

【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】 | 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065 |
| 【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】 | 上限 各1兆円 |
| 【縦覧に供する場所】 | 該当なし |

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

（なお、愛称として「年金コンパス」という名称を用いる場合があります。また、上記のそれぞれをまたは総称して、以下「ファンド」または「当ファンド」ということがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初の1口当たり元本は1円です。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

各1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の翌営業日の基準価額

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

委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）

東京海上アセットマネジメント サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

(5)【申込手数料】

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

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。

当初申込日にかかる発行価額の総額は信託設定日に、継続申込期間中の各取得申込日の発行価額の総額は各追加信託が行われる日に、販売会社から、委託会社の指定する口座を経由して、受託会社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】

該当ありません。

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日本株TOPIXマザーファンド受益証券」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド受益証券」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド受益証券」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド受益証券」（それぞれをまたは総称して、以下「マザーファンド」ということがあります。）を主要投資対象として運用を行います。

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

基本的性格

当ファンドは、追加型投信／内外／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 | 為替ヘッジ |
|---|--------------|------------------|--------------|-----------|
| 株式 一般 大型株 中小型株 | 年1回 | グローバル (日本を含む) | ファミリーファンド | あり () |
| | 年2回 | 日本 | | |
| 債券 一般 公債 社債 その他債券 クレジット属性 () | 年4回 | 北米 | ファンド・オブ・ファンズ | なし |
| | 年6回 (隔月) | 欧州 | | |
| | 年12回 (毎月) | アジア オセアニア | | |
| 不動産投信 | 日々 | 中南米 | | |
| その他資産(投資信託証券 (資産複合(株式・債券) 資産配分変更型)) | その他 () | アフリカ | | |
| | | 中近東 (中東) | | |
| 資産複合 () 資産配分固定型 資産配分変更型 | | エマージング | | |

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

属性区分に記載している「為替ヘッジ」は、対円での為替リスクに対するヘッジの有無を記載しています。

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

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

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

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

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

信託金の限度額

当ファンドの信託金限度額は、信託約款の定めにより各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、以下のマザーファンドへの投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

| 資産 | マザーファンド | 指数 |
|------|----------------------|---------------------------------|
| 国内株式 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | TOPIX |
| 国内債券 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | NOMURA-BPI(総合) |
| 外国株式 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | MSCIコクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース) |
| 外国債券 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース) |

- 実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

2

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

<当初設定時>

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

次ページへ続く

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

3

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

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

<2021年4月時点>

| ファンド | 資産配分比率 | | | |
|------------------------|--------|------|------|------|
| | 国内株式 | 国内債券 | 外国株式 | 外国債券 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035 | 31% | 28% | 31% | 10% |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045 | 32% | 26% | 32% | 10% |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055 | 33% | 24% | 33% | 10% |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065 | 35% | 20% | 35% | 10% |

<ターゲットイヤーの10年前>

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

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

次ページへ続く

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

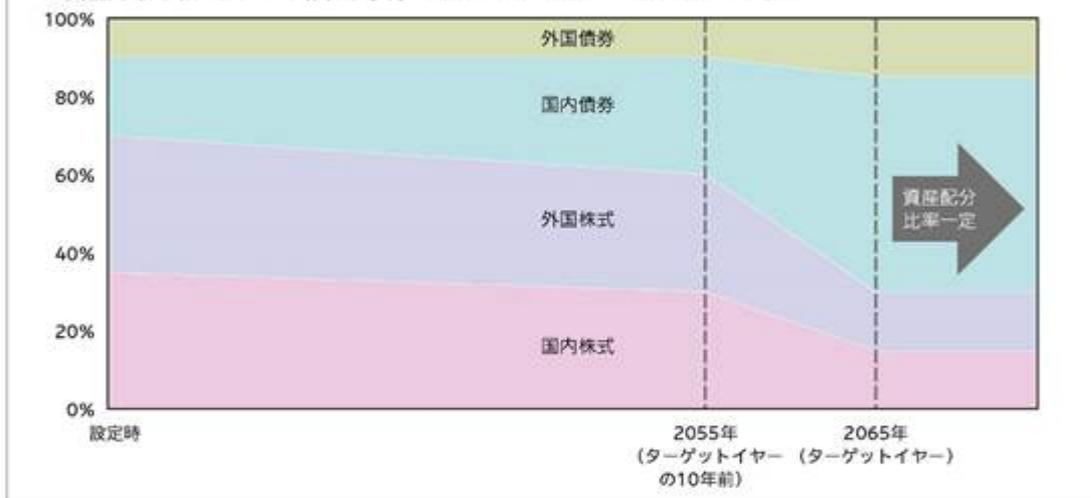
4

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

<ターゲットイヤーの資産配分比率見直し実施日以降>

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

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



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

<各マザーファンドが対象とする指数について>

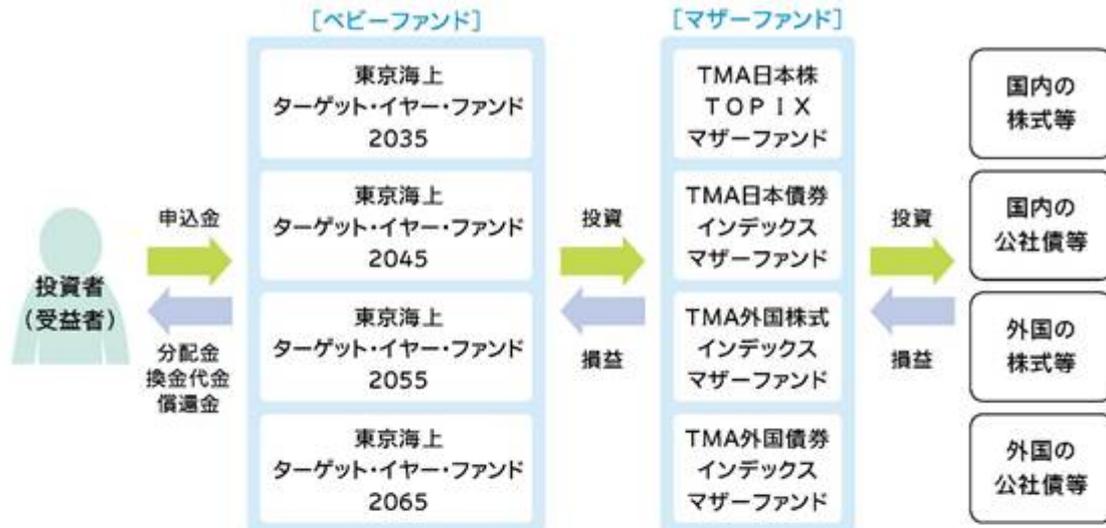
- *「TOPIX」は日本の株式市場を広範に調範するとともに、投資対象としての機能性を有するマーケット・ベンチマークです。TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。
- *「NOMURA-BPI(野村ボンド・パフォーマンス・インデックス)(総合)」とは、野村證券が公表する日本の公債券流通市場全体の動向を的確に表す代表的な指標です。NOMURA-BPIは、野村證券の知的財産です。野村證券は、ファンドの運用成績等に関し、一切責任ありません。
- *「MSCIコクサイ指数」とは、MSCI社が発表している日本を除く主要先進国の株式市場の動きを捉える代表的な株価指標です。同指数の著作権、知的財産権その他一切の権利はMSCI社に帰属します。また、MSCI社は同指数の内容を変更する権利および公表を停止する権利を有しています。MSCI社の許諾なしにインデックスの一部または全部を複製、頒布、使用等することは禁じられています。MSCI社はファンドとは関係なく、ファンドから生じうるいかなる責任も負いません。
- *「FTSE世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)」は、FTSE Fixed Income LLCにより運営され、日本を除く世界主要国の国債の総合収益率を各市場の時価総額で加重平均した債券インデックスです。このインデックスのデータは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。

次ページへ続く

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

ファンドの仕組み

- ファミリーファンド方式により運用を行います。



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

主な投資制限

| | |
|--------|---|
| 株 式 | 株式への実質投資割合には制限を設けません。 |
| 外貨建資産 | 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。 |
| 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、金利変動リスクおよび為替変動リスクを回避する目的以外には利用しません。 |

次ページへ続く

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

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。

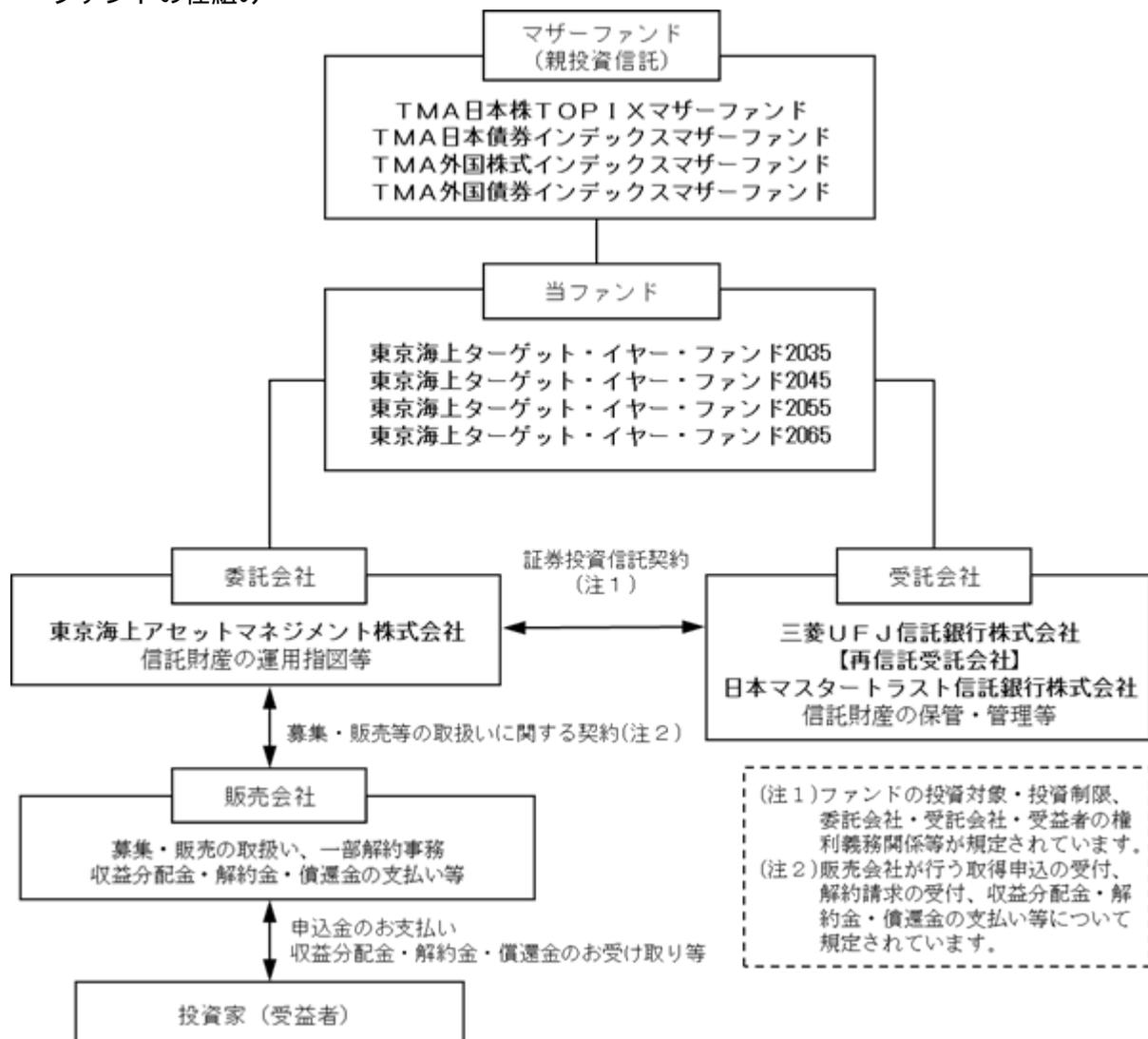
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2019年9月20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
 - 2016年10月 東京海上不動産投資顧問株式会社と合併

・大株主の状況（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

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

(2) 投資態度

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

主として、以下の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受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

| 資産 | マザーファンド | 指数 |
|------|----------------------|-------------------------------------|
| 国内株式 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | TOPIX |
| 国内債券 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | NOMURA - BPI（総合） |
| 外国株式 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | MSCIコクサイ指数 （円ヘッジなし・円ベース） |
| 外国債券 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | FTSE世界国債インデックス （除く日本、ヘッジなし・円ベース） |

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：31%

国内債券：28%

海外株式：31%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

イ．2035年（ターゲットイヤー）の10年前となる2025年に近づくにしたがい、リスク性資産（国内外の株式）の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産（国内外の債券）の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。

ロ．2025年からターゲットイヤーに近づくにしたがい、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

2035年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

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。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

主として、以下の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受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

| 資産 | マザーファンド | 指数 |
|------|----------------------|-------------------------------------|
| 国内株式 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | TOPIX |
| 国内債券 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | NOMURA - BPI（総合） |
| 外国株式 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | MSCIコクサイ指数 （円ヘッジなし・円ベース） |
| 外国債券 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | FTSE世界国債インデックス （除く日本、ヘッジなし・円ベース） |

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：32%

国内債券：26%

海外株式：32%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

イ．2045年（ターゲットイヤー）の10年前となる2035年に近づくにしたがい、リスク性資産（国内外の株式）の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産（国内外の債券）の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。

ロ．2035年からターゲットイヤーに近づくにしたがい、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

2045年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

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。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

主として、以下の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受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

| 資産 | マザーファンド | 指数 |
|------|----------------------|-------------------------------------|
| 国内株式 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | TOPIX |
| 国内債券 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | NOMURA - BPI（総合） |
| 外国株式 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | MSCIコクサイ指数 （円ヘッジなし・円ベース） |
| 外国債券 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | FTSE世界国債インデックス （除く日本、ヘッジなし・円ベース） |

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：34%

国内債券：22%

海外株式：34%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

イ．2055年（ターゲットイヤー）の10年前となる2045年に近づくにしたがい、リスク性資産（国内外の株式）の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産（国内外の債券）の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。

ロ．2045年からターゲットイヤーに近づくにしたがい、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

2055年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

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。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

主として、以下の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受益証券への投資を通じて、実質的に国内外の株式および債券に分散投資を行います。

| 資産 | マザーファンド | 指数 |
|------|----------------------|-------------------------------------|
| 国内株式 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | TOPIX |
| 国内債券 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | NOMURA - BPI (総合) |
| 外国株式 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | MSCIコクサイ指数 (円ヘッジなし・円ベース) |
| 外国債券 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | FTSE世界国債インデックス (除く日本、ヘッジなし・円ベース) |

