

## 【表紙】

【提出書類】	有価証券届出書
【提出先】	関東財務局長
【提出日】	2021年10月25日
【発行者名】	東京海上アセットマネジメント株式会社
【代表者の役職氏名】	代表取締役社長 後藤 俊夫
【本店の所在の場所】	東京都千代田区丸の内一丁目8番2号
【事務連絡者氏名】	尾崎 正幸
【電話番号】	03 - 3212 - 8421
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券に係るファンドの名称】	東京海上・円資産インデックスバランスファンド
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限 1兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

## 第一部【証券情報】

### (1)【ファンドの名称】

東京海上・円資産インデックスバランスファンド

（なお、愛称として「つみたて円奏会」という名称を用いる場合があります。以下「当ファンド」ということがあります。）

### (2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初の1口当たり元本は1円です。

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

### (3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

### (4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額

基準価額は、販売会社または委託会社に問い合わせることにより知ることができます。

委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）

東京海上アセットマネジメント サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

### (5)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

### (6)【申込単位】

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

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

販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。また、販売会社により取扱うコースが異なる場合があります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。（販売会社との間で定額購入サービスに関する契約を締結した場合、当該契約で規定する取得申込単位によるものとします。）

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

### (7)【申込期間】

2021年10月26日から2022年4月25日まで

上記申込期間中の毎営業日にお申込みを受け付けます。

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

### (8)【申込取扱場所】

販売会社の本・支店等で取扱います。ただし、一部取扱いを行わない支店等がある場合がありますので、販売会社の最寄りの本・支店等にお問い合わせください。なお、販売会社については、委託会社サービスデスクにお問い合わせください。

### (9)【払込期日】

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

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

**(10)【払込取扱場所】**

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

**(11)【振替機関に関する事項】**

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

**(12)【その他】**

申込の方法

- a. 受益権の取得申込は、販売会社において申込期間中の毎営業日に受け付けます。
- b. 取得申込者は、申込金額相当額の申込金を販売会社に支払うものとします。ただし、当ファンドは上記「(9)払込期日」にしたがい受託会社に払込まれた時点で初めて設定がなされ、取得申込者はその時点から当ファンドの当該設定にかかる受益者となります。申込金には利息を付けません。
- c. 取得申込の受付は、原則として午後3時までの受付分を当日分とし、この受付時間を過ぎてからの申込分は翌営業日の受付分とします。
- d. 上記にかかわらず、取引所( )における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。  
( )金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場をいいます(以下、本書において同じ。 )。
- e. 取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込を行うものとします。(ただし、既に取引口座をお持ちの場合を除きます。 )
- f. 分配金再投資コースの場合には、申込の際、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく(累積)投資に関する契約を締結する必要があります。  
上記の契約について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約等が用いられることがあります。この場合、当該別の名称に読替えるものとします(以下同じ。 )。
- g. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。

日本以外の地域における発行

該当ありません。

振替受益権について

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

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

## 第二部【ファンド情報】

### 第1【ファンドの状況】

#### 1【ファンドの性格】

##### (1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、信託財産の着実な成長と安定した収益の確保をめざして、「TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券」、「TMA日本株TOPIXマザーファンド受益証券」、「東京海上・東証REITマザーファンド受益証券」（それぞれをまたは総称して、以下「マザーファンド」ということがあります。）を主要投資対象として運用を行います。

「TMA」とは委託会社である「東京海上アセットマネジメント株式会社（TOKIO MARINE ASSET MANAGEMENT CO.,LTD.）」の略称です。

基本的性格

当ファンドは、追加型投信/国内/資産複合に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)
単位型投信	国内	株式
	海外	債券
追加型投信	内外	不動産投信
		その他資産 ( )
		資産複合

属性区分表

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

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

投資形態が、ファミリーファンドまたはファンド・オブ・ファンズに該当する場合、投資信託証券を通じて投資することとなりますので、商品分類表と属性区分表の投資対象資産が異なります。

商品分類の定義

単位型・追加型	単位型投信	当初、募集された資金が一つの単位として信託され、その後の追加設定は一切行われのないファンドをいいます。
	追加型投信	一度設定されたファンドであってもその後追加設定が行われ従来の信託財産とともに運用されるファンドをいいます。
投資対象地域	国内	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に国内の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	海外	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に海外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	内外	目論見書または投資信託約款において、国内および海外の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資対象資産	株式	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	債券	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に債券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	不動産投信（リート）	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に不動産投資信託の受益証券および不動産投資法人の投資証券を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	その他資産	目論見書または投資信託約款において、組入資産による主たる投資収益が実質的に株式、債券および不動産投信以外の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	資産複合	目論見書または投資信託約款において、株式、債券、不動産投信およびその他資産のうち複数の資産による投資収益を実質的に源泉とする旨の記載があるものをいいます。
独立区分	MMF（マネー・マネージメント・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMMFをいいます。
	MRF（マネー・リザーブ・ファンド）	一般社団法人投資信託協会の「MMF等の運営に関する規則」に定められるMRFをいいます。
	ETF	投資信託及び投資法人に関する法律施行令（平成12年政令480号）第12条第1号及び第2号に規定する証券投資信託並びに租税特別措置法（昭和32年法律第26号）第9条の4の2に規定する上場証券投資信託をいいます。
補足分類	インデックス型	目論見書または投資信託約款において、各種指数に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	特殊型	目論見書または投資信託約款において、投資者に対して注意を喚起することが必要と思われる特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

#### 属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。

	公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債(地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。)に主として投資する旨の記載があるものをいいます。	
	社債	目論見書または投資信託約款において、企業等が発行する社債に主として投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他債券	目論見書または投資信託約款において、公債または社債以外の債券に主として投資する旨の記載があるものをいいます。	
	格付等クレジットによる属性	目論見書または投資信託約款において、上記債券の「発行体」による区分のほか、特にクレジットに対して明確な記載があるものについては、上記債券に掲げる区分に加え「高格付債」「低格付債」等を併記します。	
	不動産投信	目論見書または投資信託約款において、主として不動産投信に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	その他資産	目論見書または投資信託約款において、主として株式、債券および不動産投信以外に投資する旨の記載があるものをいいます。	
	資産複合	資産配分固定型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については固定的とする旨の記載があるものをいいます。
		資産配分変更型	目論見書または投資信託約款において、複数資産を投資対象とし、組入比率については、機動的な変更を行う旨の記載があるものもしくは固定的とする旨の記載がないものをいいます。
決算頻度	年1回	目論見書または投資信託約款において、年1回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年2回	目論見書または投資信託約款において、年2回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年4回	目論見書または投資信託約款において、年4回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年6回(隔月)	目論見書または投資信託約款において、年6回決算する旨の記載があるものをいいます。	
	年12回(毎月)	目論見書または投資信託約款において、年12回(毎月)決算する旨の記載があるものをいいます。	
	日々	目論見書または投資信託約款において、日々決算する旨の記載があるものをいいます。	
	その他	上記属性にあてはまらない全てのものをいいます。	
投資対象地域	グローバル	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が世界の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	日本	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	北米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が北米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	欧州	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が欧州地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	アジア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が日本を除くアジア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	
	オセアニア	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がオセアニア地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。	

	中南米	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中南米地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	アフリカ	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がアフリカ地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	中近東(中東)	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益が中近東地域の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
	エマージング	目論見書または投資信託約款において、組入資産による投資収益がエマージング地域(新興成長国(地域))の資産を源泉とする旨の記載があるものをいいます。
投資形態	ファミリーファンド	目論見書または投資信託約款において、親投資信託(ファンド・オブ・ファンズにのみ投資されるものを除きます。)を投資対象として投資するものをいいます。
	ファンド・オブ・ファンズ	一般社団法人投資信託協会の「投資信託等の運用に関する規則」第2条に規定されるファンド・オブ・ファンズをいいます。
為替ヘッジ	あり	目論見書または投資信託約款において、為替のフルヘッジまたは一部の資産に為替のヘッジを行う旨の記載があるものをいいます。
	なし	目論見書または投資信託約款において、為替のヘッジを行わない旨の記載があるものまたは為替のヘッジを行う旨の記載がないものをいいます。
対象インデックス	日経225	目論見書または投資信託約款において、日経225に連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	TOPIX	目論見書または投資信託約款において、TOPIXに連動する運用成果を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他	上記指数にあてはまらない全てのものをいいます。
特殊型	ブル・ベア型	目論見書または投資信託約款において、派生商品をヘッジ目的以外に用い、積極的に投資を行うとともに各種指数・資産等への連動若しくは逆連動(一定倍の連動若しくは逆連動を含む。)を目指す旨の記載があるものをいいます。
	条件付運用型	目論見書または投資信託約款において、仕組債への投資またはその他特殊な仕組みを用いることにより、目標とする投資成果(基準価額、償還価額、収益分配金等)や信託終了日等が、明示的な指標等の値により定められる一定の条件によって決定される旨の記載があるものをいいます。
	ロング・ショート型 /絶対収益追求型	目論見書または投資信託約款において、特定の市場に左右されにくい収益の追求を目指す旨若しくはロング・ショート戦略により収益の追求を目指す旨の記載があるものをいいます。
	その他型	目論見書または投資信託約款において、上記特殊型に掲げる属性のいずれにも該当しない特殊な仕組みあるいは運用手法の記載があるものをいいます。

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

#### 信託金の限度額

当ファンドの信託金限度額は、信託約款の定めにより1兆円となっています。ただし、受託会社と合意のうえ、変更することができます。

## ファンドの特色

1

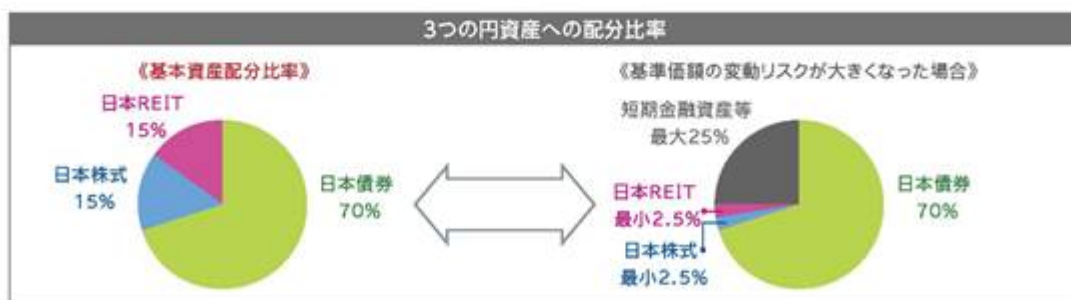
主として国内の債券や株式、不動産投資信託（REIT）を主要投資対象とするマザーファンドへの投資を通じて、国内の複数の資産（債券・株式・REIT）に分散投資します。

2

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

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

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



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

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

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。



## ● 価格変動リスクとは

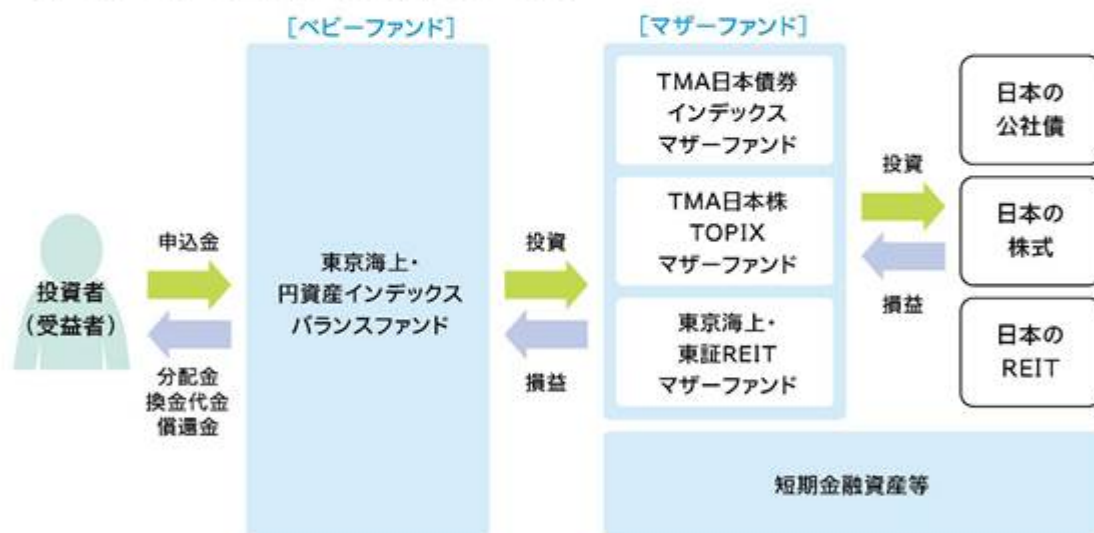
価格が下落した場合だけでなく、上昇した場合も含めた「値動きの振れ幅の程度」をいいます。リスクの大小を数値で表す場合、一般的には「標準偏差」を用います。標準偏差とは、価格の変化率（リターン）のばらつき度合いを示す指標です。標準偏差が小さいほど値動きが緩やかでリスクは小さく、標準偏差が大きいほど値動きは荒くリスクが大きいことを示します。

<各マザーファンドが対象とする指数について>

- \*「NOMURA-BPI(野村ボンド・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債流通市場全体の動向を表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、野村證券の知的財産です。野村證券は、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- \*「TOPIX」は日本の株式市場を広くに網羅するとともに、投資対象としての可能性を有するマーケット・ベンチマークです。TOPIXの指数値および商標は、(株)東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは(株)東京証券取引所が有します。(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。
- \*「東証REIT指数」は(株)東京証券取引所に上場しているREIT全銘柄の動きを捉える指数です。東証REIT指数は(株)東京証券取引所の知的財産であり、指数の算出、指数値の公表、利用等該指数に関するすべての権利・ノウハウおよび東証REIT指数の商標または標章に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。なお、ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証または販売されるものではなく、(株)東京証券取引所はファンドの発行または売買取引に起因するいかなる損害に対しても責任を有しません。

## ファンドの仕組み

- ・ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

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。

## 主な投資制限

株 式	株式への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の30%以下とします。
外貨建資産	外貨建資産への実質投資割合は、信託財産の純資産総額の10%以下とします。
デリバティブ	デリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

## 分配方針

◎年1回決算を行います。

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

《イメージ図》

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

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

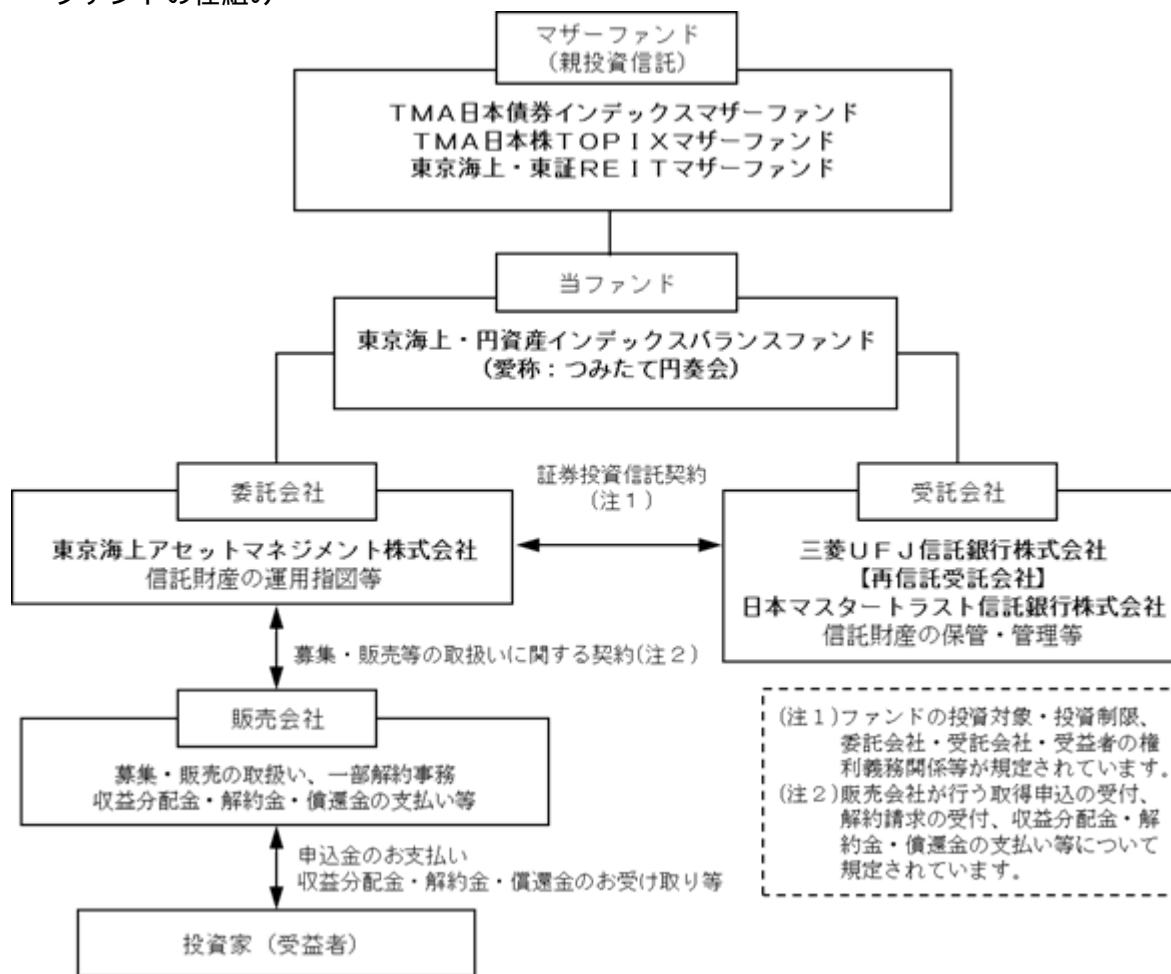
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

**(2) 【ファンドの沿革】**

2017年10月11日 ファンドの設定、運用開始

**(3) 【ファンドの仕組み】**

ファンドの仕組み

**委託会社の概況**

- ・名称 東京海上アセットマネジメント株式会社
- ・資本金の額 20億円（2021年7月末日現在）
- ・会社の沿革

- 1985年12月 東京海上グループ（現：東京海上日動グループ）等の出資により、資産運用ビジネスの戦略的位置付けで、東京海上エム・シー投資顧問株式会社の社名にて資本金2億円で設立
- 1987年2月 投資顧問業者として登録
- 同年6月 投資一任業務認可取得
- 1991年4月 国内および海外年金の運用受託を開始
- 1998年5月 東京海上アセットマネジメント投信株式会社に社名変更し、投資信託法上の委託会社としての免許取得
- 2007年9月 金融商品取引業者として登録
- 2014年4月 東京海上アセットマネジメント株式会社に社名変更
- 2018年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

**・大株主の状況（2021年7月末日現在）**

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

**2 【投資方針】****(1) 【投資方針】**

## 1. 基本方針

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

## 2. 運用方法

### (1) 主要投資対象

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券

TMA日本株TOPIXマザーファンド受益証券

東京海上・東証REITマザーファンド受益証券

### (2) 投資態度

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

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

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

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

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

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

原則として月次でリバランスを実施します。

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

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

**<参考情報> マザーファンドの運用の基本方針、主な投資対象と投資制限（要約）****TMA日本債券インデックスマザーファンド****1. 基本方針**

NOMURA - BPI（総合）に連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

わが国の公社債を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

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

信託財産の効率的な運用に資するため、債券先物取引等を利用することがあります。このため、公社債の組入総額および債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

**3. 運用制限**

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

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

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

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

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

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

(7) 同一銘柄の転換社債および転換社債型新株予約権付社債への投資割合は、信託財産の純資産総額の5%以下とします。

(8) 約款第18条（先物取引等の運用指図）、約款第19条（スワップ取引の運用指図）および約款第20条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）の運用指図に定めるデリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

**TMA日本株TOPIXマザーファンド****1. 基本方針**

TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

**2. 運用方法****(1) 投資対象**

東京証券取引所第一部に上場されている銘柄( )を主要投資対象とします。

**(2) 投資態度**

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

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

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

有価証券等の価格変動リスクを回避するため、日本において行われる有価証券先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号イに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券指数等先物取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ロに掲げるものをいいます。以下同じ。)、有価証券オプション取引(金融商品取引法第28条第8項第3号ハに掲げるものをいいます。以下同じ。)、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引ならびに外国の市場における日本の有価証券先物取引、有価証券指数等先物取引、有価証券オプション取引、金利にかかる先物取引および金利にかかるオプション取引と類似の取引を行うことがあります。また、信託財産に属する資産の効率的な運用に資するため、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(スワップ取引)を行うことがあります。

( )東京証券取引所の市場は、2022年4月以降、プライム、スタンダード、グロースの新しい市場区分に再編される予定です。「TOPIXに採用されている銘柄」に投資する当ファンドの基本方針に変更はありません。

**3. 運用制限**

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

(7) 約款第16条(先物取引等の運用指図)、約款第17条(スワップ取引の運用指図)および約款第18条(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)の運用指図に定めるデリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

**東京海上・東証REITマザーファンド**

## 1．基本方針

東証REIT指数（配当込み）に連動する投資成果の達成を目標とします。

## 2．運用方法

## (1) 投資対象

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

## (2) 投資態度

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

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

原則として、REITへの組入比率を高位に維持します。

## 3．運用制限

(1) 株式への直接投資は行いません。

(2) 外貨建資産への直接投資は行いません。

(3) 投資信託証券への投資割合には制限を設けません。

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

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

(5) 約款第14条の2（先物取引等の運用指図）に定めるデリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

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

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

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の運用にあたっては、TOPIX（東証株価指数）採用銘柄から時価総額・業種別構成比率等を勘案し、層化抽出法を用いてTOPIXに連動するようポートフォリオを構築します。

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

**(2)【投資対象】**

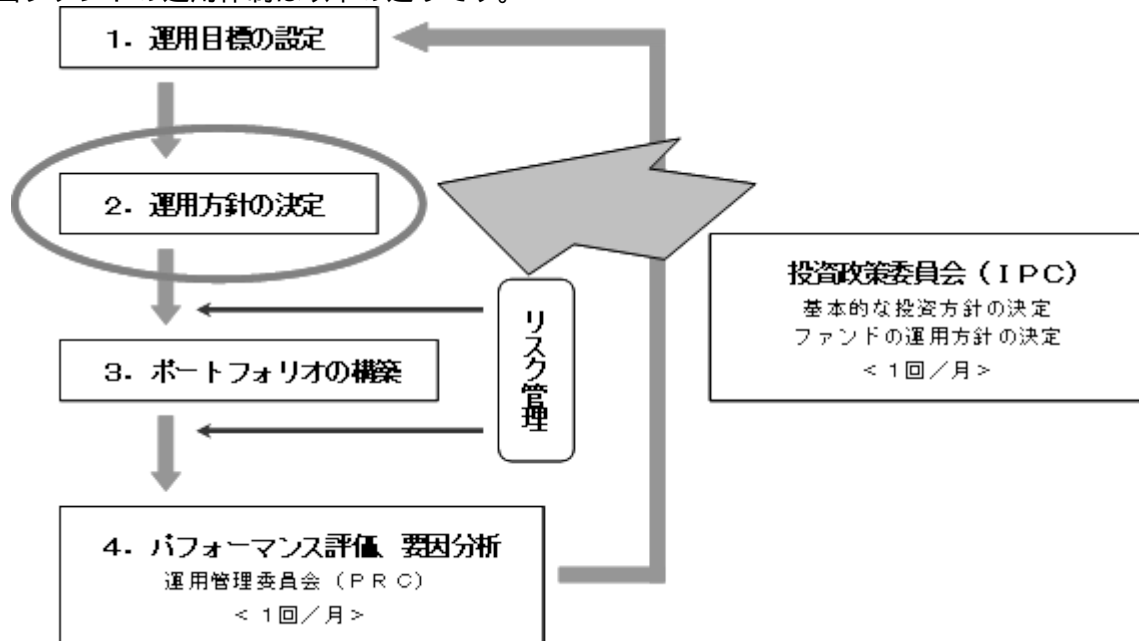
1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。
  - (1) 次に掲げる特定資産（投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいいます。以下同じ。）
    - 有価証券
    - デリバティブ取引にかかる権利（金融商品取引法第2条第20項に規定するものをいい、約款第22条、第23条および第24条に定めるものに限りません。）
    - 金銭債権（ に掲げるものに該当するものを除きます。）
    - 約束手形（金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。）
  - (2) 次に掲げる特定資産以外の資産  
為替手形
2. 委託会社は、信託金を、主として東京海上アセットマネジメント株式会社を委託会社とし、三菱UFJ信託銀行株式会社を受託会社として締結された「TMA日本債券インデックスマザーファンド」、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「東京海上・東証REITマザーファンド」の受益証券および次の有価証券（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を除きます。）に投資することを指図します。
  - (1) 株券または新株引受権証券
  - (2) 国債証券
  - (3) 地方債証券
  - (4) 特別の法律により法人の発行する債券
  - (5) 社債券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を除きます。）
  - (6) 特定目的会社にかかる特定社債券（金融商品取引法第2条第1項第4号で定めるものをいいます。）
  - (7) 特別の法律により設立された法人の発行する出資証券（金融商品取引法第2条第1項第6号で定めるものをいいます。）
  - (8) 協同組織金融機関にかかる優先出資証券（金融商品取引法第2条第1項第7号で定めるものをいいます。）
  - (9) 特定目的会社にかかる優先出資証券または新優先出資引受権を表示する証券（金融商品取引法第2条第1項第8号で定めるものをいいます。）
  - (10) コマーシャル・ペーパー
  - (11) 新株引受権証券（新株引受権証券と社債券が一体となった新株引受権付社債券の新株引受権証券を含みます。）および新株予約権証券
  - (12) 外国または外国の者の発行する証券または証書で、上記(1)から(11)までの証券または証書の性質を有するもの
  - (13) 投資信託または外国投資信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第10号で定めるものをいいます。）
  - (14) 投資証券、投資法人債券または外国投資証券（金融商品取引法第2条第1項第11号で定めるものをいいます。）
  - (15) 外国貸付債権信託受益証券（金融商品取引法第2条第1項第18号で定めるものをいいます。）
  - (16) オプションを表示する証券または証書（金融商品取引法第2条第1項第19号で定めるものをいい、有価証券にかかるものに限りません。）
  - (17) 預託証券（金融商品取引法第2条第1項第20号で定めるものをいいます。）
  - (18) 外国法人が発行する譲渡性預金証書
  - (19) 指定金銭信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に限りません。）
  - (20) 抵当証券（金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。）
  - (21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
  - (22) 受益証券発行信託の受益証券（金融商品取引法第2条第1項第14号で定めるものをいい、上記(1)から(21)に該当するものを除きます。）
  - (23) 外国の者に対する権利で上記(21)および(22)の有価証券の性質を有するものなお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券（投資法人債券を除きます。）を以下「投資信託証券」といいます。
3. 委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品（金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。）により運用することを指図することができます。
  - (1) 預金



