

【表紙】

【提出書類】 有価証券届出書の訂正届出書

【提出先】 関東財務局長

【提出日】 2020年4月24日

【発行者名】 東京海上アセットマネジメント株式会社

【代表者の役職氏名】 代表取締役社長 後藤 俊夫

【本店の所在の場所】 東京都千代田区丸の内一丁目8番2号

【事務連絡者氏名】 尾崎 正幸

【電話番号】 03 - 3212 - 8421

【届出の対象とした募集(売出)内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

【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】 当初申込日 上限 各50億円
継続申込期間 上限 各1兆円

【縦覧に供する場所】 該当なし

1【有価証券届出書の訂正届出書の提出理由】

2019年8月30日付をもって提出した有価証券届出書（以下「原届出書」といいます。）について、有価証券報告書の提出に伴う新たな情報の更新、および原届出書記載事項の一部に訂正すべき事項があるため、本訂正届出書を提出するものです。

2【訂正の内容】

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

<更新後>

（略）

ファンドの特色

1

主として、以下のマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

資産	マザーファンド	指数
国内株式	TMA日本株TOPIXマザーファンド	TOPIX
国内債券	TMA日本債券インデックスマザーファンド	NOMURA-BPI(総合)
外国株式	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)
外国債券	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)

- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

2

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

<当初設定時>

ファンド	資産配分比率			
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	31%	28%	31%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	32%	26%	32%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	34%	22%	34%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	35%	20%	35%	10%

次ページへ続く

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

3

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

- ターゲットイヤー（2035年／2045年／2055年／2065年）の10年前（2025年／2035年／2045年／2055年）に近づくにしたいが、リスク性資産（国内外の株式）の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産（国内外の債券）の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。
- ターゲットイヤーの10年前からターゲットイヤーに近づくにしたいが、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

<2020年4月時点>

ファンド	資産配分比率			
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	31%	28%	31%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	32%	26%	32%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	34%	22%	34%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	35%	20%	35%	10%

<ターゲットイヤーの10年前>

ファンド	資産配分比率			
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	30%	30%	30%	10%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045				
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055				
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065				

※上記は、資産配分のイメージであり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。

次ページへ続く

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

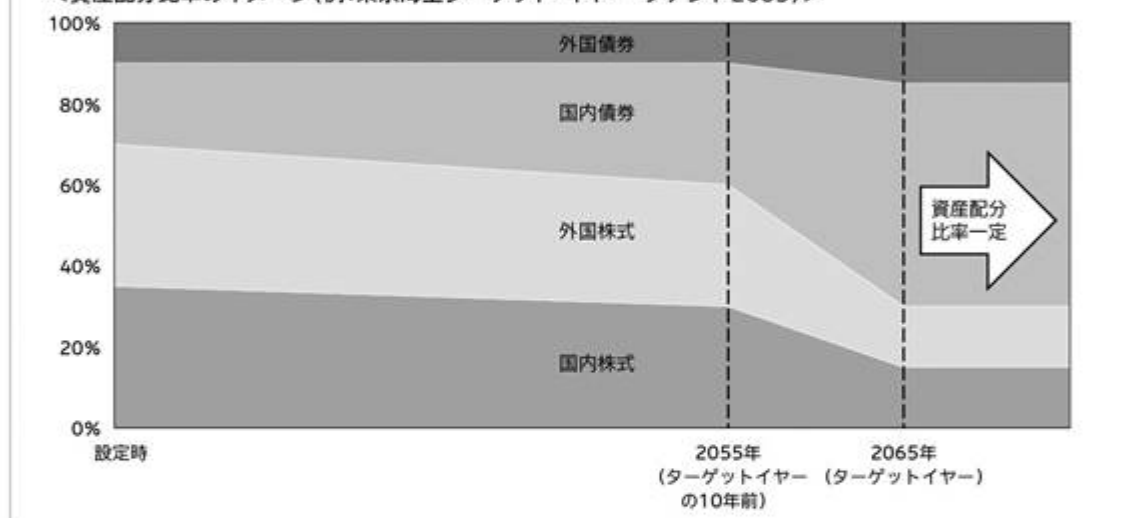
4

ターゲットイヤーの資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

<ターゲットイヤーの資産配分比率見直し実施日以降>

ファンド	資産配分比率			
	国内株式	国内債券	外国株式	外国債券
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	15%	55%	15%	15%
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045				
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055				
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065				

<資産配分比率のイメージ(例:東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065)>



※上記は、資産配分のイメージであり、実際のファンドの資産配分比率と異なる場合があります。

<各マザーファンドが対象とする指数について>

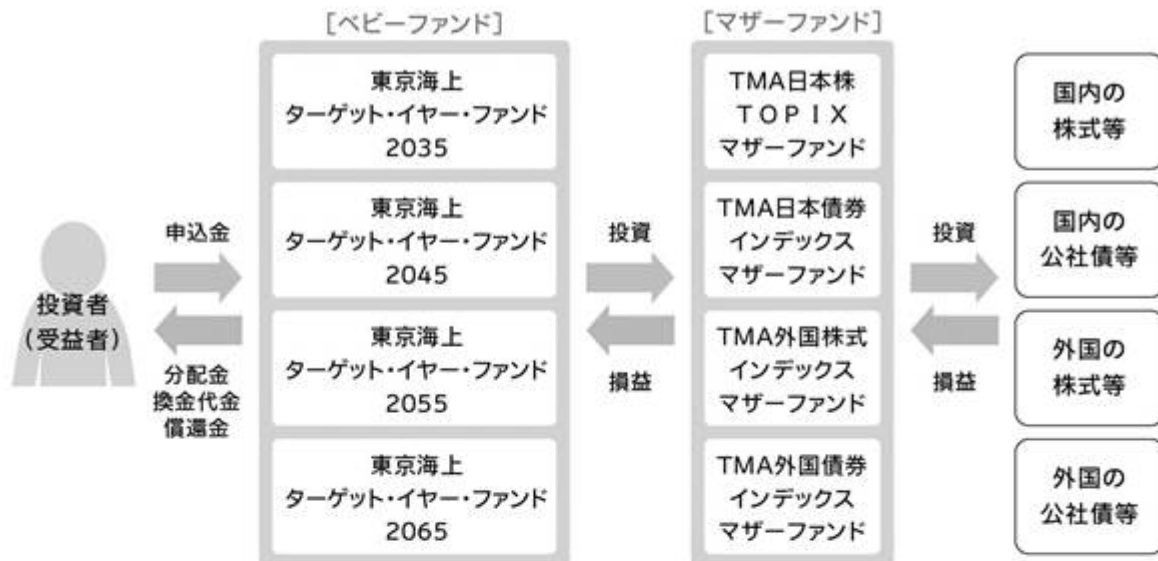
- ※「TOPIX」は東京証券取引所が発表している東証市場第一部全銘柄の動きを捉える株価指数です。TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。
- ※「NOMURA-BPI(野村ボンド・パフォーマンス・インデックス)(総合)」とは、野村證券が公表する日本の公募債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、野村證券の知的財産です。野村證券は、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社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。
- ※「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。

次ページへ続く

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

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

主な投資制限

株 式 株式への実質投資割合には制限を設けません。

外貨建資産 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。

分配方針

◎年1回決算を行います。

- 1月25日(休業日の場合は翌営業日)に決算を行い、原則として次の方針に基づき分配を行います。分配対象額は、経費控除後の、繰越分を含めた配当等収益および売買益(評価益を含みます。)等の全額とします。収益分配金額は、委託会社が基準価額の水準、市況動向等を勘案して決定します。ただし、分配対象額が少額の場合等には、収益分配を行わないことがあります。

《イメージ図》

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

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

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

(3)【ファンドの仕組み】

<更新後>

(略)

委託会社の概況

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社

- ・ 資本金の額 20億円（2020年1月末日現在）
- ・ 会社の沿革
 - 1985年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
 - 1987年2月 投資顧問業者として登録
 - 同年6月 投資一任業務認可取得
 - 1991年4月 国内および海外年金の運用受託を開始
 - 1998年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
 - 2007年9月 金融商品取引業者として登録
 - 2014年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更
 - 2016年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併
- ・ 大株主の状況（2020年1月末日現在）

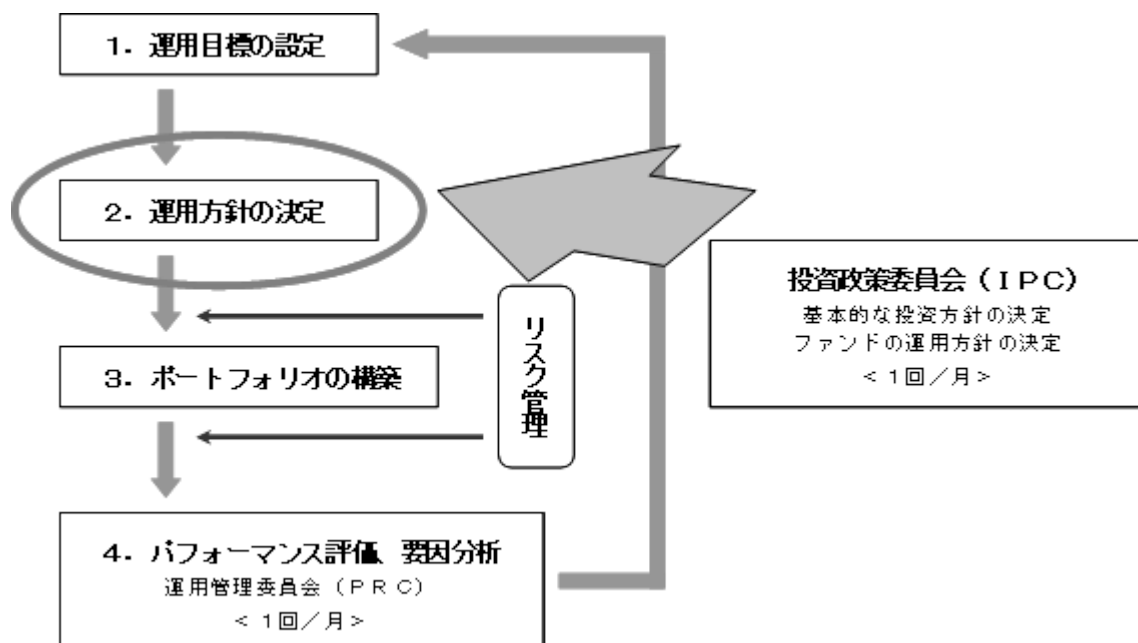
株主名	住所	所有株数	所有比率
東京海上ホールディングス株式会社	東京都千代田区丸の内一丁目2番1号	38,300株	100.0%

2【投資方針】

(3)【運用体制】

<更新後>

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が、日本債券および外国債券を債券運用部が、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（5～10名程度）による法令・運用ガイドライン等の遵守状況のチェックや運用リスク項目のチェック等が随時実施され、担当運用部へフィードバックされるとともに、原則として月1回開催される運用管理委員会（管理本部長を委員長に、運用・営業・商品企画などファンド運用に関係する各部長が参加）において投資行動の評価が行われます。（リスク管理についての詳細は、「3 投資リスク」の「3.管理体制」をご参照ください）

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

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

（上記の体制や人員等については、2020年2月1日現在）

3【投資リスク】

<更新後>

(略)

3.管理体制

(略)

参考情報

2015年2月～2020年1月

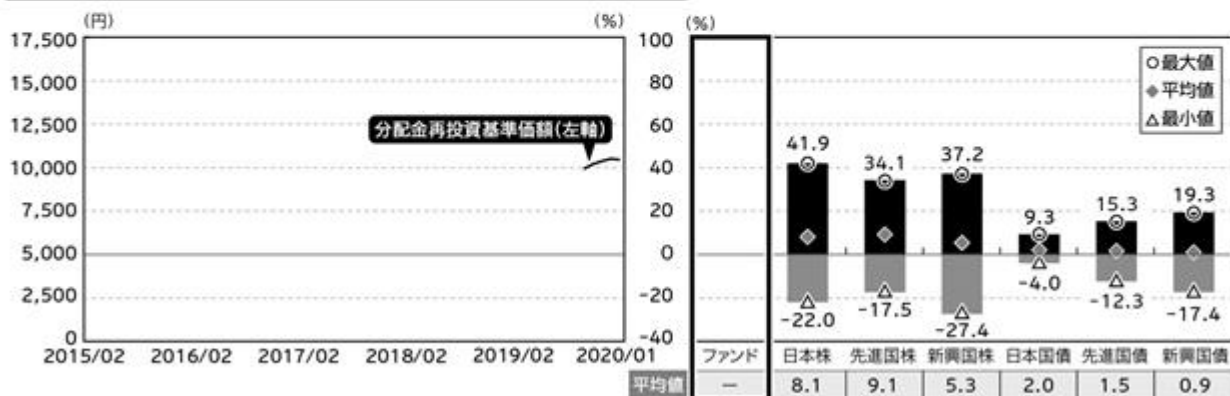
ファンドの年間騰落率および 分配金再投資基準価額の推移

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

ファンドと代表的な資産クラスとの 騰落率の比較

ファンドと代表的な資産クラスを定量的に比較できるように作成したものです。過去5年間の各月末における直近1年間の騰落率の平均値・最大値・最小値を表示したものです。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



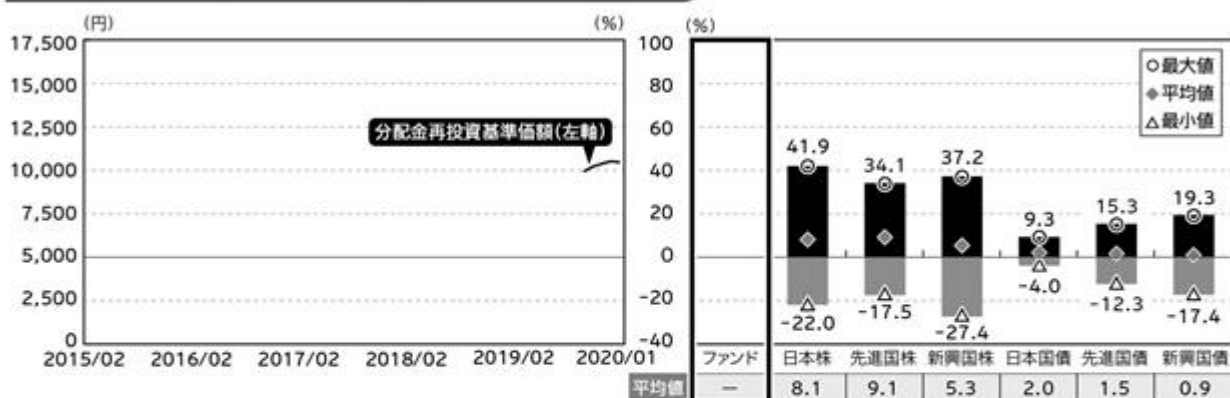
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものとして計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



※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。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

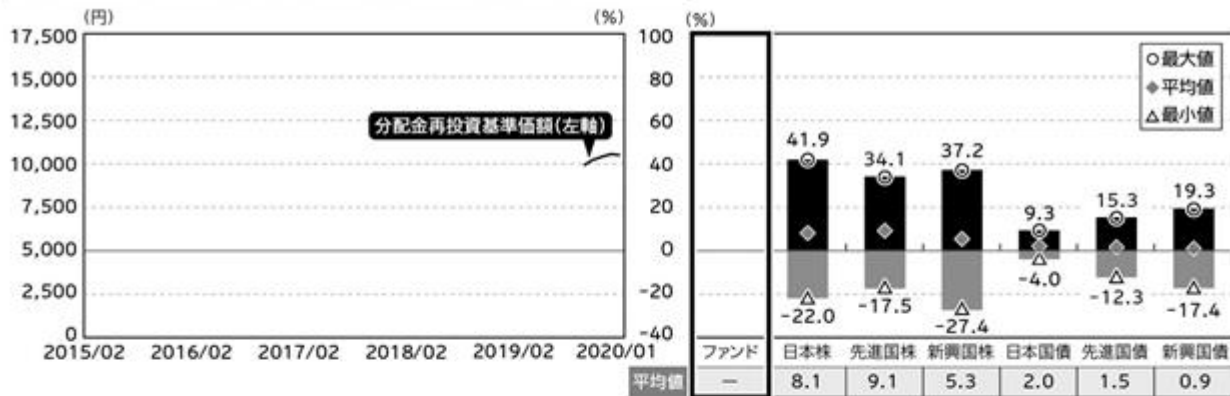
※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できません。

次ページへ続く

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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



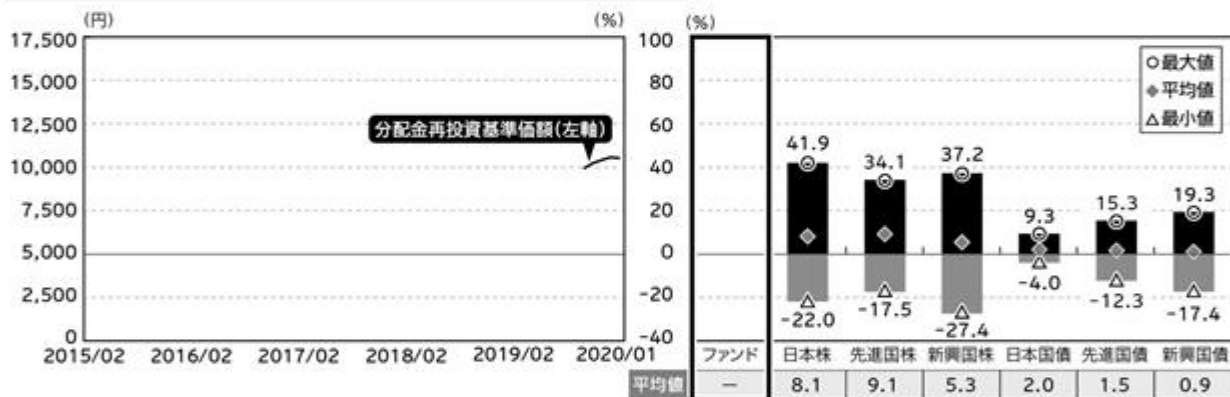
※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと
して計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場
合があります。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できま
せん。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できま
せん。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



※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。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できま
せん。

※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは設定1年未満であるため、年間騰落率を表示できま
せん。

次ページへ続く

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。

代表的な資産クラスと指数名

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

指数について

●TOPIXは東京証券取引所が発表している東証市場第一部全銘柄の動きを捉える株価指数です。TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。 ●MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●MSCIエマージング・マーケット・インデックス (配当込み、円ベース)は、MSCI社が発表している新興国の株式市場の動きを捉える代表的な指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じるいかなる責任も負いません。 ●NOMURA-BPI (国債)は、野村證券が公表する日本の国債市場の動向を的確に表すために開発された投資収益指数です。なお、NOMURA-BPI (国債)に関する著作権、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券に帰属します。 ●FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 ●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイド (円ベース)は、J.P. Morgan Securities LLCが算出、公表している、新興国が発行する現地通貨建て国債を対象とした指数です。なお、JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス-エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

4【手数料等及び税金】**(3)【信託報酬等】**

< 訂正前 >

(略)

信託報酬率およびその配分（税抜）については以下の通りとします。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2035年決算日	$\frac{\text{年率}0.3024\%}{\text{(税抜}0.28\%)}$ ¹	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2035年決算日の 翌日以降	$\frac{\text{年率}0.1944\%}{\text{(税抜}0.18\%)}$ ²	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

消費税率が10%となった場合は、1は年率0.308%、2は年率0.198%となります。

(略)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2045年決算日	$\frac{\text{年率}0.3024\%}{\text{(税抜}0.28\%)}$ ¹	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2045年決算日の 翌日以降	$\frac{\text{年率}0.1944\%}{\text{(税抜}0.18\%)}$ ²	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

消費税率が10%となった場合は、1は年率0.308%、2は年率0.198%となります。

(略)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2055年決算日	$\frac{\text{年率}0.3024\%}{\text{(税抜}0.28\%)}$ ¹	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2055年決算日の 翌日以降	$\frac{\text{年率}0.1944\%}{\text{(税抜}0.18\%)}$ ²	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

消費税率が10%となった場合は、1は年率0.308%、2は年率0.198%となります。

(略)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2065年決算日	$\frac{\text{年率}0.3024\%}{\text{(税抜}0.28\%)}$ ¹	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2065年決算日の 翌日以降	$\frac{\text{年率}0.1944\%}{\text{(税抜}0.18\%)}$ ²	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

消費税率が10%となった場合は、1は年率0.308%、2は年率0.198%となります。

(略)

<訂正後>

(略)

信託報酬率およびその配分(税抜)については以下の通りとします。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2035年決算日	$\frac{\text{年率}0.308\%}{\text{(税抜}0.28\%)}$	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2035年決算日の 翌日以降	$\frac{\text{年率}0.198\%}{\text{(税抜}0.18\%)}$	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

(略)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2045年決算日	年率0.308% (税抜0.28%)	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2045年決算日の 翌日以降	年率0.198% (税抜0.18%)	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

(略)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2055年決算日	年率0.308% (税抜0.28%)	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2055年決算日の 翌日以降	年率0.198% (税抜0.18%)	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

(略)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

計算期間	信託報酬率	配分		
		委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
設定日～ 2065年決算日	年率0.308% (税抜0.28%)	年率0.13%	年率0.13%	年率0.02%
2065年決算日の 翌日以降	年率0.198% (税抜0.18%)	年率0.08%	年率0.08%	年率0.02%

(略)

(4)【その他の手数料等】

<訂正前>

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、 $\frac{\text{年率}0.0108\%}{*1}$ (税抜0.01%)を乗じて得た金額(ただし、 $\frac{\text{年}97.2\text{万円}}{*2}$ (税抜90万円)の1日分相当額を上限とします。)を計上し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

*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99万円となります。

(略)

<訂正後>

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0.011%(税抜0.01%)を乗じて得た金額(ただし、年99万円(税抜90万円)の1日分相当額を上限とします。)を計上し、毎計算期間の最初の6ヵ月終了日および毎計算期末または信託終了のときに信託財産中から支弁します。

(略)

(5)【課税上の取扱い】

<更新後>

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。いずれの場合も

配当控除の適用はありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（ 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。

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

< 法人の受益者に対する課税 >

収益分配金のうち課税扱いとなる普通分配金ならびに解約時および償還時の「各受益者の個別元本」（ 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、益金不算入制度の適用はありません。

< 確定拠出年金に対する課税 >

受益者が確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、収益分配金および解約時・償還時の「各受益者の個別元本」（ 2 ）超過額に対する所得税、復興特別所得税および地方税はかかりません。また、確定拠出年金制度の加入者については、確定拠出年金の積立金の運用にかかる税制が適用されます。

- （ 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、2020年1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】

< 更新後 >

以下は2020年1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】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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	4,721,348	100.00
コール・ローン等、その他の資産（負債控除後）		160	0.00

合計(純資産総額)	4,721,188	100.00
-----------	-----------	--------

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,148,304	100.00
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		50	0.00
合計(純資産総額)		2,148,254	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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	1,130,226	99.99
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		17	0.00
合計(純資産総額)		1,130,243	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	2,792,063	100.00
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		32	0.00
合計(純資産総額)		2,792,031	100.00

(ご参考:親投資信託の投資状況)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065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	29,934,463,750	96.83
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		976,890,839	3.16
合計(純資産総額)		30,911,354,589	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	973,820,000	3.15

(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	2,418,637,607	47.73
	カナダ	98,214,099	1.93
	ドイツ	307,552,836	6.07
	イタリア	457,276,299	9.02
	フランス	484,676,789	9.56
	オーストラリア	101,360,214	2.00
	イギリス	336,193,818	6.63

シンガポール	18,163,204	0.35
マレーシア	19,375,896	0.38
オランダ	100,473,597	1.98
スペイン	279,549,890	5.51
ベルギー	105,752,722	2.08
スウェーデン	12,923,361	0.25
ノルウェー	11,035,388	0.21
オーストリア	63,581,557	1.25
フィンランド	27,819,375	0.54
デンマーク	23,396,037	0.46
メキシコ	40,961,288	0.80
アイルランド	29,471,094	0.58
ポーランド	23,171,137	0.45
南アフリカ	23,643,984	0.46
小計	4,983,230,192	98.35
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)	83,432,112	1.64
合計(純資産総額)	5,066,662,304	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	10,973,643,212	65.56
	カナダ	632,821,940	3.78
	ドイツ	502,760,503	3.00
	イタリア	122,350,798	0.73
	フランス	598,976,701	3.57
	オーストラリア	380,174,494	2.27
	イギリス	952,870,211	5.69
	スイス	626,461,702	3.74
	バミューダ	48,465,403	0.28
	香港	150,970,865	0.90
	シンガポール	65,712,415	0.39
	ニュージーランド	18,225,420	0.10
	オランダ	305,604,443	1.82
	スペイン	171,684,989	1.02
	ベルギー	60,035,982	0.35
	スウェーデン	157,244,146	0.93
	ノルウェー	35,407,165	0.21
	オーストリア	14,080,052	0.08
	ルクセンブルク	17,893,037	0.10
	フィンランド	67,262,647	0.40
	デンマーク	119,540,841	0.71
	アイルランド	295,341,115	1.76
	イスラエル	24,173,100	0.14
ポルトガル	12,823,525	0.07	

	ケイマン	32,538,315	0.19
	リベリア	10,561,075	0.06
	パナマ	8,613,967	0.05
	キュラソー	19,946,738	0.11
	ジャージー	48,822,491	0.29
	英ヴァージン諸島	3,083,494	0.01
	小計	16,478,090,786	98.44
投資証券	アメリカ	371,468,761	2.21
	カナダ	3,396,700	0.02
	フランス	21,298,077	0.12
	オーストラリア	33,420,659	0.19
	イギリス	17,968,403	0.10
	香港	7,236,918	0.04
	シンガポール	3,513,101	0.02
	小計	458,302,619	2.73
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		198,703,398	1.18
合計(純資産総額)		16,737,690,007	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	197,326,075	1.17
	買建	ドイツ	35,406,696	0.21
	買建	イギリス	31,357,107	0.18

(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	15,483,150,600	88.54
地方債証券	日本	986,818,900	5.64
特殊債券	日本	203,548,000	1.16
社債券	日本	776,979,127	4.44
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		35,155,404	0.20
合計(純資産総額)		17,485,652,031	100.00

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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	527,439	2.8141	1,484,267	2.7903	1,471,713	31.17

2	TMA日本株TOPIX マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	1,025,334	1.4180	1,453,923	1.4033	1,438,851	30.47
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	1,015,543	1.3112	1,331,579	1.3124	1,332,798	28.23
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	295,108	1.6076	474,415	1.6197	477,986	10.12

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

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	247,790	2.8141	697,305	2.7903	691,408	32.18
2	TMA日本株TOPIX マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	481,726	1.4180	683,087	1.4033	676,006	31.46
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	429,224	1.3112	562,798	1.3124	563,313	26.22
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	134,332	1.6076	215,952	1.6197	217,577	10.12

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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	138,543	2.8141	389,873	2.7903	386,576	34.20
2	TMA日本株TOPIX マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	269,470	1.4180	382,108	1.4033	378,147	33.45
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	191,219	1.3112	250,726	1.3124	250,955	22.20
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	70,722	1.6076	113,692	1.6197	114,548	10.13

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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	352,510	2.8030	988,098	2.7903	983,608	35.22
2	TMA日本株TOPIX マザーファンド	日本	親投資信託 受益証券	685,323	1.4137	968,892	1.4033	961,713	34.44
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	429,530	1.3112	563,225	1.3124	563,715	20.19
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	174,741	1.6100	281,338	1.6197	283,027	10.13

b. 投資有価証券の種類

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合 計	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合 計	100.00

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	99.99
合 計	99.99

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合 計	100.00

【投資不動産物件】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

該当事項はありません。

（ご参考：親投資信託の投資資産）

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	141,200	6,708.97	947,306,564	7,652.00	1,080,462,400	3.49
2	ソニー	日本	電気機器	株式	79,700	4,965.19	395,725,643	7,718.00	615,124,600	1.98
3	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	846,300	571.58	483,728,154	568.50	481,121,550	1.55
4	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	165,400	2,391.87	395,616,125	2,786.50	460,887,100	1.49
5	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	104,900	4,730.16	496,193,784	4,227.00	443,412,300	1.43
6	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	97,700	5,478.66	535,265,082	4,524.00	441,994,800	1.42
7	キーエンス	日本	電気機器	株式	11,400	33,985.18	387,431,109	37,370.00	426,018,000	1.37
8	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	86,000	3,180.86	273,553,960	4,304.00	370,144,000	1.19
9	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	86,900	4,037.48	350,857,012	3,884.00	337,519,600	1.09
10	任天堂	日本	その他製品	株式	7,700	31,355.82	241,439,814	40,770.00	313,929,000	1.01
11	KDDI	日本	情報・通信業	株式	92,200	2,491.58	229,723,676	3,271.00	301,586,200	0.97
12	NTTドコモ	日本	情報・通信業	株式	91,400	2,548.64	232,945,696	3,107.00	283,979,800	0.91
13	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	99,300	3,081.80	306,022,740	2,831.00	281,118,300	0.90
14	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	1,683,800	175.00	294,665,000	162.50	273,617,500	0.88
15	信越化学工業	日本	化学	株式	21,200	9,234.06	195,762,072	12,715.00	269,558,000	0.87
16	HOYA	日本	精密機器	株式	25,400	7,334.97	186,308,238	10,600.00	269,240,000	0.87
17	第一三共	日本	医薬品	株式	36,100	4,524.12	163,320,732	7,441.00	268,620,100	0.86
18	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	44,500	5,488.11	244,220,895	5,985.00	266,332,500	0.86
19	花王	日本	化学	株式	30,200	8,848.24	267,216,848	8,782.00	265,216,400	0.85
20	日立製作所	日本	電気機器	株式	60,400	3,664.55	221,338,820	4,230.00	255,492,000	0.82
21	ダイキン工業	日本	機械	株式	16,000	12,643.42	202,294,720	15,635.00	250,160,000	0.80
22	三菱商事	日本	卸売業	株式	86,700	3,212.44	278,518,548	2,823.00	244,754,100	0.79
23	ファナック	日本	電気機器	株式	11,900	19,258.63	229,177,697	20,320.00	241,808,000	0.78
24	村田製作所	日本	電気機器	株式	37,000	5,507.86	203,790,820	6,328.00	234,136,000	0.75
25	東海旅客鉄道	日本	陸運業	株式	10,500	25,276.10	265,399,050	21,585.00	226,642,500	0.73
26	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	86,100	2,054.60	176,901,060	2,568.00	221,104,800	0.71
27	東日本旅客鉄道	日本	陸運業	株式	22,200	10,705.26	237,656,772	9,700.00	215,340,000	0.69
28	アステラス製薬	日本	医薬品	株式	110,000	1,750.82	192,590,200	1,950.50	214,555,000	0.69
29	三井物産	日本	卸売業	株式	109,300	1,806.48	197,448,264	1,960.50	214,282,650	0.69
30	日本電産	日本	電気機器	株式	15,200	13,436.10	204,228,720	14,040.00	213,408,000	0.69

