【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】	2019年８月28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】	ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型） ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型） ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型） ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型） ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）
【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　各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】

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）
ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）
（なお、愛称として「未来海図」という名称を用いる場合があります。また、上記のそれぞれをまたは総称して、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】

各ファンドにつき、１兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額
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】

① 発行価格に2.16%＊（税抜２%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）が含まれます。
＊消費税率が10%となった場合は、2.2%となります。
② 分配金再投資コース（下記「(6)申込単位」をご参照ください。）の収益分配金の再投資により取得する口数については、手数料はありません。

(6)【申込単位】

① 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。

② 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時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。）
③ 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】

2019年８月29日から2020年２月28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。ただし、お申込み日がニューヨーク証券取引所、英国証券取引所およびフランクフルト証券取引所のいずれかの休業日に該当する日には、お申込みの受付を行いません。
※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額に申込手数料を加算した申込時の支払総額をいいます。）を販売会社所定の期日までに販売会社に支払うものとします。
各取得申込日の発行価額の総額は各追加信託が行われる日に、販売会社から、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社である三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社（以下「受託会社」といいます。）の指定する当ファンドの口座に振込まれます。

(10)【払込取扱場所】

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。
株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

① 申込の方法

a.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。ただし、お申込み日がニューヨーク証券取引所、英国証券取引所およびフランクフルト証券取引所のいずれかの休業日に該当する日には、お申込みの受付を行いません。

b.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。

c.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。

d.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号ロ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。）。

e.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。）

f.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。）。

g.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。

h.販売会社によって、各ファンド間の乗換え（「スイッチング」といいます。）が可能な場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

② 日本以外の地域における発行

該当ありません。

③ 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】

① ファンドの目的
当ファンドは、信託財産の中長期的な成長を目標として、「ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド受益証券」、「ＴＭＡ外国債券インデックス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。

② 基本的性格
当ファンドは、追加型投信／内外／資産複合／インデックス型に属します。
当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産（収益の源泉）	補足分類
単位型投信 追加型投信	国　内 海　外 内　外	株　式 債　券 不動産投信 その他資産（　　） 資産複合	インデックス型 特殊型

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	為替ヘッジ

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）資産配分固定型））（注） 資産複合 （　　） 資産配分固定型 資産配分変更型	年1回 年2回 年4回 年6回（隔月） 年12回（毎月） 日々 その他（　　）	グローバル（日本を含む） 日本 北米 欧州 アジア オセアニア 中南米 アフリカ 中近東（中東） エマージング	ファミリーファンド ファンド・オブ・ファンズ	あり（　　） なし

（注）当ファンドは、組入比率を年に１回見直すものとしていますが、機動的に変更を行うものではないため、「資産配分固定型」としています。
※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。
※属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われないファンドをいいます。
	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。

	その他資産	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	ＭＭＦ（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定められるＭＭＦをいいます。
	ＭＲＦ（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「ＭＭＦ等の運営に関する規則」に定められるＭＲＦをいいます。
	ＥＴＦ	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	特殊型	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

属性区分の定義

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

決算頻度	年１回	目論見書または投資信託約款において、年１回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年２回	目論見書または投資信託約款において、年２回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年４回	目論見書または投資信託約款において、年４回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年６回（隔月）	目論見書または投資信託約款において、年６回決算する旨の記載があるものをいいます。
	年12回（毎月）	目論見書または投資信託約款において、年12回（毎月）決算する旨の記載があるものをいいます。
	日々	目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。
投資対象地域	グローバル	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	北米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	欧州	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アジア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	オセアニア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中南米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東（中東）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域（新興成長国（地域））の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託（ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。）を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会の「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定されるファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経２２５	目論見書または投資信託約款において、日経２２５に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。

	ＴＯＰＩＸ	目論見書または投資信託約款において、ＴＯＰＩＸに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動（一定倍の連動若しくは逆連動を含む。）を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果（基準価額、償還価額、収益分配金等）や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型／絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他型	目論見書または投資信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

③ 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各5,000億円となっています。ただし、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

④ ファンドの特色

主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の複数の資産（日本株式、日本債券、外国株式、外国債券）に分散投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。

当ファンドは、各マザーファンドのベンチマークを＜基本資産配分＞で組み合わせた指数を合成ベンチマークとし、当該ベンチマークに連動する投資成果を目指します。
各マザーファンドは、それぞれのベンチマークに連動する投資成果を目標として運用を行います。

マザーファンド受益証券	ベンチマーク
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	ＴＯＰＩＸ
ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	ＮＯＭＵＲＡ-ＢＰＩ（総合）
ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）
ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）

※ＴＯＰＩＸについて
・ＴＯＰＩＸの指数値及びＴＯＰＩＸの商標は、株式会社東京証券取引所（以下「㈱東京証券取引所」という。）の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等ＴＯＰＩＸに関するすべての権利・ノウハウ及びＴＯＰＩＸの商標に関するすべての権利は㈱東京証券取引所が有しています。
・㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、ＴＯＰＩＸの指数値の算出若しくは公表の停止又はＴＯＰＩＸの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
・㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値及びＴＯＰＩＸの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のＴＯＰＩＸの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
・㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、㈱東京証券取引所は、ＴＯＰＩＸの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
・当ファンドは、㈱東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
・㈱東京証券取引所は、当ファンドの購入者又は公衆に対し、当ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
・㈱東京証券取引所は、委託会社又は当ファンドの購入者のニーズを、ＴＯＰＩＸの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
・以上の項目に限らず、㈱東京証券取引所は当ファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。
※「ＮＯＭＵＲＡ－ＢＰＩ（野村ボンド・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的確に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、当ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
※「ＭＳＣＩコクサイ指数」とは、ＭＳＣＩ社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はＭＳＣＩ社に帰属します。また、ＭＳＣＩ社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。ＭＳＣＩ社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。ＭＳＣＩ社は当ファンドとは関係なく、当ファンドから生じるいかなる責任も負いません。
※ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・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。

当ファンドは、＜基本資産配分＞の異なる５つのファンドで構成されています。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、主にマザーファンドで行うこととなります。

資産配分は＜基本資産配分＞を基準に、原則として一定の範囲内（±５％）に変動幅を抑制します。

＜基本資産配分＞

	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	11%	71%	7%	11%
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	18%	55%	12%	15%
ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	26%	39%	17%	18%
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	33%	27%	22%	18%
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	42%	18%	28%	12%

＜ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）＞
安定的な運用を重視し、中長期的な資産の成長を目指します。

＜ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）＞
安定性に成長性を加味し、中長期的な資産の成長を目指します。

＜ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）＞
安定性と成長性の双方を重視し、中長期的な資産の成長を目指します。

＜ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）＞
成長性を重視し、中長期的な資産の成長を目指します。

＜ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）＞
成長性を積極的に追及し、中長期的な資産の成長を目指します。

＜基本資産配分＞は、経済見通し、市況動向等の見通し、各資産のリターン予測等に基づいて、原則として年に１回見直し、委託会社が必要と判断した場合には、配分率を変更することがあります。（＜基本資産配分＞の変更内容は、運用報告書や委託会社のホームページでお知らせします。）

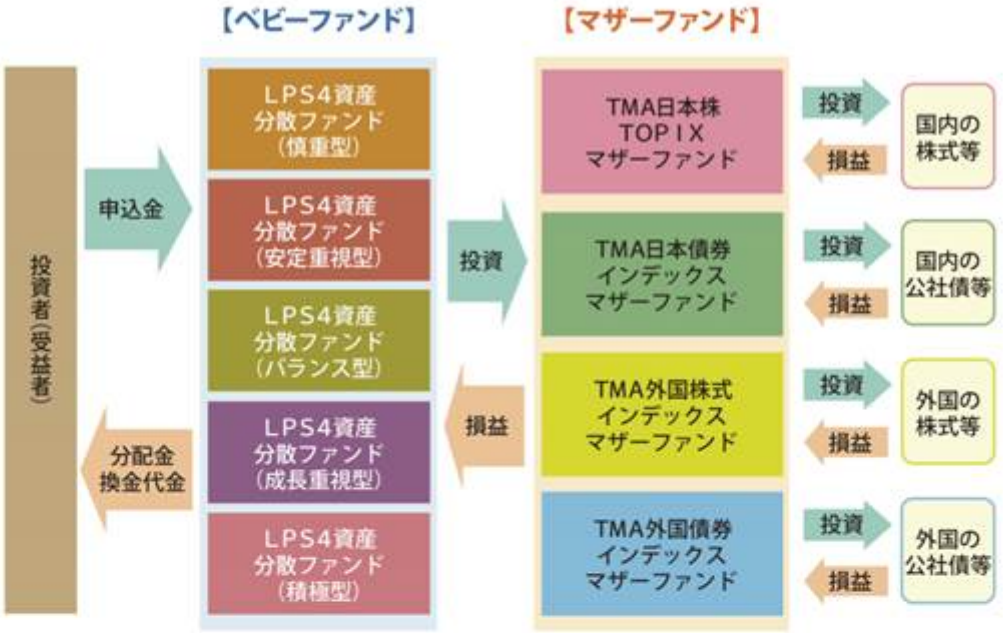
外貨建資産については、原則として為替ヘッジは行いません。

販売会社によって、各ファンド間の乗換え（「スイッチング」といいます。）が可能な場合があります。
詳しくは販売会社にお問い合わせください。

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

ファンドの仕組み

当ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

分配方針

原則として、毎決算時に収益分配を行います。分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた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、収益分配を行わないことがあります。
将来の分配金の支払いおよびその金額について保証するものではありません。

主な投資制限

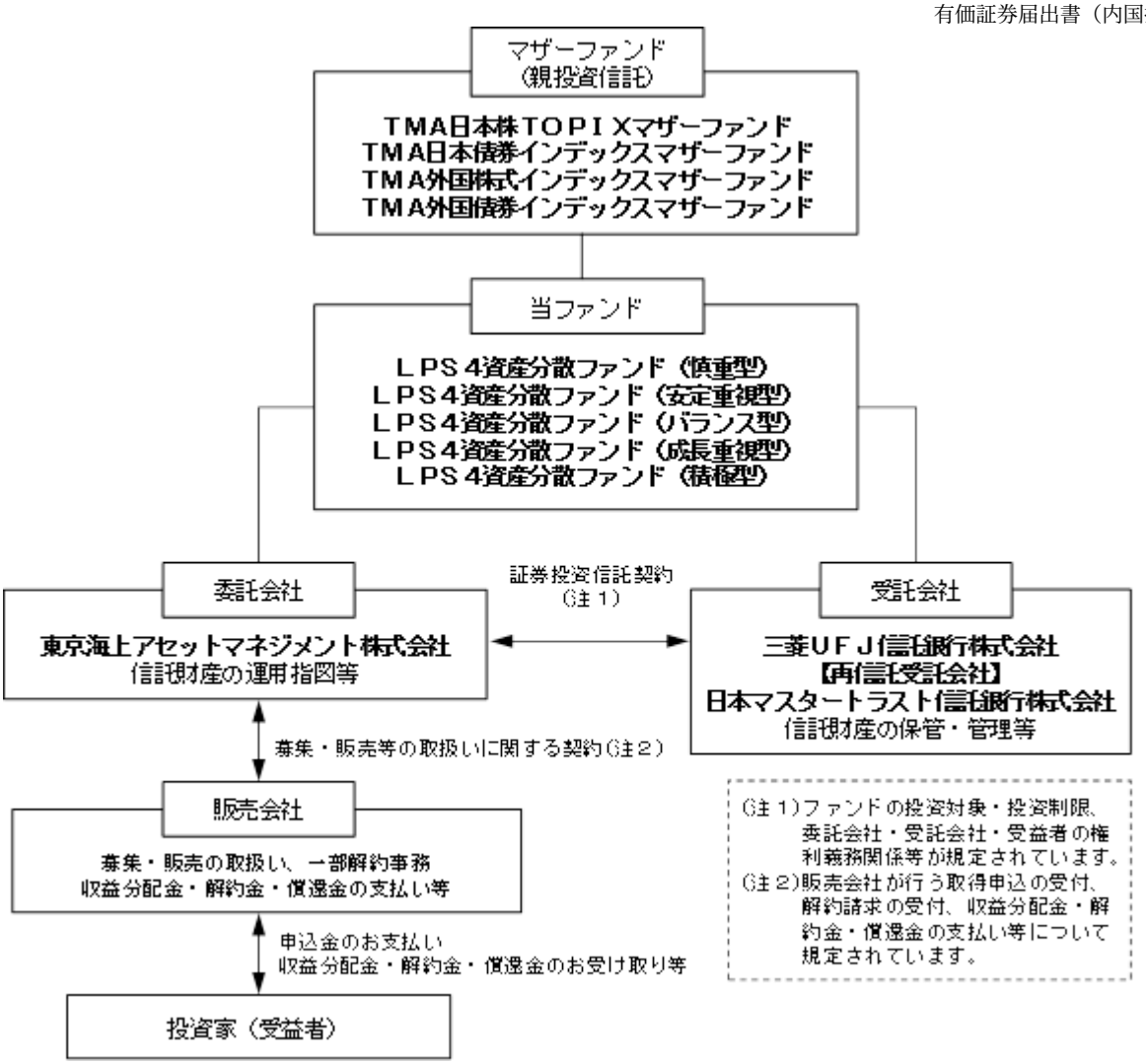
	株式への 実質投資割合	外貨建資産への 実質投資割合
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	30%以下	40%以下
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	40%以下	60%以下
ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	60%以下	60%以下
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	70%以下	70%以下
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	制限なし	75%以下

(2)【ファンドの沿革】

2009年９月２日　　ファンドの設定、運用開始
2016年４月25日　　信託期間を無期限から2021年５月28日までに変更

(3)【ファンドの仕組み】

① ファンドの仕組み



② 委託会社の概況

・名称　　東京海上アセットマネジメント株式会社

・資本金の額　20億円（2019年５月末日現在）

・会社の沿革

1985年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金２億円で設立

1987年２月 投資顧問業者として登録

同年６月 投資一任業務認可取得

1991年４月 国内および海外年金の運用受託を開始

1998年５月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得

2007年９月 金融商品取引業者として登録

2014年４月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更

2016年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

・大株主の状況（2019年５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、信託財産の中長期的な成長を目標として運用を行います。

２．運用方法

(1) 主要投資対象

主として以下のマザーファンド受益証券に投資します。
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド受益証券
ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド受益証券
ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド受益証券
ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド受益証券

(2) 投資態度

① 主として、マザーファンド受益証券への投資を通じて、国内外の複数の資産（日本株式、日本債券、外国株式、外国債券）に分散投資し、中長期的な信託財産の成長を目指します。当ファンドは、各マザーファンドのベンチマークを「基本資産配分」で組み合わせた指数を合成ベンチマークとし、当該ベンチマークに連動する投資成果を目指します。

② 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、主にマザーファンドで行うこととなります。

③ 資産配分は、「基本資産配分」を基準に、原則として一定の範囲内（±５％）に変動幅を抑制します。

④ 「基本資産配分」は、経済見通し、市況動向等の見通し、各資産のリターン予測等に基づいて、原則として年に１回見直し、委託会社が必要と判断した場合には、配分率を変更することがあります。

⑤ 株式以外の資産（マザーファンド受益証券を通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、この投資信託の信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として以下の通りとします。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	**制限なし**
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	**制限なし**
ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	**信託財産総額の75%以下**
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	**信託財産総額の75%以下**
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	**信託財産総額の50%以下**

⑥ 実質組入れ外貨建資産の為替変動リスクに対しては、原則として為替ヘッジは行いません。

⑦ 資金動向、市況動向、残存期間等の事情によっては、上記のような運用が出来ない場合があります。

＜参考情報＞マザーファンドの運用の基本方針、主な投資対象と投資制限（要約）

◇TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

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

①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。

②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。

③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。

④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）、第17条（スワップ取引の運用指図）および第18条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）に定めるデリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

◇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

①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。

②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）、第19条（スワップ取引の運用指図）および第20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。

◇TMA外国株式インデックスマザーファンド

１．基本方針

ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）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

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①主として外国の株式に投資し、ＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）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。

②組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。なお、保有外貨建資産の売買代金、償還金、利金等の受取りまたは支払にかかわる為替予約取引等を行うことができます。

③信託財産の効率的な運用に資するため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引や外国為替予約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) 株式への投資割合には、制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

(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。

◇TMA外国債券インデックスマザーファンド

１．基本方針

ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

①主として外国の公社債に投資し、ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）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。

②組入外貨建資産については、原則として、為替変動リスクを回避するための為替ヘッジは行いません。

③信託財産の効率的な運用に資するため、債券先物取引や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、組入有価証券の時価総額と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。また、外貨建資産および外国為替予約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には、制限を設けません。

(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。

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

※「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。

※「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ュレーションを勘案しポートフォリオを構築します。

※「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、リスクモデルを使用し、最適化法を用いてＭＳＣＩコクサイ指数（円ヘッジなし・円ベース）に連動するようポートフォリオを構築します。

※「TMA外国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ＦＴＳＥ世界国債インデックス（除く日本、ヘッジなし・円ベース）に連動するよう、残存期間別、国別、通貨別毎の時価ウェイトとデュレーションを勘案し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。）

① 有価証券

② 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す。）

③ 金銭債権（①④に掲げるものに該当するものを除きます。）

④ 約束手形（金融商品取引法第２条第１項第15号に掲げるものを除きます。）

(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

為替手形

２．委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱ＵＦＪ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」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書

(2) 国債証券

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

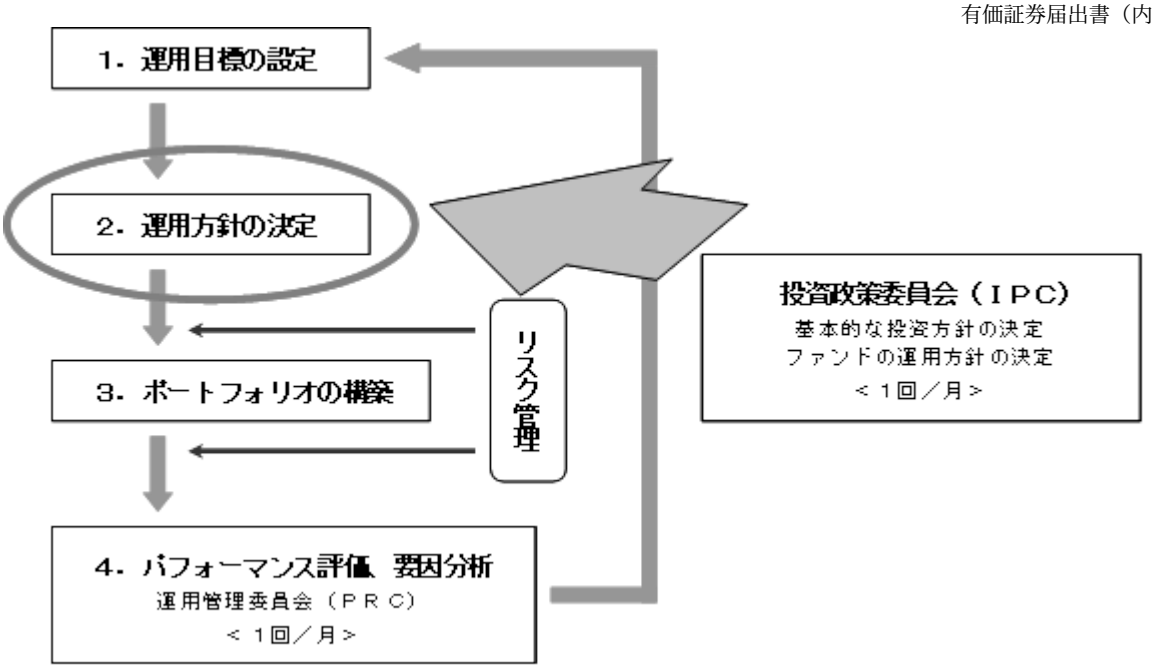
なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。

３．委託会社は、信託金を、上記２．に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第２条第２項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
(1) 預金
(2) 指定金銭信託（金融商品取引法第２条第１項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
(3) コール・ローン
(4) 手形割引市場において売買される手形
(5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第２条第２項第１号で定めるもの
(6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの

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

(3)【運用体制】

当ファンドの運用は、基本資産配分に基づき、４資産（日本株式、日本債券、外国株式、外国債券）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（13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、日本株式および外国株式をクオンツ企画運用部（10名）が、日本債券および外国債券を債券運用部（19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、2019年６月１日現在）

(4)【分配方針】

年１回（原則として５月28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。

① 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。

② 信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

a.配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（※）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等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。

③ 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。

④ 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ます。）

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】

① 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.「ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）」
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。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）」
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40を超えることとなる投資の指図をしません。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）」
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60を超えることとなる投資の指図をしません。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）」
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70を超えることとなる投資の指図をしません。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）」
株式への実質投資割合には、制限を設けません。
※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.「ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）」
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40を超えることとなる投資の指図をしません。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）」
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60を超えることとなる投資の指図をしません。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）」
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60を超えることとなる投資の指図をしません。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）」
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70を超えることとなる投資の指図をしません。
「ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）」
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75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を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の５を超えることとなる投資の指図をしません。

e.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

f.委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第１項第３号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ３第１項第７号および第８号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約

権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

② 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。

③ 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。

④ 先物取引等（約款第22条）

a.委託会社は、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、日本国内の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。

c.委託会社は、日本国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。

⑤ 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たときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

⑥ 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たときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

⑦ 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。

⑧ 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たときは、担保の受入の指図を行うものとします。

⑨ 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「⑩ 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。

⑩ 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たときは、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。

⑪ 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。

⑫ 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。

⑬ 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の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の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。

⑭ 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、主に株式や公社債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。

① 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。

② 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。

③ 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。

④ 為替変動リスク
外貨建資産の円換算価値は、資産自体の価格変動の他、当該外貨の円に対する為替レートの変動の影響を受けます。為替レートは、各国・地域の金利動向、政治・経済情勢、為替市場の需給その他の要因により大幅に変動することがあります。組入外貨建資産について、当該外貨の為替レートが円高方向にすすんだ場合には、基準価額が下落する要因となります。

⑤ カントリーリスク
投資対象国・地域において、政治・経済情勢の変化等により市場に混乱が生じた場合、または取引に対して新たな規制が設けられた場合には、基準価額が予想以上に下落したり、投資方針に沿った運用が困難となることがあります。

⑥ 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が、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、主に国内外の株式や公社債を実質的な投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れた株式や公社債の値動きやそれらの株式や公社債の発行者の信用状況の変化、為替相場の変動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
① 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。
② 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。
③ 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。
④ 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。
⑤ 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。
⑥ 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。
⑦ 分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった場合も同様です。

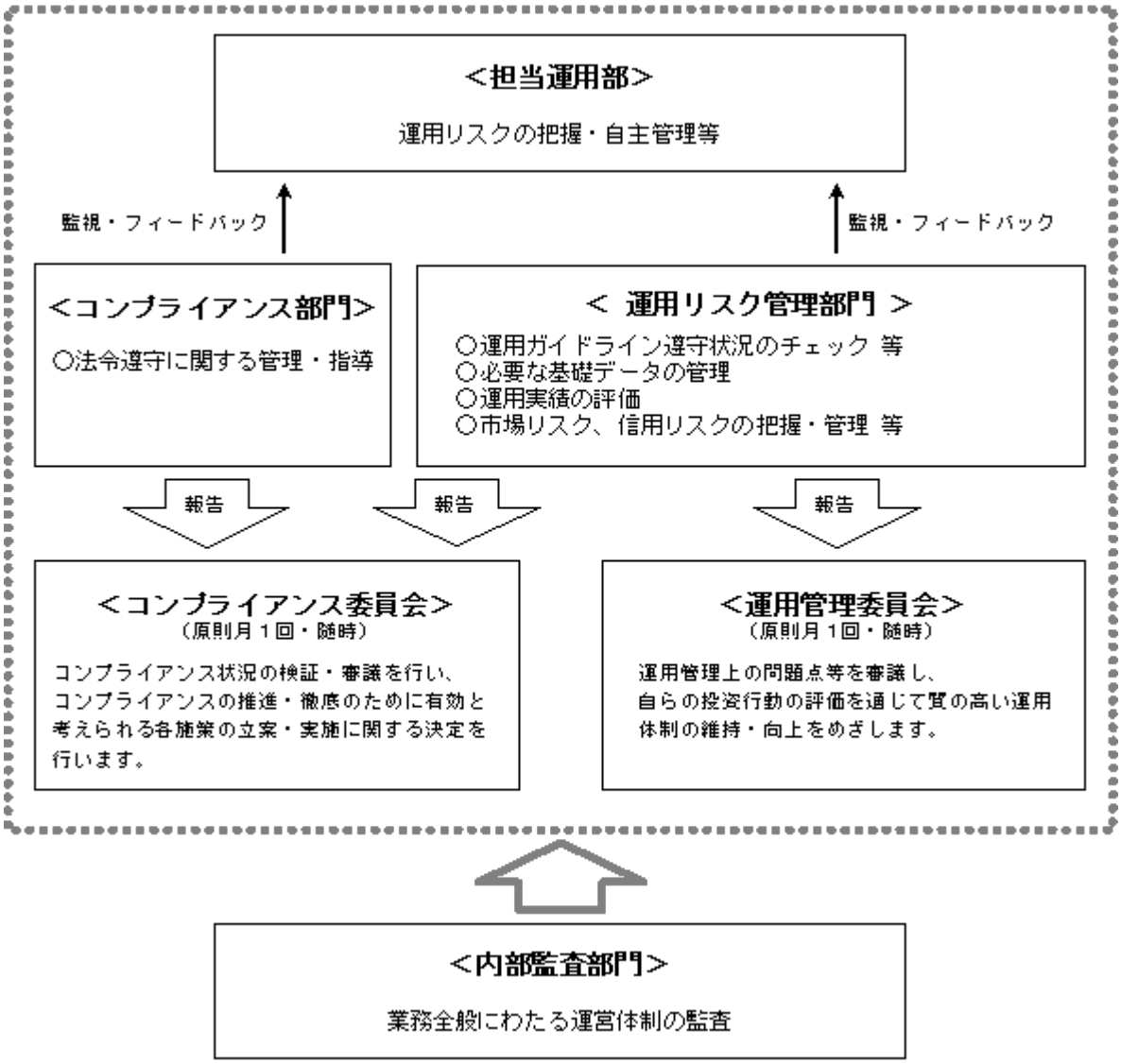
３．管理体制

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

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

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

＜リスク管理体制＞


＜担当運用部＞
運用リスクの把握・自主管理等
監視・フィードバック
監視・フィードバック
＜コンプライアンス部門＞
○法令遵守に関する管理・指導
＜ 運用リスク管理部門 ＞
○運用ガイドライン遵守状況のチェック 等
○必要な基礎データの管理
○運用実績の評価
○市場リスク、信用リスクの把握・管理 等
報告
報告
報告
＜コンプライアンス委員会＞
（原則月１回・随時）
コンプライアンス状況の検証・審議を行い、
コンプライアンスの推進・徹底のために有効と
考えられる各施策の立案・実施に関する決定を
行います。
＜運用管理委員会＞
（原則月１回・随時）
運用管理上の問題点等を審議し、
自らの投資行動の評価を通じて質の高い運用
体制の維持・向上をめざします。
＜内部監査部門＞
業務全般にわたる運営体制の監査

参考情報

LPS4資産分散ファンド(慎重型)

● ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。
※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

● ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	2.5	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4
最大値(%)	7.8	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値(%)	-2.5	-22.0	-17.5	-27.4	-4.0	-12.3	-17.4

※ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
※過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

LPS4資産分散ファンド(安定重視型)

● ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。
※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

● ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	3.5	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4
最大値(%)	12.7	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値(%)	-5.2	-22.0	-17.5	-27.4	-4.0	-12.3	-17.4

※ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
※過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

LPS4資産分散ファンド(バランス型)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。
※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	4.8	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4
最大値(%)	17.6	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値(%)	-8.9	-22.0	-17.5	-27.4	-4.0	-12.3	-17.4

※ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
※過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

LPS4資産分散ファンド(成長重視型)

ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。
※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	6.0	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4
最大値(%)	22.0	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値(%)	-12.0	-22.0	-17.5	-27.4	-4.0	-12.3	-17.4

※ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
※過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

LPS4資産分散ファンド(積極型)

● ファンドの年間騰落率および分配金再投資基準価額の推移

※過去5年間の各月末における分配金再投資基準価額と直近1年間の騰落率を表示したものです。
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。
※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

● ファンドと代表的な資産クラスとの騰落率の比較

	ファンド	日本株	先進国株	新興国株	日本国債	先進国債	新興国債
平均値(%)	7.1	10.0	11.4	7.6	2.0	3.0	1.4
最大値(%)	25.9	41.9	34.1	37.2	9.3	19.3	19.3
最小値(%)	-14.8	-22.0	-17.5	-27.4	-4.0	-12.3	-17.4

※ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。なお、全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。
※過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。
※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

● 代表的な資産クラスとの騰落率の比較に用いた指数について

日本株　:TOPIX(東証株価指数)(配当込み)

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

先進国株:MSCIコクサイ指数(配当込み、円ベース)

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

新興国株:MSCIエマージング・マーケット・インデックス(配当込み、円ベース)

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

日本国債:NOMURA-BPI(国債)

NOMURA-BPI(国債)は、野村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。

先進国債:FTSE世界国債インデックス(除く日本、円ベース)

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

新興国債:JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイド(円ベース)

JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケッツ・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・マーケッツ・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P. Morgan Securities LLCに帰属します。

(注)海外の指数は、為替ヘッジなしの指数を採用しています。

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】

(1)【申込手数料】

① 発行価格に2.16%＊（税抜２%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。申込手数料には、消費税等が含まれます。
申込手数料は、商品の説明、購入に関する事務コスト等の対価として、申込時にご負担いただくものです。
＊消費税率が10%となった場合は、2.2%となります。
② 分配金再投資コースの収益分配金の再投資により取得する口数については、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】

① 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0.6966%＊（税抜0.645%）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。
＊消費税率が10%となった場合は、年率0.7095%となります。

② ①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。

③ 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＊1	販売会社＊2	受託会社＊3
年率0.3%	年率0.3%	年率0.045%

＊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】

① 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%＊１（税抜0.01%）を乗じて得た金額（ただし、年64.8万円＊２（税抜60万円）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。
＊１消費税率が10%となった場合は、年率0.011%となります。
＊２消費税率が10%となった場合は、年66万円となります。

② 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。

③ 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。

④ 信託財産の一部解約に伴う支払資金の手当て、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当て等を目的として資金借入れの指図を行った場合、借入金の利息は受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

(5)【課税上の取扱い】

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

＜個人の受益者に対する課税＞

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金については、配当所得として課税され、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%※および地方税５%）の税率による源泉徴収が行われます。申告不要制度の適用がありますが、総合課税または申告分離課税を選択することも可能です。なお、ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）およびＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）は、配当控除の適用はありません。ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）およびＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）は、配当控除の適用があります。配当控除は、総合課税を選択した場合には適用がありますが、申告不要制度の適用を受けた場合または申告分離課税を選択した場合には適用がありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税５%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（※１）は課税されません。
※2037年12月31日までの間、復興特別所得税（所得税15%×2.1%）が付加されます。

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

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

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

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

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

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

＊上記は、2019年５月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

5【運用状況】

以下は2019年5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】

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

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	82,269,020	99.98
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		9,317	0.01
合計（純資産総額）		82,278,337	100.00

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

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	87,223,224	99.98
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		9,114	0.01
合計（純資産総額）		87,232,338	100.00

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

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	183,524,688	99.98
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		20,744	0.01
合計（純資産総額）		183,545,432	100.00

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

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	176,042,295	99.98
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		21,071	0.01
合計（純資産総額）		176,063,366	100.00

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）

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	160,364,563	99.98
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		22,075	0.01
合計（純資産総額）		160,386,638	100.00

（ご参考：親投資信託の投資状況）
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）が主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計（円）	投資比率（％）
株式	日本	34,942,895,690	95.63
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		1,594,581,677	4.36
合計（純資産総額）		36,537,477,367	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	2,484,900,000	6.80

(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。

TMA外国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	アメリカ	1,971,248,130	46.60
	カナダ	70,543,569	1.66
	ドイツ	274,888,547	6.49
	イタリア	355,584,757	8.40
	フランス	406,362,634	9.60
	オーストラリア	84,958,258	2.00
	イギリス	255,574,849	6.04
	シンガポール	17,471,108	0.41
	マレーシア	18,316,834	0.43
	オランダ	80,912,054	1.91
	スペイン	226,849,094	5.36
	ベルギー	104,096,220	2.46
	スウェーデン	13,095,018	0.30
	ノルウェー	11,587,710	0.27
	オーストリア	63,187,928	1.49
	フィンランド	28,059,852	0.66
	デンマーク	23,197,508	0.54
	メキシコ	32,326,728	0.76
	アイルランド	28,938,814	0.68
	ポーランド	23,176,808	0.54
	南アフリカ	23,681,795	0.55
	小計	4,114,058,215	97.26
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		115,539,823	2.73
合計（純資産総額）		4,229,598,038	100.00

TMA外国株式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（%）
株式	アメリカ	6,489,351,701	63.38
	カナダ	386,964,807	3.77
	ドイツ	323,873,938	3.16
	イタリア	73,761,231	0.72
	フランス	375,441,052	3.66
	オーストラリア	243,140,736	2.37
	イギリス	634,931,323	6.20
	スイス	363,289,562	3.54
	バミューダ	25,104,496	0.24
	香港	112,657,597	1.10

	シンガポール	44,604,706	0.43
	ニュージーランド	10,486,327	0.10
	オランダ	170,083,736	1.66
	スペイン	115,822,401	1.13
	ベルギー	40,574,944	0.39
	スウェーデン	93,844,720	0.91
	ノルウェー	26,003,952	0.25
	オーストリア	8,591,974	0.08
	ルクセンブルク	9,662,059	0.09
	フィンランド	42,618,054	0.41
	デンマーク	65,312,861	0.63
	アイルランド	167,550,219	1.63
	イスラエル	14,216,725	0.13
	ポルトガル	9,060,292	0.08
	ケイマン	22,323,989	0.21
	リベリア	6,346,423	0.06
	パナマ	6,003,946	0.05
	キュラソー	12,734,512	0.12
	ジャージー	27,691,963	0.27
	英ヴァージン諸島	1,969,581	0.01
	小計	9,924,019,827	96.93
投資証券	アメリカ	220,477,282	2.15
	カナダ	2,034,598	0.01
	フランス	14,411,440	0.14
	オーストラリア	22,745,694	0.22
	イギリス	9,889,591	0.09
	香港	8,635,133	0.08
	シンガポール	2,321,025	0.02
	小計	280,514,763	2.73
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		33,686,912	0.32
合計（純資産総額）		10,238,221,502	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	アメリカ	137,321,164	1.34
	買建	ドイツ	44,365,708	0.43
	買建	イギリス	49,704,783	0.48

(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。

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	8,858,086,950	157.92

地方債証券	日本	308,049,000	5.49
特殊債券	日本	103,373,000	1.84
社債券	日本	475,277,414	8.47
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		△4,135,726,303	△73.73
合計（純資産総額）		5,609,060,061	100.00