- (2) 指定金銭信託（金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。）
- (3) コール・ローン
- (4) 手形割引市場において売買される手形
- (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
- (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの
4. 上記2.の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3.に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

### (3) 【運用体制】

当ファンドの運用体制は以下の通りです。



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

運用におけるリスク管理は、運用リスク管理部門（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（運用リスク管理部門担当役員を委員長に、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、2021年7月末日現在）

**(4)【配分方針】**

年1回（原則として1月25日、休業日の場合は翌営業日）決算を行い、毎決算時に原則として以下の通り収益分配を行う方針です。

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

信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

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

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

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

**(5)【投資制限】**

運用の基本方針に基づく制限（約款別紙「運用の基本方針」）

- a. 委託会社は、信託財産に属する株式の時価総額とマザーファンドに属する株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の30を超えることとなる投資の指図をしません。  
信託財産に属するとみなした額とは、信託財産に属するマザーファンドの受益証券の時価総額に、マザーファンドの信託財産の純資産総額に占める当該資産の時価総額の割合を乗じて得た額をいいます。（以下同じ）
- b. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- c. 委託会社は、信託財産に属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券ならびに取引所に上場し、かつ当該取引所において常時売却可能な投資信託証券、また既に組入れていた株式等が転換等により投資信託証券に該当することとなった投資信託証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- e. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の株式の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の株式の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- f. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- g. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに

転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。

- h. 約款第22条(先物取引等の運用指図)、第23条(スワップ取引の運用指図)および第24条(金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図)に定めるデリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

投資する株式等の範囲(約款第19条)

- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、取引所に上場されている株式の発行会社の発行するものおよび取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。

信用取引(約款第21条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

先物取引等(約款第22条)

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

スワップ取引(約款第23条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引(以下「スワップ取引」といいます。 )を行うことの指図をすることができます。
- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

金利先渡取引および為替先渡取引(約款第24条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。

デリバティブ取引等に係る投資制限(約款第24条の2)

デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。

## 有価証券の貸付（約款第25条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
  - ・株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
  - ・公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。

## 有価証券の空売（約款第26条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産において有しない有価証券または下記「有価証券の借入」の規定により借入れた有価証券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、売付けた有価証券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a. の売付の指図は、当該売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b. の売付にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その額を超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。

## 有価証券の借入（約款第27条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、有価証券の借入の指図をすることができます。なお、当該有価証券の借入を行うにあたり担保の提供が必要と認めるときは、担保の提供の指図を行うものとします。
- b. 上記a. の借入の指図は、当該借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行うことができるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b. の借入にかかる有価証券の時価総額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する借入れた有価証券の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. 上記a. の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。

## 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限（約款第28条）

外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。

## 外国為替予約取引（約款第29条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、ならびに信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. 上記a. の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産（マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みます。）の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b. の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

## 信用リスク集中回避のための投資制限（約款第29条の2）

一般社団法人投資信託協会規則に定める一者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

## 資金の借入（約款第35条）

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て（一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。）を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ（コール市場を通じる場合を含みます。）の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信

託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。

- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

### 3【投資リスク】

#### 1．投資リスク

以下の記載は、当ファンドが主要投資対象とするマザーファンドを組み入れることにより、当ファンドが間接的に受ける実質的なリスクを含みます。

##### (1) 価格変動リスク

当ファンドは、主に株式、公社債およびREITなど値動きのある証券を実質的な投資対象としますので、基準価額は変動します。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。

委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

投資信託は預貯金や保険と異なります。

当ファンドへの投資には主に以下のリスクが想定され、これらの影響により損失を被り、投資元本を割り込むことがあります。

##### 株価変動リスク

株価は、政治・経済情勢、発行企業の業績・財務状況、市場の需給等を反映して変動します。株価は、短期的または長期的に大きく下落することがあります（発行企業が経営不安、倒産等に陥った場合には、投資資金が回収できなくなることもあります。）。組入銘柄の株価が下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

##### 金利変動リスク

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

##### 信用リスク

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

##### REITの価格変動リスク

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

##### 流動性リスク

受益者から解約申込があった場合、組入資産を売却することで解約資金の手当てを行うことがあります。その際、組入資産の市場における流動性が低いときには直前の市場価格よりも大幅に安い価格で売却せざるを得ないことがあります。この場合、基準価額が下落する要因となります。

##### (2) デリバティブ取引のリスク

当ファンドはデリバティブに投資することがあります。デリバティブの運用には、ヘッジする商品とヘッジされるべき資産との間の相関性を欠いてしまう可能性、流動性を欠く可能性、証拠金を積むことによるリスク等様々なリスクが伴います。これらの運用手法は、信託財産に属する資産の価格変動リスクを回避する目的のみならず、効率的な運用に資する目的でも用いられることがあります。実際の価格変動が委託会社の見通しと異なった場合に当ファンドが損失を被るリスクを伴います。

#### 2．その他の留意事項

##### (1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

- ・投資信託は株式・公社債などの値動きのある証券に投資しますので、基準価額は変動します。
- ・投資信託は金融機関の預金と異なり元金が保証されているものではありません。
- ・投資信託は保険契約および預金ではありません。
- ・投資信託は保険契約者保護機構の補償対象契約ではありません。
- ・投資信託は預金保険の対象ではありません。
- ・登録金融機関から購入した投資信託は投資者保護基金の補償対象ではありません。
- ・当ファンドは、主に国内の株式、公社債およびREITを実質的な投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れた有価証券の値動きやそれらの有価証券の発行者の信用状況の変化等の影響により上下しますので、投資元本を割り込むことがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
- ・委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

##### (2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

##### (3) その他の留意点

取得申込者から販売会社に申込代金が支払われた場合であっても、販売会社より委託会社に対して申込代金の払込が現実になされるまでは、当ファンドも委託会社もいかなる責任も負わず、かつその後、受託会社に払込がなされるまでは、取得申込者は受益権および受益権に付随するいかなる権利も取得しません。

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

委託会社は、販売会社とは別法人であり、委託会社は設定・運用を善良なる管理者の注意をもって行う責任を負担し、販売会社は販売(申込代金の預り等を含みます。)について責任を負担しており、互いに他について責任を負担しません。

受託会社は、委託会社に収益分配金、一部解約金および償還金を委託会社の指定する預金口座等へ払い込んだ後は、受益者に対し、それらを支払う責任を負いません。

当ファンドのお取引に関しては、金融商品取引法第37条の6の規定(いわゆるクーリング・オフ)の適用はありません。

当ファンドは、ファミリーファンド方式で運用を行います。そのため、当ファンドが投資対象とするマザーファンドを投資対象とする他のベビーファンドに追加設定・解約等に伴う資金変動等があり、その結果、当該マザーファンドにおいて売買等が生じた場合等には、当ファンドの基準価額に影響を及ぼす場合があります。

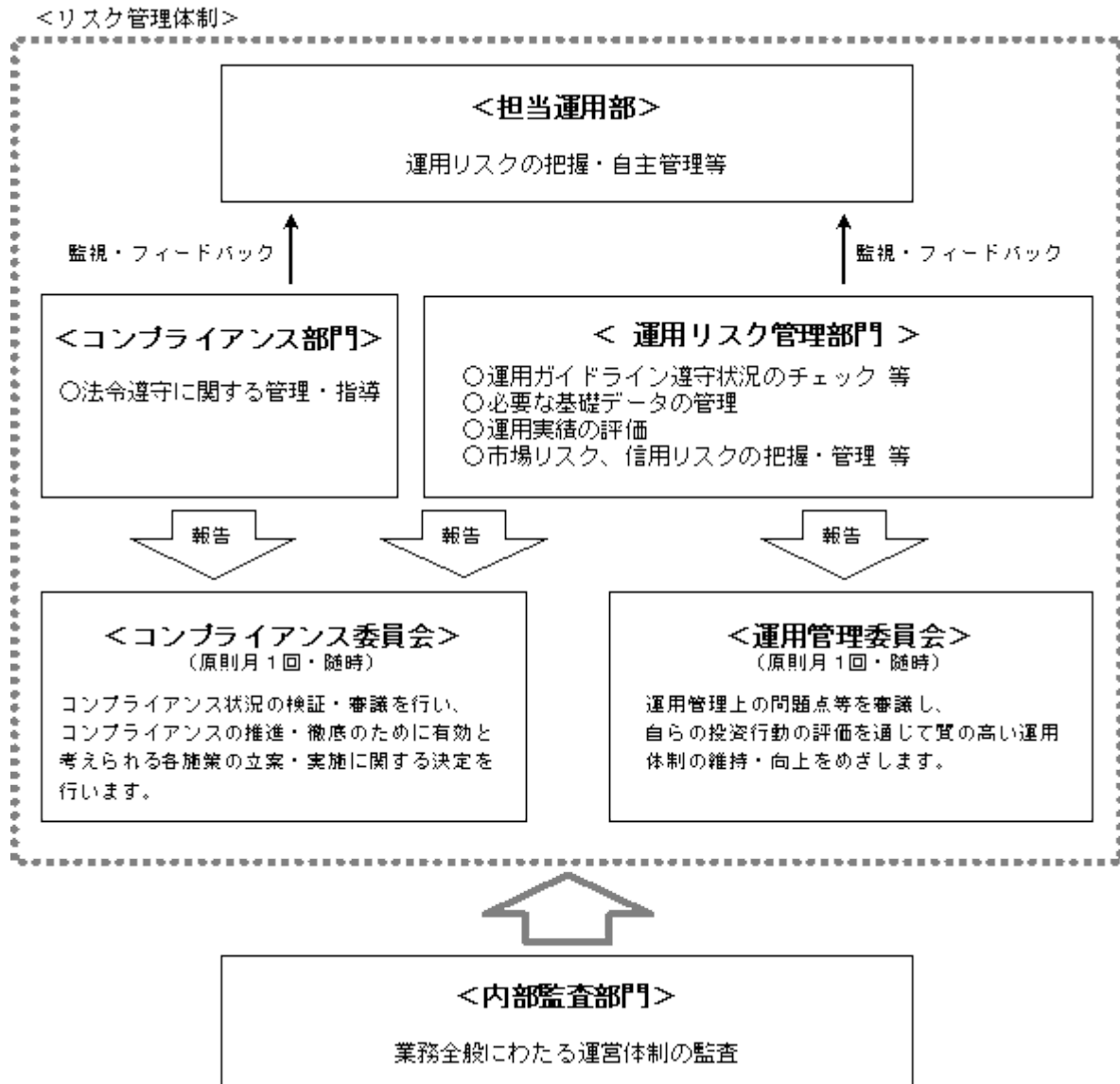
分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益(経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益)を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がりが小さかった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

### 3. 管理体制

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

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

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





## 参考情報

2016年8月～2021年7月

ファンドの年間騰落率および  
分配金再投資基準価額の推移

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

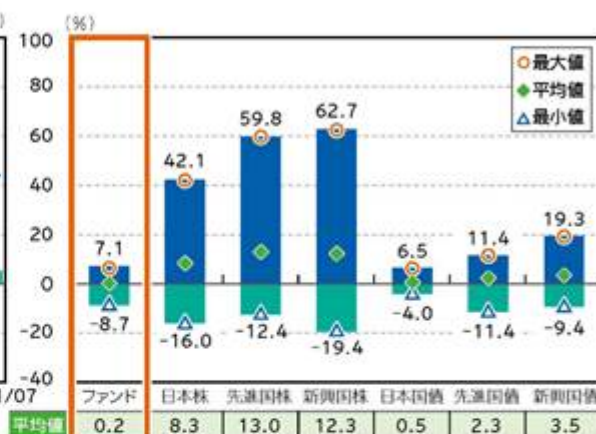


※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと計算した基準価額であり、実際の基準価額とは異なる場合があります。

※年間騰落率は、税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

ファンドと代表的な資産クラスとの  
騰落率の比較

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



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

※ファンドは分配金再投資基準価額の年間騰落率です。税引前分配金を再投資したものと計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドは2018年10月以降の年間騰落率を用いています。

## 代表的な資産クラスと指数名

日本株 TOPIX (東証株価指数) (配当込み)

先進国株 MSCIコクサイ指数 (配当込み、円ベース)

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

日本国債 NOMURA-BPI (国債)

先進国債 FTSE世界国債インデックス (除く日本、円ベース)

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

## 指数について

●TOPIXの指数値および変動は、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の名称の変更、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)に関する著作権、著作権、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・ディバシファイドに関する著作権、知的財産権その他一切の権利は、J.P.Morgan Securities LLCに帰属します。

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

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

## 4【手数料等及び税金】

### (1)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

### (2)【換金（解約）手数料】

換金時（解約時）の手数料はありません。

### (3)【信託報酬等】

委託会社、販売会社および受託会社の信託報酬の総額は信託財産の純資産総額に対し、年率0.418%（税抜0.38%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

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

信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

委託会社 <sup>*1</sup>	販売会社 <sup>*2</sup>	受託会社 <sup>*3</sup>
年率0.18%	年率0.18%	年率0.02%

\*1 委託した資金の運用、基準価額の計算、目論見書作成等の対価

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

\*3 運用財産の保管・管理、委託会社からの指図の実行の対価

### (4)【その他の手数料等】

信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）は、監査法人に支払うファンドの監査にかかる費用であり、毎日、純資産総額に対し、年率0.011%（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。

信託財産に関する租税および信託事務等に要する諸費用（消費税等相当額を含みます。）ならびに受託会社の立替えた立替金の利息は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

ファンドの組入有価証券の売買の際に発生する売買委託手数料、先物・オプション取引に要する費用、外国における資産の保管等に要する費用等（全て消費税等相当額を含みます。）は、受益者の負担とし、信託財産中から支弁します。

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

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

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

### (5)【課税上の取扱い】

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

少額投資非課税制度「NISA（ニーサ）」、未成年者少額投資非課税制度「ジュニアNISA」および非課税累積投資契約に係る少額投資非課税制度「つみたてNISA（ニーサ）」をご利用の場合、毎年、一定額の範囲で新たに購入した公募株式投資信託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、2021年7月末現在のものですので、税法が改正された場合等には、内容等が変更される場合があります。

## 5【運用状況】

以下は2021年7月30日現在の運用状況です。

また、投資比率とはファンドの純資産総額に対する当該資産の時価比率をいいます。

### (1)【投資状況】

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	105,810,979	93.52
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		7,319,590	6.47
合計(純資産総額)		113,130,569	100.00

(ご参考:親投資信託の投資状況)

当ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

#### TMA日本株TOPIXマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	37,270,739,210	94.37
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		2,223,187,448	5.62
合計(純資産総額)		39,493,926,658	100.00

#### その他の資産の投資状況

資産の種類	建別	地域	時価(円)	投資比率(%)
株価指数先物取引	買建	日本	2,286,000,000	5.78

(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	18,137,366,960	88.51
地方債証券	日本	1,053,299,200	5.14
特殊債券	日本	303,627,000	1.48
社債券	日本	1,043,928,485	5.09
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		48,060,093	0.23
合計(純資産総額)		20,490,161,552	100.00

#### 東京海上・東証REITマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
投資証券	日本	10,489,922,100	97.01
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		322,832,308	2.98
合計(純資産総額)		10,812,754,408	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	317,978,000	2.94

(注)時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

### (2)【投資資産】

#### 【投資有価証券の主要銘柄】

##### a. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本債券インデックスマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	61,017,808	1.2912	78,786,950	1.3018	79,432,982	70.21
2	東京海上・東証REITマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	8,732,174	1.3306	11,619,479	1.5324	13,381,183	11.82
3	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	7,929,722	1.6154	12,810,113	1.6390	12,996,814	11.48

## b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	93.52
合計	93.52

## 【投資不動産物件】

該当事項はありません。

## 【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(ご参考：親投資信託の投資資産)

投資有価証券の主要銘柄

## a. 主要銘柄の明細

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	144,700	8,382.97	1,213,015,920	9,805.00	1,418,783,500	3.59
2	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	89,600	11,452.17	1,026,115,128	11,375.00	1,019,200,000	2.58
3	キーエンス	日本	電気機器	株式	14,000	50,280.40	703,925,726	60,740.00	850,360,000	2.15
4	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	111,200	9,816.62	1,091,608,914	6,837.00	760,274,400	1.92
5	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	961,100	649.66	624,392,284	578.50	555,996,350	1.40
6	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	98,000	5,141.52	503,869,035	5,629.00	551,642,000	1.39
7	任天堂	日本	その他製品	株式	8,200	63,129.49	517,661,852	56,400.00	462,480,000	1.17
8	信越化学工業	日本	化学	株式	25,900	18,325.03	474,618,282	17,750.00	459,725,000	1.16
9	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	163,900	2,942.64	482,299,912	2,802.50	459,329,750	1.16
10	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	119,200	4,261.48	507,969,179	3,682.00	438,894,400	1.11
11	HOYA	日本	精密機器	株式	28,100	12,835.48	360,677,166	15,405.00	432,880,500	1.09
12	日立製作所	日本	電気機器	株式	68,900	5,391.27	371,459,090	6,258.00	431,176,200	1.09
13	日本電産	日本	電気機器	株式	34,500	13,278.80	458,118,739	12,240.00	422,280,000	1.06
14	ダイキン工業	日本	機械	株式	18,200	22,154.96	403,220,356	22,665.00	412,503,000	1.04
15	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	112,700	3,338.27	376,223,392	3,493.00	393,661,100	0.99
16	村田製作所	日本	電気機器	株式	42,100	9,020.80	379,775,784	9,040.00	380,584,000	0.96
17	KDDI	日本	情報・通信業	株式	112,600	3,497.32	393,799,161	3,332.00	375,183,200	0.94
18	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	8,300	42,002.96	348,624,599	44,920.00	372,836,000	0.94
19	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	97,700	4,269.88	417,168,111	3,695.00	361,001,500	0.91

20	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	98,700	3,561.69	351,539,040	3,232.00	318,998,400	0.80
21	ファナック	日本	電気機器	株式	12,500	25,901.21	323,765,154	24,380.00	304,750,000	0.77
22	みずほフィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	191,100	1,693.78	323,681,884	1,565.50	299,167,050	0.75
23	三井物産	日本	卸売業	株式	113,800	2,383.29	271,218,900	2,499.50	284,443,100	0.72
24	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	55,200	4,484.72	247,556,565	4,868.00	268,713,600	0.68
25	S M C	日本	機械	株式	4,100	63,113.18	258,764,052	64,800.00	265,680,000	0.67
26	三菱商事	日本	卸売業	株式	85,900	3,255.04	279,608,491	3,062.00	263,025,800	0.66
27	第一三共	日本	医薬品	株式	112,700	3,200.31	360,674,937	2,159.50	243,375,650	0.61
28	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	46,500	5,347.93	248,679,119	5,210.00	242,265,000	0.61
29	富士通	日本	電気機器	株式	12,800	16,333.69	209,071,243	18,565.00	237,632,000	0.60
30	デンソー	日本	輸送用機器	株式	31,500	7,342.03	231,274,062	7,482.00	235,683,000	0.59

## T M A日本債券インデックスマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	利率	償還期限	額面	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
							単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	第135回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2023/03/20	350,000,000	100.57	352,023,000	100.38	351,340,500	1.71
2	第136回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2023/06/20	300,000,000	100.61	301,831,600	100.43	301,299,000	1.47
3	第347回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/06/20	295,000,000	101.19	298,534,150	101.36	299,020,850	1.45
4	第359回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/06/20	286,000,000	100.77	288,229,490	101.29	289,697,980	1.41
5	第349回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/12/20	250,000,000	101.37	253,425,000	101.48	253,700,000	1.23
6	第139回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2024/03/20	251,000,000	100.74	252,880,040	100.64	252,621,460	1.23
7	第138回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2023/12/20	250,000,000	100.73	251,825,000	100.57	251,432,500	1.22
8	第348回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2027/09/20	247,000,000	101.25	250,111,260	101.42	250,512,340	1.22
9	第144回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/06/20	244,000,000	100.96	246,347,510	100.95	246,332,640	1.20
10	第141回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2024/09/20	231,000,000	100.89	233,055,900	100.75	232,744,050	1.13
11	第354回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/03/20	225,000,000	101.02	227,304,740	101.57	228,546,000	1.11
12	第353回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/12/20	222,000,000	101.17	224,604,130	101.60	225,554,220	1.10
13	第356回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/09/20	221,000,000	101.03	223,281,950	101.51	224,348,150	1.09
14	第342回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2026/03/20	220,000,000	101.07	222,354,000	101.07	222,356,200	1.08
15	第350回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/03/20	211,000,000	101.22	213,579,700	101.50	214,173,440	1.04
16	第362回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2031/03/20	212,000,000	100.25	212,542,320	100.96	214,041,560	1.04
17	第142回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2024/12/20	210,000,000	100.92	211,948,800	100.83	211,749,300	1.03
18	第134回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2022/12/20	210,000,000	100.52	211,092,000	100.32	210,682,500	1.02
19	第352回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2028/09/20	205,000,000	101.23	207,532,710	101.58	208,245,150	1.01
20	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	102.36	204,724,000	102.11	204,236,000	0.99
21	第143回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2025/03/20	201,000,000	100.93	202,869,510	100.89	202,796,940	0.98
22	第345回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2026/12/20	200,000,000	101.22	202,440,000	101.24	202,492,000	0.98
23	第140回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2024/06/20	200,000,000	100.83	201,660,000	100.69	201,388,000	0.98
24	第343回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2026/06/20	195,000,000	101.09	197,133,300	101.13	197,203,500	0.96
25	第360回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2030/09/20	185,000,000	100.76	186,418,150	101.19	187,201,500	0.91
26	第327回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.800	2022/12/20	180,000,000	101.98	183,564,000	101.28	182,320,200	0.88
27	第344回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2026/09/20	177,000,000	101.15	179,050,140	101.18	179,102,760	0.87
28	第355回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/06/20	175,000,000	100.88	176,555,220	101.54	177,709,000	0.86