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	11,159.05	89,272,426	11,340.53	90,724,287	1.79
2	T 2 08/15/25	アメリカ	国債証券	2.000	2025/08/15	800,000	11,014.20	88,113,663	11,245.10	89,960,867	1.77
3	T 2 3/4 11/15/23	アメリカ	国債証券	2.750	2023/11/15	600,000	11,340.18	68,041,085	11,457.26	68,743,584	1.35

4	T 1 5/8 02/15/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/02/15	600,000	10,771.37	64,628,274	11,024.43	66,146,593	1.30
5	T 1 7/8 11/30/21	アメリカ	国債証券	1.875	2021/11/30	600,000	10,949.45	65,696,721	10,993.75	65,962,554	1.30
6	T 2 3/4 02/15/28	アメリカ	国債証券	2.750	2028/02/15	500,000	11,625.11	58,125,571	11,934.40	59,672,008	1.17
7	T 2 1/2 05/15/24	アメリカ	国債証券	2.500	2024/05/15	500,000	11,262.14	56,310,744	11,413.81	57,069,053	1.12
8	T 1 3/4 05/15/23	アメリカ	国債証券	1.750	2023/05/15	500,000	10,917.92	54,589,641	11,039.76	55,198,844	1.08
9	T 2 02/15/22	アメリカ	国債証券	2.000	2022/02/15	500,000	10,981.83	54,909,153	11,037.21	55,186,063	1.08
10	T 1 3/4 02/28/22	アメリカ	国債証券	1.750	2022/02/28	500,000	10,916.22	54,581,121	10,984.38	54,921,934	1.08
11	T 1 5/8 08/15/22	アメリカ	国債証券	1.625	2022/08/15	500,000	10,883.84	54,419,235	10,976.71	54,883,593	1.08
12	T 3 02/15/49	アメリカ	国債証券	3.000	2049/02/15	400,000	12,488.84	49,955,382	13,234.60	52,938,404	1.04
13	T 3 11/15/45	アメリカ	国債証券	3.000	2045/11/15	400,000	12,146.55	48,586,230	13,012.22	52,048,885	1.02
14	T 2 1/4 11/15/27	アメリカ	国債証券	2.250	2027/11/15	400,000	11,207.61	44,830,476	11,510.94	46,043,768	0.90
15	T 2 11/30/22	アメリカ	国債証券	2.000	2022/11/30	400,000	11,007.96	44,031,849	11,096.00	44,384,011	0.87
16	T 2 1/8 08/15/21	アメリカ	国債証券	2.125	2021/08/15	400,000	10,984.38	43,937,547	11,015.91	44,063,648	0.86
17	T 1 3/4 05/15/22	アメリカ	国債証券	1.750	2022/05/15	400,000	10,926.44	43,705,795	10,995.46	43,981,853	0.86
18	T 3 1/8 08/15/44	アメリカ	国債証券	3.125	2044/08/15	300,000	12,356.15	37,068,471	13,204.78	39,614,340	0.78
19	T 3 02/15/47	アメリカ	国債証券	3.000	2047/02/15	300,000	12,192.56	36,577,701	13,110.20	39,330,614	0.77
20	FRTR 2 1/4 10/25/22	フランス	国債証券	2.250	2022/10/25	300,000	13,040.52	39,121,560	12,974.95	38,924,869	0.76
21	FRTR 5 1/2 04/25/29	フランス	国債証券	5.500	2029/04/25	200,000	18,361.38	36,722,778	18,473.26	36,946,536	0.72
22	T 2 1/2 08/15/23	アメリカ	国債証券	2.500	2023/08/15	300,000	11,213.58	33,640,749	11,332.01	33,996,046	0.67
23	T 2 1/8 05/15/25	アメリカ	国債証券	2.125	2025/05/15	300,000	11,096.00	33,288,008	11,306.45	33,919,363	0.66
24	T 2 02/15/23	アメリカ	国債証券	2.000	2023/02/15	300,000	11,005.68	33,017,062	11,113.04	33,339,130	0.65
25	T 1 3/4 07/31/24	アメリカ	国債証券	1.750	2024/07/31	300,000	10,948.80	32,846,410	11,081.51	33,244,554	0.65
26	T 2 1/4 07/31/21	アメリカ	国債証券	2.250	2021/07/31	300,000	11,003.98	33,011,950	11,030.39	33,091,189	0.65
27	T 1 3/4 01/31/23	アメリカ	国債証券	1.750	2023/01/31	300,000	10,917.07	32,751,228	11,028.69	33,086,077	0.65
28	T 1 5/8 05/15/26	アメリカ	国債証券	1.625	2026/05/15	300,000	10,762.85	32,288,576	11,021.87	33,065,628	0.65
29	T 2 11/15/21	アメリカ	国債証券	2.000	2021/11/15	300,000	10,973.31	32,919,931	11,019.31	33,057,959	0.65
30	T 2 3/8 03/15/21	アメリカ	国債証券	2.375	2021/03/15	300,000	11,001.42	33,004,282	11,010.79	33,032,398	0.65

T M A 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	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	17,069	28,933.03	493,857,930	35,321.26	602,898,624	3.60
2	MICROSOFT CORP	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	27,452	16,144.66	443,203,394	18,843.38	517,288,654	3.09
3	AMAZON.COM INC	アメリカ	小売	株式	1,594	195,872.21	312,220,312	204,016.36	325,202,079	1.94
4	FACEBOOK INC-A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	9,196	21,079.49	193,847,069	22,851.34	210,140,939	1.25
5	ALPHABET INC-CL C	アメリカ	メディア・娯楽	株式	1,197	144,212.79	172,622,721	158,773.90	190,052,370	1.13
6	ALPHABET INC-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	1,147	144,066.00	165,243,704	158,600.50	181,914,779	1.08

7	JPMORGAN CHASE & CO	アメリカ	銀行	株式	11,932	14,283.60	170,432,025	14,820.16	176,834,189	1.05
8	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	9,833	14,670.37	144,253,793	16,398.26	161,244,106	0.96
9	VISA INC-CLASS A SHARES	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	6,491	19,766.96	128,307,362	22,707.38	147,393,620	0.88
10	NESTLE SA-REGISTERED	スイス	食品・飲料・タバコ	株式	11,033	11,724.83	129,360,110	12,115.26	133,667,756	0.79
11	PROCTER & GAMBLE CO	アメリカ	家庭用品・パーソナル用品	株式	9,343	13,105.14	122,441,377	13,736.10	128,336,447	0.76
12	MASTERCARD INC-CLASS A	アメリカ	ソフトウェア・サービス	株式	3,435	30,426.58	104,515,322	35,385.60	121,549,562	0.72
13	INTEL CORP	アメリカ	半導体・半導体製造装置	株式	16,716	6,403.27	107,037,196	7,249.21	121,177,931	0.72
14	BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	アメリカ	各種金融	株式	4,871	24,190.62	117,832,546	24,852.59	121,056,979	0.72
15	BANK OF AMERICA CORP	アメリカ	銀行	株式	32,946	3,638.27	119,866,623	3,651.32	120,296,678	0.71
16	AT&T INC	アメリカ	電気通信サービス	株式	27,480	4,278.11	117,562,609	4,082.11	112,176,542	0.67
17	EXXON MOBIL CORPORATION	アメリカ	エネルギー	株式	15,623	7,673.42	119,881,877	7,065.99	110,392,077	0.65
18	UNITEDHEALTH GROUP INC	アメリカ	ヘルスケア機器・サービス	株式	3,548	28,410.10	100,799,058	30,643.67	108,723,772	0.64
19	THE WALT DISNEY CO	アメリカ	メディア・娯楽	株式	6,876	15,138.96	104,095,515	15,029.55	103,343,244	0.61
20	HOME DEPOT INC	アメリカ	小売	株式	4,045	25,304.19	102,355,461	25,388.07	102,694,773	0.61
21	VERIZON COMMUNICATIONS INC	アメリカ	電気通信サービス	株式	15,240	6,476.94	98,708,595	6,473.80	98,660,736	0.58
22	ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	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	2,672	33,765.56	90,221,602	36,788.93	98,300,039	0.58
23	COCA-COLA COMPANY	アメリカ	食品・飲料・タバコ	株式	14,936	5,742.36	85,767,926	6,419.27	95,878,240	0.57
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	9,736	9,167.45	89,254,320	9,433.68	91,846,405	0.54
25	CHEVRONTXACO CORP	アメリカ	エネルギー	株式	6,961	13,121.50	91,338,764	12,149.28	84,571,165	0.50
26	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	20,726	4,054.90	84,041,899	4,042.85	83,792,196	0.50
27	COMCAST CORP-CL A	アメリカ	メディア・娯楽	株式	17,275	4,920.17	84,995,961	4,813.90	83,160,267	0.49

28	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	7,870	9,896.58	77,886,123	10,373.10	81,636,360	0.48
29	WELLS FARGO & COMPANY	アメリカ	銀行	株式	15,530	5,864.75	91,079,688	5,225.06	81,145,253	0.48
30	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	15,686	5,303.34	83,188,282	5,151.99	80,814,184	0.48

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400回利付 国債(2年)	日本	国債証券	0.100	2021/05/01	640,000,000	100.33	642,156,800	100.31	642,022,400	3.67
2	第135回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2023/03/20	440,000,000	101.01	444,448,400	100.87	443,867,600	2.53
3	第133回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2022/09/20	440,000,000	100.87	443,868,500	100.73	443,251,600	2.53
4	第136回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2023/06/20	430,000,000	101.08	434,678,400	100.95	434,085,000	2.48
5	第341回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.300	2025/12/20	405,000,000	102.65	415,767,900	102.82	416,421,000	2.38
6	第131回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2022/03/20	400,000,000	100.70	402,832,000	100.56	402,256,000	2.30
7	第132回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2022/06/20	370,000,000	100.65	372,415,600	100.64	372,379,100	2.12
8	第348回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	360,000,000	102.28	368,218,200	102.00	367,225,200	2.10
9	第342回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2026/03/20	360,000,000	101.49	365,369,400	101.70	366,127,200	2.09
10	第345回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2026/12/20	335,000,000	102.07	341,946,600	101.91	341,411,900	1.95
11	第141回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2024/09/20	320,000,000	101.10	323,520,000	101.25	324,028,800	1.85
12	第355回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/06/20	300,000,000	101.86	305,595,000	101.74	305,244,000	1.74
13	第403回利付 国債(2年)	日本	国債証券	0.100	2021/08/01	300,000,000	100.49	301,470,400	100.38	301,140,000	1.72
14	第140回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2024/06/20	285,000,000	101.37	288,931,500	101.21	288,454,200	1.64
15	第42回利付国 債(30年)	日本	国債証券	1.700	2044/03/20	208,000,000	131.25	273,003,670	132.83	276,303,040	1.58
16	第130回利付 国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2021/12/20	270,000,000	100.62	271,682,100	100.48	271,320,300	1.55
17	第154回利付 国債(20年)	日本	国債証券	1.200	2035/09/20	230,000,000	116.09	267,029,900	116.74	268,513,500	1.53
18	第346回利付 国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/03/20	250,000,000	102.08	255,212,500	101.94	254,865,000	1.45

19	第137回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2023/09/20	250,000,000	101.14	252,850,900	101.02	252,555,000	1.44
20	第347回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2027/06/20	220,000,000	101.60	223,538,200	101.97	224,351,600	1.28
21	第353回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2028/12/20	210,000,000	101.47	213,089,000	101.83	213,855,600	1.22
22	第150回利付 国債（20年）	日本	国債証券	1.400	2034/09/20	177,000,000	118.12	209,085,300	119.08	210,778,680	1.20
23	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	103.09	206,188,000	102.91	205,828,000	1.17
24	第123回利付 国債（20年）	日本	国債証券	2.100	2030/12/20	160,000,000	122.86	196,582,100	123.24	197,188,800	1.12
25	第356回利付 国債（10年）	日本	国債証券	0.100	2029/09/20	190,000,000	101.23	192,344,800	101.69	193,224,300	1.10
26	第139回利付 国債（20年）	日本	国債証券	1.600	2032/06/20	145,000,000	118.89	172,391,520	119.50	173,280,800	0.99
27	第139回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2024/03/20	170,000,000	101.31	172,227,000	101.16	171,977,100	0.98
28	第129回利付 国債（5年）	日本	国債証券	0.100	2021/09/20	170,000,000	100.53	170,901,000	100.42	170,720,800	0.97
29	第164回利付 国債（20年）	日本	国債証券	0.500	2038/03/20	160,000,000	104.20	166,724,800	105.52	168,836,800	0.96
30	第162回利付 国債（20年）	日本	国債証券	0.600	2037/09/20	150,000,000	106.16	159,244,500	107.35	161,038,500	0.92

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	0.08
		鉱業	0.26
		建設業	2.74
		食料品	3.74
		繊維製品	0.57
		パルプ・紙	0.24
		化学	6.93
		医薬品	5.96
		石油・石炭製品	0.48
		ゴム製品	0.65
		ガラス・土石製品	0.74
		鉄鋼	0.72
		非鉄金属	0.68
		金属製品	0.59
		機械	4.82
		電気機器	14.08
		輸送用機器	7.44
		精密機器	2.34
その他製品	2.22		

	電気・ガス業	1.43
	陸運業	4.18
	海運業	0.15
	空運業	0.45
	倉庫・運輸関連業	0.22
	情報・通信業	8.43
	卸売業	4.99
	小売業	4.43
	銀行業	5.54
	証券、商品先物取引業	0.84
	保険業	2.18
	その他金融業	1.18
	不動産業	2.42
	サービス業	4.92
合 計		96.83

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	98.35
合 計	98.35

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	4.95
		素材	4.08
		資本財	7.04
		商業・専門サービス	1.38
		運輸	1.84
		自動車・自動車部品	1.07
		耐久消費財・アパレル	1.93
		消費者サービス	1.83
		メディア・娯楽	6.22
		小売	4.76
		食品・生活必需品小売り	1.48
		食品・飲料・タバコ	4.86
		家庭用品・パーソナル用品	2.04
		ヘルスケア機器・サービス	5.07
		医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス	8.28
		銀行	7.42
		各種金融	4.61
		保険	3.79
		不動産	0.45
		ソフトウェア・サービス	10.57

		テクノロジー・ハードウェア および機器	5.14
		電気通信サービス	2.30
		公益事業	3.75
		半導体・半導体製造装置	3.49
投資証券		-	2.73
合 計			101.18

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	88.54
地方債証券	5.64
特殊債券	1.16
社債券	4.44
合 計	99.79

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。

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	58	996,122,800.00	973,820,000	3.15

(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	11	米ドル	1,820,437.50	1,809,335.00	197,326,075	1.17
	ドイツ	Eurex	DJ EU STX 50	買建	8	ユーロ	301,620.00	294,320.00	35,406,696	0.21

イギリス	ICE Futures Europe Financials	FTSE 100 IDX	買建	3	英債券	224,925.00	219,480.00	31,357,107	0.18
------	-------------------------------------	--------------	----	---	-----	------------	------------	------------	------

(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】

【純資産の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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	(2020年 1月27日)	4	4	1.0509	1.0509
	2019年 9月末日	0.992889	-	0.9929	-
	10月末日	1	-	1.0200	-
	11月末日	1	-	1.0365	-
	12月末日	1	-	1.0503	-
	2020年 1月末日	4	-	1.0458	-

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

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	(2020年 1月27日)	2	2	1.0527	1.0527
	2019年 9月末日	0.992667	-	0.9927	-
	10月末日	1	-	1.0207	-
	11月末日	1	-	1.0379	-
	12月末日	1	-	1.0523	-
	2020年 1月末日	2	-	1.0474	-

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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	(2020年 1月27日)	1	1	1.0565	1.0565
	2019年 9月末日	0.992220	-	0.9922	-
	10月末日	1	-	1.0222	-
	11月末日	1	-	1.0407	-
	12月末日	1	-	1.0562	-
	2020年 1月末日	1	-	1.0507	-

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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	(2020年 1月27日)	1	1	1.0584	1.0584
	2019年 9月末日	0.991998	-	0.9920	-
	10月末日	1	-	1.0229	-
	11月末日	1	-	1.0421	-
	12月末日	1	-	1.0581	-
	2020年 1月末日	2	-	1.0524	-

【分配の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
該当事項はありません。

【収益率の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.1

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.3

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.7

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2019年 9月20日～2020年 1月27日	5.8

(4) 【設定及び解約の実績】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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	2019年 9月20日～2020年 1月27日	4,514,529		4,514,529

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

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	2019年 9月20日 ~ 2020年 1月27日	2,051,072		2,051,072
--------	---------------------------	-----------	--	-----------

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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	2019年 9月20日 ~ 2020年 1月27日	1,075,709		1,075,709

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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	2019年 9月20日 ~ 2020年 1月27日	1,503,582		1,503,582

< 参考情報 >

基準日:2020年1月31日

基準価額・純資産の推移

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2019年9月20日です。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第1期	2020/01/27	0円
第2期	2021/01/25	
第3期	2022/01/25	
第4期	2023/01/25	
第5期	2024/01/25	
設定来累計		分配実績なし

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2019年9月20日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第1期	2020/01/27	0円
第2期	2021/01/25	
第3期	2022/01/25	
第4期	2023/01/25	
第5期	2024/01/25	
設定来累計		分配実績なし

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

次ページへ続く

・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。

基準日:2020年1月31日

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
 ※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2019年9月20日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第1期	2020/01/27	0円
第2期	2021/01/25	
第3期	2022/01/25	
第4期	2023/01/25	
第5期	2024/01/25	
設定来累計		分配実績なし

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
 ※基準価額は1万口当たりで表示しています。 ※設定日は2019年9月20日です。

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第1期	2020/01/27	0円
第2期	2021/01/25	
第3期	2022/01/25	
第4期	2023/01/25	
第5期	2024/01/25	
設定来累計		分配実績なし

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

次ページへ続く

・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。

基準日:2020年1月31日

主要な資産の状況

資産構成

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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	30.5%	31.0%	-0.5%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	28.2%	28.0%	+0.2%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	31.2%	31.0%	+0.2%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	10.1%	10.0%	+0.1%
短期金融資産等	-0.0%	-	-0.0%

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

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	31.5%	32.0%	-0.5%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	26.2%	26.0%	+0.2%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	32.2%	32.0%	+0.2%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	10.1%	10.0%	+0.1%
短期金融資産等	-0.0%	-	-0.0%

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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	33.5%	34.0%	-0.5%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	22.2%	22.0%	+0.2%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	34.2%	34.0%	+0.2%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	10.1%	10.0%	+0.1%
短期金融資産等	0.0%	-	+0.0%

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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	34.4%	35.0%	-0.6%
TMA日本債券インデックスマザーファンド	20.2%	20.0%	+0.2%
TMA外国株式インデックスマザーファンド	35.2%	35.0%	+0.2%
TMA外国債券インデックスマザーファンド	10.1%	10.0%	+0.1%
短期金融資産等	-0.0%	-	-0.0%

※組入比率は純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

・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。

基準日:2020年1月31日

年間収益率の推移

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



※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おり、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



※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おり、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

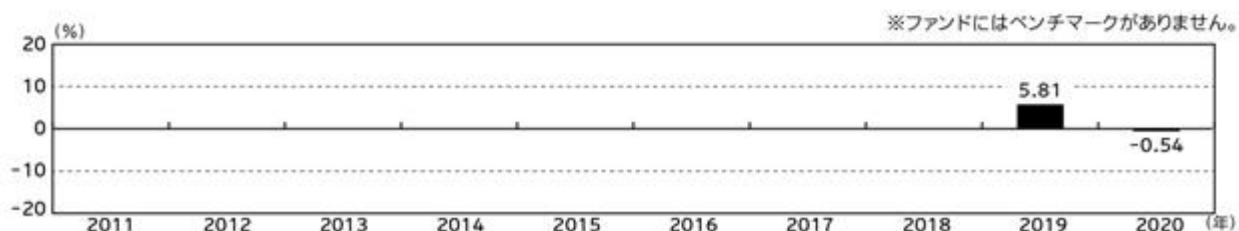
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



※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おり、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



※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おり、設定日以降を表示しています。

※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

・ファンドの運用実績はあくまで過去の実績であり、将来の運用成果を約束するものではありません。

第3【ファンドの経理状況】

<更新後>

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドの第1期計算期間は、投資信託約款第40条により、2019年9月20日から2020年1月27日までとなっております。
- (3) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第1期計算期間(2019年9月20日から2020年1月27日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035】

(1)【貸借対照表】

区 分	注記 番号	第1期 [2020年 1月27日現在]
		金額(円)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		4,744,312
未収入金		1,123
流動資産合計		4,745,435
資産合計		4,745,435
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		116
未払委託者報酬		1,131
その他未払費用		4
流動負債合計		1,251
負債合計		1,251
純資産の部		
元本等		
元本	1	4,514,529
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		229,655
(分配準備積立金)		16,526
元本等合計		4,744,184
純資産合計		4,744,184
負債純資産合計		4,745,435

(2)【損益及び剰余金計算書】

		第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
区 分	注記 番号	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益		17,785
営業収益合計		17,785
営業費用		
支払利息		8
受託者報酬		116
委託者報酬		1,131
その他費用		4
営業費用合計		1,259
営業利益又は営業損失()		16,526
経常利益又は経常損失()		16,526
当期純利益又は当期純損失()		16,526
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		
期首剰余金又は期首欠損金()		
剰余金増加額又は欠損金減少額		213,129
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		213,129
剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()		229,655

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 [2020年 1月27日現在]
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	3,514,529円

期中一部解約元本額	円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	4,514,529口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日	
1 分配金の計算過程	<p>計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,615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(7,911円)、投資信託約款に規定される収益調整金(213,129円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は229,655円(1万口当たり508.69円)であります。分配を行っておりません。</p>

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。</p> <p>法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。</p> <p>これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。</p>

. 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 [2020年 1月27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ぬ。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

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

(有価証券に関する注記)

第1期(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	16,716
合計	16,716

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

(1口当たり情報に関する注記)

第1期 [2020年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	1.0509円
(1万口当たり純資産額)	10,509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	1,025,334	1,453,923	
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	295,108	474,415	
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	527,485	1,484,395	
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	1,015,543	1,331,579	
親投資信託受益証券 合計		2,863,470	4,744,312	
合計		2,863,470	4,744,312	

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。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045】

(1) 【貸借対照表】

		第1期 [2020年 1月27日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		2,159,142
未収入金		1,148
流動資産合計		2,160,290
資産合計		2,160,290
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		107
未払委託者報酬		1,019
流動負債合計		1,126
負債合計		1,126
純資産の部		
元本等		
元本	1	2,051,072
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）		108,092
（分配準備積立金）		41,176
元本等合計		2,159,164
純資産合計		2,159,164
負債純資産合計		2,160,290

(2) 【損益及び剰余金計算書】

		第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
区 分	注記 番号	金額（円）
営業収益		
有価証券売買等損益		42,310
営業収益合計		42,310
営業費用		
支払利息		8
受託者報酬		107
委託者報酬		1,019
営業費用合計		1,134
営業利益又は営業損失（ ）		41,176
経常利益又は経常損失（ ）		41,176
当期純利益又は当期純損失（ ）		41,176

一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		
期首剰余金又は期首欠損金()		
剰余金増加額又は欠損金減少額		66,916
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		66,916
剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()		108,092

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 [2020年 1月27日現在]
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	1,051,072円
期中一部解約元本額	円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	2,051,072口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27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(7,641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(33,535円)、投資信託約款に規定される収益調整金(66,916円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は108,092円(1万口当たり526.98円)であります。分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 [2020年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

第1期(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	41,143
合計	41,143

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

(1口当たり情報に関する注記)

第1期 [2020年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	1.0527円
(1万口当たり純資産額)	10,527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	481,726	683,087	
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	134,332	215,952	
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	247,790	697,305	
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	429,224	562,798	
親投資信託受益証券 合計		1,293,072	2,159,142	
合計		1,293,072	2,159,142	

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。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055】

(1)【貸借対照表】

		第1期 [2020年 1月27日現在]
区 分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		1,136,399
未収入金		1,137
流動資産合計		1,137,536
資産合計		1,137,536
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		105
未払委託者報酬		979
流動負債合計		1,084
負債合計		1,084

純資産の部		
元本等		
元本	1	1,075,709
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		60,743
(分配準備積立金)		55,751
元本等合計		1,136,452
純資産合計		1,136,452
負債純資産合計		1,137,536

(2) 【損益及び剰余金計算書】

		第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
区 分	注記 番号	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益		56,843
営業収益合計		56,843
営業費用		
支払利息		8
受託者報酬		105
委託者報酬		979
営業費用合計		1,092
営業利益又は営業損失()		55,751
経常利益又は経常損失()		55,751
当期純利益又は当期純損失()		55,751
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		
期首剰余金又は期首欠損金()		
剰余金増加額又は欠損金減少額		4,992
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		4,992
剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()		60,743

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 [2020年 1月27日現在]
1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	75,709円
期中一部解約元本額	円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	1,075,709口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27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(7,356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(48,395円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,992円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は60,743円(1万口当たり564.65円)ですが、分配を行っておりません。

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 [2020年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

第1期(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	55,688
合計	55,688

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

(1口当たり情報に関する注記)

第1期 [2020年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	1.0565円
(1万口当たり純資産額)	10,565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	269,470	382,108	
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	70,722	113,692	
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	138,543	389,873	
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	191,219	250,726	
親投資信託受益証券 合計		669,954	1,136,399	
合計		669,954	1,136,399	

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。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065】

(1)【貸借対照表】

		第1期 [2020年 1月27日現在]
区分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券		1,591,320
未収入金		1,126
流動資産合計		1,592,446
資産合計		
1,592,446		
負債の部		
流動負債		
未払受託者報酬		106
未払委託者報酬		993
流動負債合計		1,099
負債合計		
1,099		
純資産の部		
元本等		
元本	1	1,503,582
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金()		87,765
(分配準備積立金)		51,660
元本等合計		1,591,347
純資産合計		
1,591,347		

負債純資産合計		1,592,446
---------	--	-----------

(2)【損益及び剰余金計算書】

		第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
区 分	注記 番号	金額(円)
営業収益		
有価証券売買等損益		52,767
営業収益合計		52,767
営業費用		
支払利息		8
受託者報酬		106
委託者報酬		993
営業費用合計		1,107
営業利益又は営業損失()		51,660
経常利益又は経常損失()		51,660
当期純利益又は当期純損失()		51,660
一部解約に伴う当期純利益金額の分配額又は一部解約に伴う当期純損失金額の分配額()		
期首剰余金又は期首欠損金()		
剰余金増加額又は欠損金減少額		36,105
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		36,105
剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額		
分配金	1	
期末剰余金又は期末欠損金()		87,765

(3)【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第1期 [2020年 1月27日現在]

1. 1 期首元本額	1,000,000円
期中追加設定元本額	503,582円
期中一部解約元本額	円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	1,503,582口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日	
1 分配金の計算過程	
<p>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(7,735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(43,925円)、投資信託約款に規定される収益調整金(36,105円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は87,765円(1万口当たり583.68円)であります。分配を行っておりません。</p>	

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	<p>委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。</p> <p>法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っております。</p> <p>これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。</p>

. 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第1期 [2020年 1月27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ぬ。

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

(有価証券に関する注記)

第1期(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	51,669
合計	51,669

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

(1口当たり情報に関する注記)

第1期 [2020年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	1.0584円
(1万口当たり純資産額)	10,584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	388,428	550,790	
	TMA外国債券インデックスマザーファンド	99,031	159,202	
	TMA外国株式インデックスマザーファンド	199,768	562,167	
	TMA日本債券インデックスマザーファンド	243,412	319,161	
親投資信託受益証券 合計		930,639	1,591,320	
合計		930,639	1,591,320	

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)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065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

		[2020年 1月27日現在]
区分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		837,619,475
株式	2	30,248,893,330
派生商品評価勘定		989,000
未収配当金		47,970,938
流動資産合計		31,135,472,743
資産合計		
31,135,472,743		
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		10,385,800
前受金		3,365,000
未払解約金		60,445,017

未払利息		485
流動負債合計		74,196,302
負債合計		74,196,302
純資産の部		
元本等		
元本	1	21,904,463,467
剰余金		
剰余金又は欠損金()		9,156,812,974
元本等合計		31,061,276,441
純資産合計		31,061,276,441
負債純資産合計		31,135,472,743

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27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	[2020年 1月27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	27,141,098,926円
同期中における追加設定元本額	1,882,766,278円
同期中における一部解約元本額	7,119,401,737円
同期末における元本額	21,904,463,467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 >	170,490,885円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	585,865,907円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	474,320,896円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	658,175,953円
東京海上日本株TOPIXファンド	241,129,562円
東京海上セレクション・日本株TOPIX	15,953,838,356円
LPS4資産分散ファンド(慎重型)	6,383,490円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	11,720,722円

L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)	36,327,576円
L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)	45,262,926円
L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	53,733,866円
東京海上・円資産インデックスバランス ファンド	4,600,680円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	1,025,334円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	481,726円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	269,470円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	388,428円
T M A 日本株式インデックスV A < 適格機 関投資家限定 >	314,584,425円
T M A 世界バランスファンド35 V A < 適格 機関投資家限定 >	2,147,883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 >	60,740,579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 >	424,598,455円
東京海上・T O P I X インデックスファン ド < 適格機関投資家限定 >	2,858,376,348円
計	21,904,463,467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	21,904,463,467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 712,590,000円

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

(注2) 3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(有価証券に関する注記)

(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	1,581,808,220
合計	1,581,808,220

(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2020年1月27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

(2020年1月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	827,035,000		817,680,000	9,355,000
	東証株価指数先物	827,035,000		817,680,000	9,355,000
合計		827,035,000		817,680,000	9,355,000

(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)

[2020年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	1.4180円
(1万口当たり純資産額)	14,180円)

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

(単位：円)