当初設定時は以下の資産配分比率を参考にポートフォリオを構築します。

国内株式：35%

国内債券：20%

海外株式：35%

海外債券：10%

資産配分比率は、原則として以下の方針で1年ごとに変更します。

イ．2065年(ターゲットイヤー)の10年前となる2055年に近づくにしたい、リスク性資産(国内外の株式)の比率をゆるやかに減少させ、安定性資産(国内外の債券)の比率をゆるやかに増加させる運用をめざします。

ロ．2055年からターゲットイヤーに近づくにしたい、リスク性資産の比率を大きく引き下げ、安定性資産の比率を大きく引き上げる運用をめざします。

2065年の資産配分比率見直し実施日以降は、マザーファンドへの投資を通じた各資産への当該比率を一定とします。

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。

実質組入外貨建資産については、原則として為替ヘッジを行いません。

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

TMA日本債券インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

NOMURA - B P I (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 - B P I (総合) に連動する投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

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

3. 運用制限

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

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

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

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

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

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

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

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

TMA外国株式インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

M S C I コクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース) に連動する投資成果の達成を目標とします。

2. 運用方法**(1) 投資対象**

外国の株式を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として外国の株式に投資し、M S C I コクサイ指数(円ヘッジなし・円ベース) に連動する投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

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

信託財産の効率的な運用に資するため、株価指数先物取引や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、株式の組入総額ならびに株価指数先物取引や外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

3. 運用制限

(1) 株式への投資割合には、制限を設けません。

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

(7) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに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以外には利用しません。

(8) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じる目的以外には利用しません。

TMA外国債券インデックスマザーファンド**1. 基本方針**

F T S E 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果の達成を目標とします。

2. 運用方法**(1) 投資対象**

外国の公社債を主要投資対象とします。

(2) 投資態度

主として外国の公社債に投資し、F T S E 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動する投資成果を目指して運用を行うことを基本とします。

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

信託財産の効率的な運用に資するため、債券先物取引や外国為替予約取引等を利用することがあります。このため、組入有価証券の時価総額と債券先物取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。また、外貨建資産および外国為替予約取引等の買建玉の時価総額の合計額が、信託財産の純資産総額を超えることがあります。

3. 運用制限

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

(2) 外貨建資産への投資割合には、制限を設けません。

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

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

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

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

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

(8) デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに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以外には利用しません。

(9) 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じ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日本株T O P I Xマザーファンド」の運用にあたっては、T O P I X(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T O P I Xに連動するようポートフォリオを構築します。

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

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

「TMA外国債券インデックスマザーファンド」の運用にあたっては、層化抽出法を用いてF T S E 世界国債インデックス(除く日本、ヘッジなし・円ベース)に連動するよう、残存期間別、国別、通貨別毎の時価ウェイトとデレションを勘案しポートフォリオを構築します。

(2)【投資対象】

1. 当ファンドにおいて投資の対象とする資産の種類は、次に掲げるものとします。

(1) 次に掲げる特定資産(投資信託及び投資法人に関する法律施行令第3条で定めるものをいいます。以下同じ。)

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。)

金銭債権(に掲げるものに該当するものを除きます。)

約束手形(金融商品取引法第2条第1項第15号に掲げるものを除きます。)

(2) 次に掲げる特定資産以外の資産

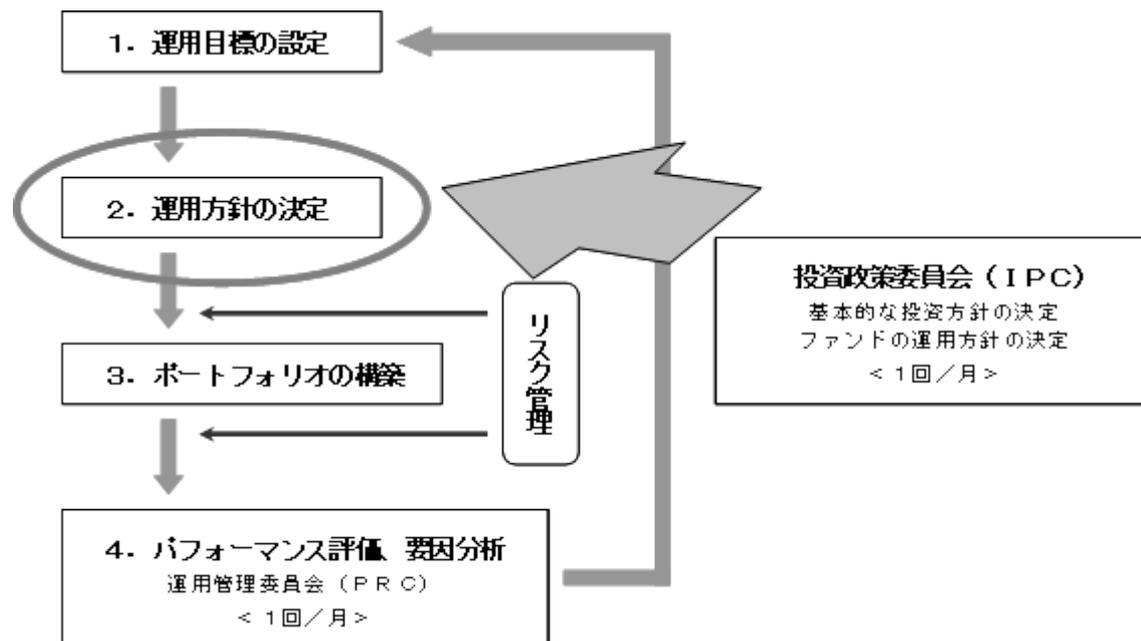
為替手形

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

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

- 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（ ）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。
- 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費（ ）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

（ ）諸経費とは、信託財産に関する租税、信託事務の処理に要する諸費用（消費税等相当額を含みます。）、信託財産の財務諸表の監査に要する費用（消費税等相当額を含みます。）ならびに受託会社の立替えた立替金の利息をいいます。

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

分配金は、毎計算期間終了後1ヵ月以内の委託会社の指定する日（原則として決算日から起算して5営業日まで）から、決算日において振替機関等の振替口座簿に記載または記録されている受益者（当該収益分配金にかかる決算日以前において一部解約が行われた受益権にかかる受益者を除きます。また、当該収益分配金にかかる決算日以前に設定された受益権で取得申込代金支払前のため販売会社の名義で記載または記録されている受益権については原則として取得申込者として）

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. 株式への実質投資割合には制限を設けません。
- b. 外貨建資産への実質投資割合には制限を設けません。
- 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。
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)
- 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. デリバティブ取引(法人税法第61条の5に定めるものをいいます。)は、価格変動、金利変動および為替変動により生じるリスクを減じる目的ならびに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以外には利用しません。
- i. 外国為替予約取引は、為替相場の変動により生じるリスクを減じ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)

- 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)

- 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)

- 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)

- 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)

- 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)

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)

- 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)

- 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)

- 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)
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)
- 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)
一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。
- 資金の借入(約款)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1. 投資リスク

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

(1) 価格変動リスク

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

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

投資信託は預貯金や保険と異なります。

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

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。

為替変動リスク

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

カントリーリスク

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

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、主に国内外の株式や公社債を実質的な投資対象としています。当ファンドの基準価額は、組入れた株式や公社債の値動きやそれらの株式や公社債の発行者の信用状況の変化、為替相場の変動等の影響により上下しますので、投資元本を割り込むことがあります。したがって、当ファンドは元本が保証されているものではありません。
- ・委託会社の運用指図によって信託財産に生じた利益および損失は、全て投資家に帰属します。

(2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(3) その他の留意点

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

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

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

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

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

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

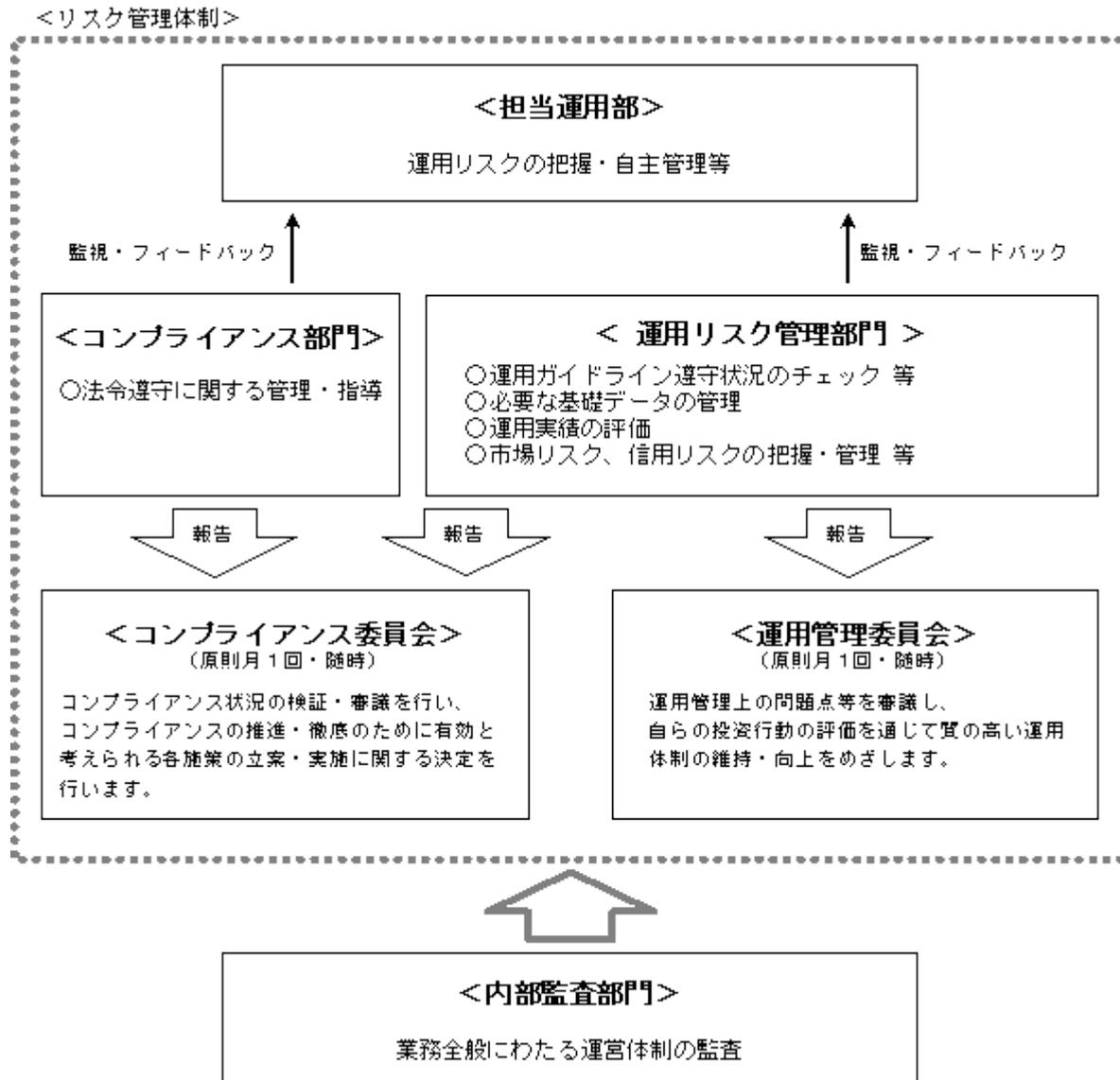
分配金は、預貯金の利息とは異なり、投資信託の純資産から支払われますので分配金が支払われると、その金額相当分、基準価額は下がります。分配金は、計算期間中に発生した収益（経費控除後の配当等収益および評価益を含む売買益）を超えて支払われる場合があります。その場合、当期決算日の基準価額は前期決算日と比べて下落することになります。また、分配金の水準は、必ずしも計算期間におけるファンドの収益率を示すものではありません。受益者のファンドの購入価額によっては、分配金の一部または全額が、実質的には元本の一部払戻しに相当する場合があります。ファンド購入後の運用状況により、分配金額より基準価額の値上がり小さかった場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

3. 管理体制

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

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

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



参考情報

2016年8月～2021年7月

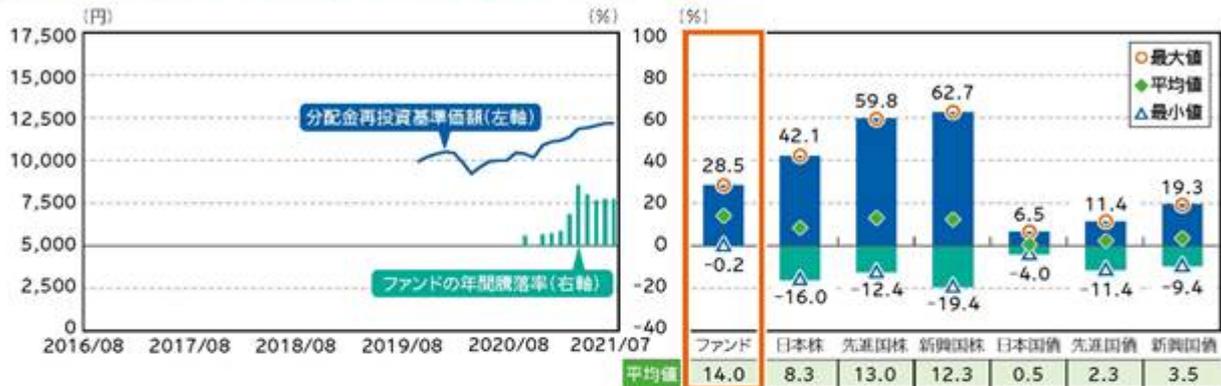
ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

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。

ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと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。

※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2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



※分配金再投資基準価額は、税引前分配金を再投資したものと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。

※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2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



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

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

※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のものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



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

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

※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のものとして計算しているため、実際の基準価額に基づいて計算した年間騰落率とは異なる場合があります。

