商事	5,000	783.00	3,915,000	
しまむら	1,200	7,450.00	8,940,000	
高島屋	9,700	952.00	9,234,400	
松屋	3,900	699.00	2,726,100	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,600	789.00	5,207,400	
丸井グループ	11,300	2,058.00	23,255,400	
アクシアル リテイリング	1,100	4,125.00	4,537,500	
イオン	47,800	2,485.50	118,806,900	
イズミ	2,200	3,470.00	7,634,000	
平和堂	3,100	1,875.00	5,812,500	
フジ	2,300	1,899.00	4,367,700	
ヤオコー	1,200	7,700.00	9,240,000	
ゼビオホールディングス	4,200	874.00	3,670,800	
ケーズホールディングス	12,500	1,464.00	18,300,000	
Genky DrugStores	1,300	3,420.00	4,446,000	
ブックオフグループホールディングス	1,100	847.00	931,700	
アインホールディングス	1,600	7,140.00	11,424,000	
ヤマダ電機	38,400	529.00	20,313,600	
ニトリホールディングス	5,400	19,835.00	107,109,000	
吉野家ホールディングス	4,400	2,362.00	10,392,800	
王将フードサービス	1,300	6,130.00	7,969,000	
プレナス	3,200	1,803.00	5,769,600	
ミニストップ	2,600	1,499.00	3,897,400	
アークス	3,000	2,145.00	6,435,000	
パローホールディングス	2,400	2,170.00	5,208,000	
ファーストリテイリング	1,600	62,710.00	100,336,000	

サンドラッグ	4,300	3,620.00	15,566,000	
ヤマザワ	2,400	1,729.00	4,149,600	
ベルーナ	1,700	631.00	1,072,700	
めぶきフィナンシャルグループ	66,600	252.00	16,783,200	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,700	1,165.00	3,145,500	
九州フィナンシャルグループ	24,200	454.00	10,986,800	
ゆうちょ銀行	35,700	867.00	30,951,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	72,400	357.00	25,846,800	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,800	728.00	5,678,400	
関西みらいフィナンシャルグループ	5,900	424.00	2,501,600	
三十三フィナンシャルグループ	2,100	1,381.00	2,900,100	
第四北越フィナンシャルグループ	2,000	2,262.00	4,524,000	
新生銀行	9,100	1,385.00	12,603,500	
あおぞら銀行	6,800	1,977.00	13,443,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	847,700	437.50	370,868,750	300,000株
りそなホールディングス	135,300	377.50	51,075,750	
三井住友トラスト・ホールディングス	23,500	3,067.00	72,074,500	
三井住友フィナンシャルグループ	86,000	3,115.00	267,890,000	
千葉銀行	42,600	522.00	22,237,200	
群馬銀行	26,000	350.00	9,100,000	
武蔵野銀行	2,600	1,569.00	4,079,400	
七十七銀行	3,700	1,668.00	6,171,600	
青森銀行	1,800	2,309.00	4,156,200	
秋田銀行	2,800	1,519.00	4,253,200	
山形銀行	2,600	1,332.00	3,463,200	
岩手銀行	1,200	2,627.00	3,152,400	
東邦銀行	12,300	228.00	2,804,400	
東北銀行	900	940.00	846,000	
ふくおかフィナンシャルグループ	10,700	1,756.00	18,789,200	
静岡銀行	31,700	705.00	22,348,500	
十六銀行	2,600	2,065.00	5,369,000	
スルガ銀行	14,000	404.00	5,656,000	
八十二銀行	28,300	422.00	11,942,600	
山梨中央銀行	1,900	859.00	1,632,100	
大垣共立銀行	2,600	2,329.00	6,055,400	
福井銀行	2,100	1,668.00	3,502,800	
北國銀行	1,900	2,909.00	5,527,100	
滋賀銀行	2,300	2,499.00	5,747,700	
南都銀行	1,600	2,191.00	3,505,600	
百五銀行	15,500	330.00	5,115,000	
京都銀行	4,300	3,940.00	16,942,000	
紀陽銀行	4,200	1,697.00	7,127,400	

