

## 【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】	2018年10月25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・円資産インデックスバランスファンド
【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・円資産インデックスバランスファンド

（なお、愛称として「つみたて円奏会」という名称を用いる場合があります。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】

申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の2種類のコースがあります。

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

販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。また、販売会社により取扱うコース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。（販売会社との間で定額購入サービスに関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込単位によるものとします。）

分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、上記にかかわらず1口単位で取得することができます。

### (7)【申込期間】

2018年10月26日から2019年4月25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・支店等で取扱います。ただし、一部取扱いを行わない支店等がある場合がありますので、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經由して、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・連合会等による購入の申込み、および「つみたてNISA(ニーサ)」をご利用の方による購入の申込み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、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. 分配金再投資コースの場合には、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。 )。
- h. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。

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、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして、「TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券」、「TMA日本株TOPIXマザーファンド受益証券」、「東京海上・東証REITマザーファンド受益証券」（それぞれをまたは総称して、以下「マザーファンド」ということがあります。）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／資産複合に属します。

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)
単位型投信	国内	株式 債券
追加型投信	海外	不動産投信
	内外	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
--------	------	--------	------

株式 一般 大型株 中小型株  債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 ( )  不動産投信  その他資産（投資信託証券 （資産複合（株式・債券・不動産投信） 資産配分変更型））  資産複合 ( ) 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回	グローバル	ファミリーファンド          ファンド・オブ・ ファンズ
	年2回	日本	
	年4回	北米	
	年6回 (隔月)	欧州	
	年12回 (毎月)	アジア	
	日々	オセアニア	
	その他 ( )	中南米	
		アフリカ	
		中近東 (中東)	
		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の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	プル・ペア型	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

主として国内の債券や株式、不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とするマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内の複数の資産（債券・株式・REIT）に分散投資します。

2

各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンドに投資し、その投資比率は以下の資産配分比率を基本とします。

資産	マザーファンド	指数	基本資産配分
日本債券	TMA日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI(総合)	70%
日本株式	TMA日本株TOPIXマザーファンド	TOPIX(東証株価指数)(配当込み)	15%
日本REIT	東京海上・東証REITマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	15%

- 上記の資産配分比率を基本としますが、ファンド全体の価格変動リスクを年率3%程度に維持することを目的とし、株式およびREITの資産配分比率を次の計算方法により決定し、機械的に変更します。
- 株式およびREITの資産配分比率の計算にあたっては、ファンド全体に対して債券の組入比率を70%に固定した上で、株式およびREITの指数を合成することにより算出された価格変動リスクが年率3%に近似する株式とREITの合計の資産配分比率を逆算して求め、原則として均等に配分します。
- 株式とREITの合計の資産配分比率は30%～5%の範囲内とし、残りは短期金融資産を組入れます。なお、原則として月次でリバランスを実施します。



※上記のイメージ図は、日本株式および日本REITの資産配分比率調整についてご理解いただくために記載したものであり、実際のファンドの運用を示すものではありません。

※組入資産の価格変動や市況の動向等によっては、各資産の実際の組入比率は上記比率と異なる場合があります。常に上記の通り運用することを示すものではありません。

## 【ご参考】 価格変動リスクについて

価格が上下に変動する振れ幅の程度のことであり、一般に標準偏差を使用します。  
標準偏差とは、散らばり具合（ばらつき）を示す指標であり、ファンドのリターンの標準偏差が小さい程、リスクは小さいといえます。また、逆に、リターンの標準偏差が大きい程、リスクは大きいということになります。

年率3%の標準偏差とは、1年間のリターンが平均リターンから±3%の範囲内に約3分の2の確率で収まるということです。

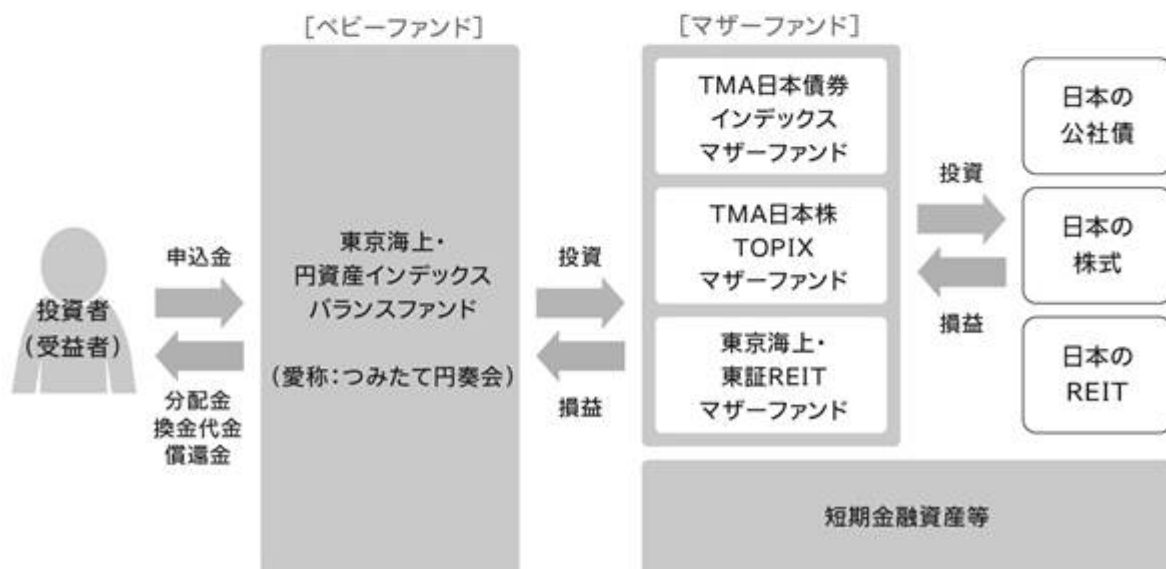
したがって、リスクを3%程度に抑制して運用を行っていたとしても、ファンドの実際の運用成績は±3%を大きく超えて変動することがあります。

<各マザーファンドが対象とする指数について>

- \*「NOMURA-BPI(野村債券・パフォーマンス・インデックス)(総合)」とは、野村證券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、野村證券の知的財産です。野村證券は、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- \*「TOPIX」は株式会社東京証券取引所((株)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、(株)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(株)東京証券取引所が有します。(株)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。
- \*「東証REIT指数」は(株)東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄の動きを捉える指数です。東証REIT指数は(株)東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等当該指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標または標章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。なお、ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所はファンドの発行または売買に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

## 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て行う方式です。ベビーファンドがマザーファンドに投資するに際しての投資コストはかかりません。また、他のベビーファンドが、マザーファンドへ投資することがあります。

## 主な投資制限

株 式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
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10%以下とします。
デリバティブ	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。

## 分配方針

◎年1回決算を行います。

- 1月25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。

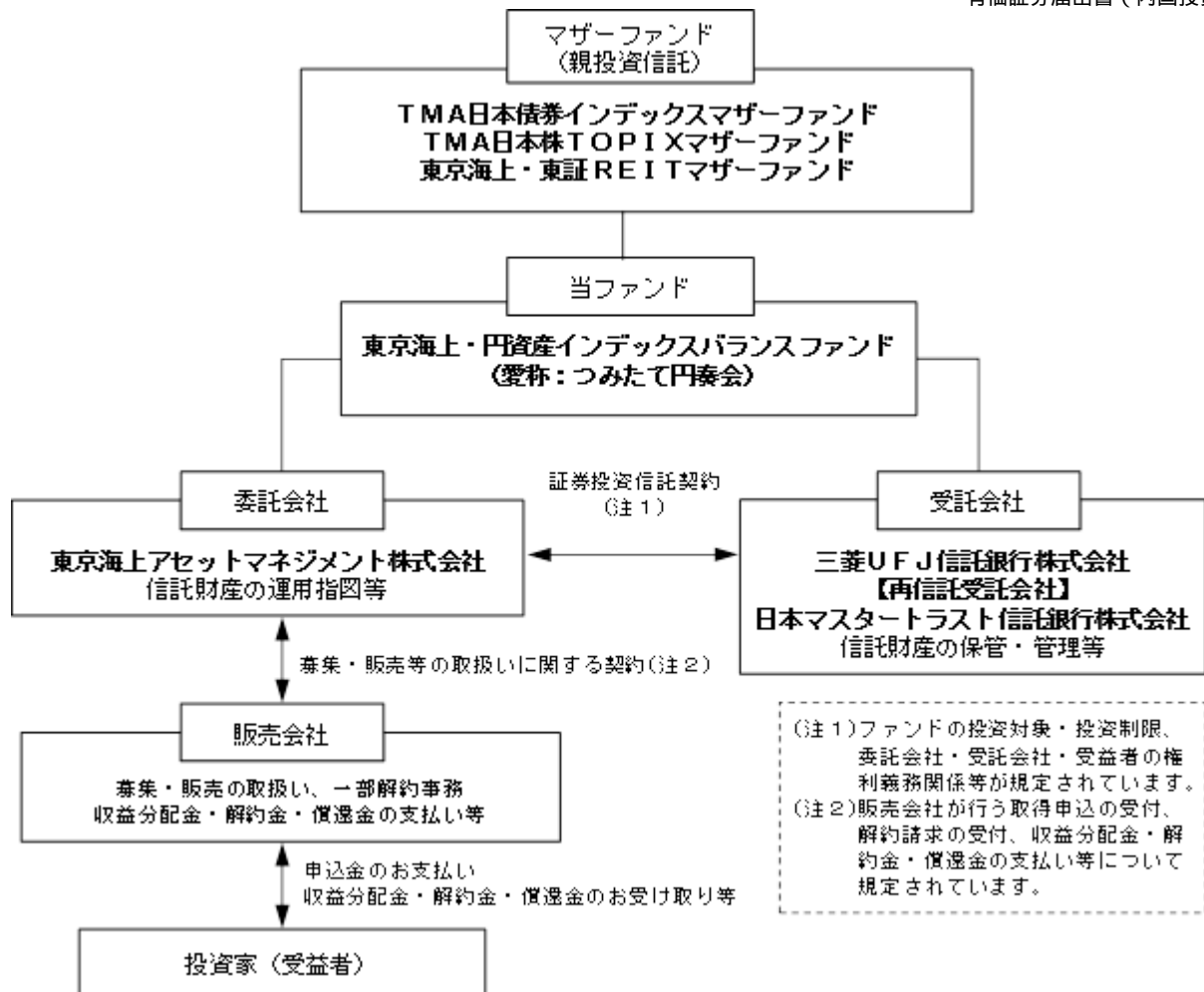
資金動向および市況動向によっては、上記のような運用ができない場合があります。

## (2)【ファンドの沿革】

2017年10月11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（2018年8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
  - 2018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（2018年8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

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして運用を行います。

#### 2．運用方法

##### (1) 主要投資対象

主として以下の親投資信託(以下「マザーファンド」といいます。)受益証券および短期金融資産に投資します。なお、有価証券等の資産に直接投資することがあります。

TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券

TMA日本株TOPIXマザーファンド受益証券

東京海上・東証REITマザーファンド受益証券

## (2) 投資態度

主として国内の債券や株式、不動産投資信託(一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下「REIT」といいます。)を主要投資対象とするマザーファンド受益証券への投資を通じて、国内の複数の資産(債券・株式・REIT)に分散投資します。

各指数に連動する投資成果をめざして運用を行う各マザーファンドに投資し、その投資比率は以下の資産配分比率を基本とします。

資産	マザーファンド	指数	基本資産配分
債券	TMA日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA - BPI (総合)	70%
株式	TMA日本株TOPIXマザーファンド	TOPIX (東証株価指数) (配当込み)	15%
REIT	東京海上・東証REITマザーファンド	東証REIT指数(配当込み)	15%

上記の資産配分比率を基本としますが、ファンド全体の価格変動リスクを年率3%程度に維持することを目的とし、株式およびREITの資産配分比率を次の計算方法により決定し、機械的に変更します。

株式およびREITの資産配分比率の計算にあたっては、ファンド全体に対して債券の組入比率を70%に固定した上で、株式およびREITの指数を合成することにより算出された価格変動リスクが年率3%に近似する株式とREITの合計の資産配分比率を逆算して求め、原則として均等に配分します。

なお、株式とREITの合計の資産配分比率は30%~5%の範囲内とし、残りは短期金融資産を組入れます。

原則として月次でリバランスを実施します。

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。

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できない場合があります。

## <参考情報> マザーファンドの運用の基本方針、主な投資対象と投資制限(要約)

**TMA日本債券インデックスマザーファンド****1. 基本方針**

NOMURA - BPI (総合) に連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

わが国の公社債を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

主としてわが国の公社債に投資し、NOMURA - BPI (総合) に連動する投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

信託財産の効率的な運用に資するため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額および債券先物取引等の買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があります。

**3. 運用制限**

(1) 株式への投資割合は、転換社債の転換、新株引受権の行使、及び新株予約権(転換社債型新株予約権付社債の新株予約権に限ります。)の行使により取得したものに限り、信託財産の純資産総額の10%以下とします。

(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10%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) 同一銘柄の株式への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(6) 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5%以下とします。

(7) 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5%以下とします。

(8) 約款第18条(先物取引等の運用指図)、約款第19条(スワップ取引の運用指図)および約款第20条(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)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。



**TMA日本株TOPIXマザーファンド****1. 基本方針**

TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(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) 投資態度**

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（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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、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。以下同じ。）、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。

**3. 運用制限**

(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）、約款第17条（スワップ取引の運用指図）および約款第18条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）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。

**東京海上・東証REITマザーファンド****1. 基本方針**

東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

主として東証REIT指数（配当込み）に採用されている不動産投資信託証券（一般社団法人投資信託協会規則に定める不動産投資信託証券をいいます。以下「REIT」といいます。）に投資します。

**(2) 投資態度**

東証REIT指数（配当込み）に採用されているREITを主要投資対象とし、当該指数に連動する投資成果の達成を目標とします。

流動性、機動性、コスト等の観点から、東証REIT指数先物取引等を行うことがあります。

原則として、REITへの組入比率を高位に維持します。

**3. 運用制限**

(1) 株式への直接投資は行いません。

(2) 外貨建資産への直接投資は行いません。

(3) 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

(4) 同一発行体の投資信託証券への投資割合は、原則として信託財産の純資産総額の35%以下とします。

ただし、東証REIT指数（配当込み）における時価の構成割合が35%を超える投資信託証券がある場合には、当該投資信託証券へ東証REIT指数（配当込み）における構成割合の範囲で投資することができるものとします。

(5) 約款第14条の2（先物取引等の運用指図）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。

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できない場合があります。

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、層化抽出法を用いてNOMURA BPI(総合)に連動するよう、残存期間別、種別毎の時価ウェイトとデレーションを勘案しポートフォリオを構築します。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の運用にあたっては、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。

「東京海上・東証REITマザーファンド」の運用にあたっては、完全法を用いて東証REIT指数(配当込み)に連動するようポートフォリオを構築します。

## (2)【投資対象】

1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - (1) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいいます。以下同じ。)
    - 有価証券
    - デリバティブ取引にかかる権利(金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。)
    - 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日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「東京海上・東証REITマザーファンド」の受益証券および次の有価証券(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。)に投資することを指図します。
  - (1) 株券または新株引受権証券
  - (2) 国債証券
  - (3) 地方債証券
  - (4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - (5) 社債券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。)
  - (6) 特定目的会社にかかる特定社債券(金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。)
  - (7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券(金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。)
  - (8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券(金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。)
  - (9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券(金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。)
  - (10) コマーシャル・ペーパー
  - (11) 新株引受権証券(新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。)および新株予約権証券
  - (12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
  - (13) 投資信託または外国投資信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。)
  - (14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券(金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。)
  - (15) 外国貸付債権信託受益証券(金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。)
  - (16) オプションを表示する証券または証書(金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。)
  - (17) 預託証券(金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。)
  - (18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - (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せん。)
  - (20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
  - (21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - (22) 受益証券発行信託の受益証券(金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、上記(1)から(21)に該当するものを除きます。)
  - (23) 外国の者に対する権利で上記(21)および(22)の有価証券の性質を有するもの



なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

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

(1) 預金

(2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）

(3) コール・ローン

(4) 手形割引市場において売買される手形

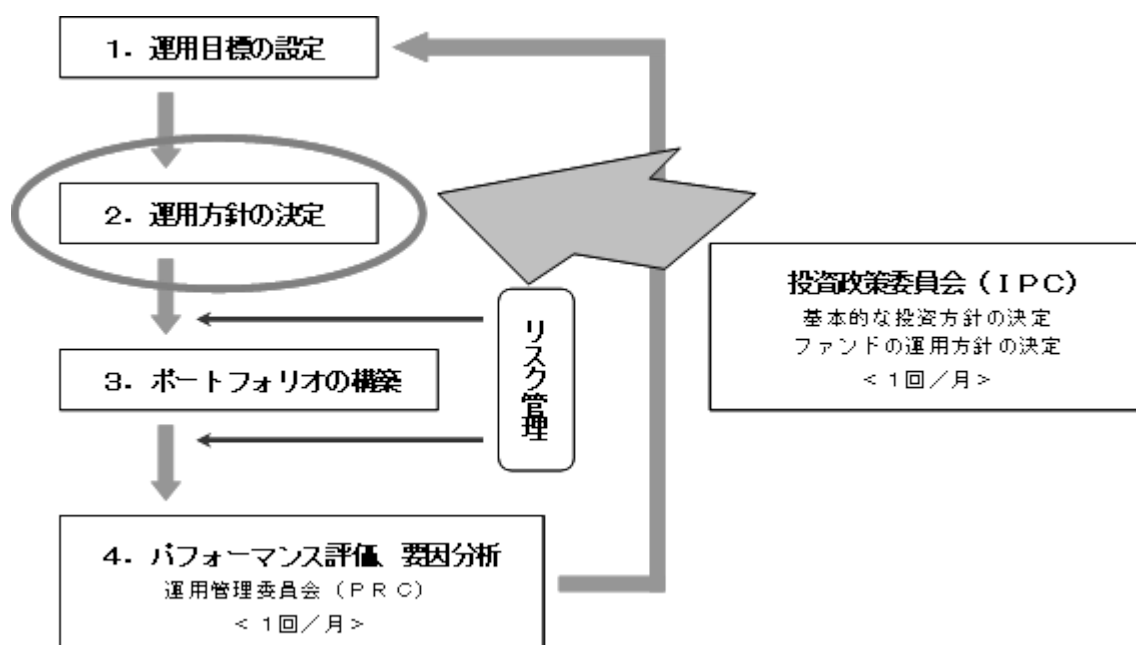
(5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの

(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

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

### (3) 【運用体制】

当ファンドの運用は、基本資産配分に基づき、3資産（日本株式、日本債券、日本REIT）の各マザーファンドへの投資を行います。各マザーファンドの運用方針は、毎月開催される投資政策委員会において決定します。



当ファンドは運用戦略部（12名）が社内規則である「投資運用業に係る業務運営規程」に基づき運用を担当します。各マザーファンドについては、日本株式および日本REITをクオンツ企画運用部（8名）が、日本債券を債券運用部日本債券運用グループ（12名）が、同じく「投資運用業に係る業務運営規程」に基づき運用を担当します。

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

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

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

（上記の体制や人員等については、2018年9月1日現在）

### (4) 【配分方針】

年1回（原則として1月25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、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とし、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して収益分配金額を決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。なお、収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、投資方針に基づいて運用を行います。

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

- a. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品賃料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額(「配当等収益」といいます。)は、諸経費( )、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税(以下「消費税等」といいます。)に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- b. 売買損益に評価損益を加減した利益金額(以下「売買益」といいます。)は、諸経費( )、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。  
( ) 諸経費とは、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用(消費税等相当額を含みます。)、信託財産の財務諸表の監査に要する費用(消費税等相当額を含みます。)ならびに受託会社の立替えた立替金の利息をいいます。