※ファンドは2020年9月以降の年間騰落率を用いています。

次ページへ続く

上記は過去の実績であり、将来の動向等を示唆・保証するものではありません。

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

指数について

●TOPIXの指数値および商標は、東京証券取引所の知的財産であり、TOPIXに関するすべての権利およびノウハウは東京証券取引所が有します。東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出もしくは公表の方法の変更、公表の停止、TOPIXの商標の変更、使用の停止を行う場合があります。 ●MSCIコクサイ指数の著作権、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、商標権、知的財産権その他一切の権利は、野村證券に帰属します。 ●FTSE世界国債インデックスは、情報提供のみを目的としており、FTSE Fixed Income LLCは、当該データの正確性および完全性を保証せず、またデータの誤謬、脱漏または遅延につき何ら責任を負いません。このインデックスに対する著作権等の知的財産その他一切の権利はFTSE Fixed Income LLCに帰属します。 ●JPモルガン・ガバメント・ボンド・インデックス・エマージング・マーケット・グローバル・ディバーシファイドに関する著作権、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、所定の信託報酬率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。

信託報酬率およびその配分（税抜）については以下の通りとします。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

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

*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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

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

* 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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

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

* 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】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------------------|----|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 440,484,178 | 99.99 |
| コール・ローン等、その他の資産（負債控除後） | | 2,819 | 0.00 |
| 合計（純資産総額） | | 440,486,997 | 100.00 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------------------|----|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 212,901,326 | 100.00 |
| コール・ローン等、その他の資産（負債控除後） | | 140 | 0.00 |
| 合計（純資産総額） | | 212,901,186 | 100.00 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------------------|----|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 134,524,685 | 99.99 |
| コール・ローン等、その他の資産（負債控除後） | | 497 | 0.00 |
| 合計（純資産総額） | | 134,525,182 | 100.00 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------------------|----|-------------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 日本 | 296,450,781 | 99.99 |
| コール・ローン等、その他の資産（負債控除後） | | 392 | 0.00 |
| 合計（純資産総額） | | 296,451,173 | 100.00 |

（ご参考：親投資信託の投資状況）

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065が主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

TMA日本株TOPIXマザーファンド

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------------------|----|----------------|---------|
| 株式 | 日本 | 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外国債券インデックスマザーファンド

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|------------------------|------------|---------------|---------|
| 国債証券 | アメリカ | 3,978,005,834 | 44.81 |
| | カナダ | 174,331,392 | 1.96 |
| | ドイツ | 659,988,049 | 7.43 |
| | イタリア | 840,229,302 | 9.46 |
| | フランス | 889,447,833 | 10.02 |
| | オーストラリア | 185,311,632 | 2.08 |
| | イギリス | 575,976,691 | 6.48 |
| | シンガポール | 35,843,201 | 0.40 |
| | マレーシア | 40,461,836 | 0.45 |
| | オランダ | 171,489,533 | 1.93 |
| | スペイン | 525,061,507 | 5.91 |
| | ベルギー | 213,615,899 | 2.40 |
| | スウェーデン | 25,884,403 | 0.29 |
| | ノルウェー | 20,676,379 | 0.23 |
| | オーストリア | 128,007,292 | 1.44 |
| | フィンランド | 58,660,744 | 0.66 |
| | デンマーク | 40,140,931 | 0.45 |
| | メキシコ | 63,500,382 | 0.71 |
| | アイルランド | 73,167,358 | 0.82 |
| | イスラエル | 40,013,922 | 0.45 |
| ポーランド | 50,649,980 | 0.57 | |
| | 小計 | 8,790,464,100 | 99.03 |
| コール・ローン等、その他の資産（負債控除後） | | 86,030,378 | 0.96 |
| 合計（純資産総額） | | 8,876,494,478 | 100.00 |

TMA外国株式インデックスマザーファンド

| 資産の種類 | 地域 | 時価合計（円） | 投資比率（％） |
|-------|----|---------|---------|
|-------|----|---------|---------|

| | | | |
|------------------------|----------------|----------------|--------|
| 株式 | アメリカ | 33,013,753,561 | 66.13 |
| | カナダ | 1,692,878,412 | 3.39 |
| | ドイツ | 1,404,669,913 | 2.81 |
| | イタリア | 261,041,933 | 0.52 |
| | フランス | 1,582,439,831 | 3.17 |
| | オーストラリア | 1,000,607,689 | 2.00 |
| | イギリス | 2,088,821,373 | 4.18 |
| | スイス | 1,623,319,017 | 3.25 |
| | バミューダ | 134,747,298 | 0.26 |
| | 香港 | 382,102,035 | 0.76 |
| | シンガポール | 128,427,140 | 0.25 |
| | ニュージーランド | 56,009,544 | 0.11 |
| | オランダ | 945,263,247 | 1.89 |
| | スペイン | 376,660,397 | 0.75 |
| | ベルギー | 137,973,455 | 0.27 |
| | スウェーデン | 566,312,903 | 1.13 |
| | ノルウェー | 97,726,153 | 0.19 |
| | オーストリア | 27,441,900 | 0.05 |
| | ルクセンブルク | 48,689,972 | 0.09 |
| | フィンランド | 190,013,069 | 0.38 |
| | デンマーク | 420,545,461 | 0.84 |
| | アイルランド | 824,898,806 | 1.65 |
| | イスラエル | 77,218,742 | 0.15 |
| | ポルトガル | 39,080,907 | 0.07 |
| | ケイマン | 53,795,202 | 0.10 |
| | キュラソー | 40,572,535 | 0.08 |
| ジャージー | 152,484,461 | 0.30 | |
| 小計 | 47,367,494,956 | 94.89 | |
| 投資証券 | アメリカ | 937,387,181 | 1.87 |
| | カナダ | 8,696,483 | 0.01 |
| | フランス | 34,526,070 | 0.06 |
| | オーストラリア | 63,920,238 | 0.12 |
| | イギリス | 37,901,023 | 0.07 |
| | 香港 | 19,866,900 | 0.03 |
| | シンガポール | 10,002,972 | 0.02 |
| | 小計 | 1,112,300,867 | 2.22 |
| コール・ローン等、その他の資産（負債控除後） | | 1,437,779,378 | 2.88 |
| 合計（純資産総額） | | 49,917,575,201 | 100.00 |

その他の資産の投資状況

| 資産の種類 | 建別 | 地域 | 時価（円） | 投資比率（％） |
|-------|----|----|-------|---------|
|-------|----|----|-------|---------|

| | | | | |
|----------|----|------|---------------|------|
| 株価指数先物取引 | 買建 | アメリカ | 1,980,496,726 | 3.96 |
| | 買建 | ドイツ | 422,711,126 | 0.84 |
| | 買建 | イギリス | 310,435,053 | 0.62 |

(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 |

(2)【投資資産】

【投資有価証券の主要銘柄】

a. 主要銘柄の明細

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

| 順位 | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 口数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率(%) |
|----|----------------------|----|---------------|------------|--------|-------------|--------|-------------|---------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 36,648,278 | 3.3925 | 124,329,821 | 3.7818 | 138,596,457 | 31.46 |
| 2 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 81,522,439 | 1.6327 | 133,102,368 | 1.6390 | 133,615,277 | 30.33 |
| 3 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 95,200,218 | 1.2924 | 123,045,913 | 1.3018 | 123,931,643 | 28.13 |
| 4 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 25,515,480 | 1.6974 | 43,310,875 | 1.7378 | 44,340,801 | 10.06 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

| 順位 | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 口数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率(%) |
|----|----------------------|----|---------------|------------|--------|------------|--------|------------|---------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 18,287,628 | 3.4480 | 63,056,476 | 3.7818 | 69,160,151 | 32.48 |
| 2 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 40,680,510 | 1.6426 | 66,825,282 | 1.6390 | 66,675,355 | 31.31 |
| 3 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 42,733,855 | 1.2927 | 55,243,437 | 1.3018 | 55,630,932 | 26.12 |
| 4 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 12,334,497 | 1.7022 | 20,996,310 | 1.7378 | 21,434,888 | 10.06 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

| 順位 | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 口数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率(%) |
|----|----------------------|----|---------------|------------|--------|------------|--------|------------|---------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 11,918,005 | 3.4113 | 40,656,746 | 3.7818 | 45,071,511 | 33.50 |

| | | | | | | | | | |
|---|----------------------|----|---------------|------------|--------|------------|--------|------------|-------|
| 2 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 26,512,228 | 1.6342 | 43,327,127 | 1.6390 | 43,453,541 | 32.30 |
| 3 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 24,929,487 | 1.2931 | 32,236,723 | 1.3018 | 32,453,206 | 24.12 |
| 4 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 7,795,159 | 1.6996 | 13,249,071 | 1.7378 | 13,546,427 | 10.06 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

| 順位 | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 口数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資 比率 (%) |
|----|----------------------|----|---------------|------------|--------|-------------|--------|-------------|-----------------|
| | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 27,864,698 | 3.4664 | 96,590,676 | 3.7818 | 105,378,714 | 35.54 |
| 2 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 61,985,545 | 1.6447 | 101,951,191 | 1.6390 | 101,594,308 | 34.27 |
| 3 | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 45,795,106 | 1.2926 | 59,198,743 | 1.3018 | 59,616,068 | 20.10 |
| 4 | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 日本 | 親投資信託 受益証券 | 17,183,618 | 1.7045 | 29,289,738 | 1.7378 | 29,861,691 | 10.07 |

b. 投資有価証券の種類

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.99 |
| 合計 | 99.99 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 100.00 |
| 合計 | 100.00 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.99 |
| 合計 | 99.99 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

| 種類 | 投資比率(%) |
|-----------|---------|
| 親投資信託受益証券 | 99.99 |
| 合計 | 99.99 |

【投資不動産物件】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
該当事項はありません。

(ご参考:親投資信託の投資資産)

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

T M A 日本株 T O P I X 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 外国債券インデックスマザーファンド

| 順位 | 銘柄名 | 地域 | 種類 | 利率 | 償還期限 | 額面 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率 (%) |
|----|------------------|------|------|-------|------------|---------|-----------|------------|-----------|------------|----------|
| | | | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | T 2 1/4 11/15/24 | アメリカ | 国債証券 | 2.250 | 2024/11/15 | 800,000 | 11,778.72 | 94,229,831 | 11,599.52 | 92,796,195 | 1.04 |
| 2 | T 2 08/15/25 | アメリカ | 国債証券 | 2.000 | 2025/08/15 | 800,000 | 11,758.19 | 94,065,596 | 11,570.44 | 92,563,529 | 1.04 |
| 3 | T 2 3/4 02/15/28 | アメリカ | 国債証券 | 2.750 | 2028/02/15 | 600,000 | 12,516.93 | 75,101,585 | 12,194.44 | 73,166,692 | 0.82 |
| 4 | T 2 3/4 11/15/23 | アメリカ | 国債証券 | 2.750 | 2023/11/15 | 600,000 | 11,773.59 | 70,641,579 | 11,576.42 | 69,458,573 | 0.78 |

| | | | | | | | | | | | |
|----|---------------------|------|------|-------|------------|---------|-----------|------------|-----------|------------|------|
| 5 | T 1 3/4 12/31/24 | アメリカ | 国債証券 | 1.750 | 2024/12/31 | 600,000 | 11,518.26 | 69,109,574 | 11,431.01 | 68,586,075 | 0.77 |
| 6 | T 1 5/8 02/15/26 | アメリカ | 国債証券 | 1.625 | 2026/02/15 | 600,000 | 11,595.67 | 69,574,051 | 11,420.32 | 68,521,920 | 0.77 |
| 7 | T 0 1/8 10/15/23 | アメリカ | 国債証券 | 0.125 | 2023/10/15 | 600,000 | 10,911.95 | 65,471,733 | 10,924.19 | 65,545,161 | 0.73 |
| 8 | T 0 1/8 12/15/23 | アメリカ | 国債証券 | 0.125 | 2023/12/15 | 600,000 | 10,930.05 | 65,580,300 | 10,915.21 | 65,491,271 | 0.73 |
| 9 | T 2 1/2 05/15/24 | アメリカ | 国債証券 | 2.500 | 2024/05/15 | 500,000 | 11,788.13 | 58,940,690 | 11,614.92 | 58,074,607 | 0.65 |
| 10 | T 1 3/4 05/15/23 | アメリカ | 国債証券 | 1.750 | 2023/05/15 | 500,000 | 11,366.43 | 56,832,153 | 11,255.22 | 56,276,148 | 0.63 |
| 11 | T 1 1/2 02/15/30 | アメリカ | 国債証券 | 1.500 | 2030/02/15 | 500,000 | 11,575.65 | 57,878,295 | 11,235.12 | 56,175,640 | 0.63 |
| 12 | T 1 5/8 08/15/22 | アメリカ | 国債証券 | 1.625 | 2022/08/15 | 500,000 | 11,227.00 | 56,135,009 | 11,124.37 | 55,621,861 | 0.62 |
| 13 | T 2 02/15/50 | アメリカ | 国債証券 | 2.000 | 2050/02/15 | 500,000 | 11,802.08 | 59,010,404 | 11,115.37 | 55,576,866 | 0.62 |
| 14 | T 0 1/8 09/15/23 | アメリカ | 国債証券 | 0.125 | 2023/09/15 | 500,000 | 10,920.77 | 54,603,860 | 10,927.61 | 54,638,075 | 0.61 |
| 15 | T 0 3/8 01/31/26 | アメリカ | 国債証券 | 0.375 | 2026/01/31 | 500,000 | 10,705.58 | 53,527,929 | 10,809.57 | 54,047,856 | 0.60 |
| 16 | T 3 02/15/49 | アメリカ | 国債証券 | 3.000 | 2049/02/15 | 400,000 | 14,175.53 | 56,702,133 | 13,509.18 | 54,036,736 | 0.60 |
| 17 | T 2 1/4 11/15/27 | アメリカ | 国債証券 | 2.250 | 2027/11/15 | 400,000 | 12,108.90 | 48,435,638 | 11,832.19 | 47,328,762 | 0.53 |
| 18 | T 2 11/30/22 | アメリカ | 国債証券 | 2.000 | 2022/11/30 | 400,000 | 11,352.74 | 45,410,977 | 11,221.44 | 44,885,767 | 0.50 |
| 19 | T 1 1/2 09/15/22 | アメリカ | 国債証券 | 1.500 | 2022/09/15 | 400,000 | 11,212.24 | 44,848,986 | 11,120.93 | 44,483,734 | 0.50 |
| 20 | T 0 1/8 09/30/22 | アメリカ | 国債証券 | 0.125 | 2022/09/30 | 400,000 | 10,943.05 | 43,772,222 | 10,951.13 | 43,804,553 | 0.49 |
| 21 | FRTR 5 3/4 10/25/32 | フランス | 国債証券 | 5.750 | 2032/10/25 | 200,000 | 22,011.94 | 44,023,889 | 21,626.88 | 43,253,768 | 0.48 |
| 22 | T 1 1/8 02/15/31 | アメリカ | 国債証券 | 1.125 | 2031/02/15 | 400,000 | 10,487.39 | 41,949,596 | 10,812.56 | 43,250,258 | 0.48 |
| 23 | T 0 1/4 10/31/25 | アメリカ | 国債証券 | 0.250 | 2025/10/31 | 400,000 | 10,783.22 | 43,132,890 | 10,779.20 | 43,116,818 | 0.48 |
| 24 | FRTR 1 05/25/27 | フランス | 国債証券 | 1.000 | 2027/05/25 | 300,000 | 14,321.20 | 42,963,623 | 14,185.89 | 42,557,679 | 0.47 |
| 25 | T 0 3/8 09/30/27 | アメリカ | 国債証券 | 0.375 | 2027/09/30 | 400,000 | 10,651.21 | 42,604,869 | 10,592.30 | 42,369,208 | 0.47 |
| 26 | FRTR 0 3/4 11/25/28 | フランス | 国債証券 | 0.750 | 2028/11/25 | 300,000 | 14,087.00 | 42,261,029 | 14,106.52 | 42,319,578 | 0.47 |
| 27 | T 0 5/8 05/15/30 | アメリカ | 国債証券 | 0.625 | 2030/05/15 | 400,000 | 10,657.44 | 42,629,796 | 10,416.94 | 41,667,788 | 0.46 |
| 28 | DBR 0 1/4 08/15/28 | ドイツ | 国債証券 | 0.250 | 2028/08/15 | 300,000 | 13,926.06 | 41,778,190 | 13,871.02 | 41,613,081 | 0.46 |
| 29 | BTPS 0.85 01/15/27 | イタリア | 国債証券 | 0.850 | 2027/01/15 | 300,000 | 13,436.37 | 40,309,129 | 13,580.88 | 40,742,645 | 0.45 |
| 30 | T 3 1/8 08/15/44 | アメリカ | 国債証券 | 3.125 | 2044/08/15 | 300,000 | 14,217.44 | 42,652,341 | 13,502.34 | 40,507,022 | 0.45 |