(2)【投資資産】

①【投資有価証券の主要銘柄】

a.主要銘柄の明細

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

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	44,608,082	1.3043	58,182,424	1.3077	58,333,988	70.89
2	TMA外国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	7,998,195	1.5420	12,333,989	1.5408	12,323,618	14.97
3	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	5,605,887	1.2745	7,145,199	1.2426	6,965,875	8.46
4	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	1,934,674	2.4403	4,721,335	2.4012	4,645,539	5.64

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

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	34,113,004	1.3043	44,493,802	1.3077	44,609,575	51.13
2	TMA外国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	13,130,511	1.5420	20,248,449	1.5408	20,231,491	23.19
3	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	10,671,353	1.2745	13,601,387	1.2426	13,260,223	15.20
4	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	3,798,907	2.4403	9,270,637	2.4012	9,121,935	10.45

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

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	52,176,251	1.3043	68,053,928	1.3077	68,230,883	37.17
2	TMA外国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	29,107,186	1.5420	44,885,853	1.5408	44,848,352	24.43
3	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	34,007,397	1.2745	43,344,434	1.2426	42,257,591	23.02
4	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	11,739,073	2.4403	28,647,120	2.4012	28,187,862	15.35

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	45,313,714	1.2744	57,752,209	1.2426	56,306,821	31.98
2	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	37,916,529	1.3043	49,454,534	1.3077	49,583,444	28.16
3	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	15,641,855	2.4402	38,170,717	2.4012	37,559,222	21.33
4	TMA外国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	21,153,173	1.5420	32,618,202	1.5408	32,592,808	18.51

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	53,079,292	1.2744	67,649,548	1.2426	65,956,328	41.12
2	TMA外国株式インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	18,321,802	2.4401	44,708,853	2.4012	43,994,310	27.43
3	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	23,260,819	1.3043	30,339,087	1.3077	30,418,173	18.96
4	TMA外国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	12,977,513	1.5419	20,011,325	1.5408	19,995,752	12.46

b.投資有価証券の種類

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合　　計	99.98

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合　　計	99.98

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合　　計	99.98

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98

合　　計	99.98

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.98
合　　計	99.98

②【投資不動産物件】
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）
該当事項はありません。

③【その他投資資産の主要なもの】
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）
該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）
該当事項はありません。

（ご参考：親投資信託の投資資産）
①投資有価証券の主要銘柄
a.主要銘柄の明細
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	179,300	6,718.13	1,204,561,268	6,384.00	1,144,651,200	3.13
2	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	66,000	10,957.33	723,184,314	10,250.00	676,500,000	1.85
3	ソニー	日本	電気機器	株式	107,900	4,965.19	535,744,709	5,257.00	567,230,300	1.55
4	三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	1,092,300	571.58	624,345,943	501.10	547,351,530	1.49
5	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	108,100	4,783.75	517,124,210	4,866.00	526,014,600	1.43
6	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	140,600	4,730.16	665,061,671	3,669.00	515,861,400	1.41
7	キーエンス	日本	電気機器	株式	7,900	67,970.37	536,965,980	61,510.00	485,929,000	1.32

8	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	111,800	4,037.48	451,390,420	3,783.00	422,939,400	1.15
9	ＫＤＤＩ	日本	情報・通信業	株式	139,300	2,491.58	347,077,760	2,788.50	388,438,050	1.06
10	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	110,300	3,180.86	350,849,930	3,468.00	382,520,400	1.04
11	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	135,800	3,081.80	418,508,966	2,651.00	360,005,800	0.98
12	任天堂	日本	その他製品	株式	9,200	30,760.71	282,998,562	38,700.00	356,040,000	0.97
13	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	2,160,200	175.00	378,037,500	153.70	332,022,740	0.90
14	花王	日本	化学	株式	39,100	8,848.24	345,966,472	8,480.00	331,568,000	0.90
15	東海旅客鉄道	日本	陸運業	株式	14,400	25,276.10	363,975,908	22,645.00	326,088,000	0.89
16	三菱商事	日本	卸売業	株式	111,400	3,212.44	357,866,256	2,833.00	315,596,200	0.86
17	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	56,900	5,488.11	312,273,588	5,401.00	307,316,900	0.84
18	東日本旅客鉄道	日本	陸運業	株式	28,600	10,705.26	306,170,624	10,310.00	294,866,000	0.80
19	ダイキン工業	日本	機械	株式	22,000	12,643.42	278,155,432	13,230.00	291,060,000	0.79
20	ファナック	日本	電気機器	株式	15,300	19,258.63	294,657,060	18,475.00	282,667,500	0.77
21	日立製作所	日本	電気機器	株式	72,300	3,614.36	261,318,656	3,686.00	266,497,800	0.72
22	キヤノン	日本	電気機器	株式	86,800	3,210.30	278,654,808	3,065.00	266,042,000	0.72
23	日本電産	日本	電気機器	株式	19,400	13,436.10	260,660,528	13,590.00	263,646,000	0.72
24	信越化学工業	日本	化学	株式	27,800	9,234.06	256,706,904	9,047.00	251,506,600	0.68
25	資生堂	日本	化学	株式	32,000	7,947.81	254,330,014	7,833.00	250,656,000	0.68
26	ＮＴＴドコモ	日本	情報・通信業	株式	100,200	2,480.92	248,588,364	2,495.50	250,049,100	0.68
27	ＨＯＹＡ	日本	精密機器	株式	32,400	7,334.97	237,653,028	7,558.00	244,879,200	0.67
28	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	66,300	4,424.17	293,322,743	3,666.00	243,055,800	0.66
29	第一三共	日本	医薬品	株式	46,000	4,524.12	208,109,680	5,255.00	241,730,000	0.66
30	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	18,200	12,363.38	225,013,640	13,250.00	241,150,000	0.66

ＴＭＡ外国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	T 2 1/4 11/15/24	アメリカ	国債証券	2.250	2024/11/15	800,000	10,583.25	84,666,000	11,032.54	88,260,355	2.08
2	T 2 08/15/25	アメリカ	国債証券	2.000	2025/08/15	800,000	10,187.56	81,500,540	10,866.79	86,934,365	2.05
3	T 2 3/4 11/15/23	アメリカ	国債証券	2.750	2023/11/15	600,000	10,783.92	64,703,527	11,259.80	67,558,848	1.59
4	T 1 7/8 11/30/21	アメリカ	国債証券	1.875	2021/11/30	600,000	10,663.02	63,978,163	10,889.86	65,339,182	1.54
5	T 2 3/4 02/15/28	アメリカ	国債証券	2.750	2028/02/15	500,000	10,632.35	53,161,774	11,409.32	57,046,618	1.34
6	T 2 1/2 05/15/24	アメリカ	国債証券	2.500	2024/05/15	500,000	10,617.31	53,086,590	11,164.97	55,824,862	1.31
7	T 2 5/8 11/15/20	アメリカ	国債証券	2.625	2020/11/15	500,000	10,866.79	54,333,978	11,006.91	55,034,565	1.30
8	T 2 02/15/22	アメリカ	国債証券	2.000	2022/02/15	500,000	10,596.81	52,984,065	10,928.31	54,641,553	1.29
9	T 1 3/4 12/31/20	アメリカ	国債証券	1.750	2020/12/31	500,000	10,666.87	53,334,359	10,865.08	54,325,434	1.28
10	T 1 3/4 02/28/22	アメリカ	国債証券	1.750	2022/02/28	500,000	10,548.11	52,740,569	10,851.41	54,257,084	1.28
11	T 1 3/4 05/15/23	アメリカ	国債証券	1.750	2023/05/15	500,000	10,342.20	51,711,046	10,813.82	54,069,121	1.27
12	T 1 3/8 09/30/20	アメリカ	国債証券	1.375	2020/09/30	500,000	10,625.86	53,129,309	10,810.40	54,052,034	1.27

13	T 1 5/8 08/15/22	アメリカ	国債証券	1.625	2022/08/15	500,000	10,394.32	51,971,630	10,802.71	54,013,587	1.27
14	T 1 5/8 02/15/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/02/15	500,000	10,192.52	50,962,614	10,595.95	52,979,793	1.25
15	T 3 02/15/47	アメリカ	国債証券	3.000	2047/02/15	400,000	10,157.66	40,630,657	11,706.64	46,826,585	1.10
16	T 3 11/15/45	アメリカ	国債証券	3.000	2045/11/15	400,000	10,177.31	40,709,260	11,696.39	46,785,575	1.10
17	T 2 1/4 11/15/27	アメリカ	国債証券	2.250	2027/11/15	400,000	10,174.75	40,699,007	10,982.99	43,931,962	1.03
18	T 2 1/8 08/15/21	アメリカ	国債証券	2.125	2021/08/15	400,000	10,687.37	42,749,507	10,950.52	43,802,097	1.03
19	T 1 3/4 05/15/22	アメリカ	国債証券	1.750	2022/05/15	400,000	10,476.34	41,905,385	10,849.70	43,398,832	1.02
20	T 1 5/8 11/30/20	アメリカ	国債証券	1.625	2020/11/30	400,000	10,648.93	42,595,720	10,846.29	43,385,162	1.02
21	FRTR 2 1/4 10/25/22	フランス	国債証券	2.250	2022/10/25	300,000	13,327.77	39,983,311	13,331.13	39,993,416	0.94
22	T 3 1/8 08/15/44	アメリカ	国債証券	3.125	2044/08/15	300,000	10,436.19	31,308,571	11,927.07	35,781,225	0.84
23	T 3 5/8 02/15/21	アメリカ	国債証券	3.625	2021/02/15	300,000	11,094.05	33,282,177	11,205.98	33,617,947	0.79
24	T 2 1/2 08/15/23	アメリカ	国債証券	2.500	2023/08/15	300,000	10,667.72	32,003,178	11,135.06	33,405,207	0.78
25	T 2 1/4 07/31/21	アメリカ	国債証券	2.250	2021/07/31	300,000	10,724.96	32,174,907	10,976.15	32,928,466	0.77
26	T 2 1/4 03/31/21	アメリカ	国債証券	2.250	2021/03/31	300,000	10,755.72	32,267,179	10,960.77	32,882,329	0.77
27	T 2 1/8 05/15/25	アメリカ	国債証券	2.125	2025/05/15	300,000	10,298.63	30,895,908	10,950.52	32,851,572	0.77
28	T 2 11/15/21	アメリカ	国債証券	2.000	2021/11/15	300,000	10,625.00	31,875,022	10,926.60	32,779,804	0.77
29	T 2 02/15/23	アメリカ	国債証券	2.000	2023/02/15	300,000	10,482.32	31,446,979	10,921.47	32,764,426	0.77
30	T 1 3/4 01/31/23	アメリカ	国債証券	1.750	2023/01/31	300,000	10,485.76	31,457,307	10,827.49	32,482,482	0.76

TMA外国株式インデックスマザーファンド

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	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	19,183	12,091.41	231,949,653	13,749.83	263,763,042	2.57
2	APPLE INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	12,385	21,644.30	268,064,735	19,498.88	241,493,727	2.35
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	株式	1,100	187,317.92	206,049,715	198,632.75	218,496,030	2.13
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	6,312	16,312.08	102,961,873	20,013.97	126,328,201	1.23
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	834	117,965.44	98,383,178	122,259.01	101,964,016	0.99
6	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	株式	8,614	12,013.47	103,484,065	11,708.08	100,853,414	0.98
7	JOHNSON & JOHNSON	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	6,954	15,615.32	108,588,999	14,447.54	100,468,259	0.98
8	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	794	119,173.45	94,623,722	122,637.39	97,374,093	0.95
9	EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	株式	10,890	8,705.91	94,807,427	7,870.63	85,711,260	0.83
10	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	4,638	15,854.30	73,532,283	17,799.43	82,553,773	0.80
11	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	7,553	9,365.67	70,738,923	10,686.71	80,716,728	0.78
12	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	6,526	10,296.94	67,197,854	11,518.88	75,172,268	0.73
13	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	各種金融	株式	3,403	23,608.04	80,338,186	21,843.56	74,333,656	0.72

14	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	銀行	株式	24,379	3,094.31	75,436,412	2,970.21	72,410,934	0.70
15	THE WALT DISNEY CO	アメリカ	メディア・娯楽	株式	4,803	12,798.69	61,472,126	14,457.39	69,438,853	0.67
16	CISCO SYSTEMS INC	アメリカ	テクノロジー・ハードウェアおよび機器	株式	11,724	5,192.52	60,877,119	5,858.41	68,684,059	0.67
17	MASTERCARD INC-CLASS A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	2,437	22,926.89	55,872,855	27,798.21	67,744,258	0.66
18	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	2,524	29,576.83	74,651,942	26,629.15	67,211,999	0.65
19	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	電気通信サービス	株式	10,806	6,350.45	68,623,045	6,214.92	67,158,520	0.65
20	PFIZER INC	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	14,641	4,806.06	70,365,533	4,582.18	67,087,755	0.65
21	AT&T INC	アメリカ	電気通信サービス	株式	18,928	3,355.35	63,510,082	3,484.20	65,949,119	0.64
22	CHEVRONTEXACO CORP	アメリカ	エネルギー	株式	4,911	13,006.23	63,873,619	12,617.95	61,966,785	0.60
23	HOME DEPOT INC	アメリカ	小売	株式	2,943	20,288.34	59,708,614	20,896.50	61,498,425	0.60
24	MERCK & CO. INC.	アメリカ	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	6,907	8,284.07	57,218,116	8,713.80	60,186,249	0.58
25	INTEL CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	11,735	5,280.75	61,969,616	4,891.67	57,403,780	0.56
26	COCA-COLA COMPANY	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	10,328	5,390.30	55,671,087	5,385.97	55,626,401	0.54
27	WELLS FARGO & COMPANY	アメリカ	銀行	株式	11,229	5,724.85	64,284,383	4,926.66	55,321,554	0.54
28	COMCAST CORP-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	12,107	4,216.80	51,052,815	4,564.68	55,264,658	0.53
29	BOEING CO	アメリカ	資本財	株式	1,425	40,117.21	57,167,031	38,261.78	54,523,041	0.53
30	NOVARTIS AG-REG SHS	スイス	医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	株式	5,456	8,583.72	46,832,789	9,444.72	51,530,431	0.50

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１３５回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2023/03/20	510,000,000	101.10	515,626,200	101.14	515,849,700	9.19
2	第１３１回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2022/03/20	440,000,000	100.82	443,643,200	100.82	443,643,200	7.90
3	第４００回利付国債（２年）	日本	国債証券	0.100	2021/05/01	430,000,000	100.53	432,300,500	100.53	432,304,800	7.70
4	第３４６回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2027/03/20	310,000,000	101.88	315,854,600	102.21	316,860,300	5.64
5	第１３９回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2024/03/20	310,000,000	101.43	314,444,600	101.45	314,501,200	5.60
6	第３３８回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.400	2025/03/20	250,000,000	103.51	258,787,500	103.51	258,792,500	4.61

7	第３５４回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2029/03/20	250,000,000	101.97	254,942,500	101.97	254,945,000	4.54
8	平成２７年度第３回福岡県公募公債	日本	地方債証券	0.529	2025/08/25	200,000,000	103.16	206,326,000	103.26	206,534,000	3.68
9	第１３３回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2022/09/20	190,000,000	100.81	191,542,800	100.99	191,892,400	3.42
10	第１６４回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.500	2038/03/20	180,000,000	104.43	187,986,700	104.48	188,076,600	3.35
11	第４２回利付国債（３０年）	日本	国債証券	1.700	2044/03/20	140,000,000	131.09	183,533,000	131.09	183,537,200	3.27
12	第３５０回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2028/03/20	170,000,000	102.18	173,707,700	102.18	173,709,400	3.09
13	第１２９回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2021/09/20	170,000,000	100.65	171,106,700	100.65	171,116,900	3.05
14	第１２６回利付国債（５年）	日本	国債証券	0.100	2020/12/20	170,000,000	100.51	170,877,200	100.42	170,724,200	3.04
15	第１５６回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.400	2036/03/20	150,000,000	102.10	153,152,200	103.58	155,379,000	2.77
16	第１５２回利付国債（２０年）	日本	国債証券	1.200	2035/03/20	130,000,000	116.46	151,407,100	116.46	151,409,700	2.69
17	第３４回利付国債（３０年）	日本	国債証券	2.200	2041/03/20	100,000,000	130.24	130,245,000	139.15	139,152,000	2.48
18	第３３回道路債券	日本	社債券	2.910	2034/06/20	100,000,000	134.38	134,386,000	138.58	138,581,000	2.47
19	第３４８回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	130,000,000	100.35	130,457,600	102.22	132,897,700	2.36
20	第１２７回利付国債（２０年）	日本	国債証券	1.900	2031/03/20	100,000,000	121.90	121,900,400	122.69	122,699,000	2.18
21	第３５１回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.100	2028/06/20	120,000,000	100.00	120,000,000	102.15	122,582,400	2.18
22	第６２回利付国債（３０年）	日本	国債証券	0.500	2049/03/20	120,000,000	101.07	121,290,700	101.31	121,575,600	2.16
23	第１６０回利付国債（２０年）	日本	国債証券	0.700	2037/03/20	110,000,000	103.77	114,149,300	108.31	119,143,200	2.12
24	第５２回利付国債（３０年）	日本	国債証券	0.500	2046/09/20	110,000,000	102.20	112,429,900	102.20	112,429,900	2.00
25	第１１７回利付国債（２０年）	日本	国債証券	2.100	2030/03/20	90,000,000	122.32	110,094,300	123.46	111,121,200	1.98
26	第１１回利付国債（４０年）	日本	国債証券	0.800	2058/03/20	100,000,000	110.13	110,130,500	110.82	110,827,000	1.97
27	第１３３回利付国債（２０年）	日本	国債証券	1.800	2031/12/20	90,000,000	119.43	107,491,500	122.43	110,188,800	1.96
28	第１３６回利付国債（２０年）	日本	国債証券	1.600	2032/03/20	90,000,000	120.15	108,143,100	120.16	108,146,700	1.92
29	第３３５回利付国債（１０年）	日本	国債証券	0.500	2024/09/20	100,000,000	103.28	103,288,000	103.74	103,748,000	1.84
30	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	104.43	104,435,000	103.37	103,373,000	1.84

b.投資有価証券の種類

ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国内	水産・農林業	0.10
		鉱業	0.24
		建設業	2.70
		食料品	4.05
		繊維製品	0.63
		パルプ・紙	0.27
		化学	6.99
		医薬品	5.32
		石油・石炭製品	0.58
		ゴム製品	0.73
		ガラス・土石製品	0.75
		鉄鋼	0.87
		非鉄金属	0.70
		金属製品	0.53
		機械	4.72
		電気機器	12.53
		輸送用機器	7.38
		精密機器	2.00
		その他製品	2.10
		電気・ガス業	1.65
		陸運業	4.67
		海運業	0.14
		空運業	0.53
		倉庫・運輸関連業	0.22
		情報・通信業	8.73
		卸売業	4.82
		小売業	4.39
		銀行業	5.75
		証券、商品先物取引業	0.74
		保険業	2.20
		その他金融業	1.06
		不動産業	2.30
		サービス業	5.07
合　　計			95.63

TMA外国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	97.26
合　　計	97.26

TMA外国株式インデックスマザーファンド

種類	国内／国外	業種	投資比率(%)
株式	国外	エネルギー	6.06

		素材	4.26
		資本財	6.85
		商業・専門サービス	1.35
		運輸	1.94
		自動車・自動車部品	1.03
		耐久消費財・アパレル	1.93
		消費者サービス	1.95
		メディア・娯楽	6.09
		小売	4.89
		食品・生活必需品小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	4.96
		家庭用品・パーソナル用品	2.14
		ヘルスケア機器・サービス	4.78
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.03
		銀行	7.92
		各種金融	4.35
		保険	3.91
		不動産	0.47
		ソフトウェア・サービス	9.68
		テクノロジー・ハードウェアおよび機器	4.10
		電気通信サービス	2.38
		公益事業	3.45
		半導体・半導体製造装置	2.79
投資証券	―	―	2.73
合　　計			99.67

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	157.92
地方債証券	5.49
特殊債券	1.84
社債券	8.47
合　　計	173.73

②投資不動産物件

TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

該当事項はありません。

TMA外国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外国株式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。

③その他投資資産の主要なもの

TMA日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/売建	数量（枚）	帳簿価額	評価額（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証株価指数先物	買建	165	2,582,328,200.00	2,484,900,000	6.80

(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。

TMA外国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外国株式インデックスマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/売建	数量（枚）	通貨	帳簿価額	評価額	評価額（円）	投資比率(%)
株価指数先物取引	アメリカ	Chicago Mercantile Exchange	S&P 500 EMIN	買建	9	米ドル	1,263,762.50	1,255,680.00	137,321,164	1.34
	ドイツ	Eurex	DJ EU STX 50	買建	11	ユーロ	365,670.00	364,430.00	44,365,708	0.43
	イギリス	ICE Futures Europe Financials	FTSE 100 IDX	買建	5	英ポンド	362,230.00	360,650.00	49,704,783	0.48

(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。

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。

(3)【運用実績】

①【純資産の推移】

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

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	(2010年 5月28日)	0.993903	0.993903	0.9939	0.9939
第2計算期間末	(2011年 5月30日)	1	1	1.0016	1.0016
第3計算期間末	(2012年 5月28日)	1	1	1.0026	1.0026
第4計算期間末	(2013年 5月28日)	3	3	1.1296	1.1296
第5計算期間末	(2014年 5月28日)	8	8	1.1741	1.1741
第6計算期間末	(2015年 5月28日)	39	39	1.2648	1.2648
第7計算期間末	(2016年 5月30日)	49	49	1.2729	1.2729
第8計算期間末	(2017年 5月29日)	65	65	1.2771	1.2771
第9計算期間末	(2018年 5月28日)	72	72	1.3026	1.3026
第10計算期間末	(2019年 5月28日)	82	82	1.3079	1.3079
2018年 5月末日		72	－	1.2991	－
6月末日		78	－	1.3017	－

7月末日	73	－	1.3056	－
8月末日	73	－	1.3001	－
9月末日	74	－	1.3090	－
10月末日	73	－	1.2882	－
11月末日	74	－	1.2960	－
12月末日	74	－	1.2811	－
2019年 1月末日	76	－	1.2931	－
2月末日	77	－	1.3049	－
3月末日	87	－	1.3141	－
4月末日	90	－	1.3153	－
5月末日	82	－	1.3060	－

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

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	(2010年 5月28日)	5	5	0.9779	0.9779
第2計算期間末	(2011年 5月30日)	8	8	0.9835	0.9835
第3計算期間末	(2012年 5月28日)	9	9	0.9669	0.9669
第4計算期間末	(2013年 5月28日)	14	14	1.1868	1.1868
第5計算期間末	(2014年 5月28日)	7	7	1.2474	1.2474
第6計算期間末	(2015年 5月28日)	20	20	1.4041	1.4041
第7計算期間末	(2016年 5月30日)	48	48	1.3587	1.3587
第8計算期間末	(2017年 5月29日)	40	40	1.3928	1.3928
第9計算期間末	(2018年 5月28日)	83	83	1.4423	1.4423
第10計算期間末	(2019年 5月28日)	87	87	1.4372	1.4372
2018年 5月末日		82	－	1.4349	－
6月末日		87	－	1.4390	－
7月末日		79	－	1.4488	－
8月末日		79	－	1.4446	－
9月末日		79	－	1.4646	－
10月末日		78	－	1.4227	－
11月末日		78	－	1.4340	－
12月末日		75	－	1.3970	－
2019年 1月末日		78	－	1.4171	－
2月末日		81	－	1.4379	－
3月末日		84	－	1.4482	－
4月末日		82	－	1.4551	－
5月末日		87	－	1.4307	－

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

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	(2010年 5月28日)	1	1	0.9726	0.9726

第2計算期間末	(2011年 5月30日)	10	10	0.9810	0.9810
第3計算期間末	(2012年 5月28日)	14	14	0.9458	0.9458
第4計算期間末	(2013年 5月28日)	16	16	1.2415	1.2415
第5計算期間末	(2014年 5月28日)	27	27	1.3182	1.3182
第6計算期間末	(2015年 5月28日)	78	78	1.5499	1.5499
第7計算期間末	(2016年 5月30日)	118	118	1.4536	1.4536
第8計算期間末	(2017年 5月29日)	130	130	1.5354	1.5354
第9計算期間末	(2018年 5月28日)	161	161	1.6134	1.6134
第10計算期間末	(2019年 5月28日)	184	184	1.5927	1.5927
2018年 5月末日		161	－	1.6022	－
6月末日		164	－	1.6065	－
7月末日		169	－	1.6228	－
8月末日		170	－	1.6196	－
9月末日		174	－	1.6523	－
10月末日		169	－	1.5846	－
11月末日		175	－	1.5999	－
12月末日		170	－	1.5355	－
2019年 1月末日		176	－	1.5673	－
2月末日		181	－	1.5980	－
3月末日		181	－	1.6088	－
4月末日		185	－	1.6229	－
5月末日		183	－	1.5804	－

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

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	(2010年 5月28日)	4	4	0.9689	0.9689
第2計算期間末	(2011年 5月30日)	6	6	0.9782	0.9782
第3計算期間末	(2012年 5月28日)	10	10	0.9262	0.9262
第4計算期間末	(2013年 5月28日)	23	23	1.2864	1.2864
第5計算期間末	(2014年 5月28日)	15	15	1.3782	1.3782
第6計算期間末	(2015年 5月28日)	66	66	1.6814	1.6814
第7計算期間末	(2016年 5月30日)	118	118	1.5351	1.5351
第8計算期間末	(2017年 5月29日)	117	117	1.6639	1.6639
第9計算期間末	(2018年 5月28日)	161	161	1.7799	1.7799
第10計算期間末	(2019年 5月28日)	177	177	1.7375	1.7375
2018年 5月末日		161	－	1.7652	－
6月末日		165	－	1.7677	－
7月末日		172	－	1.7914	－
8月末日		177	－	1.7895	－
9月末日		183	－	1.8360	－
10月末日		173	－	1.7374	－
11月末日		179	－	1.7570	－

12月末日	170	－	1.6587	－
2019年 1月末日	177	－	1.7066	－
2月末日	182	－	1.7484	－
3月末日	181	－	1.7587	－
4月末日	180	－	1.7823	－
5月末日	176	－	1.7183	－

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）

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	(2010年 5月28日)	1	1	0.9643	0.9643
第2計算期間末	(2011年 5月30日)	3	3	0.9758	0.9758
第3計算期間末	(2012年 5月28日)	6	6	0.9069	0.9069
第4計算期間末	(2013年 5月28日)	14	14	1.3320	1.3320
第5計算期間末	(2014年 5月28日)	24	24	1.4366	1.4366
第6計算期間末	(2015年 5月28日)	85	85	1.8101	1.8101
第7計算期間末	(2016年 5月30日)	121	121	1.6135	1.6135
第8計算期間末	(2017年 5月29日)	131	131	1.7878	1.7878
第9計算期間末	(2018年 5月28日)	184	184	1.9419	1.9419
第10計算期間末	(2019年 5月28日)	162	162	1.8734	1.8734
2018年 5月末日		183	－	1.9235	－
6月末日		182	－	1.9243	－
7月末日		189	－	1.9555	－
8月末日		190	－	1.9548	－
9月末日		197	－	2.0171	－
10月末日		187	－	1.8830	－
11月末日		201	－	1.9075	－
12月末日		176	－	1.7708	－
2019年 1月末日		183	－	1.8368	－
2月末日		185	－	1.8907	－
3月末日		175	－	1.9001	－
4月末日		165	－	1.9345	－
5月末日		160	－	1.8462	－

②【分配の推移】

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

該当事項はありません。

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）
該当事項はありません。

③【収益率の推移】
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

期	計算期間	収益率（％）（分配付）
第1計算期間	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	△0.6
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	0.8
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	0.1
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	12.7
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	3.9
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	7.7
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	0.6
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	0.3
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	2.0
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	0.4

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

期	計算期間	収益率（％）（分配付）
第1計算期間	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	△2.2
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	0.6
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	△1.7
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	22.7
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	5.1
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	12.6
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	△3.2
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	2.5
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	3.6
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	△0.4

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

期	計算期間	収益率（％）（分配付）
第1計算期間	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	△2.7
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	0.9
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	△3.6
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	31.3
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	6.2
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	17.6
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	△6.2
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	5.6
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	5.1
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	△1.3

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

期	計算期間	収益率（％）（分配付）

第1計算期間	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	△3.1
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	1.0
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	△5.3
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	38.9
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	7.1
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	22.0
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	△8.7
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	8.4
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	7.0
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	△2.4

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）

期	計算期間	収益率（％）（分配付）
第1計算期間	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	△3.6
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	1.2
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	△7.1
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	46.9
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	7.9
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	26.0
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	△10.9
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	10.8
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	8.6
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	△3.5

(4)【設定及び解約の実績】

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

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	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	1,000,000	―	1,000,000
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	8,804,375	7,895,419	1,908,956
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	451,037	664,291	1,695,702
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	1,744,252	194,813	3,245,141
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	4,444,257	167,909	7,521,489
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	24,911,999	1,513,796	30,919,692
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	35,902,050	27,787,732	39,034,010
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	35,772,205	23,610,777	51,195,438
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	15,621,106	11,296,402	55,520,142
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	29,294,620	21,872,861	62,941,901

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

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	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	6,075,969	―	6,075,969
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	2,068,674	―	8,144,643
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	2,025,169	81,395	10,088,417

第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	2,319,305	358,872	12,048,850
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	4,702,172	11,092,879	5,658,143
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	11,794,261	2,520,687	14,931,717
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	25,668,820	4,626,970	35,973,567
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	13,457,422	20,549,656	28,881,333
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	33,353,972	4,620,506	57,614,799
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	19,468,653	16,263,072	60,820,380

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

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	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	1,801,377	―	1,801,377
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	9,453,063	547,575	10,706,865
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	6,970,199	1,908,436	15,768,628
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	6,196,189	8,722,320	13,242,497
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	16,606,747	9,215,518	20,633,726
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	41,287,216	11,094,349	50,826,593
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	49,089,529	18,212,059	81,704,063
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	25,304,256	22,165,672	84,842,647
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	52,908,557	37,565,287	100,185,917
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	31,827,578	16,274,452	115,739,043

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

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	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	4,156,362	―	4,156,362
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	3,385,628	513,347	7,028,643
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	4,890,861	398,904	11,520,600
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	10,182,482	3,785,371	17,917,711
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	6,514,791	12,874,980	11,557,522
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	32,097,314	3,947,189	39,707,647
第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	47,714,020	10,012,998	77,408,669
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	24,056,011	31,031,071	70,433,609
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	36,482,971	16,008,166	90,908,414
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	27,429,451	15,981,549	102,356,316

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）

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	2009年 9月 2日～2010年 5月28日	1,100,840	―	1,100,840
第2計算期間	2010年 5月29日～2011年 5月30日	3,095,209	133,061	4,062,988
第3計算期間	2011年 5月31日～2012年 5月28日	4,615,071	2,002,933	6,675,126
第4計算期間	2012年 5月29日～2013年 5月28日	5,849,917	1,477,495	11,047,548
第5計算期間	2013年 5月29日～2014年 5月28日	14,274,311	8,410,069	16,911,790
第6計算期間	2014年 5月29日～2015年 5月28日	63,952,024	33,894,421	46,969,393

第7計算期間	2015年 5月29日～2016年 5月30日	66,146,858	37,966,094	75,150,157
第8計算期間	2016年 5月31日～2017年 5月29日	30,974,696	32,502,355	73,622,498
第9計算期間	2017年 5月30日～2018年 5月28日	47,877,906	26,444,776	95,055,628
第10計算期間	2018年 5月29日～2019年 5月28日	30,262,954	38,646,662	86,671,920

＜参考情報＞

2019年5月31日現在

LPS4資産分散ファンド(慎重型) 安定的な運用を重視し、中長期的な資産の成長を目指します。

●基準価額・純資産総額の推移

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※ベンチマークは設定日前営業日(設定日：2009年9月2日)を10,000円として指数化したもので、参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。
※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	-0.71	+0.08	+0.77	+0.53	+2.38	+30.60
ベンチマーク	-0.66	+0.15	+0.98	+1.00	+3.76	+37.25

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

●基準価額・純資産総額

基準価額	13,060円
純資産総額	82百万円

●分配の推移(1万口当たり、税引前)

第6期	2015年 5月 28日	0円
第7期	2016年 5月 30日	0円
第8期	2017年 5月 29日	0円
第9期	2018年 5月 28日	0円
第10期	2019年 5月 28日	0円
設定来累計		分配実績なし

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

●主要な資産の状況(%)

ファンド名	比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	8.5	9.0	-0.5
TMA日本債券インデックスマザーファンド	70.9	70.0	+0.9
TMA外国株式インデックスマザーファンド	5.6	6.0	-0.4
TMA外国債券インデックスマザーファンド	15.0	15.0	-0.0
短期金融資産等	0.0	－	+0.0

※比率は純資産総額に占める割合です。
ベンチマークは、TOPIX、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。
基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、MSCIコクサイ指数は、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したもの、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。
出所：ブルームバーグ

LPS4資産分散ファンド(安定重視型) 安定性に成長性を加味し、中長期的な資産の成長を目指します。

●基準価額・純資産総額の推移

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※ベンチマークは設定日前営業日(設定日：2009年9月2日)を10,000円として指数化したもので、参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。
※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	-1.68	-0.50	-0.23	-0.29	+4.96	+43.07
ベンチマーク	-1.62	-0.51	-0.07	+0.07	+5.98	+48.60

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

●基準価額・純資産総額

基準価額	14,307円
純資産総額	87百万円

●分配の推移(1万口当たり、税引前)

第6期	2015年 5月 28日	0円
第7期	2016年 5月 30日	0円
第8期	2017年 5月 29日	0円
第9期	2018年 5月 28日	0円
第10期	2019年 5月 28日	0円
設定来累計		分配実績なし

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

●主要な資産の状況(%)

ファンド名	比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	15.2	16.0	-0.8
TMA日本債券インデックスマザーファンド	51.1	50.0	+1.1
TMA外国株式インデックスマザーファンド	10.5	11.0	-0.5
TMA外国債券インデックスマザーファンド	23.2	23.0	+0.2
短期金融資産等	0.0	－	+0.0

※比率は純資産総額に占める割合です。
ベンチマークは、TOPIX、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。
基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、MSCIコクサイ指数は、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したもの、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。
出所：ブルームバーグ

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

2019年5月31日現在

LPS4資産分散ファンド(バランス型)　安定性と成長性の双方を重視し、中長期的な資産の成長を目指します。

基準価額・純資産総額の推移

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※ベンチマークは設定日前営業日(設定日：2009年9月2日)を10,000円として指数化したもので、参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。
※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1カ月	3カ月	6カ月	1年	3年	設定来
ファンド	-2.62	-1.10	-1.22	-1.36	+8.28	+58.04
ベンチマーク	-2.55	-1.18	-1.13	-1.14	+8.80	+61.07