29	第137回利付国債(5年)	日本	国債証券	0.100	2023/09/20	170,000,000	100.68	171,156,000	100.49	170,836,400	0.83
30	第357回利付国債(10年)	日本	国債証券	0.100	2029/12/20	166,000,000	100.95	167,577,000	101.47	168,450,160	0.82

## 東京海上・東証REITマザーファンド

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率 (%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	日本ビルファンド投資法人	日本	投資証券	1,005	618,004.16	621,094,180	708,000.00	711,540,000	6.58
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	日本	投資証券	886	623,529.16	552,446,835	687,000.00	608,682,000	5.62
3	GLP投資法人	日本	投資証券	2,871	172,674.96	495,749,810	196,500.00	564,151,500	5.21
4	日本プロロジスリート投資法人	日本	投資証券	1,404	334,619.91	469,806,353	366,000.00	513,864,000	4.75
5	日本都市ファンド投資法人	日本	投資証券	4,472	98,931.45	442,421,467	114,500.00	512,044,000	4.73
6	野村不動産マスターファンド投資法人	日本	投資証券	2,866	158,783.47	455,073,425	174,100.00	498,970,600	4.61
7	大和ハウスリート投資法人	日本	投資証券	1,265	277,881.75	351,520,413	326,000.00	412,390,000	3.81
8	オリックス不動産投資法人	日本	投資証券	1,766	175,882.45	310,608,406	209,000.00	369,094,000	3.41
9	アドバンス・レジデンス投資法人	日本	投資証券	886	316,400.57	280,330,908	373,500.00	330,921,000	3.06
10	ユナイテッド・アーバン投資法人	日本	投資証券	1,995	140,579.12	280,455,356	161,100.00	321,394,500	2.97
11	産業ファンド投資法人	日本	投資証券	1,258	192,079.13	241,635,545	211,900.00	266,570,200	2.46
12	積水ハウス・リート投資法人	日本	投資証券	2,607	78,053.61	203,485,761	96,600.00	251,836,200	2.32
13	日本プライムリアルティ投資法人	日本	投資証券	582	376,659.37	219,215,756	428,000.00	249,096,000	2.30
14	ケネディクス・オフィス投資法人	日本	投資証券	274	684,878.33	187,656,662	807,000.00	221,118,000	2.04
15	アクティブ・プロパティーズ投資法人	日本	投資証券	444	437,205.84	194,119,392	497,500.00	220,890,000	2.04
16	ラサールロジポート投資法人	日本	投資証券	1,085	166,128.57	180,249,498	201,000.00	218,085,000	2.01
17	日本アコモデーションファンド投資法人	日本	投資証券	306	574,383.40	175,761,320	671,000.00	205,326,000	1.89
18	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	日本	投資証券	329	535,089.27	176,044,372	614,000.00	202,006,000	1.86
19	日本ロジスティクスファンド投資法人	日本	投資証券	579	312,083.21	180,696,178	332,500.00	192,517,500	1.78
20	ジャパン・ホテル・リート投資法人	日本	投資証券	2,715	55,833.00	151,586,595	66,700.00	181,090,500	1.67
21	インヴィンシブル投資法人	日本	投資証券	3,901	37,192.06	145,086,233	43,050.00	167,938,050	1.55
22	森ヒルズリート投資法人	日本	投資証券	1,042	148,309.11	154,538,092	161,100.00	167,866,200	1.55
23	フロンティア不動産投資法人	日本	投資証券	311	438,052.73	136,234,399	508,000.00	157,988,000	1.46
24	イオンリート投資法人	日本	投資証券	959	142,017.51	136,194,800	159,500.00	152,960,500	1.41
25	ヒューリックリート投資法人	日本	投資証券	779	161,905.08	126,124,062	193,800.00	150,970,200	1.39
26	大和証券オフィス投資法人	日本	投資証券	187	679,222.52	127,014,611	790,000.00	147,730,000	1.36
27	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	日本	投資証券	605	189,368.25	114,567,791	237,300.00	143,566,500	1.32
28	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	日本	投資証券	399	305,123.79	121,744,392	350,500.00	139,849,500	1.29
29	大和証券リビング投資法人	日本	投資証券	1,159	100,248.29	116,187,768	120,400.00	139,543,600	1.29
30	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	日本	投資証券	5,633	15,639.35	88,096,458	22,750.00	128,150,750	1.18

## 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	0.07
		鉱業	0.16
		建設業	2.15
		食料品	3.20
		繊維製品	0.50
		パルプ・紙	0.24



	化学	6.71
	医薬品	4.80
	石油・石炭製品	0.39
	ゴム製品	0.70
	ガラス・土石製品	0.68
	鉄鋼	0.82
	非鉄金属	0.68
	金属製品	0.61
	機械	5.14
	電気機器	17.37
	輸送用機器	7.74
	精密機器	2.64
	その他製品	2.18
	電気・ガス業	1.14
	陸運業	3.06
	海運業	0.34
	空運業	0.43
	倉庫・運輸関連業	0.19
	情報・通信業	7.79
	卸売業	4.65
	小売業	4.38
	銀行業	4.84
	証券、商品先物取引業	0.75
	保険業	1.81
	その他金融業	1.05
	不動産業	1.82
	サービス業	5.18
合 計		94.37

## 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	88.51
地方債証券	5.14
特殊債券	1.48
社債券	5.09
合 計	100.23

## 東京海上・東証REITマザーファンド

種類	投資比率(%)
投資証券	97.01
合 計	97.01

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。

東京海上・東証REITマザーファンド

該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

TMA日本株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	120	2,336,400,000.00	2,286,000,000	5.78

(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。

東京海上・東証REITマザーファンド

種類	地域	取引所	資産名	買建/ 売建	数量 (枚)	帳簿価額	評価額(円)	投資 比率(%)
株価指数先物取引	日本	大阪取引所	東証REIT指数先物	買建	148	315,299,200.00	317,978,000	2.94

(注)時価については、原則として当該日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段または最終相場で評価しています。このような時価が発表されていない場合には、当該日に最も近い最終相場や気配値等、原則に準ずる方法で評価しています。

## (3) 【運用実績】

## 【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第1計算期間末	(2018年 1月25日)	1	1	1.0294	1.0294
第2計算期間末	(2019年 1月25日)	4	4	1.0243	1.0243
第3計算期間末	(2020年 1月27日)	44	44	1.0829	1.0829
第4計算期間末	(2021年 1月25日)	76	76	1.0180	1.0180
2020年 7月末日		55		0.9979	
8月末日		58		0.9990	
9月末日		60		1.0007	
10月末日		64		0.9917	
11月末日		65		1.0049	
12月末日		71		1.0139	
2021年 1月末日		74		1.0174	
2月末日		79		1.0222	
3月末日		83		1.0392	
4月末日		93		1.0401	
5月末日		102		1.0426	
6月末日		107		1.0489	
7月末日		113		1.0505	

## 【分配の推移】

該当事項はありません。

## 【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	2.9
第2計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	0.5
第3計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	5.7
第4計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	6.0
第5中間計算期間	2021年 1月26日～2021年 7月25日	3.1

## (4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第1計算期間	2017年10月11日～2018年 1月25日	1,081,855		1,081,855
第2計算期間	2018年 1月26日～2019年 1月25日	3,969,342	218,643	4,832,554
第3計算期間	2019年 1月26日～2020年 1月27日	48,695,808	12,789,758	40,738,604
第4計算期間	2020年 1月28日～2021年 1月25日	60,312,399	26,011,910	75,039,093
第5中間計算期間	2021年 1月26日～2021年 7月25日	53,529,513	21,140,219	107,428,387

## &lt; 参考情報 &gt;

基準日: 2021年7月30日

## 基準価額・純資産の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。

※基準価額は1万口当たりで表示しています。※設定日は2017年10月11日です。

## 分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第1期	2018/01/25	0円
第2期	2019/01/25	0円
第3期	2020/01/27	0円
第4期	2021/01/25	0円
第5期	2022/01/25	0円
設定来累計		分配実績なし

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

## 主要な資産の状況

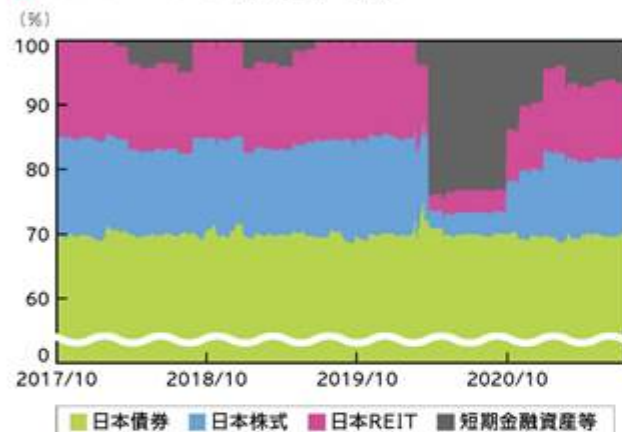
## 各マザーファンド組入比率、騰落率

マザーファンド	組入比率	基本資産配分	差	騰落率				
				1ヵ月	3ヵ月	6ヵ月	1年	3年
日本債券	70.2%	70.0%	+0.2%	+0.49%	+0.60%	+0.63%	+0.18%	+1.79%
日本株式	11.5%	15.0%	-3.5%	-2.14%	+0.33%	+6.39%	+29.75%	+16.42%
日本REIT	11.8%	15.0%	-3.2%	+0.74%	+5.49%	+19.11%	+34.94%	+37.35%
短期金融資産等	6.5%	-	+6.5%					

※比率は、純資産総額に占める割合です。

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

## 各マザーファンド組入比率の推移



※比率は、純資産総額(一部の未払金の計上を除く)に占める割合です。

## 各マザーファンドの組入上位銘柄

## TMA日本債券インデックスマザーファンド

	銘柄	クーポン	比率
1	第135回利付国債(5年)	0.100%	1.7%
2	第136回利付国債(5年)	0.100%	1.5%
3	第347回利付国債(10年)	0.100%	1.5%

## TMA日本株TOPIXマザーファンド

	銘柄	比率
1	トヨタ自動車	3.6%
2	ソニーグループ	2.6%
3	キーエンス	2.2%

## 東京海上・東証REITマザーファンド

	銘柄	比率
1	日本ビルファンド投資法人	6.6%
2	ジャパンリアルエステイト投資法人	5.6%
3	GLP投資法人	5.2%

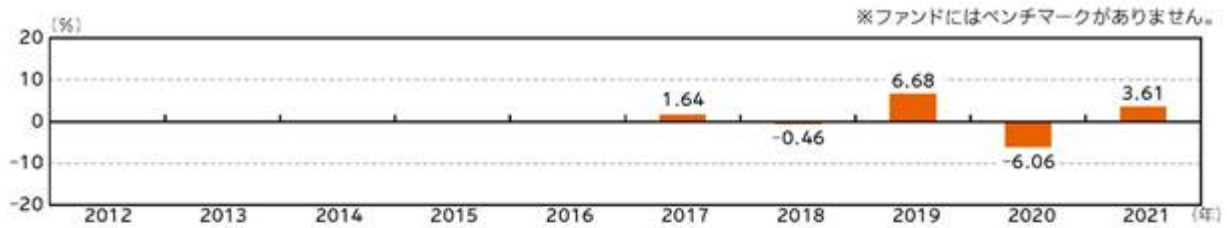
※比率は、各マザーファンドの純資産総額に占める割合です。

次ページへ続く

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

基準日:2021年7月30日

## 年間収益率の推移



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したも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。

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

## 第2【管理及び運営】

### 1【申込（販売）手続等】

- a. 毎営業日にお申込みを受け付けます。  
 b. 申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の2種類のコースがあります。

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

- c. 販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、1口単位で取得することができます。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。
- e. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。  
 取得申込受付日の基準価額  
 基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。  
 委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）  
 東京海上アセットマネジメント サービスデスク  
 0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）
- f. 取得申込にかかる手数料はありません。
- g. 上記にかかわらず、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
- h. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。
- i. 定時定額購入サービスを選択した取得申込者は、販売会社との間で定時定額購入サービスに関する取り決めを行います。詳しくは販売会社にお問い合わせください。

## 2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社やお申込みのコース等によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取り扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の基準価額とします。  
信託財産留保額はありませぬ。  
確定拠出年金法に規定する資産管理機関および連合会等の場合は、収益分配金および解約時・償還時の個別元本超過額に対する所得税、地方税はかかりませぬ。
- g. 解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。
- h. 解約にかかる手数料はありませぬ。
- i. 解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から、お支払いします。
- j. 委託会社は、取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情があるときは、解約請求の受付を中止することおよび既に受け付けた解約請求の受付を取り消すことができます。解約請求の受付が中止された場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
- k. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。ただし、確定拠出年金制度に基づく受益者である場合には制限はありませぬ。
- l. 受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

### 3【資産管理等の概要】

#### (1)【資産の評価】

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

< 主要投資対象資産の評価方法 >

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

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

#### (2)【保管】

該当事項はありません。

#### (3)【信託期間】

原則として、2017年10月11日から無期限とします。ただし、後記「(5)その他 信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

#### (4)【計算期間】

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

#### (5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。



- f. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- g. 上記f.の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、信託は、「信託約款の変更」b.の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- i. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

#### 信託約款の変更

- a. 委託会社は、受益者の利益のため必要と認めるときまたはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託約款を変更することまたは信託と他の信託との併合(投資信託及び投資法人に関する法律第16条第2号に規定する「委託者指図型投資信託の併合」をいいます。以下同じ。)を行うことができるものとし、あらかじめ、変更または併合しようとする旨およびその内容を監督官庁に届け出ます。なお、信託約款は「信託約款の変更」に定める以外の方法によって変更することができないものとします。
- b. 委託会社は、上記a.の事項(上記a.の変更事項にあっては、その内容が重大なものに該当する場合に限り、上記a.の併合事項にあってはその併合が受益者の利益に及ぼす影響が軽微なものに該当する場合を除きます。以下「重大な約款の変更等」といいます。)について、書面決議を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに重大な約款の変更等の内容およびその理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託約款にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者(委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。)は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。
- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 書面決議の効力は、信託のすべての受益者に対してその効力を生じます。
- f. 上記b.からe.までの規定は、委託会社が重大な約款の変更等について提案をした場合において、当該提案につき、信託約款にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。
- g. 上記a.からf.までの規定にかかわらず、この投資信託において併合の書面決議が可決された場合にあっては、当該併合にかかる一または複数の他の投資信託において当該併合の書面決議が否決された場合は、当該他の投資信託との併合を行うことはできません。

#### 関係会社との契約の更改等

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

#### 運用報告書

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

#### 公告

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

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

#### 4【受益者の権利等】

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

##### 収益分配金の請求権

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

##### 償還金の請求権

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

##### 換金（解約）請求権

受益者は、自己に帰属する受益権について、一部解約の実行請求の方法により、換金を請求することができます。詳細は上記「2 換金（解約）手続等」をご参照ください。

##### 買取請求権

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

### 第3【ファンドの経理状況】

- (1) 当ファンドの財務諸表は、「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、第4期計算期間(2020年1月28日から2021年1月25日まで)の財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## 1【財務諸表】

## 【東京海上・円資産インデックスバランスファンド】

## (1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第3期 [2020年 1月27日現在]	第4期 [2021年 1月25日現在]
<b>資産の部</b>		
流動資産		
コール・ローン	-	3,328,132
親投資信託受益証券	44,111,254	73,095,321
未収入金	106,774	1,002,498
流動資産合計	44,218,028	77,425,951
<b>資産合計</b>		
	44,218,028	77,425,951
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	23,457	902,333
未払受託者報酬	4,072	7,052
未払委託者報酬	73,133	126,763
未払利息	-	1
その他未払費用	1,946	3,439
流動負債合計	102,608	1,039,588
<b>負債合計</b>		
	102,608	1,039,588
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 40,738,604	1 75,039,093
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	3,376,816	1,347,270
（分配準備積立金）	958,677	853,301
元本等合計	44,115,420	76,386,363
<b>純資産合計</b>		
	44,115,420	76,386,363
<b>負債純資産合計</b>		
	44,218,028	77,425,951

## (2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第3期 自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	第4期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	-	71
有価証券売買等損益	1,226,249	2,000,416
営業収益合計	1,226,249	2,000,345
<b>営業費用</b>		
支払利息	44	3,963
受託者報酬	5,390	12,254
委託者報酬	97,013	220,340
その他費用	2,544	5,949
営業費用合計	104,991	242,506
営業利益又は営業損失( )	1,121,258	2,242,851
経常利益又は経常損失( )	1,121,258	2,242,851
当期純利益又は当期純損失( )	1,121,258	2,242,851
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( )	188,966	1,142,958
期首剰余金又は期首欠損金( )	117,609	3,376,816
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,904,149	478,918
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,904,149	478,918
剰余金減少額又は欠損金増加額	577,234	1,408,571
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	577,234	1,408,571
当期追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
分配金	1 -	1 -
期末剰余金又は期末欠損金( )	3,376,816	1,347,270

## (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4期	
	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日	
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。	
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 2020年1月25日が休日のため、前計算期間末日を2020年1月27日としております。このため、当計算期間は364日となっております。	

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第3期	第4期
	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
1. 1 期首元本額	4,832,554円	40,738,604円
期中追加設定元本額	48,695,808円	60,312,399円
期中一部解約元本額	12,789,758円	26,011,910円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	40,738,604口	75,039,093口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第3期	第4期
自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
<p>1 分配金の計算過程</p> <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（300,447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（623,104円）、投資信託約款に規定される収益調整金（2,418,139円）及び分配準備積立金（35,126円）より、分配対象額は3,376,816円（1万口当たり828.86円）であります。分配を行っておりません。</p>	<p>1 分配金の計算過程</p> <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（260,755円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（3,855,551円）及び分配準備積立金（592,546円）より、分配対象額は4,708,852円（1万口当たり627.50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)

・金融商品の状況に関する事項

区 分	第3期	第4期
	自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左

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

## ・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	第3期 [2020年 1月27日現在]	第4期 [2021年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

（有価証券に関する注記）

第3期（自 2019年1月26日 至 2020年1月27日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,007,025円
合計	1,007,025円

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

第4期（自 2020年1月28日 至 2021年1月25日）

売買目的有価証券

種 類	当計算期間の損益に含まれた評価差額
親投資信託受益証券	1,244,450円
合計	1,244,450円

(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3期 [2020年 1月27日現在]		第4期 [2021年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額	1.0829円 10,829円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額	1.0180円 10,180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	6,363,953	10,089,411	
	TMA日本債券インデックスマ ザーファンド	41,050,741	53,148,394	
	東京海上・東証REITマザー ファンド	7,891,695	9,857,516	
親投資信託受益証券 合計		55,306,389	73,095,321	
合計		55,306,389	73,095,321	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(ご参考)

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

## 「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
		金額(円)	金額(円)
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		837,619,475	2,696,408,532
株式	2	30,248,893,330	34,094,932,310
派生商品評価勘定		989,000	9,595,500
未収配当金		47,970,938	39,290,559
流動資産合計		31,135,472,743	36,840,226,901
資産合計		31,135,472,743	36,840,226,901
<b>負債の部</b>			
流動負債			
派生商品評価勘定		10,385,800	
前受金		3,365,000	6,130,000
未払解約金		60,445,017	43,800,858
未払利息		485	1,482
流動負債合計		74,196,302	49,932,340
負債合計		74,196,302	49,932,340
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1	21,904,463,467	23,205,064,108
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		9,156,812,974	13,585,230,453
元本等合計		31,061,276,441	36,790,294,561
純資産合計		31,061,276,441	36,790,294,561
負債純資産合計		31,135,472,743	36,840,226,901

## (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 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	30,949,367,570円	21,904,463,467円
同期中における追加設定元本額	7,281,859,918円	14,089,938,434円
同期中における一部解約元本額	16,326,764,021円	12,789,337,793円
同期末における元本額	21,904,463,467円	23,205,064,108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	102,659,801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	356,122,493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	291,783,942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	388,080,266円
東京海上日本株TOPIXファンド	241,129,562円	円
東京海上セレクション・日本株TOPIX LPS4資産分散ファンド(慎重型)	15,953,838,356円	15,376,675,823円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	6,383,490円	6,870,642円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	11,720,722円	11,122,210円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	36,327,576円	36,135,437円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	45,262,926円	48,835,209円
53,733,866円	50,765,644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	6,363,953円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	1,025,334円	30,374,294円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	481,726円	10,606,283円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	269,470円	9,625,843円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	388,428円	17,770,539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	486,249,709円
T M A 世界バランスファンド35V A <適格機関投資家限定>	2,147,883円	円
東京海上・世界インデックス・バランス40 <適格機関投資家限定>	60,740,579円	129,226,810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	864,717,062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	4,806,171,995円
円資産バランスオープン <適格機関投資家限定>	円	174,906,153円
計	21,904,463,467円	23,205,064,108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	23,205,064,108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	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 681,390,000円

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

(注2) 3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びその リスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券及びデリバティブ取引であります。デリバティブ取引には、先物取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左

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

・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>

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

## (有価証券に関する注記)

(自 2019年1月26日 至 2020年1月27日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	1,581,808,220円
合計	1,581,808,220円

(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。

(自 2020年1月28日 至 2021年1月25日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
株式	8,804,564,668円
合計	8,804,564,668円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年3月24日から2021年1月25日まで)を指しております。

## (デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(2020年1月27日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等	うち	時 価	評価損益
			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

(2021年1月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,684,345,000		2,694,100,000	9,755,000
	東証株価指数先物	2,684,345,000		2,694,100,000	9,755,000
合計		2,684,345,000		2,694,100,000	9,755,000

(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]		[2021年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4180円 14,180円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5854円 15,854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	18,000	434.00	7,812,000	
マルハニチロ	3,100	2,350.00	7,285,000	
サカタのタネ	2,000	3,630.00	7,260,000	
ホクト	2,500	2,176.00	5,440,000	
国際石油開発帝石	68,400	618.00	42,271,200	
石油資源開発	2,400	2,062.00	4,948,800	
K&Oエナジーグループ	2,800	1,435.00	4,018,000	
ショーボンドホールディングス	2,500	4,625.00	11,562,500	
ミライト・ホールディングス	4,700	1,704.00	8,008,800	
ベステラ	3,000	1,771.00	5,313,000	
安藤・間	11,400	735.00	8,379,000	
東急建設	7,900	515.00	4,068,500	
コムシスホールディングス	6,400	3,115.00	19,936,000	
東建コーポレーション	700	7,930.00	5,551,000	
ヤマウラ	4,800	928.00	4,454,400	
大成建設	14,000	3,500.00	49,000,000	
大林組	42,000	921.00	38,682,000	

清水建設	42,800	774.00	33,127,200
長谷工コーポレーション	17,200	1,249.00	21,482,800
鹿島建設	32,800	1,424.00	46,707,200
西松建設	2,800	2,403.00	6,728,400
三井住友建設	12,400	445.00	5,518,000
前田建設工業	11,000	883.00	9,713,000
奥村組	2,600	2,661.00	6,918,600
東鉄工業	2,900	2,741.00	7,948,900
戸田建設	19,400	737.00	14,297,800
熊谷組	2,800	2,647.00	7,411,600
大東建託	4,500	9,660.00	43,470,000
N I P P O	3,800	2,694.00	10,237,200
前田道路	4,200	1,754.00	7,366,800
東亜建設工業	2,900	2,092.00	6,066,800
五洋建設	18,300	906.00	16,579,800
住友林業	10,400	2,068.00	21,507,200
日本基礎技術	5,700	465.00	2,650,500
大和ハウス工業	41,100	3,037.00	124,820,700
積水ハウス	45,100	2,130.50	96,085,550
北陸電気工事	4,000	1,228.00	4,912,000
中電工	2,400	2,162.00	5,188,800
関電工	6,800	905.00	6,154,000
きんでん	10,000	1,723.00	17,230,000
日本電設工業	2,800	2,030.00	5,684,000
協和エクシオ	5,900	2,772.00	16,354,800
新日本空調	1,600	2,166.00	3,465,600
九電工	2,600	3,215.00	8,359,000
三機工業	4,200	1,247.00	5,237,400
日揮ホールディングス	13,200	1,184.00	15,628,800
中外炉工業	2,300	1,633.00	3,755,900
ヤマト	6,500	707.00	4,595,500
高砂熱学工業	4,600	1,599.00	7,355,400
三晃金属工業	800	2,898.00	2,318,400
大気社	3,700	2,804.00	10,374,800
日比谷総合設備	3,500	1,868.00	6,538,000
OSJBホールディングス	17,300	275.00	4,757,500
東洋エンジニアリング	5,600	454.00	2,542,400
レイズネクスト	3,300	1,202.00	3,966,600
ニッポン	3,900	1,619.00	6,314,100
日清製粉グループ本社	15,400	1,676.00	25,810,400
鳥越製粉	6,000	872.00	5,232,000
日本甜菜製糖	3,000	1,602.00	4,806,000
三井製糖	2,000	1,869.00	3,738,000