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

| 順位 | 銘柄名 | 地域 | 業種 | 種類 | 株式数 | 帳簿価額 | | 評価額 | | 投資比率 (%) |
|----|---------------------|------|--------------------|----|---------|------------|---------------|-------------|---------------|----------|
| | | | | | | 単価(円) | 金額(円) | 単価(円) | 金額(円) | |
| 1 | APPLE INC | アメリカ | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 株式 | 134,413 | 13,096.55 | 1,760,347,782 | 15,946.12 | 2,143,366,311 | 4.29 |
| 2 | MICROSOFT CORP | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 株式 | 57,563 | 24,607.26 | 1,416,467,952 | 31,368.88 | 1,805,687,127 | 3.61 |
| 3 | AMAZON.COM INC | アメリカ | 小売 | 株式 | 3,441 | 347,074.28 | 1,194,282,598 | 394,155.24 | 1,356,288,183 | 2.71 |
| 4 | FACEBOOK INC-A | アメリカ | メディア・娯楽 | 株式 | 19,337 | 31,125.22 | 39,232.45 | 758,638,017 | 1.51 | |
| 5 | ALPHABET INC-CL C | アメリカ | メディア・娯楽 | 株式 | 2,384 | 205,744.88 | 490,495,798 | 298,996.38 | 712,807,386 | 1.42 |
| 6 | ALPHABET INC-CL A | アメリカ | メディア・娯楽 | 株式 | 2,389 | 202,553.23 | 483,899,675 | 297,325.56 | 710,310,785 | 1.42 |
| 7 | TESLA INC | アメリカ | 自動車・自動車部品 | 株式 | 6,231 | 54,250.64 | 338,035,769 | 74,163.05 | 462,109,973 | 0.92 |
| 8 | NVIDIA CORP | アメリカ | 半導体・半導体製造装置 | 株式 | 20,136 | 15,270.50 | 307,486,968 | 21,527.92 | 433,486,273 | 0.86 |
| 9 | JPMORGAN CHASE & CO | アメリカ | 銀行 | 株式 | 24,204 | 13,720.16 | 332,082,970 | 16,751.96 | 405,464,681 | 0.81 |

| | | | | | | | | | | |
|----|-----------------------------|------|------------------------|----|--------|-----------|-------------|-----------|-------------|------|
| 10 | JOHNSON & JOHNSON | アメリカ | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 株式 | 20,691 | 16,508.96 | 341,587,097 | 18,851.98 | 390,066,487 | 0.78 |
| 11 | VISA INC-CLASS A SHARES | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 株式 | 13,373 | 23,528.92 | 314,652,287 | 27,144.76 | 363,006,886 | 0.72 |
| 12 | UNITEDHEALTH GROUP INC | アメリカ | ヘルスケア機器・サービス | 株式 | 7,511 | 39,157.52 | 294,112,144 | 45,118.63 | 338,886,099 | 0.67 |
| 13 | BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | アメリカ | 各種金融 | 株式 | 10,758 | 25,312.33 | 272,310,128 | 30,630.92 | 329,527,463 | 0.66 |
| 14 | NESTLE SA-REGISTERED | スイス | 食品・飲料・タバコ | 株式 | 22,585 | 12,805.12 | 289,203,672 | 13,740.64 | 310,332,467 | 0.62 |
| 15 | HOME DEPOT INC | アメリカ | 小売 | 株式 | 8,541 | 30,381.82 | 259,491,162 | 35,850.31 | 306,197,503 | 0.61 |
| 16 | MASTERCARD INC-CLASS A | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 株式 | 7,101 | 38,050.14 | 270,194,055 | 42,570.80 | 302,295,299 | 0.60 |
| 17 | PROCTER & GAMBLE CO | アメリカ | 家庭用品・パーソナル用品 | 株式 | 19,275 | 15,020.22 | 289,514,841 | 15,271.66 | 294,361,346 | 0.58 |
| 18 | THE WALT DISNEY CO | アメリカ | メディア・娯楽 | 株式 | 14,830 | 16,674.23 | 247,278,926 | 19,527.54 | 289,593,440 | 0.58 |
| 19 | ASML HOLDING NV | オランダ | 半導体・半導体製造装置 | 株式 | 3,442 | 50,879.74 | 175,128,083 | 83,621.69 | 287,825,881 | 0.57 |
| 20 | PAYPAL HOLDINGS INC | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 株式 | 9,114 | 22,166.52 | 202,025,708 | 31,004.28 | 282,573,037 | 0.56 |
| 21 | ADOBE INC | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 株式 | 3,934 | 52,371.49 | 206,029,471 | 68,069.93 | 267,787,116 | 0.53 |
| 22 | BANK OF AMERICA CORP | アメリカ | 銀行 | 株式 | 62,197 | 3,320.74 | 206,540,314 | 4,235.07 | 263,408,847 | 0.52 |
| 23 | ROCHE HOLDING AG-GENUSSS | スイス | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 株式 | 5,784 | 37,657.34 | 217,810,100 | 42,007.45 | 242,971,148 | 0.48 |
| 24 | COMCAST CORP-CL A | アメリカ | メディア・娯楽 | 株式 | 35,872 | 5,367.01 | 192,525,574 | 6,362.46 | 228,234,305 | 0.45 |
| 25 | EXXON MOBIL CORPORATION | アメリカ | エネルギー | 株式 | 34,201 | 4,648.22 | 158,974,095 | 6,452.24 | 220,673,255 | 0.44 |
| 26 | PFIZER INC | アメリカ | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 株式 | 44,552 | 4,076.66 | 181,623,648 | 4,685.07 | 208,729,554 | 0.41 |
| 27 | SALESFORCE.COM INC | アメリカ | ソフトウェア・サービス | 株式 | 7,602 | 27,360.82 | 207,997,018 | 26,719.93 | 203,124,980 | 0.40 |
| 28 | NETFLIX INC | アメリカ | メディア・娯楽 | 株式 | 3,574 | 52,816.88 | 188,767,545 | 56,305.23 | 201,234,900 | 0.40 |
| 29 | COCA-COLA COMPANY | アメリカ | 食品・飲料・タバコ | 株式 | 31,876 | 5,762.75 | 183,693,463 | 6,246.40 | 199,110,389 | 0.39 |
| 30 | CISCO SYSTEMS INC | アメリカ | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 株式 | 32,675 | 4,518.28 | 147,634,874 | 6,029.61 | 197,017,647 | 0.39 |

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 |

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 |

T M A 外国債券インデックスマザーファンド

| 種類 | 投資比率(%) |
|------|---------|
| 国債証券 | 99.03 |
| 合計 | 99.03 |

T M A 外国株式インデックスマザーファンド

| 種類 | 国内/国外 | 業種 | 投資比率(%) |
|----|-------|------------------------|---------|
| 株式 | 国外 | エネルギー | 3.03 |
| | | 素材 | 4.25 |
| | | 資本財 | 6.25 |
| | | 商業・専門サービス | 1.20 |
| | | 運輸 | 1.89 |
| | | 自動車・自動車部品 | 1.90 |
| | | 耐久消費財・アパレル | 2.04 |
| | | 消費者サービス | 1.83 |
| | | メディア・娯楽 | 7.34 |
| | | 小売 | 5.53 |
| | | 食品・生活必需品小売り | 1.31 |
| | | 食品・飲料・タバコ | 3.72 |
| | | 家庭用品・パーソナル用品 | 1.65 |
| | | ヘルスケア機器・サービス | 5.10 |
| | | 医薬品・バイオテクノロジー・ライフサイエンス | 7.44 |

| | | |
|------|--------------------|-------|
| | 銀行 | 5.70 |
| | 各種金融 | 4.60 |
| | 保険 | 2.83 |
| | 不動産 | 0.39 |
| | ソフトウェア・サービス | 12.11 |
| | テクノロジー・ハードウェアおよび機器 | 5.77 |
| | 電気通信サービス | 1.61 |
| | 公益事業 | 2.78 |
| | 半導体・半導体製造装置 | 4.50 |
| 投資証券 | - | 2.22 |
| 合計 | | 97.11 |

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 |

投資不動産物件

TMA日本株TOPIXマザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国株式インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

TMA日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

その他投資資産の主要なもの

TMA日本株TOPIXマザーファンド

| 種類 | 地域 | 取引所 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 (枚) | 帳簿価額 | 評価額(円) | 投資 比率(%) |
|----------|----|-------|----------|-----------|-----------|------------------|---------------|-------------|
| 株価指数先物取引 | 日本 | 大阪取引所 | 東証株価指数先物 | 買建 | 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外国債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

TMA外国株式インデックスマザーファンド

| 種類 | 地域 | 取引所 | 資産名 | 買建/ 売建 | 数量 (枚) | 通貨 | 帳簿価額 | 評価額 | 評価額(円) | 投資 比率(%) |
|----|----|-----|-----|-----------|-----------|----|------|-----|--------|-------------|
|----|----|-----|-----|-----------|-----------|----|------|-----|--------|-------------|

| | | | | | | | | | | |
|--------------|------|----------------------------------|--------------|----|----|------|---------------|---------------|---------------|------|
| 株価指数 先物取引 | アメリカ | Chicago Mercantile Exchange | S&P 500 EMIN | 買建 | 82 | 米ドル | 17,853,280.00 | 18,088,380.00 | 1,980,496,726 | 3.96 |
| | ドイツ | Eurex | DJ EU STX 50 | 買建 | 79 | ユーロ | 3,241,845.00 | 3,248,875.00 | 422,711,126 | 0.84 |
| | イギリス | ICE Futures Europe Financials | FTSE 100 IDX | 買建 | 29 | 英ポンド | 2,033,060.00 | 2,032,175.00 | 310,435,053 | 0.62 |

(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。

T M A 日本債券インデックスマザーファンド
該当事項はありません。

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

| 期 | 年月日 | 純資産総額 (百万円) (分配落) | 純資産総額 (百万円) (分配付) | 1口当たり 純資産額(円) (分配落) | 1口当たり 純資産額(円) (分配付) |
|------------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 第1計算期間末 | (2020年 1月27日) | 4 | 4 | 1.0509 | 1.0509 |
| 第2計算期間末 | (2021年 1月25日) | 153 | 153 | 1.1305 | 1.1305 |
| 2020年 7月末日 | | 50 | | 0.9990 | |
| 8月末日 | | 57 | | 1.0459 | |
| 9月末日 | | 60 | | 1.0380 | |
| 10月末日 | | 76 | | 1.0175 | |
| 11月末日 | | 94 | | 1.0897 | |
| 12月末日 | | 128 | | 1.1103 | |
| 2021年 1月末日 | | 159 | | 1.1171 | |
| 2月末日 | | 196 | | 1.1363 | |
| 3月末日 | | 236 | | 1.1847 | |
| 4月末日 | | 283 | | 1.1922 | |
| 5月末日 | | 333 | | 1.2043 | |
| 6月末日 | | 395 | | 1.2173 | |
| 7月末日 | | 440 | | 1.2171 | |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

| 期 | 年月日 | 純資産総額 (百万円) (分配落) | 純資産総額 (百万円) (分配付) | 1口当たり 純資産額(円) (分配落) | 1口当たり 純資産額(円) (分配付) |
|------------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 第1計算期間末 | (2020年 1月27日) | 2 | 2 | 1.0527 | 1.0527 |
| 第2計算期間末 | (2021年 1月25日) | 51 | 51 | 1.1351 | 1.1351 |
| 2020年 7月末日 | | 13 | | 0.9991 | |
| 8月末日 | | 16 | | 1.0477 | |
| 9月末日 | | 17 | | 1.0395 | |
| 10月末日 | | 25 | | 1.0184 | |
| 11月末日 | | 30 | | 1.0928 | |
| 12月末日 | | 41 | | 1.1142 | |
| 2021年 1月末日 | | 51 | | 1.1213 | |
| 2月末日 | | 59 | | 1.1415 | |
| 3月末日 | | 84 | | 1.1914 | |
| 4月末日 | | 131 | | 1.1991 | |
| 5月末日 | | 151 | | 1.2116 | |
| 6月末日 | | 192 | | 1.2251 | |
| 7月末日 | | 212 | | 1.2247 | |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

| 期 | 年月日 | 純資産総額 (百万円) (分配落) | 純資産総額 (百万円) (分配付) | 1口当たり 純資産額(円) (分配落) | 1口当たり 純資産額(円) (分配付) |
|---------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 第1計算期間末 | (2020年 1月27日) | 1 | 1 | 1.0565 | 1.0565 |