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に、お支払いします。なお、「分配金再投資コース」をお申込みの場合は、分配金は税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

## (5)【投資制限】

運用の基本方針に基づく制限(約款別紙「運用の基本方針」)

- a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式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30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)
- b. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- c. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券(マザーファンド受益証券ならびに取引所に上場し、かつ当該取引所において常時売却可能な投資信託証券、また既に組入れていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。)の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- e. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式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。
- g. 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。

- h. 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。

#### 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、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るものとします。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

#### 先物取引等(約款第22条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、日本国内の取引所における有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。 )および有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。 )ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします(以下同じ。 )。
- b. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、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、信託財産の効率的な運用に資するため、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、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、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。

#### 有価証券の空売(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、信託財産において有しない有価証券または下記「有価証券の借入」の規定により借入れた有価証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、売付けた有価証券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a. の売付の指図は、当該売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b. の売付にかかる有価証券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、その額を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。

#### 有価証券の借入(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、有価証券の借入の指図をすることができます。なお、当該有価証券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、当該借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b. の借入にかかる有価証券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有価証券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、ならびに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、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35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、公社債およびREIT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・財務状況、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)。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 金利変動リスク

公社債は、一般に金利が上昇した場合には価格は下落し、反対に金利が下落した場合には価格は上昇します。したがって、金利が上昇した場合、基準価額が下落する要因となります。

##### 信用リスク

一般に、公社債や短期金融商品等の発行体にデフォルト(債務不履行)が生じた場合、またはデフォルトが予想される場合には、当該公社債等の価格は大幅に下落することになります。したがって、組入公社債等にデフォルトが生じた場合、またデフォルトが予想される場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### REITの価格変動リスク

REITの価格は、REITが保有する不動産の評価の下落、不動産市況に対する見通しや需給など、さまざまな要因を反映して変動します。組入REITの価格が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 流動性リスク

受益者から解約申込があった場合、組入資産を売却することで解約資金の手当てを行うことがあります。その際、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。この場合、基準価額が下落する要因となります。

##### (2) 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、主に国内の株式、公社債およびREIT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、組入れた有価証券の値動きやそれらの有価証券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。

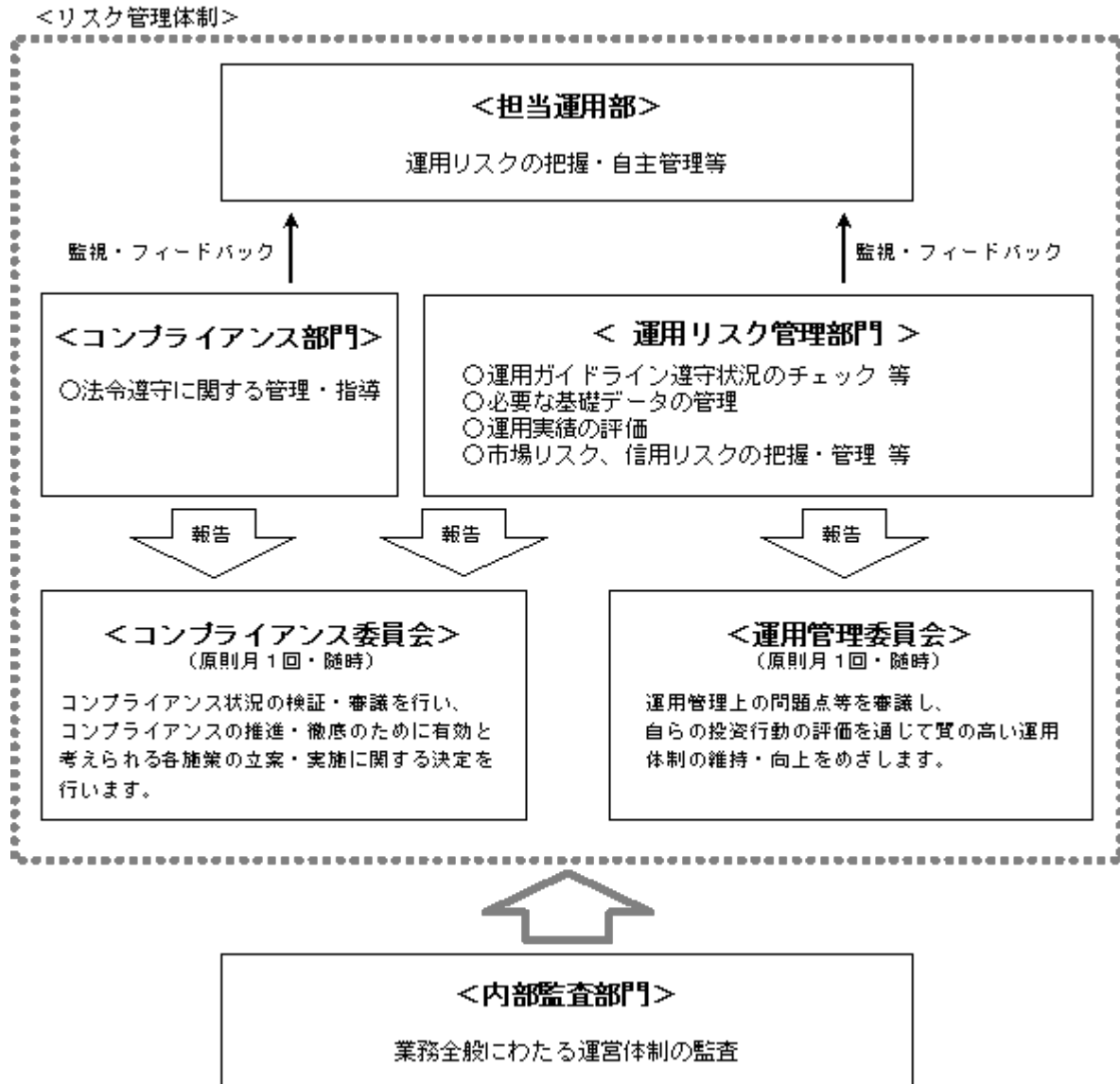
分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場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

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。





## 参考情報

2013年9月～2018年8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。

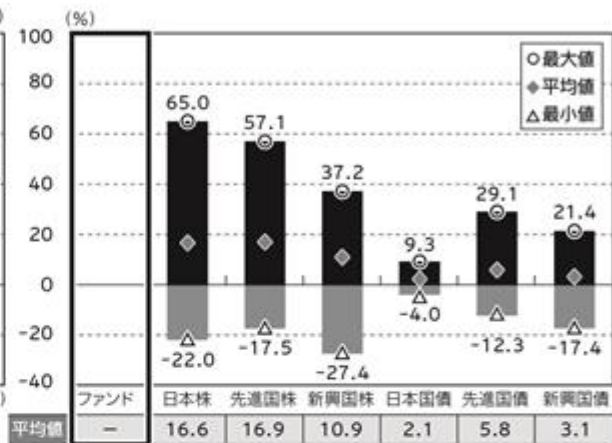


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

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。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

## 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。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社は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。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社は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および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象にした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなし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0.4104%（税抜0.38%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

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

信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

委託会社 <sup>*1</sup>	販売会社 <sup>*2</sup>	受託会社 <sup>*3</sup>
年率0.18%	年率0.18%	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0.0108%（税抜0.01%）を乗じて得た金額（ただし、年97.2万円（税抜90万円）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。

非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託等から生じる配当所得および譲渡所得が一定期間非課税となります。ご利用になれるのは、販売会社で非課税口座を開設する等、一定の条件に該当する方が対象となります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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。いずれの場合も配当控除の適用はありません。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。

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

#### < 法人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の「各受益者の個別元本」（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、2018年8月末現在のもので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

## 5 【運用状況】

以下は2018年8月31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	2,348,560	95.17
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		119,162	4.82
合計（純資産総額）		2,467,722	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日本債券インデックスマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（%）
国債証券	日本	2,562,305,150	71.03
地方債証券	日本	317,616,240	8.80
特殊債券	日本	108,798,960	3.01
社債券	日本	503,422,912	13.95
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		115,131,911	3.19
合計（純資産総額）		3,607,275,173	100.00

## 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	52,831,781,030	95.39
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		2,548,360,576	4.60
合計（純資産総額）		55,380,141,606	100.00

## その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価（円）	投資比率（％）
株価指数先物取引	買建	日本	2,496,240,000	4.50

(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。

## 東京海上・東証REITマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
投資証券	日本	4,053,763,420	96.32
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		154,486,251	3.67
合計（純資産総額）		4,208,249,671	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	150,715,000	3.58

(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日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,358,625	1.2734	1,730,204	1.2720	1,728,171	70.03
2	東京海上・東証REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	279,876	1.0841	303,438	1.1121	311,250	12.61
3	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	221,828	1.4379	318,984	1.3936	309,139	12.52

## 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	95.17
合計	95.17

## 【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日本債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
							単価 (円)	金額 (円)	単価 (円)	金額 (円)	
1	第33回道路債券	日本	社債券	2.910	2034/06/20	100,000,000	136.95	136,957,000	134.79	134,793,000	3.73
2	第74回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.100	2024/12/20	100,000,000	115.39	115,390,000	113.39	113,399,000	3.14
3	第133回利付国債（20年）	日本	国債証券	1.800	2031/12/20	90,000,000	120.65	108,591,200	119.79	107,811,900	2.98
4	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	日本	特殊債券	1.900	2021/02/26	100,000,000	106.33	106,333,000	104.78	104,783,000	2.90
5	第7回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債（劣後特約付）	日本	社債券	2.110	2019/12/20	100,000,000	103.99	103,990,000	102.62	102,624,000	2.84
6	平成22年度第3回横浜市公募公債	日本	地方債証券	1.168	2020/09/18	100,000,000	103.23	103,230,000	102.33	102,330,000	2.83
7	第1回川崎市15年公募公債	日本	地方債証券	1.780	2019/09/20	100,000,000	103.23	103,234,000	101.85	101,851,000	2.82
8	第75回共同発行市場公募地方債	日本	地方債証券	1.640	2019/06/25	100,000,000	102.59	102,593,000	101.31	101,318,000	2.80
9	第51回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.000	2021/06/21	90,000,000	107.68	96,912,000	105.90	95,314,500	2.64
10	第84回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.000	2025/12/20	80,000,000	116.43	93,144,000	114.59	91,672,800	2.54
11	第100回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.200	2028/03/20	70,000,000	122.06	85,442,000	120.01	84,013,300	2.32
12	第135回利付国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2023/03/20	80,000,000	101.00	80,800,000	100.82	80,656,000	2.23
13	第49回利付国債（30年）	日本	国債証券	1.400	2045/12/20	70,000,000	115.89	81,123,000	114.98	80,490,900	2.23
14	第29回利付国債（30年）	日本	国債証券	2.400	2038/09/20	60,000,000	134.98	80,988,600	133.40	80,041,800	2.21
15	第90回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.200	2026/09/20	65,000,000	119.46	77,649,000	117.41	76,322,350	2.11
16	第343回利付国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2026/06/20	75,000,000	101.06	75,795,000	100.58	75,437,250	2.09
17	第105回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.100	2028/09/20	60,000,000	121.79	73,075,200	119.77	71,864,400	1.99
18	第71回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.200	2024/06/20	60,000,000	115.00	69,000,000	113.00	67,805,400	1.87
19	第66回利付国債（20年）	日本	国債証券	1.800	2023/12/20	60,000,000	111.48	66,888,000	109.85	65,911,200	1.82
20	第50回利付国債（20年）	日本	国債証券	1.900	2021/03/22	60,000,000	106.83	64,098,000	105.12	63,073,200	1.74
21	第116回利付国債（20年）	日本	国債証券	2.200	2030/03/20	50,000,000	124.99	62,499,500	122.84	61,420,500	1.70

22	第346回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/03/20	60,000,000	100.74	60,444,000	100.42	60,255,000	1.67
23	第347回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/06/20	60,000,000	100.66	60,396,000	100.34	60,209,400	1.66
24	第145回利付国債(20年)	日本	国債証券	1.700	2033/06/20	50,000,000	120.68	60,340,000	119.32	59,662,500	1.65
25	第327回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.800	2022/12/20	55,000,000	104.58	57,519,000	103.79	57,086,150	1.58
26	第154回利付国債(20年)	日本	国債証券	1.200	2035/09/20	50,000,000	112.57	56,288,500	111.78	55,892,500	1.54
27	第7回利付国債(40年)	日本	国債証券	1.700	2054/03/20	45,000,000	124.81	56,164,500	124.04	55,821,600	1.54
28	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	日本	社債券	1.410	2046/12/10	52,207,000	105.48	55,067,943	105.44	55,047,582	1.52
29	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	日本	社債券	1.440	2047/04/10	50,897,000	105.61	53,752,321	105.57	53,734,507	1.48
30	第5回利付国債(40年)	日本	国債証券	2.000	2052/03/20	40,000,000	133.59	53,436,000	132.25	52,903,600	1.46

## 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	259,400	6,894.26	1,788,372,372	6,930.00	1,797,642,000	3.24
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	1,473,700	702.97	1,035,972,029	670.80	988,557,960	1.78
3	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	94,800	8,582.81	813,650,464	10,300.00	976,440,000	1.76
4	ソニー	日本	電気機器	株式	142,900	5,216.80	745,481,207	6,348.00	907,129,200	1.63
5	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	150,200	5,050.38	758,567,648	4,950.00	743,490,000	1.34
6	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	159,300	4,524.59	720,767,312	4,381.00	697,893,300	1.26
7	キーエンス	日本	電気機器	株式	10,500	64,284.66	674,989,026	62,890.00	660,345,000	1.19
8	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	192,000	3,601.77	691,541,253	3,292.00	632,064,000	1.14
9	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	2,861,100	193.12	552,555,062	195.10	558,200,610	1.00
10	KDDI	日本	情報・通信業	株式	184,500	2,738.72	505,295,410	2,941.00	542,614,500	0.97
11	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	157,400	2,595.12	408,472,900	3,387.00	533,113,800	0.96
12	任天堂	日本	その他製品	株式	13,100	46,951.68	615,067,028	40,160.00	526,096,000	0.94
13	三菱商事	日本	卸売業	株式	147,600	2,913.34	430,010,312	3,171.00	468,039,600	0.84
14	花王	日本	化学	株式	52,500	7,549.47	396,347,278	8,625.00	452,812,500	0.81
15	ファナック	日本	電気機器	株式	20,300	25,408.60	515,794,768	21,775.00	442,032,500	0.79
16	NTTドコモ	日本	情報・通信業	株式	150,400	2,780.78	418,230,802	2,885.00	433,904,000	0.78
17	村田製作所	日本	電気機器	株式	22,400	15,286.36	342,414,485	19,185.00	429,744,000	0.77
18	東海旅客鉄道	日本	陸運業	株式	19,100	20,124.36	384,375,438	22,315.00	426,216,500	0.76
19	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	79,300	5,002.61	396,707,394	5,237.00	415,294,100	0.74
20	日本電産	日本	電気機器	株式	25,700	16,461.93	423,071,628	16,105.00	413,898,500	0.74

21	ダイキン工業	日本	機械	株式	29,100	11,944.71	347,591,308	14,170.00	412,347,000	0.74
22	キヤノン	日本	電気機器	株式	115,000	3,827.58	440,171,813	3,563.00	409,745,000	0.73
23	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	88,000	4,511.07	396,974,838	4,525.00	398,200,000	0.71
24	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	209,900	1,611.23	338,197,900	1,882.00	395,031,800	0.71
25	東日本旅客鉄道	日本	陸運業	株式	38,300	9,901.42	379,224,610	10,055.00	385,106,500	0.69
26	信越化学工業	日本	化学	株式	36,800	10,892.21	400,833,681	10,425.00	383,640,000	0.69
27	日立製作所	日本	電気機器	株式	512,000	783.75	401,283,792	725.50	371,456,000	0.67
28	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	78,700	5,361.61	421,958,989	4,653.00	366,191,100	0.66
29	日本たばこ産業	日本	食料品	株式	123,800	2,967.00	367,315,048	2,922.00	361,743,600	0.65
30	資生堂	日本	化学	株式	42,400	6,635.30	281,336,772	7,824.00	331,737,600	0.59

## 東京海上・東証REITマザーファンド

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	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	464	596,028.23	276,557,098	647,000.00	300,208,000	7.13
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	479	563,355.96	269,847,504	591,000.00	283,089,000	6.72
3	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	投資証券	1,421	150,986.61	214,551,972	154,800.00	219,970,800	5.22
4	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	1,057	169,869.69	179,552,262	175,300.00	185,292,100	4.40
5	日本リテールファンド投資法人	日本	投資証券	906	208,196.25	188,625,802	201,000.00	182,106,000	4.32
6	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	955	169,926.05	162,279,377	173,400.00	165,597,000	3.93
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	600	264,666.78	158,800,068	257,600.00	154,560,000	3.67
8	日本プロロジスリート投資法人	日本	投資証券	643	234,322.51	150,669,373	216,500.00	139,209,500	3.30
9	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	467	279,898.48	130,712,590	283,700.00	132,487,900	3.14
10	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	303	386,745.75	117,183,962	402,000.00	121,806,000	2.89
11	GLP投資法人	日本	投資証券	1,060	118,112.70	125,199,462	111,300.00	117,978,000	2.80
12	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	1,388	80,999.50	112,427,306	84,200.00	116,869,600	2.77
13	アクティブ・プロパティーズ投資法人	日本	投資証券	230	481,948.88	110,848,244	489,000.00	112,470,000	2.67
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	148	686,105.87	101,543,668	690,000.00	102,120,000	2.42
15	積水ハウス・リート投資法人	日本	投資証券	1,237	72,378.73	89,532,489	72,100.00	89,187,700	2.11
16	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	1,678	48,939.76	82,120,917	48,150.00	80,795,700	1.91
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	159	495,815.28	78,834,629	505,000.00	80,295,000	1.90
18	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	550	140,229.74	77,126,357	140,700.00	77,385,000	1.83
19	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	111	641,358.49	71,190,793	677,000.00	75,147,000	1.78
20	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	163	449,071.26	73,198,617	447,500.00	72,942,500	1.73
21	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	320	212,246.05	67,918,736	211,300.00	67,616,000	1.60
22	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	559	120,626.60	67,430,269	116,000.00	64,844,000	1.54
23	ジャパンエクセレント投資法人	日本	投資証券	429	140,579.61	60,308,652	145,000.00	62,205,000	1.47
24	イオンリート投資法人	日本	投資証券	492	119,365.81	58,727,978	119,500.00	58,794,000	1.39
25	ヒューリックリート投資法人	日本	投資証券	346	167,136.54	57,829,246	163,300.00	56,501,800	1.34
26	森トラスト総合リート投資法人	日本	投資証券	343	161,798.90	55,497,024	162,300.00	55,668,900	1.32
27	日本リート投資法人	日本	投資証券	155	335,007.01	51,926,087	356,000.00	55,180,000	1.31

28	プレミア投資法人	日本	投資証券	456	113,183.03	51,611,461	113,500.00	51,756,000	1.22
29	東急リアル・エステート投資法人	日本	投資証券	321	146,135.13	46,909,376	153,800.00	49,369,800	1.17
30	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	284	161,947.82	45,993,180	171,600.00	48,734,400	1.15