森永製菓	3,200	3,935.00	12,592,000
江崎グリコ	3,700	4,580.00	16,946,000
山崎製パン	10,600	1,784.00	18,910,400
亀田製菓	1,000	4,865.00	4,865,000
寿スピリッツ	1,200	5,500.00	6,600,000
カルビー	6,000	3,150.00	18,900,000
森永乳業	2,500	5,140.00	12,850,000
ヤクルト本社	9,100	5,560.00	50,596,000
明治ホールディングス	8,800	7,160.00	63,008,000
雪印メグミルク	2,800	2,289.00	6,409,200
プリマハム	2,300	3,170.00	7,291,000
日本ハム	5,100	4,410.00	22,491,000
丸大食品	2,900	1,708.00	4,953,200
S Foods	2,500	3,455.00	8,637,500
伊藤ハム米久ホールディングス	10,200	700.00	7,140,000
サッポロホールディングス	4,600	2,000.00	9,200,000
アサヒグループホールディングス	29,000	4,294.00	124,526,000
キリンホールディングス	56,400	2,297.50	129,579,000
宝ホールディングス	10,200	1,252.00	12,770,400
オエノンホールディングス	10,400	384.00	3,993,600
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	9,900	1,575.00	15,592,500
サントリー食品インターナショナル	8,900	3,655.00	32,529,500
ダイドーグループホールディングス	1,100	5,130.00	5,643,000
伊藤園	4,000	6,490.00	25,960,000
キーコーヒー	1,800	2,148.00	3,866,400
ユニカフェ	3,600	992.00	3,571,200
ジャパンフーズ	3,800	1,220.00	4,636,000
日清オイリオグループ	2,600	3,030.00	7,878,000
不二製油グループ本社	3,000	3,065.00	9,195,000
J - オイルミルズ	700	3,670.00	2,569,000
キッコーマン	9,600	7,570.00	72,672,000
味の素	29,400	2,445.50	71,897,700
キューピー	7,500	2,274.00	17,055,000
ハウス食品グループ本社	4,600	3,750.00	17,250,000
カゴメ	5,100	3,395.00	17,314,500
アリアケジャパン	900	6,710.00	6,039,000
ニチレイ	6,800	2,926.00	19,896,800
東洋水産	6,800	5,160.00	35,088,000
日清食品ホールディングス	5,600	9,020.00	50,512,000
フジッコ	3,500	2,029.00	7,101,500
ロック・フィールド	4,200	1,519.00	6,379,800
日本たばこ産業	71,300	2,053.50	146,414,550
ユーグレナ	5,600	881.00	4,933,600

片倉工業	4,600	1,372.00	6,311,200
ゲンゼ	1,100	3,300.00	3,630,000
東洋紡	5,400	1,352.00	7,300,800
倉敷紡績	1,900	1,806.00	3,431,400
日本毛織	7,000	963.00	6,741,000
帝国繊維	2,300	2,289.00	5,264,700
帝人	10,500	1,960.00	20,580,000
東レ	95,100	724.60	68,909,460
日本フェルト	8,000	430.00	3,440,000
セーレン	4,100	1,596.00	6,543,600
小松マテール	6,400	1,012.00	6,476,800
ワコールホールディングス	3,400	2,059.00	7,000,600
ホギメディカル	2,400	3,230.00	7,752,000
T S Iホールディングス	9,800	252.00	2,469,600
ゴールドウイン	2,100	6,400.00	13,440,000
デサント	3,700	1,817.00	6,722,900
特種東海製紙	1,100	4,805.00	5,285,500
王子ホールディングス	57,800	643.00	37,165,400
日本製紙	5,900	1,242.00	7,327,800
三菱製紙	6,300	334.00	2,104,200
北越コーポレーション	13,200	434.00	5,728,800
大王製紙	6,000	1,957.00	11,742,000
レンゴー	13,600	859.00	11,682,400
ザ・バック	1,100	2,581.00	2,839,100
クラレ	21,600	1,133.00	24,472,800
旭化成	86,200	1,204.50	103,827,900
共和レザー	4,200	633.00	2,658,600
昭和電工	9,600	2,433.00	23,356,800
住友化学	98,900	500.00	49,450,000
日産化学	7,100	6,120.00	43,452,000
クレハ	1,100	6,770.00	7,447,000
石原産業	6,700	763.00	5,112,100
片倉コープアグリ	3,600	1,227.00	4,417,200
日本曹達	1,900	3,060.00	5,814,000
東ソー	20,300	1,789.00	36,316,700
トクヤマ	3,400	2,622.00	8,914,800
セントラル硝子	2,700	2,187.00	5,904,900
東亜合成	8,300	1,176.00	9,760,800
大阪ソーダ	1,800	2,620.00	4,716,000
デンカ	4,700	4,180.00	19,646,000
信越化学工業	22,300	19,635.00	437,860,500
堺化学工業	4,200	2,058.00	8,643,600
エア・ウォーター	11,400	1,758.00	20,041,200

日本酸素ホールディングス	12,400	2,093.00	25,953,200	
日本パーカライジング	6,800	1,017.00	6,915,600	
ステラ ケミファ	1,300	3,725.00	4,842,500	
日本触媒	2,000	5,810.00	11,620,000	
カネカ	3,100	3,695.00	11,454,500	
三菱瓦斯化学	12,700	2,539.00	32,245,300	
三井化学	12,100	3,060.00	37,026,000	
J S R	12,100	3,280.00	39,688,000	
東京応化工業	1,900	7,760.00	14,744,000	
三菱ケミカルホールディングス	87,900	746.00	65,573,400	
K H ネオケム	2,000	2,526.00	5,052,000	
ダイセル	18,400	793.00	14,591,200	
住友ベークライト	1,700	3,760.00	6,392,000	
積水化学工業	27,600	2,047.00	56,497,200	
日本ゼオン	12,200	1,542.00	18,812,400	
アイカ工業	3,600	3,570.00	12,852,000	
宇部興産	6,500	2,038.00	13,247,000	
旭有機材	2,800	1,501.00	4,202,800	
タイガースポリマー	5,600	400.00	2,240,000	
ミライアル	2,800	1,236.00	3,460,800	
日本化薬	7,800	1,000.00	7,800,000	
A D E K A	6,000	1,806.00	10,836,000	
日油	4,800	5,040.00	24,192,000	
ハリマ化成グループ	4,700	954.00	4,483,800	
花王	31,600	7,680.00	242,688,000	
ニイタカ	1,800	2,805.00	5,049,000	
三洋化成工業	1,200	5,410.00	6,492,000	
日本ペイントホールディングス	10,600	9,430.00	99,958,000	
関西ペイント	14,700	3,020.00	44,394,000	
中国塗料	6,400	981.00	6,278,400	
太陽ホールディングス	800	6,560.00	5,248,000	
D I C	5,700	2,610.00	14,877,000	
サカタインクス	4,000	1,049.00	4,196,000	
東洋インキ S C ホールディングス	2,700	1,868.00	5,043,600	
富士フイルムホールディングス	25,400	6,257.00	158,927,800	
資生堂	26,300	7,009.00	184,336,700	
ライオン	17,300	2,357.00	40,776,100	
高砂香料工業	2,200	2,515.00	5,533,000	
マンダム	3,000	1,588.00	4,764,000	
ミルボン	1,400	6,790.00	9,506,000	
ファンケル	5,600	4,020.00	22,512,000	
コーセー	2,500	16,620.00	41,550,000	
コタ	4,100	1,471.00	6,031,100	

ポーラ・オルビスホールディングス	5,400	2,162.00	11,674,800	
ノエビアホールディングス	1,900	4,630.00	8,797,000	
エステー	2,800	1,985.00	5,558,000	
長谷川香料	2,900	2,048.00	5,939,200	
小林製薬	3,700	11,880.00	43,956,000	
荒川化学工業	4,000	1,207.00	4,828,000	
メック	2,000	2,410.00	4,820,000	
タカラバイオ	3,200	2,877.00	9,206,400	
アース製薬	700	6,060.00	4,242,000	
大成ラミック	1,600	2,890.00	4,624,000	
クミアイ化学工業	7,100	880.00	6,248,000	
日本農薬	6,300	487.00	3,068,100	
日東電工	9,200	9,290.00	85,468,000	
レック	3,300	1,353.00	4,464,900	
前澤化成工業	3,800	968.00	3,678,400	
エフピコ	2,400	4,175.00	10,020,000	
天馬	2,700	2,183.00	5,894,100	
信越ポリマー	5,200	971.00	5,049,200	
ニフコ	4,900	3,860.00	18,914,000	
バルカー	1,800	2,160.00	3,888,000	
ユニ・チャーム	28,000	4,822.00	135,016,000	
協和キリン	13,500	2,918.00	39,393,000	
武田薬品工業	110,200	3,714.00	409,282,800	
アステラス製薬	114,900	1,720.00	197,628,000	
大日本住友製薬	9,900	1,547.00	15,315,300	
塩野義製薬	16,700	5,751.00	96,041,700	
あすか製薬	3,700	1,579.00	5,842,300	
日本新薬	3,400	7,280.00	24,752,000	
中外製薬	41,400	5,649.00	233,868,600	
科研製薬	2,200	4,100.00	9,020,000	
エーザイ	15,900	7,850.00	124,815,000	
ロート製薬	6,600	3,135.00	20,691,000	
小野薬品工業	30,500	3,108.00	94,794,000	
久光製薬	3,500	6,130.00	21,455,000	
持田製薬	1,500	3,905.00	5,857,500	
参天製薬	24,900	1,692.00	42,130,800	
ツムラ	4,000	3,395.00	13,580,000	
日医工	4,200	1,002.00	4,208,400	
キッセイ薬品工業	4,100	2,228.00	9,134,800	
生化学工業	3,800	1,031.00	3,917,800	
栄研化学	3,500	1,995.00	6,982,500	
鳥居薬品	1,200	3,270.00	3,924,000	
JCRファーマ	3,100	2,483.00	7,697,300	

東和薬品	2,700	1,986.00	5,362,200
沢井製薬	2,500	4,775.00	11,937,500
ゼリア新薬工業	3,200	1,926.00	6,163,200
第一三共	113,700	3,586.00	407,728,200
キョーリン製薬ホールディングス	3,100	1,958.00	6,069,800
大幸薬品	4,200	1,632.00	6,854,400
大塚ホールディングス	27,500	4,478.00	123,145,000
大正製薬ホールディングス	2,700	6,730.00	18,171,000
ペプチドリーム	6,700	5,910.00	39,597,000
ニチレキ	2,400	1,516.00	3,638,400
出光興産	14,900	2,524.00	37,607,600
E N E O Sホールディングス	195,200	435.40	84,990,080
コスモエネルギーホールディングス	3,700	2,321.00	8,587,700
横浜ゴム	7,600	1,696.00	12,889,600
TOYO TIRE	7,200	1,639.00	11,800,800
ブリヂストン	35,200	4,100.00	144,320,000
住友ゴム工業	12,000	994.00	11,928,000
オカモト	900	3,905.00	3,514,500
ニッタ	1,800	2,225.00	4,005,000
住友理工	8,500	587.00	4,989,500
バンドー化学	5,800	660.00	3,828,000
日東紡績	1,600	4,660.00	7,456,000
A G C	12,200	3,830.00	46,726,000
日本山村硝子	3,200	863.00	2,761,600
日本電気硝子	5,300	2,257.00	11,962,100
住友大阪セメント	2,400	3,115.00	7,476,000
太平洋セメント	8,300	2,661.00	22,086,300
日本ヒューム	6,400	787.00	5,036,800
東海カーボン	13,000	1,530.00	19,890,000
東洋炭素	2,600	2,059.00	5,353,400
T O T O	9,500	5,960.00	56,620,000
日本碍子	16,400	1,753.00	28,749,200
日本特殊陶業	10,800	1,798.00	19,418,400
ニチアス	3,300	2,464.00	8,131,200
ニチハ	3,400	3,290.00	11,186,000
日本製鉄	58,700	1,305.50	76,632,850
神戸製鋼所	25,100	521.00	13,077,100
ジェイ エフ イー ホールディングス	35,000	1,003.00	35,105,000
東京製鐵	8,100	674.00	5,459,400
共英製鋼	3,400	1,383.00	4,702,200
大和工業	2,400	2,688.00	6,451,200
大阪製鐵	3,200	1,269.00	4,060,800
淀川製鋼所	2,200	2,102.00	4,624,400

丸一鋼管	4,500	2,276.00	10,242,000	
大同特殊鋼	2,000	4,220.00	8,440,000	
山陽特殊製鋼	5,100	1,468.00	7,486,800	
愛知製鋼	1,400	3,185.00	4,459,000	
日立金属	14,500	1,680.00	24,360,000	
大平洋金属	2,900	2,366.00	6,861,400	
新日本電工	25,900	284.00	7,355,600	
三菱製鋼	3,900	642.00	2,503,800	
シンニッタン	9,400	205.00	1,927,000	
日本軽金属ホールディングス	4,000	1,982.00	7,928,000	
三井金属鉱業	3,500	4,035.00	14,122,500	
東邦亜鉛	2,400	2,380.00	5,712,000	
三菱マテリアル	8,600	2,380.00	20,468,000	
住友金属鉱山	16,800	5,103.00	85,730,400	
DOWAホールディングス	2,800	4,045.00	11,326,000	
古河機械金属	3,600	1,246.00	4,485,600	
UACJ	2,300	1,922.00	4,420,600	
古河電気工業	3,500	2,850.00	9,975,000	
住友電気工業	49,100	1,449.00	71,145,900	
フジクラ	15,800	487.00	7,694,600	
タツタ電線	7,100	789.00	5,601,900	
リョービ	4,500	1,242.00	5,589,000	
アサヒホールディングス	2,000	4,330.00	8,660,000	
トーカロ	4,700	1,549.00	7,280,300	
SUMCO	16,500	2,446.00	40,359,000	
東洋製罐グループホールディングス	8,200	1,155.00	9,471,000	
コロナ	3,400	942.00	3,202,800	
横河ブリッジホールディングス	2,900	2,057.00	5,965,300	
駒井ハルテック	1,800	2,323.00	4,181,400	
三和ホールディングス	13,400	1,222.00	16,374,800	
文化シャッター	5,600	931.00	5,213,600	
三協立山	4,700	813.00	3,821,100	
LIXIL	19,400	2,487.00	48,247,800	
ノーリツ	5,100	1,534.00	7,823,400	
長府製作所	2,100	2,093.00	4,395,300	
リンナイ	2,400	11,250.00	27,000,000	
日東精工	9,100	452.00	4,113,200	
東プレ	7,400	1,469.00	10,870,600	
高周波熱錬	4,800	483.00	2,318,400	
パイオラックス	4,700	1,539.00	7,233,300	
日本発條	13,800	722.00	9,963,600	
三益半導体工業	1,500	3,010.00	4,515,000	
日本製鋼所	3,900	3,100.00	12,090,000	

三浦工業	5,600	6,170.00	34,552,000	
タクマ	4,900	2,166.00	10,613,400	
オークマ	1,100	6,240.00	6,864,000	
芝浦機械	2,700	2,512.00	6,782,400	
アマダ	17,700	1,203.00	21,293,100	
アイダエンジニアリング	5,700	992.00	5,654,400	
F U J I	4,900	2,864.00	14,033,600	
牧野フライス製作所	1,600	4,220.00	6,752,000	
オーエスジー	6,400	1,949.00	12,473,600	
旭ダイヤモンド工業	9,300	475.00	4,417,500	
D M G 森精機	8,100	1,619.00	13,113,900	
ディスコ	1,800	37,200.00	66,960,000	
日東工器	2,500	1,745.00	4,362,500	
島精機製作所	2,300	1,880.00	4,324,000	
日阪製作所	4,600	848.00	3,900,800	
ナブテスコ	7,700	5,080.00	39,116,000	
S M C	4,100	67,740.00	277,734,000	
ユニオンツール	1,900	3,575.00	6,792,500	
オイレス工業	2,300	1,686.00	3,877,800	
サトーホールディングス	4,000	2,206.00	8,824,000	
小松製作所	60,000	2,935.00	176,100,000	
住友重機械工業	7,500	3,035.00	22,762,500	
日立建機	5,000	3,220.00	16,100,000	
巴工業	2,400	2,035.00	4,884,000	
井関農機	3,700	1,388.00	5,135,600	
タカキタ	5,500	710.00	3,905,000	
クボタ	70,200	2,360.00	165,672,000	
月島機械	3,800	1,386.00	5,266,800	
帝国電機製作所	3,300	1,192.00	3,933,600	
新東工業	6,100	753.00	4,593,300	
小森コーポレーション	4,900	712.00	3,488,800	
鶴見製作所	3,200	1,813.00	5,801,600	
荏原製作所	5,600	3,685.00	20,636,000	
西島製作所	5,900	874.00	5,156,600	
ダイキン工業	16,900	23,330.00	394,277,000	
栗田工業	7,100	4,435.00	31,488,500	
椿本チエイン	2,200	2,760.00	6,072,000	
ダイフク	6,700	12,850.00	86,095,000	
タダノ	4,600	941.00	4,328,600	
フジテック	5,200	2,373.00	12,339,600	
C K D	3,800	2,649.00	10,066,200	
平和	3,600	1,457.00	5,245,200	
S A N K Y O	3,100	2,940.00	9,114,000	

日本金銭機械	4,900	522.00	2,557,800
フクシマガリレイ	1,400	4,335.00	6,069,000
竹内製作所	2,500	2,404.00	6,010,000
アマノ	3,500	2,431.00	8,508,500
グローリー	3,900	2,048.00	7,987,200
大和冷機工業	4,700	1,036.00	4,869,200
セガサミーホールディングス	13,600	1,706.00	23,201,600
リケン	2,000	2,128.00	4,256,000
ホシザキ	4,200	9,030.00	37,926,000
大豊工業	4,200	760.00	3,192,000
日本精工	26,800	971.00	26,022,800
N T N	34,800	275.00	9,570,000
ジェイテクト	13,400	886.00	11,872,400
不二越	1,800	4,395.00	7,911,000
日本トムソン	10,600	483.00	5,119,800
T H K	8,000	3,660.00	29,280,000
ユーシン精機	4,100	965.00	3,956,500
キッツ	6,600	600.00	3,960,000
マキタ	17,300	5,150.00	89,095,000
日立造船	12,400	662.00	8,208,800
三菱重工業	22,300	3,158.00	70,423,400
I H I	10,300	1,999.00	20,589,700
スター精密	3,700	1,625.00	6,012,500
日清紡ホールディングス	8,100	786.00	6,366,600
イビデン	8,000	5,110.00	40,880,000
コニカミノルタ	30,800	423.00	13,028,400
ブラザー工業	16,300	2,340.00	38,142,000
ミネベアミツミ	24,800	2,352.00	58,329,600
日立製作所	63,500	4,398.00	279,273,000
三菱電機	132,400	1,670.00	221,108,000
富士電機	8,000	4,150.00	33,200,000
安川電機	14,300	5,820.00	83,226,000
明電舎	3,500	2,494.00	8,729,000
東芝テック	1,200	3,760.00	4,512,000
マブチモーター	3,500	4,180.00	14,630,000
日本電産	31,800	14,320.00	455,376,000
東光高岳	3,200	1,623.00	5,193,600
ダイヘン	1,500	4,975.00	7,462,500
日新電機	3,800	1,400.00	5,320,000
オムロン	11,800	9,410.00	111,038,000
日東工業	2,400	2,074.00	4,977,600
ジーエス・ユアサ コーポレーション	4,700	3,215.00	15,110,500
メルコホールディングス	1,400	3,500.00	4,900,000



テクノメディカ	1,800	1,580.00	2,844,000	
日本電気	16,000	5,930.00	94,880,000	
富士通	12,700	16,740.00	212,598,000	
沖電気工業	5,400	1,080.00	5,832,000	
サンケン電気	2,100	5,110.00	10,731,000	
アイホン	2,800	1,642.00	4,597,600	
ルネサスエレクトロニクス	56,100	1,334.00	74,837,400	
セイコーエプソン	17,300	1,662.00	28,752,600	
ワコム	6,200	1,008.00	6,249,600	
アルバック	2,600	5,150.00	13,390,000	
E I Z O	3,100	3,750.00	11,625,000	
日本信号	4,500	936.00	4,212,000	
能美防災	2,300	2,223.00	5,112,900	
ホーチキ	3,500	1,237.00	4,329,500	
エレコム	1,200	5,050.00	6,060,000	
パナソニック	151,400	1,423.00	215,442,200	
シャープ	14,900	2,073.00	30,887,700	
アンリツ	8,800	2,654.00	23,355,200	
富士通ゼネラル	4,000	2,636.00	10,544,000	
ソニー	82,800	10,300.00	852,840,000	
T D K	6,400	17,750.00	113,600,000	
アルプスアルパイン	12,000	1,543.00	18,516,000	
日本トリム	700	4,545.00	3,181,500	
フォスター電機	3,400	1,488.00	5,059,200	
ヨコオ	2,200	3,290.00	7,238,000	
ホシデン	8,400	960.00	8,064,000	
ヒロセ電機	1,900	15,610.00	29,659,000	
日本航空電子工業	3,900	1,627.00	6,345,300	
アイコム	2,000	2,712.00	5,424,000	
船井電機	5,600	430.00	2,408,000	
横河電機	11,900	2,318.00	27,584,200	
アズビル	8,400	5,450.00	45,780,000	
日本光電工業	5,700	3,140.00	17,898,000	
堀場製作所	2,500	6,940.00	17,350,000	
アドバンテスト	9,800	9,170.00	89,866,000	
キーエンス	12,000	57,470.00	689,640,000	
日置電機	1,000	4,255.00	4,255,000	
シスメックス	9,500	13,000.00	123,500,000	
O B A R A G R O U P	1,000	4,140.00	4,140,000	
コーセル	1,400	1,221.00	1,709,400	
イリソ電子工業	1,100	4,805.00	5,285,500	
オプテックスグループ	3,200	2,090.00	6,688,000	
千代田インテグレ	2,600	1,801.00	4,682,600	

レーザーテック	5,800	15,060.00	87,348,000	
スタンレー電気	9,400	3,300.00	31,020,000	
ウシオ電機	7,800	1,395.00	10,881,000	
日本セラミック	1,900	2,843.00	5,401,700	
図研	2,200	2,859.00	6,289,800	
日本電子	2,600	4,475.00	11,635,000	
カシオ計算機	11,700	1,769.00	20,697,300	
ファナック	12,400	26,960.00	334,304,000	
ローム	5,500	11,690.00	64,295,000	
浜松ホトニクス	9,500	6,520.00	61,940,000	
三井ハイテック	3,200	4,395.00	14,064,000	
新光電気工業	4,900	2,700.00	13,230,000	
京セラ	18,600	6,952.00	129,307,200	
太陽誘電	5,800	6,040.00	35,032,000	
村田製作所	38,900	10,580.00	411,562,000	
双葉電子工業	4,500	946.00	4,257,000	
ニチコン	4,900	1,509.00	7,394,100	
日本ケミコン	2,300	1,976.00	4,544,800	
K O A	3,100	1,693.00	5,248,300	
小糸製作所	7,900	7,070.00	55,853,000	
ミツバ	7,800	452.00	3,525,600	
S C R E E Nホールディングス	2,100	8,430.00	17,703,000	
キヤノン電子	3,400	1,597.00	5,429,800	
キヤノン	65,900	2,225.00	146,627,500	
リコー	36,200	736.00	26,643,200	
象印マホービン	3,700	1,739.00	6,434,300	
東京エレクトロン	8,300	43,970.00	364,951,000	
トヨタ紡織	3,900	1,664.00	6,489,600	
ユニプレス	6,300	979.00	6,167,700	
豊田自動織機	10,700	8,680.00	92,876,000	
モリタホールディングス	2,800	1,705.00	4,774,000	
デンソー	29,100	5,993.00	174,396,300	
東海理化電機製作所	3,500	1,704.00	5,964,000	
川崎重工業	10,600	2,392.00	25,355,200	
日産自動車	151,500	549.50	83,249,250	
いすゞ自動車	38,900	952.00	37,032,800	
トヨタ自動車	147,600	7,677.00	1,133,125,200	70,000株
日野自動車	17,800	919.00	16,358,200	
三菱自動車工業	51,500	235.00	12,102,500	
武蔵精密工業	4,000	1,495.00	5,980,000	
日産車体	4,700	867.00	4,074,900	
新明和工業	4,500	909.00	4,090,500	
極東開発工業	3,000	1,436.00	4,308,000	