ほくほくフィナンシャルグループ	7,800	924.00	7,207,200	
広島銀行	18,400	511.00	9,402,400	
山陰合同銀行	3,600	551.00	1,983,600	
中国銀行	9,900	1,009.00	9,989,100	
鳥取銀行	900	1,224.00	1,101,600	
伊予銀行	16,500	655.00	10,807,500	
百十四銀行	2,100	1,953.00	4,101,300	
四国銀行	5,700	816.00	4,651,200	
阿波銀行	2,300	2,514.00	5,782,200	
大分銀行	1,500	2,399.00	3,598,500	
宮崎銀行	1,200	2,385.00	2,862,000	
佐賀銀行	2,400	1,207.00	2,896,800	
沖縄銀行	1,300	3,175.00	4,127,500	
琉球銀行	4,200	975.00	4,095,000	
セブン銀行	44,000	296.00	13,024,000	
みずほフィナンシャルグループ	1,679,300	135.50	227,545,150	
山口フィナンシャルグループ	15,500	669.00	10,369,500	
長野銀行	900	1,169.00	1,052,100	
名古屋銀行	1,300	2,423.00	3,149,900	
北洋銀行	17,800	214.00	3,809,200	
中京銀行	1,800	2,111.00	3,799,800	
愛媛銀行	2,800	1,178.00	3,298,400	
トマト銀行	1,700	1,036.00	1,761,200	
京葉銀行	7,500	524.00	3,930,000	
栃木銀行	19,300	169.00	3,261,700	
トモニホールディングス	13,200	354.00	4,672,800	
フィデアホールディングス	17,000	108.00	1,836,000	
池田泉州ホールディングス	17,200	169.00	2,906,800	
F P G	6,100	628.00	3,830,800	
S B Iホールディングス	14,000	2,298.00	32,172,000	
ジャフコ	1,900	3,510.00	6,669,000	
大和証券グループ本社	99,900	459.70	45,924,030	
野村ホールディングス	216,500	485.20	105,045,800	
岡三証券グループ	10,200	333.00	3,396,600	
丸三証券	5,100	427.00	2,177,700	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	11,000	251.00	2,761,000	
水戸証券	12,300	200.00	2,460,000	
いちよし証券	6,000	442.00	2,652,000	
松井証券	6,500	832.00	5,408,000	
マネックスグループ	13,600	226.00	3,073,600	
極東証券	5,600	527.00	2,951,200	
藍澤證券	4,900	704.00	3,449,600	
かんぽ生命保険	4,900	1,417.00	6,943,300	