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

基準価額・純資産総額

基準価額	15,804円
純資産総額	184百万円

分配の推移(1万口当たり、税引前)

第6期	2015年 5月 28日	0円
第7期	2016年 5月 30日	0円
第8期	2017年 5月 29日	0円
第9期	2018年 5月 28日	0円
第10期	2019年 5月 28日	0円
設定来累計		分配実績なし

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

主要な資産の状況(%)

ファンド名	比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	23.0	24.0	-1.0
TMA日本債券インデックスマザーファンド	37.2	36.0	+1.2
TMA外国株式インデックスマザーファンド	15.4	16.0	-0.6
TMA外国債券インデックスマザーファンド	24.4	24.0	+0.4
短期金融資産等	0.0	－	+0.0

※比率は純資産総額に占める割合です。
ベンチマークは、TOPIX、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。
基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、MSCIコクサイ指数は、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したもの、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。
出所：ブルームバーグ

LPS4資産分散ファンド(成長重視型)　成長性を重視し、中長期的な資産の成長を目指します。

基準価額・純資産総額の推移

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※ベンチマークは設定日前営業日(設定日：2009年9月2日)を10,000円として指数化したもので、参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。
※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1カ月	3カ月	6カ月	1年	3年	設定来
ファンド	-3.59	-1.72	-2.20	-2.66	+11.38	+71.83
ベンチマーク	-3.52	-1.91	-2.23	-2.62	+11.31	+72.48

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

基準価額・純資産総額

基準価額	17,183円
純資産総額	176百万円

分配の推移(1万口当たり、税引前)

第6期	2015年 5月 28日	0円
第7期	2016年 5月 30日	0円
第8期	2017年 5月 29日	0円
第9期	2018年 5月 28日	0円
第10期	2019年 5月 28日	0円
設定来累計		分配実績なし

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

主要な資産の状況(%)

ファンド名	比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	32.0	33.0	-1.0
TMA日本債券インデックスマザーファンド	28.2	27.0	+1.2
TMA外国株式インデックスマザーファンド	21.3	22.0	-0.7
TMA外国債券インデックスマザーファンド	18.5	18.0	+0.5
短期金融資産等	0.0	－	+0.0

※比率は純資産総額に占める割合です。
ベンチマークは、TOPIX、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。
基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、MSCIコクサイ指数は、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したもの、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。
出所：ブルームバーグ

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

2019年5月31日現在

LPS4資産分散ファンド(積極型)

成長性を積極的に追及し、中長期的な資産の成長を目指します。

●基準価額・純資産総額の推移

※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※ベンチマークは設定日前営業日(設定日：2009年9月2日)を10,000円として指数化したもので、参考情報として記載しており、ファンドの運用実績ではありません。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。
※上記グラフは過去の実績であり、将来の運用成果をお約束するものではありません。

●騰落率(税引前分配金再投資、%)

	1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年	設定来
ファンド	-4.56	-2.35	-3.21	-4.02	+13.77	+84.62
ベンチマーク	-4.49	-2.63	-3.35	-4.19	+13.12	+82.88

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

●基準価額・純資産総額

基準価額	18,462円
純資産総額	160百万円

●分配の推移(1万口当たり、税引前)

第6期	2015年 5月 28日	0円
第7期	2016年 5月 30日	0円
第8期	2017年 5月 29日	0円
第9期	2018年 5月 28日	0円
第10期	2019年 5月 28日	0円
設定来累計		分配実績なし

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

●主要な資産の状況(%)

ファンド名	比率	基本資産配分	差
TMA日本株TOPIXマザーファンド	41.1	42.0	-0.9
TMA日本債券インデックスマザーファンド	19.0	18.0	+1.0
TMA外国株式インデックスマザーファンド	27.4	28.0	-0.6
TMA外国債券インデックスマザーファンド	12.5	12.0	+0.5
短期金融資産等	0.0	－	+0.0

※比率は純資産総額に占める割合です。
ベンチマークは、TOPIX、NOMURA-BPI(総合)、MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース)、FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)を基本資産配分で組み合わせた合成指数です。
基準価額は対顧客電信売買相場の仲値(TTM)を用いて計算しているため、MSCIコクサイ指数は、基準日前日のMSCIコクサイ指数(米ドルベース)を基準日のTTMで委託会社が円換算したもの、FTSE世界国債インデックスは、FTSE世界国債インデックス(国内投信用)を使用しています。
出所：ブルームバーグ

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

2019年5月31日現在

年間収益率の推移

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

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

第２【管理及び運営】

１【申込（販売）手続等】

a.毎営業日にお申込みを受け付けます。ただし、お申込み日がニューヨーク証券取引所、英国証券取引所およびフランクフルト証券取引所のいずれかの休業日に該当する日には、お申込みの受付を行いません。

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

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

c.販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、１口単位で取得することができます。

d.取得申込の受付は、原則として午後３時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。

e.受益権の取得申込価額は以下の通りです。
取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに問い合わせることにより知ることができます。
●委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）
東京海上アセットマネジメント　サービスデスク
０１２０－７１２－０１６（土日祝日・年末年始を除く９時～17時）

f.申込手数料は、発行価格に2.16%＊（税抜２%）の率を乗じて得た額を上限として販売会社が個別に定める額とします。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
＊消費税率が10%となった場合は、2.2%となります。

g.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。

h.取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとします。振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

i.定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

j.販売会社によって、各ファンド間の乗換え（「スイッチング」といいます。）が可能な場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

２【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。ただし、解約請求日がニューヨーク証券取引所、英国証券取引所およびフランクフルト証券取引所のいずれかの休業日に該当する日には、お申込みの受付を行いません。

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、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
※信託財産留保額はありません。

g.解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに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。

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
先物取引	国内取引所に上場されているものは、当該取引所が発表する計算日の清算値段または証拠金算定基準値段で評価します。 海外取引所に上場されているものは、当該海外取引所が発表する計算日に知りうる直近の日の清算価格または最終相場で評価するものとします。

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、2009年９月２日から2021年５月28日までとします。ただし、後記「(5)その他 ①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５月29日から翌年５月28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】

① 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30億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、「②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。受託会社が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、「②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。

② 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「②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.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあっ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っても、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。

③ 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。

④ 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、知れている受益者に対して、販売会社から、あらかじめお申し出いただいたご住所にお届けします。
b.委託会社は、運用報告書（全体版）を作成し、委託会社のホームページ（https://www.tokiomarineam.co.jp/）に掲載します。
c.上記b.の規定にかかわらず、受益者から運用報告書（全体版）の交付の請求があった場合は、交付します。

⑤ 公告

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

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

4【受益者の権利等】

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

① 収益分配金の請求権

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

② 償還金の請求権

償還金（信託終了時における信託財産の純資産総額を受益権総口数で除した金額をいいます。以下同じ。）は、信託終了日後１ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として償還日（償還日が休業日の場合には当該償還日の翌営業日）から起算して５営業日まで）から、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者とします。）にお支払いします。ただし、受益者が償還金について、上記に規定する支払開始日から10年間その支払いを請求しないときは、その権利を失い、委託会社が受託会社より交付を受けた金銭は委託会社に帰属します。

③ 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。

④ 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10期計算期間（2018年5月29日から2019年5月28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】
【ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	72,309,689	82,306,219
未収入金	320,272	294,944
流動資産合計	72,629,961	82,601,163
資産合計	72,629,961	82,601,163
負債の部		
流動負債		
未払解約金	84,852	－
未払受託者報酬	15,423	19,312
未払委託者報酬	205,628	257,351
その他未払費用	3,312	4,194
流動負債合計	309,215	280,857
負債合計	309,215	280,857
純資産の部		
元本等		
元本	※1 55,520,142	※1 62,941,901
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,800,604	19,378,405
（分配準備積立金）	1,956,921	2,065,734
元本等合計	72,320,746	82,320,306
純資産合計	72,320,746	82,320,306
負債純資産合計	72,629,961	82,601,163

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	1,697,347	788,226
営業収益合計	1,697,347	788,226
営業費用		
受託者報酬	31,045	37,362
委託者報酬	413,922	497,952
その他費用	6,707	8,095
営業費用合計	451,674	543,409
営業利益又は営業損失（△）	1,245,673	244,817
経常利益又は経常損失（△）	1,245,673	244,817
当期純利益又は当期純損失（△）	1,245,673	244,817
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（△）	175,278	4,273
期首剰余金又は期首欠損金（△）	14,186,596	16,800,604
剰余金増加額又は欠損金減少額	4,685,281	8,963,952
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	4,685,281	8,963,952
剰余金減少額又は欠損金増加額	3,141,668	6,626,695
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	3,141,668	6,626,695
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	16,800,604	19,378,405

(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10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1.※1 期首元本額	51,195,438円	55,520,142円
期中追加設定元本額	15,621,106円	29,294,620円
期中一部解約元本額	11,296,402円	21,872,861円
2.※1 計算期間末日における受益権の総数	55,520,142口	62,941,901口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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（861,611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（42,806円）、投資信託約款に規定される収益調整金（14,843,683円）及び分配準備積立金（1,052,504円）より、分配対象額は16,800,604円（１万口当たり3,026.00円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（699,148円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（17,312,671円）及び分配準備積立金（1,366,586円）より、分配対象額は19,378,405円（１万口当たり3,078.75円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
第9期（自 2017年5月30日　至 2018年5月28日）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,351,323
合計	1,351,323

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

第10期（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	796,016
合計	796,016

(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9期 [2018年 5月28日現在]		第10期 [2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.3026円	1口当たり純資産額	1.3079円
（1万口当たり純資産額	13,026円）	（1万口当たり純資産額	13,079円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	5,600,664	7,138,606	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	7,990,743	12,322,524	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	1,932,867	4,716,968	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	44,566,527	58,128,121	
親投資信託受益証券 合計		60,090,801	82,306,219	
合計		60,090,801	82,306,219	

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。

【ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	83,082,388	87,396,954
未収入金	322,960	297,386
流動資産合計	83,405,348	87,694,340
資産合計	83,405,348	87,694,340
負債の部		
流動負債		
未払解約金	33,892	－
未払受託者報酬	18,919	19,466
未払委託者報酬	252,260	259,494
その他未払費用	4,120	4,251
流動負債合計	309,191	283,211
負債合計	309,191	283,211
純資産の部		
元本等		
元本	※1 57,614,799	※1 60,820,380
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	25,481,358	26,590,749
（分配準備積立金）	2,612,327	2,903,172
元本等合計	83,096,157	87,411,129
純資産合計	83,096,157	87,411,129
負債純資産合計	83,405,348	87,694,340

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,140,103	330,642
営業収益合計	2,140,103	330,642
営業費用		
受託者報酬	31,837	39,384
委託者報酬	424,443	525,004
その他費用	6,925	8,597
営業費用合計	463,205	572,985
営業利益又は営業損失（△）	1,676,898	△242,343
経常利益又は経常損失（△）	1,676,898	△242,343
当期純利益又は当期純損失（△）	1,676,898	△242,343
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（△）	141,091	△6,532
期首剰余金又は期首欠損金（△）	11,346,004	25,481,358
剰余金増加額又は欠損金減少額	14,452,042	8,535,245
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	14,452,042	8,535,245
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,852,495	7,190,043
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,852,495	7,190,043
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	25,481,358	26,590,749

(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10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1.※1 期首元本額	28,881,333円	57,614,799円
期中追加設定元本額	33,353,972円	19,468,653円
期中一部解約元本額	4,620,506円	16,263,072円
2.※1 計算期間末日における受益権の総数	57,614,799口	60,820,380口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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（1,114,632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（25,304円）、投資信託約款に規定される収益調整金（22,869,031円）及び分配準備積立金（1,472,391円）より、分配対象額は25,481,358円（1万口当たり4,422.68円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（940,130円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（23,687,577円）及び分配準備積立金（1,963,042円）より、分配対象額は26,590,749円（1万口当たり4,371.99円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
第9期（自 2017年5月30日　至 2018年5月28日）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,771,561
合計	1,771,561

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

第10期（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	461,180
合計	461,180

(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9期 [2018年 5月28日現在]		第10期 [2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.4423円	1口当たり純資産額	1.4372円
（1万口当たり純資産額	14,423円）	（1万口当たり純資産額	14,372円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	10,644,838	13,567,910	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	13,097,881	20,198,242	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	3,789,447	9,247,766	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	34,028,242	44,383,036	
親投資信託受益証券 合計		61,560,408	87,396,954	
合計		61,560,408	87,396,954	

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。

【ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	161,615,788	184,301,996
未収入金	588,831	659,247
流動資産合計	162,204,619	184,961,243
資産合計	162,204,619	184,961,243
負債の部		
流動負債		
未払解約金	27,923	－
未払受託者報酬	36,706	43,145
未払委託者報酬	489,379	575,195
その他未払費用	8,069	9,494
流動負債合計	562,077	627,834
負債合計	562,077	627,834
純資産の部		
元本等		
元本	※1 100,185,917	※1 115,739,043
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	61,456,625	68,594,366
（分配準備積立金）	9,806,321	10,752,302
元本等合計	161,642,542	184,333,409
純資産合計	161,642,542	184,333,409
負債純資産合計	162,204,619	184,961,243

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	7,806,695	△771,489
営業収益合計	7,806,695	△771,489
営業費用		
受託者報酬	71,480	84,479
委託者報酬	952,942	1,126,189
その他費用	15,699	18,589
営業費用合計	1,040,121	1,229,257
営業利益又は営業損失（△）	6,766,574	△2,000,746
経常利益又は経常損失（△）	6,766,574	△2,000,746
当期純利益又は当期純損失（△）	6,766,574	△2,000,746
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（△）	1,712,727	△71,103
期首剰余金又は期首欠損金（△）	45,422,542	61,456,625
剰余金増加額又は欠損金減少額	31,416,275	19,023,599
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	31,416,275	19,023,599
剰余金減少額又は欠損金増加額	20,436,039	9,956,215
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	20,436,039	9,956,215
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	61,456,625	68,594,366

(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10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1.※1 期首元本額	84,842,647円	100,185,917円
期中追加設定元本額	52,908,557円	31,827,578円
期中一部解約元本額	37,565,287円	16,274,452円
2.※1 計算期間末日における受益権の総数	100,185,917口	115,739,043口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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（2,729,733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（1,794,257円）、投資信託約款に規定される収益調整金（51,650,304円）及び分配準備積立金（5,282,331円）より、分配対象額は61,456,625円（1万口当たり6,134.22円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,310,292円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（57,842,064円）及び分配準備積立金（8,442,010円）より、分配対象額は68,594,366円（1万口当たり5,926.62円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
第9期（自 2017年5月30日　至 2018年5月28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	5,696,780
合計	5,696,780

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

第10期（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	△497,063
合計	△497,063

(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9期 [2018年 5月28日現在]		第10期 [2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.6134円	1口当たり純資産額	1.5927円
（1万口当たり純資産額	16,134円）	（1万口当たり純資産額	15,927円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	33,891,316	43,197,871	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	29,007,809	44,732,942	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	11,698,912	28,550,024	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	51,998,129	67,821,159	
親投資信託受益証券 合計		126,596,166	184,301,996	
合計		126,596,166	184,301,996	

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。

【ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	161,781,602	177,814,653
未収入金	674,440	656,975
流動資産合計	162,456,042	178,471,628
資産合計	162,456,042	178,471,628
負債の部		
流動負債		
未払解約金	100,354	6
未払受託者報酬	37,570	42,991
未払委託者報酬	500,919	573,155
その他未払費用	8,252	9,470
流動負債合計	647,095	625,622
負債合計	647,095	625,622
純資産の部		
元本等		
元本	※1 90,908,414	※1 102,356,316
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	70,900,533	75,489,690
（分配準備積立金）	13,835,369	14,288,001
元本等合計	161,808,947	177,846,006
純資産合計	161,808,947	177,846,006
負債純資産合計	162,456,042	178,471,628

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	9,338,940	△2,733,750
営業収益合計	9,338,940	△2,733,750
営業費用		
受託者報酬	68,159	85,278
委託者報酬	908,693	1,136,874
その他費用	14,968	18,776
営業費用合計	991,820	1,240,928
営業利益又は営業損失（△）	8,347,120	△3,974,678
経常利益又は経常損失（△）	8,347,120	△3,974,678
当期純利益又は当期純損失（△）	8,347,120	△3,974,678
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（△）	1,094,487	△235,809
期首剰余金又は期首欠損金（△）	46,761,161	70,900,533
剰余金増加額又は欠損金減少額	27,772,529	20,747,487
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	27,772,529	20,747,487
剰余金減少額又は欠損金増加額	10,885,790	12,419,461
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	10,885,790	12,419,461
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	70,900,533	75,489,690

(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10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1.※1 期首元本額	70,433,609円	90,908,414円
期中追加設定元本額	36,482,971円	27,429,451円
期中一部解約元本額	16,008,166円	15,981,549円
2.※1 計算期間末日における受益権の総数	90,908,414口	102,356,316口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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（2,844,149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（4,408,484円）、投資信託約款に規定される収益調整金（57,065,164円）及び分配準備積立金（6,582,736円）より、分配対象額は70,900,533円（1万口当たり7,799.09円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,480,741円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（61,201,689円）及び分配準備積立金（11,807,260円）より、分配対象額は75,489,690円（1万口当たり7,375.16円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
第9期（自 2017年5月30日　至 2018年5月28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	7,920,310
合計	7,920,310

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

第10期（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	△2,183,563
合計	△2,183,563

(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9期 [2018年 5月28日現在]		第10期 [2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.7799円	1口当たり純資産額	1.7375円
（1万口当たり純資産額	17,799円）	（1万口当たり純資産額	17,375円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	45,265,505	57,695,412	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	21,130,671	32,585,607	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	15,625,177	38,131,681	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	37,876,220	49,401,953	
親投資信託受益証券 合計		119,897,573	177,814,653	
合計		119,897,573	177,814,653	

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。

【ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）】
(1)【貸借対照表】

（単位：円）

	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	184,556,408	162,337,949
未収入金	651,581	1,054,267
流動資産合計	185,207,989	163,392,216
資産合計	185,207,989	163,392,216
負債の部		
流動負債		
未払解約金	15,309	395,978
未払受託者報酬	41,635	43,077
未払委託者報酬	555,106	574,297
その他未払費用	9,169	9,470
流動負債合計	621,219	1,022,822
負債合計	621,219	1,022,822
純資産の部		
元本等		
元本	※1 95,055,628	※1 86,671,920
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（△）	89,531,142	75,697,474
（分配準備積立金）	13,300,157	11,147,804
元本等合計	184,586,770	162,369,394
純資産合計	184,586,770	162,369,394
負債純資産合計	185,207,989	163,392,216

(2)【損益及び剰余金計算書】

（単位：円）

	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
営業収益		
有価証券売買等損益	12,560,822	△4,432,378
営業収益合計	12,560,822	△4,432,378
営業費用		
受託者報酬	76,225	89,527
委託者報酬	1,016,159	1,193,604
その他費用	16,766	19,701
営業費用合計	1,109,150	1,302,832
営業利益又は営業損失（△）	11,451,672	△5,735,210
経常利益又は経常損失（△）	11,451,672	△5,735,210
当期純利益又は当期純損失（△）	11,451,672	△5,735,210
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（△）	2,709,363	△818,978
期首剰余金又は期首欠損金（△）	58,000,824	89,531,142
剰余金増加額又は欠損金減少額	44,135,837	27,228,620
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	44,135,837	27,228,620
剰余金減少額又は欠損金増加額	21,347,828	36,146,056
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	21,347,828	36,146,056
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	－	－
分配金	※1 －	※1 －
期末剰余金又は期末欠損金（△）	89,531,142	75,697,474

(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10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1.※1 期首元本額	73,622,498円	95,055,628円
期中追加設定元本額	47,877,906円	30,262,954円
期中一部解約元本額	26,444,776円	38,646,662円
2.※1 計算期間末日における受益権の総数	95,055,628口	86,671,920口

（損益及び剰余金計算書に関する注記）

第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28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（3,283,017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（5,218,635円）、投資信託約款に規定される収益調整金（76,230,985円）及び分配準備積立金（4,798,505円）より、分配対象額は89,531,142円（1万口当たり9,418.77円）でありますが、分配を行っておりません。	※1　分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額（2,260,332円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（64,549,670円）及び分配準備積立金（8,887,472円）より、分配対象額は75,697,474円（1万口当たり8,733.77円）でありますが、分配を行っておりません。

（金融商品に関する注記）

I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	第9期 自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	第10期 自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	第9期 [2018年 5月28日現在]	第10期 [2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
第9期（自 2017年5月30日　至 2018年5月28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	9,696,960
合計	9,696,960

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

第10期（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	△3,279,958
合計	△3,279,958

(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9期 [2018年 5月28日現在]		第10期 [2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.9419円	1口当たり純資産額	1.8734円
（1万口当たり純資産額	19,419円）	（1万口当たり純資産額	18,734円）

(4)【附属明細表】

第1　有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

（単位：円）

種　類	銘　柄	券面総額	評価額	備考
親投資信託受益証券	ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド	52,955,054	67,496,511	
	ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド	12,947,124	19,965,759	
	ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド	18,278,820	44,607,632	
	ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド	23,206,354	30,268,047	
親投資信託受益証券 合計		107,387,352	162,337,949	
合計		107,387,352	162,337,949	

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）

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）、ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）は、「ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド」、「ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド」、「ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド」、「ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド」を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。
なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28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		3,393,709,271	2,227,909,799
株式	※2	50,269,924,780	35,838,993,320
派生商品評価勘定		49,582,640	1,838,400
未収入金		116,896,113	66,832,802
未収配当金		596,538,534	379,322,383
前払金		—	79,010,000
流動資産合計		54,426,651,338	38,593,906,704
資産合計		54,426,651,338	38,593,906,704
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		3,744,040	52,072,480

前受金		76,360,000	―
未払金		1,248,737,247	1,085,981,187
未払解約金		141,547,146	28,743,104
未払利息		9,465	2,830
流動負債合計		1,470,397,898	1,166,799,601
負債合計		1,470,397,898	1,166,799,601
純資産の部			
元本等			
元本	※1	37,314,542,259	29,363,112,802
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		15,641,711,181	8,063,994,301
元本等合計		52,956,253,440	37,427,107,103
純資産合計		52,956,253,440	37,427,107,103
負債純資産合計		54,426,651,338	38,593,906,704

(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 5月29日 至 2019年 5月28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 5月28日現在]	[2019年 5月28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	56,917,619,977円	37,314,542,259円
同期中における追加設定元本額	54,862,001,175円	16,492,594,222円
同期中における一部解約元本額	74,465,078,893円	24,444,023,679円
同期末における元本額	37,314,542,259円	29,363,112,802円
元本の内訳＊		
円資産バランスファンド2018－09＜適格機関投資家限定＞	―円	293,729,565円
東京海上日本株ＴＯＰＩＸファンド	318,508,196円	286,247,310円
東京海上セレクション・日本株ＴＯＰＩＸ	16,064,993,963円	16,298,992,035円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	4,573,781円	5,600,664円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	9,352,353円	10,644,838円

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	27,285,576円	33,891,316円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	37,502,672円	45,265,505円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	53,091,677円	52,955,054円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	159,801円	1,385,610円
ＴＭＡ日本株式インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	227,590,653円	239,860,905円
ＴＭＡ世界バランスファンド55ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,285,459円	―円
ＴＭＡ世界バランスファンド35ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,679,059,071円	109,442,438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＞	5,069,569円	31,009,465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＞	43,308,724円	220,043,482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＞	18,842,760,764円	11,734,044,615円
計	37,314,542,259円	29,363,112,802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	37,314,542,259口	29,363,112,802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 881,160,000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 789,465,000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）
I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

II．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2017年5月30日　至 2018年5月28日）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,486,724,278
合計	1,486,724,278

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2018年3月21日から2018年5月28日まで)を指しております。

（自 2018年5月29日　至 2019年5月28日）
売買目的有価証券

（単位：円）

種類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	△1,423,656,883
合計	△1,423,656,883

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2019年3月21日から2019年5月28日まで)を指しております。

（デリバティブ取引等に関する注記）
取引の時価等に関する事項

株式関連
（2018年5月28日現在）

（単位：円）

区分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	3,590,640,000	—	3,636,700,000	46,060,000
	東証株価指数先物	3,590,640,000	—	3,636,700,000	46,060,000

合計	3,590,640,000	—	3,636,700,000	46,060,000

（2019年5月28日現在）

（単位：円）

区分	種　類	契約額等	うち1年超	時　価	評価損益
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	1,614,110,000	—	1,563,985,000	△50,125,000
	東証株価指数先物	1,614,110,000	—	1,563,985,000	△50,125,000
合計		1,614,110,000	—	1,563,985,000	△50,125,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2.株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3.契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

4.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

（1口当たり情報に関する注記）

[2018年 5月28日現在]		[2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.4192円	1口当たり純資産額	1.2746円
（1万口当たり純資産額	14,192円）	（1万口当たり純資産額	12,746円）

(3) 附属明細表

第1　有価証券明細表

(1)株式

（単位：円）

銘　柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
日本水産	21,300	655.00	13,951,500	
マルハニチロ	3,300	3,435.00	11,335,500	
サカタのタネ	2,500	3,425.00	8,562,500	
ホクト	2,400	1,813.00	4,351,200	
国際石油開発帝石	87,700	903.40	79,228,180	
石油資源開発	3,200	2,327.00	7,446,400	
K＆Oエナジーグループ	3,200	1,648.00	5,273,600	
ショーボンドホールディングス	1,600	7,550.00	12,080,000	
ミライト・ホールディングス	6,100	1,697.00	10,351,700	
ベステラ	3,200	1,270.00	4,064,000	
安藤・間	13,700	706.00	9,672,200	
東急建設	8,700	771.00	6,707,700	
コムシスホールディングス	7,900	2,610.00	20,619,000	
ミサワホーム	6,600	1,013.00	6,685,800	
東建コーポレーション	1,000	6,470.00	6,470,000	
ヤマウラ	5,600	841.00	4,709,600	

大成建設	18,000	4,090.00	73,620,000	
大林組	54,700	991.00	54,207,700	
清水建設	55,900	878.00	49,080,200	
長谷工コーポレーション	22,500	1,115.00	25,087,500	
鹿島建設	42,400	1,506.00	63,854,400	
西松建設	3,800	2,080.00	7,904,000	
三井住友建設	13,300	618.00	8,219,400	
前田建設工業	13,100	893.00	11,698,300	
奥村組	2,900	3,460.00	10,034,000	
東鉄工業	2,100	3,215.00	6,751,500	
戸田建設	21,900	601.00	13,161,900	
熊谷組	2,500	2,882.00	7,205,000	
大東建託	6,400	14,245.00	91,168,000	
ＮＩＰＰＯ	4,900	2,131.00	10,441,900	
前田道路	5,600	2,218.00	12,420,800	
東亜建設工業	4,300	1,574.00	6,768,200	
五洋建設	21,500	483.00	10,384,500	
住友林業	12,500	1,231.00	15,387,500	
日本基礎技術	13,800	362.00	4,995,600	
大和ハウス工業	50,000	3,369.00	168,450,000	
積水ハウス	55,300	1,778.50	98,351,050	
北陸電気工事	5,200	826.00	4,295,200	
中電工	3,200	2,222.00	7,110,400	
関電工	7,600	877.00	6,665,200	
きんでん	12,200	1,658.00	20,227,600	
日本電設工業	3,400	2,419.00	8,224,600	
協和エクシオ	6,900	2,473.00	17,063,700	
新日本空調	4,200	1,762.00	7,400,400	
九電工	3,500	3,195.00	11,182,500	
三機工業	6,400	1,255.00	8,032,000	
日揮	15,800	1,424.00	22,499,200	
中外炉工業	2,300	1,665.00	3,829,500	
ヤマト	7,800	536.00	4,180,800	
高砂熱学工業	4,600	1,686.00	7,755,600	
三晃金属工業	1,200	2,528.00	3,033,600	
大氣社	2,300	3,335.00	7,670,500	
日比谷総合設備	4,500	1,871.00	8,419,500	
東芝プラントシステム	3,900	1,947.00	7,593,300	
ＯＳＪＢホールディングス	25,400	285.00	7,239,000	
東洋エンジニアリング	11,000	465.00	5,115,000	
新興プランテック	5,700	1,187.00	6,765,900	
日本製粉	4,900	1,845.00	9,040,500	
日清製粉グループ本社	18,400	2,634.00	48,465,600	

鳥越製粉	7,000	749.00	5,243,000	
日本甜菜製糖	3,300	1,969.00	6,497,700	
三井製糖	2,200	2,380.00	5,236,000	
森永製菓	4,100	5,030.00	20,623,000	
江崎グリコ	4,800	5,320.00	25,536,000	
山崎製パン	13,300	1,716.00	22,822,800	
亀田製菓	1,500	4,735.00	7,102,500	
寿スピリッツ	1,800	5,720.00	10,296,000	
カルビー	7,200	3,265.00	23,508,000	
森永乳業	3,100	4,065.00	12,601,500	
ヤクルト本社	12,000	6,520.00	78,240,000	
明治ホールディングス	11,500	7,900.00	90,850,000	
雪印メグミルク	3,800	2,173.00	8,257,400	
プリマハム	3,000	2,204.00	6,612,000	
日本ハム	6,600	4,515.00	29,799,000	
丸大食品	2,800	1,989.00	5,569,200	
Ｓ　Ｆｏｏｄｓ	1,600	3,850.00	6,160,000	
伊藤ハム米久ホールディングス	11,200	673.00	7,537,600	
サッポロホールディングス	5,800	2,364.00	13,711,200	
アサヒグループホールディングス	33,900	4,873.00	165,194,700	
キリンホールディングス	73,100	2,398.00	175,293,800	
宝ホールディングス	12,400	1,311.00	16,256,400	
オエノンホールディングス	16,300	387.00	6,308,100	
コカ・コーラボトラーズジャパンホールディングス	12,400	2,623.00	32,525,200	
サントリー食品インターナショナル	10,900	4,705.00	51,284,500	
ダイドーグループホールディングス	1,300	4,730.00	6,149,000	
伊藤園	5,000	5,470.00	27,350,000	
キーコーヒー	2,900	2,129.00	6,174,100	
ユニカフェ	4,000	982.00	3,928,000	
ジャパンフーズ	3,900	1,131.00	4,410,900	
日清オイリオグループ	2,200	3,285.00	7,227,000	
不二製油グループ本社	4,000	3,515.00	14,060,000	
Ｊ－オイルミルズ	1,300	4,030.00	5,239,000	
キッコーマン	10,700	5,000.00	53,500,000	
味の素	35,700	1,928.00	68,829,600	
キユーピー	9,100	2,575.00	23,432,500	
ハウス食品グループ本社	6,100	4,670.00	28,487,000	
カゴメ	6,500	2,658.00	17,277,000	
アリアケジャパン	1,400	7,350.00	10,290,000	
ニチレイ	8,400	2,742.00	23,032,800	
東洋水産	8,400	4,420.00	37,128,000	
日清食品ホールディングス	6,900	6,660.00	45,954,000	
フジッコ	2,900	2,195.00	6,365,500	

ロック・フィールド	4,900	1,636.00	8,016,400	
日本たばこ産業	93,400	2,547.50	237,936,500	
ユーグレナ	9,900	872.00	8,632,800	
片倉工業	5,300	1,258.00	6,667,400	
グンゼ	1,500	4,755.00	7,132,500	
東洋紡	6,400	1,229.00	7,865,600	
倉敷紡績	2,700	2,006.00	5,416,200	
日本毛織	7,900	864.00	6,825,600	
帝国繊維	2,600	2,285.00	5,941,000	
帝人	12,700	1,790.00	22,733,000	
東レ	122,100	743.10	90,732,510	
日本フエルト	10,500	465.00	4,882,500	
セーレン	4,100	1,417.00	5,809,700	
小松マテーレ	8,000	787.00	6,296,000	
ワコールホールディングス	4,400	2,729.00	12,007,600	
ホギメディカル	2,100	3,540.00	7,434,000	
ＴＳＩホールディングス	9,300	658.00	6,119,400	
三陽商会	3,000	1,726.00	5,178,000	
オンワードホールディングス	10,200	586.00	5,977,200	
ゴールドウイン	1,400	14,870.00	20,818,000	
デサント	3,600	1,883.00	6,778,800	
特種東海製紙	1,600	3,775.00	6,040,000	
王子ホールディングス	71,400	593.00	42,340,200	
日本製紙	7,500	1,942.00	14,565,000	
三菱製紙	9,900	564.00	5,583,600	
北越コーポレーション	11,900	574.00	6,830,600	
大王製紙	7,200	1,308.00	9,417,600	
レンゴー	16,200	1,003.00	16,248,600	
ザ・パック	1,800	3,120.00	5,616,000	
クラレ	26,600	1,215.00	32,319,000	
旭化成	112,400	1,163.50	130,777,400	
共和レザー	5,200	786.00	4,087,200	
昭和電工	10,500	3,075.00	32,287,500	
住友化学	125,400	475.00	59,565,000	
日産化学	9,800	4,650.00	45,570,000	
クレハ	1,500	7,140.00	10,710,000	
石原産業	5,800	1,052.00	6,101,600	
片倉コープアグリ	3,600	1,118.00	4,024,800	
日本曹達	2,800	2,719.00	7,613,200	
東ソー	24,800	1,395.00	34,596,000	
トクヤマ	4,500	2,477.00	11,146,500	
セントラル硝子	3,400	2,460.00	8,364,000	
東亞合成	10,200	1,194.00	12,178,800	

大阪ソーダ	2,400	2,610.00	6,264,000	
デンカ	6,100	3,195.00	19,489,500	
信越化学工業	27,800	9,284.00	258,095,200	
堺化学工業	2,500	2,486.00	6,215,000	
エア・ウォーター	13,200	1,624.00	21,436,800	
大陽日酸	13,300	2,120.00	28,196,000	
日本パーカライジング	8,400	1,205.00	10,122,000	
ステラ　ケミファ	2,100	2,671.00	5,609,100	
日本触媒	2,600	6,310.00	16,406,000	
カネカ	4,100	3,805.00	15,600,500	
三菱瓦斯化学	16,000	1,365.00	21,840,000	
三井化学	14,600	2,380.00	34,748,000	
ＪＳＲ	16,300	1,535.00	25,020,500	
東京応化工業	2,700	3,105.00	8,383,500	
三菱ケミカルホールディングス	106,300	713.30	75,823,790	
ＫＨネオケム	2,900	2,856.00	8,282,400	
ダイセル	24,100	957.00	23,063,700	
住友ベークライト	2,600	3,780.00	9,828,000	
積水化学工業	34,900	1,596.00	55,700,400	
日本ゼオン	14,600	1,046.00	15,271,600	
アイカ工業	4,700	3,785.00	17,789,500	
宇部興産	8,000	2,091.00	16,728,000	
旭有機材	4,700	1,419.00	6,669,300	
日立化成	7,400	2,916.00	21,578,400	
タイガースポリマー	5,800	592.00	3,433,600	
ミライアル	3,900	1,097.00	4,278,300	
日本化薬	9,600	1,258.00	12,076,800	
ＡＤＥＫＡ	7,500	1,567.00	11,752,500	
日油	6,100	3,950.00	24,095,000	
ハリマ化成グループ	5,600	999.00	5,594,400	
花王	39,100	8,883.00	347,325,300	
ニイタカ	2,800	1,544.00	4,323,200	
三洋化成工業	1,100	5,160.00	5,676,000	
日本ペイントホールディングス	13,000	4,390.00	57,070,000	
関西ペイント	18,000	2,042.00	36,756,000	
中国塗料	7,200	940.00	6,768,000	
太陽ホールディングス	2,400	3,310.00	7,944,000	
ＤＩＣ	7,100	2,784.00	19,766,400	
サカタインクス	4,700	967.00	4,544,900	
東洋インキＳＣホールディングス	3,200	2,311.00	7,395,200	
富士フイルムホールディングス	33,500	5,362.00	179,627,000	
資生堂	32,000	8,354.00	267,328,000	
ライオン	22,300	2,165.00	48,279,500	