## b. 投資有価証券の種類

## TMA日本債券インデックスマザーファンド

種類	投資比率(%)
国債証券	71.03
地方債証券	8.80
特殊債券	3.01
社債券	13.95
合計	96.80

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

種類	国内/国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.28
		建設業	2.74
		食料品	3.83
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.29
		化学	7.16
		医薬品	4.71
		石油・石炭製品	0.80
		ゴム製品	0.70
		ガラス・土石製品	0.85
		鉄鋼	1.04
		非鉄金属	0.77
		金属製品	0.61
		機械	4.88
		電気機器	13.20
		輸送用機器	8.18
		精密機器	1.67
		その他製品	2.04
		電気・ガス業	1.63
		陸運業	3.98
		海運業	0.18
		空運業	0.54
倉庫・運輸関連業	0.19		
情報・通信業	7.54		
卸売業	4.59		
小売業	4.60		
銀行業	6.60		

	証券、商品先物取引業	0.90
	保険業	2.20
	その他金融業	1.15
	不動産業	2.15
	サービス業	4.50
合 計		95.39

## 東京海上・東証REITマザーファンド

種類	投資比率(%)
投資証券	96.32
合 計	96.32

## 投資不動産物件

TMA日本債券インデックスマザーファンド  
該当事項はありません。

TMA日本株TOPIXマザーファンド  
該当事項はありません。

東京海上・東証REIT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日本債券インデックスマザーファンド  
該当事項はありません。

## 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	144	2,488,975,520.00	2,496,240,000	4.50

(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。

## 東京海上・東証REIT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REIT指数先物	買建	86	148,103,870.00	150,715,000	3.58

(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1計算期間末	(2018年 1月25日)	1	1	1.0294	1.0294
	2017年10月末日	1	-	1.0057	-
	11月末日	1	-	1.0139	-
	12月末日	1	-	1.0164	-



2018年 1月末日	1	-	1.0247	-
2月末日	1	-	1.0185	-
3月末日	1	-	1.0155	-
4月末日	1	-	1.0231	-
5月末日	1	-	1.0230	-
6月末日	1	-	1.0251	-
7月末日	2	-	1.0261	-
8月末日	2	-	1.0202	-

## 【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1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	2.9
第2中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	0.5

## (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1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	1,081,855		1,081,855
第2中間計算期間	2018年 1月26日～2018年 7月25日	1,072,895	27,712	2,127,038

## &lt; 参考情報 &gt;

基準日:2018年8月31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2017年10月11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1期	2018/01/25	0円
第2期	2019/01/25	
第3期	2020/01/27	
第4期	2021/01/25	
第5期	2022/01/25	
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

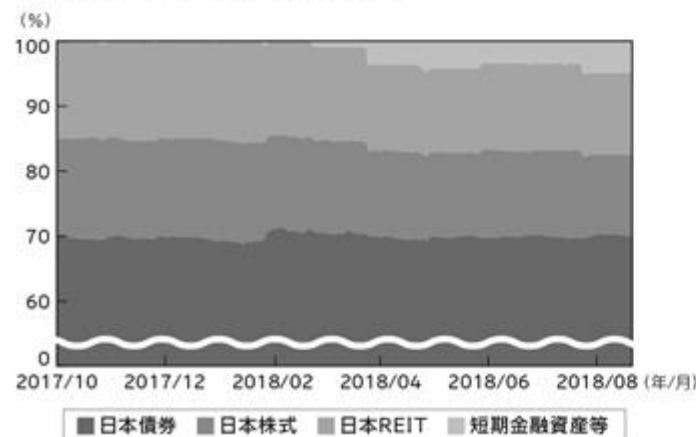
### 各マザーファンド組入比率、騰落率

ファンド名	比率	基本資産 配分	差	騰落率				
				1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
TMA日本債券インデックスマザーファンド	70.0%	70.0%	+0.0%	-0.54%	-0.61%	-0.27%	-0.02%	+4.56%
TMA日本株TOPIXマザーファンド	12.5%	15.0%	-2.5%	-1.01%	-0.49%	-0.66%	+9.60%	+20.25%
東京海上・東証REITマザーファンド	12.6%	15.0%	-2.4%	-0.32%	+2.32%	+5.12%	-	-
短期金融資産等	4.8%	-	+4.8%					

※比率は、純資産総額に占める割合です。

※短期金融資産等には未払金等が含まれるため、組入比率がマイナスとなる場合があります。

### 各マザーファンド組入比率の推移



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

### 各マザーファンドの組入上位銘柄

#### TMA日本債券インデックスマザーファンド

	銘柄名	クーポン	比率
1	第33回道路債券	2.910%	3.7%
2	第74回利付国債(20年)	2.100%	3.1%
3	第133回利付国債(20年)	1.800%	3.0%

#### TMA日本株TOPIXマザーファンド

	銘柄名	比率
1	トヨタ自動車	3.2%
2	三菱UFJフィナンシャル・グループ	1.8%
3	ソフトバンクグループ	1.8%

#### 東京海上・東証REITマザーファンド

	銘柄名	比率
1	日本ビルファンド投資法人	7.1%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	6.7%
3	野村不動産マスターファンド投資法人	5.2%

※比率は、各マザーファンドの純資産総額に占める割合です。

## 年間収益率の推移



※ファンドにはベンチマークがありません。

※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おり、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- a. 当ファンドの取得申込は、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・連合会等による購入の申込み、および「つみたてNISA（ニーサ）」をご利用の方による購入の申込み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. 毎営業日にお申込みを受け付けます。
- c. 申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の2種類のコースがあります。

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

- d. 販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、1口単位で取得することができます。
- e. 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。
- f. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。  
 取得申込受付日の基準価額  
 基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。  
 委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）  
 東京海上アセットマネジメント サービスデスク  
 0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）
- g. 取得申込にかかる手数料はありません。
- h. 上記にかかわらず、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。
- i. 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。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。
- j. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

### 2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の基準価額とします。  
 信託財産留保額はありませぬ。  
 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ぬ。

- 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、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および既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日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】

- a. 基準価額とは、受益権1口当たりの純資産価額（純資産総額を計算日における受益権総口数で除した金額）をいいます。ただし、便宜上1万口当たりに換算した価額で表示されることがあります。
- b. 純資産総額とは、信託財産に属する資産（受入担保金代用有価証券および借入有価証券を除きます。）を法令および一般社団法人投資信託協会規則にしたがって時価または一部償却原価法により評価して得た信託財産の資産総額から負債総額を控除した金額をいいます。なお、外貨建資産の円換算については、原則として日本における計算日の対顧客電信売買相場の仲値によって計算し、外国為替予約に基づく予約為替の評価は、原則として日本における計算日の対顧客先物売買相場の仲値によるものとします。

<主要投資対象資産の評価方法>

対象	評価方法
マザーファンド 受益証券	原則として、当ファンドの基準価額計算日の基準価額で評価します。
株式	原則として、上場されている取引所における計算日（外国株式の場合は、計算時に知り得る直近の日）の最終相場で評価します。
公社債等	原則として、以下のいずれかの価額で評価します。 a. 日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値） b. 金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（売気配相場を除く） c. 価格情報会社の提供する価額

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

原則として、2017年10月11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1月26日から翌年1月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（ ）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。  
（ ）法令により、これと異なる日を計算期間の末日と定めている場合には、法令にしたがいます。

#### (5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了さ

せることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。

- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議(以下「書面決議」といいます。)を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 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。
- g. 上記f.の規定にかかわらず、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、信託は、「信託約款の変更」b.の書面決議で否決された場合を除き、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。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- i. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、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、信託約款を変更することまたは信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款は「信託約款の変更」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあつては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあつてはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあつても、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### 関係会社との契約の更改等

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

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

## 4【受益者の権利等】

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

#### 収益分配金の請求権

収益分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日(原則として決算日から起算して5営業日まで)から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる計算期間の末日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とし、)に、お支払いします。ただし、受益者が収益分配金について、上記に規定する支払開始日から5年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は、委託会社に帰属します。なお、分配金再投資コースの収益分配金は、税金を差し引いた後、自動的に無手数料で再投資されますが、再投資により増加した受益権は、振替口座簿に記載または記録されます。

#### 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、)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

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は、投資信託約款第38条により、平成29年10月11日から平成30年1月25日までとなっております。
- (3) 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1期計算期間(平成29年10月11日から平成30年1月25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・円資産インデックスバランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第1期 [平成30年 1月25日現在]
<b>資産の部</b>	
流動資産	
親投資信託受益証券	1,113,656
未収入金	1,249
流動資産合計	1,114,905
資産合計	1,114,905
<b>負債の部</b>	
流動負債	
未払受託者報酬	88
未払委託者報酬	1,109
流動負債合計	1,197
負債合計	1,197
<b>純資産の部</b>	
元本等	
元本	1,081,855
剰余金	
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	31,853
（分配準備積立金）	29,686
元本等合計	1,113,708
純資産合計	1,113,708
負債純資産合計	1,114,905



## (2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	第1期 自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	30,883
<b>営業収益合計</b>	<b>30,883</b>
<b>営業費用</b>	
受託者報酬	88
委託者報酬	1,109
<b>営業費用合計</b>	<b>1,197</b>
営業利益又は営業損失（ ）	29,686
経常利益又は経常損失（ ）	29,686
当期純利益又は当期純損失（ ）	29,686
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（ ）	-
期首剰余金又は期首欠損金（ ）	-
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,167
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	2,167
剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
<b>分配金</b>	<b>1 -</b>
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	<b>31,853</b>

## (3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第1期 自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準 価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 [平成30年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	81,855円
期中一部解約元本額	円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	1,081,855口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25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 (5,225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(24,461円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,167円)及び分配 準備積立金(0円)より、分配対象額は31,853円(1万口当たり294.41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1期 自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25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。
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。

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>
-------------------	---

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 [平成30年 1月25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。
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 該当事項はありません。</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>
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。

（有価証券に関する注記）

第1期（自 平成29年10月11日 至 平成30年1月25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	30,329
合計	30,329

（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1期 [平成30年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.0294円
（1万口当たり純資産額	10,294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日本債券インデックスマザーファンド	604,754	768,037	
	TMA日本株TOPIXマザーファンド	114,443	170,977	
	東京海上・東証REITマザーファンド	160,827	174,642	
親投資信託受益証券 合計		880,024	1,113,656	
合計		880,024	1,113,656	

## 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日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「東京海上・東証REIT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日本債券インデックスマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

[平成30年 1月25日現在]		
区分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		20,609,901
国債証券		10,466,190,900
地方債証券		1,116,057,440
特殊債券		646,562,600
社債券		1,366,349,888
未収入金		918,660,900
未収利息		52,263,332
前払費用		499,065
流動資産合計		14,587,194,026
資産合計		14,587,194,026
負債の部		
流動負債		
未払解約金		694,111,708
未払利息		43

流動負債合計		694,111,751
負債合計		694,111,751
純資産の部		
元本等		
元本	1	10,939,745,639
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		2,953,336,636
元本等合計		13,893,082,275
純資産合計		13,893,082,275
負債純資産合計		14,587,194,026

## (2) 注記表

## (重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額(但し、売気配相場は使用しない)、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値(平均値)等で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成30年 1月25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	18,146,201,776円
同期中における追加設定元本額	1,256,583,435円
同期中における一部解約元本額	8,463,039,572円
同期末における元本額	10,939,745,639円
元本の内訳*	
L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)	35,201,940円
L P S 4 資産分散ファンド(安定重視型)	31,362,936円
L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)	42,831,728円
L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)	32,987,377円
L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	25,342,480円
東京海上セレクション・日本債券インデックス	947,304,991円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	77,879,303円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	604,754円
T M A 日本債券インデックスV A <適格機関投資家限定>	483,346,485円
T M A 世界バランスファンド55 V A <適格機関投資家限定>	33,796,689円
T M A 世界バランスファンド35 V A <適格機関投資家限定>	9,202,137,243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＞	4,628,596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＞	22,321,117円
計	10,939,745,639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	10,939,745,639口

（注）＊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

（金融商品に関する注記）

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25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。
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。
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。

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成30年 1月25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。
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。

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。
--------------------------------	---

(有価証券に関する注記)

(自平成29年10月11日 至平成30年1月25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
国債証券	50,355,300
地方債証券	4,801,480
特殊債券	2,479,400
社債券	5,101,537
合計	62,737,717

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(平成29年11月11日から平成30年1月25日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[平成30年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.2700円
(1万口当たり純資産額)	12,700円)

(3) 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
国債証券	第126回利付国債(5年)	50,000,000	50,282,500	
	第132回利付国債(5年)	200,000,000	201,630,000	
	第133回利付国債(5年)	100,000,000	100,862,000	
	第4回利付国債(40年)	45,000,000	62,152,650	
	第5回利付国債(40年)	40,000,000	53,084,000	
	第6回利付国債(40年)	65,000,000	84,494,150	
	第7回利付国債(40年)	65,000,000	80,607,800	
	第8回利付国債(40年)	30,000,000	34,366,200	
	第9回利付国債(40年)	10,000,000	8,229,900	
	第308回利付国債(10年)	10,000,000	10,336,500	
	第313回利付国債(10年)	30,000,000	31,316,700	
	第320回利付国債(10年)	50,000,000	52,117,500	
	第322回利付国債(10年)	150,000,000	156,133,500	
	第324回利付国債(10年)	50,000,000	51,937,500	

第327回利付国債(10年)	150,000,000	156,441,000	
第336回利付国債(10年)	40,000,000	41,434,800	
第340回利付国債(10年)	40,000,000	41,190,800	
第345回利付国債(10年)	200,000,000	200,884,000	
第346回利付国債(10年)	200,000,000	200,726,000	
第347回利付国債(10年)	200,000,000	200,746,000	
第3回利付国債(30年)	20,000,000	25,119,000	
第5回利付国債(30年)	10,000,000	12,567,400	
第9回利付国債(30年)	20,000,000	23,102,800	
第19回利付国債(30年)	60,000,000	78,343,200	
第21回利付国債(30年)	40,000,000	52,338,800	
第22回利付国債(30年)	10,000,000	13,448,700	
第25回利付国債(30年)	50,000,000	65,761,000	
第26回利付国債(30年)	30,000,000	40,025,100	
第28回利付国債(30年)	20,000,000	27,168,800	
第29回利付国債(30年)	60,000,000	80,725,200	
第30回利付国債(30年)	110,000,000	146,312,100	
第33回利付国債(30年)	40,000,000	51,213,600	
第35回利付国債(30年)	50,000,000	64,293,000	
第36回利付国債(30年)	40,000,000	51,534,800	
第38回利付国債(30年)	70,000,000	87,298,400	
第39回利付国債(30年)	20,000,000	25,420,400	
第42回利付国債(30年)	10,000,000	12,263,600	
第43回利付国債(30年)	50,000,000	61,342,000	
第44回利付国債(30年)	30,000,000	36,818,700	
第45回利付国債(30年)	30,000,000	35,391,000	
第46回利付国債(30年)	50,000,000	58,987,000	
第47回利付国債(30年)	50,000,000	60,272,500	
第48回利付国債(30年)	60,000,000	69,325,200	
第49回利付国債(30年)	140,000,000	161,735,000	
第50回利付国債(30年)	20,000,000	20,069,000	
第51回利付国債(30年)	120,000,000	105,025,200	
第56回利付国債(30年)	40,000,000	39,856,400	
第42回利付国債(20年)	260,000,000	268,080,800	
第43回利付国債(20年)	450,000,000	472,342,500	
第44回利付国債(20年)	350,000,000	369,565,000	
第45回利付国債(20年)	80,000,000	84,300,800	
第47回利付国債(20年)	310,000,000	328,987,500	
第49回利付国債(20年)	30,000,000	32,085,600	
第50回利付国債(20年)	80,000,000	85,056,800	
第51回利付国債(20年)	230,000,000	246,394,400	
第52回利付国債(20年)	140,000,000	151,208,400	
第53回利付国債(20年)	230,000,000	249,614,400	



第60回利付国債(20年)	20,000,000	21,453,200	
第62回利付国債(20年)	130,000,000	136,117,800	
第64回利付国債(20年)	170,000,000	188,859,800	
第66回利付国債(20年)	160,000,000	177,486,400	
第67回利付国債(20年)	150,000,000	167,953,500	
第69回利付国債(20年)	10,000,000	11,320,000	
第70回利付国債(20年)	140,000,000	161,828,800	
第71回利付国債(20年)	60,000,000	68,586,600	
第72回利付国債(20年)	100,000,000	114,135,000	
第74回利付国債(20年)	120,000,000	137,505,600	
第75回利付国債(20年)	230,000,000	264,564,400	
第76回利付国債(20年)	10,000,000	11,360,000	
第80回利付国債(20年)	40,000,000	46,206,400	
第82回利付国債(20年)	150,000,000	173,935,500	
第83回利付国債(20年)	100,000,000	116,432,000	
第84回利付国債(20年)	80,000,000	92,514,400	
第90回利付国債(20年)	250,000,000	296,500,000	
第99回利付国債(20年)	50,000,000	59,940,000	
第100回利付国債(20年)	110,000,000	133,381,600	
第105回利付国債(20年)	60,000,000	72,596,400	
第107回利付国債(20年)	50,000,000	60,675,000	
第112回利付国債(20年)	100,000,000	122,040,000	
第113回利付国債(20年)	20,000,000	24,476,000	
第115回利付国債(20年)	60,000,000	74,325,000	
第116回利付国債(20年)	50,000,000	62,070,000	
第118回利付国債(20年)	50,000,000	61,028,000	
第120回利付国債(20年)	50,000,000	58,604,000	
第123回利付国債(20年)	40,000,000	49,550,400	
第124回利付国債(20年)	60,000,000	73,571,400	
第127回利付国債(20年)	70,000,000	85,123,500	
第128回利付国債(20年)	40,000,000	48,708,000	
第131回利付国債(20年)	100,000,000	119,284,000	
第133回利付国債(20年)	50,000,000	60,403,500	
第135回利付国債(20年)	90,000,000	107,598,600	
第136回利付国債(20年)	80,000,000	94,552,800	
第141回利付国債(20年)	100,000,000	119,955,000	
第143回利付国債(20年)	30,000,000	35,569,500	
第145回利付国債(20年)	50,000,000	60,032,000	
第146回利付国債(20年)	50,000,000	60,098,500	
第148回利付国債(20年)	20,000,000	23,441,400	
第149回利付国債(20年)	90,000,000	105,551,100	
第150回利付国債(20年)	70,000,000	80,984,400	
第151回利付国債(20年)	70,000,000	78,673,000	

	第152回利付国債(20年)	90,000,000	101,060,100	
	第153回利付国債(20年)	90,000,000	102,501,900	
	第154回利付国債(20年)	50,000,000	56,083,000	
	第156回利付国債(20年)	30,000,000	29,476,500	
	第157回利付国債(20年)	100,000,000	94,470,000	
	第158回利付国債(20年)	70,000,000	69,643,700	
	第159回利付国債(20年)	70,000,000	70,719,600	
	第161回利付国債(20年)	80,000,000	80,418,400	
	第162回利付国債(20年)	130,000,000	130,457,600	
国債証券 合計		9,375,000,000	10,466,190,900	
地方債証券	第2回東京都公募公債(20年)	100,000,000	110,666,000	
	第10回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,510,000	
	第11回東京都公募公債(20年)	100,000,000	118,145,000	
	平成24年度第12回愛知県公募公債(30年)	100,000,000	126,786,000	
	平成25年度第4回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	104,156,000	
	平成21年度第1回千葉県公募公債	12,000,000	12,223,440	
	第75回共同発行市場公募地方債	100,000,000	102,268,000	
	平成22年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	102,996,000	
	第1回川崎市15年公募公債	100,000,000	102,881,000	
	第2回川崎市15年公募公債	100,000,000	103,833,000	
	第10回公営企業債券(20年)	100,000,000	113,593,000	
地方債証券 合計		1,012,000,000	1,116,057,440	
特殊債券	第344回政府保証道路債券	100,000,000	104,013,000	
	第6回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	105,932,000	
	第9回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	106,079,000	
	第43回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	120,220,000	
	第69回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	4,000,000	4,054,600	
	第87回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	102,432,000	
	第173回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	103,832,000	
特殊債券 合計		604,000,000	646,562,600	