トピー工業	2,800	1,283.00	3,592,400
ティラド	2,400	1,338.00	3,211,200
NOK	6,800	1,245.00	8,466,000
フタバ産業	8,200	515.00	4,223,000
K Y B	2,900	2,330.00	6,757,000
プレス工業	19,800	310.00	6,138,000
アイシン精機	11,000	3,130.00	34,430,000
マツダ	41,100	765.00	31,441,500
今仙電機製作所	6,000	735.00	4,410,000
本田技研工業	104,200	2,824.50	294,312,900
スズキ	26,200	5,137.00	134,589,400
S U B A R U	41,200	2,031.00	83,677,200
ヤマハ発動機	18,700	2,195.00	41,046,500
エクセディ	4,300	1,467.00	6,308,100
豊田合成	4,100	2,794.00	11,455,400
愛三工業	7,200	525.00	3,780,000
ヨロズ	3,800	1,251.00	4,753,800
エフ・シー・シー	2,700	1,724.00	4,654,800
シマノ	4,900	26,220.00	128,478,000
テイ・エス テック	2,900	3,090.00	8,961,000
テルモ	37,500	4,193.00	157,237,500
クリエートメディック	4,000	968.00	3,872,000
島津製作所	15,900	4,155.00	66,064,500
ブイ・テクノロジー	900	6,510.00	5,859,000
東京精密	2,200	5,120.00	11,264,000
マニー	5,000	2,906.00	14,530,000
ニコン	22,000	855.00	18,810,000
トプコン	6,800	1,305.00	8,874,000
オリンパス	73,300	2,056.50	150,741,450
理研計器	2,400	3,040.00	7,296,000
タムロン	2,700	2,032.00	5,486,400
H O Y A	26,200	13,710.00	359,202,000
朝日インテック	15,000	3,455.00	51,825,000
シチズン時計	18,700	306.00	5,722,200
メニコン	1,500	6,830.00	10,245,000
セイコーホールディングス	2,400	1,322.00	3,172,800
ニプロ	9,200	1,236.00	11,371,200
パラマウントベッドホールディングス	1,400	4,775.00	6,685,000
バンダイナムコホールディングス	13,700	9,544.00	130,752,800
アイフィスジャパン	4,400	708.00	3,115,200
パイロットコーポレーション	1,900	2,988.00	5,677,200
トッパン・フォームズ	5,400	1,066.00	5,756,400
フジシールインターナショナル	2,900	1,931.00	5,599,900

タカラトミー	6,700	900.00	6,030,000	
タカノ	4,100	597.00	2,447,700	
大建工業	4,800	1,757.00	8,433,600	
凸版印刷	19,700	1,488.00	29,313,600	
大日本印刷	17,500	1,849.00	32,357,500	
N I S S H A	4,200	1,384.00	5,812,800	
アシックス	11,700	1,782.00	20,849,400	
小松ウオール工業	2,200	1,739.00	3,825,800	
ヤマハ	7,900	6,070.00	47,953,000	
クリナップ	5,100	469.00	2,391,900	
ピジョン	8,500	4,600.00	39,100,000	
キングジム	5,800	861.00	4,993,800	
リンテック	2,700	2,429.00	6,558,300	
イトーキ	9,700	335.00	3,249,500	
任天堂	8,100	62,680.00	507,708,000	
三菱鉛筆	5,000	1,306.00	6,530,000	
タカラスタンダード	3,400	1,509.00	5,130,600	
コクヨ	6,000	1,343.00	8,058,000	
オカムラ	6,900	942.00	6,499,800	
美津濃	2,400	2,076.00	4,982,400	
東京電力ホールディングス	108,000	409.00	44,172,000	
中部電力	40,800	1,318.00	53,774,400	
関西電力	50,600	1,079.50	54,622,700	
中国電力	19,800	1,292.00	25,581,600	
北陸電力	13,400	712.00	9,540,800	
東北電力	33,900	910.00	30,849,000	
四国電力	12,400	729.00	9,039,600	
九州電力	28,700	1,025.00	29,417,500	
北海道電力	13,700	427.00	5,849,900	
沖縄電力	3,100	1,418.00	4,395,800	
電源開発	10,800	1,775.00	19,170,000	
レノバ	2,000	4,470.00	8,940,000	
東京瓦斯	25,600	2,356.00	60,313,600	
大阪瓦斯	25,800	1,971.00	50,851,800	
東邦瓦斯	6,500	6,290.00	40,885,000	
北海道瓦斯	3,200	1,560.00	4,992,000	
西部瓦斯	2,300	3,025.00	6,957,500	
静岡ガス	5,600	997.00	5,583,200	
東武鉄道	13,900	2,943.00	40,907,700	
相鉄ホールディングス	4,400	2,451.00	10,784,400	
東急	33,700	1,267.00	42,697,900	
京浜急行電鉄	17,700	1,620.00	28,674,000	
小田急電鉄	19,800	3,205.00	63,459,000	

京王電鉄	6,800	8,190.00	55,692,000	
京成電鉄	9,400	3,465.00	32,571,000	
富士急行	2,100	4,965.00	10,426,500	
東日本旅客鉄道	23,300	6,840.00	159,372,000	
西日本旅客鉄道	11,800	5,390.00	63,602,000	
東海旅客鉄道	10,900	14,750.00	160,775,000	
西武ホールディングス	18,100	989.00	17,900,900	
西日本鉄道	3,200	2,929.00	9,372,800	
近鉄グループホールディングス	12,600	4,475.00	56,385,000	
阪急阪神ホールディングス	16,800	3,365.00	56,532,000	
南海電気鉄道	5,600	2,537.00	14,207,200	
京阪ホールディングス	5,600	4,935.00	27,636,000	
名古屋鉄道	10,600	2,661.00	28,206,600	
日本通運	4,500	7,280.00	32,760,000	
ヤマトホールディングス	21,300	2,616.00	55,720,800	
山九	3,400	3,955.00	13,447,000	
丸運	12,500	254.00	3,175,000	
センコーグループホールディングス	8,300	994.00	8,250,200	
トナミホールディングス	700	5,420.00	3,794,000	
ニッコンホールディングス	4,500	2,108.00	9,486,000	
日本石油輸送	700	2,652.00	1,856,400	
福山通運	1,500	4,080.00	6,120,000	
セイノーホールディングス	9,600	1,390.00	13,344,000	
日立物流	2,500	3,125.00	7,812,500	
C & F ロジホールディングス	4,000	2,119.00	8,476,000	
九州旅客鉄道	11,400	2,137.00	24,361,800	
S Gホールディングス	26,400	2,775.00	73,260,000	
日本郵船	10,900	2,585.00	28,176,500	
商船三井	7,400	2,978.00	22,037,200	
川崎汽船	4,800	1,971.00	9,460,800	
飯野海運	15,200	431.00	6,551,200	
日本航空	26,100	1,890.00	49,329,000	
A N Aホールディングス	31,300	2,233.00	69,892,900	
三菱倉庫	4,000	3,100.00	12,400,000	
三井倉庫ホールディングス	2,300	2,290.00	5,267,000	
住友倉庫	4,700	1,288.00	6,053,600	
東陽倉庫	13,800	319.00	4,402,200	
安田倉庫	4,900	953.00	4,669,700	
上組	7,300	1,861.00	13,585,300	
キムラユニティ	3,500	1,082.00	3,787,000	
キューソー流通システム	1,800	1,565.00	2,817,000	
近鉄エクスプレス	3,300	2,622.00	8,652,600	
エーアイティー	4,400	990.00	4,356,000	

NEC ネットエスアイ	4,100	1,917.00	7,859,700
システナ	5,000	2,038.00	10,190,000
デジタルアーツ	900	10,370.00	9,333,000
日鉄ソリューションズ	1,700	3,235.00	5,499,500
T I S	13,200	2,192.00	28,934,400
J N S ホールディングス	3,900	570.00	2,223,000
電算システム	1,200	3,270.00	3,924,000
グリー	10,400	593.00	6,167,200
コーエーテクモホールディングス	2,900	6,010.00	17,429,000
ブレインパッド	1,300	4,250.00	5,525,000
K L a b	4,600	921.00	4,236,600
ネクソン	32,800	3,265.00	107,092,000
エイチーム	5,900	1,184.00	6,985,600
コロプラ	6,700	930.00	6,231,000
サイバーリンクス	1,200	2,198.00	2,637,600
C A R T A H O L D I N G S	4,300	1,368.00	5,882,400
S H I F T	500	13,100.00	6,550,000
ティーガイア	2,000	1,918.00	3,836,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,800	2,593.00	9,853,400
G M O ペイメントゲートウェイ	2,700	15,640.00	42,228,000
ザッパラス	6,800	497.00	3,379,600
インターネットイニシアティブ	4,100	2,236.00	9,167,600
チェンジ	1,700	3,770.00	6,409,000
フェイス	3,000	812.00	2,436,000
野村総合研究所	18,500	3,805.00	70,392,500
C E ホールディングス	6,800	645.00	4,386,000
インテージホールディングス	4,500	1,153.00	5,188,500
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,800	1,965.00	5,502,000
フジ・メディア・ホールディングス	13,500	1,171.00	15,808,500
オービック	4,500	20,930.00	94,185,000
ジャストシステム	2,000	7,890.00	15,780,000
Zホールディングス	178,200	690.10	122,975,820
トレンドマイクロ	6,900	5,660.00	39,054,000
日本オラクル	2,600	13,170.00	34,242,000
フューチャー	3,900	1,816.00	7,082,400
C A C H o l d i n g s	5,900	1,391.00	8,206,900
S B テクノロジー	1,800	3,490.00	6,282,000
オービックビジネスコンサルタント	1,000	6,910.00	6,910,000
伊藤忠テクノソリューションズ	5,700	3,725.00	21,232,500
大塚商会	7,000	5,300.00	37,100,000
サイボウズ	1,700	2,767.00	4,703,900
電通国際情報サービス	1,700	3,950.00	6,715,000

デジタルガレージ	2,200	3,775.00	8,305,000	
ウェザーニューズ	700	5,170.00	3,619,000	
日本エンタープライズ	4,800	234.00	1,123,200	
ネットワンシステムズ	4,600	3,815.00	17,549,000	
アルゴグラフィックス	1,500	3,095.00	4,642,500	
エイベックス	4,200	1,321.00	5,548,200	
日本ユニシス	3,900	4,015.00	15,658,500	
兼松エレクトロニクス	1,700	4,015.00	6,825,500	
TBSホールディングス	8,400	1,925.00	16,170,000	
日本テレビホールディングス	11,800	1,153.00	13,605,400	
テレビ朝日ホールディングス	3,500	1,879.00	6,576,500	
スカパーJ S A Tホールディングス	13,500	475.00	6,412,500	
テレビ東京ホールディングス	2,400	2,330.00	5,592,000	
日本電信電話	173,600	2,740.00	475,664,000	
KDDI	94,700	3,260.00	308,722,000	
ソフトバンク	118,200	1,343.50	158,801,700	
光通信	1,300	22,220.00	28,886,000	
GMOインターネット	4,900	3,105.00	15,214,500	
KADOKAWA	3,800	3,490.00	13,262,000	
ゼンリン	3,400	1,186.00	4,032,400	
松竹	900	14,240.00	12,816,000	
東宝	7,800	3,950.00	30,810,000	
東映	200	17,490.00	3,498,000	
エヌ・ティ・ティ・データ	34,800	1,510.00	52,548,000	
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	1,603.00	3,847,200	
DTS	3,100	2,098.00	6,503,800	
スクウェア・エニックス・ホールディングス	5,500	5,900.00	32,450,000	
カプコン	6,000	7,200.00	43,200,000	
SCSK	3,200	5,560.00	17,792,000	
アイネス	5,700	1,424.00	8,116,800	
TKC	900	7,190.00	6,471,000	
富士ソフト	1,700	5,210.00	8,857,000	
NSD	4,400	2,042.00	8,984,800	
コナミホールディングス	5,000	6,620.00	33,100,000	
ソフトバンクグループ	103,000	8,664.00	892,392,000	
伊藤忠食品	700	5,270.00	3,689,000	
エレマテック	4,800	1,002.00	4,809,600	
JALUX	2,000	1,400.00	2,800,000	
双日	73,000	248.00	18,104,000	
アルフレッサホールディングス	14,700	2,017.00	29,649,900	
横浜冷凍	6,100	874.00	5,331,400	
神戸物産	8,800	3,035.00	26,708,000	
あいホールディングス	2,600	2,042.00	5,309,200	

ダイワボウホールディングス	800	8,890.00	7,112,000	
マクニカ・富士エレホールディングス	3,500	2,175.00	7,612,500	
バイタルケーエスケー・ホールディングス	6,900	797.00	5,499,300	
レスターホールディングス	2,300	2,160.00	4,968,000	
OCHIホールディングス	3,100	1,313.00	4,070,300	
TOKAIホールディングス	7,500	976.00	7,320,000	
シップヘルスケアホールディングス	2,300	6,110.00	14,053,000	
明治電機工業	2,800	1,570.00	4,396,000	
コメダホールディングス	3,100	1,891.00	5,862,100	
エコートレーディング	7,400	655.00	4,847,000	
ナガイレーベン	3,000	3,020.00	9,060,000	
三菱食品	2,200	2,851.00	6,272,200	
松田産業	3,700	1,893.00	7,004,100	
第一興商	1,700	3,510.00	5,967,000	
メディパルホールディングス	14,600	2,041.00	29,798,600	
アズワン	800	16,480.00	13,184,000	
尾家産業	3,200	1,273.00	4,073,600	
ドウシシャ	2,900	1,975.00	5,727,500	
丸文	5,100	551.00	2,810,100	
橋本総業ホールディングス	2,300	2,587.00	5,950,100	
日本ライフライン	3,700	1,533.00	5,672,100	
進和	2,000	2,118.00	4,236,000	
オーハシテクニカ	2,300	1,412.00	3,247,600	
白銅	2,400	1,421.00	3,410,400	
伊藤忠商事	91,200	3,130.00	285,456,000	
丸紅	135,100	718.50	97,069,350	
長瀬産業	7,700	1,568.00	12,073,600	
豊田通商	14,600	4,280.00	62,488,000	
兼松	5,600	1,340.00	7,504,000	
三井物産	112,600	2,037.00	229,366,200	
日本紙パルプ商事	900	3,515.00	3,163,500	
山善	5,300	1,003.00	5,315,900	
住友商事	82,600	1,439.00	118,861,400	
内田洋行	800	4,135.00	3,308,000	
三菱商事	85,600	2,707.50	231,762,000	
キヤノンマーケティングジャパン	3,100	2,424.00	7,514,400	
西華産業	3,500	1,357.00	4,749,500	
菱洋エレクトロ	1,900	3,420.00	6,498,000	
東京産業	4,700	614.00	2,885,800	
阪和興業	3,800	2,786.00	10,586,800	
岩谷産業	2,800	6,970.00	19,516,000	
イワキ	9,200	688.00	6,329,600	
三愛石油	5,300	1,125.00	5,962,500	



稲畑産業	4,100	1,481.00	6,072,100
ワキタ	3,600	975.00	3,510,000
東邦ホールディングス	3,600	1,959.00	7,052,400
サンゲツ	3,800	1,561.00	5,931,800
シナネンホールディングス	1,400	3,020.00	4,228,000
伊藤忠エネクス	5,300	1,037.00	5,496,100
サンリオ	4,000	1,554.00	6,216,000
リョーサン	1,800	2,084.00	3,751,200
三信電気	1,100	1,883.00	2,071,300
モスフードサービス	2,200	3,065.00	6,743,000
加賀電子	2,500	2,339.00	5,847,500
立花エレテック	2,500	1,599.00	3,997,500
フォーバル	4,600	790.00	3,634,000
PALTA C	2,000	5,570.00	11,140,000
日鉄物産	1,100	3,650.00	4,015,000
トラスコ中山	2,700	2,644.00	7,138,800
オートバックスセブン	5,100	1,419.00	7,236,900
加藤産業	1,600	3,475.00	5,560,000
イノテック	4,300	1,315.00	5,654,500
杉本商事	2,400	2,302.00	5,524,800
因幡電機産業	3,500	2,483.00	8,690,500
ミスミグループ本社	16,400	3,210.00	52,644,000
スズケン	5,800	3,955.00	22,939,000
ジェコス	5,300	960.00	5,088,000
ローソン	3,000	4,850.00	14,550,000
サンエー	1,900	4,085.00	7,761,500
エービーシー・マート	1,800	5,920.00	10,656,000
ハードオフコーポレーション	4,200	768.00	3,225,600
アスクル	1,800	3,755.00	6,759,000
ゲオホールディングス	4,900	1,200.00	5,880,000
アダストリア	2,100	1,899.00	3,987,900
ジーフット	2,800	416.00	1,164,800
エディオン	5,600	1,021.00	5,717,600
あみやき亭	1,100	2,856.00	3,141,600
ハニーズホールディングス	5,600	998.00	5,588,800
ジンスホールディングス	200	6,850.00	1,370,000
ビックカメラ	7,400	1,137.00	8,413,800
DCMホールディングス	7,100	1,082.00	7,682,200
MonotaRO	9,400	5,230.00	49,162,000
J.フロント リテイリング	17,400	863.00	15,016,200
ドトール・日レスホールディングス	2,400	1,562.00	3,748,800
マツモトキヨシホールディングス	5,300	4,285.00	22,710,500
ZOZO	9,600	3,045.00	29,232,000

トレジャー・ファクトリー	2,100	730.00	1,533,000	
ココカラファイン	1,000	7,040.00	7,040,000	
三越伊勢丹ホールディングス	24,300	617.00	14,993,100	
ウエルシアホールディングス	7,900	3,625.00	28,637,500	
クリエイトSDホールディングス	2,000	3,430.00	6,860,000	
シュッピン	3,600	933.00	3,358,800	
ジョイフル本田	3,800	1,426.00	5,418,800	
すかいらーくホールディングス	15,300	1,657.00	25,352,100	
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	4,300	1,124.00	4,833,200	
ゴルフダイジェスト・オンライン	5,000	877.00	4,385,000	
あさひ	3,300	1,649.00	5,441,700	
コスモス薬品	1,200	16,250.00	19,500,000	
トーエル	2,900	831.00	2,409,900	
セブン&アイ・ホールディングス	51,000	4,005.00	204,255,000	
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	8,400	726.00	6,098,400	
ツルハホールディングス	2,800	14,070.00	39,396,000	
サンマルクホールディングス	2,800	1,491.00	4,174,800	
トリドールホールディングス	4,800	1,487.00	7,137,600	
クスリのアオキホールディングス	900	8,550.00	7,695,000	
スシローグローバルホールディングス	7,000	3,870.00	27,090,000	
ノジマ	2,200	2,883.00	6,342,600	
カップ・クリエイト	4,100	1,502.00	6,158,200	
ライトオン	5,200	604.00	3,140,800	
良品計画	17,400	2,407.00	41,881,800	
三城ホールディングス	7,500	317.00	2,377,500	
アドヴァン	3,700	1,148.00	4,247,600	
G-7ホールディングス	3,900	2,533.00	9,878,700	
コーナン商事	2,600	2,896.00	7,529,600	
エコス	1,400	1,911.00	2,675,400	
マルシェ	3,800	494.00	1,877,200	
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	28,900	2,278.00	65,834,200	
西松屋チェーン	4,400	1,409.00	6,199,600	
ゼンショーホールディングス	6,400	2,892.00	18,508,800	
サイゼリヤ	3,200	2,068.00	6,617,600	
魚力	2,900	1,859.00	5,391,100	
ユナイテッドアローズ	2,900	1,533.00	4,445,700	
ハイデイ日高	2,400	1,705.00	4,092,000	
京都きもの友禅	3,500	211.00	738,500	
コロワイド	4,200	1,828.00	7,677,600	
壱番屋	1,000	5,160.00	5,160,000	
スギホールディングス	2,600	7,280.00	18,928,000	

薬王堂ホールディングス	1,900	2,606.00	4,951,400
スクロール	5,800	894.00	5,185,200
木曽路	2,400	2,397.00	5,752,800
千趣会	14,700	323.00	4,748,100
ケーヨー	7,800	757.00	5,904,600
上新電機	2,100	2,838.00	5,959,800
日本瓦斯	1,800	5,060.00	9,108,000
ロイヤルホールディングス	2,600	1,818.00	4,726,800
いなげや	2,000	1,757.00	3,514,000
島忠	2,400	5,480.00	13,152,000
チヨダ	4,000	891.00	3,564,000
ライフコーポレーション	1,400	3,280.00	4,592,000
AOKIホールディングス	7,500	537.00	4,027,500
コメリ	2,200	2,944.00	6,476,800
青山商事	7,000	616.00	4,312,000
しまむら	1,500	11,600.00	17,400,000
高島屋	10,300	937.00	9,651,100
松屋	5,100	828.00	4,222,800
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,500	705.00	5,287,500
丸井グループ	12,100	1,785.00	21,598,500
アクシアル リテイリング	1,100	5,110.00	5,621,000
イオン	50,200	3,361.00	168,722,200
イズミ	2,300	3,755.00	8,636,500
平和堂	2,900	2,171.00	6,295,900
フジ	2,400	1,996.00	4,790,400
ヤオコー	1,200	6,710.00	8,052,000
ゼビオホールディングス	4,200	861.00	3,616,200
ケーズホールディングス	13,500	1,438.00	19,413,000
Genky DrugStores	1,200	3,995.00	4,794,000
ブックオフグループホールディングス	2,700	842.00	2,273,400
アインホールディングス	1,500	6,510.00	9,765,000
ヤマダホールディングス	41,700	539.00	22,476,300
ニトリホールディングス	5,600	21,735.00	121,716,000
吉野家ホールディングス	4,600	2,137.00	9,830,200
王将フードサービス	1,800	5,810.00	10,458,000
ブレナス	2,900	1,950.00	5,655,000
ミニストップ	3,100	1,419.00	4,398,900
アークス	3,100	2,307.00	7,151,700
パローホールディングス	2,500	2,470.00	6,175,000
ファーストリテイリング	1,700	94,000.00	159,800,000
サンドラッグ	4,400	4,050.00	17,820,000
ヤマザワ	2,400	1,739.00	4,173,600
ベルーナ	4,900	1,183.00	5,796,700

めぶきフィナンシャルグループ	75,400	210.00	15,834,000	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,800	1,115.00	4,237,000	
九州フィナンシャルグループ	26,500	424.00	11,236,000	
ゆうちょ銀行	37,600	899.00	33,802,400	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	78,900	393.00	31,007,700	
西日本フィナンシャルホールディングス	8,600	653.00	5,615,800	
関西みらいフィナンシャルグループ	12,600	517.00	6,514,200	
三十三フィナンシャルグループ	3,800	1,263.00	4,799,400	
第四北越フィナンシャルグループ	2,800	2,231.00	6,246,800	
ひろぎんホールディングス	19,900	622.00	12,377,800	
新生銀行	9,700	1,329.00	12,891,300	
あおぞら銀行	7,400	1,946.00	14,400,400	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	894,100	480.00	429,168,000	300,000株
りそなホールディングス	145,200	372.60	54,101,520	
三井住友トラスト・ホールディングス	24,700	3,170.00	78,299,000	
三井住友フィナンシャルグループ	90,300	3,316.00	299,434,800	
千葉銀行	43,600	585.00	25,506,000	
群馬銀行	28,100	325.00	9,132,500	
武蔵野銀行	4,500	1,547.00	6,961,500	
七十七銀行	3,900	1,374.00	5,358,600	
青森銀行	1,600	2,426.00	3,881,600	
秋田銀行	2,800	1,389.00	3,889,200	
山形銀行	5,700	1,012.00	5,768,400	
岩手銀行	2,100	1,951.00	4,097,100	
東邦銀行	12,300	203.00	2,496,900	
東北銀行	2,100	1,094.00	2,297,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	11,500	1,922.00	22,103,000	
静岡銀行	31,200	774.00	24,148,800	
十六銀行	2,100	1,881.00	3,950,100	
スルガ銀行	14,200	317.00	4,501,400	
八十二銀行	30,900	338.00	10,444,200	
山梨中央銀行	3,000	795.00	2,385,000	
大垣共立銀行	2,700	2,010.00	5,427,000	
福井銀行	2,100	1,907.00	4,004,700	
北國銀行	2,000	2,508.00	5,016,000	
滋賀銀行	3,400	1,964.00	6,677,600	
南都銀行	2,500	1,702.00	4,255,000	
百五銀行	17,400	290.00	5,046,000	
京都銀行	4,500	5,640.00	25,380,000	
紀陽銀行	4,400	1,372.00	6,036,800	
ほくほくフィナンシャルグループ	8,400	951.00	7,988,400	
山陰合同銀行	9,500	490.00	4,655,000	
中国銀行	10,700	822.00	8,795,400	