高砂香料工業	1,700	3,025.00	5,142,500	
マンダム	3,600	2,741.00	9,867,600	
ミルボン	2,000	5,380.00	10,760,000	
ファンケル	6,900	2,880.00	19,872,000	
コーセー	2,700	17,850.00	48,195,000	
コタ	4,400	1,188.00	5,227,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	6,900	3,155.00	21,769,500	
ノエビアホールディングス	1,500	5,850.00	8,775,000	
エステー	3,300	1,780.00	5,874,000	
長谷川香料	3,600	1,835.00	6,606,000	
小林製薬	4,500	8,400.00	37,800,000	
荒川化学工業	4,400	1,246.00	5,482,400	
メック	6,000	1,014.00	6,084,000	
タカラバイオ	4,000	2,486.00	9,944,000	
アース製薬	1,400	5,100.00	7,140,000	
大成ラミック	1,900	2,807.00	5,333,300	
クミアイ化学工業	10,700	750.00	8,025,000	
日本農薬	12,700	410.00	5,207,000	
日東電工	11,100	5,004.00	55,544,400	
レック	2,400	1,294.00	3,105,600	
前澤化成工業	4,200	1,017.00	4,271,400	
エフピコ	1,700	6,370.00	10,829,000	
天馬	3,100	1,783.00	5,527,300	
信越ポリマー	9,100	778.00	7,079,800	
ニフコ	6,300	2,827.00	17,810,100	
バルカー	2,000	2,072.00	4,144,000	
ユニ・チャーム	34,100	3,375.00	115,087,500	
協和発酵キリン	19,100	2,134.00	40,759,400	
武田薬品工業	140,600	3,949.00	555,229,400	
アステラス製薬	148,400	1,507.50	223,713,000	
大日本住友製薬	12,100	2,357.00	28,519,700	
塩野義製薬	20,600	6,227.00	128,276,200	
田辺三菱製薬	17,100	1,287.00	22,007,700	
あすか製薬	5,900	1,187.00	7,003,300	
日本新薬	4,200	8,030.00	33,726,000	
中外製薬	16,800	7,160.00	120,288,000	
科研製薬	3,000	5,210.00	15,630,000	
エーザイ	19,200	6,591.00	126,547,200	
ロート製薬	8,200	3,190.00	26,158,000	
小野薬品工業	38,200	1,971.00	75,292,200	
久光製薬	4,700	4,695.00	22,066,500	
持田製薬	2,400	5,330.00	12,792,000	
参天製薬	30,300	1,654.00	50,116,200	

ツムラ	5,000	3,235.00	16,175,000	
日医工	5,000	1,303.00	6,515,000	
キッセイ薬品工業	2,700	2,656.00	7,171,200	
生化学工業	5,000	1,267.00	6,335,000	
栄研化学	2,700	1,937.00	5,229,900	
鳥居薬品	1,900	2,347.00	4,459,300	
ＪＣＲファーマ	1,100	7,220.00	7,942,000	
東和薬品	2,700	2,733.00	7,379,100	
沢井製薬	3,300	5,840.00	19,272,000	
ゼリア新薬工業	3,900	2,072.00	8,080,800	
第一三共	46,000	5,479.00	252,034,000	
キョーリン製薬ホールディングス	3,800	1,942.00	7,379,600	
大幸薬品	3,800	1,922.00	7,303,600	
大塚ホールディングス	30,600	3,841.00	117,534,600	
大正製薬ホールディングス	3,600	9,220.00	33,192,000	
ペプチドリーム	8,000	5,500.00	44,000,000	
ニチレキ	6,700	1,032.00	6,914,400	
出光興産	18,700	3,000.00	56,100,000	
ＪＸＴＧホールディングス	270,800	509.30	137,918,440	
コスモエネルギーホールディングス	4,500	2,170.00	9,765,000	
横浜ゴム	9,300	1,900.00	17,670,000	
ＴＯＹＯ　ＴＩＲＥ	8,100	1,343.00	10,878,300	
ブリヂストン	49,400	4,082.00	201,650,800	
住友ゴム工業	14,500	1,236.00	17,922,000	
オカモト	1,200	5,020.00	6,024,000	
ニッタ	1,900	3,115.00	5,918,500	
住友理工	7,400	823.00	6,090,200	
バンドー化学	4,400	949.00	4,175,600	
日東紡績	3,000	2,018.00	6,054,000	
ＡＧＣ	16,000	3,670.00	58,720,000	
日本山村硝子	3,400	1,510.00	5,134,000	
日本電気硝子	6,900	2,658.00	18,340,200	
住友大阪セメント	3,300	4,410.00	14,553,000	
太平洋セメント	10,200	3,320.00	33,864,000	
日本ヒューム	6,800	712.00	4,841,600	
東海カーボン	14,700	1,079.00	15,861,300	
東洋炭素	2,700	2,090.00	5,643,000	
ＴＯＴＯ	12,500	4,155.00	51,937,500	
日本碍子	19,500	1,513.00	29,503,500	
日本特殊陶業	13,700	1,940.00	26,578,000	
ニチアス	4,100	1,883.00	7,720,300	
ニチハ	2,500	2,862.00	7,155,000	
日本製鉄	73,700	1,845.50	136,013,350	

神戸製鋼所	29,400	705.00	20,727,000	
合同製鐵	2,300	2,085.00	4,795,500	
ジェイ　エフ　イー　ホールディングス	42,900	1,554.50	66,688,050	
東京製鐵	8,600	875.00	7,525,000	
共英製鋼	2,100	1,869.00	3,924,900	
大和工業	3,300	3,165.00	10,444,500	
大阪製鐵	3,000	1,790.00	5,370,000	
淀川製鋼所	2,900	2,001.00	5,802,900	
丸一鋼管	5,600	2,841.00	15,909,600	
大同特殊鋼	2,500	3,935.00	9,837,500	
山陽特殊製鋼	2,400	1,513.00	3,631,200	
愛知製鋼	1,000	3,265.00	3,265,000	
日立金属	17,100	1,108.00	18,946,800	
大平洋金属	1,300	2,245.00	2,918,500	
新日本電工	26,800	204.00	5,467,200	
三菱製鋼	4,200	1,173.00	4,926,600	
シンニッタン	11,500	345.00	3,967,500	
日本軽金属ホールディングス	44,600	232.00	10,347,200	
三井金属鉱業	4,300	2,192.00	9,425,600	
東邦亜鉛	1,300	2,334.00	3,034,200	
三菱マテリアル	10,400	2,829.00	29,421,600	
住友金属鉱山	21,900	2,922.50	64,002,750	
ＤＯＷＡホールディングス	3,800	3,365.00	12,787,000	
古河機械金属	4,300	1,369.00	5,886,700	
ＵＡＣＪ	3,400	1,750.00	5,950,000	
古河電気工業	4,500	2,817.00	12,676,500	
住友電気工業	59,400	1,346.00	79,952,400	
フジクラ	18,400	369.00	6,789,600	
タツタ電線	12,700	448.00	5,689,600	
リョービ	3,200	2,069.00	6,620,800	
アサヒホールディングス	3,600	2,053.00	7,390,800	
トーカロ	6,400	700.00	4,480,000	
ＳＵＭＣＯ	17,600	1,230.00	21,648,000	
東洋製罐グループホールディングス	10,100	2,087.00	21,078,700	
コロナ	4,100	1,024.00	4,198,400	
横河ブリッジホールディングス	4,200	1,546.00	6,493,200	
駒井ハルテック	1,800	1,619.00	2,914,200	
三和ホールディングス	16,100	1,092.00	17,581,200	
文化シヤッター	7,500	842.00	6,315,000	
三協立山	5,500	1,221.00	6,715,500	
ＬＩＸＩＬグループ	24,000	1,386.00	33,264,000	
ノーリツ	4,700	1,418.00	6,664,600	
長府製作所	2,700	2,191.00	5,915,700	

リンナイ	2,900	7,250.00	21,025,000	
日東精工	9,100	554.00	5,041,400	
東プレ	2,700	1,803.00	4,868,100	
高周波熱錬	7,800	866.00	6,754,800	
パイオラックス	2,700	1,838.00	4,962,600	
日本発條	16,300	814.00	13,268,200	
三益半導体工業	4,600	1,505.00	6,923,000	
日本製鋼所	4,900	1,655.00	8,109,500	
三浦工業	6,900	3,405.00	23,494,500	
タクマ	5,700	1,476.00	8,413,200	
オークマ	2,000	5,330.00	10,660,000	
東芝機械	2,900	2,273.00	6,591,700	
アマダホールディングス	24,700	1,124.00	27,762,800	
アイダエンジニアリング	7,600	744.00	5,654,400	
ＦＵＪＩ	5,700	1,210.00	6,897,000	
牧野フライス製作所	1,700	3,750.00	6,375,000	
オーエスジー	7,800	2,063.00	16,091,400	
旭ダイヤモンド工業	9,200	671.00	6,173,200	
DMG森精機	10,000	1,327.00	13,270,000	
ディスコ	2,200	15,280.00	33,616,000	
日東工器	2,900	2,180.00	6,322,000	
島精機製作所	2,300	3,070.00	7,061,000	
日阪製作所	7,000	925.00	6,475,000	
ナブテスコ	8,800	2,744.00	24,147,200	
ＳＭＣ	4,700	36,930.00	173,571,000	
ユニオンツール	2,000	2,756.00	5,512,000	
オイレス工業	3,000	1,521.00	4,563,000	
サトーホールディングス	2,400	2,758.00	6,619,200	
小松製作所	72,900	2,433.00	177,365,700	
住友重機械工業	9,100	3,495.00	31,804,500	
日立建機	6,400	2,577.00	16,492,800	
巴工業	2,600	2,336.00	6,073,600	
井関農機	3,300	1,496.00	4,936,800	
タカキタ	6,000	536.00	3,216,000	
クボタ	86,400	1,652.00	142,732,800	
月島機械	5,200	1,350.00	7,020,000	
帝国電機製作所	5,800	1,197.00	6,942,600	
新東工業	6,000	937.00	5,622,000	
小森コーポレーション	5,900	1,110.00	6,549,000	
鶴見製作所	3,600	1,947.00	7,009,200	
荏原製作所	7,100	2,749.00	19,517,900	
酉島製作所	6,400	958.00	6,131,200	
ダイキン工業	22,000	13,810.00	303,820,000	

栗田工業	8,600	2,572.00	22,119,200	
椿本チエイン	1,900	3,330.00	6,327,000	
ダイフク	8,900	5,420.00	48,238,000	
タダノ	7,800	1,042.00	8,127,600	
フジテック	6,100	1,441.00	8,790,100	
ＣＫＤ	6,000	1,029.00	6,174,000	
平和	4,500	2,206.00	9,927,000	
ＳＡＮＫＹＯ	4,000	4,225.00	16,900,000	
日本金銭機械	5,800	1,118.00	6,484,400	
福島工業	1,900	3,630.00	6,897,000	
竹内製作所	3,700	1,832.00	6,778,400	
アマノ	4,600	2,857.00	13,142,200	
グローリー	4,500	2,761.00	12,424,500	
大和冷機工業	6,400	1,222.00	7,820,800	
セガサミーホールディングス	16,300	1,349.00	21,988,700	
リケン	1,100	4,595.00	5,054,500	
ホシザキ	4,700	8,080.00	37,976,000	
大豊工業	5,800	835.00	4,843,000	
日本精工	33,700	903.00	30,431,100	
ＮＴＮ	37,300	291.00	10,854,300	
ジェイテクト	16,000	1,186.00	18,976,000	
不二越	1,500	4,350.00	6,525,000	
日本トムソン	9,500	460.00	4,370,000	
ＴＨＫ	10,200	2,276.00	23,215,200	
ユーシン精機	5,200	1,076.00	5,595,200	
キッツ	8,700	713.00	6,203,100	
マキタ	19,700	3,875.00	76,337,500	
日立造船	16,500	365.00	6,022,500	
三菱重工業	27,000	4,759.00	128,493,000	
ＩＨＩ	12,500	2,492.00	31,150,000	
スター精密	3,900	1,339.00	5,222,100	
日清紡ホールディングス	8,900	768.00	6,835,200	
イビデン	9,800	1,708.00	16,738,400	
コニカミノルタ	35,900	1,010.00	36,259,000	
ブラザー工業	20,800	1,903.00	39,582,400	
ミネベアミツミ	29,700	1,595.00	47,371,500	
日立製作所	72,300	3,794.00	274,306,200	
三菱電機	161,000	1,392.50	224,192,500	
富士電機	10,400	3,685.00	38,324,000	
安川電機	18,800	3,255.00	61,194,000	
明電舎	4,400	1,524.00	6,705,600	
東芝テック	2,900	2,793.00	8,099,700	
マブチモーター	4,300	3,765.00	16,189,500	

日本電産	19,400	13,925.00	270,145,000	
東光高岳	3,400	1,147.00	3,899,800	
ダイヘン	2,500	2,958.00	7,395,000	
日新電機	6,200	1,044.00	6,472,800	
オムロン	17,100	5,270.00	90,117,000	
日東工業	3,700	1,945.00	7,196,500	
ジーエス・ユアサ　コーポレーション	5,600	1,934.00	10,830,400	
メルコホールディングス	1,800	3,055.00	5,499,000	
テクノメディカ	2,100	2,099.00	4,407,900	
日本電気	20,900	4,080.00	85,272,000	
富士通	15,500	7,640.00	118,420,000	
沖電気工業	6,600	1,391.00	9,180,600	
サンケン電気	2,900	2,153.00	6,243,700	
アイホン	3,600	1,562.00	5,623,200	
ルネサスエレクトロニクス	16,700	473.00	7,899,100	
セイコーエプソン	20,400	1,620.00	33,048,000	
ワコム	16,600	343.00	5,693,800	
アルバック	3,400	3,135.00	10,659,000	
ＥＩＺＯ	1,700	3,990.00	6,783,000	
日本信号	6,400	1,106.00	7,078,400	
能美防災	2,700	2,056.00	5,551,200	
ホーチキ	3,900	1,198.00	4,672,200	
パナソニック	183,900	897.70	165,087,030	
シャープ	16,000	1,017.00	16,272,000	
アンリツ	10,700	1,691.00	18,093,700	
富士通ゼネラル	5,000	1,546.00	7,730,000	
ソニー	107,900	5,458.00	588,918,200	
ＴＤＫ	8,400	7,500.00	63,000,000	
アルプスアルパイン	16,700	1,779.00	29,709,300	
日本トリム	900	5,210.00	4,689,000	
フォスター電機	4,400	1,563.00	6,877,200	
ヨコオ	2,900	2,027.00	5,878,300	
ホシデン	5,900	1,025.00	6,047,500	
ヒロセ電機	2,300	12,090.00	27,807,000	
日本航空電子工業	4,900	1,499.00	7,345,100	
アイコム	2,600	2,234.00	5,808,400	
船井電機	8,300	738.00	6,125,400	
横河電機	16,400	2,131.00	34,948,400	
アズビル	10,600	2,598.00	27,538,800	
日本光電工業	7,100	3,050.00	21,655,000	
堀場製作所	3,100	5,090.00	15,779,000	
アドバンテスト	10,800	2,682.00	28,965,600	
キーエンス	7,900	62,610.00	494,619,000	

日置電機	1,600	3,575.00	5,720,000	
シスメックス	12,500	7,700.00	96,250,000	
ＯＢＡＲＡ　ＧＲＯＵＰ	1,300	3,530.00	4,589,000	
コーセル	4,100	1,061.00	4,350,100	
イリソ電子工業	1,500	5,160.00	7,740,000	
オプテックスグループ	4,200	1,357.00	5,699,400	
千代田インテグレ	2,800	2,001.00	5,602,800	
レーザーテック	3,400	3,880.00	13,192,000	
スタンレー電気	11,300	2,614.00	29,538,200	
ウシオ電機	9,600	1,392.00	13,363,200	
日本セラミック	2,000	2,863.00	5,726,000	
図研	5,200	1,455.00	7,566,000	
カシオ計算機	14,100	1,269.00	17,892,900	
ファナック	15,300	18,335.00	280,525,500	
ローム	7,700	6,480.00	49,896,000	
浜松ホトニクス	11,600	4,000.00	46,400,000	
三井ハイテック	5,000	1,051.00	5,255,000	
新光電気工業	7,800	882.00	6,879,600	
京セラ	24,500	6,867.00	168,241,500	
太陽誘電	6,900	2,037.00	14,055,300	
村田製作所	50,600	4,689.00	237,263,400	
双葉電子工業	3,700	1,411.00	5,220,700	
ニチコン	6,400	789.00	5,049,600	
日本ケミコン	2,100	1,594.00	3,347,400	
ＫＯＡ	4,100	1,236.00	5,067,600	
小糸製作所	9,700	5,370.00	52,089,000	
ミツバ	8,500	580.00	4,930,000	
ＳＣＲＥＥＮホールディングス	2,900	3,985.00	11,556,500	
キヤノン電子	3,800	1,741.00	6,615,800	
キヤノン	86,800	3,100.00	269,080,000	
リコー	49,000	1,056.00	51,744,000	
東京エレクトロン	10,700	15,010.00	160,607,000	
トヨタ紡織	5,300	1,404.00	7,441,200	
ユニプレス	3,000	1,770.00	5,310,000	
豊田自動織機	13,000	5,620.00	73,060,000	
モリタホールディングス	3,500	1,949.00	6,821,500	
デンソー	35,400	4,390.00	155,406,000	
東海理化電機製作所	4,200	1,732.00	7,274,400	
三井Ｅ＆Ｓホールディングス	7,300	874.00	6,380,200	
川崎重工業	12,700	2,489.00	31,610,300	
日産自動車	189,900	765.10	145,292,490	
いすゞ自動車	51,100	1,238.00	63,261,800	
トヨタ自動車	179,300	6,604.00	1,184,097,200	70,000株

日野自動車	19,900	887.00	17,651,300	
三菱自動車工業	59,900	516.00	30,908,400	
武蔵精密工業	3,900	1,358.00	5,296,200	
日産車体	7,400	1,000.00	7,400,000	
新明和工業	6,700	1,301.00	8,716,700	
極東開発工業	4,000	1,358.00	5,432,000	
日信工業	4,700	1,416.00	6,655,200	
トピー工業	1,700	2,268.00	3,855,600	
ティラド	3,100	1,883.00	5,837,300	
ＮＯＫ	8,500	1,450.00	12,325,000	
フタバ産業	11,200	543.00	6,081,600	
ＫＹＢ	2,100	2,798.00	5,875,800	
プレス工業	13,900	489.00	6,797,100	
ケーヒン	3,700	1,490.00	5,513,000	
アイシン精機	13,300	3,710.00	49,343,000	
マツダ	50,800	1,170.50	59,461,400	
今仙電機製作所	6,000	878.00	5,268,000	
本田技研工業	135,800	2,770.00	376,166,000	
スズキ	29,400	5,499.00	161,670,600	
ＳＵＢＡＲＵ	50,000	2,670.50	133,525,000	
ヤマハ発動機	22,400	1,903.00	42,627,200	
ショーワ	5,100	1,435.00	7,318,500	
エクセディ	2,500	2,250.00	5,625,000	
豊田合成	5,200	1,988.00	10,337,600	
愛三工業	7,900	698.00	5,514,200	
ヨロズ	3,500	1,383.00	4,840,500	
エフ・シー・シー	2,900	2,339.00	6,783,100	
シマノ	6,500	16,830.00	109,395,000	
テイ・エス　テック	3,700	2,741.00	10,141,700	
テルモ	45,500	3,180.00	144,690,000	
クリエートメディック	4,400	913.00	4,017,200	
島津製作所	20,900	2,775.00	57,997,500	
ブイ・テクノロジー	600	10,070.00	6,042,000	
東京精密	2,800	2,536.00	7,100,800	
マニー	2,000	6,660.00	13,320,000	
ニコン	28,500	1,556.00	44,346,000	
トプコン	8,300	1,408.00	11,686,400	
オリンパス	96,100	1,342.00	128,966,200	
理研計器	2,700	1,960.00	5,292,000	
タムロン	2,700	2,306.00	6,226,200	
ＨＯＹＡ	32,400	7,940.00	257,256,000	
朝日インテック	6,700	6,160.00	41,272,000	
シチズン時計	18,900	502.00	9,487,800	

メニコン	2,000	3,745.00	7,490,000	
セイコーホールディングス	2,900	2,056.00	5,962,400	
ニプロ	11,100	1,245.00	13,819,500	
パラマウントベッドホールディングス	1,800	4,545.00	8,181,000	
バンダイナムコホールディングス	16,800	5,400.00	90,720,000	
アイフィスジャパン	6,100	596.00	3,635,600	
パイロットコーポレーション	2,700	4,035.00	10,894,500	
トッパン・フォームズ	6,900	901.00	6,216,900	
フジシールインターナショナル	3,600	3,805.00	13,698,000	
タカラトミー	7,300	1,288.00	9,402,400	
タカノ	4,900	740.00	3,626,000	
大建工業	3,000	2,227.00	6,681,000	
凸版印刷	22,500	1,668.00	37,530,000	
大日本印刷	22,700	2,449.00	55,592,300	
ＮＩＳＳＨＡ	4,300	1,041.00	4,476,300	
アシックス	15,400	1,290.00	19,866,000	
小松ウオール工業	2,300	1,864.00	4,287,200	
ヤマハ	9,600	5,080.00	48,768,000	
クリナップ	6,800	521.00	3,542,800	
ピジョン	9,800	4,520.00	44,296,000	
キングジム	5,800	889.00	5,156,200	
リンテック	3,600	2,191.00	7,887,600	
イトーキ	11,200	407.00	4,558,400	
任天堂	9,200	39,110.00	359,812,000	
三菱鉛筆	2,800	1,981.00	5,546,800	
タカラスタンダード	4,100	1,669.00	6,842,900	
コクヨ	7,500	1,448.00	10,860,000	
オカムラ	6,000	1,091.00	6,546,000	
美津濃	2,900	2,491.00	7,223,900	
東京電力ホールディングス	129,100	601.00	77,589,100	
中部電力	49,400	1,546.50	76,397,100	
関西電力	65,600	1,343.50	88,133,600	
中国電力	22,400	1,368.00	30,643,200	
北陸電力	16,000	799.00	12,784,000	
東北電力	37,600	1,139.00	42,826,400	
四国電力	14,900	1,021.00	15,212,900	
九州電力	33,500	1,091.00	36,548,500	
北海道電力	15,700	603.00	9,467,100	
沖縄電力	3,100	1,692.00	5,245,200	
電源開発	12,900	2,397.00	30,921,300	
東京瓦斯	31,500	2,726.00	85,869,000	
大阪瓦斯	31,200	1,949.00	60,808,800	
東邦瓦斯	7,900	4,250.00	33,575,000	

北海道瓦斯	3,700	1,482.00	5,483,400	
西部瓦斯	2,800	2,323.00	6,504,400	
静岡ガス	7,100	861.00	6,113,100	
東武鉄道	17,200	3,185.00	54,782,000	
相鉄ホールディングス	5,500	3,080.00	16,940,000	
東京急行電鉄	43,800	1,974.00	86,461,200	
京浜急行電鉄	22,400	1,850.00	41,440,000	
小田急電鉄	26,000	2,683.00	69,758,000	
京王電鉄	9,000	7,530.00	67,770,000	
京成電鉄	12,000	4,105.00	49,260,000	
富士急行	2,100	4,110.00	8,631,000	
東日本旅客鉄道	28,600	10,460.00	299,156,000	
西日本旅客鉄道	14,500	8,565.00	124,192,500	
東海旅客鉄道	14,400	22,930.00	330,192,000	
西武ホールディングス	20,400	1,825.00	37,230,000	
西日本鉄道	4,300	2,419.00	10,401,700	
近鉄グループホールディングス	15,200	5,260.00	79,952,000	
阪急阪神ホールディングス	20,400	3,950.00	80,580,000	
南海電気鉄道	6,800	2,884.00	19,611,200	
京阪ホールディングス	6,900	4,780.00	32,982,000	
名古屋鉄道	12,400	2,999.00	37,187,600	
日本通運	6,000	5,670.00	34,020,000	
ヤマトホールディングス	26,900	2,271.00	61,089,900	
山九	4,200	5,710.00	23,982,000	
丸運	16,900	279.00	4,715,100	
センコーグループホールディングス	9,300	833.00	7,746,900	
トナミホールディングス	1,000	5,810.00	5,810,000	
ニッコンホールディングス	5,700	2,513.00	14,324,100	
日本石油輸送	1,500	2,821.00	4,231,500	
福山通運	2,000	3,940.00	7,880,000	
セイノーホールディングス	11,600	1,430.00	16,588,000	
日立物流	3,400	3,205.00	10,897,000	
Ｃ＆Ｆロジホールディングス	4,500	1,391.00	6,259,500	
九州旅客鉄道	12,900	3,470.00	44,763,000	
ＳＧホールディングス	14,600	2,932.00	42,807,200	
日本郵船	13,000	1,641.00	21,333,000	
商船三井	9,100	2,362.00	21,494,200	
川崎汽船	5,800	1,268.00	7,354,400	
飯野海運	13,500	361.00	4,873,500	
日本航空	27,800	3,506.00	97,466,800	
ＡＮＡホールディングス	27,900	3,688.00	102,895,200	
三菱倉庫	5,200	2,968.00	15,433,600	
三井倉庫ホールディングス	2,800	1,659.00	4,645,200	

住友倉庫	5,600	1,396.00	7,817,600	
東陽倉庫	15,900	311.00	4,944,900	
安田倉庫	6,000	887.00	5,322,000	
上組	9,500	2,566.00	24,377,000	
キムラユニティー	3,900	1,032.00	4,024,800	
キユーソー流通システム	1,800	1,979.00	3,562,200	
近鉄エクスプレス	4,500	1,431.00	6,439,500	
エーアイテイー	5,300	1,023.00	5,421,900	
ＮＥＣネッツエスアイ	3,100	2,855.00	8,850,500	
システナ	6,100	1,600.00	9,760,000	
デジタルアーツ	1,000	8,530.00	8,530,000	
日鉄ソリューションズ	2,300	3,310.00	7,613,000	
ＴＩＳ	5,400	5,490.00	29,646,000	
ネオス	5,900	778.00	4,590,200	
電算システム	2,100	4,270.00	8,967,000	
グリー	11,900	503.00	5,985,700	
コーエーテクモホールディングス	3,900	2,022.00	7,885,800	
ブレインパッド	1,000	8,420.00	8,420,000	
ＫＬａｂ	6,900	927.00	6,396,300	
ネクソン	40,700	1,675.00	68,172,500	
エイチーム	3,300	1,589.00	5,243,700	
コロプラ	7,700	693.00	5,336,100	
サイバーリンクス	2,800	1,114.00	3,119,200	
ＣＡＲＴＡ　ＨＯＬＤＩＮＧＳ	3,500	1,674.00	5,859,000	
ティーガイア	2,700	1,825.00	4,927,500	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	40,400	320.00	12,928,000	
GMOペイメントゲートウェイ	2,600	7,830.00	20,358,000	
ザッパラス	11,000	373.00	4,103,000	
インターネットイニシアティブ	3,100	2,140.00	6,634,000	
ＬＩＮＥ	4,700	3,360.00	15,792,000	
フェイス	3,000	797.00	2,391,000	
野村総合研究所	10,200	5,290.00	53,958,000	
ＣＥホールディングス	6,100	1,019.00	6,215,900	
インテージホールディングス	7,000	1,021.00	7,147,000	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	3,000	1,690.00	5,070,000	
フジ・メディア・ホールディングス	16,700	1,536.00	25,651,200	
オービック	5,500	13,520.00	74,360,000	
ジャストシステム	2,000	3,485.00	6,970,000	
ヤフー	105,700	306.00	32,344,200	
トレンドマイクロ	8,600	4,930.00	42,398,000	
日本オラクル	3,300	7,710.00	25,443,000	
フューチャー	4,900	1,909.00	9,354,100	

ＣＡＣ　Ｈｏｌｄｉｎｇｓ	5,000	1,764.00	8,820,000	
ソフトバンク・テクノロジー	3,300	2,367.00	7,811,100	
オービックビジネスコンサルタント	1,700	4,940.00	8,398,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	7,300	2,706.00	19,753,800	
大塚商会	8,700	4,340.00	37,758,000	
サイボウズ	6,600	1,193.00	7,873,800	
電通国際情報サービス	2,900	3,565.00	10,338,500	
デジタルガレージ	3,100	3,790.00	11,749,000	
ウェザーニューズ	1,600	3,330.00	5,328,000	
日本エンタープライズ	18,900	168.00	3,175,200	
ネットワンシステムズ	5,700	3,060.00	17,442,000	
アルゴグラフィックス	4,000	2,542.00	10,168,000	
エイベックス	4,700	1,392.00	6,542,400	
日本ユニシス	5,000	3,575.00	17,875,000	
兼松エレクトロニクス	1,800	3,040.00	5,472,000	
東京放送ホールディングス	10,400	1,833.00	19,063,200	
日本テレビホールディングス	14,800	1,609.00	23,813,200	
テレビ朝日ホールディングス	4,300	1,803.00	7,752,900	
スカパーＪＳＡＴホールディングス	14,500	422.00	6,119,000	
テレビ東京ホールディングス	1,400	2,321.00	3,249,400	
日本電信電話	108,100	4,951.00	535,203,100	35,000株
ＫＤＤＩ	139,300	2,795.00	389,343,500	
ソフトバンク	167,600	1,440.00	241,344,000	
光通信	1,900	22,410.00	42,579,000	
ＮＴＴドコモ	100,200	2,544.00	254,908,800	
GMOインターネット	5,700	1,795.00	10,231,500	
カドカワ	5,000	1,467.00	7,335,000	
ゼンリン	3,200	2,105.00	6,736,000	
松竹	1,000	13,040.00	13,040,000	
東宝	10,400	4,690.00	48,776,000	
東映	700	14,640.00	10,248,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	42,700	1,318.00	56,278,600	
ビジネスブレイン太田昭和	1,900	2,073.00	3,938,700	
ＤＴＳ	1,900	4,550.00	8,645,000	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	7,400	3,660.00	27,084,000	
カプコン	7,000	2,292.00	16,044,000	
ＳＣＳＫ	4,300	5,210.00	22,403,000	
アイネス	6,600	1,223.00	8,071,800	
ＴＫＣ	2,500	4,400.00	11,000,000	
富士ソフト	2,400	4,735.00	11,364,000	
ＮＳＤ	2,600	3,055.00	7,943,000	
コナミホールディングス	6,600	5,120.00	33,792,000	
ソフトバンクグループ	66,000	10,525.00	694,650,000	

伊藤忠食品	1,200	4,515.00	5,418,000	
エレマテック	3,100	2,086.00	6,466,600	
ＪＡＬＵＸ	2,200	2,794.00	6,146,800	
双日	90,000	355.00	31,950,000	
アルフレッサ　ホールディングス	17,800	2,842.00	50,587,600	
横浜冷凍	7,000	979.00	6,853,000	
神戸物産	2,300	5,110.00	11,753,000	
あい　ホールディングス	3,800	1,778.00	6,756,400	
ダイワボウホールディングス	1,400	4,685.00	6,559,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	5,000	1,273.00	6,365,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	4,900	1,064.00	5,213,600	
レスターホールディングス	3,100	1,561.00	4,839,100	
ＯＣＨＩホールディングス	3,100	1,131.00	3,506,100	
ＴＯＫＡＩホールディングス	9,000	903.00	8,127,000	
シップヘルスケアホールディングス	3,400	4,810.00	16,354,000	
明治電機工業	2,800	1,321.00	3,698,800	
コメダホールディングス	3,400	2,074.00	7,051,600	
エコートレーディング	8,100	544.00	4,406,400	
ナガイレーベン	2,500	2,443.00	6,107,500	
三菱食品	2,700	2,888.00	7,797,600	
松田産業	4,000	1,468.00	5,872,000	
第一興商	2,200	5,070.00	11,154,000	
メディパルホールディングス	17,100	2,446.00	41,826,600	
アズワン	1,100	9,560.00	10,516,000	
尾家産業	3,300	1,281.00	4,227,300	
ドウシシャ	3,600	1,801.00	6,483,600	
丸文	7,500	550.00	4,125,000	
橋本総業ホールディングス	2,900	1,401.00	4,062,900	
日本ライフライン	4,900	1,833.00	8,981,700	
進和	3,300	2,116.00	6,982,800	
オーハシテクニカ	3,900	1,383.00	5,393,700	
白銅	2,400	1,324.00	3,177,600	
伊藤忠商事	111,000	1,999.50	221,944,500	
丸紅	156,900	694.70	108,998,430	
長瀬産業	9,300	1,607.00	14,945,100	
豊田通商	17,800	3,205.00	57,049,000	
兼松	6,600	1,238.00	8,170,800	
三井物産	130,700	1,661.50	217,158,050	
日本紙パルプ商事	1,500	3,960.00	5,940,000	
日立ハイテクノロジーズ	4,900	4,610.00	22,589,000	
山善	6,900	1,007.00	6,948,300	
住友商事	93,900	1,578.00	148,174,200	