| | | | | | |
|------------|---------------|-----|----|--------|--------|
| 第2計算期間末 | (2021年 1月25日) | 44 | 44 | 1.1445 | 1.1445 |
| 2020年 7月末日 | | 11 | | 0.9992 | |
| 8月末日 | | 13 | | 1.0512 | |
| 9月末日 | | 14 | | 1.0422 | |
| 10月末日 | | 19 | | 1.0200 | |
| 11月末日 | | 28 | | 1.0991 | |
| 12月末日 | | 36 | | 1.1219 | |
| 2021年 1月末日 | | 45 | | 1.1296 | |
| 2月末日 | | 56 | | 1.1519 | |
| 3月末日 | | 66 | | 1.2048 | |
| 4月末日 | | 77 | | 1.2130 | |
| 5月末日 | | 92 | | 1.2260 | |
| 6月末日 | | 117 | | 1.2401 | |
| 7月末日 | | 134 | | 1.2395 | |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

| 期 | 年月日 | 純資産総額 (百万円) (分配落) | 純資産総額 (百万円) (分配付) | 1口当たり 純資産額(円) (分配落) | 1口当たり 純資産額(円) (分配付) |
|------------|---------------|-------------------------|-------------------------|---------------------------|---------------------------|
| 第1計算期間末 | (2020年 1月27日) | 1 | 1 | 1.0584 | 1.0584 |
| 第2計算期間末 | (2021年 1月25日) | 79 | 79 | 1.1490 | 1.1490 |
| 2020年 7月末日 | | 16 | | 0.9992 | |
| 8月末日 | | 18 | | 1.0528 | |
| 9月末日 | | 18 | | 1.0435 | |
| 10月末日 | | 42 | | 1.0206 | |
| 11月末日 | | 56 | | 1.1021 | |
| 12月末日 | | 65 | | 1.1256 | |
| 2021年 1月末日 | | 82 | | 1.1337 | |
| 2月末日 | | 99 | | 1.1570 | |
| 3月末日 | | 137 | | 1.2114 | |
| 4月末日 | | 175 | | 1.2197 | |
| 5月末日 | | 200 | | 1.2335 | |
| 6月末日 | | 258 | | 1.2485 | |
| 7月末日 | | 296 | | 1.2475 | |

【分配の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055
該当事項はありません。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065
該当事項はありません。

【収益率の推移】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

| 期 | 計算期間 | 収益率（％）（分配付） |
|----------|-------------------------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 5.1 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 7.6 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 6.9 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

| 期 | 計算期間 | 収益率（％）（分配付） |
|----------|-------------------------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 5.3 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 7.8 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 7.1 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

| 期 | 計算期間 | 収益率（％）（分配付） |
|----------|-------------------------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 5.7 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 8.3 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 7.5 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

| 期 | 計算期間 | 収益率（％）（分配付） |
|----------|-------------------------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 5.8 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 8.6 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 7.7 |

(4)【設定及び解約の実績】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

| 期 | 計算期間 | 設定口数(口) | 解約口数(口) | 発行済み口数(口) |
|----------|-------------------------|-------------|------------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 4,514,529 | | 4,514,529 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 147,556,612 | 16,408,441 | 135,662,700 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 245,967,893 | 24,323,367 | 357,307,226 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

| 期 | 計算期間 | 設定口数(口) | 解約口数(口) | 発行済み口数(口) |
|----------|-------------------------|-------------|-----------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 2,051,072 | | 2,051,072 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 47,146,627 | 3,465,092 | 45,732,607 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 132,932,208 | 9,384,723 | 169,280,092 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

| 期 | 計算期間 | 設定口数(口) | 解約口数(口) | 発行済み口数(口) |
|----------|-------------------------|------------|-----------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 1,075,709 | | 1,075,709 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 42,994,246 | 5,274,240 | 38,795,715 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 71,112,806 | 6,866,164 | 103,042,357 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

| 期 | 計算期間 | 設定口数(口) | 解約口数(口) | 発行済み口数(口) |
|----------|-------------------------|-------------|------------|-------------|
| 第1計算期間 | 2019年 9月20日～2020年 1月27日 | 1,503,582 | | 1,503,582 |
| 第2計算期間 | 2020年 1月28日～2021年 1月25日 | 88,824,986 | 20,986,846 | 69,341,722 |
| 第3中間計算期間 | 2021年 1月26日～2021年 7月25日 | 211,033,933 | 49,525,142 | 230,850,513 |

< 参考情報 >

基準価額・純資産の推移

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



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

基準日: 2021年7月30日

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

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

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



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

(1万口当たり、税引前)

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

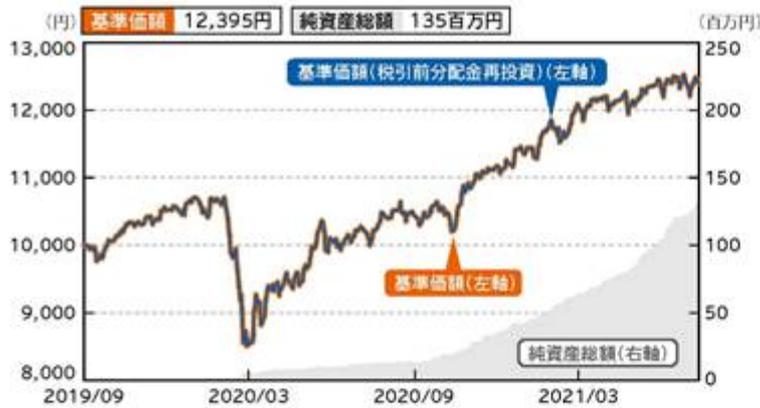
※分配金額は、収益分配方針に基づいて委託会社が決定します。分配対象額が少額の場合等には、分配を行わないことがあります。

次ページへ続く

- ・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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



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

(1万口当たり、税引前)

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

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

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



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

(1万口当たり、税引前)

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

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

次ページへ続く

- ・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

主要な資産の状況

資産構成

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

| ファンド名 | 組入比率 | 基本資産配分 | 差 |
|----------------------|-------|--------|-------|
| TMA日本株TOPIXマザーファンド | 30.3% | 31.0% | -0.7% |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 28.1% | 28.0% | +0.1% |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 31.5% | 31.0% | +0.5% |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 10.1% | 10.0% | +0.1% |
| 短期金融資産等 | 0.0% | - | +0.0% |

※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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

| ファンド名 | 組入比率 | 基本資産配分 | 差 |
|----------------------|-------|--------|-------|
| TMA日本株TOPIXマザーファンド | 31.3% | 32.0% | -0.7% |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 26.1% | 26.0% | +0.1% |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 32.5% | 32.0% | +0.5% |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 10.1% | 10.0% | +0.1% |
| 短期金融資産等 | -0.0% | - | -0.0% |

※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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

| ファンド名 | 組入比率 | 基本資産配分 | 差 |
|----------------------|-------|--------|-------|
| TMA日本株TOPIXマザーファンド | 32.3% | 33.0% | -0.7% |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 24.1% | 24.0% | +0.1% |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 33.5% | 33.0% | +0.5% |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 10.1% | 10.0% | +0.1% |
| 短期金融資産等 | 0.0% | - | +0.0% |

※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。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

| ファンド名 | 組入比率 | 基本資産配分 | 差 |
|----------------------|-------|--------|-------|
| TMA日本株TOPIXマザーファンド | 34.3% | 35.0% | -0.7% |
| TMA日本債券インデックスマザーファンド | 20.1% | 20.0% | +0.1% |
| TMA外国株式インデックスマザーファンド | 35.5% | 35.0% | +0.5% |
| TMA外国債券インデックスマザーファンド | 10.1% | 10.0% | +0.1% |
| 短期金融資産等 | 0.0% | - | +0.0% |

※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。

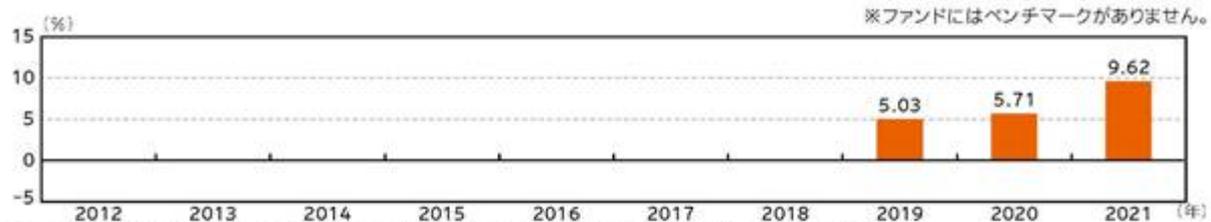
次ページへ続く

- ・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

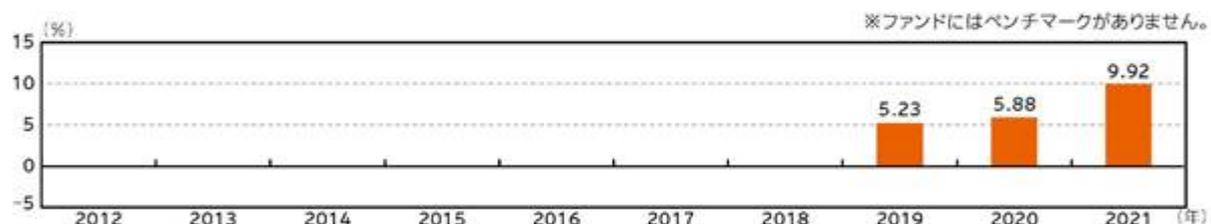
年間収益率の推移

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035



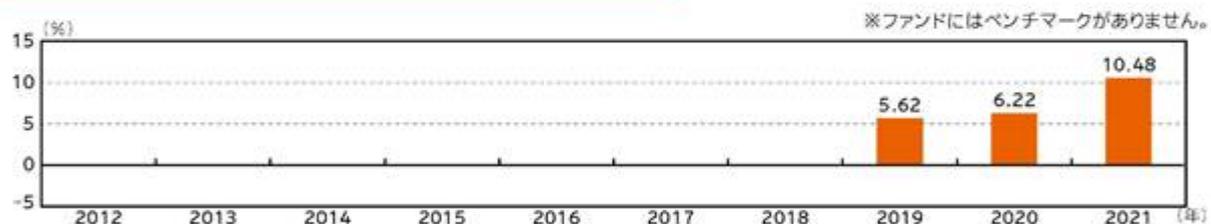
※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したのものと計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045



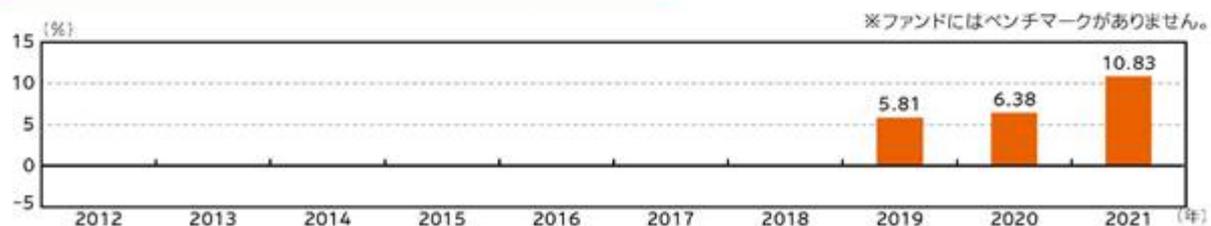
※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したのものと計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したのものと計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したのものと計算しており、設定日以降を表示しています。
※設定年は設定時と年末の騰落率です。当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- a. 毎営業日にお申込みを受け付けます。ただし、お申込み日が以下の日のいずれかに該当する場合には、取得のお申込みの受付を行いません。
- ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 - ・ロンドン証券取引所の休業日
 - ・フランクフルト証券取引所の休業日
- b. 申込方法には、収益分配金の受取方法によって、以下の2種類のコースがあります。

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

- c. 販売会社やお申込みのコース等によって申込単位は異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。なお、分配金再投資コースにおける収益分配金の再投資に際しては、1口単位で取得することができます。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。
- e. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。
取得申込受付日の翌営業日の基準価額
基準価額は信託設定日以降、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（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（本書において、同じ。）。）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。受託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつと、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。ただし、解約請求日が以下の日のいずれかに該当する場合には、お申込みの受付を行いません。
 - ・ニューヨーク証券取引所の休業日
 - ・ロンドン証券取引所の休業日
 - ・フランクフルト証券取引所の休業日
- 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、解約請求受付日の翌営業日の基準価額とします。
 - 信託財産留保額はありませぬ。
 - 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 |
| 先物取引 | 国内取引所に上場されているものは、当該取引所が発表する計算日の清算値段または証拠金算定基準値段で評価します。 海外取引所に上場されているものは、当該海外取引所が発表する計算日に知りうる直近の日の清算価格または最終相場で評価するものとします。 |

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

(2)【保管】

該当事項はありません。

(3)【信託期間】

原則として、2019年9月20日から無期限とします。ただし、後記「(5)その他 信託の終了（繰上償還）」に該当する場合には、信託を終了させることがあります。

(4)【計算期間】

原則として、毎年1月26日から翌年1月25日までとします。ただし、各計算期間の末日が休業日のときはその翌営業日（ ）を計算期間の末日とし、その翌日より次の計算期間が開始するものとします。

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

(5)【その他】

信託の終了（繰上償還）

- a. 委託会社は、信託期間中において、信託契約の一部を解約することにより受益権の総口数が10億口を下ることとなったとき、信託契約を解約することが受益者のため有利であると認めるとき、またはやむを得ない事情が発生したときは、受託会社と合意のうえ、信託契約を解約し、信託を終了させることができます。この場合において、委託会社は、あらかじめ、解約しようとする旨を監督官庁に届け出ます。
- b. 委託会社は、上記a.の事項について、書面による決議（以下「書面決議」といいます。）を行います。この場合において、あらかじめ、書面決議の日ならびに信託契約の解約の理由などの事項を定め、当該決議の日の2週間前までに、信託契約にかかる知れている受益者に対し、書面をもってこれらの事項を記載した書面決議の通知を発送します。
- c. 上記b.の書面決議において、受益者（委託会社および信託の信託財産に信託の受益権が属するときの当該受益権にかかる受益者としての受託会社を除きます。以下c.において同じ。）は受益権の口数に応じて、議決権を有し、これを行使することができます。なお、知れている受益者が議決権を行使しないときは、当該知れている受益者は書面決議について賛成するものとみなします。