鳥取銀行	1,600	1,116.00	1,785,600
伊予銀行	18,100	614.00	11,113,400
百十四銀行	2,100	1,483.00	3,114,300
四国銀行	5,700	666.00	3,796,200
阿波銀行	2,000	2,215.00	4,430,000
大分銀行	3,000	2,040.00	6,120,000
宮崎銀行	2,100	2,219.00	4,659,900
佐賀銀行	2,400	1,314.00	3,153,600
沖縄銀行	2,200	2,700.00	5,940,000
琉球銀行	4,200	740.00	3,108,000
セブン銀行	47,700	230.00	10,971,000
みずほフィナンシャルグループ	177,600	1,392.50	247,308,000
山口フィナンシャルグループ	16,700	609.00	10,170,300
長野銀行	1,900	1,246.00	2,367,400
名古屋銀行	4,100	2,707.00	11,098,700
北洋銀行	19,700	212.00	4,176,400
中京銀行	1,800	1,917.00	3,450,600
愛媛銀行	4,800	971.00	4,660,800
トマト銀行	2,200	1,023.00	2,250,600
京葉銀行	7,500	407.00	3,052,500
栃木銀行	19,300	172.00	3,319,600
トモニホールディングス	14,100	306.00	4,314,600
フィデアホールディングス	22,000	108.00	2,376,000
池田泉州ホールディングス	24,000	151.00	3,624,000
F P G	7,400	498.00	3,685,200
S B Iホールディングス	14,900	2,700.00	40,230,000
ジャフコ グループ	1,800	5,450.00	9,810,000
大和証券グループ本社	106,800	499.10	53,303,880
野村ホールディングス	230,200	563.00	129,602,600
岡三証券グループ	12,000	404.00	4,848,000
丸三証券	7,300	524.00	3,825,200
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	19,200	323.00	6,201,600
水戸証券	12,300	268.00	3,296,400
いちよし証券	6,900	506.00	3,491,400
松井証券	7,300	820.00	5,986,000
マネックスグループ	13,300	516.00	6,862,800
極東証券	5,600	763.00	4,272,800
藍澤証券	5,800	807.00	4,680,600
かんぽ生命保険	5,100	2,219.00	11,316,900
S O M P Oホールディングス	24,600	4,223.00	103,885,800
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	34,100	3,112.00	106,119,200
第一生命ホールディングス	74,100	1,636.00	121,227,600

東京海上ホールディングス	46,200	5,409.00	249,895,800
T & Dホールディングス	39,300	1,253.00	49,242,900
全国保証	3,400	4,515.00	15,351,000
クレディセゾン	9,000	1,218.00	10,962,000
芙蓉総合リース	1,200	7,220.00	8,664,000
みずほリース	2,100	3,255.00	6,835,500
東京センチュリー	2,500	9,220.00	23,050,000
日本証券金融	9,200	520.00	4,784,000
アイフル	20,200	265.00	5,353,000
リコーリース	1,300	3,120.00	4,056,000
イオンフィナンシャルサービス	8,600	1,299.00	11,171,400
アコム	28,400	467.00	13,262,800
オリエントコーポレーション	37,400	122.00	4,562,800
日立キャピタル	3,100	2,659.00	8,242,900
オリックス	79,300	1,737.00	137,744,100
三菱UFJリース	32,100	530.00	17,013,000
日本取引所グループ	37,600	2,656.50	99,884,400
アサックス	5,500	731.00	4,020,500
NECキャピタルソリューション	2,000	1,973.00	3,946,000
いちご	18,600	284.00	5,282,400
ヒューリック	29,200	1,132.00	33,054,400
野村不動産ホールディングス	8,300	2,225.00	18,467,500
オープンハウス	3,500	4,205.00	14,717,500
東急不動産ホールディングス	36,100	568.00	20,504,800
飯田グループホールディングス	11,000	2,373.00	26,103,000
パーク24	7,600	1,965.00	14,934,000
三井不動産	63,500	2,054.50	130,460,750
三菱地所	91,800	1,645.50	151,056,900
平和不動産	2,800	3,690.00	10,332,000
東京建物	13,000	1,452.00	18,876,000
ダイビル	5,400	1,215.00	6,561,000
京阪神ビルディング	2,800	1,687.00	4,723,600
住友不動産	29,500	3,089.00	91,125,500
テーオーシー	6,200	724.00	4,488,800
スターツコーポレーション	1,900	2,723.00	5,173,700
空港施設	5,500	479.00	2,634,500
ゴールドクレスト	3,400	1,687.00	5,735,800
エスリード	2,000	1,525.00	3,050,000
A V A N T I A	4,300	863.00	3,710,900
イオンモール	6,800	1,713.00	11,648,400
カチタス	3,500	3,370.00	11,795,000
日本空港ビルデング	4,200	5,700.00	23,940,000
ミクシィ	2,500	2,523.00	6,307,500

日本M & Aセンター	9,700	5,940.00	57,618,000
UTグループ	2,200	3,315.00	7,293,000
パソナグループ	2,300	1,943.00	4,468,900
G C A	7,300	704.00	5,139,200
エス・エム・エス	4,200	4,155.00	17,451,000
パーソルホールディングス	13,300	1,965.00	26,134,500
クックパッド	13,300	312.00	4,149,600
学情	2,600	1,340.00	3,484,000
スタジオアリス	1,800	2,023.00	3,641,400
シミックホールディングス	3,700	1,513.00	5,598,100
N J S	2,500	1,998.00	4,995,000
総合警備保障	5,000	5,230.00	26,150,000
カカクコム	9,700	2,961.00	28,721,700
アイロムグループ	2,000	1,845.00	3,690,000
ディップ	2,900	2,575.00	7,467,500
キャリアデザインセンター	2,500	912.00	2,280,000
ベネフィット・ワン	3,900	3,170.00	12,363,000
エムスリー	27,800	10,565.00	293,707,000
アウトソーシング	4,500	1,341.00	6,034,500
ディー・エヌ・エー	6,000	1,956.00	11,736,000
博報堂D Yホールディングス	18,400	1,472.00	27,084,800
ぐるなび	5,300	546.00	2,893,800
ファンコミュニケーションズ	10,500	409.00	4,294,500
W D Bホールディングス	3,100	2,637.00	8,174,700
インフォマート	13,600	930.00	12,648,000
E P Sホールディングス	4,600	1,024.00	4,710,400
クイック	3,700	1,113.00	4,118,100
電通グループ	14,300	3,160.00	45,188,000
H . U . グループホールディングス	3,300	3,160.00	10,428,000
ダイオーズ	3,400	955.00	3,247,000
日本空調サービス	7,100	736.00	5,225,600
オリエンタルランド	13,600	16,230.00	220,728,000
ダスキン	3,200	2,822.00	9,030,400
ラウンドワン	5,600	876.00	4,905,600
リゾートトラスト	5,400	1,497.00	8,083,800
ビー・エム・エル	1,900	3,670.00	6,973,000
りらいあコミュニケーションズ	4,800	1,402.00	6,729,600
リソー教育	13,400	301.00	4,033,400
早稲田アカデミー	2,600	991.00	2,576,600
ユー・エス・エス	14,500	2,100.00	30,450,000
サイバーエージェント	7,800	7,590.00	59,202,000
楽天	60,000	970.00	58,200,000
テー・オー・ダブリュー	6,300	275.00	1,732,500

エン・ジャパン	1,600	3,145.00	5,032,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,500	8,440.00	21,100,000	
インターワークス	4,800	366.00	1,756,800	
アイ・アールジャパンホールディングス	200	19,130.00	3,826,000	
ジャパンマテリアル	3,500	1,596.00	5,586,000	
キャリアリンク	1,600	2,574.00	4,118,400	
ライドオンエクスプレスホールディングス	1,300	2,131.00	2,770,300	
リクルートホールディングス	90,500	4,673.00	422,906,500	
エラン	2,200	1,662.00	3,656,400	
日本郵政	102,500	835.80	85,669,500	
ベイクレント・コンサルティング	500	18,560.00	9,280,000	
MS - J a p a n	1,600	1,156.00	1,849,600	
ジャパンエレベーターサービスホールディングス	2,600	2,629.00	6,835,400	
リログループ	7,200	2,541.00	18,295,200	
エイチ・アイ・エス	2,500	1,739.00	4,347,500	
共立メンテナンス	1,600	3,395.00	5,432,000	
建設技術研究所	3,600	2,520.00	9,072,000	
東京都競馬	1,400	4,460.00	6,244,000	
カナモト	2,600	2,278.00	5,922,800	
トランス・コスモス	1,700	2,650.00	4,505,000	
乃村工藝社	6,200	806.00	4,997,200	
日本管財	3,300	2,012.00	6,639,600	
白洋舎	1,100	2,405.00	2,645,500	
セコム	13,400	9,470.00	126,898,000	
セントラル警備保障	1,800	3,450.00	6,210,000	
メイテック	1,300	5,230.00	6,799,000	
応用地質	4,700	1,299.00	6,105,300	
船井総研ホールディングス	2,600	2,300.00	5,980,000	
ベネッセホールディングス	4,500	2,040.00	9,180,000	
イオンディライト	2,600	2,726.00	7,087,600	
ダイセキ	2,000	3,230.00	6,460,000	
ステップ	3,000	1,540.00	4,620,000	
合 計	14,032,600	-	34,094,932,310	

(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

区 分	注記 番号	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
		金額（円）	金額（円）
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		119,554,673	98,460,233
国債証券		15,514,593,340	16,876,678,160
地方債証券		886,620,100	940,470,500
特殊債券		203,610,000	404,464,000
社債券		668,878,590	948,955,624
未収入金			2,037,820
未収利息		22,353,339	27,074,201
前払費用		5,099,230	1,443,290
流動資産合計		17,420,709,272	19,299,583,828
資産合計		17,420,709,272	19,299,583,828
負債の部			
流動負債			
未払金			64,371,630
未払解約金		5,857,291	20,828,837
未払利息		69	54
流動負債合計		5,857,360	85,200,521
負債合計		5,857,360	85,200,521
純資産の部			
元本等			
元本	1	13,281,789,429	14,840,406,534
剰余金			
剰余金又は欠損金（ ）		4,133,062,483	4,373,976,773
元本等合計		17,414,851,912	19,214,383,307
純資産合計		17,414,851,912	19,214,383,307
負債純資産合計		17,420,709,272	19,299,583,828

## (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 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参考統計値（平均値）等で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,110,566,012円	13,281,789,429円
同期中における追加設定元本額	11,254,827,483円	3,906,123,892円
同期中における一部解約元本額	2,083,604,066円	2,347,506,787円
同期末における元本額	13,281,789,429円	14,840,406,534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	776,121,843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	2,692,333,657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	2,205,925,610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	2,933,938,740円
L P S 4 資産分散ファンド（慎重型）	45,183,668円	51,823,711円
L P S 4 資産分散ファンド（安定重視型）	39,274,198円	39,550,574円
L P S 4 資産分散ファンド（バランス型）	59,757,818円	65,100,188円
L P S 4 資産分散ファンド（成長重視型）	40,612,987円	47,355,744円
L P S 4 資産分散ファンド（積極型）	25,254,825円	27,881,702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	2,967,931,914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	162,175,743円
東京海上・円資産インデックス ファンド	23,543,677円	41,050,741円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	1,015,543円	32,515,238円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	429,224円	10,213,294円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	191,219円	7,381,685円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	243,412円	12,035,007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	147,197,126円

TMA世界バランスファンド35VA <適格機関投資家限定>	4,397,223円	円
東京海上・世界インデックス・バランス40 <適格機関投資家限定>	133,916,828円	298,498,751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	999,061,353円
円資産バランスオープン <適格機関投資家限定>	円	1,322,313,913円
計	13,281,789,429円	14,840,406,534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	14,840,406,534口

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

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」（昭和26年法律第198号）第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

## ・ 金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によつた場合、当該価額が異なることもあります。	同左

## (有価証券に関する注記)

(自 2019年1月26日 至 2020年1月27日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	39,168,410円
地方債証券	330,500円
特殊債券	219,000円
社債券	405,617円
合計	38,213,293円

(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。

(自 2020年1月28日 至 2021年1月25日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
国債証券	37,733,940円
地方債証券	56,100円
特殊債券	617,000円
社債券	531,558円
合計	38,938,598円

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年11月11日から2021年1月25日まで)を指しております。

(1口当たり情報に関する注記)

[2020年 1月27日現在]		[2021年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.3112円 13,112円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2947円 12,947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406回利付国債(2年)	10,000,000	10,017,500	
	第413回利付国債(2年)	65,000,000	65,209,950	
	第414回利付国債(2年)	110,000,000	110,377,300	
	第415回利付国債(2年)	75,000,000	75,267,000	
	第129回利付国債(5年)	30,000,000	30,042,600	
	第130回利付国債(5年)	110,000,000	110,216,700	
	第131回利付国債(5年)	400,000,000	401,052,000	
	第132回利付国債(5年)	120,000,000	120,393,600	
	第133回利付国債(5年)	440,000,000	441,707,200	
	第134回利付国債(5年)	250,000,000	251,117,500	
	第135回利付国債(5年)	350,000,000	351,729,000	
	第136回利付国債(5年)	300,000,000	301,695,000	
	第137回利付国債(5年)	250,000,000	251,560,000	
	第138回利付国債(5年)	270,000,000	271,844,100	
	第139回利付国債(5年)	230,000,000	231,706,600	
	第140回利付国債(5年)	255,000,000	257,045,100	
	第141回利付国債(5年)	250,000,000	252,152,500	
	第142回利付国債(5年)	210,000,000	211,934,100	
	第143回利付国債(5年)	150,000,000	151,468,500	
	第144回利付国債(5年)	270,000,000	272,805,300	
	第145回利付国債(5年)	90,000,000	90,967,500	
	第4回利付国債(40年)	8,000,000	11,354,480	
	第5回利付国債(40年)	63,000,000	86,599,170	
	第6回利付国債(40年)	8,000,000	10,846,400	
	第7回利付国債(40年)	45,000,000	58,766,400	
	第8回利付国債(40年)	36,000,000	43,974,720	
	第9回利付国債(40年)	86,000,000	78,611,740	
	第10回利付国債(40年)	64,000,000	68,582,400	
	第11回利付国債(40年)	73,000,000	75,935,330	
	第12回利付国債(40年)	58,000,000	54,507,240	

第13回利付国債(40年)	46,000,000	43,172,840	
第320回利付国債(10年)	50,000,000	50,503,500	
第324回利付国債(10年)	50,000,000	50,650,500	
第327回利付国債(10年)	205,000,000	208,628,500	
第329回利付国債(10年)	25,000,000	25,559,000	
第330回利付国債(10年)	103,000,000	105,531,740	
第332回利付国債(10年)	30,000,000	30,637,200	
第334回利付国債(10年)	30,000,000	30,747,300	
第335回利付国債(10年)	100,000,000	102,310,000	
第339回利付国債(10年)	90,000,000	92,129,400	
第340回利付国債(10年)	110,000,000	112,726,900	
第341回利付国債(10年)	165,000,000	168,455,100	
第342回利付国債(10年)	220,000,000	222,503,600	
第343回利付国債(10年)	180,000,000	182,151,000	
第344回利付国債(10年)	180,000,000	182,199,600	
第345回利付国債(10年)	235,000,000	237,928,100	
第346回利付国債(10年)	195,000,000	197,470,650	
第347回利付国債(10年)	210,000,000	212,702,700	
第348回利付国債(10年)	210,000,000	212,738,400	
第349回利付国債(10年)	385,000,000	390,074,300	
第350回利付国債(10年)	165,000,000	167,133,450	
第351回利付国債(10年)	80,000,000	81,040,800	
第352回利付国債(10年)	180,000,000	182,282,400	
第353回利付国債(10年)	202,000,000	204,563,380	
第354回利付国債(10年)	215,000,000	217,635,900	
第355回利付国債(10年)	137,000,000	138,615,230	
第356回利付国債(10年)	190,000,000	192,141,300	
第357回利付国債(10年)	186,000,000	187,904,640	
第358回利付国債(10年)	65,000,000	65,624,000	
第359回利付国債(10年)	271,000,000	273,417,320	
第360回利付国債(10年)	185,000,000	186,424,500	
第2回利付国債(30年)	24,000,000	29,249,760	
第3回利付国債(30年)	20,000,000	24,283,600	
第5回利付国債(30年)	10,000,000	12,205,700	
第22回利付国債(30年)	10,000,000	13,312,400	
第26回利付国債(30年)	8,000,000	10,628,000	
第27回利付国債(30年)	8,000,000	10,808,000	
第28回利付国債(30年)	20,000,000	27,130,600	
第29回利付国債(30年)	60,000,000	80,713,800	
第31回利付国債(30年)	72,000,000	94,986,000	
第32回利付国債(30年)	65,000,000	87,350,250	
第33回利付国債(30年)	38,000,000	49,120,700	
第34回利付国債(30年)	60,000,000	80,134,200	
第35回利付国債(30年)	40,000,000	52,058,000	
第36回利付国債(30年)	87,000,000	113,584,590	
第37回利付国債(30年)	90,000,000	116,087,400	

第38回利付国債(30年)	43,000,000	54,689,980
第39回利付国債(30年)	30,000,000	38,811,000
第40回利付国債(30年)	25,000,000	31,838,750
第42回利付国債(30年)	114,000,000	143,120,160
第43回利付国債(30年)	3,000,000	3,769,860
第44回利付国債(30年)	21,000,000	26,413,170
第45回利付国債(30年)	26,000,000	31,584,020
第46回利付国債(30年)	93,000,000	113,035,920
第47回利付国債(30年)	51,000,000	63,198,690
第48回利付国債(30年)	83,000,000	99,066,310
第49回利付国債(30年)	30,000,000	35,819,700
第50回利付国債(30年)	35,000,000	36,892,100
第51回利付国債(30年)	54,000,000	50,485,140
第52回利付国債(30年)	90,000,000	88,293,600
第53回利付国債(30年)	65,000,000	65,219,050
第54回利付国債(30年)	35,000,000	36,747,900
第55回利付国債(30年)	55,000,000	57,703,800
第56回利付国債(30年)	38,000,000	39,837,300
第57回利付国債(30年)	52,000,000	54,471,560
第58回利付国債(30年)	80,000,000	83,734,400
第59回利付国債(30年)	40,000,000	40,844,800
第60回利付国債(30年)	9,000,000	9,628,830
第61回利付国債(30年)	30,000,000	30,534,300
第62回利付国債(30年)	97,000,000	93,648,650
第63回利付国債(30年)	50,000,000	46,891,000
第64回利付国債(30年)	80,000,000	74,897,600
第65回利付国債(30年)	59,000,000	55,143,170
第66回利付国債(30年)	62,000,000	57,917,920
第67回利付国債(30年)	48,000,000	47,349,120
第68回利付国債(30年)	60,000,000	59,107,200
第51回利付国債(20年)	90,000,000	90,761,400
第53回利付国債(20年)	20,000,000	20,400,200
第60回利付国債(20年)	20,000,000	20,582,400
第62回利付国債(20年)	21,000,000	21,469,560
第66回利付国債(20年)	60,000,000	63,360,000
第67回利付国債(20年)	30,000,000	31,923,000
第70回利付国債(20年)	40,000,000	43,453,200
第71回利付国債(20年)	60,000,000	64,770,000
第74回利付国債(20年)	40,000,000	43,495,200
第75回利付国債(20年)	30,000,000	32,781,300
第76回利付国債(20年)	10,000,000	10,843,700
第80回利付国債(20年)	40,000,000	43,934,800
第82回利付国債(20年)	30,000,000	33,121,500
第83回利付国債(20年)	5,000,000	5,546,950
第84回利付国債(20年)	60,000,000	66,267,600
第85回利付国債(20年)	20,000,000	22,292,800

第 8 8 回利付国債(20年)	20,000,000	22,623,000	
第 8 9 回利付国債(20年)	10,000,000	11,257,200	
第 9 0 回利付国債(20年)	65,000,000	73,535,150	
第 9 5 回利付国債(20年)	6,000,000	6,927,120	
第 9 9 回利付国債(20年)	20,000,000	23,032,400	
第 1 0 0 回利付国債(20年)	20,000,000	23,268,400	
第 1 0 5 回利付国債(20年)	20,000,000	23,319,600	
第 1 1 2 回利付国債(20年)	7,000,000	8,262,100	
第 1 1 3 回利付国債(20年)	20,000,000	23,694,000	
第 1 1 6 回利付国債(20年)	50,000,000	60,087,000	
第 1 1 7 回利付国債(20年)	92,000,000	109,718,280	
第 1 2 3 回利付国債(20年)	113,000,000	136,018,100	
第 1 2 4 回利付国債(20年)	40,000,000	47,753,200	
第 1 2 6 回利付国債(20年)	31,000,000	37,120,330	
第 1 2 7 回利付国債(20年)	50,000,000	59,366,500	
第 1 3 0 回利付国債(20年)	55,000,000	65,091,950	
第 1 3 2 回利付国債(20年)	64,000,000	75,242,240	
第 1 3 3 回利付国債(20年)	90,000,000	106,782,300	
第 1 3 5 回利付国債(20年)	90,000,000	106,047,000	
第 1 3 6 回利付国債(20年)	77,000,000	89,879,020	
第 1 3 7 回利付国債(20年)	12,000,000	14,171,520	
第 1 3 8 回利付国債(20年)	25,000,000	28,960,250	
第 1 3 9 回利付国債(20年)	50,000,000	58,484,500	
第 1 4 0 回利付国債(20年)	72,000,000	85,216,320	
第 1 4 1 回利付国債(20年)	50,000,000	59,302,000	
第 1 4 2 回利付国債(20年)	10,000,000	11,977,800	
第 1 4 3 回利付国債(20年)	60,000,000	70,587,600	
第 1 4 4 回利付国債(20年)	75,000,000	87,336,750	
第 1 4 5 回利付国債(20年)	105,000,000	125,036,100	
第 1 4 6 回利付国債(20年)	90,000,000	107,383,500	
第 1 4 7 回利付国債(20年)	82,000,000	96,983,860	
第 1 4 8 回利付国債(20年)	95,000,000	111,317,200	
第 1 5 0 回利付国債(20年)	123,000,000	142,895,250	
第 1 5 1 回利付国債(20年)	100,000,000	113,522,000	
第 1 5 2 回利付国債(20年)	91,000,000	103,375,090	
第 1 5 3 回利付国債(20年)	112,000,000	128,879,520	
第 1 5 4 回利付国債(20年)	92,000,000	104,646,320	
第 1 5 5 回利付国債(20年)	115,000,000	127,479,800	
第 1 5 6 回利付国債(20年)	99,000,000	100,945,350	
第 1 5 7 回利付国債(20年)	100,000,000	98,819,000	
第 1 5 8 回利付国債(20年)	119,000,000	122,831,800	
第 1 5 9 回利付国債(20年)	92,000,000	96,260,520	
第 1 6 0 回利付国債(20年)	90,000,000	95,470,200	
第 1 6 1 回利付国債(20年)	93,000,000	97,131,990	
第 1 6 2 回利付国債(20年)	105,000,000	109,560,150	
第 1 6 3 回利付国債(20年)	48,000,000	50,034,240	