内田洋行	1,300	3,610.00	4,693,000	
三菱商事	111,400	2,855.00	318,047,000	
キヤノンマーケティングジャパン	4,300	2,343.00	10,074,900	
西華産業	4,100	1,262.00	5,174,200	
菱洋エレクトロ	4,200	1,641.00	6,892,200	
東京産業	7,600	470.00	3,572,000	
阪和興業	2,700	2,778.00	7,500,600	
岩谷産業	3,600	3,660.00	13,176,000	
イワキ	8,600	466.00	4,007,600	
三愛石油	6,900	939.00	6,479,100	
稲畑産業	4,800	1,387.00	6,657,600	
ワキタ	6,400	1,081.00	6,918,400	
東邦ホールディングス	4,600	2,525.00	11,615,000	
サンゲツ	5,000	2,080.00	10,400,000	
シナネンホールディングス	2,800	1,901.00	5,322,800	
伊藤忠エネクス	6,700	859.00	5,755,300	
サンリオ	4,800	2,560.00	12,288,000	
リョーサン	2,500	2,647.00	6,617,500	
三信電気	3,700	1,838.00	6,800,600	
モスフードサービス	2,900	2,408.00	6,983,200	
加賀電子	3,400	1,699.00	5,776,600	
立花エレテック	3,700	1,570.00	5,809,000	
フォーバル	5,700	924.00	5,266,800	
ＰＡＬＴＡＣ	2,800	5,930.00	16,604,000	
日鉄物産	1,700	4,185.00	7,114,500	
トラスコ中山	3,400	2,453.00	8,340,200	
オートバックスセブン	6,100	1,739.00	10,607,900	
加藤産業	2,500	3,555.00	8,887,500	
イノテック	5,000	827.00	4,135,000	
杉本商事	3,100	2,075.00	6,432,500	
因幡電機産業	2,300	4,365.00	10,039,500	
ミスミグループ本社	19,800	2,601.00	51,499,800	
スズケン	7,200	6,990.00	50,328,000	
ジェコス	5,300	949.00	5,029,700	
ローソン	4,000	5,270.00	21,080,000	
サンエー	1,300	4,390.00	5,707,000	
エービーシー・マート	2,400	6,860.00	16,464,000	
ハードオフコーポレーション	4,500	709.00	3,190,500	
アスクル	1,900	2,877.00	5,466,300	
ゲオホールディングス	3,600	1,408.00	5,068,800	
アダストリア	2,600	2,950.00	7,670,000	
ジーフット	5,200	641.00	3,333,200	
エディオン	7,000	977.00	6,839,000	

あみやき亭	1,800	3,380.00	6,084,000	
ハニーズホールディングス	5,600	1,016.00	5,689,600	
ジンズ	1,200	6,570.00	7,884,000	
ビックカメラ	8,800	1,179.00	10,375,200	
ＤＣＭホールディングス	8,700	1,099.00	9,561,300	
ＭｏｎｏｔａＲＯ	10,000	2,297.00	22,970,000	
Ｊ．フロント　リテイリング	20,500	1,194.00	24,477,000	
ドトール・日レスホールディングス	3,600	2,102.00	7,567,200	
マツモトキヨシホールディングス	6,400	3,215.00	20,576,000	
ＺＯＺＯ	17,100	1,841.00	31,481,100	
トレジャー・ファクトリー	3,800	721.00	2,739,800	
ココカラファイン	1,700	4,425.00	7,522,500	
三越伊勢丹ホールディングス	29,800	926.00	27,594,800	
ウエルシアホールディングス	4,100	3,975.00	16,297,500	
クリエイトＳＤホールディングス	2,600	2,431.00	6,320,600	
シュッピン	4,100	845.00	3,464,500	
ジョイフル本田	4,800	1,269.00	6,091,200	
すかいらーくホールディングス	14,900	1,983.00	29,546,700	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,100	961.00	4,901,100	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	717.00	4,803,900	
あさひ	4,000	1,339.00	5,356,000	
コスモス薬品	700	18,300.00	12,810,000	
トーエル	3,600	708.00	2,548,800	
セブン&アイ・ホールディングス	66,300	3,815.00	252,934,500	
薬王堂	1,500	2,268.00	3,402,000	
ツルハホールディングス	3,400	8,850.00	30,090,000	
サンマルクホールディングス	3,200	2,382.00	7,622,400	
トリドールホールディングス	4,500	1,888.00	8,496,000	
クスリのアオキホールディングス	1,500	7,180.00	10,770,000	
スシローグローバルホールディングス	1,700	7,600.00	12,920,000	
カッパ・クリエイト	6,000	1,390.00	8,340,000	
ライトオン	5,400	792.00	4,276,800	
良品計画	2,200	20,290.00	44,638,000	
三城ホールディングス	10,300	340.00	3,502,000	
アドヴァン	4,600	1,066.00	4,903,600	
Ｇ－７ホールディングス	2,800	3,050.00	8,540,000	
エコス	2,100	1,444.00	3,032,400	
マルシェ	5,300	778.00	4,123,400	
パン・パシフィック・インターナショナルホールディングス	9,500	6,940.00	65,930,000	
西松屋チェーン	5,100	906.00	4,620,600	
ゼンショーホールディングス	7,600	2,313.00	17,578,800	

サイゼリヤ	4,100	2,465.00	10,106,500	
魚力	2,900	1,472.00	4,268,800	
ユナイテッドアローズ	1,800	3,720.00	6,696,000	
ハイデイ日高	3,200	2,059.00	6,588,800	
京都きもの友禅	4,900	365.00	1,788,500	
コロワイド	5,100	2,112.00	10,771,200	
壱番屋	1,700	4,660.00	7,922,000	
スギホールディングス	3,500	5,150.00	18,025,000	
スクロール	9,000	352.00	3,168,000	
ユニー・ファミリーマートホールディングス	17,700	2,918.00	51,648,600	
木曽路	3,000	2,571.00	7,713,000	
千趣会	12,800	286.00	3,660,800	
ケーヨー	11,500	506.00	5,819,000	
上新電機	2,500	2,279.00	5,697,500	
日本瓦斯	2,700	2,704.00	7,300,800	
ロイヤルホールディングス	3,000	2,776.00	8,328,000	
いなげや	4,100	1,389.00	5,694,900	
島忠	3,100	2,512.00	7,787,200	
チヨダ	2,400	1,673.00	4,015,200	
ライフコーポレーション	2,000	2,152.00	4,304,000	
ＡＯＫＩホールディングス	3,400	1,068.00	3,631,200	
コメリ	2,500	2,161.00	5,402,500	
青山商事	2,800	2,134.00	5,975,200	
しまむら	1,800	8,320.00	14,976,000	
高島屋	12,500	1,196.00	14,950,000	
松屋	4,400	980.00	4,312,000	
エイチ・ツー・オー　リテイリング	7,800	1,205.00	9,399,000	
パルコ	5,000	1,078.00	5,390,000	
丸井グループ	13,500	2,252.00	30,402,000	
アクシアル　リテイリング	1,700	4,060.00	6,902,000	
イオン	61,000	2,002.50	122,152,500	
イズミ	3,200	4,790.00	15,328,000	
平和堂	3,000	1,935.00	5,805,000	
フジ	2,900	1,810.00	5,249,000	
ヤオコー	1,800	5,450.00	9,810,000	
ゼビオホールディングス	4,700	1,275.00	5,992,500	
ケーズホールディングス	16,100	1,088.00	17,516,800	
Ｇｅｎｋｙ　ＤｒｕｇＳｔｏｒｅｓ	1,700	2,750.00	4,675,000	
ブックオフグループホールディングス	4,500	850.00	3,825,000	
アインホールディングス	2,100	8,540.00	17,934,000	
ヤマダ電機	48,800	504.00	24,595,200	
ニトリホールディングス	6,900	13,400.00	92,460,000	

吉野家ホールディングス	5,500	1,825.00	10,037,500	
王将フードサービス	1,100	6,990.00	7,689,000	
プレナス	4,700	1,871.00	8,793,700	
ミニストップ	3,000	1,707.00	5,121,000	
アークス	2,800	2,185.00	6,118,000	
バローホールディングス	3,300	2,308.00	7,616,400	
ファーストリテイリング	2,100	66,360.00	139,356,000	
サンドラッグ	5,800	2,807.00	16,280,600	
ヤマザワ	2,400	1,628.00	3,907,200	
ベルーナ	5,800	788.00	4,570,400	
めぶきフィナンシャルグループ	83,800	273.00	22,877,400	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,300	1,713.00	5,652,900	
九州フィナンシャルグループ	25,800	435.00	11,223,000	
ゆうちょ銀行	45,100	1,122.00	50,602,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	100,100	427.00	42,742,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,800	812.00	7,957,600	
関西みらいフィナンシャルグループ	7,300	720.00	5,256,000	
三十三フィナンシャルグループ	2,500	1,434.00	3,585,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,500	2,821.00	7,052,500	
新生銀行	11,800	1,573.00	18,561,400	
あおぞら銀行	8,800	2,649.00	23,311,200	
三菱ＵＦＪフィナンシャル・グループ	1,092,300	513.00	560,349,900	300,000株
りそなホールディングス	173,600	466.80	81,036,480	
三井住友トラスト・ホールディングス	31,200	3,990.00	124,488,000	
三井住友フィナンシャルグループ	111,800	3,866.00	432,218,800	
千葉銀行	54,200	536.00	29,051,200	
群馬銀行	32,800	388.00	12,726,400	
武蔵野銀行	2,500	2,062.00	5,155,000	
千葉興業銀行	11,600	234.00	2,714,400	
七十七銀行	4,600	1,659.00	7,631,400	
青森銀行	1,000	2,792.00	2,792,000	
秋田銀行	1,700	2,214.00	3,763,800	
山形銀行	2,300	1,629.00	3,746,700	
岩手銀行	1,500	2,912.00	4,368,000	
東邦銀行	17,600	256.00	4,505,600	
東北銀行	1,300	1,035.00	1,345,500	
ふくおかフィナンシャルグループ	13,800	1,967.00	27,144,600	
静岡銀行	40,100	890.00	35,689,000	
十六銀行	2,400	2,355.00	5,652,000	
八十二銀行	36,200	459.00	16,615,800	

山梨中央銀行	2,400	1,248.00	2,995,200	
大垣共立銀行	3,100	2,447.00	7,585,700	
福井銀行	2,500	1,557.00	3,892,500	
北國銀行	1,800	3,135.00	5,643,000	
滋賀銀行	3,000	2,625.00	7,875,000	
南都銀行	2,300	2,109.00	4,850,700	
百五銀行	15,500	329.00	5,099,500	
京都銀行	5,700	4,280.00	24,396,000	
紀陽銀行	5,500	1,487.00	8,178,500	
ほくほくフィナンシャルグループ	10,400	1,182.00	12,292,800	
広島銀行	23,500	563.00	13,230,500	
山陰合同銀行	8,700	720.00	6,264,000	
中国銀行	13,100	1,044.00	13,676,400	
鳥取銀行	900	1,367.00	1,230,300	
伊予銀行	21,300	566.00	12,055,800	
百十四銀行	2,700	2,224.00	6,004,800	
四国銀行	3,400	945.00	3,213,000	
阿波銀行	2,500	2,750.00	6,875,000	
大分銀行	900	3,285.00	2,956,500	
宮崎銀行	1,500	2,589.00	3,883,500	
佐賀銀行	2,800	1,661.00	4,650,800	
沖縄銀行	1,900	3,480.00	6,612,000	
琉球銀行	4,100	1,178.00	4,829,800	
セブン銀行	55,100	291.00	16,034,100	
みずほフィナンシャルグループ	2,160,200	157.30	339,799,460	
山口フィナンシャルグループ	19,900	828.00	16,477,200	
長野銀行	900	1,664.00	1,497,600	
名古屋銀行	1,600	3,585.00	5,736,000	
北洋銀行	24,900	257.00	6,399,300	
中京銀行	2,000	2,226.00	4,452,000	
愛媛銀行	3,600	1,096.00	3,945,600	
トマト銀行	1,700	1,018.00	1,730,600	
京葉銀行	8,000	622.00	4,976,000	
栃木銀行	18,800	179.00	3,365,200	
トモニホールディングス	13,300	352.00	4,681,600	
フィデアホールディングス	27,900	119.00	3,320,100	
池田泉州ホールディングス	19,900	213.00	4,238,700	
ＦＰＧ	7,000	893.00	6,251,000	
ＳＢＩホールディングス	18,800	2,623.00	49,312,400	
ジャフコ	2,500	3,940.00	9,850,000	
大和証券グループ本社	126,600	484.30	61,312,380	
野村ホールディングス	280,600	355.30	99,697,180	
岡三証券グループ	14,300	387.00	5,534,100	

丸三証券	6,300	595.00	3,748,500	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	18,200	346.00	6,297,200	
水戸証券	9,600	203.00	1,948,800	
いちよし証券	4,800	782.00	3,753,600	
松井証券	7,700	1,043.00	8,031,100	
だいこう証券ビジネス	7,700	428.00	3,295,600	
マネックスグループ	16,200	358.00	5,799,600	
カブドットコム証券	13,900	557.00	7,742,300	
極東証券	4,200	946.00	3,973,200	
藍澤證券	5,600	695.00	3,892,000	
かんぽ生命保険	5,900	2,002.00	11,811,800	
ＳＯＭＰＯホールディングス	28,000	4,046.00	113,288,000	
ＭＳ＆ＡＤインシュアランスグループホールディングス	41,500	3,455.00	143,382,500	
ソニーフィナンシャルホールディングス	13,100	2,403.00	31,479,300	
第一生命ホールディングス	89,900	1,624.00	145,997,600	
東京海上ホールディングス	56,900	5,584.00	317,729,600	
Ｔ＆Ｄホールディングス	49,500	1,167.00	57,766,500	
全国保証	4,400	4,125.00	18,150,000	
クレディセゾン	10,900	1,172.00	12,774,800	
芙蓉総合リース	1,900	5,360.00	10,184,000	
興銀リース	2,900	2,515.00	7,293,500	
東京センチュリー	3,100	4,665.00	14,461,500	
日本証券金融	9,400	577.00	5,423,800	
アイフル	26,900	211.00	5,675,900	
リコーリース	1,900	3,375.00	6,412,500	
イオンフィナンシャルサービス	10,400	1,718.00	17,867,200	
アコム	33,100	371.00	12,280,100	
オリエントコーポレーション	49,800	113.00	5,627,400	
日立キャピタル	3,700	2,363.00	8,743,100	
オリックス	106,000	1,551.50	164,459,000	
三菱ＵＦＪリース	36,700	561.00	20,588,700	
日本取引所グループ	42,700	1,752.00	74,810,400	
アサックス	7,400	549.00	4,062,600	
ＮＥＣキャピタルソリューション	3,200	1,778.00	5,689,600	
いちご	23,000	342.00	7,866,000	
ヒューリック	33,900	892.00	30,238,800	
野村不動産ホールディングス	10,600	2,285.00	24,221,000	
オープンハウス	2,300	4,720.00	10,856,000	
東急不動産ホールディングス	42,400	637.00	27,008,800	
飯田グループホールディングス	13,200	1,781.00	23,509,200	
パーク２４	9,200	2,179.00	20,046,800	

三井不動産	84,400	2,729.00	230,327,600	
三菱地所	111,500	2,093.00	233,369,500	
平和不動産	3,600	2,109.00	7,592,400	
東京建物	17,800	1,218.00	21,680,400	
ダイビル	6,600	969.00	6,395,400	
京阪神ビルディング	6,900	1,045.00	7,210,500	
住友不動産	35,700	4,130.00	147,441,000	
テーオーシー	9,300	647.00	6,017,100	
スターツコーポレーション	2,600	2,553.00	6,637,800	
空港施設	10,000	519.00	5,190,000	
ゴールドクレスト	3,800	1,733.00	6,585,400	
日本エスリード	3,600	1,533.00	5,518,800	
サンヨーハウジング名古屋	5,200	885.00	4,602,000	
イオンモール	8,300	1,628.00	13,512,400	
カチタス	2,200	4,045.00	8,899,000	
日本空港ビルデング	5,100	4,215.00	21,496,500	
日本M&Aセンター	11,400	3,010.00	34,314,000	
パソナグループ	4,300	1,735.00	7,460,500	
ＧＣＡ	7,700	736.00	5,667,200	
エス・エム・エス	5,600	2,535.00	14,196,000	
パーソルホールディングス	15,300	2,397.00	36,674,100	
クックパッド	17,500	329.00	5,757,500	
学情	3,000	1,118.00	3,354,000	
スタジオアリス	3,000	2,075.00	6,225,000	
シミックホールディングス	2,900	2,000.00	5,800,000	
ＮＪＳ	2,700	1,598.00	4,314,600	
綜合警備保障	6,200	5,360.00	33,232,000	
カカクコム	11,700	2,319.00	27,132,300	
アイロムグループ	3,100	1,634.00	5,065,400	
ディップ	5,500	1,646.00	9,053,000	
キャリアデザインセンター	2,500	1,529.00	3,822,500	
ベネフィット・ワン	4,200	2,208.00	9,273,600	
エムスリー	32,600	2,200.00	71,720,000	
アウトソーシング	7,700	1,144.00	8,808,800	
ディー・エヌ・エー	8,100	2,173.00	17,601,300	
博報堂ＤＹホールディングス	21,700	1,743.00	37,823,100	
ぐるなび	11,400	557.00	6,349,800	
ファンコミュニケーションズ	11,800	532.00	6,277,600	
ＷＤＢホールディングス	2,600	2,736.00	7,113,600	
インフォマート	8,200	1,727.00	14,161,400	
ＥＰＳホールディングス	3,700	1,810.00	6,697,000	
クイック	4,000	1,732.00	6,928,000	
ケネディクス	14,900	535.00	7,971,500	

電通	18,800	3,680.00	69,184,000	
みらかホールディングス	4,400	2,600.00	11,440,000	
ダイオーズ	3,900	1,335.00	5,206,500	
日本空調サービス	8,900	678.00	6,034,200	
オリエンタルランド	18,200	13,375.00	243,425,000	
ダスキン	4,000	2,858.00	11,432,000	
ラウンドワン	5,200	1,657.00	8,616,400	
リゾートトラスト	6,500	1,733.00	11,264,500	
ビー・エム・エル	2,500	3,150.00	7,875,000	
りらいあコミュニケーションズ	6,400	1,215.00	7,776,000	
リソー教育	16,500	440.00	7,260,000	
早稲田アカデミー	6,100	794.00	4,843,400	
ユー・エス・エス	19,000	2,042.00	38,798,000	
サイバーエージェント	8,900	4,620.00	41,118,000	
楽天	72,100	1,150.00	82,915,000	
テー・オー・ダブリュー	6,700	783.00	5,246,100	
エン・ジャパン	2,000	3,990.00	7,980,000	
テクノプロ・ホールディングス	3,000	6,120.00	18,360,000	
インターワークス	4,000	613.00	2,452,000	
キャリアリンク	9,100	444.00	4,040,400	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,900	1,164.00	4,539,600	
リクルートホールディングス	110,300	3,617.00	398,955,100	
エラン	2,600	1,805.00	4,693,000	
日本郵政	126,200	1,214.00	153,206,800	
ＭＳ－Ｊａｐａｎ	3,000	1,571.00	4,713,000	
リログループ	8,300	3,015.00	25,024,500	
エイチ・アイ・エス	2,700	3,240.00	8,748,000	
共立メンテナンス	2,500	5,720.00	14,300,000	
建設技術研究所	3,900	1,480.00	5,772,000	
よみうりランド	1,200	5,050.00	6,060,000	
東京都競馬	2,300	3,390.00	7,797,000	
カナモト	2,500	2,494.00	6,235,000	
東京ドーム	7,900	1,114.00	8,800,600	
トランス・コスモス	3,800	2,437.00	9,260,600	
乃村工藝社	3,700	2,944.00	10,892,800	
日本管財	2,200	1,868.00	4,109,600	
白洋舎	1,600	3,000.00	4,800,000	
セコム	16,400	9,576.00	157,046,400	
セントラル警備保障	1,600	5,530.00	8,848,000	
メイテック	2,000	5,420.00	10,840,000	
応用地質	5,600	1,084.00	6,070,400	
船井総研ホールディングス	3,200	2,650.00	8,480,000	
ベネッセホールディングス	5,500	2,559.00	14,074,500	

イオンディライト	2,000	3,225.00	6,450,000	
ニチイ学館	7,000	1,429.00	10,003,000	
ダイセキ	2,700	2,713.00	7,325,100	
ステップ	3,200	1,457.00	4,662,400	
合　計	18,768,000	―	35,838,993,320	

（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。

「ＴＭＡ外国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 5月28日現在]	[2019年 5月28日現在]
区　　分	注記番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		36,945,428	―
コール・ローン		40,839,307	72,923,323
国債証券		12,910,502,904	4,118,136,433
派生商品評価勘定		676,786	63
未収入金		816,372,597	59,718,373
未収利息		118,266,688	29,199,141
前払費用		1,770,127	1,704,167
流動資産合計		13,925,373,837	4,281,681,500
資産合計		13,925,373,837	4,281,681,500
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		100	22,532
未払金		―	45,467,913
未払解約金		357,136,041	36,093,995
未払利息		113	92
流動負債合計		357,136,254	81,584,532
負債合計		357,136,254	81,584,532
純資産の部			
元本等			
元本	※1	9,006,999,485	2,723,557,753
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		4,561,238,098	1,476,539,215
元本等合計		13,568,237,583	4,200,096,968

純資産合計		13,568,237,583	4,200,096,968
負債純資産合計		13,925,373,837	4,281,681,500

(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 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券 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）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	為替予約取引 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、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　　分	[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28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	43,112,066,614円	9,006,999,485円
同期中における追加設定元本額	2,158,661,746円	1,149,352,026円
同期中における一部解約元本額	36,263,728,875円	7,432,793,758円
同期末における元本額	9,006,999,485円	2,723,557,753円
元本の内訳＊		
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	7,091,204円	7,990,743円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	12,506,420円	13,097,881円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	25,383,537円	29,007,809円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	19,030,684円	21,130,671円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	15,661,475円	12,947,124円

東京海上セレクション・外国債券インデックス	1,131,059,216円	1,769,689,829円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	33,216,244円	45,174,599円
ＴＭＡ外国債券インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	261,285,096円	150,332,518円
ＴＭＡ世界バランスファンド55ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	1,783,779円	―円
ＴＭＡ世界バランスファンド35ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	7,450,700,127円	435,686,410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＞	9,348,551円	52,745,817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＞	39,933,152円	185,754,352円
計	9,006,999,485円	2,723,557,753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	9,006,999,485口	2,723,557,753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）

I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2017年5月30日　至 2018年5月28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	△289,756,093
合計	△289,756,093

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2017年11月11日から2018年5月28日まで)を指しております。

（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	166,773,065
合計	166,773,065

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2018年11月13日から2019年5月28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

通貨関連
（2018年5月28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

市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	827,555,566	—	826,878,880	676,686
	米ドル	372,417,640	—	372,351,000	66,640
	加ドル	25,366,480	—	25,305,000	61,480
	メキシコペソ	5,616,800	—	5,610,000	6,800
	ユーロ	333,556,808	—	333,235,442	321,366
	英ポンド	58,545,500	—	58,340,000	205,500
	スウェーデンクローネ	7,306,438	—	7,306,438	—
	豪ドル	16,572,900	—	16,558,000	14,900
	シンガポールドル	8,173,000	—	8,173,000	—
合計		827,555,566	—	826,878,880	676,686

（2019年5月28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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	9,954,689	—	9,977,158	△22,469
	加ドル	8,132,945	—	8,155,454	△22,509
	メキシコペソ	1,798,375	—	1,798,312	63
	ユーロ	23,369	—	23,392	△23
合計		9,954,689	—	9,977,158	△22,469

(注)1.時価の算定方法

（1）本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

（2）本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.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 5月28日現在]		[2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.5064円	1口当たり純資産額	1.5421円
（1万口当たり純資産額	15,064円）	（1万口当たり純資産額	15,421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

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
国債証券	米ドル			米ドル	
		T 1 1/2 02/28/23	100,000	97,789.06	
		T 1 1/2 03/31/23	100,000	97,734.37	
		T 1 1/2 07/15/20	200,000	198,187.50	
		T 1 1/4 07/31/23	100,000	96,531.25	
		T 1 1/8 08/31/21	300,000	293,203.12	
		T 1 3/4 01/31/23	300,000	296,132.81	
		T 1 3/4 02/28/22	500,000	495,000.00	
		T 1 3/4 05/15/22	400,000	395,781.25	
		T 1 3/4 05/15/23	500,000	493,046.87	
		T 1 3/4 09/30/22	200,000	197,671.87	
		T 1 3/4 12/31/20	500,000	496,015.62	
		T 1 3/8 09/30/20	500,000	494,179.69	
		T 1 5/8 02/15/26	500,000	481,406.25	
		T 1 5/8 05/15/26	300,000	288,328.12	
		T 1 5/8 08/15/22	500,000	492,421.87	
		T 1 5/8 11/30/20	400,000	396,250.00	
		T 1 7/8 11/30/21	600,000	596,250.00	
		T 2 01/15/21	100,000	99,617.18	
		T 2 02/15/22	500,000	498,476.56	
		T 2 02/15/23	300,000	298,734.37	
		T 2 02/15/25	200,000	198,218.75	
		T 2 08/15/25	800,000	790,437.50	
		T 2 1/2 02/15/46	100,000	95,257.81	
		T 2 1/2 05/15/24	500,000	508,515.62	
		T 2 1/2 08/15/23	300,000	304,453.12	
		T 2 1/4 03/31/21	300,000	300,281.25	
		T 2 1/4 04/30/21	200,000	200,281.25	
		T 2 1/4 07/31/21	300,000	300,562.50	
		T 2 1/4 08/15/27	100,000	99,781.25	
		T 2 1/4 08/15/46	300,000	271,101.56	
		T 2 1/4 11/15/24	800,000	803,812.50	
		T 2 1/4 11/15/27	400,000	398,718.75	
		T 2 1/8 05/15/25	300,000	298,875.00	
		T 2 1/8 08/15/21	400,000	399,750.00	
		T 2 11/15/21	300,000	299,109.37	
		T 2 11/30/20	100,000	99,632.81	
		T 2 11/30/22	200,000	199,234.36	
		T 2 3/4 02/15/28	500,000	517,695.31	
		T 2 3/4 11/15/23	600,000	615,609.37	

		T 2 3/4 11/15/42	200,000	201,125.00	
		T 2 3/8 08/15/24	200,000	202,171.87	
		T 2 5/8 02/15/29	100,000	102,578.12	
		T 2 5/8 07/15/21	100,000	100,960.93	
		T 2 5/8 11/15/20	500,000	502,968.75	
		T 2 7/8 08/15/28	100,000	104,632.81	
		T 2 7/8 10/15/21	100,000	101,679.68	
		T 2 7/8 11/15/21	100,000	101,820.31	
		T 3 02/15/47	400,000	420,156.25	
		T 3 02/15/48	200,000	209,578.12	
		T 3 08/15/48	100,000	104,867.18	
		T 3 1/8 02/15/43	100,000	107,085.93	
		T 3 1/8 05/15/21	100,000	101,796.87	
		T 3 1/8 05/15/48	100,000	107,351.56	
		T 3 1/8 08/15/44	300,000	321,281.25	
		T 3 1/8 11/15/41	100,000	107,585.93	
		T 3 11/15/45	400,000	419,843.75	
		T 3 5/8 02/15/21	300,000	307,265.62	
		T 3 5/8 02/15/44	100,000	116,117.18	
		T 3 5/8 08/15/43	200,000	232,093.75	
		T 3 7/8 08/15/40	100,000	120,281.25	
		T 4 1/4 11/15/40	100,000	126,468.75	
		T 4 3/8 11/15/39	100,000	128,328.12	
		T 5 05/15/37	50,000	68,117.18	
	米ドル小計		17,750,000	17,920,242.00 (1,963,520,915)	
		銘柄数	63		
		比　率	46.7%	47.7%	
	加ドル			加ドル	
		CAN 0 3/4 09/01/21	100,000	98,185.00	
		CAN 1 1/2 06/01/23	100,000	99,981.00	
		CAN 2 1/2 06/01/24	100,000	104,872.00	
		CAN 2 1/4 06/01/29	100,000	106,040.00	
		CAN 2 3/4 06/01/22	100,000	103,520.00	
		CAN 2 3/4 12/01/48	100,000	120,350.00	
		CAN 3 1/2 12/01/45	100,000	134,103.00	
		CAN 3 1/4 06/01/21	100,000	103,363.00	
	加ドル小計		800,000	870,414.00 (70,964,853)	
		銘柄数	8		
		比　率	1.7%	1.7%	

メキシコペソ				メキシコペソ
	MBONO 10 11/20/36	200,000	230,324.00	
	MBONO 10 12/05/24	600,000	656,178.00	
	MBONO 5 3/4 03/05/26	400,000	353,888.00	
	MBONO 6 1/2 06/09/22	600,000	577,080.00	
	MBONO 6 1/2 06/10/21	1,000,000	971,599.10	
	MBONO 7 1/2 06/03/27	700,000	677,950.00	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	300,000	289,551.69	
	MBONO 7 3/4 11/13/42	400,000	372,140.00	
	MBONO 7 3/4 11/23/34	200,000	190,891.40	
	MBONO 8 09/05/24	100,000	100,350.60	
	MBONO 8 1/2 05/31/29	300,000	308,190.00	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	300,000	301,375.86	
	MBONO 8 11/07/47	200,000	190,110.60	
	MBONO 8 12/07/23	500,000	502,050.00	
メキシコペソ小計		5,800,000	5,721,679.25 (32,956,872)	
	銘柄数	14		
	比　率	0.8%	0.8%	
ユーロ				ユーロ
	BGB 0.2 10/22/23	100,000	102,400.00	
	BGB 1 06/22/26	100,000	107,000.00	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000	105,550.00	
	BGB 2.6 06/22/24	100,000	114,610.00	
	BGB 4 1/4 03/28/41	100,000	159,880.00	
	BGB 4 1/4 09/28/22	100,000	115,750.00	
	BGB 5 1/2 03/28/28	100,000	146,420.00	
	BTPS 0.65 11/01/20	200,000	200,866.00	
	BTPS 1 1/2 06/01/25	100,000	97,380.00	
	BTPS 1.35 04/15/22	100,000	100,500.00	
	BTPS 1.65 03/01/32	100,000	88,440.00	
	BTPS 2 12/01/25	100,000	99,830.00	
	BTPS 2.15 12/15/21	100,000	102,890.00	
	BTPS 3 08/01/29	100,000	103,310.00	
	BTPS 3 1/2 03/01/30	100,000	107,490.00	
	BTPS 3 3/4 08/01/21	100,000	106,330.00	
	BTPS 3 3/4 09/01/24	100,000	109,210.00	
	BTPS 4 02/01/37	100,000	111,840.00	
	BTPS 4 1/2 03/01/24	100,000	112,520.00	
	BTPS 4 1/2 05/01/23	100,000	111,330.00	
	BTPS 4 3/4 08/01/23	100,000	112,860.00	
	BTPS 4 3/4 09/01/21	100,000	108,660.00	
	BTPS 4 3/4 09/01/28	100,000	119,500.00	

		BTPS 5 08/01/34	100,000	123,750.00	
		BTPS 5 08/01/39	100,000	124,630.00	
		BTPS 5 09/01/40	100,000	123,870.00	
		BTPS 5 1/2 11/01/22	200,000	227,540.00	
		BTPS 5 3/4 02/01/33	100,000	131,070.00	
		BTPS 6 05/01/31	100,000	132,350.00	
		BTPS 6 1/2 11/01/27	100,000	131,260.00	
		BTPS 7 1/4 11/01/26	100,000	134,120.00	
		DBR 0 1/2 02/15/26	100,000	106,312.00	
		DBR 0 1/4 08/15/28	200,000	208,324.00	
		DBR 1 08/15/24	100,000	108,128.00	
		DBR 1 08/15/25	100,000	109,258.00	
		DBR 1 1/2 09/04/22	100,000	107,139.00	
		DBR 1 3/4 07/04/22	100,000	107,570.00	
		DBR 2 1/2 07/04/44	100,000	149,205.00	
		DBR 2 1/2 08/15/46	100,000	151,883.00	
		DBR 3 07/04/20	100,000	103,997.00	
		DBR 4 01/04/37	100,000	165,459.00	
		DBR 4 3/4 07/04/34	100,000	169,773.00	
		DBR 6.5 07/04/27	100,000	156,172.00	
		FRTR 0 02/25/21	100,000	100,650.00	
		FRTR 0 3/4 11/25/28	100,000	105,010.00	
		FRTR 1 05/25/27	200,000	215,680.00	
		FRTR 1 1/2 05/25/31	100,000	112,310.00	
		FRTR 1 1/4 05/25/36	100,000	106,660.00	
		FRTR 1 11/25/25	100,000	107,520.00	
		FRTR 1 3/4 05/25/23	100,000	108,810.00	
		FRTR 1 3/4 11/25/24	200,000	222,620.00	
		FRTR 2 05/25/48	100,000	117,210.00	
		FRTR 2 1/2 05/25/30	100,000	122,960.00	
		FRTR 2 1/4 10/25/22	300,000	328,425.00	
		FRTR 3 1/2 04/25/26	200,000	250,730.00	
		FRTR 3 1/4 05/25/45	100,000	146,420.00	
		FRTR 3 1/4 10/25/21	100,000	109,280.00	
		FRTR 3 3/4 04/25/21	100,000	108,330.00	
		FRTR 4 10/25/38	100,000	155,510.00	
		FRTR 4 3/4 04/25/35	100,000	161,080.00	
		FRTR 4.25 10/23	100,000	120,810.00	
		FRTR 5 1/2 04/25/29	100,000	151,810.00	
		FRTR 5 3/4 10/25/32	100,000	168,120.00	
		FRTR 6 10/25/25	100,000	139,740.00	
		FRTR4.5 04/25/41	100,000	168,980.00	

		IRISH 1.3 05/15/33	100,000	105,130.00	
		IRISH 5.4 03/13/25	100,000	131,460.00	
		NETHER 0 01/15/22	100,000	101,600.00	
		NETHER 2 07/15/24	100,000	112,600.00	
		NETHER 3 3/4 01/15/42	100,000	170,150.00	
		NETHER 5 1/2 01/15/28	100,000	148,740.00	
		NETHER 7 1/2 01/15/23	100,000	129,690.00	
		OBL 0 04/05/24	100,000	102,669.00	
		OBL 0 04/09/21	200,000	202,436.00	
		OBL 0 1/4 10/16/20	100,000	101,227.00	
		OBL 0 10/13/23	200,000	205,282.00	
		RAGB 0 09/20/22	100,000	101,760.00	
		RAGB 0 3/4 02/20/28	100,000	105,940.00	
		RAGB 4.15 03/37	100,000	158,550.00	
		RAGB 6 1/4 07/15/27	100,000	151,170.00	
		RFGB 0 1/2 09/15/28	100,000	103,590.00	
		RFGB 4 07/04/25	100,000	126,300.00	
		SPGB 0.05 01/31/21	100,000	100,612.00	
		SPGB 1.45 10/31/27	100,000	107,200.00	
		SPGB 1.95 04/30/26	100,000	110,930.00	
		SPGB 2 3/4 10/31/24	100,000	114,455.00	
		SPGB 2.15 10/31/25	200,000	222,740.00	
		SPGB 4.2 01/31/37	100,000	142,660.00	
		SPGB 4.4 10/31/23	100,000	119,765.00	
		SPGB 4.7 07/30/41	100,000	155,040.00	
		SPGB 4.85 10/31/20	100,000	107,400.00	
		SPGB 4.9 07/30/40	100,000	157,370.00	
		SPGB 5 1/2 04/30/21	100,000	111,176.00	
		SPGB 5.15 10/31/28	100,000	140,170.00	
		SPGB 5.85 01/31/22	100,000	116,400.00	
		SPGB 6 01/31/29	100,000	149,400.00	
	ユーロ小計		10,700,000	12,858,653.00 (1,576,728,030)	
		銘柄数	96		
		比　率	37.5%	38.3%	