- d. 上記b.の書面決議は議決権を行使することができる受益者の議決権の3分の2以上に当たる多数をもって行います。
- e. 上記b.からd.までの規定は、委託会社が信託契約の解約について提案をした場合において、当該提案につき、信託契約にかかるすべての受益者が書面または電磁的記録により同意の意思表示をしたときには適用しません。また、信託財産の状態に照らし、真にやむを得ない事情が生じている場合であって、上記b.からd.までの手続きを行うことが困難な場合も同様とします。
- f. 委託会社が監督官庁より登録の取消を受けたとき、解散したときまたは業務を廃止したときは、委託会社は、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- g. 上記f.の規定にかかわらず、監督官庁が信託契約に関する委託会社の業務を他の投資信託委託会社に引継ぐことを命じたときは、信託は、「信託約款の変更」b.の書面決議で否決された場合を除き、当該投資信託委託会社と受託会社との間において存続します。
- h. 受託会社は、委託会社の承諾を受けてその任務を辞任することができます。受託会社はその任務に違反して信託財産に著しい損害を与えたことその他重要な事由があるときは、委託会社または受益者は、裁判所に受託会社の解任を申立てることができます。受託会社が辞任した場合、または裁判所が受託会社を解任した場合、委託会社は、「信託約款の変更」の規定にしたがい、新受託会社を選任します。なお、受益者は、上記によって行う場合を除き、受託会社を解任することはできないものとします。
- i. 委託会社が新受託会社を選任できないときは、委託会社は信託契約を解約し、信託を終了させます。

信託約款の変更

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

関係会社との契約の更改等

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

運用報告書

- a. 毎決算時および償還時に、委託会社が、期間中の運用経過のほか、信託財産の内容などを記載した交付運用報告書を作成します。交付運用報告書は、知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)の交付の請求があつた場合は、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2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】

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2期 [2021年 1月25日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 4,744,312 | 153,355,223 |
| 未収入金 | 1,123 | 252,426 |
| 流動資産合計 | 4,745,435 | 153,607,649 |
| 資産合計 | 4,745,435 | 153,607,649 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | - | 110,252 |
| 未払受託者報酬 | 116 | 9,370 |
| 未払委託者報酬 | 1,131 | 121,714 |
| その他未払費用 | 4 | 4,596 |
| 流動負債合計 | 1,251 | 245,932 |
| 負債合計 | 1,251 | 245,932 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 4,514,529 | 1 135,662,700 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 229,655 | 17,699,017 |
| （分配準備積立金） | 16,526 | 10,472,541 |
| 元本等合計 | 4,744,184 | 153,361,717 |
| 純資産合計 | 4,744,184 | 153,361,717 |
| 負債純資産合計 | 4,745,435 | 153,607,649 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日 |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 17,785 | 11,024,009 |
| 営業収益合計 | 17,785 | 11,024,009 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 8 | - |
| 受託者報酬 | 116 | 11,362 |
| 委託者報酬 | 1,131 | 147,528 |
| その他費用 | 4 | 5,504 |
| 営業費用合計 | 1,259 | 164,394 |
| 営業利益又は営業損失() | 16,526 | 10,859,615 |
| 経常利益又は経常損失() | 16,526 | 10,859,615 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 16,526 | 10,859,615 |
| 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() | - | 397,207 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | - | 229,655 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 213,129 | 7,206,087 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 213,129 | 7,206,087 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 199,133 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 199,133 |
| 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() | 229,655 | 17,699,017 |

(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2期 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 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準 価額に基づいて評価しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2期 [2021年 1月25日現在] |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 1,000,000円 | 4,514,529円 |
| 期中追加設定元本額 | 3,514,529円 | 147,556,612円 |
| 期中一部解約元本額 | 円 | 16,408,441円 |
| 2. 1 計算期間末日における受益権の総数 | 4,514,529口 | 135,662,700口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日 |
|---|---|
| 1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(8,615円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(7,911円)、投資信託約款に規定される収益調整金(213,129円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は229,655円(1万口当たり508.69円)であります。分配を行っておりません。 | 1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(698,999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(9,763,409円)、投資信託約款に規定される収益調整金(7,226,476円)及び分配準備積立金(10,133円)より、分配対象額は17,699,017円(1万口当たり1,304.60円)であります。分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 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 | <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 | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2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 | <p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

第1期（自 2019年9月20日 至 2020年1月27日）

売買目的有価証券

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 16,716円 |

| | |
|----|---------|
| 合計 | 16,716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2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 | 10,307,618円 |
| 合計 | 10,307,618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1期 [2020年 1月27日現在] | 第2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) | 1.0509円 10,509円) |
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1305円 11,305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 | 30,374,294 | 48,155,405 | |
| | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 8,924,996 | 14,947,583 | |
| | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 15,384,415 | 48,154,757 | |
| | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 32,515,238 | 42,097,478 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 87,198,943 | 153,355,223 | |
| 合計 | | 87,198,943 | 153,355,223 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2期 [2021年 1月25日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 2,159,142 | 51,909,763 |
| 未収入金 | 1,148 | 165,332 |
| 流動資産合計 | 2,160,290 | 52,075,095 |
| 資産合計 | 2,160,290 | 52,075,095 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | - | 119,618 |
| 未払受託者報酬 | 107 | 2,930 |
| 未払委託者報酬 | 1,019 | 38,154 |
| その他未払費用 | - | 1,382 |
| 流動負債合計 | 1,126 | 162,084 |
| 負債合計 | 1,126 | 162,084 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 2,051,072 | 1 45,732,607 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 108,092 | 6,180,404 |
| （分配準備積立金） | 41,176 | 3,415,517 |
| 元本等合計 | 2,159,164 | 51,913,011 |
| 純資産合計 | 2,159,164 | 51,913,011 |
| 負債純資産合計 | 2,160,290 | 52,075,095 |

(2) 【損益及び剰余金計算書】

(単位：円)

| | 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日 |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 42,310 | 3,620,559 |
| 営業収益合計 | 42,310 | 3,620,559 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 8 | - |
| 受託者報酬 | 107 | 3,658 |
| 委託者報酬 | 1,019 | 47,673 |
| その他費用 | - | 1,636 |
| 営業費用合計 | 1,134 | 52,967 |
| 営業利益又は営業損失（ ） | 41,176 | 3,567,592 |
| 経常利益又は経常損失（ ） | 41,176 | 3,567,592 |
| 当期純利益又は当期純損失（ ） | 41,176 | 3,567,592 |
| 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（ ） | - | 187,862 |
| 期首剰余金又は期首欠損金（ ） | - | 108,092 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 66,916 | 2,785,088 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 66,916 | 2,785,088 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 92,506 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 92,506 |
| 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（ ） | 108,092 | 6,180,404 |

(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2期 | |
|-----------------|---|--|
| | 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 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準 価額に基づいて評価しております。 | |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 第1期 | 第2期 |
|-----------------------|-----------------|-----------------|
| | [2020年 1月27日現在] | [2021年 1月25日現在] |
| 1. 1 期首元本額 | 1,000,000円 | 2,051,072円 |
| 期中追加設定元本額 | 1,051,072円 | 47,146,627円 |
| 期中一部解約元本額 | 円 | 3,465,092円 |
| 2. 1 計算期間末日における受益権の総数 | 2,051,072口 | 45,732,607口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第1期 | 第2期 |
|--|---|
| 自 2019年 9月20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(7,641円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(33,535円)、投資信託約款に規定される収益調整金(66,916円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は108,092円(1万口当たり526.98円)ですが、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(239,132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(3,140,598円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,764,887円)及び分配準備積立金(35,787円)より、分配対象額は6,180,404円(1万口当たり1,351.40円)ですが、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1期 | 第2期 |
|-------------------|---|--------------------------------|
| | 自 2019年 9月20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 |

| | | |
|--------------------------|---|-----------|
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <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> | <p>同左</p> |
|--------------------------|---|-----------|

・金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2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 | <p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <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。</p> <p>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。</p> | <p>同左</p> |

（有価証券に関する注記）

第1期（自 2019年9月20日 至 2020年1月27日）

売買目的有価証券

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 41,143円 |

| | |
|----|---------|
| 合計 | 41,143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2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 | 3,339,637円 |
| 合計 | 3,339,637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1期 [2020年 1月27日現在] | 第2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) | 1.0527円 10,527円) |
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1351円 11,351円) |

(4)【附属明細表】

第1 有価証券明細表

(1)株式

該当事項はありません。

(2)株式以外の有価証券

(単位：円)

| 種 類 | 銘 柄 | 券面総額 | 評価額 | 備 考 |
|---------------|----------------------|------------|------------|-----|
| 親投資信託 受益証券 | TMA日本株TOPIXマザーファンド | 10,606,283 | 16,815,201 | |
| | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 3,019,097 | 5,056,383 | |
| | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 5,372,042 | 16,815,028 | |
| | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 10,213,294 | 13,223,151 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 29,210,716 | 51,909,763 | |
| 合計 | | 29,210,716 | 51,909,763 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2期 [2021年 1月25日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 1,136,399 | 44,397,345 |
| 未収入金 | 1,137 | 112,450 |
| 流動資産合計 | 1,137,536 | 44,509,795 |
| 資産合計 | 1,137,536 | 44,509,795 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | - | 73,727 |
| 未払受託者報酬 | 105 | 2,491 |
| 未払委託者報酬 | 979 | 32,316 |
| その他未払費用 | - | 1,141 |
| 流動負債合計 | 1,084 | 109,675 |
| 負債合計 | 1,084 | 109,675 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,107,709 | 1,387,957,715 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 60,743 | 5,604,405 |
| （分配準備積立金） | 55,751 | 3,365,099 |
| 元本等合計 | 1,136,452 | 44,400,120 |
| 純資産合計 | 1,136,452 | 44,400,120 |
| 負債純資産合計 | 1,137,536 | 44,509,795 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日 |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 56,843 | 3,704,226 |
| 営業収益合計 | 56,843 | 3,704,226 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 8 | - |
| 受託者報酬 | 105 | 3,224 |
| 委託者報酬 | 979 | 41,786 |
| その他費用 | - | 1,413 |
| 営業費用合計 | 1,092 | 46,423 |
| 営業利益又は営業損失() | 55,751 | 3,657,803 |
| 経常利益又は経常損失() | 55,751 | 3,657,803 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 55,751 | 3,657,803 |
| 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() | - | 331,277 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | - | 60,743 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,992 | 2,226,461 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 4,992 | 2,226,461 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 9,325 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 9,325 |
| 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() | 60,743 | 5,604,405 |

(3) 【注記表】

(重要な会計方針に係る事項に関する注記)

| 区 分 | 第2期 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 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準 価額に基づいて評価しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2期 [2021年 1月25日現在] |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 1,000,000円 | 1,075,709円 |
| 期中追加設定元本額 | 75,709円 | 42,994,246円 |
| 期中一部解約元本額 | 円 | 5,274,240円 |
| 2. 1 計算期間末日における受益権の総数 | 1,075,709口 | 38,795,715口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日 |
|---|--|
| 1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,356円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(48,395円)、投資信託約款に規定される収益調整金(4,992円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は60,743円(1万口当たり564.65円)であります。分配を行っておりません。 | 1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(215,741円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(3,110,785円)、投資信託約款に規定される収益調整金(2,239,306円)及び分配準備積立金(38,573円)より、分配対象額は5,604,405円(1万口当たり1,444.56円)であります。分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 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 | <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 | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2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 | <p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <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。</p> <p>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。</p> | 同左 |

(有価証券に関する注記)

第1期（自 2019年9月20日 至 2020年1月27日）

売買目的有価証券

| 種 類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 55,688円 |

| | |
|----|---------|
| 合計 | 55,688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2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 | 3,263,048円 |
| 合計 | 3,263,048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1期 [2020年 1月27日現在] | 第2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) | 1.0565円 10,565円) |
| 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.1445円 11,445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 | 9,625,843 | 15,260,811 | |
| | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 2,578,756 | 4,318,900 | |
| | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 4,875,425 | 15,260,567 | |
| | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 7,381,685 | 9,557,067 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 24,461,709 | 44,397,345 | |
| 合計 | | 24,461,709 | 44,397,345 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065】

(1) 【貸借対照表】

(単位：円)

| | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2期 [2021年 1月25日現在] |
|-----------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 親投資信託受益証券 | 1,591,320 | 79,672,088 |
| 未収入金 | 1,126 | 143,577 |
| 流動資産合計 | 1,592,446 | 79,815,665 |
| 資産合計 | 1,592,446 | 79,815,665 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | - | 76,419 |
| 未払受託者報酬 | 106 | 4,427 |
| 未払委託者報酬 | 993 | 57,458 |
| その他未払費用 | - | 2,115 |
| 流動負債合計 | 1,099 | 140,419 |
| 負債合計 | 1,099 | 140,419 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1,503,582 | 1,69,341,722 |
| 剰余金 | | |
| 期末剰余金又は期末欠損金（ ） | 87,765 | 10,333,524 |
| （分配準備積立金） | 51,660 | 5,161,118 |
| 元本等合計 | 1,591,347 | 79,675,246 |
| 純資産合計 | 1,591,347 | 79,675,246 |
| 負債純資産合計 | 1,592,446 | 79,815,665 |

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

| | 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日 |
|---|---------------------------------------|---------------------------------------|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 52,767 | 6,115,113 |
| 営業収益合計 | 52,767 | 6,115,113 |
| 営業費用 | | |
| 支払利息 | 8 | - |
| 受託者報酬 | 106 | 5,478 |
| 委託者報酬 | 993 | 71,067 |
| その他費用 | - | 2,529 |
| 営業費用合計 | 1,107 | 79,074 |
| 営業利益又は営業損失() | 51,660 | 6,036,039 |
| 経常利益又は経常損失() | 51,660 | 6,036,039 |
| 当期純利益又は当期純損失() | 51,660 | 6,036,039 |
| 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() | - | 901,218 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | - | 87,765 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 36,105 | 6,014,020 |
| 当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | - |
| 当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 36,105 | 6,014,020 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 903,082 |
| 当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 903,082 |
| 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() | 87,765 | 10,333,524 |

(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2期 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 | 親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。 時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準 価額に基づいて評価しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2期 [2021年 1月25日現在] |
|-----------------------|------------------------|------------------------|
| 1. 1 期首元本額 | 1,000,000円 | 1,503,582円 |
| 期中追加設定元本額 | 503,582円 | 88,824,986円 |
| 期中一部解約元本額 | 円 | 20,986,846円 |
| 2. 1 計算期間末日における受益権の総数 | 1,503,582口 | 69,341,722口 |