	第164回利付国債(20年)	80,000,000	81,940,800	
	第165回利付国債(20年)	90,000,000	92,062,800	
	第166回利付国債(20年)	80,000,000	84,443,200	
	第167回利付国債(20年)	48,000,000	48,965,280	
	第168回利付国債(20年)	68,000,000	68,057,120	
	第169回利付国債(20年)	104,000,000	102,042,720	
	第170回利付国債(20年)	65,000,000	63,650,600	
	第171回利付国債(20年)	43,000,000	42,059,590	
	第172回利付国債(20年)	79,000,000	78,580,510	
	第173回利付国債(20年)	81,000,000	80,492,130	
	第174回利付国債(20年)	85,000,000	84,308,100	
国債証券	合計	15,985,000,000	16,876,678,160	
地方債証券	第781回東京都公募公債	100,000,000	100,588,000	
	平成30年度第11回北海道公募公債(5年)	100,000,000	100,012,000	
	第26回神奈川県公募公債(20年)	20,000,000	23,136,000	
	第6回大阪府公募公債(20年)	50,000,000	58,854,000	
	平成28年度第2回京都府公募公債(15年)	50,000,000	50,251,500	
	平成31年度第1回愛知県公募公債(10年)	100,000,000	99,959,000	
	平成29年度第7回広島県公募公債	100,000,000	100,853,000	
	平成25年度第8回埼玉県公募公債	100,000,000	102,020,000	
	平成27年度第3回福岡県公募公債	200,000,000	204,798,000	
	平成29年度第1回広島市公募公債(5年)	100,000,000	99,999,000	
地方債証券	合計	920,000,000	940,470,500	
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	100,167,000	
	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	100,805,000	
	第42回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	101,487,000	
	第58回政府保証地方公共団体金融機構債券	100,000,000	102,005,000	
特殊債券	合計	400,000,000	404,464,000	

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	99,982,000	
	第33回道路債券	100,000,000	133,871,000	
	第101回都市再生債券	100,000,000	106,965,000	
	第54回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	36,201,000	38,298,485	
	第55回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	40,324,000	42,666,421	
	第56回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	38,136,000	40,284,582	
	第59回貸付債権担保住宅金融支援機構債券	39,485,000	41,791,318	
	第15回貸付債権担保住宅金融公庫債券	31,449,000	31,696,818	
	第16回成田国際空港株式会社社債	100,000,000	101,930,000	
	第83回東日本旅客鉄道株式会社無担保普通社債	100,000,000	108,778,000	
	第503回中部電力株式会社社債	100,000,000	101,963,000	
	第7回株式会社ファーストリテイリング無担保社債	100,000,000	100,729,000	
	社債券 合計	885,595,000	948,955,624	
合計	18,190,595,000	19,170,568,284		

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・東証REITマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
		金額(円)	金額(円)
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		811,040,568	408,041,441
投資証券		12,415,427,100	7,328,236,970
派生商品評価勘定		5,770,390	16,368,800
未収配当金		76,179,120	41,399,017
差入委託証拠金		6,399,000	37,222,000
流動資産合計		13,314,816,178	7,831,268,228
資産合計		13,314,816,178	7,831,268,228
<b>負債の部</b>			
流動負債			
前受金		6,986,600	17,108,800
未払金		376,698,671	138,045,237
未払解約金		173,442,182	84,635,266
未払利息		469	224
流動負債合計		557,127,922	239,789,527
負債合計		557,127,922	239,789,527
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1	8,748,643,306	6,077,766,991
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		4,009,044,950	1,513,711,710
元本等合計		12,757,688,256	7,591,478,701
純資産合計		12,757,688,256	7,591,478,701
負債純資産合計		13,314,816,178	7,831,268,228

## (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 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	4,576,756,752円	8,748,643,306円
同期中における追加設定元本額	10,849,997,835円	4,772,677,450円
同期中における一部解約元本額	6,678,111,281円	7,443,553,765円
同期末における元本額	8,748,643,306円	6,077,766,991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 >	170,701,351円	127,401,365円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	586,589,141円	441,949,927円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	474,906,431円	362,105,440円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	658,988,449円	481,609,695円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	4,606,379円	7,891,695円
東京海上・円資産バランスファンド（3倍型）（毎月決算型）	229,756,179円	294,757,284円
東京海上・円資産バランスファンド（3倍型）（年1回決算型）	246,399,701円	408,652,278円
東京海上・東証REITインデックスファンド < 適格機関投資家限定 >	6,376,695,675円	3,736,339,833円
円資産バランスオープン < 適格機関投資家限定 >	円	217,059,474円
計	8,748,643,306円	6,077,766,991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	8,748,643,306口	6,077,766,991口

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

## (金融商品に関する注記)

## . 金融商品の状況に関する事項

区 分	自 2019年 1月26日 至 2020年 1月27日	自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日

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

## ・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 1月27日現在]	[2021年 1月25日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。  (2)デリバティブ取引 (デリバティブ取引等に関する注記)に記載しております。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。	同左

## (有価証券に関する注記)

(自 2019年1月26日 至 2020年1月27日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	1,389,048,747円
合計	1,389,048,747円

(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1月26日から2020年1月27日まで)を指しております。

(自 2020年1月28日 至 2021年1月25日)

## 売買目的有価証券

種 類	当期間の損益に含まれた評価差額
投資証券	386,197,061円

合計	386,197,061円
----	--------------

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

(注2)「当期間」とは当親投資信託の計算期間の開始日から本書における開示対象ファンドの期末までの期間(2020年1月28日から2021年1月25日まで)を指しております。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(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	345,525,400		351,297,000	5,771,600
	東証REIT指数先物	345,525,400		351,297,000	5,771,600
合 計		345,525,400		351,297,000	5,771,600

(2021年1月25日現在)

(単位：円)

区 分	種 類	契約額等		時 価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	247,219,200		263,588,000	16,368,800
	東証REIT指数先物	247,219,200		263,588,000	16,368,800
合 計		247,219,200		263,588,000	16,368,800

(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]		[2021年 1月25日現在]	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.4582円 14,582円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.2491円 12,491円)

## (3) 附属明細表

## 第1 有価証券明細表

## (1) 株式

該当事項はありません。

## (2) 株式以外の有価証券

(単位:円)

種 類	銘 柄	券面総額	評価額	備 考
投資証券	エスコンジャパンリート投資法人	124	15,338,800	
	サンケイリアルエステート投資法人	186	18,879,000	
	S O S i L A 物流リート投資法人	200	25,280,000	
	日本アコモデーションファンド投資法人	262	145,672,000	
	M C U B S M i d C i t y 投資法人	930	87,792,000	
	森ヒルズリート投資法人	893	130,913,800	
	産業ファンド投資法人	1,075	207,475,000	
	アドバンス・レジデンス投資法人	722	220,210,000	
	ケネディクス・レジデンシャル・ネクスト投資法人	496	90,321,600	
	アクティブ・プロパティーズ投資法人	381	158,877,000	
	G L P 投資法人	2,375	404,937,500	
	コンフォリア・レジデンシャル投資法人	332	97,674,400	
	日本プロロジスリート投資法人	1,150	383,525,000	
	星野リゾート・リート投資法人	116	59,856,000	
	O n e リート投資法人	118	30,750,800	
	イオンリート投資法人	771	105,704,100	
	ヒューリックリート投資法人	612	93,819,600	
	日本リート投資法人	247	87,685,000	
	インベスコ・オフィス・ジェイリート投資法人	4,884	69,743,520	
	積水ハウス・リート投資法人	2,236	165,240,400	
	トーセイ・リート投資法人	168	19,303,200	
	ケネディクス商業リート投資法人	280	69,888,000	
	ヘルスケア & メディカル投資法人	162	21,821,400	
	サムティ・レジデンシャル投資法人	146	16,133,000	
	野村不動産マスターファンド投資法人	2,458	376,074,000	
	いちごホテルリート投資法人	133	9,097,200	
	ラサールロジポート投資法人	847	139,077,400	
	スターアジア不動産投資法人	781	38,347,100	
	マリモ地方創生リート投資法人	71	8,008,800	
	三井不動産ロジスティクスパーク投資法人	265	140,450,000	
大江戸温泉リート投資法人	123	8,437,800		
投資法人みらい	821	32,798,950		
森トラスト・ホテルリート投資法人	165	18,958,500		



三菱地所物流リート投資法人	171	71,136,000	
CREロジスティクスファンド投資法人	243	36,814,500	
ザイマックス・リート投資法人	116	11,692,800	
タカラレーベン不動産投資法人	228	21,796,800	
伊藤忠アドバンス・ロジスティクス投資法人	295	38,409,000	
日本ビルファンド投資法人	856	507,608,000	
ジャパンリアルエステイト投資法人	760	459,040,000	
日本リテールファンド投資法人	1,428	268,606,800	
オリックス不動産投資法人	1,515	255,883,500	
日本プライムリアルティ投資法人	473	169,807,000	
プレミア投資法人	687	87,455,100	
東急リアル・エステート投資法人	510	84,048,000	
グローバル・ワン不動産投資法人	528	54,542,400	
ユナイテッド・アーバン投資法人	1,626	217,558,800	
森トラスト総合リート投資法人	543	72,381,900	
インヴィンシブル投資法人	3,179	110,629,200	
フロンティア不動産投資法人	252	104,202,000	
平和不動産リート投資法人	466	60,766,400	
日本ロジスティクスファンド投資法人	497	155,064,000	
福岡リート投資法人	393	61,150,800	
ケネディクス・オフィス投資法人	235	153,455,000	
いちごオフィスリート投資法人	631	49,154,900	
大和証券オフィス投資法人	162	105,624,000	
阪急阪神リート投資法人	343	43,629,600	
スターツプロシード投資法人	118	23,033,600	
大和ハウスリート投資法人	1,085	292,733,000	
ジャパン・ホテル・リート投資法人	2,449	129,307,200	
大和証券リビング投資法人	993	96,420,300	
ジャパンエクセレント投資法人	705	88,195,500	
投資証券 合計	46,017	7,328,236,970	
合計	46,017	7,328,236,970	

## 第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

## 第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

- (1) 当ファンドの中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条の3及び第57条の2の規定により、「投資信託財産の計算に関する規則」(平成12年総理府令第133号)に基づいて作成しております。  
なお、中間財務諸表に記載している金額は、円単位で表示しております。
- (2) 当ファンドは、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づいて、当中間計算期間(2021年1月26日から2021年7月25日まで)の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

## 中間財務諸表

## 【東京海上・円資産インデックスバランスファンド】

## (1)【中間貸借対照表】

(単位：円)

	前期 2021年 1月25日現在	当中間計算期間末 2021年 7月25日現在
<b>資産の部</b>		
流動資産		
金銭信託	-	28,594
コール・ローン	3,328,132	7,317,325
親投資信託受益証券	73,095,321	105,397,212
未収入金	1,002,498	272,614
流動資産合計	77,425,951	113,015,745
資産合計	77,425,951	113,015,745
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払解約金	902,333	109,882
未払受託者報酬	7,052	10,198
未払委託者報酬	126,763	183,484
未払利息	1	38
その他未払費用	3,439	5,003
流動負債合計	1,039,588	308,605
負債合計	1,039,588	308,605
<b>純資産の部</b>		
元本等		
元本	1 75,039,093	1 107,428,387
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金( )	1,347,270	5,278,753
( 分配準備積立金 )	853,301	668,718
元本等合計	76,386,363	112,707,140
純資産合計	76,386,363	112,707,140
負債純資産合計	77,425,951	113,015,745

## (2)【中間損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	前中間計算期間 自 2020年 1月28日 至 2020年 7月27日	当中間計算期間 自 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日
<b>営業収益</b>		
受取利息	46	-
有価証券売買等損益	3,486,406	2,814,423
営業収益合計	3,486,360	2,814,423
<b>営業費用</b>		
支払利息	2,041	644
受託者報酬	5,202	10,198
委託者報酬	93,577	183,484
その他費用	2,510	5,003
営業費用合計	103,330	199,329
営業利益又は営業損失( )	3,589,690	2,615,094
経常利益又は経常損失( )	3,589,690	2,615,094
中間純利益又は中間純損失( )	3,589,690	2,615,094
一部解約に伴う中間純利益金額の分配額又は一部解約に伴う中間純損失金額の分配額( )	693,753	323,184
期首剰余金又は期首欠損金( )	3,376,816	1,347,270
剰余金増加額又は欠損金減少額	327,024	2,099,384
中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	327,024	2,099,384
剰余金減少額又は欠損金増加額	892,667	459,811
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	892,667	459,811
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金( )	84,764	5,278,753

## (3) 【中間注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

区 分	当中間計算期間 自 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準 価額に基づいて評価しております。

(中間貸借対照表に関する注記)

区 分	前期 2021年 1月25日現在	当中間計算期間末 2021年 7月25日現在
1. 1 期首元本額	40,738,604円	75,039,093円
期中追加設定元本額	60,312,399円	53,529,513円
期中一部解約元本額	26,011,910円	21,140,219円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	75,039,093口	107,428,387口

(中間損益及び剰余金計算書に関する注記)

前中間計算期間 自 2020年 1月28日 至 2020年 7月27日	当中間計算期間 自 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日
該当事項はありません。	同 左

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区 分	前期 2021年 1月25日現在	当中間計算期間末 2021年 7月25日現在
1. 中間貸借対照表計上額、時価 及びこれらの差額	時価で計上しているため、その 差額ははありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証 券及びデリバティブ取引に関 する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項 に関する注記）に記載してお ります。  (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。  (3)有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品について は、短期間で決済され、時価 は帳簿価額と近似しているた め、当該帳簿価額を時価とし ております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取 引以外の金融商品 同左

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

## (1口当たり情報に関する注記)

前期 2021年 1月25日現在		当中間計算期間末 2021年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額	1.0180円 10,180円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額	1.0491円 10,491円)

(ご参考)

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

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

## 「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		2,696,408,532	2,125,711,649
株式	2	34,094,932,310	37,305,759,860
派生商品評価勘定		9,595,500	
未収配当金		39,290,559	47,202,899
前払金			64,620,000
流動資産合計		36,840,226,901	39,543,294,408
資産合計		36,840,226,901	39,543,294,408
<b>負債の部</b>			
流動負債			
派生商品評価勘定			46,677,900
前受金		6,130,000	
未払解約金		43,800,858	64,981,503
未払利息		1,482	2,269
流動負債合計		49,932,340	111,661,672
負債合計		49,932,340	111,661,672
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1	23,205,064,108	24,020,777,443
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		13,585,230,453	15,410,855,293
元本等合計		36,790,294,561	39,431,632,736
純資産合計		36,790,294,561	39,431,632,736
負債純資産合計		36,840,226,901	39,543,294,408

## (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 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	株式 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	21,904,463,467円	23,205,064,108円
同期中における追加設定元本額	14,089,938,434円	6,608,861,746円
同期中における一部解約元本額	12,789,337,793円	5,793,148,411円
同中間期末における元本額	23,205,064,108円	24,020,777,443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>	102,659,801円	108,527,667円
円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>	356,122,493円	376,463,302円
円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>	291,783,942円	272,587,929円
円資産バランスファンド2019-12<適格機関投資家限定>	388,080,266円	374,546,881円
東京海上セレクション・日本株TOPIX LPS4資産分散ファンド(慎重型)	15,376,675,823円	15,492,284,450円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	6,870,642円	円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	11,122,210円	円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	36,135,437円	円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	48,835,209円	円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	50,765,644円	円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	6,363,953円	7,910,353円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045	30,374,294円	79,717,099円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055	10,606,283円	39,600,188円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	9,625,843円	24,695,552円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065	17,770,539円	59,826,088円



TMA日本株式インデックスVA<適格機関投資家限定>	486,249,709円	546,706,589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>	129,226,810円	162,481,219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>	864,717,062円	1,077,721,604円
東京海上・TOPIXインデックスファンド<適格機関投資家限定>	4,806,171,995円	5,154,055,403円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	174,906,153円	238,766,279円
円資産インデックスバランス<円奏会ベーシック>（適格機関投資家専用）	円	4,886,840円
計	23,205,064,108円	24,020,777,443円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	23,205,064,108口	24,020,777,443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 681,390,000円	代用有価証券として、担保に供している資産は次のとおりであります。  株式 852,050,000円

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

(注2) 3.については、決算日現在の代用有価証券の時価額を記載

(金融商品に関する注記)

金融商品の時価等に関する事項

区分	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。  (2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左  (2)デリバティブ取引 同左  (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左

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

(デリバティブ取引等に関する注記)  
取引の時価等に関する事項  
株式関連  
(2021年1月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,684,345,000		2,694,100,000	9,755,000
	東証株価指数先物	2,684,345,000		2,694,100,000	9,755,000
合計		2,684,345,000		2,694,100,000	9,755,000

(2021年7月25日現在)

(単位：円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	2,125,810,000		2,079,175,000	46,635,000
	東証株価指数先物	2,125,810,000		2,079,175,000	46,635,000
合計		2,125,810,000		2,079,175,000	46,635,000

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

2021年 1月25日現在		2021年 7月25日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.5854円 15,854円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	1.6416円 16,416円)

## 「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

区 分	注記 番号	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		98,460,233	25,260,295
国債証券		16,876,678,160	18,018,295,100
地方債証券		940,470,500	1,053,371,900
特殊債券		404,464,000	303,629,000
社債券		948,955,624	1,044,339,049
未収入金		2,037,820	
未収利息		27,074,201	27,503,062
前払費用		1,443,290	1,312,584
流動資産合計		19,299,583,828	20,473,710,990
資産合計		19,299,583,828	20,473,710,990
負債の部			
流動負債			
未払金		64,371,630	
未払解約金		20,828,837	9,012,799
未払利息		54	26
流動負債合計		85,200,521	9,012,825
負債合計		85,200,521	9,012,825
純資産の部			
元本等			
元本	1	14,840,406,534	15,729,063,899
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		4,373,976,773	4,735,634,266
元本等合計		19,214,383,307	20,464,698,165
純資産合計		19,214,383,307	20,464,698,165
負債純資産合計		19,299,583,828	20,473,710,990

## (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 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日
有価証券の評価基準及び評価方法	国債証券、地方債証券、特殊債券及び社債券 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提 示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、価格情 報会社の提供する価額又は日本証券業協会発表の売買参 考統計値（平均値）等で評価しております。

## (貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首にお ける当該親投資信託の元本額	13,281,789,429円	14,840,406,534円
同期中における追加設定元本額	3,906,123,892円	2,100,533,942円
同期中における一部解約元本額	2,347,506,787円	1,211,876,577円
同中間期末における元本額	14,840,406,534円	15,729,063,899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 >	776,121,843円	799,750,354円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機 関投資家限定 >	2,692,333,657円	2,774,192,912円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機 関投資家限定 >	2,205,925,610円	2,008,720,491円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機 関投資家限定 >	2,933,938,740円	2,760,072,023円
L P S 4 資産分散ファンド ( 慎重型 )	51,823,711円	円
L P S 4 資産分散ファンド ( 安定重視型 )	39,550,574円	円
L P S 4 資産分散ファンド ( バランス型 )	65,100,188円	円
L P S 4 資産分散ファンド ( 成長重視型 )	47,355,744円	円
L P S 4 資産分散ファンド ( 積極型 )	27,881,702円	円
東京海上セレクション・日本債券インデッ クス	2,967,931,914円	3,195,234,586円
東京海上・年金運用型戦略ファンド ( 年 1 回決算型 )	162,175,743円	198,328,344円
東京海上・円資産インデックスバラン スファンド	41,050,741円	60,868,767円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	32,515,238円	93,091,274円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	10,213,294円	41,598,721円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	7,381,685円	23,220,778円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	12,035,007円	44,199,240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 >	147,197,126円	118,819,668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 >	298,498,751円	420,562,887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 >	999,061,353円	1,394,811,563円

円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	1,322,313,913円	1,759,581,612円
円資産インデックスバランス＜円奏会ベーシック＞（適格機関投資家専用）	円	36,010,679円
計	14,840,406,534円	15,729,063,899円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	14,840,406,534口	15,729,063,899口

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

（金融商品に関する注記）

金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（1口当たり情報に関する注記）

2021年 1月25日現在		2021年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2947円	1口当たり純資産額	1.3011円
（1万口当たり純資産額	12,947円）	（1万口当たり純資産額	13,011円）

## 「東京海上・東証REITマザーファンド」の状況

## (1) 貸借対照表

区 分	注記 番号	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
		金額(円)	金額(円)
<b>資産の部</b>			
流動資産			
コール・ローン		408,041,441	244,073,566
投資証券		7,328,236,970	10,384,858,100
派生商品評価勘定		16,368,800	
未収入金			9,699,900
未収配当金		41,399,017	58,791,789
前払金			651,200
差入委託証拠金		37,222,000	16,872,000
流動資産合計		7,831,268,228	10,714,946,555
資産合計		7,831,268,228	10,714,946,555
<b>負債の部</b>			
流動負債			
派生商品評価勘定			577,200
前受金		17,108,800	
未払金		138,045,237	
未払解約金		84,635,266	538,626
未払利息		224	260
流動負債合計		239,789,527	1,116,086
負債合計		239,789,527	1,116,086
<b>純資産の部</b>			
元本等			
元本	1	6,077,766,991	7,062,048,753
剰余金			
剰余金又は欠損金( )		1,513,711,710	3,651,781,716
元本等合計		7,591,478,701	10,713,830,469
純資産合計		7,591,478,701	10,713,830,469
負債純資産合計		7,831,268,228	10,714,946,555

## (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 2021年 1月26日 至 2021年 7月25日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場(最終相場のないものについては、それに準ずる価額)、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。
2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法	先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	8,748,643,306円	6,077,766,991円
同期中における追加設定元本額	4,772,677,450円	2,470,178,962円
同期中における一部解約元本額	7,443,553,765円	1,485,897,200円
同中間期末における元本額	6,077,766,991円	7,062,048,753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 >	127,401,365円	119,512,048円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	441,949,927円	414,566,181円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	362,105,440円	300,177,297円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	481,609,695円	412,455,793円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	7,891,695円	8,710,847円
東京海上・円資産バランスファンド(3倍型)(毎月決算型)	294,757,284円	230,126,355円
東京海上・円資産バランスファンド(3倍型)(年1回決算型)	408,652,278円	269,101,362円
東京海上・東証REITインデックスファンド<適格機関投資家限定>	3,736,339,833円	5,039,085,367円
円資産バランスオープン<適格機関投資家限定>	217,059,474円	262,932,466円
円資産インデックスバランス<円奏会ベシック>(適格機関投資家専用)	円	5,381,037円
計	6,077,766,991円	7,062,048,753円
2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数	6,077,766,991口	7,062,048,753口

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



(金融商品に関する注記)  
金融商品の時価等に関する事項

区 分	2021年 1月25日現在	2021年 7月25日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	同左

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

株式関連

(2021年1月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	247,219,200		263,588,000	16,368,800
	東証REIT指数 先物	247,219,200		263,588,000	16,368,800
合計		247,219,200		263,588,000	16,368,800

(2021年7月25日現在)

(単位:円)

区分	種類	契約額等		時価	評価損益
			うち 1年超		
市場取引	株価指数先物取引				
	買建	315,299,200		314,722,000	577,200
	東証REIT指数 先物	315,299,200		314,722,000	577,200
合計		315,299,200		314,722,000	577,200

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

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

(1口当たり情報に関する注記)

2021年 1月25日現在		2021年 7月25日現在	
1口当たり純資産額	1.2491円	1口当たり純資産額	1.5171円
(1万口当たり純資産額	12,491円)	(1万口当たり純資産額	15,171円)

## 2【ファンドの現況】

### 【純資産額計算書】

2021年7月30日 現在

種類	金額
資産総額	113,786,641 円
負債総額	656,072 円
純資産総額( - )	113,130,569 円
発行済数量	107,689,976 口
1単位当たり純資産額( / )	1.0505 円

(ご参考: 親投資信託の現況)

TMA日本株TOPIXマザーファンド

2021年7月30日 現在

種類	金額
資産総額	39,710,217,036 円
負債総額	216,290,378 円
純資産総額( - )	39,493,926,658 円
発行済数量	24,097,069,433 口
1単位当たり純資産額( / )	1.6390 円

TMA日本債券インデックスマザーファンド

2021年7月30日 現在

種類	金額
資産総額	20,685,632,103 円
負債総額	195,470,551 円
純資産総額( - )	20,490,161,552 円
発行済数量	15,739,841,169 口
1単位当たり純資産額( / )	1.3018 円

東京海上・東証REITマザーファンド

2021年7月30日 現在

種類	金額
資産総額	10,922,137,947 円
負債総額	109,383,539 円
純資産総額( - )	10,812,754,408 円
発行済数量	7,056,285,930 口
1単位当たり純資産額( / )	1.5324 円