社債券	第33回道路債券	100,000,000	136,229,000	
	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	52,052,000	54,853,959	
	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	55,939,000	58,839,437	
	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	53,599,000	56,384,004	
	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	54,835,000	57,749,480	
	第4回貸付債権担保住宅金融公庫債券	10,793,000	10,898,339	
	第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	45,162,000	46,686,669	
	第3回ヒューリック株式会社無担保社債	100,000,000	101,265,000	
	第1回日本生命2012基金特定目的会社特定社債	100,000,000	100,404,000	
	第5回住友生命基金流動化特定目的会社第1回特定社債	100,000,000	100,505,000	
	第36回住友商事株式会社無担保社債	200,000,000	206,174,000	
	第7回株式会社三菱東京UFJ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	103,678,000	
	第7回株式会社みずほ銀行無担保社債(劣後特約付)	100,000,000	120,009,000	
	第44回三井不動産株式会社無担保社債	100,000,000	103,419,000	
第6回東海旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	109,255,000		
社債券 合計		1,272,380,000	1,366,349,888	
合計		12,263,380,000	13,595,160,828	

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。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

[平成30年 1月25日現在]		
区 分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		1,963,723,426
株式	2	67,817,832,580
派生商品評価勘定		119,600
未収配当金		88,225,550
流動資産合計		69,869,901,156
資産合計		69,869,901,156
負債の部		

流動負債		
派生商品評価勘定		971,000
前受金		10,355,000
未払金		162,960
未払解約金		408,701,638
未払利息		4,190
流動負債合計		420,194,788
負債合計		420,194,788
純資産の部		
元本等		
元本	1	46,486,410,875
剰余金		
剰余金又は欠損金( )		22,963,295,493
元本等合計		69,449,706,368
純資産合計		69,449,706,368
負債純資産合計		69,869,901,156

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成30年 1月25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	38,302,515,293円
同期中における追加設定元本額	28,864,963,585円
同期中における一部解約元本額	20,681,068,003円
同期末における元本額	46,486,410,875円
元本の内訳*	
東京海上日本株TOPIXファンド	322,775,822円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	15,712,516,254円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	3,996,491円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	8,861,055円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	25,208,641円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	35,590,667円

L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	48,271,210円
東京海上・円資産インデックスバランス ファンド	114,443円
T M A 日本株式インデックスV A <適格機関投資家限定>	375,481,468円
T M A 世界バランスファンド55 V A <適格機関投資家限定>	10,290,083円
T M A 世界バランスファンド35 V A <適格機関投資家限定>	4,076,531,856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>	2,066,445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>	19,923,453円
東京海上・T O P I X インデックスファン ド<適格機関投資家限定>	25,844,782,987円
計	46,486,410,875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	46,486,410,875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  972,860,000円

(注1) \* は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(注2) 3. については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25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。
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。

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>
-------------------	---

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成30年 1月25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。
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>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

(自 平成29年10月11日 至 平成30年1月25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	6,830,427,167
合計	6,830,427,167

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(平成29年3月22日から平成30年1月25日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

## 株式関連

（平成30年1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,509,165,000		1,508,400,000	765,000
	東証株価指数先物	1,509,165,000		1,508,400,000	765,000
合計		1,509,165,000		1,508,400,000	765,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

[平成30年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.4940円
(1万口当たり純資産額)	14,940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	33,200	591.00	19,621,200	
マルハニチロ	4,900	3,280.00	16,072,000	
サカタのタネ	3,800	3,900.00	14,820,000	
ホクト	6,800	2,066.00	14,048,800	
国際石油開発帝石	137,800	1,523.00	209,869,400	
石油資源開発	5,100	3,270.00	16,677,000	
K & Oエナジーグループ	6,300	1,849.00	11,648,700	
ショーボンドホールディングス	2,600	8,610.00	22,386,000	
ミライト・ホールディングス	9,400	1,640.00	15,416,000	
安藤・間	19,900	927.00	18,447,300	
東急建設	11,600	1,155.00	13,398,000	
コムシスホールディングス	10,200	3,120.00	31,824,000	
ミサワホーム	11,600	988.00	11,460,800	
東建コーポレーション	1,000	13,450.00	13,450,000	
ヤマウラ	8,000	949.00	7,592,000	
大成建設	28,300	5,740.00	162,442,000	

大林組	85,100	1,390.00	118,289,000	
清水建設	87,200	1,171.00	102,111,200	
長谷工コーポレーション	32,500	1,843.00	59,897,500	
鹿島建設	124,000	1,136.00	140,864,000	
西松建設	6,200	3,170.00	19,654,000	
三井住友建設	21,600	633.00	13,672,800	
前田建設工業	20,200	1,559.00	31,491,800	
奥村組	4,400	4,790.00	21,076,000	
東鉄工業	3,800	3,640.00	13,832,000	
戸田建設	33,000	884.00	29,172,000	
熊谷組	4,100	3,140.00	12,874,000	
大東建託	10,200	20,560.00	209,712,000	
N I P P O	6,000	2,517.00	15,102,000	
前田道路	9,000	2,510.00	22,590,000	
東亜建設工業	4,100	3,075.00	12,607,500	
五洋建設	34,700	876.00	30,397,200	
住友林業	18,200	1,983.00	36,090,600	
日本基礎技術	20,500	412.00	8,446,000	
大和ハウス工業	83,400	4,574.00	381,471,600	
積水ハウス	91,700	2,156.50	197,751,050	
北陸電気工事	5,200	1,150.00	5,980,000	
西部電気工業	2,400	2,959.00	7,101,600	
中電工	4,400	3,210.00	14,124,000	
関電工	12,900	1,215.00	15,673,500	
きんでん	18,700	1,879.00	35,137,300	
日本電設工業	5,900	2,461.00	14,519,900	
協和エクシオ	10,300	2,883.00	29,694,900	
新日本空調	8,800	1,554.00	13,675,200	
九電工	5,600	5,670.00	31,752,000	
三機工業	10,100	1,266.00	12,786,600	
日揮	24,400	2,389.00	58,291,600	
中外炉工業	4,000	2,640.00	10,560,000	
ヤマト	11,000	843.00	9,273,000	
高砂熱学工業	8,100	2,108.00	17,074,800	
三晃金属工業	1,700	4,175.00	7,097,500	
大気社	3,700	3,835.00	14,189,500	
日比谷総合設備	5,800	2,377.00	13,786,600	
東芝プラントシステム	6,500	2,073.00	13,474,500	
東洋エンジニアリング	7,100	1,315.00	9,336,500	
千代田化工建設	19,200	946.00	18,163,200	
新興プランテック	14,000	1,146.00	16,044,000	
日本製粉	8,500	1,727.00	14,679,500	
日清製粉グループ本社	30,700	2,221.00	68,184,700	



鳥越製粉	9,900	994.00	9,840,600	
日本甜菜製糖	5,600	2,748.00	15,388,800	
三井製糖	2,500	4,775.00	11,937,500	
森永製菓	5,800	5,850.00	33,930,000	
江崎グリコ	7,000	5,620.00	39,340,000	
山崎製パン	20,400	2,211.00	45,104,400	
亀田製菓	2,200	5,450.00	11,990,000	
寿スピリッツ	2,300	6,500.00	14,950,000	
カルビー	11,800	3,860.00	45,548,000	
森永乳業	5,000	5,240.00	26,200,000	
ヤクルト本社	15,200	8,870.00	134,824,000	
明治ホールディングス	16,700	9,360.00	156,312,000	
雪印メグミルク	6,000	3,260.00	19,560,000	
プリマハム	17,000	744.00	12,648,000	
日本ハム	22,000	2,636.00	57,992,000	
丸大食品	17,000	502.00	8,534,000	
S Foods	3,100	4,750.00	14,725,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	17,400	1,017.00	17,695,800	
サッポロホールディングス	8,900	3,365.00	29,948,500	
アサヒグループホールディングス	52,900	5,772.00	305,338,800	
キリンホールディングス	121,700	2,830.00	344,411,000	
宝ホールディングス	20,700	1,406.00	29,104,200	
オエノンホールディングス	29,700	377.00	11,196,900	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールデ	18,000	4,230.00	76,140,000	
サントリー食品インターナショナル	19,500	5,270.00	102,765,000	
ダイドーグループホールディングス	2,000	6,120.00	12,240,000	
伊藤園	8,400	4,600.00	38,640,000	
キーコーヒー	6,500	2,180.00	14,170,000	
ユニカフェ	4,600	1,223.00	5,625,800	
ジャパンフーズ	7,500	1,594.00	11,955,000	
日清オイリオグループ	3,300	3,405.00	11,236,500	
不二製油グループ本社	7,100	3,320.00	23,572,000	
J - オイルミルズ	3,600	3,930.00	14,148,000	
キッコーマン	20,000	4,485.00	89,700,000	
味の素	58,800	2,084.50	122,568,600	
キューピー	14,200	2,964.00	42,088,800	
ハウス食品グループ本社	9,800	3,660.00	35,868,000	
カゴメ	9,900	4,115.00	40,738,500	
アリアケジャパン	2,300	9,290.00	21,367,000	
ニチレイ	12,300	2,981.00	36,666,300	
東洋水産	14,100	4,710.00	66,411,000	
日清食品ホールディングス	11,100	8,100.00	89,910,000	
フジッコ	4,500	2,550.00	11,475,000	

ロック・フィールド	6,900	2,272.00	15,676,800	
日本たばこ産業	156,800	3,673.00	575,926,400	
ユーグレナ	10,100	1,101.00	11,120,100	
片倉工業	8,400	1,478.00	12,415,200	
グンゼ	2,200	6,620.00	14,564,000	
東洋紡	10,100	2,062.00	20,826,200	
倉敷紡績	53,000	365.00	19,345,000	
日本毛織	11,200	1,177.00	13,182,400	
帝国繊維	6,000	2,483.00	14,898,000	
帝人	21,900	2,471.00	54,114,900	
東レ	192,400	1,103.50	212,313,400	
日本フェルト	20,500	559.00	11,459,500	
セーレン	6,100	2,293.00	13,987,300	
小松精練	15,000	946.00	14,190,000	
ワコールホールディングス	7,400	3,490.00	25,826,000	
ホギメディカル	1,500	8,280.00	12,420,000	
T S Iホールディングス	18,600	776.00	14,433,600	
三陽商会	5,100	2,181.00	11,123,100	
オンワードホールディングス	14,300	926.00	13,241,800	
デサント	8,400	1,958.00	16,447,200	
特種東海製紙	3,100	4,350.00	13,485,000	
王子ホールディングス	112,000	775.00	86,800,000	
日本製紙	11,600	2,084.00	24,174,400	
三菱製紙	15,900	727.00	11,559,300	
北越紀州製紙	18,300	739.00	13,523,700	
大王製紙	10,600	1,525.00	16,165,000	
レンゴー	24,500	899.00	22,025,500	
ザ・パック	3,600	3,930.00	14,148,000	
クラレ	44,600	2,058.00	91,786,800	
旭化成	164,700	1,472.50	242,520,750	
共和レザー	9,200	1,000.00	9,200,000	
昭和電工	17,800	5,180.00	92,204,000	
住友化学	194,000	832.00	161,408,000	
日産化学工業	15,500	4,520.00	70,060,000	
クレハ	2,100	7,900.00	16,590,000	
石原産業	5,100	2,082.00	10,618,200	
片倉コープアグリ	4,700	1,422.00	6,683,400	
日本曹達	17,000	771.00	13,107,000	
東ソー	38,700	2,485.00	96,169,500	
トクヤマ	7,700	3,560.00	27,412,000	
セントラル硝子	5,500	2,435.00	13,392,500	
東亜合成	15,900	1,419.00	22,562,100	
大阪ソーダ	4,200	2,833.00	11,898,600	

デンカ	9,800	4,415.00	43,267,000	
信越化学工業	44,000	12,510.00	550,440,000	
堺化学工業	4,600	3,090.00	14,214,000	
エア・ウォーター	21,800	2,425.00	52,865,000	
大陽日酸	20,400	1,732.00	35,332,800	
日本パーカライジング	13,700	1,995.00	27,331,500	
ステラ ケミファ	3,700	3,785.00	14,004,500	
日本触媒	4,100	7,800.00	31,980,000	
カネカ	36,000	1,021.00	36,756,000	
三菱瓦斯化学	22,200	3,135.00	69,597,000	
三井化学	24,300	3,480.00	84,564,000	
J S R	26,300	2,288.00	60,174,400	
東京応化工業	4,600	5,110.00	23,506,000	
三菱ケミカルホールディングス	177,500	1,202.00	213,355,000	
ダイセル	36,300	1,336.00	48,496,800	
住友ベークライト	21,000	968.00	20,328,000	
積水化学工業	55,200	2,257.00	124,586,400	
日本ゼオン	22,400	1,621.00	36,310,400	
アイカ工業	7,700	4,140.00	31,878,000	
宇部興産	13,500	3,285.00	44,347,500	
旭有機材	7,600	2,027.00	15,405,200	
日立化成	13,300	2,927.00	38,929,100	
タイガースポリマー	12,600	937.00	11,806,200	
ミライアル	3,600	2,413.00	8,686,800	
日本化薬	16,800	1,632.00	27,417,600	
A D E K A	11,800	1,919.00	22,644,200	
日油	10,600	2,970.00	31,482,000	
ハリマ化成グループ	8,900	920.00	8,188,000	
花王	62,000	7,686.00	476,532,000	
ニイタカ	3,000	1,847.00	5,541,000	
三洋化成工業	2,000	5,640.00	11,280,000	
日本ペイントホールディングス	20,600	3,870.00	79,722,000	
関西ペイント	28,200	2,798.00	78,903,600	
中国塗料	13,500	952.00	12,852,000	
太陽ホールディングス	2,500	5,380.00	13,450,000	
D I C	10,600	4,355.00	46,163,000	
サカタインクス	6,100	1,860.00	11,346,000	
東洋インキ S C ホールディングス	25,000	662.00	16,550,000	
富士フイルムホールディングス	52,500	4,647.00	243,967,500	
資生堂	46,800	5,816.00	272,188,800	
ライオン	35,700	2,092.00	74,684,400	
高砂香料工業	4,000	3,480.00	13,920,000	
マンダム	5,000	3,810.00	19,050,000	

ミルボン	2,900	3,825.00	11,092,500	
ファンケル	6,000	3,380.00	20,280,000	
コーセー	4,200	19,010.00	79,842,000	
コタ	5,700	1,849.00	10,539,300	
シーズ・ホールディングス	3,200	5,860.00	18,752,000	
ポーラ・オルビスホールディングス	10,800	4,450.00	48,060,000	
ノエビアホールディングス	1,400	8,910.00	12,474,000	
エステー	4,800	2,813.00	13,502,400	
長谷川香料	5,600	2,280.00	12,768,000	
小林製薬	7,000	7,440.00	52,080,000	
荒川化学工業	5,900	2,212.00	13,050,800	
メック	6,500	2,363.00	15,359,500	
タカラバイオ	7,500	1,830.00	13,725,000	
アース製薬	2,300	5,680.00	13,064,000	
大成ラミック	2,100	3,310.00	6,951,000	
クミアイ化学工業	21,900	717.00	15,702,300	
日本農薬	17,300	641.00	11,089,300	
日東電工	19,000	9,981.00	189,639,000	
レック	3,500	3,240.00	11,340,000	
前澤化成工業	6,100	1,230.00	7,503,000	
エフピコ	2,300	5,870.00	13,501,000	
天馬	5,100	2,262.00	11,536,200	
信越ポリマー	10,600	1,330.00	14,098,000	
ニフコ	4,600	7,690.00	35,374,000	
日本バルカー工業	4,600	3,255.00	14,973,000	
ユニ・チャーム	53,400	3,012.00	160,840,800	
協和発酵キリン	31,400	2,214.00	69,519,600	
武田薬品工業	92,900	6,545.00	608,030,500	
アステラス製薬	260,000	1,418.00	368,680,000	
大日本住友製薬	18,600	1,600.00	29,760,000	
塩野義製薬	36,200	6,237.00	225,779,400	
田辺三菱製薬	31,300	2,315.00	72,459,500	
あすか製薬	5,700	2,100.00	11,970,000	
日本新薬	6,500	7,790.00	50,635,000	
中外製薬	26,200	5,960.00	156,152,000	
科研製薬	4,400	5,900.00	25,960,000	
エーザイ	30,100	6,352.00	191,195,200	
ロート製薬	13,700	3,030.00	41,511,000	
小野薬品工業	59,600	2,708.00	161,396,800	
久光製薬	7,200	7,680.00	55,296,000	
持田製薬	1,800	8,500.00	15,300,000	
参天製薬	48,400	1,842.00	89,152,800	
ツムラ	8,900	3,760.00	33,464,000	

日医工	7,400	1,744.00	12,905,600	
キッセイ薬品工業	4,200	3,160.00	13,272,000	
生化学工業	6,800	1,713.00	11,648,400	
鳥居薬品	4,100	3,205.00	13,140,500	
JCRファーマ	2,500	5,530.00	13,825,000	
東和薬品	2,400	6,280.00	15,072,000	
沢井製薬	4,800	5,010.00	24,048,000	
ゼリア新薬工業	6,400	2,247.00	14,380,800	
第一三共	71,800	3,512.00	252,161,600	
キョーリン製薬ホールディングス	6,200	2,095.00	12,989,000	
大幸薬品	5,200	2,485.00	12,922,000	
大塚ホールディングス	52,600	4,909.00	258,213,400	
大正製薬ホールディングス	5,600	9,190.00	51,464,000	
ペプチドリーム	10,600	4,475.00	47,435,000	
昭和シェル石油	23,600	1,625.00	38,350,000	
ニチレキ	9,900	1,367.00	13,533,300	
出光興産	21,300	4,375.00	93,187,500	
JXTGホールディングス	403,100	770.50	310,588,550	
コスモエネルギーホールディングス	6,900	4,475.00	30,877,500	
横浜ゴム	14,600	2,816.00	41,113,600	
東洋ゴム工業	14,700	2,355.00	34,618,500	
ブリヂストン	89,200	5,449.00	486,050,800	
住友ゴム工業	26,600	2,177.00	57,908,200	
オカモト	9,000	1,232.00	11,088,000	
ニッタ	2,900	4,690.00	13,601,000	
住友理工	11,200	1,287.00	14,414,400	
バンドー化学	9,800	1,356.00	13,288,800	
日東紡績	3,800	3,305.00	12,559,000	
旭硝子	26,000	4,890.00	127,140,000	
日本山村硝子	41,000	189.00	7,749,000	
日本電気硝子	10,800	4,545.00	49,086,000	
住友大阪セメント	50,000	532.00	26,600,000	
太平洋セメント	16,100	4,860.00	78,246,000	
日本ヒューム	10,200	842.00	8,588,400	
東海カーボン	22,200	1,608.00	35,697,600	
東洋炭素	3,900	3,740.00	14,586,000	
TOTO	19,500	6,350.00	123,825,000	
日本碍子	30,700	2,238.00	68,706,600	
日本特殊陶業	21,100	2,953.00	62,308,300	
ニチアス	13,000	1,534.00	19,942,000	
ニチハ	3,600	4,955.00	17,838,000	
新日鐵住金	111,800	2,877.50	321,704,500	
神戸製鋼所	45,600	1,153.00	52,576,800	