英ポンド				英ポンド
	UKT 1 04/22/24	100,000	101,440.00	
	UKT 1 1/2 07/22/47	100,000	99,620.00	
	UKT 1 1/4 07/22/27	100,000	103,100.00	
	UKT 1 3/4 09/07/22	100,000	103,620.00	
	UKT 1 5/8 10/22/28	100,000	106,040.00	
	UKT 2 09/07/25	100,000	107,830.00	
	UKT 2 1/4 09/07/23	100,000	106,680.00	
	UKT 3 1/2 01/22/45	100,000	141,860.00	
	UKT 3 1/2 07/22/68	100,000	173,640.00	
	UKT 3 1/4 01/22/44	100,000	135,400.00	
	UKT 3 3/4 07/22/52	100,000	159,890.00	
	UKT 3 3/4 09/07/20	100,000	103,910.00	
	UKT 4 01/22/60	100,000	179,460.00	
	UKT 4 1/4 12/07/27	30,000	38,421.00	
	UKT 6 12/07/28	10,000	14,628.00	
	UKT 8 06/07/21	150,000	172,425.00	
英ポンド小計		1,490,000	1,847,964.00 (256,793,077)	
	銘柄数	16		
	比　率	6.1%	6.2%	
スウェーデン クローネ			スウェーデン クローネ	
	SGB 0 3/4 05/12/28 #1060	100,000	106,390.00	
	SGB 1 1/2 11/13/23	200,000	217,072.00	
	SGB 1 11/12/26 #1059	100,000	108,115.00	
	SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	100,000	116,349.00	
	SGB 3 1/2 03/30/39	100,000	152,400.00	
	SGB 3 1/2 06/01/22	200,000	224,058.00	
	SGB 5 12/01/20	200,000	216,868.00	
スウェーデン クローネ小計		1,000,000	1,141,252.00 (13,055,922)	
	銘柄数	7		
	比　率	0.3%	0.3%	
ノルウェー クローネ			ノルウェー クローネ	
	NGB 1 1/2 02/19/26	100,000	100,100.00	
	NGB 1 3/4 02/17/27	100,000	101,500.00	
	NGB 1 3/4 03/13/25	100,000	101,850.00	
	NGB 2 04/26/28	100,000	103,340.00	
	NGB 2 05/24/23	200,000	204,940.00	
	NGB 3 03/14/24	100,000	107,410.00	
	NGB 3 3/4 05/25/21	200,000	209,640.00	

ノルウェークローネ小計		900,000	928,780.00 (11,693,340)	
	銘柄数	7		
	比　率	0.3%	0.3%	
デンマーククローネ			デンマーククローネ	
	DGB 0 1/2 11/15/27	200,000	212,620.00	
	DGB 0 1/4 11/15/20	100,000	101,320.00	
	DGB 1 1/2 11/15/23	100,000	109,230.00	
	DGB 1 3/4 11/15/25	200,000	228,120.00	
	DGB 3 11/15/21	200,000	218,180.00	
	DGB 4 1/2 11/15/39	300,000	549,030.00	
デンマーククローネ小計		1,100,000	1,418,500.00 (23,277,585)	
	銘柄数	6		
	比　率	0.6%	0.6%	
ポーランドズロチ			ポーランドズロチ	
	POLGB 0 07/25/20	100,000	98,140.00	
	POLGB 1 3/4 07/25/21	200,000	200,160.00	
	POLGB 2 1/2 01/25/23	100,000	101,730.00	
	POLGB 2 1/2 07/25/26	100,000	99,440.00	
	POLGB 2 1/2 07/25/27	100,000	98,260.00	
	POLGB 3 1/4 07/25/25	100,000	104,590.00	
	POLGB 5 3/4 09/23/22	100,000	112,160.00	
ポーランドズロチ小計		800,000	814,480.00 (23,285,983)	
	銘柄数	7		
	比　率	0.6%	0.6%	
豪ドル			豪ドル	
	ACGB 2 1/4 05/21/28	100,000	106,170.00	
	ACGB 2 3/4 04/21/24	100,000	107,460.00	
	ACGB 2 3/4 11/21/27	100,000	110,110.00	
	ACGB 3 03/21/47	100,000	115,910.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/25	100,000	111,070.00	
	ACGB 3 1/4 04/21/29	100,000	115,850.00	
	ACGB 4 1/4 04/21/26	100,000	118,750.00	
	ACGB 5 1/2 04/21/23	100,000	116,550.00	
	ACGB 5 3/4 05/15/21	100,000	108,913.00	
	ACGB 5 3/4 07/15/22	100,000	114,175.00	
豪ドル小計		1,000,000	1,124,958.00 (85,361,813)	
	銘柄数	10		
	比　率	2.0%	2.1%	
シンガポールドル			シンガポールドル	
	SIGB 3 1/2 03/01/27	200,000	220,440.00	

	シンガポールドル小計		200,000	220,440.00 (17,569,068)	
		銘柄数	1		
		比　率	0.4%	0.4%	
	マレーシアリンギット			マレーシアリンギット	
		MGS 3.48 03/15/23	100,000	99,570.20	
		MGS 3.502 05/31/27	100,000	97,639.20	
		MGS 3.844 04/15/33	100,000	96,800.00	
		MGS 3.882 03/10/22	100,000	101,241.50	
		MGS 4.16 07/15/21	100,000	101,556.20	
		MGS 4.181 07/15/24	100,000	102,261.40	
		MGS 4.392 04/15/26	100,000	103,625.30	
	マレーシアリンギット小計		700,000	702,693.80 (18,389,496)	
		銘柄数	7		
		比　率	0.4%	0.4%	
	南アフリカランド			南アフリカランド	
		SAGB 10 1/2 12/21/26	500,000	556,100.00	
		SAGB 6 1/2 02/28/41	200,000	141,420.00	
		SAGB 6 1/4 03/31/36	200,000	145,480.00	
		SAGB 6 3/4 03/31/21	100,000	100,163.00	
		SAGB 7 02/28/31	300,000	253,230.00	
		SAGB 7 3/4 02/28/23	200,000	201,600.00	
		SAGB 8 01/31/30 #2030	300,000	278,880.00	
		SAGB 8 1/2 01/31/37 #203	300,000	271,560.00	
		SAGB 8 1/4 03/31/32 #203	200,000	184,920.00	
		SAGB 8 3/4 01/31/44	300,000	272,610.00	
		SAGB 8 3/4 02/28/48	500,000	451,250.00	
		SAGB 8 7/8 02/28/35 #203	200,000	188,660.00	
		SAGB 9 01/31/40 #2040	200,000	187,260.00	
	南アフリカランド小計		3,500,000	3,233,133.00 (24,539,479)	
		銘柄数	13		
		比　率	0.6%	0.6%	
国債証券合計				円 4,118,136,433 (4,118,136,433)	
合計				円 4,118,136,433 (4,118,136,433)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

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。

「ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

		[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28日現在]
区　　分	注記番号	金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
預金		196,267,583	171,177,085
コール・ローン		49,833,541	49,487,419
株式		10,278,689,668	9,706,276,629
投資証券		257,835,967	272,323,419
派生商品評価勘定		3,731,134	365,659
未収入金		1,169,929,279	3,620,809
未収配当金		24,511,805	21,083,181
差入委託証拠金		182,885,968	93,104,234
流動資産合計		12,163,684,945	10,317,438,435
資産合計		12,163,684,945	10,317,438,435
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		2,461,970	4,879,192
未払金		—	27,853
未払解約金		221,692,773	19,134,013
未払利息		138	62
流動負債合計		224,154,881	24,041,120
負債合計		224,154,881	24,041,120
純資産の部			
元本等			
元本	※1	5,018,570,719	4,217,840,204
剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		6,920,959,345	6,075,557,111
元本等合計		11,939,530,064	10,293,397,315
純資産合計		11,939,530,064	10,293,397,315
負債純資産合計		12,163,684,945	10,317,438,435

(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 5月29日 至 2019年 5月28日

1．有価証券の評価基準及び評価方法	株式及び投資証券 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	(1)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。 (2)為替予約取引 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、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。
3．その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「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）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。

（貸借対照表に関する注記）

区　　分	[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28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	21,776,861,226円	5,018,570,719円
同期中における追加設定元本額	2,326,218,126円	2,351,591,429円
同期中における一部解約元本額	19,084,508,633円	3,152,321,944円
同期末における元本額	5,018,570,719円	4,217,840,204円
元本の内訳＊		
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	1,852,618円	1,932,867円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	3,906,523円	3,789,447円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	11,051,544円	11,698,912円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	15,189,410円	15,625,177円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	21,240,957円	18,278,820円
東京海上セレクション・外国株式インデックス	2,044,808,094円	3,623,087,064円

東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	36,086,261円	45,610,026円
ＴＭＡ外国株式インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	144,232,407円	90,627,635円
ＴＭＡ世界バランスファンド55ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	3,509,174円	―円
ＴＭＡ世界バランスファンド35ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	2,679,326,204円	150,788,499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＞	5,098,429円	26,948,767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＞	52,269,098円	229,452,990円
計	5,018,570,719円	4,217,840,204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	5,018,570,719口	4,217,840,204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）

I. 金融商品の状況に関する事項

区　　分	自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引及び為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

Ⅱ．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28日現在]
1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）
（自 2017年5月30日　至 2018年5月28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	381,410,076
投資証券	△16,088,716
合計	365,321,360

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2017年11月11日から2018年5月28日まで)を指しております。

（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	267,033,558
投資証券	24,169,610
合計	291,203,168

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2018年11月13日から2019年5月28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

(1) 株式関連
（2018年5月28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	943,242,959	—	944,275,099	1,032,140
	S&P 500 EMIN	579,694,368	—	580,584,025	889,657
	DJ EU STX 50	183,810,420	—	183,513,136	△297,284
	FTSE 100 IDX	179,738,171	—	180,177,938	439,767
合計		943,242,959	—	944,275,099	1,032,140

（2019年5月28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	294,581,413	—	290,067,880	△4,513,533
	S&P 500 EMIN	189,634,166	—	186,168,194	△3,465,972
	DJ EU STX 50	54,133,050	—	53,432,890	△700,160
	FTSE 100 IDX	50,814,197	—	50,466,796	△347,401
合計		294,581,413	—	290,067,880	△4,513,533

(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。
また契約額等及び時価の邦貨換算は本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
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。

(2) 通貨関連
（2018年5月28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
市場取引以外の取引	為替予約取引				
	売建	630,151,184	—	629,914,160	237,024
	米ドル	419,708,873	—	419,654,030	54,843
	加ドル	21,724,732	—	21,677,950	46,782
	ユーロ	87,581,410	—	87,519,620	61,790
	英ポンド	54,182,548	—	54,110,350	72,198
	スイスフラン	11,480,343	—	11,479,520	823
	スウェーデンクローネ	11,760,294	—	11,775,060	△14,766
	ノルウェークローネ	2,029,289	—	2,027,930	1,359
	デンマーククローネ	3,686,227	—	3,680,800	5,427
	香港ドル	13,093,398	—	13,085,100	8,298
	シンガポールドル	4,904,070	—	4,903,800	270

合計	630,151,184	—	629,914,160	237,024

(注)1.時価の算定方法

(1) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。

①同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。

②同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。

・ 同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。

(2) 本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.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。

（2019年5月28日現在）

該当事項はありません。

（1口当たり情報に関する注記）

[2018年 5月28日現在]		[2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	2.3791円	1口当たり純資産額	2.4404円
（1万口当たり純資産額	23,791円）	（1万口当たり純資産額	24,404円）

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
米ドル	株	米ドル	米ドル	
ANADARKO PETROLEUM CORP	1,304	71.99	93,874.96	
APACHE CORP	1,323	27.33	36,157.59	
BAKER HUGHES A GE CO	1,437	22.21	31,915.77	
CABOT OIL & GAS CORP	1,197	25.70	30,762.90	
CHEVRONTEXACO CORP	4,775	118.71	566,840.25	
CIMAREX ENERGY CO	341	64.00	21,824.00	
CONCHO RESOURCES INC	542	101.23	54,866.66	
CONOCOPHILLIPS	2,719	59.88	162,813.72	
DEVON ENERGY CORPORATION	1,513	26.99	40,835.87	
EOG RESOURCES INC	1,493	87.16	130,129.88	
EXXON MOBIL CORPORATION	10,570	74.10	783,237.00	
HALLIBURTON CO	2,176	22.97	49,982.72	
HELMERICH & PAYNE	387	50.47	19,531.89	
HESS CORP	788	59.47	46,862.36	
HOLLYFRONTIER CORP	664	41.11	27,297.04	
KINDER MORGAN INC	5,109	20.06	102,486.54	
MARATHON OIL CORP	2,810	14.43	40,548.30	

MARATHON PETROLEUM CORP	1,842	50.29	92,634.18	
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,298	22.39	29,062.22	
NOBLE ENERGY INC	1,665	21.70	36,130.50	
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	1,928	53.47	103,090.16	
ONEOK INC	1,018	65.66	66,841.88	
PHILLIPS 66	1,124	82.94	93,224.56	
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	450	147.00	66,150.00	
SCHLUMBERGER LTD	3,310	37.00	122,470.00	
TECHNIPFMC PLC	1,493	22.01	32,860.93	
VALERO ENERGY CORP	1,138	76.22	86,738.36	
WILLIAMS COS INC	3,124	26.99	84,316.76	
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	521	204.49	106,539.29	
ALBEMARLE CORP	344	66.80	22,979.20	
AVERY DENNISON CORP	301	101.26	30,479.26	
BALL CORP	931	61.35	57,116.85	
CELANESE CORP-SERIES A	433	99.38	43,031.54	
DOW INC	1,972	49.20	97,022.40	
DOWDUPONT INC	5,870	31.08	182,439.60	
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	480	68.78	33,014.40	
ECOLAB INC	586	182.48	106,933.28	
INTERNATIONAL PAPER CO	1,091	42.77	46,662.07	
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	261	134.71	35,159.31	
LINDE PLC	1,385	187.86	260,186.10	
LyondellBasell Industries NV	809	77.93	63,045.37	
MOSAIC CO/THE	1,287	21.60	27,799.20	
NEWMONT GOLDCORP CORPORATION	1,901	31.92	60,679.92	
NUCOR CORP	946	51.16	48,397.36	
PACKAGING CORP OF AMERICA	337	91.01	30,670.37	
PPG INDUSTRIES INC	574	107.75	61,848.50	
SEALED AIR CORP	650	41.70	27,105.00	
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	215	430.72	92,604.80	
VULCAN MATERIALS CO	386	126.25	48,732.50	
WESTROCK CO	933	34.84	32,505.72	
3M CO	1,442	166.09	239,501.78	
ACUITY BRANDS INC	179	135.51	24,256.29	
AMETEK INC	660	84.49	55,763.40	
BOEING CO	1,372	354.90	486,922.80	
CATERPILLAR INC	1,524	122.90	187,299.60	
CUMMINS INC	350	159.92	55,972.00	
DEERE & CO	802	138.95	111,437.90	
DOVER CORP	484	90.90	43,995.60	
EATON CORP PLC	1,009	77.39	78,086.51	

EMERSON ELECTRIC CO	1,437	62.53	89,855.61	
FASTENAL CO	1,524	30.86	47,030.64	
FLOWSERVE CORP	516	48.64	25,098.24	
FLUOR CORP	635	29.04	18,440.40	
FORTIVE CORP	737	78.04	57,515.48	
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	560	52.97	29,663.20	
GENERAL DYNAMICS CORP	632	164.03	103,666.96	
GENERAL ELECTRIC CO	22,594	9.45	213,513.30	
HARRIS CORP	293	187.08	54,814.44	
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	1,804	166.68	300,690.72	
ILLINOIS TOOL WORKS INC	744	145.72	108,415.68	
INGERSOLL-RAND PLC	612	120.19	73,556.28	
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	454	75.85	34,435.90	
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,325	38.51	89,535.75	
L3 TECHNOLOGIES INC	206	242.15	49,882.90	
LENNOX INTERNATIONAL INC	128	274.33	35,114.24	
LOCKHEED MARTIN CORP	653	338.78	221,223.34	
MASCO CORP	1,051	37.28	39,181.28	
MIDDLEBY CORP	204	137.78	28,107.12	
NORTHROP GRUMMAN CORP	426	312.07	132,941.82	
PACCAR INC	823	67.56	55,601.88	
PARKER HANNIFIN CORP	321	158.30	50,814.30	
PENTAIR PLC	644	36.25	23,345.00	
RAYTHEON COMPANY	726	180.00	130,680.00	
ROCKWELL AUTOMATION INC	301	154.78	46,588.78	
ROPER TECHNOLOGIES INC	249	348.07	86,669.43	
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	585	44.16	25,833.60	
STANLEY BLACK & DECKER INC	420	132.80	55,776.00	
TEXTRON INC	800	47.56	38,048.00	
TRANSDIGM GROUP INC	130	445.90	57,967.00	
UNITED RENTALS INC	291	118.54	34,495.14	
UNITED TECHNOLOGIES CORP	2,074	131.40	272,523.60	
WABCO HOLDINGS INC	175	130.26	22,795.50	
WABTEC CORP/DE	550	65.46	36,003.00	
WW GRAINGER INC	153	258.56	39,559.68	
XYLEM INC	571	73.93	42,214.03	
CINTAS CORP	235	222.50	52,287.50	
COPART INC	661	70.99	46,924.39	
COSTAR GROUP INC	100	514.08	51,408.00	
EQUIFAX INC	344	121.72	41,871.68	
IHS MARKIT LTD	818	58.38	47,754.84	
MANPOWERGROUP	273	91.52	24,984.96	

NIELSEN HOLDINGS PLC	1,300	23.00	29,900.00	
REPUBLIC SERVICES INC	536	84.56	45,324.16	
ROBERT HALF INTL INC	422	56.31	23,762.82	
ROLLINS INC	590	37.03	21,847.70	
TRANSUNION	635	65.37	41,509.95	
VERISK ANALYTICS INC	302	142.21	42,947.42	
WASTE CONNECTIONS INC	510	94.61	48,251.10	
WASTE MANAGEMENT INC	938	108.43	101,707.34	
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	455	79.72	36,272.60	
CSX CORP	1,989	74.90	148,976.10	
EXPEDITORS INTL WASH INC	561	71.71	40,229.31	
FEDEX CORP	646	159.93	103,314.78	
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	319	89.26	28,473.94	
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	647	30.00	19,410.00	
NORFOLK SOUTHERN CORP	684	199.27	136,300.68	
SOUTHWEST AIRLINES CO	558	51.15	28,541.70	
UNION PACIFIC CORP	1,840	172.17	316,792.80	
UNITED PARCEL SERVICE CL B	1,754	95.85	168,120.90	
APTIV PLC	728	67.81	49,365.68	
AUTOLIV INC	366	66.00	24,156.00	
BORGWARNER INC	792	35.64	28,226.88	
FORD MOTOR CO	9,880	9.83	97,120.40	
GENERAL MOTORS CO	3,315	35.12	116,422.80	
GOODYEAR TIRE & RUBBER CO	1,154	14.64	16,894.56	
HARLEY-DAVIDSON INC	719	34.50	24,805.50	
TESLA INC	347	190.63	66,148.61	
CAPRI HOLDINGS LTD	533	38.99	20,781.67	
DR HORTON INC	1,071	44.63	47,798.73	
GARMIN LTD	394	77.65	30,594.10	
HASBRO INC	372	98.32	36,575.04	
KONTOOR BRANDS INC	117	36.40	4,258.80	
LEGGETT & PLATT INC	570	37.19	21,198.30	
LENNAR CORP-CL A	894	51.91	46,407.54	
LULULEMON ATHLETICA INC	298	172.78	51,488.44	
MOHAWK INDUSTRIES INC	237	145.90	34,578.30	
NEWELL BRANDS INC	1,486	15.05	22,364.30	
NIKE INC -CL B	3,188	82.16	261,926.08	
POLARIS INDUSTRIES INC	242	86.34	20,894.28	
PULTE HOMES INC	975	32.12	31,317.00	
PVH CORP	282	106.96	30,162.72	
RALPH LAUREN CORP	184	109.24	20,100.16	
TAPESTRY INC	1,089	29.71	32,354.19	

VF CORP	822	84.04	69,080.88	
WHIRLPOOL CORP	242	124.89	30,223.38	
ARAMARK	957	31.56	30,202.92	
CARNIVAL CORP	1,065	51.61	54,964.65	
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	68	662.56	45,054.08	
DARDEN RESTAURANTS INC	372	120.13	44,688.36	
DOMINO'S PIZZA INC	139	282.61	39,282.79	
H&R BLOCK INC	885	27.54	24,372.90	
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	767	89.91	68,960.97	
LAS VEGAS SANDS CORP	1,055	57.43	60,588.65	
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	766	125.00	95,750.00	
MCDONALD'S CORP	1,929	197.77	381,498.33	
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	441	123.68	54,542.88	
STARBUCKS CORP	3,170	76.15	241,395.50	
VAIL RESORTS INC	150	214.41	32,161.50	
YUM! BRANDS INC	783	100.99	79,075.17	
ACTIVISION BLIZZARD INC	1,910	42.29	80,773.90	
ALPHABET INC-CL A	761	1,138.61	866,482.21	
ALPHABET INC-CL C	790	1,133.47	895,441.30	
CBS CORP CL-B	1,039	47.48	49,331.72	
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	433	375.00	162,375.00	
COMCAST CORP-CL A	11,677	42.67	498,257.59	
DISCOVERY INC-A	736	27.14	19,975.04	
DISCOVERY INC-C	1,053	25.51	26,862.03	
ELECTRONIC ARTS INC	820	92.31	75,694.20	
FACEBOOK INC-A	6,086	181.06	1,101,931.16	
FOX CORP-CLASS A	1,115	36.92	41,165.80	
FOX CORP-CLASS B	643	36.45	23,437.35	
IAC/INTERACTIVECORP	238	222.88	53,045.44	
INTERPUBLIC GROUP COS INC	1,440	22.10	31,824.00	
LIBERTY BROADBAND-C	383	99.48	38,100.84	
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	693	37.29	25,841.97	
NETFLIX INC	1,126	354.39	399,043.14	
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	1,913	11.78	22,535.14	
TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWRE	339	105.02	35,601.78	
THE WALT DISNEY CO	4,601	132.79	610,966.79	
TRIPADVISOR INC-W/I	384	45.24	17,372.16	
TWITTER INC	1,785	37.41	66,776.85	
VIACOM INC CL B	1,229	28.06	34,485.74	
ADVANCE AUTO PARTS	228	158.09	36,044.52	
AMAZON.COM INC	1,048	1,823.28	1,910,797.44	
AUTOZONE INC	67	1,052.19	70,496.73	

BEST BUY COMPANY INC	701	65.94	46,223.94	
BOOKING HOLDINGS INC	117	1,708.48	199,892.16	
CARMAX INC	558	76.48	42,675.84	
Dollar General Corp	649	121.96	79,152.04	
DOLLAR TREE INC	623	98.42	61,315.66	
EBAY INC	2,342	36.13	84,616.46	
EXPEDIA GROUP INC	332	115.92	38,485.44	
GENUINE PARTS CO	453	98.59	44,661.27	
HOME DEPOT INC	2,836	193.59	549,021.24	
KOHLS CORP	523	51.12	26,735.76	
LKQ CORP	1,199	26.54	31,821.46	
LOWE'S COMPANIES	2,041	95.37	194,650.17	
MERCADOLIBRE INC	115	592.55	68,143.25	
NORDSTROM INC	447	33.50	14,974.50	
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	215	366.85	78,872.75	
QURATE RETAIL INC-A	1,591	13.20	21,001.20	
ROSS STORES INC	921	92.78	85,450.38	
TARGET CORP	1,256	81.57	102,451.92	
TIFFANY & CO	348	93.65	32,590.20	
TJX COMPANIES INC	3,019	51.62	155,840.78	
TRACTOR SUPPLY COMPANY	405	101.14	40,961.70	
ULTA BEAUTY INC	148	335.09	49,593.32	
COSTCO WHOLESALE CORP	1,090	247.30	269,557.00	
KROGER CO	1,999	23.72	47,416.28	
SYSCO CORP	1,169	75.05	87,733.45	
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,033	51.77	105,248.41	
WALMART INC	3,588	102.67	368,379.96	
ALTRIA GROUP INC	4,750	52.40	248,900.00	
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,343	39.16	52,591.88	
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	871	52.13	45,405.23	
BUNGE LIMITED	557	50.55	28,156.35	
CAMPBELL SOUP CO	624	37.53	23,418.72	
COCA-COLA COMPANY	9,929	49.61	492,577.69	
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	732	56.15	41,101.80	
CONAGRA BRANDS INC	1,466	28.83	42,264.78	
CONSTELLATION BRANDS INC-A	436	198.68	86,624.48	
GENERAL MILS INC	1,525	52.81	80,535.25	
HORMEL FOODS CORP	1,026	40.27	41,317.02	
INGREDION INC	277	78.34	21,700.18	
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	377	126.69	47,762.13	
KELLOGG CO	717	56.56	40,553.52	
KRAFT HEINZ CO/THE	1,589	31.11	49,433.79	

MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	356	155.19	55,247.64	
MOLSON COORS BREWING CO -B	637	58.72	37,404.64	
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	3,496	52.13	182,246.48	
MONSTER BEVERAGE CORP	1,088	63.42	69,000.96	
PEPSICO INC	3,514	129.50	455,063.00	
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	3,926	84.64	332,296.64	
TYSON FOODS INC-CL A	763	81.46	62,153.98	
CHURCH & DWIGHT CO INC	717	74.71	53,567.07	
CLOROX COMPANY	324	149.63	48,480.12	
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,047	71.20	145,746.40	
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	559	165.16	92,324.44	
KIMBERLY-CLARK CORP	890	130.63	116,260.70	
PROCTER & GAMBLE CO	6,227	106.69	664,358.63	
ABBOTT LABORATORIES	4,425	76.98	340,636.50	
ABIOMED INC	126	270.39	34,069.14	
ALIGN TECHNOLOGY INC	210	311.47	65,408.70	
AMERISOURCEBERGEN CORP	545	80.68	43,970.60	
ANTHEM INC	669	277.25	185,480.25	
BAXTER INTL INC	1,250	75.10	93,875.00	
BECTON DICKINSON & CO	679	235.19	159,694.01	
BOSTON SCIENTIFIC CORP	3,630	38.47	139,646.10	
CARDINAL HEALTH INC	962	45.95	44,203.90	
CENTENE CORP	1,166	56.87	66,310.42	
CERNER CORP	823	70.59	58,095.57	
CIGNA CORP	1,005	149.48	150,227.40	
COOPER COS INC/THE	155	291.22	45,139.10	
CVS HEALTH CORPORATION	3,322	53.07	176,298.54	
DANAHER CORP	1,581	132.04	208,755.24	
DAVITA INC	521	47.56	24,778.76	
DENTSPLY SIRONA INC	732	53.75	39,345.00	
Edwards Lifesciences Corp	537	169.38	90,957.06	
HCA HEALTHCARE INC	748	123.84	92,632.32	
HUMANA INC	366	263.33	96,378.78	
IDEXX LABORATORIES INC	245	256.11	62,746.95	
INTUITIVE SURGICAL INC	297	476.53	141,529.41	
MCKESSON CORP	510	129.92	66,259.20	
MEDTRONIC PLC	3,301	93.03	307,092.03	
QUEST DIAGNOSTICS	449	98.04	44,019.96	
RESMED INC	427	113.89	48,631.03	
STRYKER CORP	838	184.77	154,837.26	
TELEFLEX INC	154	295.61	45,523.94	
UNITEDHEALTH GROUP INC	2,438	247.63	603,721.94	

UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	285	123.09	35,080.65	
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	312	128.07	39,957.84	
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	359	139.39	50,041.01	
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	526	114.52	60,237.52	
ABBVIE INC	3,803	80.06	304,468.18	
AGILENT TECHNOLOGIES INC	846	68.36	57,832.56	
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	596	127.15	75,781.40	
ALLERGAN PLC	893	135.51	121,010.43	
AMGEN INC	1,610	171.28	275,760.80	
BIOGEN INC	527	227.06	119,660.62	
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	584	89.07	52,016.88	
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	4,163	46.81	194,870.03	
CELGENE CORP	1,822	95.24	173,527.28	
ELI LILLY & CO	2,334	116.79	272,587.86	
GILEAD SCIENCES INC	3,265	66.89	218,395.85	
ILLUMINA INC	399	312.45	124,667.55	
INCYTE CORP	548	81.75	44,799.00	
IQVIA HOLDINGS INC	460	136.38	62,734.80	
JOHNSON & JOHNSON	6,711	138.85	931,822.35	
MERCK & CO. INC.	6,620	81.17	537,345.40	
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	73	728.82	53,203.86	
MYLAN NV	1,624	18.98	30,823.52	
PERRIGO CO PLC	550	47.35	26,042.50	
PFIZER INC	14,641	41.95	614,189.95	
Regeneron Pharmaceuticals Inc	208	312.56	65,012.48	
SEATTLE GENETICS INC	391	69.14	27,033.74	
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,049	271.80	285,118.20	
UNITED THERAPEUTICS CORP	189	87.50	16,537.50	
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	692	171.77	118,864.84	
WATERS CORP	237	206.25	48,881.25	
ZOETIS INC	1,283	102.40	131,379.20	
BANK OF AMERICA CORP	23,593	28.18	664,850.74	
BB&T CORPORATION	1,855	48.33	89,652.15	
CITIGROUP INC	6,301	64.39	405,721.39	
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,461	34.44	50,316.84	
COMERICA INC	552	72.42	39,975.84	
FIFTH THIRD BANCORP	2,010	27.23	54,732.30	
FIRST REPUBLIC BANK/CA	479	100.52	48,149.08	
HUNTINGTON BANCSHARES INC	3,483	13.21	46,010.43	
JPMORGAN CHASE & CO	8,330	109.71	913,884.30	
KEYCORP	3,192	16.63	53,082.96	
M & T BANK CORP	318	164.92	52,444.56	

PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	1,643	16.05	26,370.15	
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,149	131.97	151,633.53	
REGIONS FINANCIAL CORP	3,337	14.19	47,352.03	
SUNTRUST BANKS INC	1,173	62.35	73,136.55	
SVB FINANCIAL GROUP	177	224.60	39,754.20	
US BANCORP	3,594	51.33	184,480.02	
WELLS FARGO & COMPANY	11,229	46.17	518,442.93	
AFFILIATED MANAGERS GROUP	231	88.40	20,420.40	
AMERICAN EXPRESS COMPANY	1,833	119.51	219,061.83	
AMERIPRISE FINANCIAL INC	422	146.39	61,776.58	
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,533	45.16	114,390.28	
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	3,251	201.69	655,694.19	
BLACKROCK INC	296	435.76	128,984.96	
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,303	90.78	118,286.34	
CBOE GLOBAL MARKETS INC	343	106.95	36,683.85	
CME GROUP INC	884	187.92	166,121.28	
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	950	76.90	73,055.00	
E*TRADE FINANCIAL CORP	848	46.85	39,728.80	
FRANKLIN RESOURCES INC	1,036	33.28	34,478.08	
GOLDMAN SACHS GROUP INC	897	193.00	173,121.00	
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,337	81.83	109,406.71	
INVESCO LTD	1,559	20.42	31,834.78	
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	1,269	18.45	23,413.05	
MOODY'S CORP	473	185.10	87,552.30	
MORGAN STANLEY	3,482	42.96	149,586.72	
MSCI INC	271	218.86	59,311.06	
NORTHERN TRUST CORP	559	91.34	51,059.06	
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	448	86.84	38,904.32	
S&P GLOBAL INC	640	214.33	137,171.20	
SCHWAB (CHARLES) CORP	3,134	43.25	135,545.50	
SEI INVESTMENTS COMPANY	543	52.04	28,257.72	
STATE STREET CORP	1,034	58.97	60,974.98	
SYNCHRONY FINANCIAL	1,708	34.81	59,455.48	
T ROWE PRICE GROUP INC	596	103.75	61,835.00	
TD AMERITRADE HOLDING CORP	882	51.98	45,846.36	
VOYA FINANCIAL INC	568	53.16	30,194.88	
AFLAC INC	1,596	52.01	83,007.96	
ALLEGHANY CORP	53	685.85	36,350.05	
ALLSTATE CORP	817	96.37	78,734.29	
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	2,376	52.76	125,357.76	
AON PLC	597	177.79	106,140.63	
ARTHUR J GALLAGHER & CO	574	84.28	48,376.72	

ASSURANT INC	261	100.85	26,321.85	
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	639	43.09	27,534.51	
BRIGHTHOUSE FINANCIAL INC	542	37.76	20,465.92	
CHUBB LTD	1,099	148.17	162,838.83	
CINCINNATI FINANCIAL CORP	499	99.69	49,745.31	
EVEREST RE GROUP LTD	150	249.91	37,486.50	
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	980	38.85	38,073.00	
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	1,022	53.24	54,411.28	
LINCOLN NATIONAL CORP	707	63.49	44,887.43	
LOEWS CORP	895	52.22	46,736.90	
MARSH & MCLENNAN COS	1,161	95.38	110,736.18	
METLIFE INC	2,108	47.83	100,825.64	
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	843	54.22	45,707.46	
PROGRESSIVE CORP	1,488	80.22	119,367.36	
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,053	97.75	102,930.75	
TORCHMARK CORP	386	87.19	33,655.34	
TRAVELERS COS INC/THE	616	147.94	91,131.04	
UNUM GROUP	860	33.99	29,231.40	
WILLIS TOWERS WATSON PLC	327	177.73	58,117.71	
WR BERKLEY CORP	513	62.06	31,836.78	
CBRE GROUP INC - A	1,001	48.11	48,158.11	
ACCENTURE PLC-CL A	1,547	178.81	276,619.07	
ADOBE INC	1,260	274.77	346,210.20	
AKAMAI TECHNOLOGIES	517	77.89	40,269.13	
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	181	143.34	25,944.54	
ANSYS INC	246	182.15	44,808.90	
AUTODESK INC	608	161.22	98,021.76	
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,057	161.85	171,075.45	
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	388	123.90	48,073.20	
CDK GLOBAL INC	463	50.21	23,247.23	
CITRIX SYSTEMS INC	450	94.65	42,592.50	
COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,458	61.87	90,206.46	
DXC TECHNOLOGY CO	793	53.08	42,092.44	
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	789	118.74	93,685.86	
FISERV INC	1,049	86.90	91,158.10	
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	218	266.80	58,162.40	
FORTINET INC	475	77.74	36,926.50	
GARTNER INC	292	154.02	44,973.84	
GLOBAL PAYMENTS INC	411	153.44	63,063.84	
GODADDY INC - CLASS A	560	74.79	41,882.40	
INTL BUSINESS MACHINES CORP	2,249	132.28	297,497.72	
INTUIT INC	625	257.48	160,925.00	