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

| 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 自 2020年 1月28日 至 2021年 1月25日 |
|--|---|
| 1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(7,735円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(43,925円)、投資信託約款に規定される収益調整金(36,105円)及び分配準備積立金(0円)より、分配対象額は87,765円(1万口当たり583.68円)であります。分配を行っておりません。 | 1 分配金の計算過程 計算期間末における解約に伴う当期純利益金額分配後の配当等収益から費用を控除した額(346,228円)、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額(4,788,593円)、投資信託約款に規定される収益調整金(5,172,406円)及び分配準備積立金(26,297円)より、分配対象額は10,333,524円(1万口当たり1,490.20円)であります。分配を行っておりません。 |

(金融商品に関する注記)

・金融商品の状況に関する事項

| 区 分 | 第1期 自 2019年 9月20日 至 2020年 1月27日 | 第2期 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 | <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 | 第1期 [2020年 1月27日現在] | 第2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 | <p>(1)有価証券 (重要な会計方針に係る事項に関する注記)に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 該当事項はありません。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p> | <p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p> |
| 3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明 | 金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。 | 同左 |

(有価証券に関する注記)

第1期(自 2019年9月20日 至 2020年1月27日)

売買目的有価証券

| 種類 | 当計算期間の損益に含まれた評価差額 |
|-----------|-------------------|
| 親投資信託受益証券 | 51,669円 |

| | |
|----|---------|
| 合計 | 51,669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2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 | 5,092,164円 |
| 合計 | 5,092,164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1期 [2020年 1月27日現在] | | 第2期 [2021年 1月25日現在] | |
|------------------------|----------|------------------------|----------|
| 1口当たり純資産額 | 1.0584円 | 1口当たり純資産額 | 1.1490円 |
| (1万口当たり純資産額) | 10,584円) | (1万口当たり純資産額) | 11,490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 | 17,770,539 | 28,173,412 | |
| | TMA外国債券インデックスマザーファンド | 4,624,808 | 7,745,628 | |
| | TMA外国株式インデックスマザーファンド | 9,000,136 | 28,171,325 | |
| | TMA日本債券インデックスマザーファンド | 12,035,007 | 15,581,723 | |
| 親投資信託受益証券 合計 | | 43,430,490 | 79,672,088 | |
| 合計 | | 43,430,490 | 79,672,088 | |

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(ご参考)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065は、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」を主要な投資対象としており、貸借対照表の資産の部に計上された「親投資信託受益証券」はすべて同ファンドの受益証券です。なお、同ファンドの状況は次のとおりです。

なお、以下に記載した情報は監査の対象ではありません。

「TMA日本株TOPIXマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 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 | | 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 |
| 6資産合計 | | 31,135,472,743 | 36,840,226,901 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 10,385,800 | |
| 前受金 | | 3,365,000 | 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 |
| 純資産の部 | | | |
| 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 | 27,141,098,926円 | 21,904,463,467円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,882,766,278円 | 14,089,938,434円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 7,119,401,737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 |

| | | |
|--|--|--|
| TMA日本株式インデックスVA <適格機関投資家限定> | 314,584,425円 | 486,249,709円 |
| TMA世界バランスファンド35VA <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・TOPIX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 9月20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 |

| | | |
|--------------------------|---|-----------|
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <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> | <p>同左</p> |
|--------------------------|---|-----------|

・ 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | [2020年 1月27日現在] | [2021年 1月25日現在] |
|--|---|--|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額</p> | <p>時価で計上しているため、その差額はありません。</p> | <p>同左</p> |
| <p>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> | <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9月20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 1年超 | 時 価 | 評価損益 |
|------|----------------|-------------|-----------|-------------|-----------|
| 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 |
| KYB | 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 |
| SUBARU | 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 |
| HOYA | 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外国債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 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 | | | |
| 預金 | | 25,547,929 | 57,136,610 |
| コール・ローン | | 95,927,941 | 23,741,347 |
| 国債証券 | | 4,915,441,149 | 7,306,175,386 |
| 未収利息 | | 37,622,147 | 44,612,459 |
| 前払費用 | | 3,400,092 | 2,144,783 |
| 流動資産合計 | | 5,077,939,258 | 7,433,810,585 |
| 資産合計 | | 5,077,939,258 | 7,433,810,585 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 513,220 | |
| 未払金 | | 59,651,438 | 33,863,397 |
| 未払解約金 | | 18,442,850 | 9,137,293 |
| 未払利息 | | 55 | 13 |
| 流動負債合計 | | 78,607,563 | 43,000,703 |
| 負債合計 | | 78,607,563 | 43,000,703 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 3,109,800,387 | 4,412,965,149 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 1,889,531,308 | 2,977,844,733 |
| 元本等合計 | | 4,999,331,695 | 7,390,809,882 |
| 純資産合計 | | 4,999,331,695 | 7,390,809,882 |
| 負債純資産合計 | | 5,077,939,258 | 7,433,810,585 |

(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 | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | [2020年 1月27日現在] | [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 | 2,752,492,127円 | 3,109,800,387円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 583,078,394円 | 2,186,532,672円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 225,770,134円 | 883,367,910円 |
| 同期末における元本額 | 3,109,800,387円 | 4,412,965,149円 |
| 元本の内訳* | | |
| L P S 4 資産分散ファンド（慎重型） | 5,695,625円 | 6,827,561円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（安定重視型） | 8,715,106円 | 9,005,984円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（バランス型） | 22,441,016円 | 27,649,249円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（成長重視型） | 22,030,245円 | 24,263,464円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（積極型） | 13,699,334円 | 14,661,934円 |
| 東京海上セレクション・外国債券 インデックス | 2,339,794,480円 | 3,071,524,638円 |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド （年1回決算型） | 59,042,771円 | 124,630,973円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035 | 295,108円 | 8,924,996円 |

| | | |
|--|----------------|----------------|
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045 | 134,332円 | 3,019,097円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055 | 70,722円 | 2,578,756円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065 | 99,031円 | 4,624,808円 |
| TMA外国債券インデックスVA <適格機関投資家限定> | 137,028,556円 | 112,726,445円 |
| TMA世界バランスファンド35VA <適格機関投資家限定> | 8,847,149円 | 円 |
| 東京海上・世界インデックス・バランス40 <適格機関投資家限定> | 109,444,107円 | 230,644,001円 |
| 東京海上・世界インデックス・バランス60 <適格機関投資家限定> | 382,462,805円 | 771,883,243円 |
| 計 | 3,109,800,387円 | 4,412,965,149円 |
| 2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間 末日における当該親投資信託の受益権の総 数 | 3,109,800,387口 | 4,412,965,149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 9月20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、為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |

| | | |
|--------------------------|---|-----------|
| <p>3. 金融商品に係るリスク管理体制</p> | <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> | <p>同左</p> |
|--------------------------|---|-----------|

・ 金融商品の時価等に関する事項

| 区 分 | [2020年 1月27日現在] | [2021年 1月25日現在] |
|--|---|--|
| <p>1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額</p> | <p>時価で計上しているため、その差額はありません。</p> | <p>同左</p> |
| <p>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> | <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9月20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 | 48,716,179円 |
| 合計 | 48,716,179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 | 32,223,397円 |
| 合計 | 32,223,397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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(2020年1月27日現在)

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | うち 1年超 | 時 価 | 評価損益 |
|---------------|--------|------------|-----------|------------|---------|
| | | | | | |
| 市場取引 以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 61,241,220 | | 60,728,000 | 513,220 |
| | 米ドル | 21,907,930 | | 21,810,000 | 97,930 |
| | ユーロ | 24,280,290 | | 24,060,000 | 220,290 |
| | 豪ドル | 15,053,000 | | 14,858,000 | 195,000 |

| | | | |
|----|------------|------------|---------|
| 合計 | 61,241,220 | 60,728,000 | 513,220 |
|----|------------|------------|---------|

(注)1.時価の算定方法

- (1)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されている外貨については、以下のように評価しております。
- 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されている場合は、当該為替予約は当該仲値で評価しております。
- 同計算期間末日において為替予約の受渡日の対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない場合は、以下の方法によっております。
- ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されている場合には、発表されている先物相場のうち当該日に最も近い前後二つの対顧客先物売買相場の仲値をもとに計算しております。
 - ・同計算期間末日に為替予約の受渡日を超える対顧客先物売買相場が発表されていない場合には、当該日に最も近い発表されている対顧客先物売買相場の仲値を用いております。
- (2)本書における開示対象ファンドの計算期間末日に対顧客先物売買相場の仲値が発表されていない外貨については同計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で評価しております。
- 2.換算において円未満の端数は切り捨てております。
- 3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2021年1月25日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| [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 | 1.6076円 | 1口当たり純資産額 | 1.6748円 |
| (1万口当たり純資産額 | 16,076円) | (1万口当たり純資産額 | 16,748円) |

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1) 株式

該当事項はありません。

(2) 株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|------------------|---------|------------------|---------|------------|----|
| 国債証券 | 米ドル | | | 米ドル | |
| | | T 0 1/2 04/30/27 | 100,000 | 99,062.50 | |
| | | T 0 1/2 05/31/27 | 200,000 | 197,921.87 | |
| | | T 0 1/2 06/30/27 | 100,000 | 98,851.56 | |
| | | T 0 1/2 08/31/27 | 200,000 | 197,312.50 | |
| | | T 0 1/2 10/31/27 | 100,000 | 98,429.68 | |
| | | T 0 1/4 04/15/23 | 100,000 | 100,250.00 | |
| | | T 0 1/4 05/31/25 | 200,000 | 199,031.25 | |
| | | T 0 1/4 06/15/23 | 300,000 | 300,750.00 | |
| | | T 0 1/4 06/30/25 | 300,000 | 298,406.25 | |
| | | T 0 1/4 07/31/25 | 100,000 | 99,390.62 | |
| | | T 0 1/4 08/31/25 | 300,000 | 298,007.80 | |
| | | T 0 1/4 09/30/25 | 200,000 | 198,531.24 | |
| | | T 0 1/4 10/31/25 | 100,000 | 99,195.31 | |
| | | T 0 1/8 04/30/22 | 100,000 | 100,007.81 | |
| | | T 0 1/8 05/15/23 | 200,000 | 199,890.62 | |
| | | T 0 1/8 05/31/22 | 100,000 | 100,007.81 | |
| T 0 1/8 06/30/22 | 200,000 | 200,000.00 | | | |

| | | | |
|------------------|---------|------------|--|
| T 0 1/8 07/15/23 | 200,000 | 199,875.00 | |
| T 0 1/8 07/31/22 | 300,000 | 300,023.43 | |
| T 0 1/8 08/15/23 | 100,000 | 99,921.87 | |
| T 0 1/8 09/15/23 | 100,000 | 99,906.25 | |
| T 0 1/8 09/30/22 | 400,000 | 399,968.73 | |
| T 0 1/8 10/15/23 | 300,000 | 299,671.87 | |
| T 0 1/8 12/15/23 | 500,000 | 499,257.80 | |
| T 0 3/8 03/31/22 | 300,000 | 300,820.31 | |
| T 0 3/8 04/30/25 | 100,000 | 100,109.37 | |
| T 0 3/8 07/31/27 | 200,000 | 195,890.62 | |
| T 0 3/8 09/30/27 | 200,000 | 195,468.74 | |
| T 0 5/8 05/15/30 | 400,000 | 384,750.00 | |
| T 0 5/8 08/15/30 | 200,000 | 191,765.62 | |
| T 0 5/8 11/30/27 | 300,000 | 297,468.75 | |
| T 1 1/2 01/31/27 | 200,000 | 210,484.37 | |
| T 1 1/2 02/15/30 | 500,000 | 520,820.30 | |
| T 1 1/2 02/28/23 | 100,000 | 102,828.12 | |
| T 1 1/2 03/31/23 | 100,000 | 102,937.50 | |
| T 1 1/2 09/15/22 | 400,000 | 408,968.74 | |
| T 1 1/2 09/30/24 | 100,000 | 104,500.00 | |
| T 1 1/2 10/31/24 | 300,000 | 313,687.50 | |
| T 1 1/2 11/30/24 | 200,000 | 209,187.50 | |
| T 1 1/4 05/15/50 | 200,000 | 172,218.75 | |
| T 1 1/4 07/31/23 | 100,000 | 102,757.81 | |
| T 1 1/4 08/31/24 | 100,000 | 103,539.06 | |
| T 1 1/8 02/28/22 | 100,000 | 101,101.56 | |
| T 1 1/8 02/28/25 | 300,000 | 309,750.00 | |
| T 1 1/8 05/15/40 | 100,000 | 91,359.37 | |
| T 1 3/4 01/31/23 | 300,000 | 309,726.56 | |
| T 1 3/4 02/28/22 | 500,000 | 508,906.25 | |
| T 1 3/4 05/15/22 | 400,000 | 408,468.75 | |
| T 1 3/4 05/15/23 | 500,000 | 518,437.50 | |
| T 1 3/4 07/31/24 | 300,000 | 315,796.87 | |
| T 1 3/4 09/30/22 | 200,000 | 205,453.12 | |
| T 1 3/4 11/15/29 | 300,000 | 319,500.00 | |
| T 1 3/4 12/31/24 | 200,000 | 211,328.12 | |
| T 1 3/4 12/31/26 | 300,000 | 320,250.00 | |
| T 1 3/8 01/31/22 | 300,000 | 303,843.75 | |
| T 1 3/8 01/31/25 | 100,000 | 104,234.37 | |
| T 1 3/8 02/15/23 | 200,000 | 205,078.12 | |
| T 1 3/8 08/15/50 | 200,000 | 177,875.00 | |
| T 1 3/8 10/15/22 | 100,000 | 102,140.62 | |
| T 1 3/8 11/15/40 | 100,000 | 95,195.31 | |
| T 1 5/8 02/15/26 | 600,000 | 635,015.62 | |
| T 1 5/8 05/15/26 | 200,000 | 211,703.12 | |