合同製鐵	5,500	2,249.00	12,369,500	
ジェイ エフ イー ホールディングス	67,500	2,667.00	180,022,500	
日新製鋼	8,200	1,912.00	15,678,400	
東京製鐵	13,600	962.00	13,083,200	
共英製鋼	6,600	2,147.00	14,170,200	
大和工業	4,800	3,325.00	15,960,000	
大阪製鐵	4,000	2,376.00	9,504,000	
淀川製鋼所	3,800	3,360.00	12,768,000	
東洋鋼鈹	20,300	486.00	9,865,800	
丸一鋼管	8,600	3,305.00	28,423,000	
大同特殊鋼	4,200	6,780.00	28,476,000	
山陽特殊製鋼	4,500	2,826.00	12,717,000	
愛知製鋼	3,100	4,445.00	13,779,500	
日立金属	27,000	1,625.00	43,875,000	
大平洋金属	3,700	3,640.00	13,468,000	
新日本電工	31,300	515.00	16,119,500	
三菱製鋼	4,900	2,806.00	13,749,400	
シンニッタン	12,500	841.00	10,512,500	
日本軽金属ホールディングス	70,600	307.00	21,674,200	
三井金属鉱業	6,700	6,400.00	42,880,000	
東邦亜鉛	2,000	6,640.00	13,280,000	
三菱マテリアル	17,000	4,080.00	69,360,000	
住友金属鉱山	32,000	5,270.00	168,640,000	
DOWAホールディングス	6,000	4,665.00	27,990,000	
古河機械金属	4,300	2,520.00	10,836,000	
UACJ	4,200	2,926.00	12,289,200	
古河電気工業	8,300	6,240.00	51,792,000	
住友電気工業	93,100	1,902.50	177,122,750	
フジクラ	28,900	1,137.00	32,859,300	
タツタ電線	16,200	937.00	15,179,400	
リョービ	3,300	3,255.00	10,741,500	
アサヒホールディングス	6,200	2,241.00	13,894,200	
トーカロ	2,700	5,560.00	15,012,000	
SUMCO	23,200	3,125.00	72,500,000	
東洋製罐グループホールディングス	17,600	1,794.00	31,574,400	
コロナ	5,200	1,436.00	7,467,200	
横河ブリッジホールディングス	5,700	2,667.00	15,201,900	
駒井ハルテック	2,900	2,619.00	7,595,100	
三和ホールディングス	24,700	1,567.00	38,704,900	
文化シャッター	12,700	987.00	12,534,900	
三協立山	8,500	1,529.00	12,996,500	
LIXILグループ	37,200	3,220.00	119,784,000	
ノーリツ	5,800	2,161.00	12,533,800	

長府製作所	4,400	2,581.00	11,356,400	
リンナイ	4,500	10,370.00	46,665,000	
日東精工	16,600	676.00	11,221,600	
東プレ	4,400	3,375.00	14,850,000	
高周波熱錬	11,200	1,218.00	13,641,600	
パイオラックス	4,200	3,310.00	13,902,000	
日本発條	25,200	1,226.00	30,895,200	
三益半導体工業	5,500	2,253.00	12,391,500	
日本製鋼所	8,400	3,505.00	29,442,000	
三浦工業	11,100	3,185.00	35,353,500	
タクマ	9,000	1,473.00	13,257,000	
オークマ	3,000	7,640.00	22,920,000	
東芝機械	17,000	889.00	15,113,000	
アマダホールディングス	38,000	1,641.00	62,358,000	
アイダエンジニアリング	8,800	1,531.00	13,472,800	
富士機械製造	7,400	2,360.00	17,464,000	
牧野フライス製作所	11,000	1,214.00	13,354,000	
オーエスジー	11,500	2,840.00	32,660,000	
旭ダイヤモンド工業	12,400	1,372.00	17,012,800	
D M G 森精機	13,400	2,546.00	34,116,400	
ディスコ	3,400	26,330.00	89,522,000	
日東工器	3,100	3,015.00	9,346,500	
島精機製作所	2,900	7,810.00	22,649,000	
N C ホールディングス	3,600	817.00	2,941,200	
日阪製作所	14,700	1,154.00	16,963,800	
ナプテスコ	13,500	5,050.00	68,175,000	
S M C	7,900	54,550.00	430,945,000	
新川	7,600	1,641.00	12,471,600	
ユニオンツール	3,300	4,375.00	14,437,500	
オイレス工業	5,500	2,284.00	12,562,000	
サトーホールディングス	3,700	3,555.00	13,153,500	
小松製作所	121,800	4,194.00	510,829,200	
住友重機械工業	14,200	4,945.00	70,219,000	
日立建機	11,800	4,340.00	51,212,000	
巴工業	4,300	2,037.00	8,759,100	
井関農機	5,500	2,840.00	15,620,000	
タカキタ	7,700	1,208.00	9,301,600	
クボタ	135,700	2,265.50	307,428,350	
月島機械	7,800	1,407.00	10,974,600	
帝国電機製作所	11,500	1,503.00	17,284,500	
新東工業	11,400	1,446.00	16,484,400	
小森コーポレーション	7,800	1,556.00	12,136,800	
鶴見製作所	5,500	2,123.00	11,676,500	

住友精密工業	15,000	417.00	6,255,000	
荏原製作所	10,500	4,605.00	48,352,500	
西島製作所	10,000	1,173.00	11,730,000	
ダイキン工業	34,400	13,730.00	472,312,000	
栗田工業	13,600	3,690.00	50,184,000	
椿本チエイン	13,000	933.00	12,129,000	
ダイフク	12,800	7,410.00	94,848,000	
タダノ	12,800	1,885.00	24,128,000	
フジテック	8,300	1,513.00	12,557,900	
C K D	6,800	2,874.00	19,543,200	
平和	7,400	2,128.00	15,747,200	
S A N K Y O	6,300	3,455.00	21,766,500	
日本金銭機械	7,000	1,179.00	8,253,000	
福島工業	3,000	5,100.00	15,300,000	
竹内製作所	5,500	2,799.00	15,394,500	
アマノ	8,000	3,040.00	24,320,000	
グローリー	7,600	4,335.00	32,946,000	
大和冷機工業	10,100	1,449.00	14,634,900	
セガサミーホールディングス	25,800	1,453.00	37,487,400	
リケン	1,900	6,200.00	11,780,000	
ホシザキ	7,900	10,580.00	83,582,000	
大豊工業	6,200	1,679.00	10,409,800	
日本精工	52,500	1,832.00	96,180,000	
N T N	59,600	570.00	33,972,000	
ジェイテクト	26,700	1,969.00	52,572,300	
不二越	21,000	788.00	16,548,000	
日本トムソン	17,600	879.00	15,470,400	
T H K	15,500	4,575.00	70,912,500	
ユーシン精機	2,900	3,570.00	10,353,000	
キッツ	13,800	947.00	13,068,600	
マキタ	33,100	5,090.00	168,479,000	
日立造船	20,800	606.00	12,604,800	
三菱重工業	42,500	4,262.00	181,135,000	
I H I	19,700	3,845.00	75,746,500	
スター精密	6,200	2,265.00	14,043,000	
日清紡ホールディングス	15,000	1,570.00	23,550,000	
イビデン	15,400	1,706.00	26,272,400	
コニカミノルタ	59,500	1,094.00	65,093,000	
ブラザー工業	31,100	2,902.00	90,252,200	
ミネベアミツミ	47,300	2,477.00	117,162,100	
日立製作所	606,000	918.10	556,368,600	
三菱電機	252,500	2,049.50	517,498,750	
富士電機	76,000	894.00	67,944,000	



安川電機	29,400	5,800.00	170,520,000	
明電舎	26,000	461.00	11,986,000	
東芝テック	18,000	689.00	12,402,000	
マブチモーター	7,000	6,640.00	46,480,000	
日本電産	30,300	18,035.00	546,460,500	
東光高岳	4,100	1,940.00	7,954,000	
ダブル・スコープ	5,200	2,140.00	11,128,000	
ダイヘン	12,000	1,072.00	12,864,000	
日新電機	8,400	1,316.00	11,054,400	
オムロン	26,900	7,250.00	195,025,000	
日東工業	6,400	1,829.00	11,705,600	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	46,000	599.00	27,554,000	
メルコホールディングス	3,200	4,190.00	13,408,000	
テクノメディカ	1,900	1,958.00	3,720,200	
日本電気	32,900	3,160.00	103,964,000	
富士通	259,000	802.90	207,951,100	
沖電気工業	10,700	1,606.00	17,184,200	
サンケン電気	15,000	811.00	12,165,000	
アイホン	4,300	2,008.00	8,634,400	
ルネサスエレクトロニクス	13,100	1,298.00	17,003,800	
セイコーエプソン	37,900	2,695.00	102,140,500	
ワコム	23,700	640.00	15,168,000	
アルバック	4,100	7,640.00	31,324,000	
E I Z O	2,900	5,280.00	15,312,000	
日本信号	13,300	1,159.00	15,414,700	
能美防災	6,200	2,070.00	12,834,000	
ホーチキ	5,600	2,497.00	13,983,200	
パナソニック	288,500	1,679.00	484,391,500	
アンリツ	19,300	1,318.00	25,437,400	
富士通ゼネラル	8,000	2,355.00	18,840,000	
日立国際電気	5,000	3,115.00	15,575,000	
ソニー	168,600	5,249.00	884,981,400	
TDK	13,300	10,360.00	137,788,000	
アルプス電気	22,100	3,150.00	69,615,000	
バイオニア	55,900	238.00	13,304,200	
日本トリム	2,000	5,720.00	11,440,000	
フォスター電機	5,300	2,762.00	14,638,600	
ヨコオ	9,300	2,135.00	19,855,500	
ホシデン	8,000	1,805.00	14,440,000	
ヒロセ電機	4,100	16,970.00	69,577,000	
日本航空電子工業	6,000	1,859.00	11,154,000	
アルパイン	5,600	2,288.00	12,812,800	
アイコム	3,700	2,657.00	9,830,900	

船井電機	9,000	838.00	7,542,000	
横河電機	25,100	2,224.00	55,822,400	
アズビル	7,300	5,180.00	37,814,000	
日本光電工業	10,400	2,587.00	26,904,800	
堀場製作所	5,000	7,250.00	36,250,000	
アドバンテスト	13,400	2,274.00	30,471,600	
キーエンス	12,400	69,890.00	866,636,000	
日置電機	4,800	3,395.00	16,296,000	
シスメックス	19,600	9,160.00	179,536,000	
OBARA GROUP	2,000	7,800.00	15,600,000	
コーセル	8,200	1,875.00	15,375,000	
イリソ電子工業	2,200	7,080.00	15,576,000	
オプテックスグループ	2,500	7,000.00	17,500,000	
千代田インテグレ	4,000	2,605.00	10,420,000	
レーザーテック	5,200	3,910.00	20,332,000	
スタンレー電気	19,500	4,570.00	89,115,000	
ウシオ電機	15,500	1,684.00	26,102,000	
日本セラミック	4,200	3,055.00	12,831,000	
図研	5,900	1,914.00	11,292,600	
カシオ計算機	20,200	1,688.00	34,097,600	
ファナック	24,000	30,470.00	731,280,000	
ローム	11,400	12,360.00	140,904,000	
浜松ホトニクス	18,100	4,090.00	74,029,000	
三井ハイテック	5,400	2,075.00	11,205,000	
新光電気工業	12,900	938.00	12,100,200	
京セラ	41,500	7,432.00	308,428,000	
太陽誘電	11,200	1,885.00	21,112,000	
村田製作所	26,400	15,975.00	421,740,000	
双葉電子工業	5,000	2,388.00	11,940,000	
ニチコン	8,600	1,510.00	12,986,000	
日本ケミコン	3,000	3,710.00	11,130,000	
KOA	5,400	2,461.00	13,289,400	
小糸製作所	15,100	8,070.00	121,857,000	
ミツバ	6,600	1,615.00	10,659,000	
SCREENホールディングス	4,700	9,920.00	46,624,000	
キヤノン電子	5,600	2,479.00	13,882,400	
キヤノン	135,900	4,296.00	583,826,400	
リコー	77,100	1,108.00	85,426,800	
東京エレクトロン	16,800	22,285.00	374,388,000	
トヨタ紡織	7,200	2,414.00	17,380,800	
ユニプレス	4,600	3,035.00	13,961,000	
豊田自動織機	20,500	7,230.00	148,215,000	
モリタホールディングス	6,000	2,130.00	12,780,000	

デンソー	56,000	7,060.00	395,360,000	
東海理化電機製作所	6,200	2,394.00	14,842,800	
三井造船	8,600	1,972.00	16,959,200	
川崎重工業	19,800	4,500.00	89,100,000	
近畿車輛	2,200	3,125.00	6,875,000	
日産自動車	297,700	1,169.00	348,011,300	
いすゞ自動車	73,700	1,882.50	138,740,250	
トヨタ自動車	306,700	7,594.00	2,329,079,800	70,000株
日野自動車	35,500	1,478.00	52,469,000	
三菱自動車工業	94,100	886.00	83,372,600	
武蔵精密工業	3,800	3,615.00	13,737,000	
日産車体	10,900	1,162.00	12,665,800	
新明和工業	12,900	1,059.00	13,661,100	
極東開発工業	5,400	1,933.00	10,438,200	
日信工業	5,600	2,169.00	12,146,400	
トピー工業	3,500	3,450.00	12,075,000	
ティラド	2,800	3,925.00	10,990,000	
NOK	12,900	2,628.00	33,901,200	
フタバ産業	11,400	1,092.00	12,448,800	
KYB	2,600	6,920.00	17,992,000	
プレス工業	28,500	690.00	19,665,000	
ケーヒン	6,300	2,323.00	14,634,900	
アイシン精機	20,900	6,530.00	136,477,000	
マツダ	80,000	1,575.50	126,040,000	
今仙電機製作所	5,800	1,330.00	7,714,000	
本田技研工業	227,000	3,942.00	894,834,000	
スズキ	50,100	6,409.00	321,090,900	
SUBARU	78,000	3,681.00	287,118,000	
ヤマハ発動機	35,900	3,710.00	133,189,000	
ショーワ	9,000	1,411.00	12,699,000	
エクセディ	3,400	3,430.00	11,662,000	
豊田合成	8,500	2,929.00	24,896,500	
愛三工業	10,600	1,320.00	13,992,000	
ヨロズ	4,900	2,401.00	11,764,900	
エフ・シー・シー	4,400	2,939.00	12,931,600	
シマノ	10,200	16,010.00	163,302,000	
テイ・エス テック	5,900	4,890.00	28,851,000	
テルモ	38,700	5,430.00	210,141,000	
クリエートメディック	8,500	1,303.00	11,075,500	
島津製作所	30,600	2,793.00	85,465,800	
クボテック	4,400	582.00	2,560,800	
東京精密	4,700	4,790.00	22,513,000	
ニコン	44,500	2,243.00	99,813,500	

トプコン	13,200	2,685.00	35,442,000	
オリンパス	37,400	4,245.00	158,763,000	
理研計器	4,200	2,515.00	10,563,000	
タムロン	5,300	2,425.00	12,852,500	
HOYA	51,500	5,700.00	293,550,000	
シチズン時計	30,000	863.00	25,890,000	
セイコーホールディングス	4,100	3,195.00	13,099,500	
ニプロ	17,600	1,695.00	29,832,000	
パラマウントベッドホールディングス	2,800	5,650.00	15,820,000	
バンダイナムコホールディングス	26,400	3,650.00	96,360,000	
アイフィスジャパン	7,100	636.00	4,515,600	
パイロットコーポレーション	4,200	5,630.00	23,646,000	
トッパン・フォームズ	10,700	1,252.00	13,396,400	
フジシールインターナショナル	5,300	3,920.00	20,776,000	
タカラトミー	10,500	1,681.00	17,650,500	
タカノ	4,800	1,148.00	5,510,400	
大建工業	4,700	3,000.00	14,100,000	
凸版印刷	72,000	1,050.00	75,600,000	
大日本印刷	33,500	2,510.00	84,085,000	
NISSHA	5,300	2,946.00	15,613,800	
アシックス	25,500	1,843.00	46,996,500	
小松ウオール工業	4,800	2,459.00	11,803,200	
ヤマハ	17,200	4,635.00	79,722,000	
クリナップ	11,100	915.00	10,156,500	
ビジョン	15,000	4,435.00	66,525,000	
キングジム	8,400	1,009.00	8,475,600	
リンテック	5,700	3,170.00	18,069,000	
イトーキ	12,700	792.00	10,058,400	
任天堂	15,500	47,770.00	740,435,000	
三菱鉛筆	4,500	2,514.00	11,313,000	
タカラスタンダード	7,100	1,834.00	13,021,400	
コクヨ	12,100	2,091.00	25,301,100	
岡村製作所	10,000	1,548.00	15,480,000	
美津濃	4,000	3,290.00	13,160,000	
東京電力ホールディングス	199,100	458.00	91,187,800	
中部電力	77,200	1,403.00	108,311,600	
関西電力	102,300	1,407.50	143,987,250	
中国電力	34,900	1,242.00	43,345,800	
北陸電力	25,400	920.00	23,368,000	
東北電力	59,900	1,474.00	88,292,600	
四国電力	23,500	1,261.00	29,633,500	
九州電力	56,300	1,220.00	68,686,000	
北海道電力	24,800	732.00	18,153,600	

沖縄電力	4,700	2,817.00	13,239,900	
電源開発	20,000	3,165.00	63,300,000	
東京瓦斯	54,300	2,673.00	145,143,900	
大阪瓦斯	49,000	2,246.00	110,054,000	
東邦瓦斯	12,300	3,135.00	38,560,500	
北海道瓦斯	22,000	301.00	6,622,000	
西部瓦斯	4,500	2,885.00	12,982,500	
静岡ガス	15,400	996.00	15,338,400	
東武鉄道	27,300	3,800.00	103,740,000	
相鉄ホールディングス	7,600	3,060.00	23,256,000	
東京急行電鉄	68,900	1,904.00	131,185,600	
京浜急行電鉄	35,000	2,245.00	78,575,000	
小田急電鉄	38,000	2,495.00	94,810,000	
京王電鉄	14,200	5,320.00	75,544,000	
京成電鉄	17,300	3,860.00	66,778,000	
東日本旅客鉄道	45,200	11,505.00	520,026,000	
西日本旅客鉄道	22,800	8,614.00	196,399,200	
東海旅客鉄道	22,600	21,385.00	483,301,000	
西武ホールディングス	32,200	2,257.00	72,675,400	
西日本鉄道	6,600	3,150.00	20,790,000	
近鉄グループホールディングス	24,100	4,490.00	108,209,000	
阪急阪神ホールディングス	32,100	4,575.00	146,857,500	
南海電気鉄道	11,100	2,953.00	32,778,300	
京阪ホールディングス	10,800	3,565.00	38,502,000	
名古屋鉄道	18,700	2,954.00	55,239,800	
日本通運	9,300	7,710.00	71,703,000	
ヤマトホールディングス	42,400	2,653.50	112,508,400	
山九	6,200	4,825.00	29,915,000	
丸運	24,100	368.00	8,868,800	
センコーグループホールディングス	22,500	797.00	17,932,500	
トナミホールディングス	1,800	5,700.00	10,260,000	
ニッコンホールディングス	8,500	3,045.00	25,882,500	
日本石油輸送	1,700	3,880.00	6,596,000	
福山通運	3,200	4,225.00	13,520,000	
セイノーホールディングス	18,600	1,855.00	34,503,000	
日立物流	4,800	2,941.00	14,116,800	
C & F ロジホールディングス	7,200	1,642.00	11,822,400	
九州旅客鉄道	20,000	3,610.00	72,200,000	
日本郵船	20,100	2,894.00	58,169,400	
商船三井	15,100	3,945.00	59,569,500	
川崎汽船	10,700	2,950.00	31,565,000	
飯野海運	23,100	646.00	14,922,600	
日本航空	44,300	4,233.00	187,521,900	