銘柄	株式数	評価額		備考
		単価	金額	
日本水産	16,200	596.00	9,655,200	
マルハニチロ	2,400	2,647.00	6,352,800	
サカタのタネ	2,100	3,515.00	7,381,500	
ホクト	1,900	1,938.00	3,682,200	
国際石油開発帝石	68,000	1,053.00	71,604,000	
石油資源開発	2,400	2,883.00	6,919,200	
K&Oエナジーグループ	2,800	1,684.00	4,715,200	
ショーボンドホールディングス	2,300	4,575.00	10,522,500	
ミライト・ホールディングス	4,500	1,680.00	7,560,000	
ベステラ	3,000	1,242.00	3,726,000	
安藤・間	10,500	937.00	9,838,500	
東急建設	5,100	769.00	3,921,900	
コムシスホールディングス	6,000	3,165.00	18,990,000	
東建コーポレーション	800	7,530.00	6,024,000	
ヤマウラ	5,400	917.00	4,951,800	
大成建設	13,300	4,490.00	59,717,000	
大林組	41,700	1,214.00	50,623,800	

清水建設	42,700	1,144.00	48,848,800	
長谷工コーポレーション	17,600	1,482.00	26,083,200	
鹿島建設	31,900	1,422.00	45,361,800	
西松建設	2,800	2,463.00	6,896,400	
三井住友建設	10,300	629.00	6,478,700	
前田建設工業	10,100	1,134.00	11,453,400	
奥村組	2,200	2,959.00	6,509,800	
東鉄工業	2,000	3,190.00	6,380,000	
戸田建設	17,000	722.00	12,274,000	
熊谷組	1,800	3,180.00	5,724,000	
大東建託	4,800	12,835.00	61,608,000	
N I P P O	3,800	2,725.00	10,355,000	
前田道路	4,200	3,630.00	15,246,000	
東亜建設工業	3,800	1,636.00	6,216,800	
五洋建設	16,700	665.00	11,105,500	
住友林業	9,500	1,541.00	14,639,500	
日本基礎技術	1,100	395.00	434,500	
大和ハウス工業	39,000	3,495.00	136,305,000	
積水ハウス	43,200	2,431.00	105,019,200	
北陸電気工事	4,400	1,123.00	4,941,200	
中電工	2,600	2,496.00	6,489,600	
関電工	6,000	1,021.00	6,126,000	
きんでん	9,400	1,665.00	15,651,000	
日本電設工業	2,700	2,225.00	6,007,500	
協和エクシオ	5,100	2,761.00	14,081,100	
新日本空調	3,800	2,071.00	7,869,800	
九電工	2,600	3,260.00	8,476,000	
三機工業	5,300	1,520.00	8,056,000	
日揮ホールディングス	12,100	1,638.00	19,819,800	
中外炉工業	2,300	1,752.00	4,029,600	
ヤマト	6,500	889.00	5,778,500	
高砂熱学工業	3,500	1,918.00	6,713,000	
三晃金属工業	800	2,615.00	2,092,000	
大気社	1,900	3,780.00	7,182,000	
日比谷総合設備	3,500	1,902.00	6,657,000	
OSJBホールディングス	16,300	275.00	4,482,500	
東洋エンジニアリング	4,700	609.00	2,862,300	
レイズネクスト	4,900	1,355.00	6,639,500	
日本製粉	3,700	1,662.00	6,149,400	
日清製粉グループ本社	14,100	1,795.00	25,309,500	
鳥越製粉	6,300	835.00	5,260,500	
日本甜菜製糖	3,000	1,901.00	5,703,000	
三井製糖	1,600	2,144.00	3,430,400	

森永製菓	3,100	5,260.00	16,306,000	
江崎グリコ	3,600	4,720.00	16,992,000	
山崎製パン	10,400	2,069.00	21,517,600	
亀田製菓	1,200	4,925.00	5,910,000	
寿スピリッツ	1,300	7,750.00	10,075,000	
カルビー	5,700	3,660.00	20,862,000	
森永乳業	2,600	4,260.00	11,076,000	
ヤクルト本社	8,800	5,870.00	51,656,000	
明治ホールディングス	8,500	7,820.00	66,470,000	
雪印メグミルク	2,800	2,499.00	6,997,200	
プリマハム	2,300	2,426.00	5,579,800	
日本ハム	5,000	4,770.00	23,850,000	
丸大食品	2,200	2,129.00	4,683,800	
S Foods	2,200	2,679.00	5,893,800	
伊藤ハム米久ホールディングス	8,600	698.00	6,002,800	
サッポロホールディングス	4,400	2,678.00	11,783,200	
アサヒグループホールディングス	26,500	5,101.00	135,176,500	
キリンホールディングス	53,500	2,460.50	131,636,750	
宝ホールディングス	9,500	980.00	9,310,000	
オエノンホールディングス	13,700	381.00	5,219,700	
コカ・コーラ ボトラーズジャパン ホールディングス	9,600	2,808.00	26,956,800	
サントリー食品インターナショナル	8,500	4,595.00	39,057,500	
ダイドーグループホールディングス	1,000	4,260.00	4,260,000	
伊藤園	3,800	5,340.00	20,292,000	
キーコーヒー	1,900	2,274.00	4,320,600	
ユニカフェ	4,000	966.00	3,864,000	
ジャパンフーズ	3,800	1,289.00	4,898,200	
日清オイリオグループ	1,800	3,700.00	6,660,000	
不二製油グループ本社	3,000	2,851.00	8,553,000	
J - オイルミルズ	900	4,125.00	3,712,500	
キッコーマン	9,000	5,280.00	47,520,000	
味の素	27,800	1,796.00	49,928,800	
キューピー	7,000	2,320.00	16,240,000	
ハウス食品グループ本社	4,600	3,720.00	17,112,000	
カゴメ	4,900	2,688.00	13,171,200	
アリアケジャパン	1,200	7,470.00	8,964,000	
ニチレイ	6,400	2,605.00	16,672,000	
東洋水産	6,400	4,485.00	28,704,000	
日清食品ホールディングス	5,300	8,300.00	43,990,000	
フジッコ	2,200	1,923.00	4,230,600	
ロック・フィールド	4,400	1,453.00	6,393,200	
日本たばこ産業	72,500	2,317.00	167,982,500	
ユーグレナ	8,200	737.00	6,043,400	

片倉工業	4,600	1,245.00	5,727,000	
ゲンゼ	600	4,560.00	2,736,000	
東洋紡	4,800	1,519.00	7,291,200	
倉敷紡績	2,000	2,334.00	4,668,000	
日本毛織	6,500	1,069.00	6,948,500	
帝国繊維	2,100	2,367.00	4,970,700	
帝人	9,600	1,984.00	19,046,400	
東レ	86,600	725.60	62,836,960	
日本フェルト	10,300	494.00	5,088,200	
セーレン	3,100	1,405.00	4,355,500	
小松マテール	7,300	750.00	5,475,000	
ワコールホールディングス	3,300	2,945.00	9,718,500	
ホギメディカル	1,600	3,880.00	6,208,000	
T S Iホールディングス	7,800	545.00	4,251,000	
三陽商会	2,800	1,277.00	3,575,600	
オンワードホールディングス	7,800	630.00	4,914,000	
ゴールドウイン	2,200	6,660.00	14,652,000	
デサント	3,700	1,788.00	6,615,600	
特種東海製紙	1,200	3,960.00	4,752,000	
王子ホールディングス	54,600	575.00	31,395,000	
日本製紙	5,700	1,818.00	10,362,600	
三菱製紙	2,600	462.00	1,201,200	
北越コーポレーション	9,200	524.00	4,820,800	
大王製紙	5,700	1,448.00	8,253,600	
レンゴー	12,600	796.00	10,029,600	
ザ・パック	1,400	3,820.00	5,348,000	
クラレ	20,800	1,321.00	27,476,800	
旭化成	81,900	1,129.00	92,465,100	
共和レザー	5,200	797.00	4,144,400	
昭和電工	8,900	2,684.00	23,887,600	
住友化学	96,800	477.00	46,173,600	
日産化学	7,000	4,525.00	31,675,000	
クレハ	1,100	6,520.00	7,172,000	
石原産業	1,000	939.00	939,000	
片倉コープアグリ	3,600	1,224.00	4,406,400	
日本曹達	2,100	3,020.00	6,342,000	
東ソー	19,100	1,602.00	30,598,200	
トクヤマ	3,300	2,658.00	8,771,400	
セントラル硝子	2,500	2,441.00	6,102,500	
東亜合成	7,800	1,218.00	9,500,400	
大阪ソーダ	1,900	2,999.00	5,698,100	
デンカ	4,600	3,010.00	13,846,000	
信越化学工業	21,200	12,395.00	262,774,000	

堺化学工業	2,100	2,226.00	4,674,600	
エア・ウォーター	10,100	1,523.00	15,382,300	
大陽日酸	10,900	2,401.00	26,170,900	
日本パーカライジング	6,400	1,154.00	7,385,600	
ステラ ケミファ	1,800	3,125.00	5,625,000	
日本触媒	2,200	6,470.00	14,234,000	
カネカ	3,100	3,380.00	10,478,000	
三菱瓦斯化学	12,400	1,669.00	20,695,600	
三井化学	11,300	2,454.00	27,730,200	
J S R	12,700	2,003.00	25,438,100	
東京応化工業	2,000	4,785.00	9,570,000	
三菱ケミカルホールディングス	82,200	797.10	65,521,620	
K H ネオケム	2,200	2,291.00	5,040,200	
ダイセル	18,900	1,033.00	19,523,700	
住友ベークライト	1,900	4,150.00	7,885,000	
積水化学工業	26,400	1,882.00	49,684,800	
日本ゼオン	11,300	1,259.00	14,226,700	
アイカ工業	3,500	3,475.00	12,162,500	
宇部興産	6,100	2,244.00	13,688,400	
旭有機材	2,800	1,692.00	4,737,600	
日立化成	5,600	4,595.00	25,732,000	
タイガースポリマー	4,600	584.00	2,686,400	
ミライアル	2,800	1,299.00	3,637,200	
日本化薬	7,300	1,291.00	9,424,300	
A D E K A	5,700	1,624.00	9,256,800	
日油	4,700	3,490.00	16,403,000	
ハリマ化成グループ	4,700	1,133.00	5,325,100	
花王	30,200	9,100.00	274,820,000	
ニイタカ	2,800	2,795.00	7,826,000	
三洋化成工業	900	5,210.00	4,689,000	
日本ペイントホールディングス	10,100	5,150.00	52,015,000	
関西ペイント	13,800	2,609.00	36,004,200	
中国塗料	5,900	1,053.00	6,212,700	
太陽ホールディングス	2,000	4,630.00	9,260,000	
D I C	5,500	2,928.00	16,104,000	
サカタインクス	3,800	1,126.00	4,278,800	
東洋インキ S C ホールディングス	2,300	2,502.00	5,754,600	
富士フイルムホールディングス	24,100	5,656.00	136,309,600	
資生堂	25,000	7,060.00	176,500,000	
ライオン	16,400	2,091.00	34,292,400	
高砂香料工業	1,300	2,394.00	3,112,200	
マンダム	2,700	2,884.00	7,786,800	
ミルボン	1,700	6,180.00	10,506,000	

ファンケル	5,600	2,797.00	15,663,200	
コーセー	2,300	15,060.00	34,638,000	
コタ	4,200	1,596.00	6,703,200	
ポーラ・オルビスホールディングス	5,200	2,361.00	12,277,200	
ノエビアホールディングス	1,000	5,460.00	5,460,000	
エステー	2,900	1,642.00	4,761,800	
長谷川香料	3,000	2,251.00	6,753,000	
小林製薬	3,500	8,860.00	31,010,000	
荒川化学工業	4,000	1,536.00	6,144,000	
メック	5,100	1,496.00	7,629,600	
タカラバイオ	3,200	2,095.00	6,704,000	
アース製薬	1,000	5,760.00	5,760,000	
大成ラミック	1,700	2,848.00	4,841,600	
クミアイ化学工業	9,000	898.00	8,082,000	
日本農薬	4,300	579.00	2,489,700	
日東電工	8,700	6,120.00	53,244,000	
レック	1,900	1,212.00	2,302,800	
前澤化成工業	3,800	1,160.00	4,408,000	
エフピコ	1,400	6,360.00	8,904,000	
天馬	2,700	1,986.00	5,362,200	
信越ポリマー	8,400	1,034.00	8,685,600	
ニフコ	4,800	2,858.00	13,718,400	
バルカー	1,600	2,552.00	4,083,200	
ユニ・チャーム	24,300	3,710.00	90,153,000	
協和キリン	14,300	2,653.00	37,937,900	
武田薬品工業	104,900	4,297.00	450,755,300	
アステラス製薬	110,000	1,890.50	207,955,000	
大日本住友製薬	9,300	2,023.00	18,813,900	
塩野義製薬	16,100	6,691.00	107,725,100	
あすか製薬	3,900	1,210.00	4,719,000	
日本新薬	3,300	9,900.00	32,670,000	
中外製薬	13,100	10,605.00	138,925,500	
科研製薬	2,300	5,850.00	13,455,000	
エーザイ	15,200	8,245.00	125,324,000	
ロート製薬	6,200	3,175.00	19,685,000	
小野薬品工業	29,700	2,575.50	76,492,350	
久光製薬	3,500	5,830.00	20,405,000	
持田製薬	1,800	4,220.00	7,596,000	
参天製薬	23,300	2,093.00	48,766,900	
ツムラ	3,800	3,070.00	11,666,000	
日医工	3,800	1,343.00	5,103,400	
キッセイ薬品工業	2,000	3,050.00	6,100,000	
生化学工業	4,100	1,182.00	4,846,200	

栄研化学	2,200	2,327.00	5,119,400	
鳥居薬品	1,600	3,775.00	6,040,000	
JCRファーマ	900	9,550.00	8,595,000	
東和薬品	2,100	2,592.00	5,443,200	
沢井製薬	2,400	7,250.00	17,400,000	
ゼリア新薬工業	3,000	1,997.00	5,991,000	
第一三共	36,100	7,469.00	269,630,900	
キョーリン製薬ホールディングス	2,900	2,004.00	5,811,600	
大幸薬品	2,600	4,420.00	11,492,000	
大塚ホールディングス	24,000	4,882.00	117,168,000	
大正製薬ホールディングス	2,700	7,900.00	21,330,000	
ペプチドリーム	6,400	5,390.00	34,496,000	
ニチレキ	6,100	1,344.00	8,198,400	
出光興産	14,400	2,852.00	41,068,800	
JXTGホールディングス	204,000	479.80	97,879,200	
コスモエネルギーホールディングス	3,300	2,220.00	7,326,000	
横浜ゴム	7,000	1,914.00	13,398,000	
TOYO TIRE	6,800	1,387.00	9,431,600	
ブリヂストン	38,800	3,895.00	151,126,000	
住友ゴム工業	11,000	1,202.00	13,222,000	
オカモト	800	3,850.00	3,080,000	
ニッタ	1,400	3,030.00	4,242,000	
住友理工	6,500	875.00	5,687,500	
バンドー化学	3,700	841.00	3,111,700	
日東紡績	1,800	4,975.00	8,955,000	
AGC	12,400	3,885.00	48,174,000	
日本山村硝子	3,200	1,235.00	3,952,000	
日本電気硝子	5,300	2,221.00	11,771,300	
住友大阪セメント	2,400	4,550.00	10,920,000	
太平洋セメント	7,800	3,015.00	23,517,000	
日本ヒューム	6,400	809.00	5,177,600	
東海カーボン	11,800	994.00	11,729,200	
東洋炭素	2,400	2,096.00	5,030,400	
TOTO	9,100	4,630.00	42,133,000	
日本碍子	14,800	1,902.00	28,149,600	
日本特殊陶業	10,600	2,015.00	21,359,000	
ニチアス	3,300	2,713.00	8,952,900	
ニチハ	1,800	2,510.00	4,518,000	
日本製鉄	56,300	1,584.50	89,207,350	
神戸製鋼所	22,600	526.00	11,887,600	
ジェイ エフ イー ホールディングス	33,400	1,380.00	46,092,000	
東京製鐵	6,800	827.00	5,623,600	
共英製鋼	1,600	2,060.00	3,296,000	

大和工業	2,400	2,610.00	6,264,000	
大阪製鐵	1,600	1,555.00	2,488,000	
淀川製鋼所	2,300	1,965.00	4,519,500	
丸一鋼管	4,300	3,045.00	13,093,500	
大同特殊鋼	2,100	4,355.00	9,145,500	
山陽特殊製鋼	100	1,555.00	155,500	
愛知製鋼	700	3,555.00	2,488,500	
日立金属	13,100	1,741.00	22,807,100	
大平洋金属	900	2,098.00	1,888,200	
新日本電工	16,300	159.00	2,591,700	
三菱製鋼	3,800	1,010.00	3,838,000	
シンニタン	11,500	467.00	5,370,500	
日本軽金属ホールディングス	34,900	209.00	7,294,100	
三井金属鉱業	3,200	2,631.00	8,419,200	
東邦亜鉛	1,000	1,855.00	1,855,000	
三菱マテリアル	7,900	2,812.00	22,214,800	
住友金属鉱山	16,200	3,194.00	51,742,800	
DOWAホールディングス	2,800	4,010.00	11,228,000	
古河機械金属	3,600	1,354.00	4,874,400	
UACJ	2,700	2,207.00	5,958,900	
古河電気工業	3,300	2,667.00	8,801,100	
住友電気工業	46,400	1,548.50	71,850,400	
フジクラ	13,900	402.00	5,587,800	
タツタ電線	7,200	601.00	4,327,200	
リョービ	2,600	1,813.00	4,713,800	
アサヒホールディングス	2,900	2,863.00	8,302,700	
トーカロ	3,200	1,181.00	3,779,200	
SUMCO	14,200	1,828.00	25,957,600	
東洋製罐グループホールディングス	7,700	1,886.00	14,522,200	
コロナ	3,800	1,029.00	3,910,200	
横河ブリッジホールディングス	3,400	1,893.00	6,436,200	
駒井ハルテック	1,800	1,882.00	3,387,600	
三和ホールディングス	12,300	1,202.00	14,784,600	
文化シャッター	3,300	883.00	2,913,900	
三協立山	4,900	1,399.00	6,855,100	
LIXILグループ	18,300	1,872.00	34,257,600	
ノーリツ	3,800	1,357.00	5,156,600	
長府製作所	2,200	2,310.00	5,082,000	
リンナイ	2,100	8,010.00	16,821,000	
日東精工	9,100	598.00	5,441,800	
東プレ	2,900	1,685.00	4,886,500	
高周波熱錬	7,000	860.00	6,020,000	
パイオラックス	3,000	1,991.00	5,973,000	

日本発條	12,400	918.00	11,383,200	
三益半導体工業	4,200	2,496.00	10,483,200	
日本製鋼所	3,700	2,092.00	7,740,400	
三浦工業	5,200	3,905.00	20,306,000	
タクマ	4,300	1,217.00	5,233,100	
オークマ	1,500	5,210.00	7,815,000	
東芝機械	2,400	3,365.00	8,076,000	
アマダホールディングス	16,600	1,199.00	19,903,400	
アイダエンジニアリング	6,500	908.00	5,902,000	
F U J I	4,300	1,809.00	7,778,700	
牧野フライス製作所	1,400	4,450.00	6,230,000	
オーエスジー	6,000	1,939.00	11,634,000	
旭ダイヤモンド工業	8,100	611.00	4,949,100	
D M G 森精機	7,600	1,600.00	12,160,000	
ディスコ	1,700	26,720.00	45,424,000	
日東工器	2,600	2,317.00	6,024,200	
島精機製作所	1,800	2,203.00	3,965,400	
日阪製作所	6,700	918.00	6,150,600	
ナブテスコ	7,500	3,320.00	24,900,000	
S M C	3,900	49,590.00	193,401,000	
ユニオンツール	1,800	3,180.00	5,724,000	
オイレス工業	2,400	1,562.00	3,748,800	
サトーホールディングス	1,300	3,185.00	4,140,500	
小松製作所	56,900	2,567.00	146,062,300	
住友重機械工業	6,900	2,960.00	20,424,000	
日立建機	4,800	3,170.00	15,216,000	
巴工業	2,400	2,216.00	5,318,400	
井関農機	2,800	1,476.00	4,132,800	
タカキタ	6,000	608.00	3,648,000	
クボタ	66,700	1,740.50	116,091,350	
月島機械	4,300	1,526.00	6,561,800	
帝国電機製作所	3,900	1,375.00	5,362,500	
新東工業	4,900	945.00	4,630,500	
小森コーポレーション	4,800	1,067.00	5,121,600	
鶴見製作所	3,200	1,790.00	5,728,000	
荏原製作所	5,400	3,140.00	16,956,000	
西島製作所	5,900	880.00	5,192,000	
ダイキン工業	16,000	15,780.00	252,480,000	
栗田工業	6,500	3,235.00	21,027,500	
椿本チエイン	1,500	3,555.00	5,332,500	
ダイフク	6,500	7,100.00	46,150,000	
タダノ	5,900	961.00	5,669,900	
フジテック	4,700	1,817.00	8,539,900	

C K D	4,300	1,864.00	8,015,200	
平和	3,400	2,278.00	7,745,200	
S A N K Y O	3,100	3,690.00	11,439,000	
日本金銭機械	4,300	849.00	3,650,700	
フクシマガリレイ	1,100	4,025.00	4,427,500	
竹内製作所	1,500	1,926.00	2,889,000	
アマノ	3,500	3,265.00	11,427,500	
グローリー	3,400	3,235.00	10,999,000	
大和冷機工業	5,700	1,157.00	6,594,900	
セガサミーホールディングス	12,500	1,544.00	19,300,000	
リケン	800	3,725.00	2,980,000	
ホシザキ	3,700	10,050.00	37,185,000	
大豊工業	5,800	766.00	4,442,800	
日本精工	26,300	932.00	24,511,600	
N T N	28,900	315.00	9,103,500	
ジェイテクト	12,300	1,201.00	14,772,300	
不二越	1,300	4,200.00	5,460,000	
日本トムソン	8,300	462.00	3,834,600	
T H K	7,900	2,946.00	23,273,400	
ユーシン精機	4,000	970.00	3,880,000	
キッツ	7,100	696.00	4,941,600	
マキタ	15,900	3,985.00	63,361,500	
日立造船	11,400	409.00	4,662,600	
三菱重工業	21,100	4,108.00	86,678,800	
I H I	9,600	2,734.00	26,246,400	
スター精密	3,200	1,460.00	4,672,000	
日清紡ホールディングス	6,700	988.00	6,619,600	
イビデン	7,400	2,620.00	19,388,000	
コニカミノルタ	27,700	705.00	19,528,500	
ブラザー工業	15,600	2,248.00	35,068,800	
ミネベアミツミ	23,200	2,285.00	53,012,000	
日立製作所	60,400	4,443.00	268,357,200	
三菱電機	124,800	1,561.50	194,875,200	
富士電機	8,000	3,360.00	26,880,000	
安川電機	13,800	3,895.00	53,751,000	
明電舎	3,500	2,323.00	8,130,500	
東芝テック	2,400	4,485.00	10,764,000	
マブチモーター	3,500	4,145.00	14,507,500	
日本電産	15,200	14,675.00	223,060,000	
東光高岳	3,200	1,174.00	3,756,800	
ダイヘン	2,000	3,490.00	6,980,000	
日新電機	3,300	1,338.00	4,415,400	
オムロン	11,800	6,250.00	73,750,000	

日東工業	2,500	2,398.00	5,995,000	
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,200	2,290.00	9,618,000	
メルコホールディングス	1,600	2,777.00	4,443,200	
テクノメディカ	1,800	2,056.00	3,700,800	
日本電気	15,500	5,070.00	78,585,000	
富士通	12,200	10,790.00	131,638,000	
沖電気工業	5,000	1,397.00	6,985,000	
サンケン電気	2,400	2,989.00	7,173,600	
アイホン	2,800	1,710.00	4,788,000	
ルネサスエレクトロニクス	59,600	753.00	44,878,800	
セイコーエプソン	15,700	1,628.00	25,559,600	
ワコム	5,900	414.00	2,442,600	
アルバック	2,500	4,325.00	10,812,500	
E I Z O	1,300	3,630.00	4,719,000	
日本信号	5,300	1,420.00	7,526,000	
能美防災	2,100	2,481.00	5,210,100	
ホーチキ	3,500	1,565.00	5,477,500	
パナソニック	142,600	1,110.50	158,357,300	
シャープ	11,900	1,595.00	18,980,500	
アンリツ	8,200	2,171.00	17,802,200	
富士通ゼネラル	3,900	2,527.00	9,855,300	
ソニー	79,700	7,865.00	626,840,500	
T D K	6,100	12,430.00	75,823,000	
アルプスアルパイン	11,100	2,343.00	26,007,300	
日本トリム	200	4,685.00	937,000	
フォスター電機	3,400	1,805.00	6,137,000	
ヨコオ	2,500	3,160.00	7,900,000	
ホシデン	4,200	1,323.00	5,556,600	
ヒロセ電機	1,700	14,140.00	24,038,000	
日本航空電子工業	3,500	2,163.00	7,570,500	
アイコム	2,300	2,548.00	5,860,400	
船井電機	8,300	660.00	5,478,000	
横河電機	12,800	2,000.00	25,600,000	
アズビル	8,200	3,030.00	24,846,000	
日本光電工業	5,500	3,135.00	17,242,500	
堀場製作所	2,500	7,120.00	17,800,000	
アドバンテスト	9,200	6,060.00	55,752,000	
キーエンス	11,400	39,120.00	445,968,000	
日置電機	1,300	3,955.00	5,141,500	
シスメックス	9,100	7,975.00	72,572,500	
O B A R A G R O U P	900	3,520.00	3,168,000	
コーセル	3,600	1,228.00	4,420,800	
イリソ電子工業	1,100	4,350.00	4,785,000	

オプテックスグループ	3,500	1,621.00	5,673,500	
千代田インテグレ	2,600	2,067.00	5,374,200	
レーザーテック	5,000	5,930.00	29,650,000	
スタンレー電気	8,500	2,968.00	25,228,000	
ウシオ電機	7,300	1,678.00	12,249,400	
日本セラミック	1,500	2,544.00	3,816,000	
図研	2,800	2,640.00	7,392,000	
日本電子	2,600	3,745.00	9,737,000	
カシオ計算機	10,800	2,256.00	24,364,800	
ファナック	11,900	20,000.00	238,000,000	
ローム	5,700	8,800.00	50,160,000	
浜松ホトニクス	8,900	4,735.00	42,141,500	
三井ハイテック	3,500	1,707.00	5,974,500	
新光電気工業	6,400	1,325.00	8,480,000	
京セラ	17,700	7,612.00	134,732,400	
太陽誘電	5,200	3,450.00	17,940,000	
村田製作所	37,000	6,591.00	243,867,000	
双葉電子工業	3,000	1,308.00	3,924,000	
ニチコン	5,100	1,041.00	5,309,100	
日本ケミコン	1,700	1,796.00	3,053,200	
K O A	3,300	1,345.00	4,438,500	
小糸製作所	7,600	4,815.00	36,594,000	
ミツバ	7,800	677.00	5,280,600	
S C R E E Nホールディングス	2,200	7,700.00	16,940,000	
キヤノン電子	2,800	2,151.00	6,022,800	
キヤノン	67,300	3,028.00	203,784,400	
リコー	33,700	1,269.00	42,765,300	
象印マホービン	3,500	2,201.00	7,703,500	
東京エレクトロン	8,400	24,490.00	205,716,000	
トヨタ紡織	4,000	1,642.00	6,568,000	
ユニプレス	2,300	1,421.00	3,268,300	
豊田自動織機	10,100	6,280.00	63,428,000	
モリタホールディングス	2,800	1,738.00	4,866,400	
デンソー	27,700	4,651.00	128,832,700	
東海理化電機製作所	3,100	1,980.00	6,138,000	
川崎重工業	9,700	2,255.00	21,873,500	
日産自動車	146,300	597.70	87,443,510	
いすゞ自動車	39,900	1,130.50	45,106,950	
トヨタ自動車	141,200	7,752.00	1,094,582,400	70,000株
日野自動車	15,200	1,072.00	16,294,400	
三菱自動車工業	46,100	419.00	19,315,900	
武蔵精密工業	3,200	1,337.00	4,278,400	
日産車体	6,500	1,024.00	6,656,000	

新明和工業	5,300	1,468.00	7,780,400	
極東開発工業	3,200	1,516.00	4,851,200	
日信工業	3,900	2,232.00	8,704,800	
トピー工業	1,300	1,812.00	2,355,600	
ティラド	2,400	1,881.00	4,514,400	
NOK	6,400	1,520.00	9,728,000	
フタバ産業	7,000	691.00	4,837,000	
KYB	1,800	2,998.00	5,396,400	
プレス工業	11,800	378.00	4,460,400	
ケーヒン	3,000	2,579.00	7,737,000	
アイシン精機	10,400	3,715.00	38,636,000	
マツダ	38,500	930.00	35,805,000	
今仙電機製作所	6,000	908.00	5,448,000	
本田技研工業	99,300	2,910.50	289,012,650	
スズキ	25,000	4,800.00	120,000,000	
SUBARU	39,000	2,765.00	107,835,000	
ヤマハ発動機	16,500	2,090.00	34,485,000	
ショーワ	3,600	2,281.00	8,211,600	
エクセディ	2,800	2,240.00	6,272,000	
豊田合成	3,900	2,571.00	10,026,900	
愛三工業	7,200	725.00	5,220,000	
ヨロズ	3,000	1,437.00	4,311,000	
エフ・シー・シー	2,400	2,275.00	5,460,000	
シマノ	4,800	16,920.00	81,216,000	
テイ・エス テック	2,800	3,115.00	8,722,000	
テルモ	35,600	3,939.00	140,228,400	
クリエートメディック	4,400	1,071.00	4,712,400	
島津製作所	15,200	3,200.00	48,640,000	
ブイ・テクノロジー	900	5,040.00	4,536,000	
東京精密	2,100	4,260.00	8,946,000	
マニー	4,800	2,950.00	14,160,000	
ニコン	22,200	1,362.00	30,236,400	
トプコン	6,300	1,616.00	10,180,800	
オリンパス	69,600	1,785.00	124,236,000	
理研計器	2,200	2,161.00	4,754,200	
タムロン	1,800	2,421.00	4,357,800	
HOYA	25,400	11,010.00	279,654,000	
朝日インテック	10,500	3,085.00	32,392,500	
シチズン時計	14,600	547.00	7,986,200	
メニコン	1,600	5,100.00	8,160,000	
セイコーホールディングス	2,200	2,853.00	6,276,600	
ニプロ	8,500	1,260.00	10,710,000	
パラマウントベッドホールディングス	1,300	4,575.00	5,947,500	