SOMPOホールディングス	23,300	3,691.00	86,000,300	
MS&ADインシュアランスグループホールディングス	32,400	3,077.00	99,694,800	
ソニーフィナンシャルホールディングス	10,100	2,592.00	26,179,200	
第一生命ホールディングス	70,500	1,367.50	96,408,750	
東京海上ホールディングス	44,000	4,714.00	207,416,000	
T&Dホールディングス	37,600	981.00	36,885,600	
全国保証	3,300	4,175.00	13,777,500	
クレディセゾン	8,400	1,355.00	11,382,000	
芙蓉総合リース	1,200	6,010.00	7,212,000	
みずほリース	2,100	2,358.00	4,951,800	
東京センチュリー	2,400	5,540.00	13,296,000	
日本証券金融	6,200	510.00	3,162,000	
アイフル	22,100	242.00	5,348,200	
リコーリース	1,400	3,065.00	4,291,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,200	1,234.00	10,118,800	
アコム	26,200	427.00	11,187,400	
オリエントコーポレーション	30,900	126.00	3,893,400	
日立キャピタル	2,900	2,404.00	6,971,600	
オリックス	77,900	1,391.00	108,358,900	
三菱UFJリース	29,400	520.00	15,288,000	
日本取引所グループ	35,800	2,392.00	85,633,600	
アサックス	5,500	699.00	3,844,500	
NECキャピタルソリューション	1,500	2,016.00	3,024,000	
いちご	19,000	280.00	5,320,000	
ヒューリック	26,900	1,047.00	28,164,300	
野村不動産ホールディングス	7,900	2,065.00	16,313,500	
オープンハウス	3,300	3,555.00	11,731,500	
東急不動産ホールディングス	33,200	528.00	17,529,600	
飯田グループホールディングス	10,200	1,691.00	17,248,200	
パーク24	7,200	1,850.00	13,320,000	
三井不動産	60,800	2,060.50	125,278,400	
三菱地所	87,000	1,652.00	143,724,000	
平和不動産	2,800	3,110.00	8,708,000	
東京建物	13,300	1,306.00	17,369,800	
ダイビル	5,200	994.00	5,168,800	
京阪神ビルディング	2,800	1,391.00	3,894,800	
住友不動産	27,900	3,006.00	83,867,400	
テーオーシー	6,200	687.00	4,259,400	
スターツコーポレーション	1,900	2,225.00	4,227,500	
空港施設	5,500	433.00	2,381,500	
ゴールドクレスト	3,400	1,511.00	5,137,400	
エスリード	1,500	1,371.00	2,056,500	

A V A N T I A	4,300	788.00	3,388,400	
イオンモール	6,400	1,456.00	9,318,400	
カチタス	3,400	2,653.00	9,020,200	
日本空港ビルデング	4,000	4,730.00	18,920,000	
日本M & Aセンター	9,100	4,985.00	45,363,500	
パソナグループ	5,200	1,173.00	6,099,600	
G C A	7,300	650.00	4,745,000	
エス・エム・エス	4,100	2,486.00	10,192,600	
パーソルホールディングス	12,400	1,489.00	18,463,600	
クックパッド	13,300	350.00	4,655,000	
学情	2,600	1,282.00	3,333,200	
スタジオアリス	1,700	1,588.00	2,699,600	
シミックホールディングス	3,700	1,523.00	5,635,100	
N J S	2,500	1,811.00	4,527,500	
総合警備保障	4,800	5,100.00	24,480,000	
カカコム	9,000	2,704.00	24,336,000	
アイロムグループ	2,100	3,155.00	6,625,500	
ディップ	2,800	2,332.00	6,529,600	
キャリアデザインセンター	2,500	986.00	2,465,000	
ベネフィット・ワン	3,700	2,220.00	8,214,000	
エムスリー	26,500	4,500.00	119,250,000	
ディー・エヌ・エー	6,200	1,365.00	8,463,000	
博報堂D Yホールディングス	17,000	1,279.00	21,743,000	
ぐるなび	200	744.00	148,800	
ファンコミュニケーションズ	10,500	450.00	4,725,000	
W D Bホールディングス	1,500	2,681.00	4,021,500	
インフォマート	12,700	804.00	10,210,800	
E P Sホールディングス	2,800	1,065.00	2,982,000	
クイック	3,700	1,189.00	4,399,300	
ケネディクス	11,800	539.00	6,360,200	
電通グループ	12,500	2,754.00	34,425,000	
みらかホールディングス	3,200	2,714.00	8,684,800	
ダイオーズ	3,400	1,014.00	3,447,600	
日本空調サービス	7,600	747.00	5,677,200	
オリエンタルランド	12,800	14,975.00	191,680,000	
ダスキン	3,000	2,722.00	8,166,000	
ラウンドワン	4,600	839.00	3,859,400	
リゾートトラスト	5,100	1,453.00	7,410,300	
ビー・エム・エル	1,900	2,967.00	5,637,300	
りらいあコミュニケーションズ	5,100	1,039.00	5,298,900	
リソー教育	13,400	328.00	4,395,200	
早稲田アカデミー	2,600	911.00	2,368,600	
ユー・エス・エス	13,500	1,779.00	24,016,500	