A N Aホールディングス	46,600	4,579.00	213,381,400	
三菱倉庫	7,800	2,913.00	22,721,400	
三井倉庫ホールディングス	36,000	382.00	13,752,000	
住友倉庫	15,000	802.00	12,030,000	
東陽倉庫	30,400	341.00	10,366,400	
安田倉庫	8,300	999.00	8,291,700	
上組	15,100	2,463.00	37,191,300	
キムラユニティー	5,600	1,202.00	6,731,200	
キューソー流通システム	2,600	2,889.00	7,511,400	
近鉄エクスプレス	6,000	2,450.00	14,700,000	
エーアイテイナー	4,500	1,290.00	5,805,000	
N E C ネットエスアイ	4,000	3,015.00	12,060,000	
新日鉄住金ソリューションズ	4,500	3,165.00	14,242,500	
T I S	8,000	4,015.00	32,120,000	
ネオス	7,800	442.00	3,447,600	
電算システム	3,900	2,141.00	8,349,900	
グリー	17,200	708.00	12,177,600	
コーエーテクモホールディングス	5,300	2,480.00	13,144,000	
ヒト・コミュニケーションズ	2,600	2,243.00	5,831,800	
ブレインパッド	5,400	1,922.00	10,378,800	
K L a b	5,700	1,988.00	11,331,600	
ネクソン	28,000	3,725.00	104,300,000	
エイチーム	4,300	2,802.00	12,048,600	
コロブラ	9,700	985.00	9,554,500	
サイバーリンクス	4,200	1,353.00	5,682,600	
VOYAGE GROUP	5,500	1,463.00	8,046,500	
ティーガイア	5,200	2,714.00	14,112,800	
ガンホー・オンライン・ エンターテイメント	67,400	315.00	21,231,000	
GMOペイメントゲートウェイ	1,600	9,630.00	15,408,000	
ザッパラス	13,100	427.00	5,593,700	
インターネットイニシアティブ	5,700	2,281.00	13,001,700	
L I N E	7,000	4,920.00	34,440,000	
フェイス	4,000	1,347.00	5,388,000	
野村総合研究所	16,600	5,340.00	88,644,000	
C E ホールディングス	7,400	890.00	6,586,000	
インテージホールディングス	10,300	1,418.00	14,605,400	
フジ・メディア・ホールディングス	26,500	1,733.00	45,924,500	
オービック	7,700	8,680.00	66,836,000	
ヤフー	181,000	536.00	97,016,000	
トレンドマイクロ	12,200	6,070.00	74,054,000	
日本オラクル	4,000	8,940.00	35,760,000	
フューチャー	10,300	1,163.00	11,978,900	
C A C Holdings	9,500	1,111.00	10,554,500	

ソフトバンク・テクノロジー	4,800	2,070.00	9,936,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	5,300	4,920.00	26,076,000	
大塚商会	7,500	9,360.00	70,200,000	
サイボウズ	16,800	617.00	10,365,600	
電通国際情報サービス	3,500	2,823.00	9,880,500	
デジタルガレージ	4,700	3,625.00	17,037,500	
ウェザーニューズ	2,700	3,375.00	9,112,500	
日本エンタープライズ	25,300	241.00	6,097,300	
ネットワンシステムズ	10,100	1,693.00	17,099,300	
アルゴグラフィックス	4,000	3,595.00	14,380,000	
エイベックス	8,800	1,559.00	13,719,200	
日本ユニシス	7,400	2,374.00	17,567,600	
兼松エレクトロニクス	4,200	3,490.00	14,658,000	
東京放送ホールディングス	15,200	2,648.00	40,249,600	
日本テレビホールディングス	22,900	1,909.00	43,716,100	
テレビ朝日ホールディングス	6,100	2,246.00	13,700,600	
スカパーJ S A Tホールディングス	28,800	512.00	14,745,600	
テレビ東京ホールディングス	5,200	2,435.00	12,662,000	
日本電信電話	177,700	5,294.00	940,743,800	35,000株
K D D I	222,700	2,811.50	626,121,050	
光通信	3,000	16,200.00	48,600,000	
N T T ドコモ	183,400	2,749.50	504,258,300	
G M O インターネット	8,500	2,029.00	17,246,500	
カドカワ	8,200	1,407.00	11,537,400	
ゼンリン	3,400	4,230.00	14,382,000	
松竹	1,700	17,050.00	28,985,000	
東宝	16,200	3,775.00	61,155,000	
東映	1,000	11,600.00	11,600,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	77,800	1,332.00	103,629,600	
ビジネスブレイン太田昭和	4,200	1,713.00	7,194,600	
D T S	3,500	3,920.00	13,720,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	11,300	5,250.00	59,325,000	
カプコン	5,200	3,800.00	19,760,000	
S C S K	5,800	5,140.00	29,812,000	
アイネス	12,900	1,211.00	15,621,900	
T K C	2,700	4,110.00	11,097,000	
富士ソフト	3,700	3,765.00	13,930,500	
N S D	6,700	2,412.00	16,160,400	
コナミホールディングス	10,100	6,140.00	62,014,000	
ソフトバンクグループ	112,000	9,281.00	1,039,472,000	
伊藤忠食品	1,600	6,590.00	10,544,000	
エレマテック	5,000	2,662.00	13,310,000	
J A L U X	2,400	3,025.00	7,260,000	

双日	148,800	363.00	54,014,400	
アルフレッサ ホールディングス	28,100	2,714.00	76,263,400	
横浜冷凍	13,300	1,129.00	15,015,700	
あい ホールディングス	3,900	2,947.00	11,493,300	
マクニカ・富士エレホールディングス	5,900	2,511.00	14,814,900	
バイタルケーエスケー・ ホールディングス	13,400	991.00	13,279,400	
UKCホールディングス	5,600	2,333.00	13,064,800	
OCHIホールディングス	1,500	1,511.00	2,266,500	
TOKAIホールディングス	14,500	1,027.00	14,891,500	
シップヘルスケアホールディングス	5,500	3,625.00	19,937,500	
明治電機工業	3,300	1,949.00	6,431,700	
エコートレーディング	12,800	790.00	10,112,000	
ナガイレーベン	4,800	2,856.00	13,708,800	
三菱食品	3,400	3,260.00	11,084,000	
松田産業	7,800	1,999.00	15,592,200	
第一興商	3,700	5,920.00	21,904,000	
メディパルホールディングス	25,200	2,182.00	54,986,400	
アズワン	1,900	7,130.00	13,547,000	
尾家産業	1,900	1,428.00	2,713,200	
ドウシヤ	4,800	2,659.00	12,763,200	
丸文	7,600	1,125.00	8,550,000	
橋本総業ホールディングス	1,800	1,801.00	3,241,800	
日本ライフライン	6,700	2,812.00	18,840,400	
IDOM	15,900	773.00	12,290,700	
進和	3,600	2,519.00	9,068,400	
オーハシテクニカ	5,000	1,771.00	8,855,000	
白銅	3,500	2,605.00	9,117,500	
伊藤忠商事	182,500	2,229.50	406,883,750	
丸紅	205,200	845.10	173,414,520	
長瀬産業	15,000	2,033.00	30,495,000	
豊田通商	28,000	4,605.00	128,940,000	
兼松	11,400	1,545.00	17,613,000	
三井物産	211,300	1,961.50	414,464,950	
日本紙パルプ商事	3,500	4,390.00	15,365,000	
日立ハイテクノロジーズ	8,500	5,140.00	43,690,000	
山善	14,600	1,355.00	19,783,000	
住友商事	156,400	1,963.00	307,013,200	
内田洋行	3,400	3,375.00	11,475,000	
三菱商事	174,200	3,207.00	558,659,400	
キヤノンマーケティングジャパン	7,200	2,978.00	21,441,600	
西華産業	3,400	3,005.00	10,217,000	
菱洋エレクトロ	4,800	2,002.00	9,609,600	
東京産業	14,700	580.00	8,526,000	



阪和興業	4,700	5,420.00	25,474,000	
岩谷産業	5,500	3,845.00	21,147,500	
イワキ	15,000	520.00	7,800,000	
三愛石油	13,900	1,711.00	23,782,900	
稲畑産業	11,600	1,667.00	19,337,200	
ワキタ	10,200	1,350.00	13,770,000	
東邦ホールディングス	7,200	2,566.00	18,475,200	
サンゲツ	9,000	2,237.00	20,133,000	
シナネンホールディングス	4,000	2,714.00	10,856,000	
伊藤忠エネクス	8,900	1,082.00	9,629,800	
サンリオ	7,500	1,896.00	14,220,000	
リョーサン	3,500	4,370.00	15,295,000	
三信電気	6,500	2,065.00	13,422,500	
モスフードサービス	3,600	3,355.00	12,078,000	
加賀電子	3,800	3,005.00	11,419,000	
立花エレテック	6,900	2,148.00	14,821,200	
フォーバル	6,500	875.00	5,687,500	
PALTA C	3,300	5,010.00	16,533,000	
日鉄住金物産	2,600	6,600.00	17,160,000	
トラスコ中山	4,800	3,335.00	16,008,000	
オートバックスセブン	9,200	2,219.00	20,414,800	
加藤産業	3,600	4,005.00	14,418,000	
イノテック	7,900	1,092.00	8,626,800	
杉本商事	5,400	1,967.00	10,621,800	
因幡電機産業	3,200	5,230.00	16,736,000	
ミスミグループ本社	29,200	3,555.00	103,806,000	
スズケン	11,500	4,675.00	53,762,500	
ジェコス	10,200	1,347.00	13,739,400	
ローソン	6,500	7,230.00	46,995,000	
サンエー	2,500	5,530.00	13,825,000	
エービーシー・マート	4,300	7,140.00	30,702,000	
ハードオフコーポレーション	5,600	1,252.00	7,011,200	
アスクル	4,200	3,455.00	14,511,000	
ゲオホールディングス	5,500	2,200.00	12,100,000	
アダストリア	3,900	2,414.00	9,414,600	
ジーフット	7,000	804.00	5,628,000	
エディオン	15,200	1,387.00	21,082,400	
あみやき亭	2,100	5,360.00	11,256,000	
ハニーズホールディングス	8,600	1,157.00	9,950,200	
ジンス	2,200	4,810.00	10,582,000	
ビックカメラ	14,800	1,666.00	24,656,800	
DCMホールディングス	14,300	1,087.00	15,544,100	
Monotaro	9,000	3,835.00	34,515,000	

J . フロント リテイリング	29,400	2,025.00	59,535,000	
ドトール・日レスホールディングス	5,200	2,634.00	13,696,800	
マツモトキヨシホールディングス	10,100	4,640.00	46,864,000	
スタートトゥデイ	24,700	3,210.00	79,287,000	
ココカラファイン	2,500	6,880.00	17,200,000	
三越伊勢丹ホールディングス	46,300	1,308.00	60,560,400	
ウエルシアホールディングス	6,600	4,695.00	30,987,000	
クリエイトSDホールディングス	4,500	2,704.00	12,168,000	
シュッピン	5,800	1,489.00	8,636,200	
ジョイフル本田	4,000	3,555.00	14,220,000	
すかいらーく	15,400	1,590.00	24,486,000	
ユニテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	13,600	1,122.00	15,259,200	
ブックオフコーポレーション	8,500	844.00	7,174,000	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,900	1,184.00	6,985,600	
あさひ	5,900	1,394.00	8,224,600	
コスモス薬品	1,200	19,770.00	23,724,000	
トーエル	4,900	1,079.00	5,287,100	
セブン&アイ・ホールディングス	104,100	4,634.00	482,399,400	
ツルハホールディングス	5,000	15,390.00	76,950,000	
サンマルクホールディングス	4,600	3,120.00	14,352,000	
トリドールホールディングス	3,600	3,980.00	14,328,000	
クスリのアオキホールディングス	2,100	5,740.00	12,054,000	
カップ・クリエイト	9,100	1,264.00	11,502,400	
ライトオン	8,300	960.00	7,968,000	
良品計画	3,300	35,400.00	116,820,000	
三城ホールディングス	18,900	502.00	9,487,800	
アドヴァン	10,900	1,061.00	11,564,900	
G - 7ホールディングス	2,700	2,422.00	6,539,400	
エコス	5,600	1,282.00	7,179,200	
マルシェ	6,400	822.00	5,260,800	
ドンキホーテホールディングス	16,300	6,220.00	101,386,000	
西松屋チェーン	8,900	1,279.00	11,383,100	
ゼンショーホールディングス	13,100	1,965.00	25,741,500	
サイゼリヤ	3,600	3,335.00	12,006,000	
魚力	4,100	1,209.00	4,956,900	
ユニテッドアローズ	3,200	4,695.00	15,024,000	
ハイデイ日高	3,200	3,470.00	11,104,000	
京都きもの友禅	8,600	791.00	6,802,600	
コロナイド	8,200	2,241.00	18,376,200	
壱番屋	2,500	4,575.00	11,437,500	
スギホールディングス	5,600	5,880.00	32,928,000	
スクロール	14,700	536.00	7,879,200	

ユニー・ファミリーマート ホールディングス	7,900	7,440.00	58,776,000	
木曽路	4,400	2,708.00	11,915,200	
千趣会	17,400	601.00	10,457,400	
ケーヨー	17,100	678.00	11,593,800	
日本瓦斯	4,100	4,595.00	18,839,500	
ロイヤルホールディングス	4,800	3,015.00	14,472,000	
いなげや	6,900	1,815.00	12,523,500	
島忠	6,000	3,410.00	20,460,000	
チヨダ	3,400	2,807.00	9,543,800	
ライフコーポレーション	4,700	2,818.00	13,244,600	
AOKIホールディングス	8,800	1,629.00	14,335,200	
コメリ	4,400	3,380.00	14,872,000	
青山商事	4,600	4,285.00	19,711,000	
しまむら	2,800	12,330.00	34,524,000	
高島屋	39,000	1,151.00	44,889,000	
松屋	10,700	1,588.00	16,991,600	
エイチ・ツー・オー リテイリング	12,200	2,309.00	28,169,800	
パルコ	9,600	1,560.00	14,976,000	
丸井グループ	23,700	2,038.00	48,300,600	
アクシアル リテイリング	2,700	4,010.00	10,827,000	
イオン	95,500	1,899.00	181,354,500	
イズミ	4,600	7,060.00	32,476,000	
平和堂	5,600	2,421.00	13,557,600	
フジ	4,400	2,353.00	10,353,200	
ヤオコー	2,500	5,400.00	13,500,000	
ゼビオホールディングス	5,000	2,370.00	11,850,000	
ケーズホールディングス	9,900	3,215.00	31,828,500	
アインホールディングス	3,600	6,840.00	24,624,000	
ヤマダ電機	84,500	647.00	54,671,500	
ニトリホールディングス	9,800	17,730.00	173,754,000	
吉野家ホールディングス	8,700	1,941.00	16,886,700	
王将フードサービス	2,600	5,360.00	13,936,000	
ブレナス	5,000	2,186.00	10,930,000	
アークス	4,800	2,507.00	12,033,600	
バローホールディングス	5,500	2,620.00	14,410,000	
ファーストリテイリング	4,200	49,320.00	207,144,000	
サンドラッグ	10,900	4,800.00	52,320,000	
ヤマザワ	4,700	1,770.00	8,319,000	
ベルーナ	8,500	1,366.00	11,611,000	
めぶきフィナンシャルグループ	129,700	506.00	65,628,200	
東京TYフィナンシャルグループ	3,800	3,105.00	11,799,000	
九州フィナンシャルグループ	41,500	671.00	27,846,500	
ゆうちょ銀行	71,200	1,534.00	109,220,800	

コンコルディア・フィナンシャルグループ	151,900	664.00	100,861,600	
西日本フィナンシャルホールディングス	16,700	1,446.00	24,148,200	
新生銀行	21,700	1,939.00	42,076,300	
あおぞら銀行	14,600	4,485.00	65,481,000	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	1,758,500	853.30	1,500,528,050	300,000株
りそなホールディングス	274,100	694.30	190,307,630	
三井住友トラスト・ホールディングス	48,700	4,662.00	227,039,400	
三井住友フィナンシャルグループ	188,300	5,146.00	968,991,800	
第四銀行	2,500	5,240.00	13,100,000	
北越銀行	4,700	2,554.00	12,003,800	
千葉銀行	89,000	970.00	86,330,000	
群馬銀行	51,200	683.00	34,969,600	
武蔵野銀行	3,700	3,920.00	14,504,000	
千葉興業銀行	17,200	566.00	9,735,200	
七十七銀行	7,100	2,888.00	20,504,800	
青森銀行	2,900	3,555.00	10,309,500	
秋田銀行	3,900	3,030.00	11,817,000	
山形銀行	5,000	2,403.00	12,015,000	
岩手銀行	2,400	4,555.00	10,932,000	
東邦銀行	19,900	399.00	7,940,100	
東北銀行	4,600	1,503.00	6,913,800	
ふくおかフィナンシャルグループ	99,000	647.00	64,053,000	
静岡銀行	65,000	1,189.00	77,285,000	
十六銀行	3,400	3,190.00	10,846,000	
スルガ銀行	25,700	2,250.00	57,825,000	
八十二銀行	45,600	661.00	30,141,600	
山梨中央銀行	20,000	471.00	9,420,000	
大垣共立銀行	5,200	2,842.00	14,778,400	
福井銀行	4,100	2,659.00	10,901,900	
北國銀行	2,700	4,640.00	12,528,000	
滋賀銀行	21,000	604.00	12,684,000	
南都銀行	3,100	3,115.00	9,656,500	
百五銀行	23,100	554.00	12,797,400	
京都銀行	9,500	6,480.00	61,560,000	
紀陽銀行	8,900	1,846.00	16,429,400	
三重銀行	3,400	2,502.00	8,506,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	16,400	1,675.00	27,470,000	
広島銀行	37,400	931.00	34,819,400	
山陰合同銀行	14,000	1,111.00	15,554,000	
中国銀行	17,400	1,484.00	25,821,600	
鳥取銀行	4,200	1,845.00	7,749,000	
伊予銀行	35,700	925.00	33,022,500	
百十四銀行	24,000	385.00	9,240,000	

四国銀行	6,700	1,660.00	11,122,000	
阿波銀行	17,000	748.00	12,716,000	
大分銀行	2,700	4,325.00	11,677,500	
宮崎銀行	2,600	3,655.00	9,503,000	
佐賀銀行	3,500	2,596.00	9,086,000	
十八銀行	37,000	301.00	11,137,000	
沖縄銀行	2,600	4,370.00	11,362,000	
琉球銀行	6,600	1,729.00	11,411,400	
セブン銀行	94,800	414.00	39,247,200	
みずほフィナンシャルグループ	3,385,400	211.50	716,012,100	
山口フィナンシャルグループ	22,000	1,312.00	28,864,000	
長野銀行	3,900	1,932.00	7,534,800	
名古屋銀行	2,300	4,310.00	9,913,000	
北洋銀行	38,800	381.00	14,782,800	
第三銀行	3,800	1,768.00	6,718,400	
中京銀行	3,200	2,308.00	7,385,600	
愛媛銀行	8,200	1,382.00	11,332,400	
トマト銀行	4,900	1,564.00	7,663,600	
京葉銀行	24,000	520.00	12,480,000	
関西アーバン銀行	8,600	1,422.00	12,229,200	
栃木銀行	21,800	453.00	9,875,400	
トモニホールディングス	18,800	561.00	10,546,800	
フィデアホールディングス	56,800	202.00	11,473,600	
池田泉州ホールディングス	28,800	420.00	12,096,000	
F P G	10,000	1,577.00	15,770,000	
S B Iホールディングス	28,500	2,628.00	74,898,000	
ジャフコ	3,700	6,720.00	24,864,000	
大和証券グループ本社	212,000	799.10	169,409,200	
野村ホールディングス	449,900	733.70	330,091,630	
岡三証券グループ	20,000	811.00	16,220,000	
丸三証券	12,700	1,084.00	13,766,800	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	28,900	823.00	23,784,700	
水戸証券	33,600	457.00	15,355,200	
いちよし証券	11,700	1,477.00	17,280,900	
松井証券	14,700	1,017.00	14,949,900	
だいこう証券ビジネス	8,200	785.00	6,437,000	
マネックスグループ	59,000	353.00	20,827,000	
カブドットコム証券	42,200	399.00	16,837,800	
極東証券	8,200	1,745.00	14,309,000	
藍澤証券	10,700	798.00	8,538,600	
かんぽ生命保険	9,100	2,964.00	26,972,400	
S O M P Oホールディングス	48,500	4,713.00	228,580,500	