JACK HENRY & ASSOCIATES INC	264	132.49	34,977.36	
LEIDOS HOLDINGS INC	478	76.27	36,457.06	
MASTERCARD INC-CLASS A	2,327	251.48	585,193.96	
MICROSOFT CORP	18,348	126.24	2,316,251.52	
ORACLE CORPORATION	6,557	52.77	346,012.89	
PALO ALTO NETWORKS INC	253	216.26	54,713.78	
PAYCHEX INC	663	86.17	57,130.71	
PAYPAL HOLDINGS INC	2,861	109.85	314,280.85	
RED HAT INC	421	185.69	78,175.49	
SALESFORCE.COM INC	1,974	154.51	305,002.74	
SERVICENOW INC	468	268.95	125,868.60	
SPLUNK INC	413	119.30	49,270.90	
SQUARE INC - A	849	64.66	54,896.34	
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	716	56.82	40,683.12	
SYMANTEC CORP	1,949	19.85	38,687.65	
SYNOPSYS INC	463	116.71	54,036.73	
TOTAL SYSTEM SERVICES INC	504	113.45	57,178.80	
VERISIGN INC	321	194.73	62,508.33	
VISA INC-CLASS A SHARES	4,408	162.64	716,917.12	
VMWARE INC-CLASS A	258	197.99	51,081.42	
WESTERN UNION CO	1,695	19.36	32,815.20	
WORKDAY INC-CLASS A	399	210.72	84,077.28	
WORLDPAY INC-CLASS A	801	120.01	96,128.01	
AMPHENOL CORP-CL A	728	89.51	65,163.28	
APPLE INC	11,947	178.97	2,138,154.59	
ARISTA NETWORKS INC	172	255.94	44,021.68	
CDW CORP/DE	474	103.19	48,912.06	
CISCO SYSTEMS INC	11,349	54.37	617,045.13	
COGNEX CORP	628	42.40	26,627.20	
CORNING INC	2,018	29.70	59,934.60	
F5 NETWORKS INC	216	136.94	29,579.04	
FLIR SYSTEMS INC	561	49.35	27,685.35	
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	3,793	14.39	54,581.27	
HP INC	4,045	20.03	81,021.35	
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	598	73.69	44,066.62	
MOTOROLA SOLUTIONS INC	463	150.63	69,741.69	
NETAPP INC	732	61.99	45,376.68	
SEAGATE TECHNOLOGY	885	43.19	38,223.15	
TE CONNECTIVITY LTD	851	86.67	73,756.17	
TRIMBLE INC	896	40.66	36,431.36	
WESTERN DIGITAL CORP	940	40.98	38,521.20	
XEROX CORP	900	31.91	28,719.00	

AT&T INC	18,250	32.27	588,927.50	
T-MOBILE US INC	881	77.27	68,074.87	
VERIZON COMMUNICATIONS INC	10,368	59.32	615,029.76	
AMEREN CORPORATION	671	75.38	50,579.98	
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,178	88.29	104,005.62	
AMERICAN WATER WORKS CO INC	513	113.69	58,322.97	
ATMOS ENERGY CORP	385	102.81	39,581.85	
CENTERPOINT ENERGY INC	1,434	29.39	42,145.26	
CMS ENERGY CORP	903	57.24	51,687.72	
CONSOLIDATED EDISON INC	706	88.14	62,226.84	
DOMINION ENERGY INC	1,821	77.72	141,528.12	
DTE ENERGY COMPANY	380	128.79	48,940.20	
DUKE ENERGY CORP	1,713	88.81	152,131.53	
EDISON INTERNATIONAL	850	60.89	51,756.50	
ENTERGY CORP	521	98.99	51,573.79	
EVERGY INC	635	59.41	37,725.35	
EVERSOURCE ENERGY	693	74.88	51,891.84	
EXELON CORP	2,285	49.56	113,244.60	
FIRSTENERGY CORP	1,274	42.86	54,603.64	
NEXTERA ENERGY INC	1,132	203.37	230,214.84	
NISOURCE INC	1,343	28.51	38,288.93	
OGE ENERGY CORP	774	42.93	33,227.82	
PINNACLE WEST CAPITAL	381	96.67	36,831.27	
PPL CORPORATION	1,668	30.80	51,374.40	
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,116	61.16	68,254.56	
SEMPRA ENERGY	655	134.35	87,999.25	
SOUTHERN CO	2,431	54.35	132,124.85	
WEC ENERGY GROUP INC	711	82.41	58,593.51	
XCEL ENERGY INC	1,248	58.99	73,619.52	
ADVANCED MICRO DEVICES	2,482	26.44	65,624.08	
ANALOG DEVICES	974	98.42	95,861.08	
APPLIED MATERIALS INC	2,595	39.50	102,502.50	
BROADCOM INC	1,045	255.94	267,457.30	
INTEL CORP	11,491	44.57	512,153.87	
KLA-TENCOR CORPORATION	446	103.81	46,299.26	
LAM RESEARCH CORP	408	181.90	74,215.20	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	769	53.35	41,026.15	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	644	80.42	51,790.48	
MICRON TECHNOLOGY INC	3,018	34.00	102,612.00	
NVIDIA CORP	1,488	145.15	215,983.20	
NXP SEMICONDUCTORS NV	893	91.81	81,986.33	
QUALCOMM INC	3,071	66.21	203,330.91	

SKYWORKS SOLUTIONS INC	536	69.53	37,268.08	
TEXAS INSTRUMENTS	2,402	105.06	252,354.12	
XILINX INC	672	101.21	68,013.12	
米ドル小計	733,056		60,217,176.74 (6,597,996,055)	
	銘柄数	482		
	比　率	64.1%	68.0%	
加ドル	**株**	**加ドル**	**加ドル**	
CAMECO CORP	1,616	13.52	21,848.32	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	3,038	35.90	109,064.20	
CENOVUS ENERGY INC	3,771	11.23	42,348.33	
ENBRIDGE INC	5,077	50.71	257,454.67	
ENCANA CORP	5,067	7.99	40,485.33	
HUSKY ENERGY INC	1,900	12.61	23,959.00	
IMPERIAL OIL LTD	1,060	37.10	39,326.00	
INTER PIPELINE LTD	1,476	20.39	30,095.64	
KEYERA CORP	889	33.50	29,781.50	
PEMBINA PIPELINE CORP	1,309	48.74	63,800.66	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,080	17.98	19,418.40	
SUNCOR ENERGY INC	4,203	42.80	179,888.40	
TC ENERGY CORP	2,348	65.68	154,216.64	
VERMILION ENERGY INC	773	29.80	23,035.40	
AGNICO EAGLE MINES LTD	843	55.43	46,727.49	
BARRICK GOLD CORP	3,986	15.93	63,496.98	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	629	62.34	39,211.86	
FRANCO-NEVADA CORP	446	99.04	44,171.84	
NUTRIEN LTD	1,565	64.97	101,678.05	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	1,523	27.43	41,775.89	
CAE INC	1,039	34.25	35,585.75	
SNC-LAVALIN GROUP INC	904	25.70	23,232.80	
THOMSON REUTERS CORP	646	87.24	56,357.04	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	1,788	124.50	222,606.00	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	377	304.36	114,743.72	
MAGNA INTERNATIONAL INC	925	60.15	55,638.75	
GILDAN ACTIVEWEAR INC	775	49.45	38,323.75	
RESTAURANT BRANDS INTERN	743	92.51	68,734.93	
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	1,724	27.52	47,444.48	
CANADIAN TIRE CORP -CL A	222	139.55	30,980.10	
DOLLARAMA INC	1,137	43.08	48,981.96	
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	1,172	85.21	99,866.12	
LOBLAW COMPANIES LTD	671	70.38	47,224.98	
METRO INC	879	49.57	43,572.03	

WESTON (GEORGE) LTD	345	102.84	35,479.80	
SAPUTO INC	811	45.30	36,738.30	
BANK OF MONTREAL	1,435	103.52	148,551.20	
BANK OF NOVA SCOTIA	2,825	70.57	199,360.25	
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	926	104.46	96,729.96	
NATIONAL BANK OF CANADA	1,045	62.57	65,385.65	
ROYAL BANK OF CANADA	3,440	104.74	360,305.60	
TORONTO-DOMINION BANK	4,352	76.52	333,015.04	
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	2,273	63.56	144,471.88	
IGM FINANCIAL INC	617	37.04	22,853.68	
GREAT-WEST LIFECO INC	1,111	31.61	35,118.71	
INTACT FINANCIAL CORP	464	118.52	54,993.28	
MANULIFE FINANCIAL CORP	5,123	23.67	121,261.41	
POWER CORP OF CANADA	1,200	29.04	34,848.00	
POWER FINANCIAL CORP	1,157	30.77	35,600.89	
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,439	54.23	78,036.97	
FIRST CAPITAL REALTY INC	1,165	21.10	24,581.50	
CGI INC	761	98.84	75,217.24	
CONSTELLATION SOFTWARE INC	58	1,203.99	69,831.42	
OPEN TEXT CORP	931	55.03	51,232.93	
BCE INC	608	60.86	37,002.88	
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,035	70.88	73,360.80	
TELUS CORP	300	50.56	15,168.00	
CANADIAN UTILITIES LTD-A	681	37.29	25,394.49	
FORTIS INC	1,317	50.82	66,929.94	
HYDRO ONE LTD	1,482	22.77	33,745.14	
加ドル小計	92,502		4,580,291.97 (373,431,204)	
	銘柄数	60		
	比　率	3.6%	3.8%	
ユーロ	**株**	**ユーロ**	**ユーロ**	
ENAGAS SA	906	25.73	23,311.38	
ENI SPA	7,078	14.07	99,587.46	
Galp Energia SGPS SA	1,739	14.09	24,502.51	
Koninklijke Vopak NV	417	36.73	15,316.41	
NESTE OYJ	1,128	31.26	35,261.28	
OMV AG	594	42.97	25,524.18	
REPSOL SA	2,608	14.62	38,142.00	
TENARIS SA	2,032	11.20	22,758.40	
TOTAL SA	5,807	47.85	277,864.95	
AIR LIQUIDE	969	114.45	110,902.05	
AKZO NOBEL	513	78.01	40,019.13	

ARCELORMITTAL	2,132	14.24	30,368.20	
BASF SE	2,206	60.99	134,543.94	
COVESTRO AG	609	41.46	25,249.14	
CRH PLC(DUBLIN)	2,214	28.37	62,811.18	
EVONIK INDUSTRIES AG	800	25.40	20,320.00	
FUCHS PETROLUB SE -PREF	356	35.36	12,588.16	
IMERYS SA	302	39.00	11,778.00	
KONINKLIJKE DSM NV	515	101.35	52,195.25	
LANXESS	371	47.22	17,518.62	
SOLVAY SA	277	85.88	23,788.76	
STORA ENSO OYJ-R SHS	2,226	9.89	22,024.04	
SYMRISE AG	386	84.74	32,709.64	
UMICORE	649	27.25	17,685.25	
UPM-KYMMENE OYJ	1,425	22.97	32,732.25	
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	779	37.76	29,415.04	
AIRBUS SE	1,469	116.84	171,637.96	
ALSTOM	623	40.34	25,131.82	
ANDRITZ AG	357	33.20	11,852.40	
BOUYGUES	846	31.84	26,936.64	
BRENNTAG AG	582	43.58	25,363.56	
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,366	33.22	45,385.35	
Eiffage SA	310	88.64	27,478.40	
FERROVIAL SA	1,641	21.77	35,724.57	
GEA GROUP AG	639	24.60	15,719.40	
KONE OYJ-B	736	50.88	37,447.68	
Legrand SA	700	61.58	43,106.00	
MTU AERO ENGINES AG	162	194.65	31,533.30	
SAFRAN SA	787	121.80	95,856.60	
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,286	73.84	94,958.24	
SIEMENS AG	1,823	105.30	191,961.90	
THALES SA	327	98.80	32,307.60	
VINCI S.A.	1,132	90.44	102,378.08	
WARTSILA	1,714	13.62	23,353.25	
Bureau Veritas SA	1,027	21.28	21,854.56	
EDENRED	782	40.48	31,655.36	
RANDSTAD NV	462	47.11	21,764.82	
TELEPERFORMANCE	182	174.50	31,759.00	
WOLTERS KLUWER	664	62.56	41,539.84	
AENA SME SA	195	167.20	32,604.00	
Aeroports de Paris	118	155.60	18,360.80	
ATLANTIA S.P.A	1,678	22.99	38,577.22	
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,056	17.46	18,443.04	

DEUTSCHE POST AG	2,329	27.05	62,999.45	
GETLINK SE	1,834	13.77	25,254.18	
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	935	63.76	59,615.60	
CONTINENTAL AG	307	124.92	38,350.44	
DAIMLER AG	2,463	47.70	117,485.10	
MICHELIN (CGDE)-B	391	105.90	41,406.90	
NOKIAN RENKAAT OYJ	456	25.75	11,742.00	
PEUGEOT SA	1,917	19.92	38,186.64	
PIRELLI & C SPA	2,572	5.23	13,461.84	
RENAULT SA	656	56.03	36,755.68	
VALEO SA	940	26.52	24,928.80	
VOLKSWAGEN AG	144	145.40	20,937.60	
VOLKSWAGEN AG PFD	445	144.06	64,106.70	
ADIDAS AG	448	261.85	117,308.80	
ESSILORLUXOTTICA	690	106.20	73,278.00	
HERMES INTERNATIONAL	79	606.00	47,874.00	
HUGO BOSS AG -ORD	283	55.42	15,683.86	
KERING	192	485.95	93,302.40	
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	686	338.65	232,313.90	
MONCLER SPA	697	35.00	24,395.00	
PUMA AG	33	553.50	18,265.50	
ACCOR SA	713	34.03	24,263.39	
PADDY POWER BETFAIR PLC	266	63.80	16,970.80	
SODEXO	322	102.40	32,972.80	
AXEL SPRINGER SE	328	45.92	15,061.76	
Eutelsat Communications	829	16.15	13,392.49	
SES SA	1,195	14.03	16,771.82	
UBISOFT ENTERTAINMENT	286	70.52	20,168.72	
VIVENDI SA	2,672	23.40	62,524.80	
DELIVERY HERO SE	400	39.89	15,956.00	
INDITEX	2,476	25.06	62,048.56	
COLRUYT SA	267	65.70	17,541.90	
JERONIMO MARTINS	1,138	14.02	15,960.45	
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	2,853	20.51	58,515.03	
METRO AG	863	13.96	12,051.79	
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	1,942	74.29	144,271.18	
DANONE	1,375	71.96	98,945.00	
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	2,465	9.08	22,394.52	
HEINEKEN HOLDING NV	402	91.25	36,682.50	
HEINEKEN NV	606	98.02	59,400.12	
KERRY GROUP PLC-A	470	103.70	48,739.00	
PERNOD-RICARD	463	163.05	75,492.15	

BEIERSDORF AG	304	103.50	31,464.00	
HENKEL AG & CO KGAA	366	78.00	28,548.00	
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	384	82.72	31,764.48	
L'OREAL	581	244.50	142,054.50	
UNILEVER NV-CVA	3,746	54.69	204,868.74	
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	603	66.84	40,304.52	
Fresenius SE & CO KG	1,086	47.69	51,791.34	
KONINKLIJKE PHILIPS NV	2,256	36.04	81,317.52	
BAYER AG	2,422	54.67	132,410.74	
GRIFOLS SA	1,037	23.57	24,442.09	
MERCK KGAA	408	89.94	36,695.52	
ORION OYJ	400	29.89	11,956.00	
QIAGEN N V	875	34.22	29,942.50	
RECORDATI SPA	493	36.35	17,920.55	
SANOFI	2,807	75.57	212,124.99	
UCB SA	429	69.26	29,712.54	
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	16,758	5.03	84,393.28	
BANCO SANTANDER S.A	41,611	4.03	167,941.99	
Bankinter SA	3,013	6.58	19,849.64	
BNP PARIBAS	2,911	44.20	128,666.20	
CaixaBank SA	12,452	2.78	34,641.46	
COMMERZBANK AG	3,805	6.67	25,390.76	
CREDIT AGRICOLE SA	3,671	10.35	37,994.85	
ERSTE GROUP BANK AG	1,051	32.05	33,684.55	
ING GROEP NV-CVA	10,317	9.77	100,838.35	
INTESA SANPAOLO	41,850	1.90	79,858.17	
KBC GROEP NV	666	60.50	40,293.00	
MEDIOBANCA SPA	2,676	8.55	22,879.80	
SOCIETE GENERALE-A	2,086	23.04	48,071.87	
UNICREDIT SPA	5,695	10.12	57,656.18	
DEUTSCHE BANK AG -REG	6,039	6.44	38,933.43	
DEUTSCHE BOERSE AG	401	125.00	50,125.00	
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	276	84.34	23,277.84	
Natixis	3,872	4.78	18,508.16	
Wendel	151	115.50	17,440.50	
AEGON NV	6,504	4.18	27,232.24	
AGEAS	679	43.29	29,393.91	
ALLIANZ SE	1,007	202.80	204,219.60	
ASSICURAZIONI GENERALI	3,099	16.09	49,862.91	
AXA	4,320	22.38	96,681.60	
CNP ASSURANCES	896	19.67	17,624.32	
HANNOVER RUECK SE	229	134.80	30,869.20	

MAPFRE S.A.	5,593	2.67	14,961.27	
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	312	219.70	68,546.40	
POSTE ITALIANE SPA	2,279	8.89	20,278.54	
SAMPO OYJ-A SHS	792	39.20	31,046.40	
SCOR SE	589	36.54	21,522.06	
VONOVIA SE	1,228	47.87	58,784.36	
ADYEN NV /WI	24	721.40	17,313.60	
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,055	69.90	73,744.50	
ATOS SE	330	71.48	23,588.40	
CAPGEMINI	445	103.55	46,079.75	
DASSAULT SYSTEMES SA	344	136.00	46,784.00	
SAP SE	2,415	113.72	274,633.80	
WIRECARD AG	320	159.70	51,104.00	
WORLDLINE SA	114	51.50	5,871.00	
NOKIA OYJ	14,238	4.55	64,790.01	
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	7,428	15.21	113,024.44	
ELISA OYJ	552	40.35	22,273.20	
Iliad SA	145	103.60	15,022.00	
KONIKLIJKE KPN NV	12,238	2.73	33,434.21	
ORANGE	4,166	14.02	58,407.32	
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	4,644	2.58	12,023.31	
TELEFONICA SA	10,528	7.24	76,254.30	
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	602	32.42	19,516.84	
E.ON SE	5,029	9.45	47,554.22	
ELECTRICITE DE FRANCE	2,163	12.22	26,431.86	
ENDESA SA	1,022	23.01	23,516.22	
ENEL SPA	22,273	5.77	128,537.48	
ENERGIAS DE PORTUGAL SA	9,493	3.37	32,000.90	
ENGIE	4,377	12.75	55,806.75	
FORTUM OYJ	1,300	19.49	25,337.00	
IBERDROLA SA	14,534	8.49	123,480.86	
INNOGY SE	475	40.40	19,190.00	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,277	26.74	34,146.98	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,640	19.92	32,677.00	
RWE AG	1,466	22.87	33,527.42	
SUEZ	1,599	12.04	19,251.96	
TERNA SPA	5,065	5.75	29,123.75	
UNIPER SE	687	24.78	17,023.86	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	1,774	20.68	36,686.32	
ASML HOLDING NV	1,039	172.86	179,601.54	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	2,957	16.41	48,524.37	
STMICROELECTRONICS NV	2,318	13.70	31,768.19	

ユーロ小計	447,631		9,288,223.01 (1,138,921,905)	
	銘柄数	179		
	比　率	11.1%	11.7%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	49,989	5.44	272,190.10	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	10,887	24.87	270,759.69	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	9,537	25.00	238,472.68	
ANGLO AMERICAN PLC	3,087	19.44	60,011.28	
BHP GROUP PLC	5,780	18.00	104,040.00	
CRODA INTERNATIONAL PLC	422	51.35	21,669.70	
Fresnillo PLC	1,353	7.26	9,833.60	
GLENCORE PLC	31,199	2.61	81,429.39	
JOHNSON MATTHEY PLC	746	31.30	23,349.80	
MONDI PLC	1,371	16.78	23,012.23	
RIO TINTO PLC	3,086	46.42	143,252.12	
ASHTEAD GROUP PLC	1,605	19.63	31,514.17	
BAE SYSTEMS PLC	7,664	4.50	34,495.66	
BUNZL PLC	1,232	20.90	25,748.80	
FERGUSON PLC	621	51.60	32,043.60	
MEGGITT PLC	3,165	5.00	15,831.33	
MELROSE INDUSTRIES PLC	16,542	1.69	27,980.79	
ROLLS-ROYCE HOLDINGS PLC	4,426	8.88	39,311.73	
SMITHS GROUP PLC	1,460	14.81	21,622.60	
WEIR GROUP PLC/THE	1,073	15.32	16,438.36	
EXPERIAN PLC	1,895	23.32	44,191.40	
G4S PLC	7,076	2.10	14,923.28	
INTERTEK GROUP PLC	497	52.42	26,052.74	
RELX PLC	4,675	18.30	85,552.50	
BURBERRY GROUP PLC	1,345	18.08	24,324.32	
PERSIMMON PLC	1,000	19.68	19,685.00	
CARNIVAL PLC	641	39.25	25,159.25	
COMPASS GROUP PLC	3,708	18.16	67,337.28	
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	608	51.27	31,172.16	
MERLIN ENTERTAINMENTS PLC-	3,494	3.77	13,175.87	
Whitbread PLC	567	45.61	25,860.87	
ITV PLC	15,092	1.08	16,306.90	
WPP PLC	3,728	9.51	35,468.19	
KINGFISHER PLC	8,470	2.13	18,083.45	
MARKS & SPENCER GROUP PLC	6,030	2.46	14,851.89	
NEXT PLC	468	57.82	27,059.76	
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	9,018	1.99	17,968.36	

TESCO PLC	24,390	2.32	56,584.80	
Associated British Foods PLC	1,101	25.10	27,635.10	
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	5,842	29.84	174,354.49	
DIAGEO PLC	5,844	33.48	195,686.34	
IMPERIAL BRANDS PLC	2,284	20.49	46,799.16	
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	1,686	64.13	108,123.18	
UNILEVER PLC	2,698	48.83	131,756.83	
SMITH & NEPHEW PLC	2,242	16.55	37,116.31	
ASTRAZENECA PLC	3,238	60.89	197,161.82	
GLAXOSMITHKLINE PLC	12,477	15.82	197,386.14	
BARCLAYS PLC	46,307	1.49	69,117.82	
HSBC HOLDINGS PLC	49,296	6.59	325,057.82	
LLOYDS BANKING GROUP PLC	185,196	0.58	108,376.69	
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	14,907	2.16	32,303.46	
STANDARD CHARTERED PLC	7,886	6.84	53,987.55	
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,100	22.86	25,146.00	
London Stock Exchange Group PLC	744	52.30	38,911.20	
SCHRODERS PLC	597	29.40	17,551.80	
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	9,403	2.63	24,795.71	
ADMIRAL GROUP PLC	867	20.49	17,764.83	
AVIVA PLC	8,433	4.04	34,094.61	
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	4,205	3.16	13,313.03	
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	10,648	2.63	28,036.18	
PRUDENTIAL PLC	6,455	15.94	102,892.70	
RSA INSURANCE GROUP PLC	3,741	5.56	20,814.92	
SAGE GROUP PLC/THE	3,739	7.54	28,207.01	
BT GROUP PLC	20,337	1.96	39,913.39	
VODAFONE GROUP PLC	67,966	1.26	85,705.12	
CENTRICA PLC	17,498	0.92	16,241.64	
NATIONAL GRID PLC	7,834	8.16	63,972.44	
SEVERN TRENT PLC	1,029	19.08	19,638.46	
SSE PLC	2,873	10.38	29,821.74	
英ポンド小計	756,420		4,368,449.14 (607,039,692)	
	銘柄数	69		
	比　率	5.9%	6.3%	
スイスフラン	株	スイスフラン	スイスフラン	
CLARIANT AG-REG	989	18.78	18,573.42	
GIVAUDAN-REG	18	2,664.00	47,952.00	
LAFARGEHOLCIM LTD	1,192	50.04	59,647.68	
SIKA AG-REG	368	152.35	56,064.80	
ABB LTD	4,047	18.87	76,387.12	

GEBERIT AG-REG	92	448.50	41,262.00	
Schindler Holding AG	156	220.60	34,413.60	
Schindler Holding AG	101	212.80	21,492.80	
ADECCO GROUP AG(REG)	598	55.96	33,464.08	
SGS SA	16	2,547.00	40,752.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	193	131.50	25,379.50	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,254	74.90	93,924.60	
THE SWATCH GROUP AG-B	117	265.80	31,098.60	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	10	1,992.00	19,920.00	
Lindt & Spruengli AG	3	6,735.00	20,205.00	
NESTLE SA-REGISTERED	7,553	99.47	751,296.91	
ALCON INC	1,103	58.15	64,139.45	
SONOVA HOLDING AG	186	219.50	40,827.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	40	832.80	33,312.00	
LONZA GROUP AG-REG	212	315.30	66,843.60	
NOVARTIS AG-REG SHS	5,456	88.52	482,965.12	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	1,751	271.95	476,184.45	
CREDIT SUISSE GROUP AG	7,118	11.71	83,351.78	
JULIUS BAER GROUP LTD	804	40.70	32,722.80	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	56	716.00	40,096.00	
UBS GROUP AG	10,432	11.88	123,932.16	
Baloise Holding AG	110	166.90	18,359.00	
SWISS LIFE HOLDING AG	105	461.70	48,478.50	
SWISS RE AG	610	96.18	58,669.80	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	326	330.70	107,808.20	
TEMENOS GROUP AG-REG	209	180.85	37,797.65	
SWISSCOM AG-REG	75	488.20	36,615.00	
スイスフラン小計	45,300		3,123,936.62 (340,883,963)	
	銘柄数	32		
	比　率	3.3%	3.5%	
スウェーデンクローネ	株	スウェーデンクローネ	スウェーデンクローネ	
LUNDIN PETROLEUM AB	726	270.80	196,600.80	
BOLIDEN AB	1,121	223.00	249,983.00	
BOLIDEN AB-REDEMPTION SHARES	1,121	4.24	4,753.04	
ALFA LAVAL AB	1,020	202.90	206,958.00	
ASSA ABLOY AB-B	1,961	193.40	379,257.40	
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,548	264.10	408,826.80	
ATLAS COPCO AB-B SHS	1,394	237.20	330,656.80	
EPIROC AB-A	2,452	92.20	226,074.40	
EPIROC AB-B	1,817	88.88	161,494.96	
SANDVIK AB	2,677	151.30	405,030.10	

SKANSKA AB-B SHS	1,223	158.80	194,212.40	
SKF AB-B SHARES	1,549	151.85	235,215.65	
VOLVO AB-B SHS	3,396	136.15	462,365.40	
SECURITAS AB-B SHS	1,333	161.90	215,812.70	
Husqvarna AB	1,869	82.56	154,304.64	
HENNES & MAURITZ AB-B	1,969	150.90	297,122.10	
SWEDISH MATCH AB	580	462.50	268,250.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	1,443	285.10	411,399.30	
NORDEA BANK ABP	6,181	70.74	437,243.94	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	4,064	87.22	354,462.08	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	3,450	97.20	335,340.00	
Swedbank AB	2,617	140.60	367,950.20	
Industrivarden AB	729	196.95	143,576.55	
INVESTOR AB-B SHS	813	430.10	349,671.30	
KINNEVIK AB-B	940	253.00	237,820.00	
ERICSSON LM-B SHS	7,224	95.28	688,302.72	
HEXAGON AB-B SHS	748	463.30	346,548.40	
Millicom International Cellular SA	322	535.00	172,270.00	
TELE2 AB-B SHS	1,747	130.05	227,197.35	
TELIA COMPANY AB	7,693	40.61	312,412.73	
スウェーデンクローネ小計	65,727		8,781,112.76 (100,455,929)	
	銘柄数	30		
	比　率	1.0%	1.0%	
ノルウェークローネ	株	ノルウェークローネ	ノルウェークローネ	
EQUINOR ASA	2,286	170.00	388,620.00	
NORSK HYDRO ASA	5,919	32.28	191,065.32	
YARA INTERNATIONAL ASA	636	385.40	245,114.40	
SCHIBSTED ASA-B SHS	674	218.60	147,336.40	
ORKLA ASA	2,593	75.42	195,564.06	
DNB ASA	2,647	154.20	408,167.40	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,000	172.60	172,600.00	
TELENOR ASA	2,139	181.25	387,693.75	
ノルウェークローネ小計	17,894		2,136,161.33 (26,894,271)	
	銘柄数	8		
	比　率	0.3%	0.3%	
デンマーククローネ	株	デンマーククローネ	デンマーククローネ	
CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S	316	712.20	225,055.20	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	659	320.30	211,077.70	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	506	554.20	280,425.20	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	14	6,695.00	93,730.00	

AP MOLLER-MAERSK A/S-B	23	7,030.00	161,690.00	
DSV A/S	457	599.40	273,925.80	
PANDORA A/S	461	248.90	114,742.90	
CARLSBERG AS-B	305	899.60	274,378.00	
COLOPLAST-B	367	720.80	264,533.60	
DEMANT A/S	437	231.00	100,947.00	
H LUNDBECK A/S	361	270.70	97,722.70	
NOVO NORDISK A/S-B	4,467	321.45	1,435,917.15	
DANSKE BANK A/S	2,241	112.70	252,560.70	
ORSTED A/S	519	540.40	280,467.60	
デンマーククローネ小計	11,133		4,067,173.55 (66,742,317)	
	銘柄数	14		
	比　率	0.6%	0.7%	
豪ドル	**株**	**豪ドル**	**豪ドル**	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	1,205	26.55	31,992.75	
ORIGIN ENERGY LIMITED	5,100	7.59	38,709.00	
SANTOS LTD	5,797	6.98	40,463.06	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	1,955	35.79	69,969.45	
ALUMINA LTD	11,767	2.43	28,593.81	
AMCOR LTD	3,902	16.16	63,056.32	
BHP GROUP LIMITED	7,847	37.94	297,715.18	
INCITEC PIVOT LTD	8,640	3.32	28,684.80	
NEWCREST MINING LIMITED	2,095	26.90	56,355.50	
ORICA LTD	1,733	20.55	35,613.15	
RIO TINTO LIMITED	1,106	103.02	113,940.12	
SOUTH32 LTD	17,463	3.46	60,421.98	
BRAMBLES LTD	5,265	12.19	64,180.35	
SEEK LTD	1,527	20.99	32,051.73	
SYDNEY AIRPORT	4,516	7.67	34,637.72	
TRANSURBAN GROUP	6,166	13.85	85,399.10	
CROWN RESORTS LIMITED	1,869	13.11	24,502.59	
DOMINO'S PIZZA ENTERPRISES L	400	40.70	16,280.00	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	350	42.84	14,994.00	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	7,825	4.61	36,073.25	
WESFARMERS LIMITED	2,720	37.84	102,924.80	
COLES GROUP LTD	4,010	12.50	50,125.00	
WOOLWORTHS GROUP LTD	2,742	32.30	88,566.60	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	2,674	9.62	25,723.88	
TREASURY WINE ESTATES LTD	1,700	15.12	25,704.00	
COCHLEAR LIMITED	197	197.52	38,911.44	
SONIC HEALTHCARE LTD	1,711	26.35	45,084.85	

CSL LIMITED	1,146	206.65	236,820.90	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	7,074	27.82	196,798.68	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	4,353	77.64	337,966.92	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	6,307	25.83	162,909.81	
WESTPAC BANKING CORPORATION	8,498	27.92	237,264.16	
AMP LIMITED	11,488	2.18	25,043.84	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	685	76.42	52,347.70	
MACQUARIE GROUP LTD	899	120.80	108,599.20	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	7,701	7.89	60,760.89	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	4,286	12.32	52,803.52	
SUNCORP GROUP LTD	4,249	13.60	57,786.40	
LENDLEASE GROUP	2,380	14.44	34,367.20	
COMPUTERSHARE LIMITED	2,006	16.80	33,700.80	
TELSTRA CORP LTD	14,558	3.53	51,389.74	
AGL ENERGY LTD	2,184	21.30	46,519.20	
豪ドル小計	190,096		3,245,753.39 (246,287,767)	
	銘柄数	42		
	比　率	2.4%	2.5%	
ニュージーランドドル	株	ニュージーランドドル	ニュージーランドドル	
AUCKLAND INTL AIRPORT LTD	4,064	8.62	35,031.68	
A2 MILK CO LTD	1,700	15.63	26,571.00	
RYMAN HEALTHCARE LTD	2,200	11.46	25,212.00	
SPARK NEW ZEALAND LTD	8,586	3.80	32,626.80	
MERIDIAN ENERGY LTD	6,704	4.31	28,894.24	
ニュージーランドドル小計	23,254		148,335.72 (10,644,571)	
	銘柄数	5		
	比　率	0.1%	0.1%	
香港ドル	株	香港ドル	香港ドル	
CK HUTCHISON HOLDINGS LTD	7,328	74.05	542,638.40	
NWS HOLDINGS LTD	9,500	15.66	148,770.00	
MTR CORPORATION	5,500	47.75	262,625.00	
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	5,000	50.35	251,750.00	
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	4,500	21.45	96,525.00	
Galaxy Entertainment Group Limited	7,000	46.85	327,950.00	
Sands China Ltd	8,000	36.55	292,400.00	
WH Group Limited	31,000	7.27	225,370.00	
BANK OF EAST ASIA	6,440	23.90	153,916.00	
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	11,000	30.25	332,750.00	
HANG SENG BANK	2,100	200.60	421,260.00	
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	3,200	249.20	797,440.00	