サイバーエージェント	7,400	5,330.00	39,442,000	
楽天	55,900	937.00	52,378,300	
テー・オー・ダブリュー	1,100	404.00	444,400	
エン・ジャパン	1,600	2,906.00	4,649,600	
テクノプロ・ホールディングス	2,400	6,070.00	14,568,000	
インターワークス	3,300	381.00	1,257,300	
ジャパンマテリアル	3,400	1,687.00	5,735,800	
キャリアリンク	100	595.00	59,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	2,700	2,230.00	6,021,000	
リクルートホールディングス	86,200	3,836.00	330,663,200	
エラン	1,300	1,858.00	2,415,400	
日本郵政	98,800	787.40	77,795,120	
ベйкаレント・コンサルティング	700	9,510.00	6,657,000	
MS - J a p a n	900	854.00	768,600	
リログループ	6,800	2,178.00	14,810,400	
エイチ・アイ・エス	2,800	1,890.00	5,292,000	
共立メンテナンス	1,600	3,735.00	5,976,000	
建設技術研究所	5,700	1,813.00	10,334,100	
よみうりランド	900	3,670.00	3,303,000	
東京都競馬	1,400	3,635.00	5,089,000	
カナモト	2,900	2,324.00	6,739,600	
東京ドーム	6,400	803.00	5,139,200	
トランス・コスモス	1,500	2,422.00	3,633,000	
乃村工藝社	5,300	918.00	4,865,400	
日本管財	3,500	1,906.00	6,671,000	
白洋舎	1,300	2,893.00	3,760,900	
セコム	12,700	9,477.00	120,357,900	
セントラル警備保障	900	4,355.00	3,919,500	
メイテック	1,300	5,200.00	6,760,000	
応用地質	4,700	1,368.00	6,429,600	
船井総研ホールディングス	2,500	2,481.00	6,202,500	
ベネッセホールディングス	4,300	2,843.00	12,224,900	
イオンディライト	2,400	3,030.00	7,272,000	
ニチイ学館	4,700	1,646.00	7,736,200	
ダイセキ	2,300	2,751.00	6,327,300	
ステップ	3,000	1,505.00	4,515,000	
合 計	14,704,400		27,869,403,190	

(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】

2020年6月30日現在

種類	金額
資産総額	21,060,329,468 円
負債総額	82,335,037 円
純資産総額（ - ）	20,977,994,431 円
発行済数量	10,986,473,584 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.9094 円

（ご参考：親投資信託の現況）

TMA日本株TOPIXマザーファンド

2020年6月30日現在

種類	金額
資産総額	28,940,373,123 円
負債総額	119,999,259 円
純資産総額（ - ）	28,820,373,864 円
発行済数量	21,896,147,028 口
1 単位当たり純資産額（ / ）	1.3162 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。

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】

2020年6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。

2020年6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	175	2,879,864
単位型公社債投資信託	2	6,999
単位型株式投資信託	5	19,544
合計	182	2,906,409

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。
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35期事業年度(2019年4月1日から2020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。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
資産の部		
流動資産		
現金・預金	17,817,927	19,928,671
前払費用	208,412	207,883
未収委託者報酬	1,954,575	2,864,007
未収収益	1,951,601	2,126,212
未収入金	1,809	101,676
その他の流動資産	21,491	22,090
流動資産計	21,955,817	25,250,541
固定資産		
有形固定資産	* 1 509,917	* 1 576,200
建物	379,427	388,342
器具備品	130,490	187,858
無形固定資産	53,138	5,385
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア仮勘定	49,343	1,590
投資その他の資産	2,769,418	2,987,389
投資有価証券	43,201	65,610
関係会社株式	1,673,049	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	28,546	32,906
敷金	450,632	450,632
その他長期差入保証金	10,030	10,030
繰延税金資産	532,758	723,961
固定資産計	3,332,475	3,568,975
資産合計	25,288,293	28,819,517
負債の部		
流動負債		
未払金	2,534,676	2,555,940
未払手数料	872,217	1,315,027
その他未払金	1,662,458	1,240,912
未払費用	455,110	544,639
未払消費税等	73,427	367,506
未払法人税等	698,000	1,347,000
預り金	54,312	43,576
前受収益	3,353	3,128
賞与引当金	313,291	244,679
流動負債計	4,132,173	5,106,470
固定負債		
退職給付引当金	378,099	750,413
固定負債計	378,099	750,413
負債合計	4,510,272	5,856,883
純資産の部		
株主資本		
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	18,375,924	20,565,811
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	17,875,924	20,065,811
特別償却準備金	16	0
繰越利益剰余金	17,875,907	20,065,811
評価・換算差額等	2,096	3,177