M S & A Dインシュアランスグループ ホールディングス	64,900	3,900.00	253,110,000	
ソニーフィナンシャルホールディングス	21,100	2,080.00	43,888,000	
第一生命ホールディングス	141,000	2,386.50	336,496,500	
東京海上ホールディングス	93,800	5,391.00	505,675,800	
T & Dホールディングス	77,300	1,995.00	154,213,500	
全国保証	6,700	5,300.00	35,510,000	
クレディセゾン	19,100	2,080.00	39,728,000	
芙蓉総合リース	2,900	7,910.00	22,939,000	
興銀リース	4,100	2,961.00	12,140,100	
東京センチュリー	5,000	6,050.00	30,250,000	
日本証券金融	18,500	663.00	12,265,500	
アイフル	42,900	404.00	17,331,600	
リコーリース	2,800	4,075.00	11,410,000	
イオンフィナンシャルサービス	17,500	2,807.00	49,122,500	
アコム	51,400	480.00	24,672,000	
オリエントコーポレーション	71,400	184.00	13,137,600	
日立キャピタル	7,000	3,080.00	21,560,000	
オリックス	165,900	2,166.00	359,339,400	
三菱UFJリース	62,900	730.00	45,917,000	
日本取引所グループ	72,600	2,082.00	151,153,200	
アサックス	1,300	1,923.00	2,499,900	
NECキャピタルソリューション	6,000	2,306.00	13,836,000	
いちご	33,300	470.00	15,651,000	
ヒューリック	51,400	1,336.00	68,670,400	
野村不動産ホールディングス	16,100	2,907.00	46,802,700	
オープンハウス	3,900	6,770.00	26,403,000	
東急不動産ホールディングス	61,200	885.00	54,162,000	
飯田グループホールディングス	20,900	2,260.00	47,234,000	
パーク24	13,700	2,767.00	37,907,900	
三井不動産	124,000	2,951.50	365,986,000	
三菱地所	185,300	2,210.50	409,605,650	
平和不動産	5,000	2,124.00	10,620,000	
東京建物	27,200	1,829.00	49,748,800	
ダイビル	6,500	1,453.00	9,444,500	
京阪神ビルディング	16,700	942.00	15,731,400	
住友不動産	60,000	4,348.00	260,880,000	
大京	6,000	2,290.00	13,740,000	
テーオーシー	11,600	982.00	11,391,200	
レオパレス21	30,300	881.00	26,694,300	
スターツコーポレーション	3,800	3,115.00	11,837,000	
空港施設	10,300	675.00	6,952,500	
ゴールドクレスト	4,700	2,470.00	11,609,000	
日本エスリード	3,800	2,549.00	9,686,200	

サンヨーハウジング名古屋	5,000	1,256.00	6,280,000	
イオンモール	16,500	2,462.00	40,623,000	
エヌ・ティ・ティ都市開発	16,000	1,431.00	22,896,000	
日本空港ビルデング	7,300	4,325.00	31,572,500	
日本M&Aセンター	8,400	6,500.00	54,600,000	
パソナグループ	6,400	2,300.00	14,720,000	
G C A	11,100	1,125.00	12,487,500	
エス・エム・エス	4,800	3,520.00	16,896,000	
パーソルホールディングス	22,100	2,806.00	62,012,600	
クックパッド	19,300	643.00	12,409,900	
学情	5,400	1,791.00	9,671,400	
スタジオアリス	4,400	2,813.00	12,377,200	
シミックホールディングス	6,900	2,165.00	14,938,500	
N J S	7,700	1,600.00	12,320,000	
総合警備保障	9,700	6,270.00	60,819,000	
カカコム	18,700	1,903.00	35,586,100	
アイロムグループ	5,100	1,900.00	9,690,000	
ディップ	4,100	3,380.00	13,858,000	
キャリアデザインセンター	3,300	2,403.00	7,929,900	
エムスリー	25,700	3,855.00	99,073,500	
アウトソーシング	7,200	2,150.00	15,480,000	
ディー・エヌ・エー	12,400	2,429.00	30,119,600	
博報堂D Yホールディングス	33,200	1,674.00	55,576,800	
ぐるなび	9,600	1,374.00	13,190,400	
ファンコミュニケーションズ	16,700	894.00	14,929,800	
W D Bホールディングス	3,300	3,920.00	12,936,000	
E P Sホールディングス	5,700	2,730.00	15,561,000	
クイック	6,500	1,729.00	11,238,500	
ケネディクス	33,200	740.00	24,568,000	
電通	29,600	5,150.00	152,440,000	
みらかホールディングス	7,200	4,975.00	35,820,000	
ダイオーズ	3,900	1,448.00	5,647,200	
日本空調サービス	11,900	825.00	9,817,500	
オリエンタルランド	28,600	10,960.00	313,456,000	
ダスキン	6,000	2,979.00	17,874,000	
ラウンドワン	6,700	2,031.00	13,607,700	
リゾートトラスト	10,700	2,669.00	28,558,300	
ビー・エム・エル	3,500	2,948.00	10,318,000	
りらいあコミュニケーションズ	10,000	1,318.00	13,180,000	
早稲田アカデミー	3,300	1,775.00	5,857,500	
ユー・エス・エス	29,700	2,531.00	75,170,700	
サイバーエージェント	16,000	4,420.00	70,720,000	
楽天	122,500	976.30	119,596,750	

テー・オー・ダブリュー	6,800	979.00	6,657,200	
テクノプロ・ホールディングス	4,000	6,170.00	24,680,000	
キャリアリンク	11,200	603.00	6,753,600	
ライドオンエクスプレス ホールディングス	6,000	1,043.00	6,258,000	
リクルートホールディングス	186,000	2,745.00	510,570,000	
エラン	6,400	1,643.00	10,515,200	
日本郵政	137,100	1,321.00	181,109,100	
リログループ	13,000	3,310.00	43,030,000	
エイチ・アイ・エス	3,900	4,060.00	15,834,000	
共立メンテナンス	4,400	4,675.00	20,570,000	
建設技術研究所	7,600	1,229.00	9,340,400	
よみうりランド	1,600	4,980.00	7,968,000	
東京都競馬	3,700	4,525.00	16,742,500	
カナモト	3,700	3,445.00	12,746,500	
東京ドーム	14,000	1,085.00	15,190,000	
トランス・コスモス	4,300	3,010.00	12,943,000	
乃村工藝社	5,600	2,431.00	13,613,600	
日本管財	6,700	2,061.00	13,808,700	
白洋舎	1,300	4,330.00	5,629,000	
セコム	25,500	8,685.00	221,467,500	
セントラル警備保障	6,100	2,665.00	16,256,500	
メイテック	2,900	6,020.00	17,458,000	
応用地質	8,800	1,454.00	12,795,200	
船井総研ホールディングス	5,100	2,631.00	13,418,100	
ベネッセホールディングス	9,000	4,250.00	38,250,000	
イオンディライト	3,300	4,060.00	13,398,000	
ニチイ学館	7,700	1,458.00	11,226,600	
ダイセキ	4,500	3,305.00	14,872,500	
ステップ	5,300	1,941.00	10,287,300	
合 計	30,439,000		67,817,832,580	

(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。

「東京海上・東証REITマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[平成30年 1月25日現在]
--	--	-----------------



区 分	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		32,771,308
投資証券		1,160,631,500
派生商品評価勘定		1,491,812
未収入金		5,903,500
未収配当金		4,229,849
差入委託証拠金		530,000
流動資産合計		1,205,557,969
資産合計		1,205,557,969
負債の部		
流動負債		
前受金		1,623,000
未払解約金		5,950,135
未払利息		69
流動負債合計		7,573,204
負債合計		7,573,204
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,103,187,856
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		94,796,909
元本等合計		1,197,984,765
純資産合計		1,197,984,765
負債純資産合計		1,205,557,969

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 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、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[平成30年 1月25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	300,160,000円
同期中における追加設定元本額	808,489,698円
同期中における一部解約元本額	5,461,842円
同期末における元本額	1,103,187,856円
元本の内訳*	
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	160,827円
東京海上・東証REITインデックスファンド<適格機関投資家限定>	1,103,027,029円
計	1,103,187,856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	1,103,187,856口

(注) \*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

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 平成29年10月11日 至 平成30年 1月25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。
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。
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。

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[平成30年 1月25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。

2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。  (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
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。

(有価証券に関する注記)

(自 平成29年10月11日 至 平成30年1月25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
投資証券	66,773,291
合計	66,773,291

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(平成29年10月11日から平成30年1月25日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(平成30年1月25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 東証REIT指数先物	33,397,000		34,890,000	1,493,000
	合計	33,397,000		34,890,000	1,493,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報に関する注記)

[平成30年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額	1.0859円
(1万口当たり純資産額)	10,859円)

## (3) 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
投資証券	日本アコモデーションファンド投資法人	48	23,784,000	
	MCUBS MidCity投資法人	146	11,680,000	
	森ヒルズリート投資法人	155	22,118,500	
	産業ファンド投資法人	39	19,812,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	134	37,922,000	
	ケネディクス・レジデンシャル投資法人	33	10,692,000	
	アクティブア・プロパティーズ投資法人	66	32,340,000	
	GLP投資法人	253	32,384,000	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	53	13,228,800	
	日本プロロジスリート投資法人	182	46,009,600	
	星野リゾート・リート投資法人	22	12,694,000	
	Oneリート投資法人	16	4,108,800	
	イオンリート投資法人	137	17,042,800	
	ヒューリックリート投資法人	98	16,758,000	
	日本リート投資法人	39	13,065,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	80	9,672,000	
	日本ヘルスケア投資法人	7	1,201,200	
	積水ハウス・リート投資法人	91	13,422,500	
	トーセイ・リート投資法人	23	2,569,100	
	ケネディクス商業リート投資法人	53	13,027,400	
	ヘルスケア & メディカル投資法人	18	1,980,000	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	25	2,367,500	
	ジャパン・シニアリビング投資法人	8	1,290,400	
	野村不動産マスターファンド投資法人	415	63,453,500	
いちごホテルリート投資法人	23	2,978,500		
ラサールロジポート投資法人	109	12,916,500		
スターアジア不動産投資法人	30	3,456,000		
マリモ地方創生リート投資法人	12	1,350,000		
三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	24	8,976,000		
大江戸温泉リート投資法人	24	2,100,000		

さくら総合リート投資法人	35	3,496,500	
投資法人みらい	19	3,583,400	
森トラスト・ホテルリート投資法人	31	4,622,100	
三菱地所物流リート投資法人	13	3,610,100	
日本ビルファンド投資法人	140	82,460,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	137	77,542,000	
日本リテールファンド投資法人	278	60,631,800	
オリックス不動産投資法人	279	48,043,800	
日本プライムリアルティ投資法人	92	35,650,000	
プレミアム投資法人	131	15,261,500	
東急リアル・エステート投資法人	97	14,084,400	
グローバル・ワン不動産投資法人	23	9,671,500	
ユナイテッド・アーバン投資法人	319	54,772,300	
森トラスト総合リート投資法人	104	17,264,000	
インヴィンシブル投資法人	397	20,326,400	
フロンティア不動産投資法人	49	22,417,500	
平和不動産リート投資法人	90	9,081,000	
日本ロジスティクスファンド投資法人	97	20,835,600	
福岡リート投資法人	70	12,719,000	
ケネディクス・オフィス投資法人	42	29,442,000	
積水ハウス・レジデンシャル投資法人	110	13,574,000	
いちごオフィスリート投資法人	112	9,206,400	
大和証券オフィス投資法人	31	19,127,000	
阪急リート投資法人	59	8,112,500	
スターツプロシード投資法人	23	3,820,300	
大和ハウスリート投資法人	149	40,289,600	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	418	34,443,200	
日本賃貸住宅投資法人	163	14,099,500	
ジャパンエクセレント投資法人	130	18,044,000	
投資証券 合計	6,001	1,160,631,500	
合計	6,001	1,160,631,500	

## 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。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」（昭和52年大蔵省令第38号）並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当中間計算期間（2018年1月26日から2018年7月25日まで）の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 中間財務諸表

## 【東京海上・円資産インデックスバランスファンド】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	-	75,988
親投資信託受益証券	1,113,656	2,102,460
未収入金	1,249	3,204
流動資産合計	1,114,905	2,181,652
資産合計	1,114,905	2,181,652
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払受託者報酬	88	176
未払委託者報酬	1,109	2,988
流動負債合計	1,197	3,164
負債合計	1,197	3,164
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1,081,855	1,212,038
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金（ ）	31,853	51,450
（分配準備積立金）	29,686	29,217
元本等合計	1,113,708	2,178,488
純資産合計	1,113,708	2,178,488
負債純資産合計	1,114,905	2,181,652

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
<b>営業収益</b>	
有価証券売買等損益	644
<b>営業収益合計</b>	<b>644</b>
<b>営業費用</b>	
受託者報酬	176
委託者報酬	2,988
<b>営業費用合計</b>	<b>3,164</b>
営業利益又は営業損失( )	2,520
経常利益又は経常損失( )	2,520
中間純利益又は中間純損失( )	2,520
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	2
期首剰余金又は期首欠損金( )	31,853
<b>剰余金増加額又は欠損金減少額</b>	<b>22,817</b>
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	22,817
剰余金減少額又は欠損金増加額	702
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	702
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-
<b>中間剰余金又は中間欠損金( )</b>	<b>51,450</b>

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	1,000,000円	1,081,855円
期中追加設定元本額	81,855円	1,072,895円
期中一部解約元本額	円	27,712円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の 総数	1,081,855口	2,127,038口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

当中間計算期間 自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
該当事項はありません。

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 2018年 1月25日現在	当中間計算期間末 2018年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左



3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左
----------------------------	---	----

## (1口当たり情報に関する注記)

前期 2018年 1月25日現在		当中間計算期間末 2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.0294円	1口当たり純資産額	1.0242円
(1万口当たり純資産額	10,294円)	(1万口当たり純資産額	10,242円)

## (ご参考)

当ファンドは、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「東京海上・東証REITマザーファンド」を主要な投資対象としており、中間貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

## 「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

		2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
区 分	注記 番号	金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		20,609,901	83,085,874
国債証券		10,466,190,900	3,751,780,050
地方債証券		1,116,057,440	318,113,600
特殊債券		646,562,600	109,054,600
社債券		1,366,349,888	707,296,909
未収入金		918,660,900	128,506,400
未収利息		52,263,332	16,486,685
前払費用		499,065	21,369
流動資産合計		14,587,194,026	5,114,345,487
資産合計		14,587,194,026	5,114,345,487
負債の部			
流動負債			
未払解約金		694,111,708	115,963,884
未払利息		43	231
流動負債合計		694,111,751	115,964,115
負債合計		694,111,751	115,964,115
純資産の部			

元本等			
元本	1	10,939,745,639	3,913,619,185
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		2,953,336,636	1,084,762,187
元本等合計		13,893,082,275	4,998,381,372
純資産合計		13,893,082,275	4,998,381,372
負債純資産合計		14,587,194,026	5,114,345,487

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 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、金融商品取引業者、銀行等の提示す る価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社 の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値 （平均値）等で評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年 1月25日現在	2018年 7月25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	18,146,201,776円	10,939,745,639円
同期中における追加設定元本額	1,256,583,435円	1,334,821,984円
同期中における一部解約元本額	8,463,039,572円	8,360,948,438円
同中間期末における元本額	10,939,745,639円	3,913,619,185円
元本の内訳*		
L P S 4 資産分散ファンド（慎重 型）	35,201,940円	39,543,627円
L P S 4 資産分散ファンド （安定重視型）	31,362,936円	30,834,197円
L P S 4 資産分散ファンド （バランス型）	42,831,728円	47,089,064円
L P S 4 資産分散ファンド （成長重視型）	32,987,377円	35,741,817円
L P S 4 資産分散ファンド（積極 型）	25,342,480円	27,741,571円
東京海上セレクション・日本債券 インデックス	947,304,991円	1,282,923,364円
東京海上・年金運用型戦略ファンド （年1回決算型）	77,879,303円	96,244,744円
東京海上・円資産インデックス バランスファンド	604,754円	1,191,052円
T M A 日本債券インデックスV A <適格機関投資家限定>	483,346,485円	237,941,363円
T M A 世界バランスファンド55V A <適格機関投資家限定>	33,796,689円	1,892,658円
T M A 世界バランスファンド35V A <適格機関投資家限定>	9,202,137,243円	2,031,696,599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>	4,628,596円	16,318,888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>	22,321,117円	64,460,241円
計	10,939,745,639円	3,913,619,185円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	10,939,745,639口	3,913,619,185口

(注) \*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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2018年 1月25日現在	2018年 7月25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

(1口当たり情報に関する注記)

2018年 1月25日現在		2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2700円	1口当たり純資産額	1.2772円
(1万口当たり純資産額)	12,700円)	(1万口当たり純資産額)	12,772円)

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			

コール・ローン		1,963,723,426	1,929,121,312
株式	2	67,817,832,580	51,853,182,170
派生商品評価勘定		119,600	23,621,600
未収入金			653,520
未収配当金		88,225,550	61,053,365
流動資産合計		69,869,901,156	53,867,631,967
資産合計		69,869,901,156	53,867,631,967
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		971,000	
前受金		10,355,000	19,055,000
未払金		162,960	
未払解約金		408,701,638	107,518,603
未払利息		4,190	5,384
流動負債合計		420,194,788	126,578,987
負債合計		420,194,788	126,578,987
純資産の部			
元本等			
元本	1	46,486,410,875	38,174,269,690
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		22,963,295,493	15,566,783,290
元本等合計		69,449,706,368	53,741,052,980
純資産合計		69,449,706,368	53,741,052,980
負債純資産合計		69,869,901,156	53,867,631,967

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年 1月25日現在	2018年 7月25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	38,302,515,293円	46,486,410,875円
同期中における追加設定元本額	28,864,963,585円	15,067,099,003円
同期中における一部解約元本額	20,681,068,003円	23,379,240,188円

同中間期末における元本額	46,486,410,875円	38,174,269,690円
元本の内訳*		
東京海上日本株TOPIXファンド	322,775,822円	313,483,848円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	15,712,516,254円	16,088,787,810円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	3,996,491円	4,688,594円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	8,861,055円	9,099,637円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	25,208,641円	28,949,622円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	35,590,667円	40,283,099円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	48,271,210円	55,200,437円
東京海上・円資産インデックス バランスファンド	114,443円	208,046円
TMA日本株式インデックスVA <適格機関投資家限定>	375,481,468円	210,463,517円
TMA世界バランスファンド55VA <適格機関投資家限定>	10,290,083円	571,564円
TMA世界バランスファンド35VA <適格機関投資家限定>	4,076,531,856円	927,367,500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>	2,066,445円	7,480,189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>	19,923,453円	59,085,102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>	25,844,782,987円	20,428,600,725円
計	46,486,410,875円	38,174,269,690円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	46,486,410,875口	38,174,269,690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 972,860,000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 895,780,000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)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2018年 1月25日現在	2018年 7月25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。	(1)有価証券 同左