## 第4【内国投資信託受益証券事務の概要】

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

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

1. 名義書換  
該当事項はありません。
2. 受益者に対する特典  
特典はありません。
3. 内国投資信託受益証券の譲渡制限の内容  
譲渡制限はありません。
4. 受益権の譲渡  
受益者は、その保有する受益権を譲渡する場合には、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等に振替の申請をするものとします。  
上記の申請のある場合には、上記の振替機関等は、当該譲渡にかかる譲渡人の保有する受益権の口数の減少および譲受人の保有する受益権の口数の増加につき、その備える振替口座簿に記載または記録するものとします。ただし、上記の振替機関等が振替先口座を開設したものでない場合には、譲受人の振替先口座を開設した他の振替機関等(当該他の振替機関等の上位機関を含みます。)に社振法の規定にしたがい、譲受人の振替先口座に受益権の口数の増加の記載または記録が行われるよう通知するものとします。  
上記の振替について、委託会社は、当該受益者の譲渡の対象とする受益権が記載または記録されている振替口座簿にかかる振替機関等と譲受人の振替先口座を開設した振替機関等が異なる場合等において、委託会社が必要と認めるときまたはやむを得ない事情があると判断したときは、振替停止日や振替停止期間を設けることができます。
5. 受益権の譲渡の対抗要件  
受益権の譲渡は、振替口座簿への記載または記録によらなければ、委託会社および受託会社に対抗することができません。
6. 受益権の再分割  
委託会社は、受託会社と協議のうえ、一定日現在の受益権を均等に再分割できるものとします。
7. 償還金  
償還金は、償還日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者(償還日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該償還日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として)にお支払いします。
8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて  
振替機関等の振替口座簿の質権口に記載または記録されている受益権にかかる収益分配金の支払い、一部解約の実行の請求の受付、一部解約金および償還金の支払い等については、約款の規定によるほか、民法その他の法令等にしたがって取り扱われます。

## 第三部【委託会社等の情報】

### 第1【委託会社等の概況】

#### 1【委託会社等の概況】

2021年7月末日現在、資本金の額は20億円です。なお、会社の発行可能株式総数は160,000株であり、38,300株を発行済みです。

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運用リスク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、運用リスク管理部門担当役員を委員長としリスク管理部を事務局とする運用管理委員会に結果報告します。

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

#### 2【事業の内容及び営業の概況】

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

2021年7月末日現在、委託会社が運用を行っている証券投資信託（親投資信託を除きます。）は次の通りです。

	本数	純資産総額（百万円）
追加型公社債投資信託	0	0
追加型株式投資信託	170	2,933,129
単位型公社債投資信託	2	5,258
単位型株式投資信託	11	39,828
合計	183	2,978,217

### 3【委託会社等の経理状況】

1. 当社の財務諸表は「財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和38年大蔵省令第59号)並びに同規則第2条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第36期事業年度(2020年4月1日から2021年3月31日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

## (1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
<b>資産の部</b>		
流動資産		
現金・預金	19,928,671	22,550,090
前払費用	207,883	235,902
未収委託者報酬	2,864,007	2,973,733
未収収益	2,126,212	2,375,688
未収入金	101,676	3,865
その他の流動資産	22,090	21,479
流動資産計	25,250,541	28,160,759
固定資産		
有形固定資産	* 1 576,200	* 1 530,601
建物	388,342	354,556
器具備品	187,858	176,045
無形固定資産	5,385	137,430
電話加入権	3,795	3,795
ソフトウェア	-	89,839
ソフトウェア仮勘定	1,590	43,795
投資その他の資産	2,987,389	3,057,965
投資有価証券	65,610	49,477
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	71,200
長期前払費用	32,906	45,424
敷金	450,632	474,324
その他長期差入保証金	10,030	10,030
繰延税金資産	723,961	734,459
固定資産計	3,568,975	3,725,997
資産合計	28,819,517	31,886,757
<b>負債の部</b>		
流動負債		
未払金	2,555,940	2,979,963
未払手数料	1,315,027	1,349,326
その他未払金	1,240,912	1,630,636
未払費用	544,639	429,654
未払消費税等	367,506	468,610
未払法人税等	1,347,000	1,378,000
預り金	43,576	45,524
前受収益	3,128	2,329
賞与引当金	244,679	273,836
その他の流動負債	-	946
流動負債計	5,106,470	5,578,864
固定負債		
退職給付引当金	750,413	802,176
固定負債計	750,413	802,176
負債合計	5,856,883	6,381,041
<b>純資産の部</b>		
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	20,565,811	23,099,322
利益準備金	500,000	500,000
その他利益剰余金	20,065,811	22,599,322
特別償却準備金	0	0
繰越利益剰余金	20,065,811	22,599,322

評価・換算差額等	3,177	6,393
その他有価証券評価差額金	3,177	6,393
純資産合計	22,962,634	25,505,715
負債・純資産合計	28,819,517	31,886,757

## (2)【損益計算書】

(単位：千円)

	第35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)
営業収益		
委託者報酬	16,536,369	17,997,091
運用受託報酬	9,077,029	9,745,973
投資助言報酬	60,786	59,827
その他営業収益	412,354	453,173
営業収益計	26,086,540	28,256,066
営業費用		
支払手数料	7,818,291	8,444,858
広告宣伝費	254,153	233,667
調査費	5,425,141	6,150,198
調査費	2,525,312	2,540,308
委託調査費	2,899,828	3,609,889
委託計算費	122,584	118,443
営業雑経費	285,550	278,728
通信費	35,052	44,106
印刷費	205,117	189,670
協会費	24,696	26,080
諸会費	12,157	10,102
図書費	8,525	8,768
営業費用計	13,905,720	15,225,895
一般管理費		
給料	3,509,999	3,799,821
役員報酬	112,566	129,108
給料・手当	2,541,727	2,761,131
賞与	855,706	909,581
交際費	17,797	4,415
寄付金	5,833	3,449
旅費交通費	174,094	13,735
租税公課	164,117	170,294
不動産賃借料	375,694	375,691
退職給付費用	466,387	156,614
賞与引当金繰入	244,679	273,836
固定資産減価償却費	118,517	139,782
法定福利費	580,893	596,481
福利厚生費	9,971	10,114
諸経費	482,967	394,336
一般管理費計	6,150,953	5,938,574
営業利益	6,029,866	7,091,595
営業外収益		
受取利息	434	455
受取配当金	* 1 4,704	* 1 7,512
匿名組合投資利益	* 1 39,334	* 1 60,878
雑益	10,094	9,958
営業外収益計	54,568	78,804
営業外費用		
為替差損	15,577	44,450
雑損	5,174	5,811
営業外費用計	20,752	50,261



経常利益	6,063,682	7,120,138
特別損失		
器具備品除却損	545	0
特別損失計	545	0
税引前当期純利益	6,063,137	7,120,138
法人税、住民税及び事業税	2,044,481	2,197,641
法人税等調整額	188,875	14,721
法人税等合計	1,855,605	2,182,919
当期純利益	4,207,531	4,937,219

**(3)【株主資本等変動計算書】**

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

(単位:千円)

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

	株主資本		評価・換算差額等		純資産合計
	利益剰余金	株主資本 合計	その他 有価証券 評価差額金	評価・換算 差額等 合計	
	利益剰余金 合計				
当期首残高	18,375,924	20,775,924	2,096	2,096	20,778,021
当期変動額					
剰余金の配当	2,017,644	2,017,644			2,017,644
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,207,531	4,207,531			4,207,531
株主資本以外の項目の 当期変動額(純額)			5,273	5,273	5,273
当期変動額合計	2,189,887	2,189,887	5,273	5,273	2,184,613
当期末残高	20,565,811	22,965,811	3,177	3,177	22,962,634

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	0	20,065,811
当期変動額						
剰余金の配当						2,403,708
特別償却準備金の取崩					0	0
当期純利益						4,937,219
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）						
当期変動額合計	-	-	-	-	0	2,533,511
当期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	22,599,322

	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	20,565,811	22,965,811	3,177	3,177	22,962,634
当期変動額					
剰余金の配当	2,403,708	2,403,708			2,403,708
特別償却準備金の取崩	-	-			-
当期純利益	4,937,219	4,937,219			4,937,219
株主資本以外の項目の 当期変動額（純額）			9,570	9,570	9,570
当期変動額合計	2,533,511	2,533,511	9,570	9,570	2,543,081
当期末残高	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715

## 注記事項

（重要な会計方針）

## 第36期

自 2020年4月1日

至 2021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

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) 無形固定資産

定額法を採用しております。なお、自社利用のソフトウェアについては、社内における利用可能期間(5年)に基づく定額法によっております。

3. 引当金の計上基準

(1) 賞与引当金

従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当期負担額を計上しております。

(2) 退職給付引当金

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

退職給付見込額の期間帰属方法

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

数理計算上の差異及び過去勤務費用の費用処理方法

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

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

4. 消費税等の会計処理方法

消費税及び地方消費税の会計処理は、税抜方式によっております。

(重要な会計上の見積り)

第36期 自 2020年4月1日 至 2021年3月31日
当事業年度の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが翌事業年度の財務諸表に重要な影響を及ぼすリスクを識別していないため、注記を省略しております。

(未適用の会計基準等)

第36期 自 2020年4月1日 至 2021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。

## (貸借対照表関係)

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021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 114,303千円	建物 148,089千円
器具備品 364,003千円	器具備品 458,314千円

## (損益計算書関係)

第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日	第36期 自 2020年4月1日 至 2021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 2,400千円	関係会社からの受取配当金 2,000千円
関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 39,334千円	関係会社からの匿名組合契約に基づく利益の分配 60,878千円

## (株主資本等変動計算書関係)

第35期(自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)

## 1. 発行済株式に関する事項

(単位：株)

株式の種類	2019年4月1日 現在	増加	減少	2020年3月31日 現在
普通株式	38,300	-	-	38,300

## 2. 配当に関する事項

## (1) 配当金支払額

2019年6月28日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

## ・普通株式の配当に関する事項

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

- (2) 基準日が当事業年度に属する配当のうち、配当の効力発生日が翌事業年度となるもの  
2020年6月26日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

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

第36期(自 2020年4月1日 至 2021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	2020年4月1日 現在	増加	減少	2021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

2020年6月26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	2,403,708千円
(ロ) 1株当たり配当額	62,760円
(ハ) 基準日	2020年3月31日
(ニ) 効力発生日	2020年6月26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  
2021年6月30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	4,937,214千円
(ロ) 配当の原資	繰越利益剰余金
(ハ) 1株当たり配当額	128,909円
(ニ) 基準日	2021年3月31日
(ホ) 効力発生日	2021年6月30日

(金融商品関係)

1. 金融商品の状況に関する事項

第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日	第36期 自 2020年4月1日 至 2021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>(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>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。</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>(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 同左</p> <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 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35期（2020年3月31日現在）における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません（（注2）参照）。

（単位：千円）

	貸借対照表計上額（*）	時価（*）	差額
(1)現金・預金	19,928,671	19,928,671	-
(2)未収委託者報酬	2,864,007	2,864,007	-
(3)未収収益	2,126,212	2,126,212	-
(4)未収入金	101,676	101,676	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	65,610	65,610	-
(6)預り金	(43,576)	(43,576)	-
(7)未払金	(2,555,940)	(2,555,940)	-
(8)未払費用	(544,639)	(544,639)	-
(9)未払消費税等	(367,506)	(367,506)	-
(10)未払法人税等	(1,347,000)	(1,347,000)	-

（\*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

第36期（2021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	22,550,090	22,550,090	-
(2)未収委託者報酬	2,973,733	2,973,733	-
(3)未収収益	2,375,688	2,375,688	-
(4)未収入金	3,865	3,865	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	49,477	49,477	-
(6)預り金	(45,524)	(45,524)	-
(7)未払金	(2,979,963)	(2,979,963)	-
(8)未払費用	(429,654)	(429,654)	-
(9)未払消費税等	(468,610)	(468,610)	-
(10)未払法人税等	(1,378,000)	(1,378,000)	-

(＊)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35期 2020年3月31日現在	第36期 2021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35期 2020年3月31日現在		第36期 2021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	71,200
敷金	450,632	敷金	474,324
その他長期差入保証金	10,030	その他長期差入保証金	10,030

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021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35期(2020年3月31日現在)

(単位:千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	19,928,370	-	-	-
未収委託者報酬	2,864,007	-	-	-
未収収益	2,126,212	-	-	-
未収入金	101,676	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	2,247	21,678	22,121	-
合計	25,022,515	21,678	22,121	-

第36期(2021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	22,549,627	-	-	-
未収委託者報酬	2,973,733	-	-	-
未収収益	2,375,688	-	-	-
未収入金	3,865	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があるもの	8,474	16,416	5,279	-
合計	27,911,389	16,416	5,279	-

(有価証券関係)

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021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>2. その他有価証券</p> <p style="text-align: right;">(単位:千円)</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 71,200千円)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 style="text-align: right;">(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	32,071	27,816	4,254	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	37,407	27,442	9,964
貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えないもの 証券投資 信託	33,538	42,372	8,834	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	12,070	12,820	749
合計	65,610	70,189	4,579	合計	49,477	40,262	9,214

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券  
該当事項はありません。

3. 当事業年度中に売却したその他有価証券  
同左

## (退職給付関係)

第35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日	
1. 採用している退職給付制度の概要	<p>当社は、従業員の退職給付に備えるため、非積立型の確定給付制度及び確定拠出年金制度を採用しております。</p> <p>退職一時金制度(非積立型制度であります。)では、当社従業員を制度対象として、給与と勤続年数に基づき算出した一時金を支給しております。受入出向者については退職給付負担金を支払っており、損益計算書上の退職給付費用には当該金額が含まれております。貸借対照表上は出向期間3年以下の出向者に係る金額が退職給付引当金に、出向期間3年超の出向者に係る金額がその他未払金にそれぞれ含まれております。</p> <p>当社は当事業年度より退職給付債務の計算方法を簡便法から原則法に変更しております。</p>
2. 確定給付制度	

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

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

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

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
	-
非積立型制度の退職給付債務	739,283千円
未積立退職給付債務	739,283千円
未認識数理計算上の差異	11,130千円
<b>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</b>	<b>750,413千円</b>
退職給付引当金	750,413千円
<b>貸借対照表に計上された負債と資産の純額</b>	<b>750,413千円</b>

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

割引率	0.4%
-----	------

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、66,184千円であります。

## 第36期

自 2020年4月1日

至 2021年3月31日

## 1. 採用している退職給付制度の概要

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

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

## 2. 確定給付制度

## (1) 退職給付債務の期首残高と期末残高の調整表

退職給付債務の期首残高	739,283千円
勤務費用	69,269千円
利息費用	2,907千円
数理計算上の差異の発生額	8,451千円
退職給付の支払額	19,300千円
退職給付債務の期末残高	800,611千円

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

積立型制度の退職給付債務	-
年金資産	-
	-
非積立型制度の退職給付債務	800,611千円
未積立退職給付債務	800,611千円
未認識数理計算上の差異	1,565千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	802,176千円
退職給付引当金	802,176千円
貸借対照表に計上された負債と資産の純額	802,176千円

## (3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

勤務費用	69,269千円
利息費用	2,907千円
数理計算上の差異の費用処理額	1,113千円
その他	12,353千円
確定給付制度に係る退職給付費用	83,417千円

## (4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

割引率	0.4%
-----	------

## 3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、73,196千円であります。

## (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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021年3月31日現在)
繰延税金資産		
退職給付引当金	229,776千円	245,626千円
未払金	3,802千円	3,859千円
賞与引当金	74,920千円	83,848千円
未払法定福利費	9,935千円	10,817千円
未払事業所税	3,672千円	3,840千円
未払事業税	70,737千円	81,915千円
未払調査費	82,822千円	79,792千円
減価償却超過額	124,870千円	86,208千円
繰延資産超過額	3,293千円	6,297千円

未払確定拠出年金	1,666千円	1,901千円
未収実績連動報酬	21,260千円	31,761千円
その他有価証券評価差額金	1,402千円	-
未払費用	95,799千円	101,413千円
繰延税金資産小計	723,961千円	737,281千円
評価性引当額	-	-
繰延税金資産合計	723,961千円	737,281千円
繰延税金負債		
特別償却準備金	0千円	0千円
その他有価証券評価差額金	-	2,821千円
繰延税金負債合計	0千円	2,821千円
繰延税金資産の純額	723,961千円	734,459千円

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35期 (2020年3月31日現在)	第36期 (2021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35期 自 2019年4月1日 至 2020年3月31日	第36期 自 2020年4月1日 至 2021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 (単位：千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>日本</th> <th>その他</th> <th>合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>23,387,535</td> <td>2,699,004</td> <td>26,086,540</td> </tr> </tbody> </table> <p>(注) 営業収益は顧客の所在地を基準とし、国ごとに分類しております。</p> <p>(2) 有形固定資産 本邦に所在している有形固定資産の金額が貸借対照表の有形固定資産の金額の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）</p> <p>(2) 委託者報酬 5,339,902千円</p> <p>(3) 関連するセグメント名 投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント</p>	日本	その他	合計	23,387,535	2,699,004	26,086,540	<p>1. 製品及びサービスごとの情報 同左</p> <p>2. 地域ごとの情報 (1) 営業収益 本邦の外部顧客への営業収益が損益計算書の営業収益の90%を超えるため、記載を省略しております。</p> <p>(2) 有形固定資産 同左</p> <p>3. 主要な顧客ごとの情報 (1) 投資信託の名称 東京海上・円資産バランスファンド（毎月決算型）</p> <p>(2) 委託者報酬 5,399,003千円</p> <p>(3) 関連するセグメント名 投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント</p>
日本	その他	合計					
23,387,535	2,699,004	26,086,540					

## (関連当事者情報)

第35期（自 2019年4月1日 至 2020年3月31日）

## 1. 関連当事者との取引

- (1) 財務諸表提出会社の親会社及び主要株主（会社等の場合に限る。）等  
重要な取引はありません。
- (2) 財務諸表提出会社の子会社及び関連会社等  
重要な取引はありません。
- (3) 財務諸表提出会社と同一の親会社をもつ会社等及び財務諸表提出会社のその他の関係会社の子会社等  
重要な取引はありません。
- (4) 財務諸表提出会社の役員及び主要株主（個人の場合に限る。）等  
重要な取引はありません。

## 2. 親会社又は重要な関連会社に関する情報

- (1) 親会社情報  
東京海上ホールディングス株式会社（東京証券取引所に上場）
- (2) 重要な関連会社の要約財務情報  
重要な関連会社はありません。

第36期（自 2020年4月1日 至 2021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35期 (自 2019年4月1日 至 2020年3月31日)	
1株当たり純資産額	599,546円59銭
1株当たり当期純利益金額	109,857円21銭
なお、潜在株式調整後1株当たり当期純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	22,962,634千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る当期末の純資産額	22,962,634千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた当期末の普通株式の数	38,300株
1株当たり当期純利益金額の算定上の基礎	
損益計算書上の当期純利益金額	4,207,531千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る当期純利益金額	4,207,531千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

第36期 (自 2020年4月1日 至 2021年3月31日)	
1株当たり純資産額	665,945円58銭
1株当たり当期純利益金額	128,909円11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	25,505,715千円
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	25,505,715千円
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	4,937,219千円
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	4,937,219千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

#### 4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

#### 5【その他】

##### (1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

##### (2) 訴訟事件その他の重要事項

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



## 第2【その他の関係法人の概況】

### 1【名称、資本金の額及び事業の内容】

#### (1) 受託会社

- ・ 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社  
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・ 資本金の額 324,279百万円(2021年3月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

#### <参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円(2021年3月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

#### (2) 販売会社

名称	資本金の額( )	事業の内容
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	金融商品取引法に定める第一種金融商品取引業を営んでいます。
株式会社 S B I 証券	48,323百万円	
松井証券株式会社	11,945百万円	
楽天証券株式会社	7,495百万円	
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。

( ) 2021年3月末日現在。

### 2【関係業務の概要】

受託会社は、信託財産の保管・管理等を行います。また、当ファンドにかかる信託事務の一部につき日本マスタートラスト信託銀行株式会社に委託することがあります。

販売会社は、募集・販売の取扱い、一部解約事務および収益分配金・解約金・償還金の支払い等を行います。

### 3【資本関係】

資本関係はありません。

### 第3【その他】

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

# 独立監査人の監査報告書

2021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

東京事務所

指定有限責任社員 公認会計士 奈良昌彦  
業務執行社員

指定有限責任社員 公認会計士 久保直毅  
業務執行社員

## 監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「委託会社等の経理状況」に掲げられている東京海上アセットマネジメント株式会社の2020年4月1日から2021年3月31日までの第36期事業年度の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益計算書、株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2021年3月31日現在の財政状態及び同日をもって終了する事業年度の経営成績を、全ての重要な点において適正に表示しているものと認める。

## 監査意見の根拠

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

## 財務諸表に対する経営者及び監査役の責任

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

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

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

## 財務諸表監査における監査人の責任

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

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

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

---

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

2. XBRLデータは監査の対象には含まれていません。

独立監査人の監査報告書

2021年3月10日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

**監査意見**

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2020年1月28日から2021年1月25日までの計算期間の財務諸表、すなわち、貸借対照表、損益及び剰余金計算書、注記表並びに附属明細表について監査を行った。

当監査法人は、上記の財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる企業会計の基準に準拠して、東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2021年1月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する計算期間の損益の状況を、すべての重要な点において適正に表示しているものと認める。

**監査意見の根拠**

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

**財務諸表に対する経営者の責任**

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

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

**財務諸表監査における監査人の責任**

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

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

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

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

#### 利害関係

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

以 上

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

独立監査人の中間監査報告書

2021年9月8日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

東京事務所

指定有限責任社員

業務執行社員

公認会計士 久保 直毅

## 中間監査意見

当監査法人は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づく監査証明を行うため、「ファンドの経理状況」に掲げられている東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2021年1月26日から2021年7月25日までの中間計算期間の中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益及び剰余金計算書並びに中間注記表について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上・円資産インデックスバランスファンドの2021年7月25日現在の信託財産の状態及び同日をもって終了する中間計算期間（2021年1月26日から2021年7月25日まで）の損益の状況に関する有用な情報を表示しているものと認める。

## 中間監査意見の根拠

当監査法人は、我が国において一般に公正妥当と認められる中間監査の基準に準拠して中間監査を行った。中間監査の基準における当監査法人の責任は、「中間財務諸表監査における監査人の責任」に記載されている。当監査法人は、我が国における職業倫理に関する規定に従って、東京海上アセットマネジメント株式会社及びファンドから独立しており、また、監査人としてのその他の倫理上の責任を果たしている。当監査法人は、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。

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

## 中間財務諸表監査における監査人の責任

監査人の責任は、監査人が実施した中間監査に基づいて、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て、中間監査報告書にお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。虚偽表示は、不正又は誤謬により発生する可能性があり、個別に又は集計すると、中間財務諸表の利用者の意思決定に影響を与えると合理的に見込まれる場合に、重要性があると判断される。

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

- 不正又は誤謬による中間財務諸表の重要な虚偽表示リスクを識別し、評価する。また、重要な虚偽表示リスクに対応する中間監査手続を立案し、実施する。中間監査手続の選択及び適用は監査人の判断による。さらに、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する。なお、中間監査手続は、年度監査と比べて監査手続の一部が省略され、監査人の判断により、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。
- 中間財務諸表監査の目的は、内部統制の有効性について意見表明するためのものではないが、監査人は、リスク評価の実施に際して、状況に応じた適切な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。
- 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会計上の見積りの合理性及び関連する注記事項の妥当性を評価する。
- 経営者が継続企業を前提として中間財務諸表を作成することが適切であるかどうか、また、入手した監査証拠に基づき、継続企業の前提に重要な疑義を生じさせるような事象又は状況に関して重要な不確実性が認められるかどうか結論付ける。継続企業の前提に関する重要な不確実性が認められる場合は、中間監査報告書において中間財務

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

- ・ 中間財務諸表の表示及び注記事項が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠しているかどうかとともに、関連する注記事項を含めた中間財務諸表の表示、構成及び内容、並びに中間財務諸表が基礎となる取引や会計事象に関して有用な情報を表示しているかどうかを評価する。

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

#### 利害関係

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

以 上

---

(注) 1. 上記は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。