バンダイナムコホールディングス	13,000	6,409.00	83,317,000	
アイフィスジャパン	6,100	717.00	4,373,700	
パイロットコーポレーション	2,000	4,275.00	8,550,000	
トッパン・フォームズ	6,000	1,256.00	7,536,000	
フジシールインターナショナル	2,700	2,330.00	6,291,000	
タカラトミー	5,600	1,227.00	6,871,200	
タカノ	4,900	795.00	3,895,500	
大建工業	2,600	1,863.00	4,843,800	
凸版印刷	18,100	2,243.00	40,598,300	
大日本印刷	16,800	3,020.00	50,736,000	
N I S S H A	1,900	1,036.00	1,968,400	
アシックス	12,300	1,653.00	20,331,900	
小松ウオール工業	2,200	2,178.00	4,791,600	
ヤマハ	7,500	6,020.00	45,150,000	
クリナップ	6,800	684.00	4,651,200	
ビジョン	7,600	3,715.00	28,234,000	
キングジム	5,800	855.00	4,959,000	
リンテック	2,600	2,409.00	6,263,400	
イトーキ	9,700	480.00	4,656,000	
任天堂	7,700	42,400.00	326,480,000	
三菱鉛筆	3,100	1,602.00	4,966,200	
タカラスタンド	3,200	1,908.00	6,105,600	
コクヨ	5,600	1,630.00	9,128,000	
オカムラ	4,500	1,079.00	4,855,500	
美津濃	2,500	2,630.00	6,575,000	
東京電力ホールディングス	99,800	429.00	42,814,200	
中部電力	38,300	1,459.00	55,879,700	
関西電力	50,300	1,214.50	61,089,350	
中国電力	17,200	1,404.00	24,148,800	
北陸電力	12,400	813.00	10,081,200	
東北電力	29,500	1,000.00	29,500,000	
四国電力	11,400	944.00	10,761,600	
九州電力	25,800	881.00	22,729,800	
北海道電力	12,200	498.00	6,075,600	
沖縄電力	2,300	2,014.00	4,632,200	
電源開発	9,900	2,504.00	24,789,600	
東京瓦斯	24,400	2,460.00	60,024,000	
大阪瓦斯	24,300	1,917.00	46,583,100	
東邦瓦斯	6,000	4,265.00	25,590,000	
北海道瓦斯	3,500	1,616.00	5,656,000	
西部瓦斯	2,300	2,365.00	5,439,500	
静岡ガス	5,900	893.00	5,268,700	
東武鉄道	13,200	3,875.00	51,150,000	

相鉄ホールディングス	4,200	2,950.00	12,390,000	
東急	32,800	1,939.00	63,599,200	
京浜急行電鉄	16,400	2,013.00	33,013,200	
小田急電鉄	19,200	2,402.00	46,118,400	
京王電鉄	6,500	6,290.00	40,885,000	
京成電鉄	8,900	4,070.00	36,223,000	
富士急行	1,800	3,930.00	7,074,000	
東日本旅客鉄道	22,200	9,910.00	220,002,000	
西日本旅客鉄道	11,300	9,316.00	105,270,800	
東海旅客鉄道	10,500	21,895.00	229,897,500	
西武ホールディングス	16,500	1,694.00	27,951,000	
西日本鉄道	3,200	2,519.00	8,060,800	
近鉄グループホールディングス	11,900	5,850.00	69,615,000	
阪急阪神ホールディングス	15,900	4,500.00	71,550,000	
南海電気鉄道	5,100	2,892.00	14,749,200	
京阪ホールディングス	5,300	5,090.00	26,977,000	
名古屋鉄道	9,800	3,270.00	32,046,000	
日本通運	4,600	6,380.00	29,348,000	
ヤマトホールディングス	20,700	1,753.00	36,287,100	
山九	3,400	5,480.00	18,632,000	
丸運	16,700	353.00	5,895,100	
センコーグループホールディングス	7,200	904.00	6,508,800	
トナミホールディングス	800	5,000.00	4,000,000	
ニッコンホールディングス	4,300	2,595.00	11,158,500	
日本石油輸送	1,100	2,898.00	3,187,800	
福山通運	1,500	3,730.00	5,595,000	
セイノーホールディングス	8,800	1,446.00	12,724,800	
日立物流	2,600	3,145.00	8,177,000	
C & F ロジホールディングス	4,000	1,351.00	5,404,000	
九州旅客鉄道	10,500	3,595.00	37,747,500	
S Gホールディングス	11,900	2,371.00	28,214,900	
日本郵船	10,000	1,804.00	18,040,000	
商船三井	6,900	2,740.00	18,906,000	
川崎汽船	4,600	1,536.00	7,065,600	
飯野海運	11,700	347.00	4,059,900	
日本航空	21,800	3,134.00	68,321,200	
A N Aホールディングス	21,800	3,441.00	75,013,800	
三菱倉庫	3,900	2,780.00	10,842,000	
三井倉庫ホールディングス	2,300	1,901.00	4,372,300	
住友倉庫	4,200	1,462.00	6,140,400	
東陽倉庫	15,400	321.00	4,943,400	
安田倉庫	5,800	1,044.00	6,055,200	
上組	7,300	2,361.00	17,235,300	

キムラユニティー	3,900	1,126.00	4,391,400	
キューソー流通システム	1,800	1,925.00	3,465,000	
近鉄エクスプレス	3,700	1,907.00	7,055,900	
エーアイティー	5,100	1,001.00	5,105,100	
NEC ネットエスアイ	2,600	4,295.00	11,167,000	
システナ	4,700	1,917.00	9,009,900	
デジタルアーツ	700	5,470.00	3,829,000	
日鉄ソリューションズ	1,600	3,345.00	5,352,000	
T I S	4,100	6,640.00	27,224,000	
ネオス	600	772.00	463,200	
電算システム	900	2,964.00	2,667,600	
グリー	9,200	463.00	4,259,600	
コーエーテクモホールディングス	3,000	2,780.00	8,340,000	
ブレインパッド	300	6,350.00	1,905,000	
K L a b	3,100	813.00	2,520,300	
ネクソン	34,900	1,486.00	51,861,400	
エイチーム	900	1,011.00	909,900	
コロプラ	4,400	1,133.00	4,985,200	
サイバーリンクス	2,800	1,205.00	3,374,000	
CARTA HOLDINGS	300	1,046.00	313,800	
ティーガイア	2,200	2,720.00	5,984,000	
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,000	2,114.00	6,342,000	
GMOペイメントゲートウェイ	1,900	7,310.00	13,889,000	
ザッパラス	11,000	404.00	4,444,000	
インターネットイニシアティブ	2,400	3,080.00	7,392,000	
L I N E	3,700	5,360.00	19,832,000	
フェイス	3,000	775.00	2,325,000	
野村総合研究所	20,900	2,380.00	49,742,000	
CEホールディングス	3,800	499.00	1,896,200	
インテージホールディングス	5,500	875.00	4,812,500	
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,690.00	4,732,000	
フジ・メディア・ホールディングス	13,000	1,538.00	19,994,000	
オービック	4,300	15,500.00	66,650,000	
ジャストシステム	2,100	6,240.00	13,104,000	
Zホールディングス	172,000	443.00	76,196,000	
トレンドマイクロ	5,400	5,780.00	31,212,000	
日本オラクル	2,400	9,690.00	23,256,000	
フューチャー	4,400	1,983.00	8,725,200	
CAC Holdings	3,600	1,489.00	5,360,400	
SBテクノロジー	2,000	2,190.00	4,380,000	
オービックビジネスコンサルタント	1,200	4,920.00	5,904,000	
伊藤忠テクノソリューションズ	5,500	3,310.00	18,205,000	

大塚商会	6,600	4,545.00	29,997,000	
サイボウズ	1,100	1,890.00	2,079,000	
電通国際情報サービス	2,500	4,720.00	11,800,000	
デジタルガレージ	2,300	4,215.00	9,694,500	
ウェザーニューズ	1,400	3,855.00	5,397,000	
日本エンタープライズ	100	234.00	23,400	
ネットワンシステムズ	4,300	1,672.00	7,189,600	
アルゴグラフィックス	2,600	3,400.00	8,840,000	
エイベックス	4,000	1,221.00	4,884,000	
日本ユニシス	3,800	3,355.00	12,749,000	
兼松エレクトロニクス	1,500	3,555.00	5,332,500	
東京放送ホールディングス	8,000	1,868.00	14,944,000	
日本テレビホールディングス	11,500	1,474.00	16,951,000	
テレビ朝日ホールディングス	3,200	2,096.00	6,707,200	
スカパーJ S A Tホールディングス	9,900	476.00	4,712,400	
テレビ東京ホールディングス	1,000	2,358.00	2,358,000	
日本電信電話	165,400	2,796.50	462,541,100	
K D D I	92,200	3,266.00	301,125,200	
ソフトバンク	112,100	1,478.50	165,739,850	
光通信	1,300	27,140.00	35,282,000	
N T T ドコモ	91,400	3,116.00	284,802,400	
G M O インターネット	4,800	2,172.00	10,425,600	
K A D O K A W A	3,800	1,941.00	7,375,800	
ゼンリン	2,700	1,657.00	4,473,900	
松竹	700	14,980.00	10,486,000	
東宝	7,500	4,145.00	31,087,500	
東映	500	15,230.00	7,615,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	32,700	1,547.00	50,586,900	
ビジネスブレイン太田昭和	1,400	2,506.00	3,508,400	
D T S	2,900	2,588.00	7,505,200	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,700	5,520.00	31,464,000	
カプコン	5,300	3,010.00	15,953,000	
S C S K	3,300	5,970.00	19,701,000	
アイネス	6,100	1,468.00	8,954,800	
T K C	2,100	5,370.00	11,277,000	
富士ソフト	1,900	4,350.00	8,265,000	
N S D	3,800	1,791.00	6,805,800	
コナミホールディングス	5,100	4,505.00	22,975,500	
ソフトバンクグループ	97,700	4,575.00	446,977,500	
伊藤忠食品	1,000	5,110.00	5,110,000	
エレマテック	4,800	1,175.00	5,640,000	
J A L U X	2,000	2,364.00	4,728,000	
双日	69,700	350.00	24,395,000	

アルフレッサ ホールディングス	13,600	2,230.00	30,328,000	
横浜冷凍	5,800	959.00	5,562,200	
神戸物産	4,200	4,295.00	18,039,000	
あい ホールディングス	3,200	1,905.00	6,096,000	
ダイワボウホールディングス	1,000	6,690.00	6,690,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,900	1,750.00	6,825,000	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	3,900	1,037.00	4,044,300	
レスターホールディングス	2,600	1,892.00	4,919,200	
OCHIホールディングス	3,100	1,470.00	4,557,000	
TOKAIホールディングス	6,900	1,065.00	7,348,500	
シップヘルスケアホールディングス	2,600	5,030.00	13,078,000	
明治電機工業	2,800	1,557.00	4,359,600	
コマダホールディングス	2,800	2,201.00	6,162,800	
エコートレーディング	8,000	571.00	4,568,000	
ナガイレーベン	1,800	2,367.00	4,260,600	
三菱食品	2,200	3,135.00	6,897,000	
松田産業	3,600	1,578.00	5,680,800	
第一興商	1,800	5,470.00	9,846,000	
メディパルホールディングス	13,300	2,376.00	31,600,800	
アズワン	800	10,160.00	8,128,000	
尾家産業	3,200	1,370.00	4,384,000	
ドウシシャ	3,200	1,670.00	5,344,000	
丸文	6,300	606.00	3,817,800	
橋本総業ホールディングス	2,700	1,808.00	4,881,600	
日本ライフライン	3,700	1,355.00	5,013,500	
進和	2,500	2,236.00	5,590,000	
オーハシテクニカ	3,100	1,545.00	4,789,500	
白銅	2,400	1,435.00	3,444,000	
伊藤忠商事	86,100	2,610.00	224,721,000	
丸紅	128,900	801.90	103,364,910	
長瀬産業	7,200	1,564.00	11,260,800	
豊田通商	13,700	3,845.00	52,676,500	
兼松	5,100	1,427.00	7,277,700	
三井物産	109,300	1,957.00	213,900,100	
日本紙パルプ商事	1,200	3,985.00	4,782,000	
日立ハイテクノロジーズ	3,700	7,840.00	29,008,000	
山善	5,400	1,046.00	5,648,400	
住友商事	78,200	1,646.00	128,717,200	
内田洋行	1,100	7,180.00	7,898,000	
三菱商事	86,700	2,847.50	246,878,250	
キヤノンマーケティングジャパン	3,100	2,566.00	7,954,600	
西華産業	3,900	1,294.00	5,046,600	
菱洋エレクトロ	3,200	2,047.00	6,550,400	

東京産業	2,400	643.00	1,543,200	
阪和興業	2,000	2,700.00	5,400,000	
岩谷産業	2,700	3,675.00	9,922,500	
イワキ	300	535.00	160,500	
三愛石油	5,800	1,101.00	6,385,800	
稲畑産業	3,900	1,547.00	6,033,300	
ワキタ	5,500	1,041.00	5,725,500	
東邦ホールディングス	3,400	2,314.00	7,867,600	
サンゲツ	3,900	1,977.00	7,710,300	
シナネンホールディングス	2,800	1,973.00	5,524,400	
伊藤忠エネクス	5,700	915.00	5,215,500	
サンリオ	3,700	2,152.00	7,962,400	
リョーサン	2,000	2,627.00	5,254,000	
三信電気	2,300	1,747.00	4,018,100	
モスフードサービス	2,200	2,960.00	6,512,000	
加賀電子	2,900	2,392.00	6,936,800	
立花エレテック	3,300	1,804.00	5,953,200	
フォーバル	5,500	1,091.00	6,000,500	
PALTA C	2,100	5,060.00	10,626,000	
日鉄物産	1,300	5,020.00	6,526,000	
トラスコ中山	2,500	2,595.00	6,487,500	
オートバックスセブン	4,600	1,612.00	7,415,200	
加藤産業	1,800	3,380.00	6,084,000	
イノテック	5,000	1,207.00	6,035,000	
杉本商事	2,900	1,985.00	5,756,500	
因幡電機産業	3,400	2,764.00	9,397,600	
ミスミグループ本社	15,400	2,918.00	44,937,200	
スズケン	5,600	4,275.00	23,940,000	
ジェコス	5,300	1,084.00	5,745,200	
ローソン	3,000	6,470.00	19,410,000	
サンエー	1,100	4,550.00	5,005,000	
エービーシー・マート	2,000	6,950.00	13,900,000	
ハードオフコーポレーション	4,500	827.00	3,721,500	
アスクル	2,400	3,545.00	8,508,000	
ゲオホールディングス	2,900	1,255.00	3,639,500	
アダストリア	1,900	2,193.00	4,166,700	
ジーフット	5,200	620.00	3,224,000	
エディオン	5,300	1,147.00	6,079,100	
あみやき亭	1,600	3,640.00	5,824,000	
ハニーズホールディングス	200	1,381.00	276,200	
ジンスホールディングス	900	7,630.00	6,867,000	
ビックカメラ	6,800	1,206.00	8,200,800	
D C Mホールディングス	6,600	1,031.00	6,804,600	

MonotaRO	8,400	2,650.00	22,260,000	
J.フロント リテイリング	15,900	1,364.00	21,687,600	
ドトール・日レスホールディングス	2,900	2,084.00	6,043,600	
マツモトキヨシホールディングス	5,100	4,275.00	21,802,500	
ZOZO	8,900	1,798.00	16,002,200	
トレジャー・ファクトリー	100	891.00	89,100	
ココカラファイン	1,200	6,510.00	7,812,000	
三越伊勢丹ホールディングス	23,200	912.00	21,158,400	
ウエルシアホールディングス	3,200	6,340.00	20,288,000	
クリエイトSDホールディングス	1,900	2,837.00	5,390,300	
シュッピン	4,100	1,148.00	4,706,800	
ジョイフル本田	3,600	1,253.00	4,510,800	
すかいらーくホールディングス	13,700	2,035.00	27,879,500	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	3,900	966.00	3,767,400	
ゴルフダイジェスト・オンライン	6,700	649.00	4,348,300	
あさひ	2,600	1,320.00	3,432,000	
コスモス薬品	600	23,890.00	14,334,000	
トーエル	3,600	789.00	2,840,400	
セブン&アイ・ホールディングス	48,500	4,206.00	203,991,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	3,500	2,352.00	8,232,000	
ツルハホールディングス	2,700	13,350.00	36,045,000	
サンマルクホールディングス	2,300	2,321.00	5,338,300	
トリドールホールディングス	2,000	2,633.00	5,266,000	
クスリのアオキホールディングス	1,200	6,390.00	7,668,000	
スシローグローバルホールディングス	1,200	9,810.00	11,772,000	
カッパ・クリエイト	4,800	1,497.00	7,185,600	
ライトオン	200	590.00	118,000	
良品計画	16,800	1,893.00	31,802,400	
三城ホールディングス	9,000	306.00	2,754,000	
アドヴァン	3,900	1,298.00	5,062,200	
G-7ホールディングス	3,200	2,694.00	8,620,800	
エコス	2,100	1,698.00	3,565,800	
マルシェ	5,300	781.00	4,139,300	
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	29,600	1,735.00	51,356,000	
西松屋チェーン	4,200	940.00	3,948,000	
ゼンショーホールディングス	5,700	2,423.00	13,811,100	
サイゼリヤ	3,400	2,454.00	8,343,600	
魚力	2,900	1,581.00	4,584,900	
ユナイテッドアローズ	1,500	2,925.00	4,387,500	
ハイデイ日高	2,500	2,004.00	5,010,000	
京都きもの友禅	4,900	341.00	1,670,900	

コロワイド	3,800	2,315.00	8,797,000	
吉番屋	1,300	5,930.00	7,709,000	
スギホールディングス	2,600	5,520.00	14,352,000	
薬王堂ホールディングス	1,400	2,169.00	3,036,600	
スクロール	6,600	358.00	2,362,800	
ファミリーマート	9,800	2,438.00	23,892,400	
木曽路	2,700	3,015.00	8,140,500	
千趣会	12,800	448.00	5,734,400	
ケーヨー	11,000	545.00	5,995,000	
上新電機	2,000	2,390.00	4,780,000	
日本瓦斯	2,000	3,410.00	6,820,000	
ロイヤルホールディングス	2,300	2,395.00	5,508,500	
いなげや	3,600	1,439.00	5,180,400	
島忠	2,500	3,065.00	7,662,500	
チヨダ	1,900	1,461.00	2,775,900	
ライフコーポレーション	1,600	2,423.00	3,876,800	
AOKIホールディングス	2,500	1,071.00	2,677,500	
コメリ	2,000	2,134.00	4,268,000	
青山商事	2,200	1,410.00	3,102,000	
しまむら	1,300	7,980.00	10,374,000	
高島屋	9,600	1,211.00	11,625,600	
松屋	3,500	744.00	2,604,000	
エイチ・ツー・オー リテイリング	6,000	1,105.00	6,630,000	
バルコ	4,500	1,848.00	8,316,000	
丸井グループ	10,100	2,579.00	26,047,900	
アクシアル リテイリング	800	3,650.00	2,920,000	
イオン	47,700	2,252.00	107,420,400	
イズミ	2,300	3,505.00	8,061,500	
平和堂	3,100	1,952.00	6,051,200	
フジ	2,300	1,821.00	4,188,300	
ヤオコー	1,300	5,620.00	7,306,000	
ゼビオホールディングス	4,200	1,180.00	4,956,000	
ケーズホールディングス	12,300	1,337.00	16,445,100	
Genky DrugStores	1,400	2,006.00	2,808,400	
ブックオフグループホールディングス	1,700	1,014.00	1,723,800	
アインホールディングス	1,800	6,290.00	11,322,000	
ヤマダ電機	37,500	552.00	20,700,000	
ニトリホールディングス	5,400	17,015.00	91,881,000	
吉野家ホールディングス	4,200	2,599.00	10,915,800	
王将フードサービス	900	6,530.00	5,877,000	
プレナス	3,200	1,989.00	6,364,800	
ミニストップ	2,600	1,572.00	4,087,200	
アークス	2,200	1,969.00	4,331,800	

パローホールディングス	2,400	1,930.00	4,632,000	
ファーストリテイリング	1,700	58,460.00	99,382,000	
サンドラッグ	4,400	3,735.00	16,434,000	
ヤマザワ	2,400	1,691.00	4,058,400	
ベルーナ	4,900	652.00	3,194,800	
めぶきフィナンシャルグループ	64,700	244.00	15,786,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	2,600	1,299.00	3,377,400	
九州フィナンシャルグループ	19,700	456.00	8,983,200	
ゆうちょ銀行	34,900	1,011.00	35,283,900	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	76,900	420.00	32,298,000	
西日本フィナンシャルホールディングス	7,300	735.00	5,365,500	
関西みらいフィナンシャルグループ	5,200	641.00	3,333,200	
三十三フィナンシャルグループ	2,100	1,606.00	3,372,600	
第四北越フィナンシャルグループ	2,100	2,665.00	5,596,500	
新生銀行	9,000	1,645.00	14,805,000	
あおぞら銀行	6,600	2,864.00	18,902,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	846,300	566.50	479,428,950	300,000株
りそなホールディングス	134,500	459.70	61,829,650	
三井住友トラスト・ホールディングス	23,700	4,088.00	96,885,600	
三井住友フィナンシャルグループ	86,900	3,871.00	336,389,900	
千葉銀行	41,500	606.00	25,149,000	
群馬銀行	25,500	350.00	8,925,000	
武蔵野銀行	2,800	1,717.00	4,807,600	
千葉興業銀行	11,600	353.00	4,094,800	
七十七銀行	3,300	1,645.00	5,428,500	
青森銀行	500	2,693.00	1,346,500	
秋田銀行	1,300	2,025.00	2,632,500	
山形銀行	1,800	1,403.00	2,525,400	
岩手銀行	1,100	2,592.00	2,851,200	
東邦銀行	12,200	251.00	3,062,200	
東北銀行	900	1,013.00	911,700	
ふくおかフィナンシャルグループ	10,600	1,936.00	20,521,600	
静岡銀行	30,900	766.00	23,669,400	
十六銀行	2,800	2,268.00	6,350,400	
スルガ銀行	12,700	427.00	5,422,900	
八十二銀行	27,600	416.00	11,481,600	
山梨中央銀行	1,900	1,016.00	1,930,400	
大垣共立銀行	2,500	2,249.00	5,622,500	
福井銀行	2,100	1,649.00	3,462,900	
北國銀行	2,300	3,165.00	7,279,500	
滋賀銀行	2,400	2,594.00	6,225,600	
南都銀行	1,600	2,653.00	4,244,800	

百五銀行	13,000	329.00	4,277,000	
京都銀行	4,300	4,515.00	19,414,500	
紀陽銀行	4,100	1,568.00	6,428,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	7,800	1,056.00	8,236,800	
広島銀行	18,000	489.00	8,802,000	
山陰合同銀行	6,300	609.00	3,836,700	
中国銀行	9,800	1,020.00	9,996,000	
鳥取銀行	900	1,336.00	1,202,400	
伊予銀行	16,100	562.00	9,048,200	
百十四銀行	2,200	1,964.00	4,320,800	
四国銀行	2,700	947.00	2,556,900	
阿波銀行	1,800	2,282.00	4,107,600	
大分銀行	600	2,557.00	1,534,200	
宮崎銀行	1,100	2,423.00	2,665,300	
佐賀銀行	2,400	1,562.00	3,748,800	
沖縄銀行	1,400	3,470.00	4,858,000	
琉球銀行	3,200	1,067.00	3,414,400	
セブン銀行	42,700	328.00	14,005,600	
みずほフィナンシャルグループ	1,683,800	162.10	272,943,980	
山口フィナンシャルグループ	15,200	658.00	10,001,600	
長野銀行	900	1,592.00	1,432,800	
名古屋銀行	1,200	3,295.00	3,954,000	
北洋銀行	19,000	220.00	4,180,000	
中京銀行	1,800	2,210.00	3,978,000	
愛媛銀行	3,000	1,117.00	3,351,000	
トマト銀行	1,700	1,038.00	1,764,600	
京葉銀行	6,400	583.00	3,731,200	
栃木銀行	11,700	207.00	2,421,900	
トモニホールディングス	10,300	372.00	3,831,600	
フィデアホールディングス	20,800	127.00	2,641,600	
池田泉州ホールディングス	9,500	199.00	1,890,500	
F P G	5,700	1,026.00	5,848,200	
S B Iホールディングス	14,100	2,395.00	33,769,500	
ジャフコ	1,800	4,555.00	8,199,000	
大和証券グループ本社	98,200	556.00	54,599,200	
野村ホールディングス	215,700	560.00	120,792,000	
岡三証券グループ	11,000	380.00	4,180,000	
丸三証券	5,100	503.00	2,565,300	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	11,900	339.00	4,034,100	
水戸証券	9,600	223.00	2,140,800	
いちよし証券	4,000	615.00	2,460,000	
松井証券	5,800	877.00	5,086,600	
だいこう証券ビジネス	7,500	698.00	5,235,000	

マネックスグループ	7,900	270.00	2,133,000	
極東証券	3,600	738.00	2,656,800	
藍澤証券	4,900	733.00	3,591,700	
かんぽ生命保険	4,500	1,902.00	8,559,000	
S O M P Oホールディングス	23,400	4,197.00	98,209,800	
M S & A D インシュアランスグループ ホールディングス	32,500	3,639.00	118,267,500	
ソニーフィナンシャルホールディング ス	10,000	2,569.00	25,690,000	
第一生命ホールディングス	69,900	1,654.00	115,614,600	
東京海上ホールディングス	44,500	5,999.00	266,955,500	
T & Dホールディングス	38,100	1,200.00	45,720,000	
全国保証	3,300	4,700.00	15,510,000	
クレディセゾン	8,300	1,851.00	15,363,300	
芙蓉総合リース	1,400	6,980.00	9,772,000	
みずほリース	2,200	3,295.00	7,249,000	
東京センチュリー	2,500	5,630.00	14,075,000	
日本証券金融	7,500	510.00	3,825,000	
アイフル	21,000	306.00	6,426,000	
リコーリース	1,500	4,380.00	6,570,000	
イオンフィナンシャルサービス	8,100	1,680.00	13,608,000	
アコム	25,600	527.00	13,491,200	
オリエントコーポレーション	31,500	171.00	5,386,500	
日立キャピタル	2,800	2,990.00	8,372,000	
オリックス	77,600	1,868.00	144,956,800	
三菱UFJリース	27,800	698.00	19,404,400	
日本取引所グループ	37,200	2,002.00	74,474,400	
アサックス	7,200	711.00	5,119,200	
NECキャピタルソリューション	1,500	2,789.00	4,183,500	
いちご	18,300	427.00	7,814,100	
ヒューリック	26,200	1,332.00	34,898,400	
野村不動産ホールディングス	8,200	2,793.00	22,902,600	
ユニゾホールディングス	1,600	5,160.00	8,256,000	
オープンハウス	3,300	2,919.00	9,632,700	
東急不動産ホールディングス	32,400	769.00	24,915,600	
飯田グループホールディングス	10,100	1,934.00	19,533,400	
パーク24	7,100	2,718.00	19,297,800	
三井不動産	62,000	2,858.50	177,227,000	
三菱地所	86,200	2,262.50	195,027,500	
平和不動産	2,800	3,200.00	8,960,000	
東京建物	13,800	1,754.00	24,205,200	
ダイビル	5,500	1,372.00	7,546,000	
京阪神ビルディング	5,700	1,488.00	8,481,600	
住友不動産	27,900	3,963.00	110,567,700	

テーオーシー	8,400	913.00	7,669,200	
スターツコーポレーション	1,900	2,746.00	5,217,400	
空港施設	7,200	545.00	3,924,000	
ゴールドクレスト	3,400	2,020.00	6,868,000	
エスリード	3,500	2,049.00	7,171,500	
A V A N T I A	5,000	998.00	4,990,000	
イオンモール	6,400	1,865.00	11,936,000	
カチタス	1,700	4,555.00	7,743,500	
日本空港ビルデング	3,900	4,970.00	19,383,000	
日本M&Aセンター	9,000	3,955.00	35,595,000	
パソナグループ	3,300	1,543.00	5,091,900	
G C A	4,400	936.00	4,118,400	
エス・エム・エス	4,300	2,819.00	12,121,700	
パーソルホールディングス	12,100	1,999.00	24,187,900	
クックパッド	11,700	339.00	3,966,300	
学情	900	2,246.00	2,021,400	
スタジオアリス	1,700	1,916.00	3,257,200	
シミックホールディングス	1,700	1,742.00	2,961,400	
N J S	2,500	1,797.00	4,492,500	
総合警備保障	4,700	5,920.00	27,824,000	
カカクコム	8,900	2,920.00	25,988,000	
アイロムグループ	1,500	1,353.00	2,029,500	
ディップ	3,900	3,550.00	13,845,000	
キャリアデザインセンター	2,500	1,311.00	3,277,500	
ベネフィット・ワン	3,100	2,180.00	6,758,000	
エムスリー	26,100	3,170.00	82,737,000	
アウトソーシング	6,500	1,037.00	6,740,500	
ディー・エヌ・エー	6,200	1,805.00	11,191,000	
博報堂D Yホールディングス	16,700	1,608.00	26,853,600	
ぐるなび	200	938.00	187,600	
ファンコミュニケーションズ	10,700	448.00	4,793,600	
W D Bホールディングス	2,300	2,716.00	6,246,800	
インフォマート	12,200	908.00	11,077,600	
E P Sホールディングス	3,000	1,388.00	4,164,000	
クイック	1,700	1,592.00	2,706,400	
ケネディクス	11,400	554.00	6,315,600	
電通グループ	12,300	3,660.00	45,018,000	
みらかホールディングス	3,300	2,883.00	9,513,900	
ダイオーズ	3,800	1,346.00	5,114,800	
日本空調サービス	7,600	790.00	6,004,000	
オリエンタルランド	12,900	14,500.00	187,050,000	
ダスキン	3,000	3,060.00	9,180,000	
ラウンドワン	4,000	1,044.00	4,176,000	