	(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。	(2)デリバティブ取引 同左
	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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

（デリバティブ取引等に関する注記）  
取引の時価等に関する事項

株式関連

（2018年1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,509,165,000		1,508,400,000	765,000
	東証株価指数先物	1,509,165,000		1,508,400,000	765,000
	合計	1,509,165,000		1,508,400,000	765,000

（2018年7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,817,965,000		1,841,700,000	23,735,000
	東証株価指数先物	1,817,965,000		1,841,700,000	23,735,000

合計	1,817,965,000	1,841,700,000	23,735,000
----	---------------	---------------	------------

## (注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

## (1口当たり情報に関する注記)

2018年 1月25日現在		2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.4940円	1口当たり純資産額	1.4078円
(1万口当たり純資産額)	14,940円)	(1万口当たり純資産額)	14,078円)

## 「東京海上・東証REITマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		32,771,308	124,488,626
投資証券		1,160,631,500	2,889,644,840
派生商品評価勘定		1,491,812	2,255,000
未収入金		5,903,500	3,521,820
未収配当金		4,229,849	18,473,688
差入委託証拠金		530,000	3,116,000
流動資産合計		1,205,557,969	3,041,499,974
資産合計			
		1,205,557,969	3,041,499,974
負債の部			
流動負債			
前受金		1,623,000	1,886,000
未払解約金		5,950,135	3,509,298
未払利息		69	347
流動負債合計		7,573,204	5,395,645
負債合計			
		7,573,204	5,395,645
純資産の部			
元本等			
元本	1	1,103,187,856	2,742,172,147
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		94,796,909	293,932,182
元本等合計		1,197,984,765	3,036,104,329
純資産合計			
		1,197,984,765	3,036,104,329
負債純資産合計			
		1,205,557,969	3,041,499,974

## (2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2018年 1月26日 至 2018年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 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、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2018年 1月25日現在	2018年 7月25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	300,160,000円	1,103,187,856円
同期中における追加設定元本額	808,489,698円	1,793,355,747円
同期中における一部解約元本額	5,461,842円	154,371,456円
同中間期末における元本額	1,103,187,856円	2,742,172,147円
元本の内訳*		
東京海上・円資産インデックス バランスファンド	160,827円	260,443円
東京海上・東証REITインデック スファンド<適格機関投資家限定>	1,103,027,029円	2,741,911,704円
計	1,103,187,856円	2,742,172,147円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	1,103,187,856口	2,742,172,147口

(注)\*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

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2018年 1月25日現在	2018年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。  (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左



	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。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

（デリバティブ取引等に関する注記）  
取引の時価等に関する事項

株式関連

（2018年1月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	33,397,000		34,890,000	1,493,000
	東証REIT指数先物	33,397,000		34,890,000	1,493,000
合計		33,397,000		34,890,000	1,493,000

（2018年7月25日現在）

（単位：円）

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	140,794,000		143,049,000	2,255,000
	東証REIT指数先物	140,794,000		143,049,000	2,255,000
合計		140,794,000		143,049,000	2,255,000

（注）1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

2018年 1月25日現在		2018年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.0859円	1口当たり純資産額	1.1072円
(1万口当たり純資産額	10,859円)	(1万口当たり純資産額	11,072円)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2018年8月31日現在

種類	金額
資産総額	2,472,873 円
負債総額	5,151 円
純資産総額( - )	2,467,722 円
発行済数量	2,418,909 口
1 単位当たり純資産額( / )	1.0202 円

(ご参考：親投資信託の現況)

### TMA日本債券インデックスマザーファンド

2018年8月31日現在

種類	金額
資産総額	3,742,483,085 円
負債総額	135,207,912 円
純資産総額( - )	3,607,275,173 円
発行済数量	2,835,931,977 口
1 単位当たり純資産額( / )	1.2720 円

### TMA日本株TOPIXマザーファンド

2018年8月31日現在

種類	金額
資産総額	57,100,621,322 円
負債総額	1,720,479,716 円
純資産総額( - )	55,380,141,606 円
発行済数量	39,738,717,276 口
1 単位当たり純資産額( / )	1.3936 円

### 東京海上・東証REITマザーファンド

2018年8月31日現在

種類	金額
資産総額	4,214,830,504 円
負債総額	6,580,833 円
純資産総額( - )	4,208,249,671 円
発行済数量	3,784,069,388 口
1 単位当たり純資産額( / )	1.1121 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

行する場合を除き、無記名式受益証券から記名式受益証券への変更の請求、記名式受益証券から無記名式受益証券への変更の請求、受益証券の再発行の請求を行わないものとします。

1. 名義書換  
該当事項はありません。
2. 受益者に対する特典  
特典はありません。
3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。
4. 受益権の譲渡  
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。  
上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。  
上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認める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)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】

2018年8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。

2018年8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	176	2,539,898
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	0	0
合計	176	2,539,898

### 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33期事業年度(平成29年4月1日から平成30年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

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



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

## (3) 【株主資本等変動計算書】

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

（単位：千円）

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

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

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

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

（単位：千円）

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

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

## 注記事項

## 重要な会計方針

## 第33期

自 平成29年4月1日

至 平成30年3月31日

## 1. 有価証券の評価基準及び評価方法

(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

移動平均法による原価法

(2) その他有価証券

時価のあるもの

決算日の市場価格等に基づく時価法

（評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定）

時価を把握することが極めて困難と認められるもの  
移動平均法による原価法

## 2. 固定資産の減価償却の方法

### (1) 有形固定資産(リース資産を除く)

定率法を採用しております。ただし、平成28年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として3年間で均等償却する方法を採用しております。

### (2) リース資産

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

## 3. 引当金の計上基準

### (1) 賞与引当金

従業員賞与との支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

### (2) 退職給付引当金

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

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

### (3) 役員退職慰労引当金

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

## 4. 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

### (未適用の会計基準等)

#### 第33期

自 平成29年4月1日  
至 平成30年3月31日

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

### (1) 概要

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

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

### (2) 適用予定日

平成34年3月期の期首より適用予定であります。

### (3) 当該会計基準等の適用による影響

影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

### (貸借対照表関係)

第32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30年3月31日現在
----------------------	----------------------

* 1 . 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。	* 1 . 有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。												
<table> <tr><td>建物</td><td>20,366千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>453,412千円</td></tr> <tr><td>リース資産</td><td>2,612千円</td></tr> </table>	建物	20,366千円	器具備品	453,412千円	リース資産	2,612千円	<table> <tr><td>建物</td><td>51,080千円</td></tr> <tr><td>器具備品</td><td>424,930千円</td></tr> <tr><td>リース資産</td><td>3,395千円</td></tr> </table>	建物	51,080千円	器具備品	424,930千円	リース資産	3,395千円
建物	20,366千円												
器具備品	453,412千円												
リース資産	2,612千円												
建物	51,080千円												
器具備品	424,930千円												
リース資産	3,395千円												

## (損益計算書関係)

<p style="text-align: center;">第32期</p> <p style="text-align: center;">自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日</p>	<p style="text-align: center;">第33期</p> <p style="text-align: center;">自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日</p>								
* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。	* 1 . 関係会社との主な取引高は次のとおりであります。								
<table> <tr><td>関係会社からの受取配当金</td><td>45,377千円</td></tr> <tr><td>関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配</td><td>77,298千円</td></tr> </table>	関係会社からの受取配当金	45,377千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	77,298千円	<table> <tr><td>関係会社からの受取配当金</td><td>104,224千円</td></tr> <tr><td>関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配</td><td>50,146千円</td></tr> </table>	関係会社からの受取配当金	104,224千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	50,146千円
関係会社からの受取配当金	45,377千円								
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	77,298千円								
関係会社からの受取配当金	104,224千円								
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配	50,146千円								

## (株主資本等変動計算書関係)

第32期(自 平成28年 4月 1日 至 平成29年 3月31日)

## 1 . 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	平成28年 4月 1日 現在	増加	減少	平成29年 3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

## 2 . 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成28年 6月28日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	791,278千円
(ロ) 1株当たり配当額	20,660円
(ハ) 基準日	平成28年 3月31日
(ニ) 効力発生日	平成28年 6月28日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成29年 6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

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

第33期(自 平成29年 4月 1日 至 平成30年 3月31日)

## 1 . 発行済株式に関する事項

(単位:株)

株式の種類	平成29年 4月 1日 現在	増加	減少	平成30年 3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

## 2 . 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

平成29年 6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	1,784,014千円
------------	-------------

(口) 1株当たり配当額	46,580円
(ハ) 基準日	平成29年3月31日
(二) 効力発生日	平成29年6月30日

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
平成30年6月29日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。

・普通株式の配当に関する事項

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

(リース取引関係)

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

1. リース資産の内容

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

2. リース資産の減価償却の方法

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

第33期（自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日）

所有権移転外ファイナンス・リース取引

1. リース資産の内容

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

2. リース資産の減価償却の方法

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

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	第33期 自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。	(1) 金融商品に対する取組方針 同左
(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。  営業債務である未払金は、ほとんど1年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。	(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左
(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。	(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左

<p>市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回収できず当社が損失を被るリスクが存在しますが、過去の回収実績からリスクは僅少であると判断しております。</p> <p>投資有価証券については、管理部門において定期的に時価を把握する体制としております。</p> <p>流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動性リスクを管理しております。</p>	<p>市場リスク 同左</p> <p>流動性リスク 同左</p>
--	--

## 2. 金融商品の時価等に関する事項

第32期（平成29年3月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1)現金・預金	13,325,797	13,325,797	-
(2)未収委託者報酬	1,578,384	1,578,384	-
(3)未収収益	2,534,825	2,534,825	-
(4)未収入金	1,207	1,207	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	54,270	54,270	-
(6)預り金	(41,371)	(41,371)	-
(7)未払金	(1,958,922)	(1,958,922)	-
(8)未払費用	(445,613)	(445,613)	-
(9)未払消費税等	(108,541)	(108,541)	-
(10)未払法人税等	(735,000)	(735,000)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

第33期（平成30年3月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1)現金・預金	16,828,496	16,828,496	-
(2)未収委託者報酬	1,524,731	1,524,731	-
(3)未収収益	2,530,730	2,530,730	-
(4)未収入金	1,919	1,919	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	43,545	43,545	-
(6)預り金	(43,264)	(43,264)	-
(7)未払金	(2,563,951)	(2,563,951)	-
(8)未払費用	(530,106)	(530,106)	-
(9)未払消費税等	(262,100)	(262,100)	-
(10)未払法人税等	(960,000)	(960,000)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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

第32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30年3月31日現在
(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金、(6) 預り金、(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等	(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金、(6) 預り金、(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等

これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。	同左
(5) 投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1. 有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(5) 投資有価証券 同左

## (注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第32期 平成29年3月31日現在		第33期 平成30年3月31日現在	
以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。		以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。	
(単位：千円)		(単位：千円)	
	貸借対照表計上額		貸借対照表計上額
子会社株式	1,639,743	子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747	関連会社株式	32,747
その他の関係会社 有価証券	31,200	その他の関係会社 有価証券	31,200
敷金	450,632	敷金	450,632
その他長期差入保証金	20,912	その他長期差入保証金	10,865

## (注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

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

## (注4) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

第32期(平成29年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	13,325,573	-	-	-
未収委託者報酬	1,578,384	-	-	-
未収収益	2,534,825	-	-	-
未収入金	1,207	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	6,000	21,783	6,000	-
合計	17,445,990	21,783	6,000	-

第33期(平成30年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	16,827,976	-	-	-
未収委託者報酬	1,524,731	-	-	-
未収収益	2,530,730	-	-	-
未収入金	1,919	-	-	-

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

## (有価証券関係)

第32期 平成29年3月31日現在	第33期 平成30年3月31日現在																																
<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 子会社株式1,639,743千円、関連会社株式32,747千円）並びにその他の関係会社有価証券（貸借対照表計上額 31,200千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p>	<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式（貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円）並びにその他の関係会社有価証券（貸借対照表計上額 31,200千円）は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p>																																
<p>2. その他有価証券 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託</td> <td>33,725</td> <td>27,289</td> <td>6,435</td> </tr> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託</td> <td>20,545</td> <td>24,081</td> <td>3,536</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>54,270</td> <td>51,371</td> <td>2,899</td> </tr> </tbody> </table>	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	33,725	27,289	6,435	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	20,545	24,081	3,536	合計	54,270	51,371	2,899	<p>2. その他有価証券 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託</td> <td>27,151</td> <td>21,652</td> <td>5,498</td> </tr> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託</td> <td>16,394</td> <td>18,178</td> <td>1,783</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>43,545</td> <td>39,831</td> <td>3,714</td> </tr> </tbody> </table>	区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額	貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	27,151	21,652	5,498	貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	16,394	18,178	1,783	合計	43,545	39,831	3,714
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額																														
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	33,725	27,289	6,435																														
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	20,545	24,081	3,536																														
合計	54,270	51,371	2,899																														
区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額																														
貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	27,151	21,652	5,498																														
貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	16,394	18,178	1,783																														
合計	43,545	39,831	3,714																														
<p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。</p>	<p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左</p>																																

## (退職給付関係)

<p>1. 採用している退職給付制度の概要</p> <p>当社は、従業員の退職給付に備えるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出年金制度を採用しております。</p> <p>退職一時金制度（非積立型制度であります。）では、当社従業員を制度対象として、給与と勤続年数に基づき算出した一時金を支給しております。受入出向者については退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。貸借対照表上は出向期間3年以下の出向者に係る金額が退職給付引当金に、出向期間3年超の出向者に係る金額がその他未払金にそれぞれ含まれております。</p> <p>なお、当社が有する退職一時金制度は、簡便法により退職給付引当金及び退職給付費用を計算しております。</p>
<p>2. 確定給付制度</p>



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

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

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

	第32期		第33期	
	平成29年 3月31日現在		平成30年 3月31日現在	
積立型制度の退職給付債務		-		-
年金資産		-		-
		-		-
非積立型制度の退職給付債務		393,213千円		386,552千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		393,213千円		386,552千円
退職給付引当金		393,213千円		386,552千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額		393,213千円		386,552千円

## (3) 退職給付費用

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

## 3. 確定拠出制度

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

## (税効果会計関係)

## 1. 繰延税金資産及び繰延税金負債の発生 of 主な原因別の内訳

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

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

2. 法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との差異の原因となった主な項目別の内訳

第32期 (平成29年3月31日現在)	第33期 (平成30年3月31日現在)
法定実効税率と税効果会計適用後の法人税等の負担率との間の差異が法定実効税率の100分の5以下であるため注記を省略しております。	同左

(セグメント情報等)

第32期 自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日	第33期 自 平成29年4月1日 至 平成30年3月31日
<p>[セグメント情報]</p> <p>当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。</p> <p>当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。</p>	<p>[セグメント情報]</p> <p>同左</p>

[関連情報]	[関連情報]
<p>1. 製品及びサービスごとの情報 単一のサービス区分の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。 (2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 当社は、外部顧客からの収益のうち、損益計算書の営業収益の10%以上を占める相手先がないため、記載を省略しております。</p>	<p>1. 製品及びサービスごとの情報 同左</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 同左 (2) 有形固定資産 同左</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型） (2) 委託者報酬 2,915,606千円 (3) 関連するセグメント名 投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント</p>

## (関連当事者情報)

第32期（自 平成28年4月1日 至 平成29年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

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

## (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
関連会社	TOKIO MARINE ROGGE ASSET MANAGEMENT LIMITED	英国・ ロンドン	GBP 300千	投資運用業 投資助言業	(所有) 直接50%	運用の 再委任	委託 調査費 の支払	917,507	未払金	200,874
						役員 の 派遣			未払費用	14,636

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

\* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

## (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称 又は氏名	所在地	資本金 又は 出資金	事業の 内容 又は 職業	議決権の 所有 割合	関連当 事者との 関係	取引の 内容	取引金額 (千円)	科目	期末残高 (千円)
----	----------------	-----	------------------	-----------------------	------------------	-------------------	-----------	--------------	----	--------------

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

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

\* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

### (1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所に上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

第33期(自平成29年4月1日至平成30年3月31日)

### 1. 関連当事者との取引

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

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等重要な取引はありません。

(3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等

種類	会社等の名称又は氏名	所在地	資本金又は出資金	事業の内容又は職業	議決権の所有割合	関連当事者との関係	取引の内容	取引金額(千円)	科目	期末残高(千円)
同一の親会社をもつ会社	東京海上日動火災保険株式会社	東京都千代田区	101,994,694千円	損害保険業	なし	運用の一任	運用受託報酬の受取	1,518,481	未収収益	386,279
						役員の兼任				
同一の親会社をもつ会社	Delphi Capital Management, Inc.	米国・ニューヨーク	USD 1千	資産運用業	なし	運用の再委託	委託調査費の支払	936,716	未払金	288,919

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

\* 取引金額には、消費税等は含まれておりません。

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

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

### (1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社(東京証券取引所に上場)

### (2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

## ( 1 株当たり情報 )

第32期 ( 自 平成28年 4 月 1 日 至 平成29年 3 月31日 )	
1 株当たり純資産額	440,915円03銭
1 株当たり当期純利益金額	82,325円02銭
なお、潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	16,887,045千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	16,887,045千円
1 株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	3,153,048千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	3,153,048千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第33期 ( 自 平成29年 4 月 1 日 至 平成30年 3 月31日 )	
1 株当たり純資産額	504,352円83銭
1 株当たり当期純利益金額	110,003円02銭
なお、潜在株式調整後 1 株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1 株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	19,316,713千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	19,316,713千円
1 株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1 株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	4,213,116千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	4,213,116千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

通常取引の条件と異なる条件であって取引の公正を害するおそれのある条件で、委託会社の親法人等(委託会社の総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下において同じ。)又は子法人等(委託会社が総株主等の議決権の過半数を保有していることその他の当該金融商品取引業者と密接な関係を有する法人その他の団体として政令で定める要件に該当する者をいいます。以下同じ。)と有価証券の売買その他の取引又は金融デリバティブ取引を行うこと。

委託会社の親法人等又は子法人等の利益を図るため、その行う投資運用業に関して運用の方針、運用財産の額若しくは市場の状況に照らして不必要な取引を行うことを内容とした運用を行うこと。

上記に掲げるもののほか、委託会社の親法人等又は子法人等が関与する行為であって、投資者の保護に欠け、若しくは取引の公正を害し、又は金融商品取引業の信用を失墜させるおそれのあるものとして内閣府令で定める行為。

#### 5【その他】

##### (1)定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2)訴訟事件その他の重要事項

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

## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

- ・ 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・ 資本金の額 324,279百万円（2018年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（2018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
楽天証券株式会社	7,495百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
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。

( ) 2018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

平成30年6月4日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 荒川 進指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の平成29年4月1日から平成30年3月31日までの第33期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

## 財務諸表に対する経営者の責任

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

## 監査人の責任

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

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

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

## 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の平成30年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

## 独立監査人の監査報告書

平成30年3月14日

東京海上アセットマネジメント株式会社  
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 荒川 進指定有限責任社員  
業務執行社員 公認会計士 久保 直毅

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・円資産インデックスバランスファンドの平成29年10月11日から平成30年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

### 財務諸表に対する経営者の責任

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

### 監査人の責任

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

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

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

### 監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上・円資産インデックスバランスファンドの平成30年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

### 利害関係

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

以上

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2018年9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

指定有限責任社員 公認会計士 荒川 進  
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅  
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2018年1月26日から2018年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

**中間財務諸表に対する経営者の責任**

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

**監査人の責任**

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

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

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

**中間監査意見**

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2018年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2018年1月26日から2018年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

**利害関係**

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

以上

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

2．XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。