その他有価証券評価差額金	2,096	3,177
純資産合計	20,778,021	22,962,634
負債・純資産合計	25,288,293	28,819,517

(2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第34期 (自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	12,725,446	16,536,369
運用受託報酬	9,897,931	9,077,029
投資助言報酬	69,049	60,786
その他営業収益	328,576	412,354
営業収益計	23,021,003	26,086,540
営業費用		
支払手数料	5,892,133	7,818,291
広告宣伝費	212,070	254,153
調査費	5,956,517	5,425,141
調査費	3,009,203	2,525,312
委託調査費	2,947,314	2,899,828
委託計算費	119,436	122,584
営業雑経費	238,392	285,550
通信費	32,765	35,052
印刷費	167,851	205,117
協会費	20,903	24,696
諸会費	8,374	12,157
図書費	8,498	8,525
営業費用計	12,418,551	13,905,720
一般管理費		
給料	3,450,052	3,509,999
役員報酬	117,075	112,566
給料・手当	2,360,494	2,541,727
賞与	972,483	855,706
交際費	19,897	17,797
寄付金	131	5,833
旅費交通費	200,290	174,094
租税公課	139,043	164,117
不動産賃借料	377,671	375,694
退職給付費用	113,433	466,387
賞与引当金繰入	313,291	244,679
固定資産減価償却費	106,175	118,517
法定福利費	567,366	580,893
福利厚生費	10,913	9,971
諸経費	480,371	482,967
一般管理費計	5,778,637	6,150,953
営業利益	4,823,815	6,029,866
営業外収益		
受取利息	421	434
受取配当金	* 1 5,041	* 1 4,704
匿名組合投資利益	* 1 59,798	* 1 39,334
雑益	16,161	10,094
営業外収益計	81,422	54,568
営業外費用		
為替差損	33,574	15,577
雑損	2,395	5,174
営業外費用計	35,970	20,752
経常利益	4,869,267	6,063,682
特別損失		

器具備品除却損	0	545
特別損失計	0	545
税引前当期純利益	4,869,267	6,063,137
法人税、住民税及び事業税	1,551,497	2,044,481
法人税等調整額	45,612	188,875
法人税等合計	1,505,884	1,855,605
当期純利益	3,363,382	4,207,531

(3) 【株主資本等変動計算書】

第34期（自 2018年4月1日 至 2019年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		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
当期変動額						
剰余金の配当						1,901,595
特別償却準備金の取崩					21	21
当期純利益						3,363,382
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	21	1,461,809
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	16	17,875,907

	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	-	-			-
当期純利益	3,363,382	3,363,382			3,363,382
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			480	480	480
当期変動額合計	1,461,787	1,461,787	480	480	1,461,307
当期末残高	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		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	16	17,875,907
当期変動額						
剰余金の配当						2,017,644
特別償却準備金の取崩					16	16
当期純利益						4,207,531
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	16	2,189,903
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	20,065,811

	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	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021
当期変動額					
剰余金の配当	2,017,644	2,017,644			2,017,644
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,207,531	4,207,531			4,207,531
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			5,273	5,273	5,273
当期変動額合計	2,189,887	2,189,887	5,273	5,273	2,184,613
当期末残高	20,565,811	22,965,811	3,177	3,177	22,962,634