リゾートトラスト	4,800	1,730.00	8,304,000	
ビー・エム・エル	2,000	3,055.00	6,110,000	
りらいあコミュニケーションズ	5,200	1,478.00	7,685,600	
リソー教育	7,600	348.00	2,644,800	
早稲田アカデミー	5,000	1,159.00	5,795,000	
ユー・エス・エス	14,800	1,960.00	29,008,000	
サイバーエージェント	6,800	3,820.00	25,976,000	
楽天	55,700	875.00	48,737,500	
テー・オー・ダブリュー	6,700	997.00	6,679,900	
エン・ジャパン	1,800	4,375.00	7,875,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,400	7,450.00	17,880,000	
インターワークス	4,000	542.00	2,168,000	
ジャパンマテリアル	3,600	1,703.00	6,130,800	
キャリアリンク	100	618.00	61,800	
ライドオンエクスプレスホールディングス	2,800	2,026.00	5,672,800	
リクルートホールディングス	86,000	4,394.00	377,884,000	
エラン	400	1,694.00	677,600	
日本郵政	97,400	1,006.00	97,984,400	
MS - J a p a n	900	1,450.00	1,305,000	
リログループ	6,700	3,055.00	20,468,500	
エイチ・アイ・エス	2,000	2,548.00	5,096,000	
共立メンテナンス	1,800	4,345.00	7,821,000	
建設技術研究所	3,500	2,459.00	8,606,500	
よみうりランド	1,000	4,360.00	4,360,000	
東京都競馬	1,500	3,185.00	4,777,500	
カナモト	2,000	2,736.00	5,472,000	
東京ドーム	6,400	1,053.00	6,739,200	
トランス・コスモス	3,400	2,814.00	9,567,600	
乃村工藝社	5,700	1,285.00	7,324,500	
日本管財	1,700	1,949.00	3,313,300	
白洋舎	1,500	2,816.00	4,224,000	
セコム	12,800	9,755.00	124,864,000	
セントラル警備保障	900	6,000.00	5,400,000	
メイテック	1,500	6,360.00	9,540,000	
応用地質	5,100	1,411.00	7,196,100	
船井総研ホールディングス	2,300	2,728.00	6,274,400	
ベネッセホールディングス	4,200	3,045.00	12,789,000	
イオンディライト	1,500	3,720.00	5,580,000	
ニチイ学館	4,900	1,521.00	7,452,900	
ダイセキ	2,000	2,975.00	5,950,000	
ステップ	3,000	1,573.00	4,719,000	
合 計	14,735,700		30,248,893,330	

(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

		[2020年 1月27日現在]
区 分	注記 番号	金額（円）
資産の部		
流動資産		
預金		25,547,929
コール・ローン		95,927,941
国債証券		4,915,441,149
未収利息		37,622,147
前払費用		3,400,092
流動資産合計		5,077,939,258
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		513,220
未払金		59,651,438
未払解約金		18,442,850
未払利息		55
流動負債合計		78,607,563
負債合計		
78,607,563		
純資産の部		
元本等		
元本	1	3,109,800,387
剰余金		
剰余金又は欠損金（ ）		1,889,531,308
元本等合計		
4,999,331,695		
純資産合計		
4,999,331,695		
負債純資産合計		
5,077,939,258		

(2) 注記表
(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日

1. 有価証券の評価基準及び評価方法	<p>国債証券</p> <p>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。</p>
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	<p>為替予約取引</p> <p>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。</p>
3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 1月27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	2,752,492,127円
同期中における追加設定元本額	583,078,394円
同期中における一部解約元本額	225,770,134円
同期末における元本額	3,109,800,387円
元本の内訳*	
L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)	5,695,625円
L P S 4 資産分散ファンド(安定重視型)	8,715,106円
L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)	22,441,016円
L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)	22,030,245円
L P S 4 資産分散ファンド(積極型)	13,699,334円
東京海上セレクション・外国債券インデックス	2,339,794,480円
東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)	59,042,771円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	295,108円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	134,332円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	70,722円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	99,031円
TMA外国債券インデックスVA<適格機 関投資家限定>	137,028,556円
TMA世界バランスファンド35VA<適格 機関投資家限定>	8,847,149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>	109,444,107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>	382,462,805円
計	3,109,800,387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	3,109,800,387口

(注) *は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。

	<p>(2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。

(有価証券に関する注記)

(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	48,716,179
合計	48,716,179

(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11月12日から2020年1月27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

(2020年1月27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				
	買建	61,241,220		60,728,000	513,220
	米ドル	21,907,930		21,810,000	97,930
	ユーロ	24,280,290		24,060,000	220,290
	豪ドル	15,053,000		14,858,000	195,000
	合計	61,241,220		60,728,000	513,220

(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。

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。

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)

[2020年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	1.6076円
(1万口当たり純資産額	16,076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	100,101.56	
		T 1 1/2 03/31/23	100,000	100,085.93	
		T 1 1/2 08/31/21	300,000	299,835.93	
		T 1 1/2 09/15/22	200,000	200,140.62	
		T 1 1/2 09/30/21	100,000	99,960.93	
		T 1 1/2 10/31/24	100,000	99,968.75	
		T 1 1/2 11/30/21	200,000	199,984.37	
		T 1 1/2 11/30/24	100,000	100,000.00	
		T 1 1/4 07/31/23	100,000	99,234.37	
		T 1 1/4 08/31/24	300,000	296,671.87	
		T 1 1/8 08/31/21	300,000	298,007.81	
		T 1 3/4 01/31/23	300,000	302,460.93	
		T 1 3/4 02/28/22	500,000	502,734.37	
		T 1 3/4 05/15/22	400,000	402,468.75	
		T 1 3/4 05/15/23	500,000	504,335.94	
		T 1 3/4 07/31/24	300,000	303,234.37	
		T 1 3/4 09/30/22	200,000	201,484.37	
		T 1 3/4 11/15/29	200,000	201,171.86	
		T 1 3/8 10/15/22	100,000	99,734.37	
		T 1 5/8 02/15/26	600,000	601,500.00	
		T 1 5/8 05/15/26	300,000	300,773.43	
		T 1 5/8 06/30/21	100,000	100,109.37	
T 1 5/8 08/15/22	500,000	502,148.44			
T 1 5/8 08/15/29	200,000	199,015.62			

T 1 5/8 09/30/26	200,000	200,390.62	
T 1 5/8 11/30/26	100,000	100,156.25	
T 1 5/8 12/15/22	100,000	100,437.50	
T 1 7/8 02/28/22	200,000	201,546.87	
T 1 7/8 07/31/26	100,000	101,765.62	
T 1 7/8 11/30/21	600,000	604,125.00	
T 2 02/15/22	500,000	505,273.44	
T 2 02/15/23	300,000	304,757.81	
T 2 02/15/25	200,000	204,703.12	
T 2 06/30/24	100,000	102,101.56	
T 2 08/15/25	800,000	818,750.00	
T 2 1/2 01/31/24	200,000	207,812.50	
T 2 1/2 02/15/46	100,000	107,187.50	
T 2 1/2 05/15/24	500,000	520,781.25	
T 2 1/2 05/15/46	100,000	107,234.37	
T 2 1/2 08/15/23	300,000	310,617.18	
T 2 1/4 03/31/21	300,000	302,390.62	
T 2 1/4 04/30/21	200,000	201,703.12	
T 2 1/4 07/31/21	300,000	303,187.50	
T 2 1/4 08/15/27	100,000	104,507.81	
T 2 1/4 08/15/46	200,000	204,343.75	
T 2 1/4 08/15/49	100,000	102,632.81	
T 2 1/4 11/15/24	800,000	827,187.50	
T 2 1/4 11/15/27	400,000	418,312.50	
T 2 1/8 05/15/25	300,000	308,835.93	
T 2 1/8 08/15/21	400,000	403,468.75	
T 2 11/15/21	300,000	302,695.31	
T 2 11/15/26	100,000	102,578.12	
T 2 11/30/22	400,000	405,875.00	
T 2 3/4 02/15/28	500,000	541,640.62	
T 2 3/4 07/31/23	100,000	104,320.31	
T 2 3/4 11/15/23	600,000	627,890.62	
T 2 3/4 11/15/42	200,000	223,203.12	
T 2 3/8 03/15/21	300,000	302,718.75	
T 2 3/8 05/15/27	100,000	105,304.68	
T 2 3/8 05/15/29	100,000	106,023.43	
T 2 3/8 08/15/24	200,000	207,656.25	
T 2 5/8 01/31/26	100,000	106,062.50	
T 2 5/8 02/15/29	200,000	216,062.50	
T 2 5/8 03/31/25	100,000	105,468.75	
T 2 5/8 07/15/21	100,000	101,554.68	
T 2 7/8 05/15/28	100,000	109,523.43	

T 2 7/8 07/31/25	100,000	106,976.56	
T 2 7/8 08/15/28	100,000	109,742.18	
T 2 7/8 10/15/21	100,000	102,281.25	
T 2 7/8 11/15/21	100,000	102,398.43	
T 3 02/15/47	300,000	354,046.87	
T 3 02/15/48	200,000	236,625.00	
T 3 02/15/49	300,000	356,718.75	
T 3 05/15/47	100,000	118,000.00	
T 3 08/15/48	100,000	118,554.68	
T 3 1/8 02/15/43	100,000	118,460.93	
T 3 1/8 05/15/21	100,000	102,007.81	
T 3 1/8 05/15/48	100,000	121,125.00	
T 3 1/8 08/15/44	300,000	356,812.50	
T 3 1/8 11/15/41	100,000	118,343.75	
T 3 11/15/45	400,000	468,531.25	
T 3 5/8 02/15/21	300,000	306,351.56	
T 3 5/8 02/15/44	100,000	128,242.18	
T 3 5/8 08/15/43	200,000	255,921.87	
T 3 7/8 08/15/40	100,000	131,226.56	
T 4 1/4 11/15/40	100,000	137,742.18	
T 4 3/4 02/15/41	100,000	146,687.50	
T 4 3/8 11/15/39	100,000	139,304.68	
T 5 05/15/37	50,000	73,085.93	
T 5 3/8 02/15/31	100,000	136,960.93	
米ドル小計	20,750,000	21,804,101.26 (2,377,955,283)	
銘柄数	90		
比 率	47.6%	48.4%	
加ドル		加ドル	
CAN 0 3/4 09/01/21	100,000	98,649.00	
CAN 1 06/01/27	100,000	97,255.00	
CAN 1 09/01/22	100,000	98,805.00	
CAN 1 1/2 06/01/23	100,000	100,192.00	
CAN 1 1/4 03/01/25	100,000	99,363.00	
CAN 2 1/2 06/01/24	100,000	104,669.00	
CAN 2 1/4 06/01/29	100,000	107,720.00	
CAN 2 3/4 06/01/22	100,000	102,850.00	
CAN 2 3/4 12/01/48	100,000	129,150.00	
CAN 3 1/2 12/01/45	100,000	142,446.00	
CAN 3 1/4 06/01/21	100,000	102,223.00	

加ドル小計		1,100,000	1,183,322.00 (98,144,726)	
	銘柄数	11		
	比率	2.0%	2.0%	
メキシコペソ			メキシコペソ	
	MBONO 10 11/20/36	200,000	258,947.30	
	MBONO 10 12/05/24	600,000	681,021.00	
	MBONO 5 3/4 03/05/26	400,000	379,460.40	
	MBONO 6 1/2 06/09/22	600,000	596,520.00	
	MBONO 6 1/2 06/10/21	1,000,000	998,140.70	
	MBONO 6 3/4 03/09/23	100,000	100,045.00	
	MBONO 7 1/2 06/03/27	700,000	728,420.00	
	MBONO 7 1/4 12/09/21	100,000	101,058.68	
	MBONO 7 3/4 05/29/31	300,000	320,842.32	
	MBONO 7 3/4 11/13/42	400,000	427,871.16	
	MBONO 7 3/4 11/23/34	200,000	215,329.80	
	MBONO 8 09/05/24	300,000	315,375.30	
	MBONO 8 1/2 05/31/29	500,000	556,950.00	
	MBONO 8 1/2 11/18/38	400,000	458,936.16	
	MBONO 8 11/07/47	300,000	332,743.80	
	MBONO 8 12/07/23	500,000	520,700.00	
メキシコペソ 小計		6,600,000	6,992,361.62 (40,485,773)	
	銘柄数	16		
	比率	0.8%	0.8%	
ユーロ			ユーロ	
	BGB 0 1/2 10/22/24	100,000	104,350.00	
	BGB 0.2 10/22/23	100,000	101,200.00	
	BGB 1 06/22/26	100,000	108,420.00	
	BGB 1.6 06/22/47	100,000	122,310.00	
	BGB 4 1/4 03/28/41	100,000	175,000.00	
	BGB 4 1/4 09/28/22	100,000	112,700.00	
	BGB 5 1/2 03/28/28	100,000	147,030.00	
	BKO 0 06/11/21	100,000	100,830.00	
	BTPS 0.05 04/15/21	100,000	100,305.00	
	BTPS 0.85 01/15/27	100,000	99,860.00	
	BTPS 1 1/2 06/01/25	100,000	104,510.00	
	BTPS 1.35 04/15/22	100,000	102,900.00	
	BTPS 1.45 11/15/24	100,000	104,450.00	
	BTPS 1.6 06/01/26	100,000	105,170.00	
	BTPS 1.65 03/01/32	100,000	102,930.00	
	BTPS 2 02/01/28	100,000	107,960.00	
	BTPS 2 1/4 09/01/36	100,000	107,300.00	

BTPS 2 12/01/25	100,000	107,390.00	
BTPS 2.15 12/15/21	100,000	104,129.00	
BTPS 3 08/01/29	100,000	116,750.00	
BTPS 3 1/2 03/01/30	100,000	121,560.00	
BTPS 3 3/4 08/01/21	100,000	105,830.00	
BTPS 3 3/4 09/01/24	100,000	114,670.00	
BTPS 4 02/01/37	100,000	131,680.00	
BTPS 4 1/2 03/01/24	100,000	116,520.00	
BTPS 4 1/2 05/01/23	100,000	113,830.00	
BTPS 4 3/4 08/01/23	100,000	115,580.00	
BTPS 4 3/4 09/01/21	100,000	107,704.00	
BTPS 4 3/4 09/01/28	100,000	130,410.00	
BTPS 4 3/4 09/01/44	100,000	148,850.00	
BTPS 5 08/01/34	100,000	143,140.00	
BTPS 5 08/01/39	100,000	149,000.00	
BTPS 5 09/01/40	100,000	149,440.00	
BTPS 5 1/2 11/01/22	200,000	229,400.00	
BTPS 5 3/4 02/01/33	100,000	149,760.00	
BTPS 6 05/01/31	100,000	148,660.00	
BTPS 6 1/2 11/01/27	100,000	141,350.00	
BTPS 7 1/4 11/01/26	100,000	142,100.00	
DBR 0 08/15/26	100,000	103,452.00	
DBR 0 1/4 02/15/27	100,000	105,370.00	
DBR 0 1/4 02/15/29	100,000	105,996.00	
DBR 0 1/4 08/15/28	200,000	211,836.00	
DBR 1 08/15/24	100,000	107,381.00	
DBR 1 08/15/25	100,000	108,806.00	
DBR 1 1/2 09/04/22	100,000	105,601.00	
DBR 1 3/4 07/04/22	100,000	105,843.00	
DBR 2 1/2 07/04/44	100,000	158,520.00	
DBR 2 1/2 08/15/46	100,000	162,110.00	
DBR 4 01/04/37	100,000	170,034.00	
DBR 4 3/4 07/04/34	100,000	172,509.00	
DBR 5.5 01/04/31	100,000	164,971.00	
DBR 6.5 07/04/27	100,000	152,815.00	
FRTR 0 03/25/25	100,000	102,120.00	
FRTR 0 1/2 05/25/26	100,000	104,700.00	
FRTR 0 3/4 11/25/28	200,000	215,900.00	
FRTR 1 05/25/27	200,000	218,720.00	
FRTR 1 1/2 05/25/31	100,000	116,800.00	
FRTR 1 1/2 05/25/50	100,000	119,820.00	
FRTR 1 1/4 05/25/34	100,000	114,700.00	

FRTR 1 1/4 05/25/36	100,000	114,510.00	
FRTR 1 11/25/25	100,000	108,060.00	
FRTR 1 3/4 05/25/23	100,000	107,625.00	
FRTR 1 3/4 11/25/24	200,000	221,530.00	
FRTR 2 05/25/48	100,000	132,940.00	
FRTR 2 1/2 05/25/30	100,000	126,430.00	
FRTR 2 1/4 10/25/22	300,000	323,370.00	
FRTR 3 1/2 04/25/26	200,000	248,230.00	
FRTR 3 1/4 05/25/45	100,000	162,060.00	
FRTR 3 1/4 10/25/21	100,000	106,671.00	
FRTR 3 3/4 04/25/21	100,000	105,400.00	
FRTR 4 10/25/38	100,000	165,700.00	
FRTR 4 3/4 04/25/35	100,000	167,920.00	
FRTR 4.25 10/23	100,000	118,120.00	
FRTR 5 1/2 04/25/29	200,000	305,540.00	
FRTR 5 3/4 10/25/32	100,000	172,240.00	
FRTR 6 10/25/25	100,000	137,040.00	
FRTR4.5 04/25/41	100,000	181,610.00	
IRISH 1.3 05/15/33	100,000	114,040.00	
IRISH 5.4 03/13/25	100,000	129,530.00	
NETHER 0 01/15/22	100,000	101,162.00	
NETHER 2 07/15/24	100,000	111,380.00	
NETHER 3 3/4 01/15/42	100,000	178,080.00	
NETHER 5 1/2 01/15/28	100,000	147,140.00	
NETHER 7 1/2 01/15/23	100,000	124,380.00	
OBL 0 04/05/24	100,000	102,563.00	
OBL 0 04/09/21	200,000	201,442.00	
OBL 0 10/13/23	200,000	204,652.00	
OBL 0 10/18/24	100,000	102,793.00	
RAGB 0 09/20/22	100,000	101,500.00	
RAGB 0 3/4 02/20/28	100,000	107,990.00	
RAGB 3.15 06/20/44	100,000	164,940.00	
RAGB 6 1/4 07/15/27	100,000	149,400.00	
RFGB 0 1/2 09/15/28	100,000	105,870.00	
RFGB 4 07/04/25	100,000	124,320.00	
SPGB 0.6 10/31/29	100,000	102,400.00	
SPGB 1.3 10/31/26	100,000	108,250.00	
SPGB 1.45 10/31/27	100,000	109,840.00	
SPGB 1.95 04/30/26	100,000	112,030.00	
SPGB 1.95 07/30/30	100,000	115,600.00	
SPGB 2 3/4 10/31/24	100,000	113,655.00	
SPGB 2.15 10/31/25	100,000	112,185.00	

	SPGB 2.35 07/30/33	100,000	122,200.00	
	SPGB 4.2 01/31/37	100,000	154,060.00	
	SPGB 4.4 10/31/23	100,000	117,400.00	
	SPGB 4.7 07/30/41	100,000	171,290.00	
	SPGB 4.8 01/31/24	100,000	120,050.00	
	SPGB 4.9 07/30/40	100,000	173,450.00	
	SPGB 5 1/2 04/30/21	100,000	107,410.00	
	SPGB 5 3/4 07/30/32	100,000	163,460.00	
	SPGB 5.15 10/31/28	100,000	142,130.00	
	SPGB 5.85 01/31/22	100,000	112,480.00	
	SPGB 6 01/31/29	100,000	150,900.00	
ユーロ小計		12,300,000	15,207,950.00 (1,829,516,385)	
	銘柄数	112		
	比率	36.6%	37.2%	
英ポンド			英ポンド	
	UKT 0 7/8 10/22/29	100,000	102,930.00	
	UKT 1 04/22/24	100,000	102,560.00	
	UKT 1 1/2 07/22/47	100,000	110,320.00	
	UKT 1 1/4 07/22/27	100,000	105,970.00	
	UKT 1 3/4 09/07/22	100,000	103,570.00	
	UKT 1 3/4 09/07/37	100,000	112,680.00	
	UKT 1 5/8 10/22/28	100,000	109,720.00	
	UKT 2 09/07/25	100,000	109,130.00	
	UKT 2 1/4 09/07/23	100,000	106,700.00	
	UKT 3 1/2 01/22/45	100,000	153,350.00	
	UKT 3 1/2 07/22/68	100,000	198,390.00	
	UKT 3 1/4 01/22/44	100,000	146,040.00	
	UKT 3 3/4 07/22/52	100,000	175,490.00	
	UKT 4 1/2 12/07/42	100,000	170,480.00	
	UKT 4 1/4 12/07/27	30,000	38,844.00	
	UKT 4 1/4 12/07/49	100,000	181,720.00	
	UKT 4.25 06/07/32	100,000	141,990.00	
	UKT 6 12/07/28	10,000	14,783.00	
	UKT 8 06/07/21	150,000	165,360.00	
英ポンド小計		1,790,000	2,350,027.00 (334,902,347)	
	銘柄数	19		
	比率	6.7%	6.8%	

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	106,698.00	
	SGB 0 3/4 11/12/29 #1061	100,000	106,682.00	
	SGB 1 1/2 11/13/23	200,000	213,438.00	
	SGB 1 11/12/26 #1059	100,000	107,675.00	
	SGB 2 1/2 05/12/25 #1058	200,000	228,742.00	
	SGB 3 1/2 03/30/39	100,000	155,664.00	
	SGB 3 1/2 06/01/22	200,000	217,938.00	
スウェーデン クローネ小計		1,000,000	1,136,837.00 (12,959,941)	
	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	101,160.00	
	NGB 1 3/4 02/17/27	100,000	102,970.00	
	NGB 1 3/4 03/13/25	100,000	102,270.00	
	NGB 2 04/26/28	100,000	105,240.00	
	NGB 2 05/24/23	200,000	204,520.00	
	NGB 3 03/14/24	100,000	106,830.00	
	NGB 3 3/4 05/25/21	200,000	206,260.00	
ノルウェー クローネ小計		900,000	929,250.00 (11,197,462)	
	銘柄数	7		
	比 率	0.2%	0.2%	
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	214,860.00	
	DGB 0 1/2 11/15/29	100,000	108,000.00	
	DGB 1 1/2 11/15/23	100,000	108,040.00	
	DGB 1 3/4 11/15/25	200,000	226,740.00	
	DGB 3 11/15/21	200,000	213,220.00	
	DGB 4 1/2 11/15/39	300,000	571,170.00	
デンマーク クローネ小計		1,100,000	1,442,030.00 (23,216,683)	
	銘柄数	6		
	比 率	0.5%	0.5%	

ポーランド ズロチ	POLGB 1 3/4 07/25/21	200,000	ポーランドズロチ 200,620.00
	POLGB 2 1/2 01/25/23	100,000	102,210.00
	POLGB 2 1/2 04/25/24	100,000	102,100.00
	POLGB 2 1/2 07/25/26	100,000	102,050.00
	POLGB 2 1/2 07/25/27	100,000	101,890.00
	POLGB 3 1/4 07/25/25	100,000	105,360.00
	POLGB 5 3/4 09/23/22	100,000	110,480.00
ポーランド ズロチ小計		800,000	824,710.00 (23,314,551)
	銘柄数	7	
	比 率	0.5%	0.5%
豪ドル	ACGB 2 1/2 05/21/30	100,000	豪ドル 113,770.00
	ACGB 2 1/4 05/21/28	100,000	109,800.00
	ACGB 2 3/4 04/21/24	100,000	108,150.00
	ACGB 2 3/4 11/21/27	200,000	226,400.00
	ACGB 3 03/21/47	100,000	128,520.00
	ACGB 3 1/4 04/21/25	100,000	112,260.00
	ACGB 3 1/4 04/21/29	100,000	118,930.00
	ACGB 4 1/4 04/21/26	100,000	120,300.00
	ACGB 5 1/2 04/21/23	100,000	115,185.00
	ACGB 5 3/4 05/15/21	100,000	106,354.00
	ACGB 5 3/4 07/15/22	100,000	112,260.00
豪ドル小計		1,200,000	1,371,929.00 (101,934,324)
	銘柄数	11	
	比 率	2.0%	2.1%
シンガポール ドル	SIGB 3 1/2 03/01/27	200,000	シンガポールドル 226,000.00
シンガポール ドル小計		200,000	226,000.00 (18,215,600)
	銘柄数	1	
	比 率	0.4%	0.4%
マレーシア リングgit	MGS 3.48 03/15/23	100,000	マレーシア リングgit 101,788.90
	MGS 3.502 05/31/27	100,000	101,807.00
	MGS 3.844 04/15/33	100,000	105,323.90
	MGS 3.882 03/10/22	100,000	102,125.80
	MGS 4.16 07/15/21	100,000	101,863.60
	MGS 4.181 07/15/24	100,000	104,743.40
	MGS 4.392 04/15/26	100,000	106,763.70

マレーシア リングgit 小計		700,000	724,416.30 (19,465,065)	
	銘柄数	7		
	比率	0.4%	0.4%	
南アフリカ ランド	SAGB 10 1/2 12/21/26	500,000	南アフリカランド 558,100.00	
	SAGB 6 1/2 02/28/41	200,000	138,740.00	
	SAGB 6 1/4 03/31/36	200,000	142,880.00	
	SAGB 6 3/4 03/31/21	100,000	100,067.00	
	SAGB 7 02/28/31	300,000	254,430.00	
	SAGB 7 3/4 02/28/23	200,000	204,620.00	
	SAGB 8 01/31/30 #2030	300,000	280,020.00	
	SAGB 8 1/2 01/31/37 #203	300,000	264,840.00	
	SAGB 8 1/4 03/31/32 #203	200,000	183,320.00	
	SAGB 8 3/4 01/31/44	300,000	262,110.00	
	SAGB 8 3/4 02/28/48	500,000	435,150.00	
	SAGB 8 7/8 02/28/35 #203	200,000	186,100.00	
	SAGB 9 01/31/40 #2040	200,000	181,820.00	
	南アフリカ ランド小計	3,500,000	3,192,197.00 (24,133,009)	
	銘柄数	13		
	比率	0.5%	0.5%	
国債証券合計			円 4,915,441,149 (4,915,441,149)	
合計			円 4,915,441,149 (4,915,441,149)	

(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

[2020年 1月27日現在]		
区 分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
預金		295,369,817
コール・ローン		48,982,961

株式		15,879,805,238
投資証券		442,360,030
派生商品評価勘定		2,802,044
未収配当金		12,298,775
差入委託証拠金		134,580,232
流動資産合計		16,816,199,097
資産合計		16,816,199,097
負債の部		
流動負債		
派生商品評価勘定		1,771,670
未払解約金		13,272,370
未払利息		28
流動負債合計		15,044,068
負債合計		15,044,068
純資産の部		
元本等		
元本	1	5,970,420,435
剰余金		
剰余金又は欠損金()		10,830,734,594
元本等合計		16,801,155,029
純資産合計		16,801,155,029
負債純資産合計		16,816,199,097

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27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	<p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>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。</p>
----------------------------	---

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 1月27日現在]
<p>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</p> <p>同期中における追加設定元本額</p> <p>同期中における一部解約元本額</p> <p>同期末における元本額</p> <p>元本の内訳*</p> <p>L P S 4 資産分散ファンド(慎重型)</p> <p>L P S 4 資産分散ファンド(安定重視型)</p> <p>L P S 4 資産分散ファンド(バランス型)</p> <p>L P S 4 資産分散ファンド(成長重視型)</p> <p>L P S 4 資産分散ファンド(積極型)</p> <p>東京海上セレクション・外国株式インデックス</p> <p>東京海上・年金運用型戦略ファンド(年1回決算型)</p> <p>東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035</p> <p>東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045</p> <p>東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055</p> <p>東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065</p> <p>T M A 外国株式インデックスV A < 適格機関投資家限定 ></p> <p>T M A 世界バランスファンド35 V A < 適格機関投資家限定 ></p> <p>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 ></p> <p>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 ></p> <p>計</p>	<p>5,030,956,418円</p> <p>1,276,800,070円</p> <p>337,336,053円</p> <p>5,970,420,435円</p> <p>2,088,168円</p> <p>4,016,661円</p> <p>12,211,022円</p> <p>15,513,019円</p> <p>18,417,393円</p> <p>5,286,359,643円</p> <p>56,682,934円</p> <p>527,485円</p> <p>247,790円</p> <p>138,543円</p> <p>199,768円</p> <p>77,687,159円</p> <p>2,884,211円</p> <p>52,569,417円</p> <p>440,877,222円</p> <p>5,970,420,435円</p>
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	5,970,420,435口

(注) *は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引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。
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。

. 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。

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

(有価証券に関する注記)

(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	818,871,726
投資証券	21,952,875
合計	840,824,601

(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11月12日から2020年1月27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

(2020年1月27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	476,973,951		478,092,957	1,119,006
	S&P 500 EMIN	339,727,350		341,229,651	1,502,301
	DJ EU STX 50	72,576,990		72,507,216	69,774
	FTSE 100 IDX	64,669,611		64,356,090	313,521
合計		476,973,951		478,092,957	1,119,006

(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

(2020年1月27日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時 価	評価損益
			うち1年超		
市場取引 以外の取引	為替予約取引				
	買建	15,159,132		15,070,500	88,632
	米ドル	9,861,228		9,814,500	46,728
	ユーロ	2,422,520		2,406,000	16,520
	英ポンド	2,875,384		2,850,000	25,384
合計		15,159,132		15,070,500	88,632

(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。

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。

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)

[2020年 1月27日現在]	
1口当たり純資産額	2.8141円
(1万口当たり純資産額)	28,141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	
APACHE CORP	1,723	29.98	51,655.54	
BAKER HUGHES COMPANY	2,633	22.86	60,190.38	
CABOT OIL & GAS CORP	1,567	14.64	22,940.88	
CHEVRONTEXACO CORP	6,672	111.85	746,263.20	
CONCHO RESOURCES INC	744	82.55	61,417.20	
CONOCOPHILLIPS	3,888	62.62	243,466.56	
DEVON ENERGY CORPORATION	1,812	23.95	43,397.40	
EOG RESOURCES INC	2,016	79.85	160,977.60	
EXXON MOBIL CORPORATION	14,968	66.32	992,677.76	
HALLIBURTON CO	2,815	23.10	65,026.50	
HESS CORP	1,260	64.41	81,156.60	