AIA GROUP LTD	31,400	75.75	2,378,550.00	
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	7,328	58.25	426,856.00	
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	4,912	48.90	240,196.80	
HYSAN DEVELOPMENT CO	4,000	41.35	165,400.00	
SINO LAND CO	13,800	12.94	178,572.00	
SUN HUNG KAI PROPERTIES	4,500	135.30	608,850.00	
SWIRE PACIFIC LTD A	2,000	92.00	184,000.00	
SWIRE PROPERTIES LTD	5,800	33.15	192,270.00	
HKT Trust / HKT Ltd	16,000	12.40	198,400.00	
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	3,000	60.65	181,950.00	
CLP HOLDINGS LIMITED	4,500	92.70	417,150.00	
HONG KONG & CHINA GAS	24,478	19.64	480,747.92	
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	5,000	54.25	271,250.00	
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,800	77.25	139,050.00	
香港ドル小計	229,086		9,916,637.12 (138,436,254)	
	銘柄数	26		
	比　率	1.3%	1.4%	
シンガポールドル	株	シンガポールドル	シンガポールドル	
KEPPEL CORP LTD	5,600	6.10	34,160.00	
SINGAPORE TECH ENGINEERING	7,500	3.92	29,400.00	
COMFORTDELGRO CORP LTD	11,000	2.45	26,950.00	
SINGAPORE AIRLINES LTD	3,000	9.24	27,720.00	
GENTING SINGAPORE LTD	29,000	0.88	25,520.00	
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	9,000	2.37	21,330.00	
DBS GROUP HOLDINGS LTD	4,400	25.06	110,264.00	
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	7,900	10.99	86,821.00	
UNITED OVERSEAS BANK	3,100	24.70	76,570.00	
CITY DEVELOPMENTS	3,000	8.31	24,930.00	
UNITED OVERSEAS LAND LTD	3,000	6.88	20,640.00	
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	21,700	3.17	68,789.00	
シンガポールドル小計	108,200		553,094.00 (44,081,591)	
	銘柄数	12		
	比　率	0.4%	0.5%	
イスラエルシュケル	株	イスラエル シュケル	イスラエル シュケル	
ISRAEL CHEMICALS LTD	3,551	19.31	68,569.81	
BANK HAPOALIM BM	3,708	27.00	100,116.00	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	5,116	24.85	127,132.60	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	700	78.32	54,824.00	
NICE LTD	255	490.40	125,052.00	

イスラエルシュケル小計	13,330		475,694.41 (14,461,110)	
	銘柄数	5		
	比　率	0.1%	0.1%	
合　　計	株 2,733,629		円 9,706,276,629 (9,706,276,629)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券

種類	通貨	銘柄	券面総額	評価額	備考
投資証券	米ドル			米ドル	
		AMERICAN TOWER CORP	1,131	229,593.00	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	301	61,789.28	
		BOSTON PROPERTIES INC	359	47,395.18	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	347	36,192.10	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,018	130,130.94	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	507	60,829.86	
		DUKE REALTY CORP	1,266	38,866.20	
		EQUINIX INC	208	103,276.16	
		EQUITY RESIDENTIAL	844	65,148.36	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	189	54,993.33	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	410	43,861.80	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	271	35,893.95	
		HCP INC	1,470	46,790.10	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	2,437	46,936.62	
		IRON MOUNTAIN INC	1,049	32,844.19	
		KIMCO REALTY CORP	1,624	29,524.32	
		LIBERTY PROPERTY TRUST	574	27,793.08	
		MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	390	44,779.80	
		PROLOGIS INC	1,580	119,147.80	
		PUBLIC STORAGE	365	86,223.95	
		REALTY INCOME CORP	747	52,685.91	
		REGENCY CENTERS CORP	555	37,051.80	
		SBA COMMUNICATIONS CORP	324	67,631.76	
		SIMON PROPERTY GROUP INC	793	135,864.69	
		SL GREEN REALTY CORP	346	30,659.06	
		UDR INC	883	40,008.73	
		VENTAS INC	916	60,401.04	
		VORNADO REALTY TRUST	572	38,712.96	
		WELLTOWER INC	971	79,204.47	

	WEYERHAEUSER CO	2,071	47,653.71	
米ドル小計		24,518	1,931,884.15 (211,676,546)	
	銘柄数	30		
	比　率	2.1%	77.7%	
加ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	967	加ドル 25,896.26	
加ドル小計		967	25,896.26 (2,111,322)	
	銘柄数	1		
	比　率	0.0%	0.8%	
ユーロ	COVIVIO	219	ユーロ 20,695.50	
	GECINA SA	190	25,232.00	
	KLEPIERRE	837	25,771.23	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	356	49,448.40	
ユーロ小計		1,602	121,147.13 (14,855,061)	
	銘柄数	4		
	比　率	0.1%	5.5%	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	3,567	英ポンド 19,062.04	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	2,801	23,332.33	
	SEGRO PLC	3,836	26,982.42	
英ポンド小計		10,204	69,376.79 (9,640,598)	
	銘柄数	3		
	比　率	0.1%	3.5%	
豪ドル	DEXUS	3,100	豪ドル 40,796.00	
	GOODMAN GROUP	4,877	67,205.06	
	GPT GROUP	7,406	44,287.88	
	MIRVAC GROUP	13,856	43,230.72	
	SCENTRE GROUP	17,768	69,650.56	
	STOCKLAND	10,257	45,643.65	
豪ドル小計		57,264	310,813.87 (23,584,556)	
	銘柄数	6		
	比　率	0.2%	8.7%	
香港ドル	LINK REIT	6,000	香港ドル 581,100.00	
香港ドル小計		6,000	581,100.00 (8,112,156)	
	銘柄数	1		
	比　率	0.1%	3.0%	

	シンガポールドル	CAPITALAND MALL TRUST	12,000	シンガポールドル 29,400.00	
	シンガポールドル小計		12,000	29,400.00 (2,343,180)	
		銘柄数	1		
		比　率	0.0%	0.9%	
投資証券合計				円 272,323,419 (272,323,419)	
合計				円 272,323,419 (272,323,419)	

(注1)通貨種類毎の小計欄の( )内は、邦貨換算額（単位:円）であります。
(注2)合計金額欄の( )内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。
(注3)比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

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。

「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 5月28日現在]	[2019年 5月28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		162,081,764	75,415,814
国債証券		5,259,203,000	4,860,647,250
地方債証券		447,789,680	101,517,000
特殊債券		332,907,840	103,387,000
社債券		815,121,514	474,675,300
未収利息		28,516,646	16,382,761
前払費用		179,998	176,321
流動資産合計		7,045,800,442	5,632,201,446
資産合計		7,045,800,442	5,632,201,446
負債の部			
流動負債			
未払解約金		158,837,989	29,746,602
未払利息		452	95
流動負債合計		158,838,441	29,746,697
負債合計		158,838,441	29,746,697
純資産の部			
元本等			
元本	※1	5,386,453,942	4,295,399,648

剰余金			
剰余金又は欠損金（△）		1,500,508,059	1,307,055,101
元本等合計		6,886,962,001	5,602,454,749
純資産合計		6,886,962,001	5,602,454,749
負債純資産合計		7,045,800,442	5,632,201,446

(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 5月29日 至 2019年 5月28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 5月28日現在]	[2019年 5月28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	29,681,018,125円	5,386,453,942円
同期中における追加設定元本額	4,428,970,609円	3,109,323,476円
同期中における一部解約元本額	28,723,534,792円	4,200,377,770円
同期末における元本額	5,386,453,942円	4,295,399,648円
元本の内訳＊		
円資産バランスファンド2018－09＜適格機関投資家限定＞	－円	1,402,305,459円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）	39,675,292円	44,566,527円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）	32,594,909円	34,028,242円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）	45,644,933円	51,998,129円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）	34,219,352円	37,876,220円
ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）	27,437,742円	23,206,354円
東京海上セレクション・日本債券インデックス	1,178,400,062円	1,881,155,162円
東京海上・年金運用型戦略ファンド（年１回決算型）	92,857,026円	125,914,138円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	966,035円	6,977,075円
ＴＭＡ日本債券インデックスＶＡ＜適格機関投資家限定＞	276,693,949円	182,696,650円
ＴＭＡ世界バランスファンド55ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	4,249,023円	－円
ＴＭＡ世界バランスファンド35ＶＡ＜適格機関投資家限定＞	3,594,876,893円	222,091,657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＞	11,161,026円	62,494,862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＞	47,677,700円	220,089,173円
計	5,386,453,942円	4,295,399,648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	5,386,453,942口	4,295,399,648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）

I．金融商品の状況に関する事項

区　　分	自 2017年 5月30日 至 2018年 5月28日	自 2018年 5月29日 至 2019年 5月28日
1．金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2．金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3．金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

II．金融商品の時価等に関する事項

区　　分	[2018年 5月28日現在]	[2019年 5月28日現在]

1．貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2．時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3．金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）
（自 2017年5月30日　至 2018年5月28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	△8,215,400
地方債証券	△498,240
特殊債券	△2,821,160
社債券	△2,766,076
合計	△14,300,876

(注1)時価の算定方法については、重要な会計方針に係る事項に関する注記「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。
(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2017年11月11日から2018年5月28日まで)を指しております。

（自 2018年5月29日　至 2019年5月28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	106,316,100
地方債証券	△605,000
特殊債券	△1,048,000
社債券	3,938,352
合計	108,601,452

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2018年11月13日から2019年5月28日まで)を指しております。

（1口当たり情報に関する注記）

[2018年 5月28日現在]		[2019年 5月28日現在]	
1口当たり純資産額	1.2786円	1口当たり純資産額	1.3043円
（1万口当たり純資産額	12,786円）	（1万口当たり純資産額	13,043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３９１回利付国債（２年）	100,000,000	100,306,000	
	第１２６回利付国債（５年）	170,000,000	170,691,900	
	第１２９回利付国債（５年）	170,000,000	171,064,200	
	第１３２回利付国債（５年）	50,000,000	50,423,000	
	第１３３回利付国債（５年）	190,000,000	191,772,700	
	第１３５回利付国債（５年）	80,000,000	80,858,400	
	第１３６回利付国債（５年）	60,000,000	60,687,000	
	第１３７回利付国債（５年）	50,000,000	50,608,000	
	第１３９回利付国債（５年）	40,000,000	40,543,200	
	第５回利付国債（４０年）	30,000,000	43,542,000	
	第７回利付国債（４０年）	45,000,000	62,021,250	
	第１０回利付国債（４０年）	30,000,000	33,815,400	
	第１１回利付国債（４０年）	10,000,000	10,921,800	
	第３２０回利付国債（１０年）	50,000,000	51,505,000	
	第３２４回利付国債（１０年）	50,000,000	51,499,500	
	第３２７回利付国債（１０年）	55,000,000	56,931,600	
	第３３５回利付国債（１０年）	100,000,000	103,647,000	
	第３３９回利付国債（１０年）	30,000,000	31,056,600	
	第３４０回利付国債（１０年）	80,000,000	82,936,000	
	第３４２回利付国債（１０年）	60,000,000	61,136,400	
	第３４３回利付国債（１０年）	85,000,000	86,670,250	
	第３４４回利付国債（１０年）	30,000,000	30,599,700	
	第３４５回利付国債（１０年）	30,000,000	30,608,700	
	第３４６回利付国債（１０年）	60,000,000	61,209,000	
	第３４７回利付国債（１０年）	80,000,000	81,631,200	
	第３４８回利付国債（１０年）	130,000,000	132,623,400	
	第３５１回利付国債（１０年）	120,000,000	122,305,200	
	第３５２回利付国債（１０年）	50,000,000	50,939,500	
	第３５３回利付国債（１０年）	70,000,000	71,282,400	

第３回利付国債（３０年）	20,000,000	25,117,400	
第５回利付国債（３０年）	10,000,000	12,619,400	
第２２回利付国債（３０年）	10,000,000	13,773,700	
第２８回利付国債（３０年）	20,000,000	28,108,800	
第２９回利付国債（３０年）	60,000,000	83,611,200	
第３２回利付国債（３０年）	10,000,000	13,930,700	
第３３回利付国債（３０年）	20,000,000	26,757,000	
第３４回利付国債（３０年）	100,000,000	138,466,000	
第３８回利付国債（３０年）	20,000,000	26,373,200	
第３９回利付国債（３０年）	20,000,000	26,879,200	
第４０回利付国債（３０年）	10,000,000	13,234,000	
第４７回利付国債（３０年）	20,000,000	25,755,200	
第４９回利付国債（３０年）	70,000,000	86,911,300	
第５０回利付国債（３０年）	20,000,000	21,804,800	
第５１回利付国債（３０年）	50,000,000	48,132,500	
第５６回利付国債（３０年）	20,000,000	21,757,800	
第５８回利付国債（３０年）	80,000,000	87,029,600	
第５９回利付国債（３０年）	40,000,000	42,406,400	
第６２回利付国債（３０年）	10,000,000	10,026,000	
第５０回利付国債（２０年）	60,000,000	62,253,600	
第５１回利付国債（２０年）	90,000,000	94,032,900	
第５３回利付国債（２０年）	20,000,000	21,168,000	
第６０回利付国債（２０年）	20,000,000	21,132,600	
第６６回利付国債（２０年）	60,000,000	65,448,600	
第６７回利付国債（２０年）	30,000,000	33,018,300	
第７０回利付国債（２０年）	40,000,000	45,258,400	
第７１回利付国債（２０年）	60,000,000	67,275,000	
第７４回利付国債（２０年）	40,000,000	45,110,800	
第７５回利付国債（２０年）	30,000,000	33,994,800	
第７６回利付国債（２０年）	10,000,000	11,214,200	
第８０回利付国債（２０年）	40,000,000	45,560,000	
第８２回利付国債（２０年）	30,000,000	34,345,200	
第８４回利付国債（２０年）	80,000,000	91,519,200	
第８５回利付国債（２０年）	20,000,000	23,119,000	
第９０回利付国債（２０年）	65,000,000	76,349,650	
第９９回利付国債（２０年）	20,000,000	23,840,800	
第１００回利付国債（２０年）	70,000,000	84,382,200	
第１０５回利付国債（２０年）	20,000,000	24,124,600	
第１１３回利付国債（２０年）	20,000,000	24,457,200	
第１１６回利付国債（２０年）	50,000,000	62,090,000	
第１１７回利付国債（２０年）	50,000,000	61,548,000	
第１２３回利付国債（２０年）	70,000,000	87,045,700	
第１２７回利付国債（２０年）	30,000,000	36,708,900	

	第１３３回利付国債（２０年）	90,000,000	109,866,600	
	第１４１回利付国債（２０年）	70,000,000	85,270,500	
	第１４５回利付国債（２０年）	50,000,000	61,177,000	
	第１４６回利付国債（２０年）	50,000,000	61,288,000	
	第１４７回利付国債（２０年）	30,000,000	36,406,200	
	第１５１回利付国債（２０年）	20,000,000	23,193,400	
	第１５３回利付国債（２０年）	60,000,000	70,599,000	
	第１５４回利付国債（２０年）	50,000,000	58,081,500	
	第１５６回利付国債（２０年）	50,000,000	51,542,000	
	第１５８回利付国債（２０年）	50,000,000	52,247,500	
	第１６０回利付国債（２０年）	80,000,000	86,284,800	
	第１６１回利付国債（２０年）	40,000,000	42,419,200	
	第１６４回利付国債（２０年）	10,000,000	10,393,000	
	第１６７回利付国債（２０年）	10,000,000	10,350,400	
国債証券 合計		4,400,000,000	4,860,647,250	
地方債証券	平成２２年度第３回横浜市公募公債	100,000,000	101,517,000	
地方債証券 合計		100,000,000	101,517,000	
特殊債券	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	103,387,000	
特殊債券 合計		100,000,000	103,387,000	
社債券	第３３回道路債券	100,000,000	138,106,000	
	第５４回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,934,000	46,684,707	
	第５５回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	48,027,000	51,009,476	
	第５６回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	45,768,000	48,595,547	
	第５９回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	46,867,000	49,833,212	
	第１５回貸付債権担保住宅金融公庫債券	38,268,000	39,307,358	
	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	101,139,000	
社債券 合計		422,864,000	474,675,300	
合計		5,022,864,000	5,540,226,550	

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。

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	82,283,107 円
Ⅱ　負債総額	4,770 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	82,278,337 円
Ⅳ　発行済数量	63,000,591 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3060 円

ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	87,237,399 円
Ⅱ　負債総額	5,061 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	87,232,338 円
Ⅳ　発行済数量	60,971,899 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.4307 円

ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	183,556,101 円
Ⅱ　負債総額	10,669 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	183,545,432 円
Ⅳ　発行済数量	116,135,579 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5804 円

ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	176,573,751 円
Ⅱ　負債総額	510,385 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	176,063,366 円
Ⅳ　発行済数量	102,465,334 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.7183 円

ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	161,085,387 円

Ⅱ　負債総額	698,749 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	160,386,638 円
Ⅳ　発行済数量	86,875,377 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.8462 円

（ご参考：親投資信託の現況）
ＴＭＡ日本株ＴＯＰＩＸマザーファンド

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	36,677,223,475 円
Ⅱ　負債総額	139,746,108 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	36,537,477,367 円
Ⅳ　発行済数量	29,403,945,700 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.2426 円

ＴＭＡ外国債券インデックスマザーファンド

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	4,238,754,434 円
Ⅱ　負債総額	9,156,396 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	4,229,598,038 円
Ⅳ　発行済数量	2,745,022,428 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.5408 円

ＴＭＡ外国株式インデックスマザーファンド

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	10,647,723,996 円
Ⅱ　負債総額	409,502,494 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	10,238,221,502 円
Ⅳ　発行済数量	4,263,858,762 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	2.4012 円

ＴＭＡ日本債券インデックスマザーファンド

2019年5月31日現在

種類	金額
Ⅰ　資産総額	9,809,346,346 円
Ⅱ　負債総額	4,200,286,285 円
Ⅲ　純資産総額（Ⅰ－Ⅱ）	5,609,060,061 円
Ⅳ　発行済数量	4,289,241,564 口
Ⅴ　１単位当たり純資産額（Ⅲ／Ⅳ）	1.3077 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
① 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。
② 上記①の申請のある場合には、上記①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①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。
③ 上記①の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めたと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ます。）にお支払いします。

８．質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

第三部【委託会社等の情報】

第１【委託会社等の概況】

１【委託会社等の概況】

2019年５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。

①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。
②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。
③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。
④売買の執行はトレーディング部が行います。
⑤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。
⑥運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

２【事業の内容及び営業の概況】

「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社である委託会社は、証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者としてその運用（投資運用業）を行っています。また「金融商品取引法」に定める投資助言業務を行っています。

2019年５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	177	2,633,094
単位型公社債投資信託	0	0
単位型株式投資信託	3	11,742
合計	180	2,644,836

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34期事業年度（2018年４月１日から2019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33期 （2018年３月31日現在）		第34期 （2019年３月31日現在）	
資産の部				
流動資産				
現金・預金		16,828,496		17,817,927
前払費用		150,894		208,412
未収委託者報酬		1,524,731		1,954,575
未収収益		2,530,730		1,951,601
未収入金		1,919		1,809
その他の流動資産		23,613		21,491
流動資産計		21,060,384		21,955,817
固定資産				
有形固定資産	＊1	547,215	＊1	509,917
建物		409,858		379,427
器具備品		136,834		130,490
リース資産		522		-
無形固定資産		34,467		53,138
電話加入権		3,795		3,795
ソフトウエア仮勘定		30,672		49,343
投資その他の資産		2,706,769		2,769,418
投資有価証券		43,545		43,201
関係会社株式		1,673,049		1,673,049
その他の関係会社有価証券		31,200		31,200
長期前払費用		10,541		28,546
敷金		450,632		450,632
その他長期差入保証金		10,865		10,030
繰延税金資産		486,934		532,758
固定資産計		3,288,452		3,332,475
資産合計		24,348,837		25,288,293
負債の部				
流動負債				
リース債務		548		-
未払金		2,563,951		2,534,676
未払手数料		634,789		872,217
その他未払金		1,929,162		1,662,458
未払費用		530,106		455,110
未払消費税等		262,100		73,427
未払法人税等		960,000		698,000
預り金		43,264		54,312
前受収益		3,156		3,353
賞与引当金		282,443		313,291
流動負債計		4,645,570		4,132,173
固定負債				
退職給付引当金		386,552		378,099
固定負債計		386,552		378,099
負債合計		5,032,123		4,510,272
純資産の部				
株主資本		19,314,136		20,775,924
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		16,914,136		18,375,924
利益準備金		500,000		500,000
その他利益剰余金		16,414,136		17,875,924
特別償却準備金		38		16

繰越利益剰余金	16,414,098	17,875,907
評価・換算差額等	2,577	2,096
その他有価証券評価差額金	2,577	2,096
純資産合計	19,316,713	20,778,021
負債・純資産合計	24,348,837	25,288,293

(2)【損益計算書】

（単位：千円）

	第33期 （自　2017年４月１日 至　2018年３月31日）		第34期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）	
営業収益				
委託者報酬		11,741,085		12,725,446
運用受託報酬		11,384,860		9,897,931
投資助言報酬		68,541		69,049
その他営業収益		215,481		328,576
営業収益計		23,409,968		23,021,003
営業費用				
支払手数料		5,463,460		5,892,133
広告宣伝費		176,289		212,070
調査費		6,331,477		5,956,517
調査費		2,359,989		3,009,203
委託調査費		3,971,487		2,947,314
委託計算費		110,708		119,436
営業雑経費		226,401		238,392
通信費		30,555		32,765
印刷費		160,440		167,851
協会費		21,276		20,903
諸会費		6,349		8,374
図書費		7,778		8,498
営業費用計		12,308,336		12,418,551
一般管理費				
給料		3,103,124		3,450,052
役員報酬		132,792		117,075
給料・手当		2,139,811		2,360,494
賞与		830,521		972,483
交際費		16,511		19,897
寄付金		3,384		131
旅費交通費		181,123		200,290
租税公課		142,241		139,043
不動産賃借料		375,691		377,671
役員退職慰労金		6,710		-
退職給付費用		114,711		113,433
賞与引当金繰入		282,443		313,291
固定資産減価償却費		76,622		106,175
法定福利費		499,149		567,366
福利厚生費		8,917		10,913
諸経費		437,854		480,371
一般管理費計		5,248,487		5,778,637
営業利益		5,853,144		4,823,815
営業外収益				
受取利息		472		421
受取配当金	＊１	107,891	＊１	5,041
匿名組合投資利益	＊１	50,146	＊１	59,798
雑益		11,209		16,161
営業外収益計		169,720		81,422
営業外費用				
為替差損		19,974		33,574
雑損		2,653		2,395

営業外費用計	22,628	35,970
経常利益	6,000,236	4,869,267
特別損失		
器具備品除却損	257	0
特別損失計	257	0
税引前当期純利益	5,999,979	4,869,267
法人税、住民税及び事業税	1,806,783	1,551,497
法人税等調整額	△19,919	△ 45,612
法人税等合計	1,786,863	1,505,884
当期純利益	4,213,116	3,363,382

(3)【株主資本等変動計算書】

第33期（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					特別償却準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	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

第34期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

(単位：千円)

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益剰余金		
		その他資本剰余金	資本剰余金合計	利益準備金	その他利益剰余金	
					特別償却準備金	繰越利益剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	38	16,414,098
当期変動額						
剰余金の配当						△ 1,901,595
特別償却準備金の取崩					△ 21	21
当期純利益						3,363,382
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	△ 21	1,461,809
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	16	17,875,907

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本合計	その他有価証券評価差額金	評価・換算差額等合計	
	利益剰余金合計				
当期首残高	16,914,136	19,314,136	2,577	2,577	19,316,713
当期変動額					
剰余金の配当	△ 1,901,595	△ 1,901,595			△ 1,901,595
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	3,363,382	3,363,382			3,363,382
株主資本以外の項目の当期変動額（純額）			△ 480	△ 480	△ 480
当期変動額合計	1,461,787	1,461,787	△ 480	△ 480	1,461,307
当期末残高	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021

注記事項

重要な会計方針

第34期 自　2018年４月１日 至　2019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、2016年４月１日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として３年間で均等償却する方法を採用しております。

(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。

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34期 自　2018年４月１日 至　2019年３月31日
・「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号　平成30年３月30日） ・「収益認識に関する会計基準の適用指針」（企業会計基準適用指針第30号　平成30年３月30日） (1) 概要 収益認識に関する包括的な会計基準であります。収益は、次の５つのステップを適用し認識されます。 ステップ1 ： 顧客との契約を識別する。 ステップ2 ： 契約における履行義務を識別する。 ステップ3 ： 取引価格を算定する。 ステップ4 ： 契約における履行義務に取引価格を配分する。 ステップ5 ： 履行義務を充足した時に又は充足するにつれて収益を認識する。 (2) 適用予定日 2022年３月期の期首より適用予定であります。 (3) 当該会計基準等の適用による影響 影響額は、当財務諸表の作成時において評価中であります。

（表示方法の変更）

第34期 自　2018年４月１日 至　2019年３月31日
（「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」の適用に伴う変更） 「『税効果会計に係る会計基準』の一部改正」（企業会計基準第28号　平成30年2月16日）を当事業年度の期首から適用し、繰延税金資産は投資その他の資産の区分に表示し、繰延税金負債は固定負債の区分に表示する方法に変更しました。 この結果、前事業年度の貸借対照表において、「流動資産」の「繰延税金資産」291,045千円は、「投資その他の資産」の「繰延税金資産」486,934千円に含めて表示しております。

（貸借対照表関係）

第33期 2018年３月31日現在	第34期 2019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。 建物　51,080千円 器具備品　424,930千円 リース資産　3,395千円	＊１．有形固定資産の減価償却累計額は次のとおりであります。 建物　81,793千円 器具備品　498,485千円 リース資産　3,918千円

（損益計算書関係）

第33期 自　2017年４月１日 至　2018年３月31日	第34期 自　2018年４月１日 至　2019年３月31日
＊１．関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 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	＊１．関係会社との主な取引高は次のとおりであります。 関係会社からの受取配当金　4,800千円 関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配　59,798千円

（株主資本等変動計算書関係）

第33期（自　2017年４月１日　至　2018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	2017年４月１日現在	増加	減少	2018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

2017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) １株当たり配当額　46,580円
(ハ) 基準日　2017年３月31日
(ニ) 効力発生日　2017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

2018年６月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額　1,901,595千円
(ロ) 配当の原資　繰越利益剰余金
(ハ) １株当たり配当額　49,650円
(ニ) 基準日　2018年３月31日
(ホ) 効力発生日　2018年６月29日

第34期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１．発行済株式に関する事項

（単位：株）

株式の種類	2018年４月１日現在	増加	減少	2019年３月31日現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

２．配当に関する事項

(1)　配当金支払額

2018年６月29日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。
・普通株式の配当に関する事項

(イ) 配当金の総額	1,901,595千円
(ロ) １株当たり配当額	49,650円
(ハ) 基準日	2018年３月31日
(ニ) 効力発生日	2018年６月29日

(2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの
2019年６月28日の定時株主総会において、次のとおり配当を提案する予定であります。
・普通株式の配当に関する事項

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

（リース取引関係）
第33期（自　2017年４月１日　至　2018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34期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）
所有権移転外ファイナンス・リース取引
１．リース資産の内容
事務機器の一部については、所有権移転外ファイナンス・リース契約により使用しておりましたが、当事業年度においてリース契約が満了しております。

２．リース資産の減価償却の方法
「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33期 自　2017年４月１日 至　2018年３月31日	第34期 自　2018年４月１日 至　2019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 ① 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 ① 信用リスク 同左
② 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。 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。	② 市場リスク 同左
③ 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。	③ 流動性リスク 同左

２．金融商品の時価等に関する事項

第33期（2018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。

第34期（2019年３月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
(1)現金・預金	17,817,927	17,817,927	-
(2)未収委託者報酬	1,954,575	1,954,575	-
(3)未収収益	1,951,601	1,951,601	-
(4)未収入金	1,809	1,809	-
(5)投資有価証券			
その他有価証券	43,201	43,201	-
(6)預り金	(54,312)	(54,312)	-
(7)未払金	(2,534,676)	(2,534,676)	-
(8)未払費用	(455,110)	(455,110)	-
(9)未払消費税等	(73,427)	(73,427)	-
(10)未払法人税等	(698,000)	(698,000)	-

(＊)負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

（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33期 2018年３月31日現在	第34期 2019年３月31日現在
(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金、(6) 預り金、(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。	(1) 現金・預金、(2) 未収委託者報酬、(3) 未収収益、(4) 未収入金、(6) 預り金、(7) 未払金、(8) 未払費用、(9) 未払消費税等及び(10) 未払法人税等 同左
(5) 投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「１．有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(5) 投資有価証券 同左

（注2）時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第33期 2018年３月31日現在	第34期 2019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）

	貸借対照表計上額
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747
その他の関係会社有価証券	31,200
敷金	450,632
その他長期差入保証金	10,865

（単位：千円）

	貸借対照表計上額
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747
その他の関係会社有価証券	31,200
敷金	450,632
その他長期差入保証金	10,030

（注3）金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第33期 2018年３月31日現在	第34期 2019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33期（2018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	-

第34期（2019年３月31日現在）

（単位：千円）

	１年以内	１年超 ５年以内	５年超 10年以内	10年超
預金	17,817,465	-	-	-
未収委託者報酬	1,954,575	-	-	-
未収収益	1,951,601	-	-	-
未収入金	1,809	-	-	-
投資有価証券				
その他有価証券のうち満期があるもの	8,308	13,426	5,810	-
合計	21,733,759	13,426	5,810	-

（有価証券関係）

第33期 2018年３月31日現在	第34期 2019年３月31日現在
１．子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 子会社株式及び関連会社株式（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。	１．子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 子会社株式及び関連会社株式（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。
２．その他有価証券 （単位：千円）	２．その他有価証券 （単位：千円）

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①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
②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

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。

区分	貸借対照表計上額	取得原価	差額
①貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの 証券投資信託	27,344	22,052	5,292
②貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの 証券投資信託	15,856	18,126	△2,269
合計	43,201	40,179	3,022

3．当事業年度中に売却したその他有価証券
同左

（退職給付関係）

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

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

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

2．確定給付制度

(1) 簡便法を適用した制度の、退職給付引当金の期首残高と期末残高の調整表

	第33期 自　2017年４月１日 至　2018年３月31日	第34期 自　2018年４月１日 至　2019年３月31日
退職給付引当金の期首残高	393,213千円	386,552千円
退職給付費用	46,223千円	38,082千円
退職給付の支払額	△43,667千円	△37,318千円
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	386,552千円	378,099千円

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

	第33期 2018年３月31日現在	第34期 2019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	386,552千円	378,099千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	386,552千円	378,099千円
退職給付引当金	386,552千円	378,099千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	386,552千円	378,099千円

(3) 退職給付費用

	第33期 自　2017年４月１日 至　2018年３月31日	第34期 自　2018年４月１日 至　2019年３月31日
簡便法で計算した退職給付費用	37,006千円	28,865千円

３．確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、第33期（自　2017年４月１日　至　2018年３月31日）54,764千円、第34期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）62,736千円であります。

（税効果会計関係）

１．繰延税金資産及び繰延税金負債の発生の主な原因別の内訳

	第33期 （2018年３月31日現在）	第34期 （2019年３月31日現在）
繰延税金資産		
退職給付引当金	118,362千円	115,773千円
未払金	4,251千円	3,921千円
賞与引当金	86,484千円	95,929千円
未払法定福利費	10,538千円	10,904千円
未払事業所税	3,288千円	3,587千円
未払事業税	50,364千円	40,339千円
未払調査費	44,622千円	83,845千円
減価償却超過額	78,443千円	98,061千円
繰延資産超過額	237千円	1,733千円
未払確定拠出年金	1,519千円	1,664千円
未収実績連動報酬	-	3,881千円

過大確定拠出年金掛金	-	19千円
未払費用	89,977千円	74,029千円
繰延税金資産小計	488,088千円	533,691千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	488,088千円	533,691千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	16千円	7千円
その他有価証券評価差額金	1,137千円	925千円
繰延税金負債合計	1,154千円	932千円
繰延税金資産の純額	486,934千円	532,758千円

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33期 （2018年３月31日現在）	第34期 （2019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33期 自　2017年４月１日 至　2018年３月31日	第34期 自　2018年４月１日 至　2019年３月31日
[セグメント情報] 当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用（投資運用業）を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。 当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。	[セグメント情報] 同左

[関連情報] 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。 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。 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	[関連情報] １．製品及びサービスごとの情報 同左 ２．地域ごとの情報 (1) 営業収益 同左 (2) 有形固定資産 同左 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 3,641,416千円 (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

（関連当事者情報）
第33期（自　2017年４月１日　至　2018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 役員の兼任	運用受託報酬の受取	1,518,481	未収収益	386,279
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。

第34期（自　2018年４月１日　至　2019年３月31日）

１．関連当事者との取引

(1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等

重要な取引はありません。

(2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等

重要な取引はありません。

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

重要な取引はありません。

(4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等

重要な取引はありません。

２．親会社又は重要な関連会社に関する情報

(1) 親会社情報

東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）

(2) 重要な関連会社の要約財務情報

重要な関連会社はありません。

（１株当たり情報）

	第33期 （自　2017年４月１日 至　2018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おりません。	
（注）１株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	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

	第34期 （自　2018年４月１日 至　2019年３月31日）
１株当たり純資産額	542,507円07銭
１株当たり当期純利益金額	87,816円78銭

なお、潜在株式調整後１株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載しておりません。

（注）１株当たり純資産額の算定上の基礎

貸借対照表の純資産の部の合計額	20,778,021千円
純資産の部の合計額から控除する金額	－
普通株式に係る当期末の純資産額	20,778,021千円
１株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株

１株当たり当期純利益金額の算定上の基礎

損益計算書上の当期純利益金額	3,363,382千円
普通株主に帰属しない金額	－
普通株式に係る当期純利益金額	3,363,382千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

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。

①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。)。

②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。)。

③通常の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④⑤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。

④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。

⑤上記③④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（2019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（2019年３月末日現在）

・事業の内容　銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額（※）	事業の内容
株式会社ＳＢＩ証券	48,323百万円	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。
髙木証券株式会社（注）	11,069百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
株式会社関西みらい銀行	38,971百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
株式会社埼玉りそな銀行	70,000百万円	
株式会社りそな銀行	279,928百万円	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。
広島信用金庫	3,604百万円	信用金庫法に基づき信用金庫の事業を営んでいます。

（※）2019年３月末日現在。ただし、株式会社関西みらい銀行は2019年４月１日現在。
広島信用金庫の資本金の額の箇所には出資の総額を記載しております。
（注）髙木証券株式会社は2019年９月１日に東海東京証券株式会社と合併し、東海東京証券株式会社となる予定です。

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

2019年６月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　荒　川　　進　㊞

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　久　保　直　毅　㊞

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2018年４月１日から2019年３月31日までの第34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2019年３月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績をすべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

利害関係

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

以　上

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

２．XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独 立 監 査 人 の 監 査 報 告 書

2019年７月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　荒川　　進

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）の2018年５月29日から2019年５月28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、ＬＰＳ４資産分散ファンド（慎重型）の2019年５月28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 監 査 報 告 書

2019年７月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　荒川　　進

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）の2018年５月29日から2019年５月28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、ＬＰＳ４資産分散ファンド（安定重視型）の2019年５月28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 監 査 報 告 書

2019年７月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　荒川　　進

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）の2018年５月29日から2019年５月28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、ＬＰＳ４資産分散ファンド（バランス型）の2019年５月28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 監 査 報 告 書

2019年７月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　荒川　　進

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）の2018年５月29日から2019年５月28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、ＬＰＳ４資産分散ファンド（成長重視型）の2019年５月28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 監 査 報 告 書

2019年７月３日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取 締 役 会 御 中

ＰｗＣあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　荒川　　進

指定有限責任社員 業務執行社員　公認会計士　久保　直毅

当監査法人は、金融商品取引法第193条の２第１項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられているＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）の2018年５月29日から2019年５月28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、ＬＰＳ４資産分散ファンド（積極型）の2019年５月28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。