注記事項

重要な会計方針

第35期

自 2019年4月1日

至 2020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

有形固定資産

定率法を採用しております。ただし、2016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。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当事業年度末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

数理計算上の差異は、各事業年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌事業年度から費用処理しております。

過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数(10年)による定額法により費用処理しております。

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35期

自 2019年4月1日

至 2020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

2022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。

(追加情報)

第35期

自 2019年4月1日

至 2020年3月31日

(退職給付債務の計算方法の変更)

当社は、退職給付債務の計算方法について、従来まで期末自己都合要支給額を退職給付債務とする簡便法によっておりましたが、従業員数の増加に伴い当事業年度より原則的な方法に変更しております。この変更に伴い、当事業年度末における退職給付引当金が319,413千円増加し、同額を退職給付費用として一般管理費に計上しております。

(貸借対照表関係)

第34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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。
建物 81,793千円	建物 114,303千円
器具備品 498,485千円	器具備品 364,003千円
リース資産 3,918千円	

(損益計算書関係)

第34期 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日	第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日
* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。	* 1. 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。
関係会社からの受取配当金 4,800千円	関係会社からの受取配当金 2,400千円
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 59,798千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 39,334千円

(株主資本等変動計算書関係)

第34期(自 2018年4月1日 至 2019年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	2018年4月1日 現在	増加	減少	2019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

2018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	2018年3月31日
(ニ) 効力発生日	2018年6月29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

2019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	2,017,644千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	52,680円
(二) 基準日	2019年3月31日
(ホ) 効力発生日	2019年6月28日

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

1. 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	2019年4月1日 現在	増加	減少	2020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

2019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	2,017,644千円
(ロ) 1株当たり配当額	52,680円
(ハ) 基準日	2019年3月31日
(ニ) 効力発生日	2019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
2020年6月26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	2,403,708千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	62,760円
(ニ) 基準日	2020年3月31日
(ホ) 効力発生日	2020年6月26日

(リース取引関係)

第34期(自 2018年4月1日 至 2019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したが、当事業年度においてリース契約が満了しております。

2. リース資産の減価償却の方法

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。

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

該当事項はありません。

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第34期		第35期	
自	2018年4月1日	自	2019年4月1日
至	2019年3月31日	至	2020年3月31日

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

第34期（2019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	17,817,927	17,817,927	-
(2)未収委託者報酬	1,954,575	1,954,575	-
(3)未収収益	1,951,601	1,951,601	-
(4)未収入金	1,809	1,809	-
(5)投資有価証券 其他有価証券	43,201	43,201	-
(6)預り金	(54,312)	(54,312)	-
(7)未払金	(2,534,676)	(2,534,676)	-
(8)未払費用	(455,110)	(455,110)	-
(9)未払消費税等	(73,427)	(73,427)	-
(10)未払法人税等	(698,000)	(698,000)	-

（*）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35期（2020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	19,928,671	19,928,671	-
(2)未収委託者報酬	2,864,007	2,864,007	-
(3)未収収益	2,126,212	2,126,212	-
(4)未収入金	101,676	101,676	-
(5)投資有価証券 其他有価証券	65,610	65,610	-
(6)預り金	(43,576)	(43,576)	-
(7)未払金	(2,555,940)	(2,555,940)	-
(8)未払費用	(544,639)	(544,639)	-
(9)未払消費税等	(367,506)	(367,506)	-
(10)未払法人税等	(1,347,000)	(1,347,000)	-

(＊)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34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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 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。	(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 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34期 2019年3月31日現在		第35期 2020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	1,640,302	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	10,030	その他長期差入保証金	10,030

(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34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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34期(2019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	17,817,465	-	-	-
未収委託者報酬	1,954,575	-	-	-
未収収益	1,951,601	-	-	-
未収入金	1,809	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	8,308	13,426	5,810	-
合計	21,733,759	13,426	5,810	-