HOLLYFRONTIER CORP	906	46.53	42,156.18
KINDER MORGAN INC	7,338	21.56	158,207.28
MARATHON OIL CORP	4,300	11.93	51,299.00
MARATHON PETROLEUM CORP	2,580	54.49	140,584.20
NATIONAL OILWELL VARCO INC	1,542	21.88	33,738.96
NOBLE ENERGY INC	2,173	21.67	47,088.91
OCCIDENTAL PETROLEUM CORP	3,177	42.22	134,132.94
ONEOK INC	1,615	74.84	120,866.60
PHILLIPS 66	1,588	100.32	159,308.16
PIONEER NATURAL RESOURCES CO	618	142.03	87,774.54
SCHLUMBERGER LTD	5,034	35.77	180,066.18
TECHNIPFMC PLC	2,193	17.97	39,408.21
VALERO ENERGY CORP	1,490	89.26	132,997.40
WILLIAMS COS INC	4,432	22.19	98,346.08
AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC	793	243.95	193,452.35
ALBEMARLE CORP	478	81.18	38,804.04
AMCOR PLC	6,834	10.49	71,688.66
AVERY DENNISON CORP	444	129.68	57,577.92
BALL CORP	1,376	71.93	98,975.68
CELANESE CORP-SERIES A	590	114.51	67,560.90
CF INDUSTRIES HOLDINGS INC	1,105	40.93	45,227.65
CORTEVA INC	2,867	27.95	80,132.65
DOW INC	2,695	48.49	130,680.55
DUPONT DE NEMOURS INC	2,824	59.39	167,717.36
EASTMAN CHEMICAL COMPANY	691	73.17	50,560.47
ECOLAB INC	867	198.01	171,674.67
INTERNATIONAL PAPER CO	1,355	43.53	58,983.15
INTL FLAVORS & FRAGRANCES	451	135.79	61,241.29
LINDE PLC	2,004	209.99	420,819.96
LyondellBasell Industries NV	809	84.95	68,724.55
MARTIN MARIETTA MATERIALS	273	263.89	72,041.97
MOSAIC CO/THE	2,330	19.14	44,596.20
NEWMONT CORPORATION	2,898	44.29	128,352.42
NUCOR CORP	1,398	50.33	70,361.34
PACKAGING CORP OF AMERICA	506	105.65	53,458.90
PPG INDUSTRIES INC	711	125.81	89,450.91
SEALED AIR CORP	650	37.03	24,069.50
SHERWIN-WILLIAMS CO/THE	315	594.84	187,374.60
VULCAN MATERIALS CO	553	140.52	77,707.56
WESTROCK CO	1,246	40.94	51,011.24
3M CO	2,010	178.15	358,081.50
ACUITY BRANDS INC	220	121.49	26,727.80

AMETEK INC	799	99.57	79,556.43
BOEING CO	1,939	323.05	626,393.95
CATERPILLAR INC	2,008	140.38	281,883.04
CUMMINS INC	470	169.15	79,500.50
DEERE & CO	1,105	170.12	187,982.60
DOVER CORP	665	117.11	77,878.15
EATON CORP PLC	1,357	96.84	131,411.88
EMERSON ELECTRIC CO	1,932	76.70	148,184.40
FASTENAL CO	1,887	35.52	67,026.24
FLOWSERVE CORP	867	48.26	41,841.42
FORTIVE CORP	930	76.91	71,526.30
FORTUNE BRANDS HOME & SECURI	770	69.51	53,522.70
GENERAL DYNAMICS CORP	835	185.07	154,533.45
GENERAL ELECTRIC CO	32,100	11.71	375,891.00
HD SUPPLY HOLDINGS INC	798	40.11	32,007.78
HONEYWELL INTERNATIONAL INC	2,521	177.13	446,544.73
HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE	222	276.47	61,376.34
IDEX CORP	400	172.14	68,856.00
ILLINOIS TOOL WORKS INC	1,060	176.30	186,878.00
INGERSOLL-RAND PLC	860	130.60	112,316.00
JACOBS ENGINEERING GROUP INC	684	97.00	66,348.00
JOHNSON CONTROLS INTERNATION	2,904	41.35	120,080.40
L3HARRIS TECHNOLOGIES INC	848	222.98	189,087.04
LENNOX INTERNATIONAL INC	198	240.97	47,712.06
LOCKHEED MARTIN CORP	960	432.50	415,200.00
MASCO CORP	1,338	48.55	64,959.90
MIDDLEBY CORP	332	114.17	37,904.44
NORTHROP GRUMMAN CORP	616	381.64	235,090.24
PACCAR INC	1,253	76.79	96,217.87
PARKER HANNIFIN CORP	475	198.28	94,183.00
PENTAIR PLC	744	46.20	34,372.80
RAYTHEON COMPANY	1,047	231.24	242,108.28
ROCKWELL AUTOMATION INC	408	199.72	81,485.76
ROPER TECHNOLOGIES INC	378	376.84	142,445.52
SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING	942	50.30	47,382.60
SMITH (A.O.) CORP	672	45.43	30,528.96
SNAP-ON INC	286	165.97	47,467.42
STANLEY BLACK & DECKER INC	523	166.48	87,069.04
TEXTRON INC	1,073	44.70	47,963.10
TRANSDIGM GROUP INC	212	656.73	139,226.76
UNITED RENTALS INC	389	151.65	58,991.85
UNITED TECHNOLOGIES CORP	3,028	153.19	463,859.32

WABCO HOLDINGS INC	221	135.87	30,027.27
WABTEC CORP/DE	823	79.04	65,049.92
WW GRAINGER INC	174	329.00	57,246.00
XYLEM INC	860	81.48	70,072.80
CINTAS CORP	289	283.44	81,914.16
COPART INC	931	100.29	93,369.99
COSTAR GROUP INC	139	650.65	90,440.35
EQUIFAX INC	501	154.01	77,159.01
IHS MARKIT LTD	1,669	79.89	133,336.41
MANPOWERGROUP	273	95.25	26,003.25
REPUBLIC SERVICES INC	683	94.64	64,639.12
ROBERT HALF INTL INC	422	61.95	26,142.90
ROLLINS INC	708	36.61	25,919.88
TRANSUNION	877	92.88	81,455.76
VERISK ANALYTICS INC	464	165.30	76,699.20
WASTE CONNECTIONS INC	945	98.42	93,006.90
WASTE MANAGEMENT INC	1,340	121.00	162,140.00
C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC	609	79.62	48,488.58
CSX CORP	2,560	76.70	196,352.00
EXPEDITORS INTL WASH INC	693	74.34	51,517.62
FEDEX CORP	890	154.07	137,122.30
HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC	444	115.71	51,375.24
KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION	915	37.06	33,909.90
NORFOLK SOUTHERN CORP	925	207.86	192,270.50
OLD DOMINION FREIGHT LINE INC	323	204.47	66,043.81
SOUTHWEST AIRLINES CO	784	56.55	44,335.20
UNION PACIFIC CORP	2,507	185.68	465,499.76
UNITED PARCEL SERVICE CL B	2,472	116.66	288,383.52
APTIV PLC	927	91.54	84,857.58
AUTOLIV INC	471	77.35	36,431.85
BORGWARNER INC	1,108	39.24	43,477.92
FORD MOTOR CO	13,631	9.00	122,679.00
GENERAL MOTORS CO	4,309	34.31	147,841.79
HARLEY-DAVIDSON INC	981	35.23	34,560.63
LEAR CORP	270	133.75	36,112.50
TESLA INC	517	564.82	292,011.94
CAPRI HOLDINGS LTD	739	35.38	26,145.82
DR HORTON INC	1,454	58.51	85,073.54
GARMIN LTD	663	99.59	66,028.17
HASBRO INC	598	104.68	62,598.64
LEGGETT & PLATT INC	803	50.88	40,856.64
LENNAR CORP-CL A	1,240	66.64	82,633.60

LULULEMON ATHLETICA INC	430	240.35	103,350.50
MOHAWK INDUSTRIES INC	307	141.86	43,551.02
NEWELL BRANDS INC	1,934	19.89	38,467.26
NIKE INC -CL B	4,487	102.03	457,808.61
POLARIS INC	349	91.83	32,048.67
PULTE HOMES INC	1,404	43.71	61,368.84
PVH CORP	385	94.95	36,555.75
RALPH LAUREN CORP	247	116.23	28,708.81
TAPESTRY INC	1,366	27.29	37,278.14
VF CORP	1,234	84.53	104,310.02
WHIRLPOOL CORP	339	149.42	50,653.38
ARAMARK	1,306	46.09	60,193.54
CARNIVAL CORP	1,765	47.52	83,872.80
CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A	109	869.71	94,798.39
DARDEN RESTAURANTS INC	574	117.09	67,209.66
DOMINO'S PIZZA INC	203	285.10	57,875.30
HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN	1,107	108.49	120,098.43
LAS VEGAS SANDS CORP	1,568	67.85	106,388.80
MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A	1,163	141.02	164,006.26
MCDONALD'S CORP	2,651	211.24	559,997.24
ROYAL CARIBBEAN CRUISES LTD	748	126.51	94,629.48
STARBUCKS CORP	4,443	92.03	408,889.29
VAIL RESORTS INC	220	243.88	53,653.60
YUM! BRANDS INC	1,051	104.98	110,333.98
ACTIVISION BLIZZARD INC	2,916	59.40	173,210.40
ALPHABET INC-CL A	1,089	1,466.17	1,596,659.13
ALPHABET INC-CL C	1,145	1,466.71	1,679,382.95
CHARTER COMMUNICATIONS INC-A	605	504.67	305,325.35
COMCAST CORP-CL A	16,329	44.59	728,110.11
DISCOVERY INC-A	1,197	30.32	36,293.04
DISCOVERY INC-C	1,762	28.64	50,472.49
DISH NETWORK CORPORATION	1,362	36.74	50,039.88
ELECTRONIC ARTS INC	1,020	112.33	114,576.60
FACEBOOK INC-A	8,794	217.94	1,916,564.36
FOX CORP-CLASS A	1,493	36.61	54,658.73
FOX CORP-CLASS B	1,106	36.04	39,860.24
IAC/INTERACTIVECORP	360	263.36	94,809.60
INTERPUBLIC GROUP COS INC	2,232	23.41	52,251.12
LIBERTY BROADBAND-C	560	130.17	72,895.20
LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C	948	49.49	46,921.26
NETFLIX INC	1,624	353.16	573,531.84
NEWS CORP/NEW-CL A-W/I	2,885	13.94	40,216.90

TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE	529	125.28	66,273.12
THE WALT DISNEY CO	6,546	140.08	916,963.68
TRIPADVISOR INC-W/I	1,082	29.74	32,178.68
TWITTER INC	3,165	33.19	105,046.35
VIACOMCBS INC-CLASS B	2,663	35.79	95,308.77
ADVANCE AUTO PARTS	311	141.68	44,062.48
AMAZON.COM INC	1,522	1,861.64	2,833,416.08
AUTOZONE INC	94	1,140.23	107,181.62
BEST BUY COMPANY INC	975	89.44	87,204.00
BOOKING HOLDINGS INC	153	1,962.96	300,332.88
CARMAX INC	842	96.73	81,446.66
Dollar General Corp	916	154.34	141,375.44
DOLLAR TREE INC	915	87.71	80,254.65
EBAY INC	2,823	35.36	99,821.28
EXPEDIA GROUP INC	711	112.14	79,731.54
GENUINE PARTS CO	719	98.07	70,512.33
HOME DEPOT INC	3,854	232.00	894,128.00
KOHL'S CORP	808	45.49	36,755.92
LKQ CORP	1,753	33.61	58,918.33
LOWE'S COMPANIES	2,831	120.23	340,371.13
MERCADOLIBRE INC	191	660.58	126,170.78
NORDSTROM INC	664	38.67	25,676.88
O'REILLY AUTOMOTIVE INC	285	430.77	122,769.45
ROSS STORES INC	1,299	115.76	150,372.24
TARGET CORP	1,937	114.32	221,437.84
TIFFANY & CO	560	134.29	75,202.40
TJX COMPANIES INC	4,345	61.19	265,870.55
TRACTOR SUPPLY COMPANY	533	93.57	49,872.81
ULTA BEAUTY INC	235	272.98	64,150.30
COSTCO WHOLESALE CORP	1,589	310.51	493,400.39
KROGER CO	2,866	28.19	80,792.54
SYSCO CORP	1,703	82.63	140,718.89
WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC	2,669	52.04	138,894.76
WALMART INC	4,966	114.37	567,961.42
ALTRIA GROUP INC	6,667	50.25	335,016.75
ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO	1,793	44.30	79,429.90
BROWN-FORMAN CORP-CLASS B	1,130	71.79	81,122.70
BUNGE LIMITED	688	54.32	37,372.16
CAMPBELL SOUP CO	984	48.79	48,009.36
COCA-COLA COMPANY	14,264	57.68	822,747.52
COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS	1,194	53.12	63,425.28
CONAGRA BRANDS INC	2,011	32.28	64,915.08

CONSTELLATION BRANDS INC-A	606	191.56	116,085.36
GENERAL MILS INC	1,981	53.71	106,399.51
HERSHEY CO/THE	600	154.68	92,808.00
HORMEL FOODS CORP	1,267	47.23	59,840.41
INGREDION INC	325	92.26	29,984.50
JM SMUCKER CO/THE-NEW COM	549	107.67	59,110.83
KELLOGG CO	1,024	69.34	71,004.16
KRAFT HEINZ CO/THE	2,656	30.41	80,768.96
MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS	473	172.67	81,672.91
MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B	903	56.12	50,676.36
MONDELEZ INTERNATIONAL INC	4,854	55.09	267,406.86
MONSTER BEVERAGE CORP	1,435	67.10	96,288.50
PEPSICO INC	4,886	142.91	698,282.69
PHILIP MORRIS INTERNATIONAL	5,572	86.15	480,027.80
TYSON FOODS INC-CL A	1,083	85.93	93,062.19
CHURCH & DWIGHT CO INC	1,038	71.31	74,019.78
CLOROX COMPANY	470	158.28	74,391.60
COLGATE-PALMOLIVE CO	2,680	70.30	188,404.00
ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A	853	205.34	175,155.02
KIMBERLY-CLARK CORP	1,241	143.42	177,984.22
PROCTER & GAMBLE CO	8,936	125.14	1,118,251.04
ABBOTT LABORATORIES	6,323	90.40	571,599.20
ABIOMED INC	259	182.98	47,391.82
ALIGN TECHNOLOGY INC	318	269.98	85,853.64
AMERISOURCEBERGEN CORP	826	88.92	73,447.92
ANTHEM INC	931	297.28	276,767.68
BAXTER INTL INC	1,758	90.78	159,591.24
BECTON DICKINSON & CO	1,026	278.25	285,484.50
BOSTON SCIENTIFIC CORP	5,231	43.21	226,031.51
CARDINAL HEALTH INC	1,521	53.82	81,860.22
CENTENE CORP	1,848	66.61	123,095.28
CERNER CORP	1,083	74.46	80,640.18
CIGNA CORP	1,439	206.01	296,448.39
COOPER COS INC/THE	234	352.36	82,452.24
CVS HEALTH CORPORATION	4,835	71.43	345,364.05
DANAHER CORP	2,387	162.25	387,290.75
DAVITA INC	611	83.19	50,829.09
DENTSPLY SIRONA INC	1,124	59.66	67,057.84
DEXCOM INC	427	233.94	99,892.38
Edwards Lifesciences Corp	793	230.45	182,746.85
HCA HEALTHCARE INC	1,031	143.45	147,896.95
HUMANA INC	523	356.90	186,658.70

IDEXX LABORATORIES INC	373	280.77	104,727.21
INTUITIVE SURGICAL INC	428	589.20	252,177.60
MCKESSON CORP	713	152.62	108,818.06
MEDTRONIC PLC	4,653	119.26	554,916.78
QUEST DIAGNOSTICS	672	107.79	72,434.88
RESMED INC	626	162.39	101,656.14
STRYKER CORP	1,249	214.23	267,573.27
TELEFLEX INC	211	380.02	80,184.22
UNITEDHEALTH GROUP INC	3,401	292.81	995,846.81
UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC	368	147.26	54,191.68
VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC	464	148.29	68,806.56
VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A	578	145.19	83,919.82
ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC	820	147.80	121,196.00
ABBVIE INC	5,590	83.54	466,988.60
AGILENT TECHNOLOGIES INC	1,381	88.26	121,887.06
ALEXION PHARMACEUTICALS INC	1,019	105.27	107,270.13
ALLERGAN PLC	1,280	188.19	240,883.20
AMGEN INC	2,259	225.59	509,607.81
BIOGEN INC	743	278.14	206,658.02
BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC	856	86.15	73,744.40
BRISTOL-MYERS SQUIBB CO	8,518	64.16	546,514.88
ELI LILLY & CO	3,267	139.07	454,341.69
GILEAD SCIENCES INC	4,914	63.15	310,319.10
ILLUMINA INC	580	319.58	185,356.40
INCYTE CORP	949	76.74	72,826.26
IQVIA HOLDINGS INC	748	158.10	118,258.80
JOHNSON & JOHNSON	9,378	148.32	1,390,944.96
MERCK & CO. INC.	9,304	85.98	799,957.92
METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC	112	819.95	91,834.40
MYLAN NV	2,465	21.85	53,860.25
PERRIGO CO PLC	793	58.76	46,596.68
PFIZER INC	19,675	39.82	783,458.50
Regeneron Pharmaceuticals Inc	353	345.28	121,883.84
SEATTLE GENETICS INC	628	113.57	71,321.96
THERMO FISHER SCIENTIFIC INC	1,515	333.68	505,525.20
VERTEX PHARMACEUTICALS INC	1,028	229.06	235,473.68
WATERS CORP	339	237.53	80,522.67
ZOETIS INC	1,892	136.31	257,898.52
BANK OF AMERICA CORP	31,871	33.54	1,068,953.34
CITIGROUP INC	8,151	78.42	639,201.42
CITIZENS FINANCIAL GROUP	1,623	39.13	63,507.99
COMERICA INC	799	64.73	51,719.27

EAST WEST BANCORP INC	822	49.23	40,467.06
FIFTH THIRD BANCORP	2,381	28.84	68,668.04
FIRST REPUBLIC BANK/CA	756	113.75	85,995.00
HUNTINGTON BANCSHARES INC	4,917	13.72	67,461.24
JPMORGAN CHASE & CO	11,554	133.15	1,538,415.10
KEYCORP	4,479	19.29	86,399.91
M & T BANK CORP	380	171.49	65,166.20
PEOPLE'S UNITED FINANCIAL	2,398	15.85	38,008.30
PNC FINANCIAL SERVICES GROUP	1,607	150.38	241,660.66
REGIONS FINANCIAL CORP	4,269	15.72	67,108.68
SVB FINANCIAL GROUP	276	252.66	69,734.16
TRUIST FINANCIAL CORP	4,984	55.48	276,512.32
US BANCORP	5,782	53.84	311,302.88
WELLS FARGO & COMPANY	14,905	47.57	709,030.85
AMERICAN EXPRESS COMPANY	2,471	135.11	333,856.81
AMERIPRISE FINANCIAL INC	520	167.57	87,136.40
BANK OF NEW YORK MELLON CORP	2,968	45.95	136,379.60
BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B	4,659	226.86	1,056,940.74
BLACKROCK INC	382	536.84	205,072.88
BLACKSTONE GROUP INC/THE-A	2,630	62.21	163,612.30
CAPITAL ONE FINANCIAL CORP	1,634	104.30	170,426.20
CBOE GLOBAL MARKETS INC	532	119.81	63,738.92
CME GROUP INC	1,276	209.24	266,990.24
DISCOVER FINANCIAL SERVICES	1,082	76.29	82,545.78
E*TRADE FINANCIAL CORP	1,279	45.63	58,360.77
EQUITABLE HOLDINGS INC	1,700	24.98	42,466.00
FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC	160	276.56	44,249.60
FRANKLIN RESOURCES INC	1,161	25.26	29,326.86
GOLDMAN SACHS GROUP INC	1,138	241.92	275,304.96
INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC	1,977	97.11	191,986.47
INVESCO LTD	1,900	18.17	34,523.00
JEFFERIES FINANCIAL GROUP INC.	1,967	21.89	43,057.63
MOODY'S CORP	672	255.62	171,776.64
MORGAN STANLEY	4,347	54.55	237,128.85
MSCI INC	369	276.11	101,884.59
NORTHERN TRUST CORP	824	101.62	83,734.88
RAYMOND JAMES FINANCIAL INC	653	90.42	59,044.26
S&P GLOBAL INC	901	294.83	265,641.83
SCHWAB (CHARLES) CORP	4,463	47.15	210,430.45
SEI INVESTMENTS COMPANY	754	63.71	48,037.34
STATE STREET CORP	1,396	78.34	109,362.64
SYNCHRONY FINANCIAL	2,240	32.63	73,091.20

T ROWE PRICE GROUP INC	721	131.18	94,580.78
TD AMERITRADE HOLDING CORP	1,393	49.32	68,702.76
VOYA FINANCIAL INC	783	61.47	48,131.01
AFLAC INC	2,230	52.39	116,829.70
ALLEGHANY CORP	73	804.85	58,754.05
ALLSTATE CORP	1,020	118.28	120,645.60
AMERICAN FINANCIAL GROUP INC	340	110.49	37,566.60
AMERICAN INTERNATIONAL GROUP	3,090	51.06	157,775.40
AON PLC	771	213.42	164,546.82
ARTHUR J GALLAGHER & CO	855	96.86	82,815.30
ASSURANT INC	362	129.18	46,763.16
ATHENE HOLDING LTD-CLASS A	740	44.63	33,026.20
CHUBB LTD	1,594	152.01	242,303.94
CINCINNATI FINANCIAL CORP	721	106.01	76,436.81
EVEREST RE GROUP LTD	214	277.35	59,352.90
FIDELITY NATIONAL FINANCIAL	1,267	48.30	61,196.10
GLOBE LIFE INC	542	104.79	56,796.18
HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP	976	58.98	57,564.48
LINCOLN NATIONAL CORP	975	56.55	55,136.25
LOEWS CORP	1,292	51.35	66,344.20
MARSH & MCLENNAN COS	1,759	113.87	200,297.33
METLIFE INC	2,448	51.27	125,508.96
PRINCIPAL FINANCIAL GROUP	1,280	54.36	69,580.80
PROGRESSIVE CORP	1,999	76.75	153,423.25
PRUDENTIAL FINANCIAL INC	1,304	93.52	121,950.08
RENAISSANCERE HOLDINGS LTD	200	190.09	38,018.00
TRAVELERS COS INC/THE	816	134.78	109,980.48
UNUM GROUP	1,026	28.10	28,830.60
WILLIS TOWERS WATSON PLC	459	209.01	95,935.59
WR BERKLEY CORP	853	72.07	61,475.71
CBRE GROUP INC - A	1,447	60.77	87,934.19
ACCENTURE PLC-CL A	2,311	208.57	482,005.27
ADOBE INC	1,791	351.37	629,303.67
AKAMAI TECHNOLOGIES	798	95.52	76,224.96
ALLIANCE DATA SYSTEMS CORP	208	107.40	22,339.20
ANSYS INC	367	277.34	101,783.78
AUTODESK INC	912	199.19	181,661.28
AUTOMATIC DATA PROCESSING	1,600	177.21	283,536.00
BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS	557	131.03	72,983.71
CDK GLOBAL INC	585	54.51	31,888.35
CHECK POINT SOFTWARE TECH	601	115.48	69,403.48
CITRIX SYSTEMS INC	647	128.26	82,984.22

COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A	1,902	62.42	118,722.84
DXC TECHNOLOGY CO	1,577	34.48	54,374.96
FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES	2,360	147.92	349,091.20
FISERV INC	2,271	120.84	274,427.64
FLEETCOR TECHNOLOGIES INC	344	320.63	110,296.72
FORTINET INC	691	117.99	81,531.09
GARTNER INC	435	160.57	69,847.95
GLOBAL PAYMENTS INC	1,202	198.77	238,921.54
GODADDY INC - CLASS A	871	71.29	62,093.59
INTL BUSINESS MACHINES CORP	3,113	140.56	437,563.28
INTUIT INC	962	288.08	277,132.96
JACK HENRY & ASSOCIATES INC	397	151.25	60,046.25
LEIDOS HOLDINGS INC	689	101.62	70,016.18
MASTERCARD INC-CLASS A	3,276	323.67	1,060,342.92
MICROSOFT CORP	26,222	165.04	4,327,678.88
NORTONLIFELOCK INC	2,573	28.07	72,224.11
ORACLE CORPORATION	8,359	54.07	451,971.13
PALO ALTO NETWORKS INC	418	242.90	101,532.20
PAYCHEX INC	989	88.91	87,931.99
PAYPAL HOLDINGS INC	4,240	116.98	495,995.20
SALESFORCE.COM INC	3,085	182.11	561,809.35
SERVICENOW INC	753	309.39	232,970.67
SPLUNK INC	641	157.00	100,637.00
SQUARE INC - A	1,582	71.14	112,543.48
SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS	1,186	65.45	77,623.70
SYNOPSYS INC	658	154.05	101,364.90
VERISIGN INC	471	212.75	100,205.25
VISA INC-CLASS A SHARES	6,133	205.00	1,257,265.00
VMWARE INC-CLASS A	421	150.63	63,415.23
WESTERN UNION CO	2,199	27.10	59,592.90
WORKDAY INC-CLASS A	724	186.07	134,714.68
AMPHENOL CORP-CL A	1,065	105.36	112,208.40
APPLE INC	16,311	318.31	5,191,954.41
ARISTA NETWORKS INC	288	238.05	68,558.40
CDW CORP/DE	644	137.92	88,820.48
CISCO SYSTEMS INC	14,995	48.85	732,505.75
COGNEX CORP	912	57.73	52,649.76
CORNING INC	2,552	29.36	74,926.72
F5 NETWORKS INC	275	135.82	37,350.50
FLIR SYSTEMS INC	665	54.29	36,102.85
HEWLETT PACKARD ENTERPRISE	4,881	14.76	72,043.56
HP INC	5,077	21.98	111,592.46

JUNIPER NETWORKS INC	1,676	24.58	41,196.08
KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC	831	102.98	85,576.38
MOTOROLA SOLUTIONS INC	569	179.66	102,226.54
NETAPP INC	1,122	59.81	67,106.82
SEAGATE TECHNOLOGY	1,135	63.23	71,766.05
TE CONNECTIVITY LTD	1,026	98.40	100,958.40
TRIMBLE INC	1,359	44.08	59,904.72
WESTERN DIGITAL CORP	1,269	69.52	88,220.88
XEROX HOLDINGS CORP	1,051	35.52	37,331.52
ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A	243	252.70	61,406.10
AT&T INC	26,239	38.50	1,010,201.50
T-MOBILE US INC	1,346	81.58	109,806.68
VERIZON COMMUNICATIONS INC	14,569	60.28	878,219.32
AMEREN CORPORATION	1,013	80.39	81,435.07
AMERICAN ELECTRIC POWER	1,545	102.16	157,837.20
AMERICAN WATER WORKS CO INC	643	135.78	87,306.54
AQUA AMERICA INC	830	51.86	43,043.80
ATMOS ENERGY CORP	595	117.38	69,841.10
CENTERPOINT ENERGY INC	2,545	26.46	67,340.70
CMS ENERGY CORP	1,302	67.49	87,871.98
CONSOLIDATED EDISON INC	1,003	93.61	93,890.83
DOMINION ENERGY INC	2,906	84.00	244,104.00
DTE ENERGY COMPANY	451	132.76	59,874.76
DUKE ENERGY CORP	2,386	96.28	229,724.08
EDISON INTERNATIONAL	1,375	76.92	105,765.00
ENERGY CORP	854	130.73	111,643.42
EVERGY INC	1,203	71.37	85,858.11
EVERSOURCE ENERGY	1,019	91.81	93,554.39
EXELON CORP	3,186	47.73	152,067.78
FIRSTENERGY CORP	1,943	50.47	98,063.21
NEXTERA ENERGY INC	1,759	263.72	463,883.48
NISOURCE INC	2,047	29.08	59,526.76
OGE ENERGY CORP	1,231	45.52	56,035.12
PINNACLE WEST CAPITAL	617	97.12	59,923.04
PPL CORPORATION	2,566	36.53	93,735.98
PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP	1,585	61.66	97,731.10
SEMPRA ENERGY	1,020	159.76	162,955.20
SOUTHERN CO	3,906	69.44	271,232.64
WEC ENERGY GROUP INC	1,183	98.96	117,069.68
XCEL ENERGY INC	1,873	67.17	125,809.41
ADVANCED MICRO DEVICES	3,933	50.35	198,026.55
ANALOG DEVICES	1,510	117.57	177,530.70

APPLIED MATERIALS INC	3,369	62.00	208,878.00	
BROADCOM INC	1,487	324.00	481,788.00	
INTEL CORP	15,884	68.47	1,087,577.48	
KLA CORPORATION	633	179.40	113,560.20	
LAM RESEARCH CORP	541	306.54	165,838.14	
MAXIM INTEGRATED PRODUCTS	1,186	62.56	74,196.16	
MICROCHIP TECHNOLOGY INC	1,048	107.22	112,366.56	
MICRON TECHNOLOGY INC	4,283	57.76	247,386.08	
NVIDIA CORP	2,128	250.48	533,021.44	
NXP SEMICONDUCTORS NV	1,102	135.28	149,078.56	
QUALCOMM INC	4,453	89.65	399,211.45	
SKYWORKS SOLUTIONS INC	708	122.31	86,595.48	
TEXAS INSTRUMENTS	3,356	130.52	438,025.12	
XILINX INC	936	100.80	94,348.80	
米ドル小計	1,039,991		100,695,884.87 (10,981,893,203)	
	銘柄数	487		
	比率	65.4%	69.2%	
加ドル	株	加ドル	加ドル	
CAMECO CORP	2,934	11.05	32,420.70	
CANADIAN NATURAL RESOURCES	4,359	39.78	173,401.02	
CENOVUS ENERGY INC	5,145	11.53	59,321.85	
ENBRIDGE INC	7,570	53.96	408,477.20	
ENCANA CORP	5,921	4.96	29,368.16	
HUSKY ENERGY INC	3,906	9.15	35,739.90	
IMPERIAL OIL LTD	1,060	33.58	35,594.80	
INTER PIPELINE LTD	2,281	22.30	50,866.30	
KEYERA CORP	1,334	35.00	46,690.00	
PEMBINA PIPELINE CORP	2,544	50.84	129,336.96	
PRAIRIESKY ROYALTY LTD	1,433	14.88	21,323.04	
SUNCOR ENERGY INC	5,687	42.48	241,583.76	
TC ENERGY CORP	3,460	72.32	250,227.20	
AGNICO EAGLE MINES LTD	1,162	81.45	94,644.90	
BARRICK GOLD CORP	6,515	24.60	160,269.00	
CCL INDUSTRIES INC - CL B	826	57.14	47,197.64	
FRANCO-NEVADA CORP	797	145.01	115,572.97	
NUTRIEN LTD	2,098	58.17	122,040.66	
WHEATON PRECIOUS METALS CORP	2,272	39.06	88,744.32	
CAE INC	1,670	39.03	65,180.10	
THOMSON REUTERS CORP	949	104.06	98,752.94	
CANADIAN NATL RAILWAY CO	2,348	124.31	291,879.88	
CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD	497	343.48	170,709.56	

MAGNA INTERNATIONAL INC	925	69.53	64,315.25
GILDAN ACTIVEWEAR INC	1,344	39.24	52,738.56
RESTAURANT BRANDS INTERN	1,217	84.41	102,726.97
SHAW COMMUNICATIONS INC-B	2,594	26.06	67,599.64
CANADIAN TIRE CORP -CL A	279	144.92	40,432.68
DOLLARAMA INC	1,335	46.57	62,170.95
ALIMENTATION COUCHE-TARD INC	3,268	44.00	143,792.00
LOBLAW COMPANIES LTD	961	68.93	66,241.73
METRO INC	1,334	54.45	72,636.30
WESTON (GEORGE) LTD	498	107.08	53,325.84
SAPUTO INC	961	40.04	38,478.44
BANK OF MONTREAL	2,193	104.02	228,115.86
BANK OF NOVA SCOTIA	4,115	73.34	301,794.10
CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE	1,428	108.95	155,580.60
NATIONAL BANK OF CANADA	1,616	73.79	119,244.64
ROYAL BANK OF CANADA	4,951	105.77	523,667.27
TORONTO-DOMINION BANK	6,232	74.20	462,414.40
BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A	3,601	81.98	295,209.98
IGM FINANCIAL INC	879	39.12	34,386.48
FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD	144	598.47	86,179.68
GREAT-WEST LIFECO INC	1,631	34.40	56,106.40
INTACT FINANCIAL CORP	706	142.29	100,456.74
MANULIFE FINANCIAL CORP	7,153	27.14	194,132.42
POWER CORP OF CANADA	1,725	34.09	58,805.25
POWER FINANCIAL CORP	1,745	35.36	61,703.20
SUN LIFE FINANCIAL INC	1,674	63.50	106,299.00
CGI INC	836	113.29	94,710.44
CONSTELLATION SOFTWARE INC	93	1,394.90	129,725.70
OPEN TEXT CORP	1,384	60.96	84,368.64
SHOPIFY INC - CLASS A	403	611.84	246,571.52
BCE INC	821	62.44	51,263.24
ROGERS COMMUNICATIONS -CL B	1,447	66.12	95,675.64
TELUS CORP	800	52.32	41,856.00
CANADIAN UTILITIES LTD-A	1,142	40.25	45,965.50
FORTIS INC	2,013	58.19	117,136.47
HYDRO ONE LTD	2,210	26.55	58,675.50
加ドル小計	132,426		7,283,845.89 (604,122,178)
	銘柄数	59	
	比率	3.6%	3.8%
ユーロ	株	ユーロ	ユーロ
ENI SPA	7,972	13.47	107,382.84

Galp Energia SGPS SA	2,148	14.11	30,319.02
Koninklijke Vopak NV	567	48.66	27,590.22
NESTE OYJ	1,731	34.27	59,321.37
OMV AG	815	47.17	38,443.55
REPSOL SA	3,770	13.10	49,387.00
TENARIS SA	2,391	10.23	24,471.88
TOTAL SA	8,274	47.38	392,063.49
AIR LIQUIDE	1,545	130.60	201,777.00
AKZO NOBEL	679	88.04	59,779.16
ARCELORMITTAL	3,727	14.10	52,550.70
BASF SE	3,017	63.69	192,152.73
COVESTRO AG	609	39.76	24,213.84
CRH PLC(DUBLIN)	3,327	34.99	116,411.73
EVONIK INDUSTRIES AG	947	25.99	24,612.53
FUCHS PETROLUB SE -PREF	481	42.00	20,202.00
HEIDELBERGCEMENT AG	596	65.10	38,799.60
KONINKLIJKE DSM NV	628	112.90	70,901.20
LANXESS	584	55.50	32,412.00
SOLVAY SA	383	95.00	36,385.00
STORA ENSO OYJ-R SHS	2,226	11.95	26,600.70
SYMRISE AG	662	92.96	61,539.52
UMICORE	1,078	42.90	46,246.20
UPM-KYMMENE OYJ	1,684	29.22	49,206.48
ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV	1,270	31.93	40,551.10
AIRBUS SE	2,158	139.00	299,962.00
ALSTOM	1,130	47.12	53,245.60
ANDRITZ AG	671	37.58	25,216.18
BOUYGUES	1,261	38.08	48,018.88
BRENNTAG AG	677	48.73	32,990.21
COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN	1,558	35.21	54,857.18
Eiffage SA	479	104.85	50,223.15
FERROVIAL SA	2,511	29.60	74,325.60
GEA GROUP AG	828	28.40	23,515.20
KINGSPAN GROUP PLC	680	57.50	39,100.00
KONE OYJ-B	932	59.50	55,454.00
Legrand SA	700	73.40	51,380.00
MTU AERO ENGINES AG	245	286.70	70,241.50
SAFRAN SA	1,220	147.00	179,340.00
SCHNEIDER ELECTRIC SE	1,827	94.22	172,139.94
SIEMENS AG	2,676	117.92	315,553.92
THALES SA	475	98.70	46,882.50
VINCI S.A.	1,690	102.40	173,056.00

WARTSILA	1,714	11.03	18,913.99
Bureau Veritas SA	1,252	25.52	31,951.04
EDENRED	1,239	48.48	60,066.72
RANDSTAD NV	627	54.26	34,021.02
TELEPERFORMANCE	303	232.00	70,296.00
WOLTERS KLUWER	742	69.58	51,628.36
AENA SME SA	282	168.50	47,517.00
Aeroports de Paris	183	171.10	31,311.30
ATLANTIA S.P.A	2,407	21.36	51,413.52
DEUTSCHE LUFTHANSA-REG	1,693	14.42	24,421.52
DEUTSCHE POST AG	3,158	33.20	104,861.39
GETLINK SE	2,604	15.82	41,195.28
BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG	991	69.41	68,785.31
CONTINENTAL AG	386	103.10	39,796.60
DAIMLER AG	3,106	43.94	136,477.64
FERRARI NV	500	157.00	78,500.00
MICHELIN (CGDE)-B	461	106.70	49,188.70
NOKIAN RENKAAT OYJ	730	23.24	16,965.20
PEUGEOT SA	2,370	19.27	45,669.90
PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE	636	66.48	42,281.28
RENAULT SA	781	36.27	28,326.87
VALEO SA	1,067	28.56	30,473.52
VOLKSWAGEN AG	208	175.45	36,493.60
VOLKSWAGEN AG PFD	557	177.52	98,878.64
ADIDAS AG	643	313.00	201,259.00
ESSILORLUXOTTICA	1,044	139.00	145,116.00
HERMES INTERNATIONAL	79	711.00	56,169.00
KERING	282	573.30	161,670.60
LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE	1,007	416.30	419,214.10
MONCLER SPA	984	40.55	39,901.20
PUMA AG	499	78.10	38,971.90
ACCOR SA	1,005	38.18	38,370.90
FLUTTER ENTERTAINMENT PLC	446	105.30	46,963.80
SODEXO	452	98.30	44,431.60
Eutelsat Communications	1,586	14.45	22,917.70
SES SA	2,318	12.75	29,554.50
UBISOFT ENTERTAINMENT	441	66.00	29,106.00
VIVENDI SA	3,368	24.83	83,627.44
DELIVERY HERO SE	706	70.00	49,420.00
INDITEX	3,647	31.14	113,567.58
PROSUS NV	1,831	68.04	124,581.24
CARREFOUR SA	2,282	15.29	34,891.78

COLRUYT SA	371	45.28	16,798.88
JERONIMO MARTINS	1,418	15.81	22,425.67
KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV	4,061	22.44	91,149.14
METRO AG	1,222	12.84	15,690.48
ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV	2,646	70.71	187,098.66
DANONE	1,916	74.10	141,975.60
DAVIDE CAMPARI-MILANO SPA	3,816	8.72	33,275.52
HEINEKEN HOLDING NV	544	91.40	49,721.60
HEINEKEN NV	885	100.50	88,942.50
KERRY GROUP PLC-A	681	117.80	80,221.80
PERNOD-RICARD	683	164.20	112,148.60
BEIERSDORF AG	477	106.50	50,800.50
HENKEL AG & CO KGAA	564	87.55	49,378.20
HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG	384	95.64	36,725.76
L'OREAL	867	270.50	234,523.50
UNILEVER NV	4,909	51.86	254,580.74
FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co	906	72.02	65,250.12
Fresenius SE & CO KG	1,445	48.82	70,552.12
KONINKLIJKE PHILIPS NV	3,260	45.61	148,688.60
BAYER AG	3,385	75.25	254,721.25
GRIFOLS SA	1,621	31.16	50,510.36
MERCK KGAA	651	120.00	78,120.00
ORION OYJ	630	43.38	27,329.40
QIAGEN N V	1,408	31.46	44,295.68
RECORDATI SPA	748	40.29	30,136.92
SANOFI	4,128	89.11	367,846.08
UCB SA	686	82.20	56,389.20
BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA	19,961	4.60	91,960.32
BANCO SANTANDER S.A	54,742	3.54	193,786.68
Bankinter SA	4,854	5.94	28,852.17
BNP PARIBAS	3,951	49.91	197,194.41
CaixaBank SA	17,413	2.65	46,196.68
COMMERZBANK AG	6,055	5.14	31,122.70
CREDIT AGRICOLE SA	5,704	12.57	71,727.80
ERSTE GROUP BANK AG	1,674	33.80	56,581.20
FINECOBANK SPA	3,667	10.98	40,281.99
ING GROEP NV-CVA	13,596	10.22	138,951.12
INTESA SANPAOLO	58,823	2.27	133,998.79
KBC GROEP NV	902	68.32	61,624.64
MEDIOBANCA SPA	4,272	9.56	40,848.86
SOCIETE GENERALE-A	3,027	30.19	91,385.13
UNICREDIT SPA	8,783	12.44	109,295.65

DEUTSCHE BANK AG -REG	8,278	7.82	64,808.46
DEUTSCHE BOERSE AG	644	150.10	96,664.40
GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA	505	95.46	48,207.30
Natixis	6,886	3.92	27,027.55
Wendel	243	123.10	29,913.30
AEGON NV	9,971	3.85	38,388.35
AGEAS	954	51.50	49,131.00
ALLIANZ SE	1,442	220.95	318,609.90
ASSICURAZIONI GENERALI	3,479	18.14	63,109.06
AXA	6,186	24.31	150,381.66
CNP ASSURANCES	1,594	17.05	27,177.70
HANNOVER RUECK SE	317	179.40	56,869.80
MAPFRE S.A.	10,951	2.39	26,172.89
MUENCHENER RUECKVER AG-REG	445	272.70	121,351.50
NN GROUP NV	1,415	32.43	45,888.45
POSTE ITALIANE SPA	3,884	10.58	41,112.14
SAMPO OYJ-A SHS	1,126	40.98	46,143.48
SCOR SE	731	38.40	28,070.40
AROUNDTOWN SA	4,000	8.25	33,008.00
VONOVIA SE	2,272	51.22	116,371.84
ADYEN NV /WI	59	835.20	49,276.80
AMADEUS IT GROUP SA-A SHS	1,512	77.70	117,482.40
ATOS SE	470	78.18	36,744.60
CAPGEMINI	609	119.05	72,501.45
DASSAULT SYSTEMES SA	508	163.95	83,286.60
SAP SE	3,552	126.90	450,748.80
WIRECARD AG	526	140.60	73,955.60
WORLDLINE SA	626	67.60	42,317.60
NOKIA OYJ	19,523	3.67	71,756.78
CELLNEX TELECOM SAU	1,275	43.85	55,908.75
DEUTSCHE TELEKOM AG-REG	10,671	14.80	157,930.80
ELISA OYJ	778	53.22	41,405.16
KONIKLIJKE KPN NV	17,774	2.73	48,611.89
ORANGE	5,618	13.09	73,539.62
TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI	9,356	2.76	25,906.76
TELEFONICA SA	13,818	6.11	84,538.52
UNITED INTERNET AG-REG SHARE	896	30.00	26,880.00
E.ON SE	7,203	10.45	75,328.97
ELECTRICITE DE FRANCE	3,070	11.47	35,228.25
ENAGAS SA	1,063	24.13	25,650.19
ENDESA SA	1,843	24.65	45,429.95
ENEL SPA	30,470	7.81	238,244.93

ENERGIAS DE PORTUGAL SA	12,484	4.30	53,718.65	
ENGIE	5,871	15.71	92,233.41	
FORTUM OYJ	2,126	22.68	48,217.68	
IBERDROLA SA	19,648	9.88	194,240.12	
NATURGY ENERGY GROUP SA	1,524	23.47	35,768.28	
RED ELECTRICA CORPORACION SA	1,640	18.36	30,118.60	
RWE AG	2,582	31.92	82,417.44	
SUEZ	2,138	14.92	31,909.65	
TERNA SPA	8,025	6.32	50,734.05	
UNIPER SE	1,151	29.78	34,276.78	
VEOLIA ENVIRONNEMENT	2,775	26.99	74,897.25	
ASML HOLDING NV	1,580	270.65	427,627.00	
INFINEON TECHNOLOGIES AG	4,565	22.00	100,452.82	
STMICROELECTRONICS NV	3,296	27.74	91,431.04	
ユーロ小計	641,130		15,210,220.85 (1,829,789,568)	
	銘柄数	183		
	比率	10.9%	11.5%	
英ポンド	株	英ポンド	英ポンド	
BP PLC	70,218	4.86	341,329.69	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS	14,720	21.87	321,926.40	
ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS	13,816	22.00	303,952.00	
ANGLO AMERICAN PLC	4,535	21.32	96,686.20	
BHP GROUP PLC	8,134	17.79	144,703.86	
CRODA INTERNATIONAL PLC	600	52.10	31,260.00	
GLENCORE PLC	43,619	2.30	100,563.60	
JOHNSON MATTHEY PLC	746	27.92	20,828.32	
MONDI PLC	2,176	16.27	35,403.52	
RIO TINTO PLC	4,454	44.38	197,690.79	
ASHTREAD GROUP PLC	2,371	25.58	60,650.18	
BAE SYSTEMS PLC	10,395	6.43	66,923.01	
BUNZL PLC	1,580	20.39	32,216.20	
FERGUSON PLC	755	70.50	53,227.50	
MEGGITT PLC	4,729	6.93	32,790.88	
MELROSE INDUSTRIES PLC	22,779	2.46	56,036.34	
SMITHS GROUP PLC	2,299	17.42	40,060.07	
WEIR GROUP PLC/THE	1,672	13.87	23,190.64	
EXPERIAN PLC	2,770	26.93	74,596.10	
G4S PLC	8,403	2.06	17,377.40	
INTERTEK GROUP PLC	732	61.70	45,164.40	
RELX PLC	6,026	20.50	123,533.00	
RENTOKIL INITIAL PLC	9,859	4.81	47,461.22	
BURBERRY GROUP PLC	1,594	20.99	33,458.06	

PERSIMMON PLC	1,380	30.49	42,076.20
CARNIVAL PLC	750	34.28	25,710.00
COMPASS GROUP PLC	5,619	19.27	108,278.13
INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC	890	48.06	42,773.40
Whitbread PLC	796	43.02	34,243.92
ITV PLC	21,584	1.41	30,433.44
WPP PLC	5,239	10.03	52,547.17
KINGFISHER PLC	11,068	2.06	22,899.69
MARKS & SPENCER GROUP PLC	10,312	1.84	19,030.79
NEXT PLC	598	71.94	43,020.12
MORRISON <WM.> SUPERMARKETS	11,832	1.87	22,202.74
TESCO PLC	35,928	2.48	89,424.79
Associated British Foods PLC	1,463	26.70	39,062.10
BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC	8,314	34.12	283,715.25
DIAGEO PLC	8,011	32.40	259,556.40
IMPERIAL BRANDS PLC	3,064	19.59	60,023.76
RECKITT BENCKISER GROUP PLC	2,555	61.50	157,132.50
UNILEVER PLC	3,784	44.74	169,296.16
SMITH & NEPHEW PLC	3,613	19.30	69,730.90
ASTRAZENECA PLC	4,890	76.59	374,525.10
GLAXOSMITHKLINE PLC	18,390	18.22	335,212.92
BARCLAYS PLC	69,262	1.73	120,128.01
HSBC HOLDINGS PLC	70,027	5.79	405,736.43
LLOYDS BANKING GROUP PLC	269,623	0.58	156,624.00
ROYAL BANK OF SCOTLAND GROU	24,531	2.23	54,802.25
STANDARD CHARTERED PLC	11,227	6.88	77,331.57
3I GROUP PLC	4,668	11.17	52,141.56
HARGREAVES LANSDOWN PLC	1,290	18.31	23,626.35
London Stock Exchange Group PLC	1,301	79.50	103,429.50
M&G PLC	14,455	2.45	35,472.57
SCHRODERS PLC	900	32.65	29,385.00
STANDARD LIFE ABERDEEN PLC	13,130	3.13	41,215.07
ADMIRAL GROUP PLC	1,039	23.02	23,917.78
AVIVA PLC	10,816	4.11	44,518.65
DIRECT LINE INSURANCE GROUP	6,516	3.39	22,121.82
LEGAL & GENERAL GROUP PLC	23,161	3.11	72,215.99
PRUDENTIAL PLC	9,214	14.17	130,608.45
RSA INSURANCE GROUP PLC	4,358	5.52	24,073.59
SAGE GROUP PLC/THE	5,798	7.66	44,412.68
BT GROUP PLC	30,146	1.71	51,549.66
VODAFONE GROUP PLC	99,235	1.56	155,302.77
CENTRICA PLC	27,367	0.91	24,975.12

NATIONAL GRID PLC	11,544	10.14	117,102.33	
SEVERN TRENT PLC	1,221	26.18	31,965.78	
SSE PLC	4,258	15.29	65,126.11	
英ポンド小計	1,114,149		6,489,707.90 (924,848,272)	
	銘柄数	69		
	比率	5.5%	5.8%	
スイスフラン 株		スイスフラン	スイスフラン	
CLARIANT AG-REG	1,407	22.22	31,263.54	
GIVAUDAN-REG	29	3,154.00	91,466.00	
LAFARGEHOLCIM LTD	1,692	51.94	87,882.48	
SIKA AG-REG	482	181.65	87,555.30	
ABB LTD	6,208	23.41	145,329.28	
GEBERIT AG-REG	110	523.20	57,552.00	
Schindler Holding AG	156	255.70	39,889.20	
Schindler Holding AG	136	245.80	33,428.80	
ADECCO GROUP AG(REG)	598	60.32	36,071.36	
SGS SA	19	2,766.00	52,554.00	
KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG	269	163.70	44,035.30	
CIE FINANCIERE RICHEMON-REG	1,797	75.72	136,068.84	
THE SWATCH GROUP AG-B	145	260.00	37,700.00	
BARRY CALLEBAUT AG-REG	20	2,184.00	43,680.00	
Lindt & Spruengli AG	7	8,205.00	57,435.00	
NESTLE SA-REGISTERED	10,546	108.90	1,148,459.40	
ALCON INC	1,461	59.99	87,645.39	
SONOVA HOLDING AG	260	242.40	63,024.00	
STRAUMANN HOLDING AG-REG	57	1,007.00	57,399.00	
LONZA GROUP AG-REG	330	395.10	130,383.00	
NOVARTIS AG-REG SHS	7,525	91.55	688,913.75	
ROCHE HOLDING AG-GENUSSS	2,565	323.50	829,777.50	
CREDIT SUISSE GROUP AG	9,525	13.20	125,730.00	
JULIUS BAER GROUP LTD	1,196	50.16	59,991.36	
PARTNERS GROUP HOLDING AG	82	900.40	73,832.80	
UBS GROUP AG	12,731	12.39	157,800.74	
Baloise Holding AG	284	177.70	50,466.80	
SWISS LIFE HOLDING AG	156	499.70	77,953.20	
SWISS RE AG	948	111.05	105,275.40	
ZURICH INSURANCE GROUP AG	486	413.00	200,718.00	
TEMENOS GROUP AG-REG	357	157.55	56,245.35	
SWISSCOM AG-REG	135	534.40	72,144.00	

スイスフラン小計	61,719		4,967,670.79 (558,316,520)	
	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	1,141	319.00	363,979.00	
BOLIDEN AB	1,613	243.00	391,959.00	
ALFA LAVAL AB	1,476	248.70	367,081.20	
ASSA ABLOY AB-B	3,034	240.20	728,766.80	
ATLAS COPCO AB-A SHS	1,733	386.50	669,804.50	
ATLAS COPCO AB-B SHS	2,047	340.60	697,208.20	
EPIROC AB-A	2,452	122.70	300,860.40	
EPIROC AB-B	2,265	120.25	272,366.25	
SANDVIK AB	3,078	187.60	577,432.80	
SKANSKA AB-B SHS	1,939	226.70	439,571.30	
SKF AB-B SHARES	1,549	184.60	285,945.40	
VOLVO AB-B SHS	3,763	156.60	589,285.80	
SECURITAS AB-B SHS	1,333	157.25	209,614.25	
Husqvarna AB	3,205	75.94	243,387.70	
HENNES & MAURITZ AB-B	2,649	188.94	500,502.06	
SWEDISH MATCH AB	710	545.00	386,950.00	
ESSITY AKTIEBOLAG-B	2,325	313.00	727,725.00	
NORDEA BANK ABP	10,327	76.51	790,118.77	
SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A	7,783	92.48	719,771.84	
SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS	6,073	94.46	573,655.58	
Swedbank AB	3,485	134.75	469,603.75	
Industrivarden AB	1,262	232.00	292,784.00	
INVESTOR AB-B SHS	1,125	539.60	607,050.00	
KINNEVIK AB-B	1,447	234.60	339,466.20	
ERICSSON LM-B SHS	10,771	79.70	858,448.70	
HEXAGON AB-B SHS	1,148	560.40	643,339.20	
Millicom International Cellular SA	636	451.40	287,090.40	
TELE2 AB-B SHS	3,083	148.50	457,825.50	
TELIA COMPANY AB	10,160	41.29	419,506.40	
スウェーデンクローネ小計	93,612		14,211,100.00 (162,006,540)	
	銘柄数	29		
	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	2,681	179.80	482,043.80	
NORSK HYDRO ASA	10,693	30.46	325,708.78	
YARA INTERNATIONAL ASA	636	338.70	215,413.20	

SCHIBSTED ASA-B SHS	1,116	269.80	301,096.80	
MOWI ASA	2,154	224.30	483,142.20	
ORKLA ASA	3,259	88.74	289,203.66	
GJENSIDIGE FORSIKRING ASA	1,579	200.20	316,115.80	
TELENOR ASA	3,058	167.00	510,686.00	
ノルウェークローネ小計	25,176		2,923,410.24 (35,227,093)	
	銘柄数	8		
	比率	0.2%	0.2%	
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	482	508.60	245,145.20	
NOVOZYMES A/S-B SHARES	785	354.90	278,596.50	
VESTAS WIND SYSTEMS A/S	752	670.00	503,840.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-A	20	8,150.00	163,000.00	
AP MOLLER-MAERSK A/S-B	33	8,622.00	284,526.00	
DSV PANALPINA A/S	808	758.40	612,787.20	
PANDORA A/S	461	375.40	173,059.40	
CARLSBERG AS-B	452	1,038.50	469,402.00	
COLOPLAST-B	524	857.40	449,277.60	
DEMANT A/S	938	224.00	210,112.00	
H LUNDBECK A/S	716	277.10	198,403.60	
NOVO NORDISK A/S-B	6,320	418.85	2,647,132.00	
DANSKE BANK A/S	3,195	109.60	350,172.00	
ORSTED A/S	772	749.60	578,691.20	
デンマーククローネ小計	16,258		7,164,144.70 (115,342,729)	
	銘柄数	14		
	比率	0.7%	0.7%	
豪ドル	株	豪ドル	豪ドル	
CALTEX AUSTRALIA LIMITED	1,205	35.12	42,319.60	
ORIGIN ENERGY LIMITED	7,799	8.55	66,681.45	
SANTOS LTD	9,771	8.84	86,375.64	
WOODSIDE PETROLEUM LTD	2,530	35.39	89,536.70	
ALUMINA LTD	18,920	2.25	42,570.00	
BHP GROUP LIMITED	10,971	40.45	443,776.95	
FORTESCUE METALS GROUP LTD	5,000	12.48	62,400.00	
INCITEC PIVOT LTD	13,698	3.40	46,573.20	
NEWCREST MINING LIMITED	2,940	31.98	94,021.20	
ORICA LTD	2,565	23.00	58,995.00	
RIO TINTO LIMITED	1,551	103.18	160,032.18	
SOUTH32 LTD	27,981	2.73	76,388.13	
BRAMBLES LTD	6,365	12.32	78,416.80	

SEEK LTD	1,898	24.01	45,570.98	
SYDNEY AIRPORT	7,039	8.43	59,338.77	
TRANSURBAN GROUP	11,572	15.89	183,879.08	
CROWN RESORTS LIMITED	3,355	12.04	40,394.20	
FLIGHT CENTRE TRAVEL GROUP LTD	535	41.47	22,186.45	
TABCORP HOLDINGS LIMITED	14,393	4.75	68,366.75	
WESFARMERS LIMITED	3,349	44.91	150,403.59	
COLES GROUP LTD	4,948	16.30	80,652.40	
WOOLWORTHS GROUP LTD	3,826	40.84	156,253.84	
COCA-COLA AMATIL LIMITED	3,503	11.94	41,825.82	
TREASURY WINE ESTATES LTD	3,779	17.70	66,888.30	
COCHLEAR LIMITED	315	236.05	74,355.75	
SONIC HEALTHCARE LTD	2,459	31.22	76,769.98	
CSL LIMITED	1,753	310.70	544,657.10	
AUST AND NZ BANKING GROUP LTD	9,221	25.90	238,823.90	
COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA	6,275	84.94	532,998.50	
NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD	10,231	25.80	263,959.80	
WESTPAC BANKING CORPORATION	11,760	25.21	296,469.60	
AMP LIMITED	15,418	1.86	28,677.48	
AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE	1,031	85.45	88,098.95	
MACQUARIE GROUP LTD	1,135	145.86	165,551.10	
INSURANCE AUSTRALIA GROUP	8,865	7.30	64,714.50	
QBE INSURANCE GROUP LIMITED	6,350	13.77	87,439.50	
SUNCORP GROUP LTD	5,560	12.99	72,224.40	
LENDLEASE GROUP	2,856	18.69	53,378.64	
COMPUTERSHARE LIMITED	2,719	17.89	48,642.91	
TELSTRA CORP LTD	20,781	3.88	80,630.28	
AGL ENERGY LTD	3,070	19.96	61,277.20	
豪ドル小計	279,292		5,042,516.62 (374,658,984)	
	銘柄数	41		
	比率	2.2%	2.4%	
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	5,670	8.88	50,377.95	
A2 MILK CO LTD	2,965	16.01	47,469.65	
RYMAN HEALTHCARE LTD	3,391	16.62	56,358.42	
SPARK NEW ZEALAND LTD	8,586	4.58	39,323.88	
MERIDIAN ENERGY LTD	11,495	5.22	60,003.90	
ニュージーランドドル小計	32,107		253,533.80 (18,208,797)	
	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	9,328	74.35	693,536.80
NWS HOLDINGS LTD	19,500	10.90	212,550.00
TECHTRONIC INDUSTRIES CO	7,500	66.80	501,000.00
MTR CORPORATION	9,000	46.15	415,350.00
YUE YUEN INDUSTRIAL HLDG	6,000	23.30	139,800.00
Galaxy Entertainment Group Limited	10,000	56.05	560,500.00
Sands China Ltd	12,400	41.30	512,120.00
WH Group Limited	47,000	7.96	374,120.00
BANK OF EAST ASIA	14,440	17.66	255,010.40
BOC HONG KONG HOLDINGS LTD	19,500	27.35	533,325.00
HANG SENG BANK	2,400	165.50	397,200.00
HONG KONG EXCHANGES & CLEAR	4,000	271.40	1,085,600.00
AIA GROUP LTD	43,400	83.00	3,602,200.00
CK ASSET HOLDINGS LIMITED	10,828	53.40	578,215.20
HENDERSON LAND DEVELOPMENT	9,403	37.05	348,381.15
SINO LAND CO	25,800	11.22	289,476.00
SUN HUNG KAI PROPERTIES	6,500	115.70	752,050.00
SWIRE PACIFIC LTD A	3,500	73.00	255,500.00
SWIRE PROPERTIES LTD	10,600	26.40	279,840.00
HKT Trust / HKT Ltd	27,000	11.74	316,980.00
CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI)	4,500	56.00	252,000.00
CLP HOLDINGS LIMITED	5,500	82.60	454,300.00
HONG KONG & CHINA GAS	34,925	15.50	541,337.50
POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED	7,000	57.55	402,850.00
ASM PACIFIC TECHNOLOGY	1,800	115.50	207,900.00
香港ドル小計	351,824		13,961,142.05 (195,874,822)
	銘柄数	25	
	比率	1.2%	1.2%
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	8,400	6.75	56,700.00
SINGAPORE TECH ENGINEERING	11,300	4.12	46,556.00
COMFORTDELGRO CORP LTD	13,800	2.22	30,636.00
SINGAPORE AIRLINES LTD	5,300	8.82	46,746.00
GENTING SINGAPORE LTD	34,100	0.91	31,031.00
SINGAPORE PRESS HOLDINGS	16,500	2.09	34,485.00
DBS GROUP HOLDINGS LTD	6,000	26.20	157,200.00
OVERSEA-CHINESE BANKING CORP	8,500	11.10	94,350.00
UNITED OVERSEAS BANK	4,100	26.35	108,035.00
CITY DEVELOPMENTS	3,900	10.92	42,588.00
UNITED OVERSEAS LAND LTD	4,900	8.36	40,964.00
SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS	28,900	3.39	97,971.00