第35期(2020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	19,928,370	-	-	-
未収委託者報酬	2,864,007	-	-	-
未収収益	2,126,212	-	-	-
未収入金	101,676	-	-	-
投資有価証券 其他有価証券のうち満期があるもの	2,247	21,678	22,121	-
合計	25,022,515	21,678	22,121	-

(有価証券関係)

第34期 2019年3月31日現在	第35期 2020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1,640,302千円、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>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. 其他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>	<p>2. 其他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えるもの 証券投資 信託	27,344	22,052	5,292	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	32,071	27,816	4,254
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	15,856	18,126	2,269	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	33,538	42,372	8,834
合計	43,201	40,179	3,022	合計	65,610	70,189	4,579

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券
該当事項はありません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券
同左

(退職給付関係)

第34期 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日	
1. 採用している退職給付制度の概要	<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>
2. 確定給付制度	

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

退職給付引当金の期首残高	386,552千円
退職給付費用	38,082千円
退職給付の支払額	37,318千円
確定拠出年金制度への移管額	9,217千円
退職給付引当金の期末残高	378,099千円

(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

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	378,099千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	378,099千円
退職給付引当金	378,099千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	378,099千円

(3) 退職給付費用

簡便法で計算した退職給付費用	28,865千円
----------------	----------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、62,736千円であります。

第35期

自 2019年4月1日
至 2020年3月31日

1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

当社は当事業年度より退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法に変更しております。

2. 確定給付制度

(1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	378,099千円
簡便法から原則法への変更に伴う費用処理額	319,413千円
勤務費用	70,137千円
利息費用	1,378千円
数理計算上の差異の発生額	11,130千円
退職給付の支払額	9,404千円
確定拠出年金制度への移管額	9,212千円
退職給付債務の期末残高	739,283千円

(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

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	739,283千円
未積立退職給付債務	739,283千円
未認識数理計算上の差異	11,130千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	750,413千円
退職給付引当金	750,413千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	750,413千円

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	70,137千円
利息費用	1,378千円
簡便法から原則法への変更に伴う費用処理額	319,413千円
その他	9,272千円
確定給付制度に係る退職給付費用	400,202千円

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

当事業年度末における主要な数理計算上の計算基礎(加重平均で表しております。)

割引率	0.4%
-----	------

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、66,184千円であります。

(税効果会計関係)

1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	115,773千円	229,776千円
未払金	3,921千円	3,802千円
賞与引当金	95,929千円	74,920千円
未払法定福利費	10,904千円	9,935千円
未払事業所税	3,587千円	3,672千円
未払事業税	40,339千円	70,737千円
未払調査費	83,845千円	82,822千円

減価償却超過額	98,061千円	124,870千円
繰延資産超過額	1,733千円	3,293千円
未払確定拠出年金	1,664千円	1,666千円
未収実績連動報酬	3,881千円	21,260千円
過大確定拠出年金掛金	19千円	-
その他有価証券評価差額金	-	1,402千円
未払費用	74,029千円	95,799千円
繰延税金資産小計	533,691千円	723,961千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	533,691千円	723,961千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	7千円	0千円
その他有価証券評価差額金	925千円	-
繰延税金負債合計	932千円	0千円
繰延税金資産の純額	532,758千円	723,961千円

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34期 (2019年3月31日現在)	第35期 (2020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34期 自 2018年4月1日 至 2019年3月31日	第35期 自 2019年4月1日 至 2020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>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 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。</p>	<p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>23,387,535</td> <td>2,699,004</td> <td>26,086,540</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。</p>	日本	その他	合計	23,387,535	2,699,004	26,086,540
日本	その他	合計					
23,387,535	2,699,004	26,086,540					
<p>(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>(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）</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）</p>						
<p>(2) 委託者報酬 3,641,416千円</p>	<p>(2) 委託者報酬 5,339,902千円</p>						
<p>(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>	<p>(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34期（自 2018年4月1日 至 2019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
重要な取引はありません。
- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