シンガポールドル小計	145,700		787,262.00 (63,453,317)	
	銘柄数	12		
	比率	0.4%	0.4%	
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	14.38	51,063.38	
BANK HAPOLIM BM	3,708	29.40	109,015.20	
BANK LEUMI LE-ISRAEL	5,116	24.94	127,593.04	
MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD	700	93.30	65,310.00	
NICE LTD	255	613.00	156,315.00	
イスラエルシュケル小計	13,330		509,296.62 (16,063,215)	
	銘柄数	5		
	比率	0.1%	0.1%	
合計	株 3,946,714		円 15,879,805,238 (15,879,805,238)	

(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	1,676	398,083.52	
		AVALONBAY COMMUNITIES INC	412	90,363.96	
		BOSTON PROPERTIES INC	420	59,644.20	
		CAMDEN PROPERTY TRUST	513	56,963.52	
		CROWN CASTLE INTL CORP	1,596	239,240.40	
		DIGITAL REALTY TRUST INC	816	104,660.16	
		DUKE REALTY CORP	1,950	70,395.00	
		EQUINIX INC	339	200,674.44	
		EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC	943	67,971.44	
		EQUITY RESIDENTIAL	1,220	100,967.20	
		ESSEX PROPERTY TRUST INC	245	75,820.15	
		EXTRA SPACE STORAGE INC	674	74,766.82	
		FEDERAL REALTY INVS TRUST	411	53,351.91	
		HEALTHPEAK PROPERTIES INC	2,261	83,657.00	
		HOST HOTELS & RESORTS INC	3,306	56,466.48	
		IRON MOUNTAIN INC	1,621	51,142.55	
		KIMCO REALTY CORP	2,387	48,575.45	
LIBERTY PROPERTY TRUST	863	55,974.18			
MEDICAL PROPERTIES TRUST INC	2,100	47,040.00			

	MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC	539	73,821.44	
	NATIONAL RETAIL PROPERTIES INC	921	52,045.71	
	PROLOGIS INC	2,368	227,683.20	
	PUBLIC STORAGE	463	103,929.61	
	REALTY INCOME CORP	987	76,127.31	
	REGENCY CENTERS CORP	962	61,361.17	
	SBA COMMUNICATIONS CORP	474	119,993.10	
	SIMON PROPERTY GROUP INC	960	139,027.20	
	SL GREEN REALTY CORP	346	32,302.56	
	UDR INC	1,538	74,100.84	
	VENTAS INC	1,098	64,595.34	
	VORNADO REALTY TRUST	718	48,328.58	
	WELLTOWER INC	1,336	116,165.20	
	WEYERHAEUSER CO	2,773	84,659.69	
	WP CAREY INC	825	69,580.50	
米ドル小計		40,061	3,279,479.83 (357,660,070)	
	銘柄数	34		
	比率	2.1%	80.9%	
加ドル	RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST	1,510	加ドル 41,449.50	
加ドル小計		1,510	41,449.50 (3,437,821)	
	銘柄数	1		
	比率	0.0%	0.8%	
ユーロ	COVIVIO	315	ユーロ 34,020.00	
	GECINA SA	267	45,203.10	
	KLEPIERRE	1,044	34,065.72	
	UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD	387	51,084.00	
ユーロ小計		2,013	164,372.82 (19,774,050)	
	銘柄数	4		
	比率	0.1%	4.5%	
英ポンド	BRITISH LAND CO PLC	5,456	英ポンド 32,201.31	
	LAND SECURITIES GROUP PLC	4,083	39,605.10	
	SEGRO PLC	5,525	50,597.95	
英ポンド小計		15,064	122,404.36 (17,443,845)	
	銘柄数	3		
	比率	0.1%	3.9%	

豪ドル	DEXUS	4,753	豪ドル 60,220.51
	GOODMAN GROUP	7,538	113,220.76
	GPT GROUP	8,597	51,152.15
	MIRVAC GROUP	22,399	77,948.52
	SCENTRE GROUP	17,768	69,650.56
	STOCKLAND	14,113	70,988.39
豪ドル小計		75,168	443,180.89 (32,928,340)
	銘柄数	6	
	比率	0.2%	7.4%
香港ドル	LINK REIT	6,500	香港ドル 530,400.00
香港ドル小計		6,500	530,400.00 (7,441,512)
	銘柄数	1	
	比率	0.0%	1.7%
シンガポールドル	CAPITALAND MALL TRUST	17,400	シンガポールドル 45,588.00
シンガポールドル小計		17,400	45,588.00 (3,674,392)
	銘柄数	1	
	比率	0.0%	0.8%
投資証券合計			円 442,360,030 (442,360,030)
合計			円 442,360,030 (442,360,030)

(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

[2020年 1月27日現在]		
区 分	注記 番号	金額(円)
資産の部		
流動資産		
コール・ローン		119,554,673
国債証券		15,514,593,340

地方債証券		886,620,100
特殊債証券		203,610,000
社債証券		668,878,590
未収利息		22,353,339
前払費用		5,099,230
流動資産合計		17,420,709,272
資産合計		17,420,709,272
負債の部		
流動負債		
未払解約金		5,857,291
未払利息		69
流動負債合計		5,857,360
負債合計		5,857,360
純資産の部		
元本等		
元本	1	13,281,789,429
剰余金		
剰余金又は欠損金()		4,133,062,483
元本等合計		17,414,851,912
純資産合計		17,414,851,912
負債純資産合計		17,420,709,272

(2) 注記表

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27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、特殊債証券及び社債証券 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)、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	[2020年 1月27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	9,480,647,072円
同期中における追加設定元本額	4,300,013,084円
同期中における一部解約元本額	498,870,727円
同期末における元本額	13,281,789,429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 >	874,925,437円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	3,006,547,739円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	2,434,120,848円

円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	3,377,619,870円
L P S 4 資産分散ファンド (慎重型)	45,183,668円
L P S 4 資産分散ファンド (安定重視型)	39,274,198円
L P S 4 資産分散ファンド (バランス型)	59,757,818円
L P S 4 資産分散ファンド (成長重視型)	40,612,987円
L P S 4 資産分散ファンド (積極型)	25,254,825円
東京海上セレクション・日本債券インデックス	2,408,548,223円
東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型)	169,321,271円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	23,543,677円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	1,015,543円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	429,224円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	191,219円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	243,412円
T M A 日本債券インデックスV A < 適格機関投資家限定 >	168,872,008円
T M A 世界バランスファンド35 V A < 適格機関投資家限定 >	4,397,223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 >	133,916,828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 >	468,013,411円
計	13,281,789,429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	13,281,789,429口

(注) *は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

(金融商品に関する注記)

1. 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 1月27日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。

(有価証券に関する注記)

(自 2019年9月20日 至 2020年1月27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	39,168,410
地方債証券	330,500
特殊債券	219,000
社債券	405,617
合計	38,213,293

(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11月12日から2020年1月27日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2020年 1月27日現在]

1口当たり純資産額	1.3112円
(1万口当たり純資産額)	13,112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400回利付国債(2年)	640,000,000	641,964,800	
	第403回利付国債(2年)	300,000,000	301,107,000	
	第406回利付国債(2年)	60,000,000	60,259,200	
	第129回利付国債(5年)	170,000,000	170,685,100	
	第130回利付国債(5年)	270,000,000	271,255,500	
	第131回利付国債(5年)	400,000,000	402,144,000	
	第132回利付国債(5年)	370,000,000	372,264,400	
	第133回利付国債(5年)	440,000,000	443,036,000	
	第134回利付国債(5年)	60,000,000	60,453,000	
	第135回利付国債(5年)	440,000,000	443,608,000	
	第136回利付国債(5年)	430,000,000	433,809,800	
	第137回利付国債(5年)	250,000,000	252,380,000	
	第139回利付国債(5年)	170,000,000	171,805,400	
	第140回利付国債(5年)	285,000,000	288,149,250	
	第141回利付国債(5年)	320,000,000	323,664,000	
	第5回利付国債(40年)	34,000,000	50,719,840	
	第7回利付国債(40年)	45,000,000	63,915,750	
	第8回利付国債(40年)	10,000,000	13,327,200	
	第9回利付国債(40年)	86,000,000	86,271,760	
	第10回利付国債(40年)	34,000,000	39,948,980	
	第11回利付国債(40年)	93,000,000	106,188,330	
	第12回利付国債(40年)	102,000,000	105,630,180	
	第320回利付国債(10年)	50,000,000	51,081,500	
	第324回利付国債(10年)	50,000,000	51,140,000	
	第327回利付国債(10年)	55,000,000	56,526,250	
	第335回利付国債(10年)	100,000,000	103,063,000	
	第339回利付国債(10年)	30,000,000	30,905,100	
	第340回利付国債(10年)	60,000,000	61,895,400	
	第341回利付国債(10年)	405,000,000	415,959,300	
	第342回利付国債(10年)	360,000,000	365,688,000	
	第343回利付国債(10年)	40,000,000	40,645,200	
	第344回利付国債(10年)	30,000,000	30,503,100	
	第345回利付国債(10年)	335,000,000	340,832,350	
	第346回利付国債(10年)	250,000,000	254,417,500	
	第347回利付国債(10年)	220,000,000	223,942,400	

第348回利付国債(10年)	360,000,000	366,534,000	
第349回利付国債(10年)	80,000,000	81,434,400	
第350回利付国債(10年)	140,000,000	142,472,400	
第351回利付国債(10年)	30,000,000	30,520,500	
第352回利付国債(10年)	150,000,000	152,548,500	
第353回利付国債(10年)	210,000,000	213,479,700	
第354回利付国債(10年)	240,000,000	243,864,000	
第355回利付国債(10年)	300,000,000	304,677,000	
第356回利付国債(10年)	180,000,000	182,703,600	
第3回利付国債(30年)	20,000,000	24,830,600	
第5回利付国債(30年)	10,000,000	12,494,500	
第22回利付国債(30年)	10,000,000	13,757,300	
第28回利付国債(30年)	20,000,000	28,225,000	
第29回利付国債(30年)	60,000,000	84,027,000	
第31回利付国債(30年)	110,000,000	151,582,200	
第32回利付国債(30年)	110,000,000	154,570,900	
第33回利付国債(30年)	20,000,000	27,056,600	
第34回利付国債(30年)	60,000,000	83,997,600	
第35回利付国債(30年)	20,000,000	27,298,400	
第36回利付国債(30年)	97,000,000	133,029,680	
第37回利付国債(30年)	100,000,000	135,651,000	
第38回利付国債(30年)	20,000,000	26,810,200	
第39回利付国債(30年)	20,000,000	27,322,800	
第40回利付国債(30年)	25,000,000	33,650,500	
第42回利付国債(30年)	208,000,000	276,346,720	
第46回利付国債(30年)	93,000,000	119,787,720	
第47回利付国債(30年)	20,000,000	26,289,600	
第48回利付国債(30年)	110,000,000	139,309,500	
第49回利付国債(30年)	30,000,000	38,065,800	
第50回利付国債(30年)	30,000,000	33,594,900	
第51回利付国債(30年)	50,000,000	49,635,500	
第52回利付国債(30年)	143,000,000	149,136,130	
第56回利付国債(30年)	35,000,000	39,167,100	
第57回利付国債(30年)	52,000,000	58,242,080	
第58回利付国債(30年)	80,000,000	89,565,600	
第59回利付国債(30年)	40,000,000	43,728,400	
第62回利付国債(30年)	124,000,000	128,747,960	
第63回利付国債(30年)	5,000,000	5,053,150	
第64回利付国債(30年)	120,000,000	121,123,200	
第50回利付国債(20年)	60,000,000	61,407,000	
第51回利付国債(20年)	90,000,000	92,697,300	
第53回利付国債(20年)	20,000,000	20,852,200	
第60回利付国債(20年)	20,000,000	20,906,800	

第66回利付国債(20年)	60,000,000	64,594,200	
第67回利付国債(20年)	30,000,000	32,568,600	
第70回利付国債(20年)	40,000,000	44,509,200	
第71回利付国債(20年)	60,000,000	66,233,400	
第74回利付国債(20年)	40,000,000	44,436,000	
第75回利付国債(20年)	30,000,000	33,496,200	
第76回利付国債(20年)	10,000,000	11,061,800	
第80回利付国債(20年)	40,000,000	44,892,000	
第82回利付国債(20年)	30,000,000	33,842,100	
第84回利付国債(20年)	80,000,000	90,226,400	
第85回利付国債(20年)	20,000,000	22,788,400	
第90回利付国債(20年)	65,000,000	75,250,500	
第99回利付国債(20年)	20,000,000	23,538,000	
第100回利付国債(20年)	70,000,000	83,280,400	
第105回利付国債(20年)	20,000,000	23,815,600	
第113回利付国債(20年)	20,000,000	24,178,600	
第116回利付国債(20年)	50,000,000	61,402,500	
第117回利付国債(20年)	92,000,000	112,044,040	
第123回利付国債(20年)	160,000,000	197,028,800	
第127回利付国債(20年)	50,000,000	60,650,000	
第130回利付国債(20年)	120,000,000	145,065,600	
第133回利付国債(20年)	95,000,000	115,199,850	
第136回利付国債(20年)	90,000,000	107,220,600	
第139回利付国債(20年)	145,000,000	173,105,350	
第141回利付国債(20年)	110,000,000	133,421,200	
第144回利付国債(20年)	90,000,000	107,035,200	
第145回利付国債(20年)	118,000,000	143,804,240	
第146回利付国債(20年)	90,000,000	109,974,600	
第147回利付国債(20年)	70,000,000	84,735,700	
第148回利付国債(20年)	40,000,000	47,974,800	
第150回利付国債(20年)	177,000,000	210,511,410	
第151回利付国債(20年)	48,000,000	55,788,960	
第152回利付国債(20年)	85,000,000	98,870,300	
第153回利付国債(20年)	60,000,000	70,806,600	
第154回利付国債(20年)	230,000,000	268,347,900	
第156回利付国債(20年)	153,000,000	159,277,590	
第157回利付国債(20年)	100,000,000	100,799,000	
第158回利付国債(20年)	111,000,000	117,308,130	
第160回利付国債(20年)	70,000,000	76,305,600	
第161回利付国債(20年)	120,000,000	128,715,600	
第162回利付国債(20年)	150,000,000	160,911,000	
第164回利付国債(20年)	160,000,000	168,696,000	
第165回利付国債(20年)	110,000,000	115,956,500	

	第167回利付国債(20年)	10,000,000	10,526,900	
	第168回利付国債(20年)	68,000,000	70,247,400	
	第169回利付国債(20年)	8,000,000	8,111,440	
	第170回利付国債(20年)	50,000,000	50,657,500	
国債証券	合計	14,381,000,000	15,514,593,340	
地方債証券	第781回東京都公募公債	100,000,000	101,172,000	
	平成30年度第11回北海道公募公債(5年)	100,000,000	100,166,000	
	第26回神奈川県公募公債(20年)	20,000,000	23,607,600	
	平成28年度第2回京都府公募公債(15年)	50,000,000	50,532,500	
	平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	101,546,000	
	平成25年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	102,823,000	
	平成27年度第3回福岡県公募公債	200,000,000	205,960,000	
	平成22年度第3回横浜市公募公債	100,000,000	100,756,000	
	平成29年度第1回広島市公募公債(5年)	100,000,000	100,057,000	
地方債証券	合計	870,000,000	886,620,100	
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	102,149,000	
	第348回政府保証日本高速道路保有・債務返済機構債券	100,000,000	101,461,000	
特殊債券	合計	200,000,000	203,610,000	
社債券	第106回株式会社日本政策投資銀行無担保社債	100,000,000	100,158,000	
	第33回道路債券	100,000,000	137,797,000	
	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,558,000	42,982,962	
	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	44,837,000	47,496,282	
	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	42,537,000	45,042,854	
	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	43,638,000	46,261,516	
	第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	35,391,000	36,198,976	
	第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	102,659,000	
第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	110,282,000		
社債券	合計	606,961,000	668,878,590	
合計		16,057,961,000	17,273,702,030	

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】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

2020年1月31日現在

種類	金額
資産総額	4,721,348 円
負債総額	160 円
純資産総額 (-)	4,721,188 円
発行済数量	4,514,529 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0458 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

2020年1月31日現在

種類	金額
資産総額	2,148,326 円
負債総額	72 円
純資産総額 (-)	2,148,254 円
発行済数量	2,051,072 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0474 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

2020年1月31日現在

種類	金額
資産総額	1,130,279 円
負債総額	36 円
純資産総額 (-)	1,130,243 円
発行済数量	1,075,709 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0507 円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

2020年1月31日現在

種類	金額
資産総額	2,792,090 円
負債総額	59 円
純資産総額 (-)	2,792,031 円
発行済数量	2,653,094 口
1 単位当たり純資産額 (/)	1.0524 円

(ご参考：親投資信託の現況)

TMA日本株TOPIXマザーファンド

2020年1月31日現在

種類	金額
----	----

資産総額	30,981,407,714 円
負債総額	70,053,125 円
純資産総額(-)	30,911,354,589 円
発行済数量	22,027,694,704 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.4033 円

TMA 外国債券インデックスマザーファンド

2020年1月31日現在

種類	金額
資産総額	5,146,844,498 円
負債総額	80,182,194 円
純資産総額(-)	5,066,662,304 円
発行済数量	3,128,135,896 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.6197 円

TMA 外国株式インデックスマザーファンド

2020年1月31日現在

種類	金額
資産総額	17,510,506,486 円
負債総額	772,816,479 円
純資産総額(-)	16,737,690,007 円
発行済数量	5,998,606,309 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.7903 円

TMA 日本債券インデックスマザーファンド

2020年1月31日現在

種類	金額
資産総額	17,754,976,728 円
負債総額	269,324,697 円
純資産総額(-)	17,485,652,031 円
発行済数量	13,323,636,186 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.3124 円

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

<更新後>

2020年1月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

委託会社業務執行上重要な事項は、取締役会の決議をもって決定します。取締役の選任は株主総会において、議決権を行使することができる株主の3分の1以上を有する株主が出席し、その議決権の過半数をもってこれを行い、累積投票によらないものとします。取締役の任期は、選任後1年内に終了する事業年度のうち最終のものに関する定時株主総会の終結の時までとします。取締役会はその決議をもって、取締役中より代表取締役を選任します。

投資信託の投資運用の意思決定プロセスは以下の通りです。

運用本部で運用計画案、収益分配方針案等の運用の基本方針案を作成します。

運用の基本方針は、運用本部長を委員長とする投資政策委員会で投資環境見通し等をふまえて決定されます。

決定された運用の基本方針に基づき、具体的運用計画を策定し、運用を行います。

売買の執行はトレーディング部が行います。

運用部門とは独立した管理部門にて運用評価、ガイドライン遵守状況のチェックを行い、管理本部長を委員長とし運用管理部を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。

運用管理委員会から投資政策委員会へ運用評価、ガイドライン遵守状況がフィードバックされ次の基本方針決定に生かされます。

2【事業の内容及び営業の概況】

<更新後>

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

2020年1月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	180	3,070,837
単位型公社債投資信託	2	7,157
単位型株式投資信託	5	21,662
合計	187	3,099,657

3【委託会社等の経理状況】

<更新後>

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間(2019年4月1日から2019年9月30日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

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

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

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。	* 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	建物 81,793千円
器具備品 424,930千円	器具備品 498,485千円
リース資産 3,395千円	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。	* 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 50,146千円	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	第34期
自 2017年4月1日	自 2018年4月1日
至 2018年3月31日	至 2019年3月31日

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

2. 金融商品の時価等に関する事項

第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 其他有価証券	43,545	43,545	-
(6)預り金	(43,264)	(43,264)	-
(7)未払金	(2,563,951)	(2,563,951)	-
(8)未払費用	(530,106)	(530,106)	-
(9)未払消費税等	(262,100)	(262,100)	-
(10)未払法人税等	(960,000)	(960,000)	-

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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)		(単位：千円)	
	貸借対照表計上額		貸借対照表計上額
子会社株式	1,640,302	子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747	関連会社株式	32,747
その他の関係会社 有価証券	31,200	その他の関係会社 有価証券	31,200
敷金	450,632	敷金	450,632
その他長期差入保証金	10,865	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
<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p>	<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p>
<p>2. その他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>	<p>2. その他有価証券</p> <p>(単位：千円)</p>

区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額	区分	貸借対照表 計上額	取得原価	差額
貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えるもの 証券投資 信託	27,151	21,652	5,498	貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えるもの 証券投資 信託	27,344	22,052	5,292
貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えないもの 証券投資 信託	16,394	18,178	1,783	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	43,545	39,831	3,714	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 該当事項はありません。				3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左			

(退職給付関係)

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

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

(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いません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	19,316,713千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	19,316,713千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	4,213,116千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	4,213,116千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

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

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

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	20,778,021千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	20,778,021千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	3,363,382千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	3,363,382千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

[次へ](#)

中間財務諸表
中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (2019年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		16,391,035
前払費用		169,413
未収委託者報酬		2,264,946
未収収益		2,409,775
未収入金		22,553
その他の流動資産		23,480
流動資産計		21,281,205
固定資産		
有形固定資産	* 1	572,176
建物		404,959
器具備品		167,216
無形固定資産		17,518
電話加入権		3,795
ソフトウェア仮勘定		13,722
投資その他の資産		3,141,678
投資有価証券		77,633
関係会社株式		1,673,049
その他の関係会社有価証券		31,200
長期前払費用		23,029
敷金		450,632
その他長期差入保証金		10,030
繰延税金資産		876,103
固定資産計		3,731,372
資産合計		25,012,578
負債の部		
流動負債		
未払金		2,027,310
未払手数料		1,029,360
その他未払金		997,949
未払費用		354,421
未払消費税等	* 2	129,230
未払法人税等		1,043,000
預り金		49,969
前受収益		14,362
賞与引当金		481,550
その他の流動負債		12
流動負債計		4,099,857
固定負債		
退職給付引当金		732,354
固定負債計		732,354
負債合計		4,832,211
純資産の部		
株主資本		20,178,621
資本金		2,000,000

資本剰余金	400,000
その他資本剰余金	400,000
利益剰余金	17,778,621
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	17,278,621
特別償却準備金	5
繰越利益剰余金	17,278,615
評価・換算差額等	1,745
その他有価証券評価差額金	1,745
純資産合計	20,180,366
負債・純資産合計	25,012,578

中間損益計算書

(単位：千円)

当中間会計期間	
(自 2019年4月1日	
至 2019年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	7,524,393
運用受託報酬	4,252,315
投資助言報酬	30,928
その他営業収益	186,820
営業収益計	11,994,458
営業費用	
支払手数料	3,540,165
広告宣伝費	141,048
調査費	2,738,418
調査費	1,339,056
委託調査費	1,399,361
委託計算費	62,315
営業雑経費	144,140
通信費	18,197
印刷費	98,645
協会費	13,896
諸会費	6,343
図書費	7,057
営業費用計	6,626,088
一般管理費	
給料	1,473,323
役員報酬	56,880
給料・手当	1,261,518
賞与	154,925
交際費	9,299
寄付金	2,231
旅費交通費	94,102
租税公課	75,821
不動産賃借料	187,847
退職給付費用	393,207
賞与引当金繰入	481,550
固定資産減価償却費	* 1 44,275
法定福利費	279,063
福利厚生費	9,776
諸経費	254,123

一般管理費計	3,304,621
営業利益	2,063,748
営業外収益	
受取利息	61
受取配当金	86
雑益	6,429
営業外収益計	6,577
営業外費用	
為替差損	16,795
雑損	629
営業外費用計	17,424
経常利益	2,052,900
特別損失	
器具備品除却損	0
特別損失計	0
税引前中間純利益	2,052,900
法人税、住民税及び事業税	975,749
法人税等調整額	343,190
法人税等合計	632,559
中間純利益	1,420,341

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2019年4月1日 至 2019年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		その他利益 剰余金	
					特別償却 準備金	繰越利益 剰余金
当期首残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	16	17,875,907
当中間期変動額						
剰余金の配当						2,017,644
特別償却準備金の取崩					10	10
中間純利益						1,420,341
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	10	597,292
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	5	17,278,615

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021
当中間期変動額					
剰余金の配当	2,017,644	2,017,644			2,017,644
特別償却準備金の取崩	-	-			-

中間純利益	1,420,341	1,420,341			1,420,341
株主資本以外の項目の 当中間期変動額(純額)			351	351	351
当中間期変動額合計	597,302	597,302	351	351	597,654
当中間期末残高	17,778,621	20,178,621	1,745	1,745	20,180,366

注記事項

重要な会計方針

	当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)
1. 資産の評価基準及び 評価方法	<p>有価証券</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 時価のあるもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法(評価差額は全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 時価を把握することが極めて困難と認められるもの 移動平均法による原価法</p>
2. 固定資産の減価償却 の方法	<p>有形固定資産 定率法を採用しております。ただし、2016年4月1日以降に取得した建物附属設備については、定額法を採用しております。また、取得価額が10万円以上20万円未満の少額減価償却資産については、一括償却資産として3年間で均等償却する方法を採用しております。</p>
3. 引当金の計上基準	<p>(1) 賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。</p>

	<p>数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法</p> <p>数理計算上の差異は、各会計年度の発生時における従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により按分した額をそれぞれ発生の翌会計年度から費用処理しております。</p> <p>過去勤務費用は、その発生時の従業員の平均残存勤務期間以内の一定の年数（10年）による定額法により費用処理しております。</p>
4. 消費税等の会計処理方法	消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(追加情報)

<p>当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)</p>
<p>(退職給付債務の計算方法の変更)</p> <p>当社は、退職給付債務の計算方法について、従来まで期末自己都合要支給額を退職給付債務とする簡便法によっておりましたが、従業員数の増加に伴い当事業年度より原則的な方法に変更しております。この変更に伴い、当中間会計期間末における退職給付引当金が319,413千円増加し、同額を退職給付費用として一般管理費に計上しております。</p>

(中間貸借対照表関係)

	<p>当中間会計期間 (2019年9月30日現在)</p>
1 有形固定資産の減価償却累計額	<p>建物 97,396千円 器具備品 498,508千円</p>
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

(中間損益計算書関係)

	<p>当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)</p>
1 減価償却実施額	有形固定資産 44,275千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

	<p>当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)</p>			
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300

2. 配当に関する事項

配当金支払額

2019年6月28日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

- (イ) 配当金の総額・・・・・・・・・・2,017,644千円
- (ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・52,680円
- (ハ) 基準日・・・・・・・・・・2019年3月31日
- (ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・2019年6月28日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2019年9月30日現在)

金融商品の時価等に関する事項

2019年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含まれておりません(注2参照)。

(単位:千円)

	中間貸借対照表計上額(＊)	時価(＊)	差額
(1)現金・預金	16,391,035	16,391,035	-
(2)未収委託者報酬	2,264,946	2,264,946	-
(3)未収収益	2,409,775	2,409,775	-
(4)未収入金	22,553	22,553	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	77,633	77,633	-
(6)預り金	(49,969)	(49,969)	-
(7)未払金	(2,027,310)	(2,027,310)	-
(8)未払費用	(354,421)	(354,421)	-
(9)未払消費税等	(129,230)	(129,230)	-
(10)未払法人税等	(1,043,000)	(1,043,000)	-

(＊)負債で計上されているものについては、()で示しております。

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

- (1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(6)預り金、(7)未払金、(8)未払費用、(9)未払消費税等並びに(10)未払法人税等

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

(5)投資有価証券

時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1.資産の評価基準及び評価方法」に記載しております。

(注2)子会社株式(中間貸借対照表計上額 1,640,302千円)及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 32,747千円)及びその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額 31,200千円)及び敷金(中間貸借対照表計上額 450,632千円)並びにその他長期差入保証金(中間貸借対照表計上額 10,030千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

(有価証券関係)

当中間会計期間(2019年9月30日現在)

1.子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券

子会社株式及び関連会社株式(中間貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(中間貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。

2.その他有価証券

	種類	中間貸借対照表計上額(千円)	取得原価(千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	証券投資信託	41,234	35,140	6,094

中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	証券投資信託	36,399	39,977	3,578
合計		77,633	75,118	2,515

(セグメント情報等)

[セグメント情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

当社は「投資信託及び投資法人に関する法律」に定める投資信託委託会社であり証券投資信託の設定を行うとともに「金融商品取引法」に定める金融商品取引業者として運用(投資運用業)を行っております。また「金融商品取引法」に定める投資助言・代理業を行っております。

当社は、投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメントを報告セグメントとしております。従いまして、開示対象となるセグメントはありませんので、記載を省略しております。

[関連情報]

当中間会計期間(自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)

1. 製品及びサービスごとの情報

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

2. 地域ごとの情報

(1) 営業収益

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

(2) 有形固定資産

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

3. 主要な顧客ごとの情報

投資信託の名称	委託者報酬 (単位:千円)	関連するセグメント名
東京海上・円資産バランスファンド(毎月決算型)	2,440,965	投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント

(1株当たり情報)

当中間会計期間 (自 2019年4月1日 至 2019年9月30日)	
1株当たり純資産額	526,902円52銭
1株当たり中間純利益金額	37,084円62銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	20,180,366千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	20,180,366千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株
1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益金額	1,420,341千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	1,420,341千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

<更新後>

(1) 受託会社

- ・ 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・ 資本金の額 324,279百万円(2019年9月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円(2019年9月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額()	事業の内容
株式会社八十二銀行	52,243百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
三菱UFJ信託銀行株式会社	324,279百万円	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。
東京海上日動火災保険株式会社	101,994百万円	保険業法に基づき損害保険業を営んでいます。

() 2019年9月末日現在。

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

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年3月11日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2019年9月20日から2020年1月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035の2020年1月27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。

[次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年3月11日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2019年9月20日から2020年1月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045の2020年1月27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。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年3月11日

東京海上アセットマネジメント株式会社
取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2019年9月20日から2020年1月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055の2020年1月27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。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の監査報告書

2020年3月11日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwC あらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 久保 直毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2019年9月20日から2020年1月27日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

監査意見

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065の2020年1月27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。

[前へ](#) [次へ](#)

独立監査人の中間監査報告書

2019年12月2日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

指定有限責任社員 公認会計士 奈良昌彦
業務執行社員指定有限責任社員 公認会計士 久保直毅
業務執行社員

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2019年4月1日から2020年3月31日までの第35期事業年度の中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

中間財務諸表に対する経営者の責任

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

監査人の責任

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

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

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

中間監査意見

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2019年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間（2019年4月1日から2019年9月30日まで）の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

利害関係

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

以上

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

[前へ](#)