- (1) 親会社情報
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）
- (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35期（自 2019年4月1日 至 2020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
重要な取引はありません。
- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等
重要な取引はありません。

2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

- (1) 親会社情報
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）
- (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34期 (自 2018年 4 月 1 日 至 2019年 3 月31日)	
1 株当たり純資産額	542,507円07銭
1 株当たり当期純利益金額	87,816円78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	20,778,021千円
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	20,778,021千円
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	3,363,382千円
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	3,363,382千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株
第35期 (自 2019年 4 月 1 日 至 2020年 3 月31日)	
1 株当たり純資産額	599,546円59銭
1 株当たり当期純利益金額	109,857円21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	22,962,634千円
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	22,962,634千円
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	4,207,531千円
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	4,207,531千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

委託会社は、「金融商品取引法」の定めるところにより、利害関係人との取引について、次に掲げる行為が禁止されています。

自己又はその取締役若しくは執行役との間における取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

運用財産相互間において取引を行うことを内容とした運用を行うこと(投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれがないものとして内閣府令で定めるものを除きます。)

通常の実行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（2020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（2020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。

() 2020年3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【その他】

- 1．目論見書の表紙にロゴ・マーク、図案を使用し、委託会社の名称、ファンドの基本的性格等を記載することがあります。
- 2．目論見書の表紙に委託会社の金融商品取引業者登録番号および目論見書の使用を開始する日を記載する場合があります。
- 3．請求目論見書に当ファンドの約款を添付します。
- 4．目論見書の別称として「投資信託説明書（目論見書）」、「投資信託説明書（交付目論見書）」または「投資信託説明書（請求目論見書）」という名称を使用することがあります。
- 5．目論見書は電子媒体として使用されたり、インターネット等に掲載されることがあります。

独立監査人の監査報告書

2020年6月1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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 奈良 昌彦
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**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」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2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2020年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、会社から独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業的前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

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

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業的前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業的前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事

項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、企業は継続企業として存続できなくなる可能性がある。

- ・ 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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

以 上

-
- (注) 1. 上記は監査報告書の原本に記載された事項を電子化したものであり、その原本は当社が別途保管しております。
2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2020年8月5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

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上セレクション・日本株TOPIXの2019年6月21日から2020年6月22日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上セレクション・日本株TOPIXの2020年6月22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。

監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に準拠して監査を行った。監査の基準における当監査法人の責任は、「財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手したと判断している。

財務諸表に対する経営者の責任

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

財務諸表を作成するに当たり、経営者は、継続企業の前提に基づき財務諸表を作成することが適切であるかどうかを評価し、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に基づいて継続企業に関する事項を開示する必要がある場合には当該事項を開示する責任がある。

財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した監査に基づいて、全体としての財務諸表に不正又は誤謬による重要な虚偽表示がないかどうかについて合理的な保証を得て、監査報告書において独立の立場から財務諸表に対する意見を表明することにある。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

監査人は、我が国において一般に公正妥当と認められる監査の基準に従って、監査の過程を通じて、職業的専門家としての判断を行い、職業的懐疑心を保持して以下を実施する。

- 不正又は誤謬による重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応した監査手続を立案し、実施する。監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、意見表明の基礎となる十分かつ適切な監査証拠を入手する。
- 財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な監査手続を立案するために、監査に関連する内部統制を検討する。
- 経営者が採用した会計方針及びその適用方法の適切性、並びに経営者によって行われた会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、監査報告書において財務諸表の注記事項に注意を喚起すること、又は重要な不確実性に関する財務諸表の注記事項が適切でない場合は、財務諸表に対して除外事項付意見を表明することが求められている。監査人の結論は、監査報告書日までに入手した監査証拠に基づいているが、将来の事象や状況により、ファンドは継続企業として存続できなくなる可能性がある。
- 財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた財務諸表の表示、構成及び内容、並びに財務諸表が基礎となる取引や会計事象を適正に表示しているかどうかを評価する。

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

利害関係

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。