| | | | |
|------------------|---------|------------|--|
| T 1 5/8 08/15/22 | 500,000 | 511,835.94 | |
| T 1 5/8 08/15/29 | 200,000 | 210,937.50 | |
| T 1 5/8 09/30/26 | 200,000 | 211,953.12 | |
| T 1 5/8 11/15/22 | 100,000 | 102,687.50 | |
| T 1 5/8 11/30/26 | 200,000 | 211,953.12 | |
| T 1 5/8 12/15/22 | 100,000 | 102,820.31 | |
| T 1 5/8 12/31/21 | 100,000 | 101,398.43 | |
| T 1 7/8 02/28/22 | 200,000 | 203,843.75 | |
| T 1 7/8 07/31/26 | 100,000 | 107,320.31 | |
| T 2 02/15/22 | 500,000 | 510,039.06 | |
| T 2 02/15/23 | 300,000 | 311,414.06 | |
| T 2 02/15/25 | 200,000 | 213,562.50 | |
| T 2 02/15/50 | 400,000 | 414,312.49 | |
| T 2 06/30/24 | 100,000 | 106,031.25 | |
| T 2 08/15/25 | 800,000 | 858,562.50 | |
| T 2 1/2 01/31/24 | 200,000 | 213,875.00 | |
| T 2 1/2 02/15/46 | 100,000 | 114,625.00 | |
| T 2 1/2 05/15/24 | 500,000 | 537,382.81 | |
| T 2 1/2 05/15/46 | 100,000 | 114,562.50 | |
| T 2 1/2 08/15/23 | 300,000 | 317,976.56 | |
| T 2 1/4 08/15/27 | 100,000 | 109,976.56 | |
| T 2 1/4 08/15/46 | 200,000 | 218,828.12 | |
| T 2 1/4 08/15/49 | 100,000 | 109,320.31 | |
| T 2 1/4 11/15/24 | 800,000 | 859,500.00 | |
| T 2 1/4 11/15/27 | 400,000 | 440,250.00 | |
| T 2 1/8 05/15/25 | 300,000 | 322,687.50 | |
| T 2 11/15/26 | 100,000 | 108,078.12 | |
| T 2 11/30/22 | 400,000 | 413,750.00 | |
| T 2 3/4 02/15/28 | 600,000 | 681,609.37 | |
| T 2 3/4 07/31/23 | 100,000 | 106,523.43 | |
| T 2 3/4 11/15/23 | 600,000 | 643,546.87 | |
| T 2 3/4 11/15/42 | 200,000 | 238,734.37 | |
| T 2 3/8 05/15/27 | 100,000 | 110,664.06 | |
| T 2 3/8 05/15/29 | 100,000 | 111,531.25 | |
| T 2 3/8 08/15/24 | 200,000 | 215,000.00 | |
| T 2 3/8 11/15/49 | 100,000 | 112,242.18 | |
| T 2 5/8 01/31/26 | 100,000 | 110,796.87 | |
| T 2 5/8 02/15/29 | 100,000 | 113,390.62 | |
| T 2 5/8 03/31/25 | 100,000 | 109,445.31 | |
| T 2 7/8 05/15/28 | 100,000 | 114,695.31 | |
| T 2 7/8 05/15/43 | 100,000 | 121,734.37 | |
| T 2 7/8 05/31/25 | 200,000 | 221,781.25 | |
| T 2 7/8 07/31/25 | 100,000 | 111,171.87 | |
| T 2 7/8 08/15/28 | 100,000 | 114,929.68 | |
| T 2 7/8 08/15/45 | 100,000 | 122,257.81 | |

| | | | |
|--------------------|------------|----------------------------------|-------|
| T 3 02/15/47 | 300,000 | 376,382.81 | |
| T 3 02/15/48 | 300,000 | 377,437.50 | |
| T 3 02/15/49 | 400,000 | 505,343.75 | |
| T 3 05/15/47 | 100,000 | 125,546.87 | |
| T 3 08/15/48 | 100,000 | 126,007.81 | |
| T 3 1/8 02/15/43 | 100,000 | 126,453.12 | |
| T 3 1/8 05/15/48 | 100,000 | 128,664.06 | |
| T 3 1/8 08/15/44 | 300,000 | 380,742.18 | |
| T 3 1/8 11/15/28 | 200,000 | 234,078.12 | |
| T 3 1/8 11/15/41 | 100,000 | 126,234.37 | |
| T 3 11/15/45 | 300,000 | 375,000.00 | |
| T 3 3/8 11/15/48 | 100,000 | 134,718.75 | |
| T 3 5/8 02/15/44 | 100,000 | 136,507.81 | |
| T 3 5/8 08/15/43 | 100,000 | 136,164.06 | |
| T 3 7/8 08/15/40 | 200,000 | 277,250.00 | |
| T 4 1/4 11/15/40 | 100,000 | 145,359.37 | |
| T 4 3/4 02/15/41 | 100,000 | 154,664.06 | |
| T 4 3/8 05/15/40 | 100,000 | 146,976.56 | |
| T 4 3/8 11/15/39 | 200,000 | 293,281.24 | |
| T 5 05/15/37 | 50,000 | 76,261.71 | |
| T 5 3/8 02/15/31 | 100,000 | 141,382.81 | |
| 米ドル小計 | 28,150,000 | 30,201,034.74 (3,136,075,447) | |
| | 銘柄数 | 128 | |
| | 比率 | 42.4% | 42.9% |
| 加ドル | | 加ドル | |
| CAN 0 1/2 03/01/22 | 100,000 | 100,405.00 | |
| CAN 0 1/2 09/01/25 | 100,000 | 100,290.00 | |
| CAN 0 1/2 12/01/30 | 100,000 | 96,020.00 | |
| CAN 1 06/01/27 | 100,000 | 102,755.10 | |
| CAN 1 09/01/22 | 200,000 | 202,800.00 | |
| CAN 1 1/2 06/01/23 | 100,000 | 103,093.00 | |
| CAN 1 1/2 06/01/26 | 100,000 | 105,385.00 | |
| CAN 1 1/4 03/01/25 | 100,000 | 103,571.00 | |
| CAN 1 1/4 06/01/30 | 100,000 | 103,650.00 | |
| CAN 2 09/01/23 | 100,000 | 104,640.00 | |
| CAN 2 1/2 06/01/24 | 100,000 | 107,470.00 | |
| CAN 2 1/4 06/01/29 | 100,000 | 112,328.00 | |
| CAN 2 3/4 06/01/22 | 100,000 | 103,541.00 | |
| CAN 2 3/4 12/01/48 | 100,000 | 130,072.00 | |
| CAN 3 1/2 12/01/45 | 100,000 | 144,412.00 | |
| 加ドル小計 | 1,600,000 | 1,720,432.10 (140,507,689) | |
| | 銘柄数 | 15 | |
| | 比率 | 1.9% | 1.9% |

| | | | | |
|--------------------|----------------------|--------------|-------------------------------|--|
| メキシコ ペソ | | | メキシコペソ | |
| | MBONO 10 11/20/36 | 200,000 | 277,000.00 | |
| | MBONO 10 12/05/24 | 600,000 | 718,570.80 | |
| | MBONO 5 3/4 03/05/26 | 800,000 | 840,036.80 | |
| | MBONO 6 1/2 06/09/22 | 600,000 | 618,562.50 | |
| | MBONO 6 3/4 03/09/23 | 100,000 | 105,115.00 | |
| | MBONO 7 1/2 06/03/27 | 1,700,000 | 1,936,937.50 | |
| | MBONO 7 3/4 05/29/31 | 300,000 | 350,156.25 | |
| | MBONO 7 3/4 11/13/42 | 400,000 | 452,500.00 | |
| | MBONO 7 3/4 11/23/34 | 200,000 | 234,339.40 | |
| | MBONO 8 09/05/24 | 1,300,000 | 1,455,871.30 | |
| | MBONO 8 1/2 05/31/29 | 1,500,000 | 1,823,437.50 | |
| | MBONO 8 1/2 11/18/38 | 400,000 | 488,875.00 | |
| | MBONO 8 11/07/47 | 400,000 | 466,359.60 | |
| MBONO 8 12/07/23 | 1,500,000 | 1,648,695.00 | | |
| メキシコペソ小計 | | 10,000,000 | 11,416,456.65 (59,479,739) | |
| | 銘柄数 | 14 | | |
| | 比率 | 0.8% | 0.8% | |
| ユーロ | | | ユーロ | |
| | BGB 0 1/2 10/22/24 | 100,000 | 103,620.00 | |
| | BGB 0.2 10/22/23 | 100,000 | 102,410.00 | |
| | BGB 0.8 06/22/27 | 100,000 | 107,780.00 | |
| | BGB 1 06/22/26 | 100,000 | 108,750.00 | |
| | BGB 1 06/22/31 | 100,000 | 113,310.00 | |
| | BGB 1.6 06/22/47 | 100,000 | 130,440.00 | |
| | BGB 3 3/4 06/22/45 | 100,000 | 181,270.00 | |
| | BGB 4 1/4 03/28/41 | 100,000 | 180,380.00 | |
| | BGB 4 1/4 09/28/22 | 100,000 | 108,210.00 | |
| | BGB 5 03/28/35 | 100,000 | 172,910.00 | |
| | BGB 5 1/2 03/28/28 | 100,000 | 143,870.00 | |
| | BKO 0 03/11/22 | 200,000 | 201,502.00 | |
| | BKO 0 09/16/22 | 100,000 | 101,146.00 | |
| | BTPS 0.3 08/15/23 | 200,000 | 202,460.00 | |
| | BTPS 0.35 02/01/25 | 100,000 | 101,350.00 | |
| | BTPS 0.85 01/15/27 | 200,000 | 206,760.00 | |
| | BTPS 0.95 03/01/23 | 100,000 | 102,430.00 | |
| | BTPS 0.95 08/01/30 | 100,000 | 102,590.00 | |
| | BTPS 1 1/2 06/01/25 | 100,000 | 106,150.00 | |
| | BTPS 1 3/4 07/01/24 | 100,000 | 106,180.00 | |
| | BTPS 1.35 04/15/22 | 300,000 | 306,060.00 | |
| | BTPS 1.45 11/15/24 | 100,000 | 105,630.00 | |
| | BTPS 1.6 06/01/26 | 200,000 | 215,040.00 | |
| BTPS 1.65 03/01/32 | 100,000 | 108,820.00 | | |
| BTPS 1.65 12/01/30 | 100,000 | 109,020.00 | | |
| BTPS 1.85 07/01/25 | 100,000 | 107,840.00 | | |

| | | | |
|---------------------|---------|------------|--|
| BTPS 2 02/01/28 | 100,000 | 110,960.00 | |
| BTPS 2 1/4 09/01/36 | 100,000 | 116,310.00 | |
| BTPS 2 12/01/25 | 100,000 | 109,030.00 | |
| BTPS 2.7 03/01/47 | 100,000 | 125,470.00 | |
| BTPS 2.95 09/01/38 | 100,000 | 127,210.00 | |
| BTPS 3 08/01/29 | 200,000 | 240,400.00 | |
| BTPS 3 1/2 03/01/30 | 100,000 | 125,430.00 | |
| BTPS 3 1/4 09/01/46 | 100,000 | 136,850.00 | |
| BTPS 3 3/4 09/01/24 | 100,000 | 113,530.00 | |
| BTPS 3.35 03/01/35 | 100,000 | 130,240.00 | |
| BTPS 3.45 03/01/48 | 100,000 | 142,370.00 | |
| BTPS 4 02/01/37 | 100,000 | 141,570.00 | |
| BTPS 4 1/2 03/01/24 | 100,000 | 114,220.00 | |
| BTPS 4 1/2 05/01/23 | 100,000 | 110,730.00 | |
| BTPS 4 3/4 08/01/23 | 100,000 | 112,510.00 | |
| BTPS 4 3/4 09/01/28 | 100,000 | 131,760.00 | |
| BTPS 4 3/4 09/01/44 | 100,000 | 165,770.00 | |
| BTPS 5 08/01/34 | 100,000 | 150,760.00 | |
| BTPS 5 08/01/39 | 100,000 | 162,070.00 | |
| BTPS 5 09/01/40 | 100,000 | 163,310.00 | |
| BTPS 5 1/2 11/01/22 | 200,000 | 220,260.00 | |
| BTPS 5 3/4 02/01/33 | 100,000 | 155,420.00 | |
| BTPS 6 05/01/31 | 100,000 | 151,910.00 | |
| BTPS 6 1/2 11/01/27 | 100,000 | 140,670.00 | |
| BTPS 7 1/4 11/01/26 | 100,000 | 140,240.00 | |
| DBR 0 02/15/30 | 100,000 | 105,324.00 | |
| DBR 0 05/15/35 | 100,000 | 105,077.00 | |
| DBR 0 08/15/26 | 100,000 | 104,110.00 | |
| DBR 0 08/15/29 | 100,000 | 105,259.00 | |
| DBR 0 08/15/30 | 200,000 | 210,672.00 | |
| DBR 0 1/2 02/15/25 | 100,000 | 105,173.00 | |
| DBR 0 1/2 02/15/26 | 100,000 | 106,377.00 | |
| DBR 0 1/4 02/15/27 | 100,000 | 105,971.00 | |
| DBR 0 1/4 02/15/29 | 100,000 | 107,287.00 | |
| DBR 0 1/4 08/15/28 | 300,000 | 321,048.00 | |
| DBR 0 11/15/27 | 100,000 | 104,692.00 | |
| DBR 1 08/15/25 | 100,000 | 108,087.00 | |
| DBR 1 1/2 02/15/23 | 100,000 | 104,656.00 | |
| DBR 1 1/2 09/04/22 | 100,000 | 103,593.00 | |
| DBR 1 1/4 08/15/48 | 100,000 | 138,675.00 | |
| DBR 1 3/4 07/04/22 | 100,000 | 103,540.00 | |
| DBR 2 1/2 07/04/44 | 100,000 | 165,604.00 | |
| DBR 2 1/2 08/15/46 | 100,000 | 170,045.00 | |
| DBR 3 1/4 07/04/42 | 100,000 | 177,769.00 | |
| DBR 4 01/04/37 | 100,000 | 171,816.00 | |

| | | | |
|-----------------------|---------|------------|--|
| DBR 4 3/4 07/04/34 | 100,000 | 172,274.00 | |
| DBR 4.25 07/04/39 | 100,000 | 187,029.00 | |
| DBR 5.5 01/04/31 | 100,000 | 162,222.00 | |
| DBR 6.5 07/04/27 | 100,000 | 147,772.00 | |
| FRTR 0 02/25/23 | 200,000 | 202,740.00 | |
| FRTR 0 02/25/26 | 200,000 | 206,010.00 | |
| FRTR 0 03/25/23 | 100,000 | 100,960.00 | |
| FRTR 0 03/25/24 | 200,000 | 204,180.00 | |
| FRTR 0 03/25/25 | 300,000 | 307,890.00 | |
| FRTR 0 1/2 05/25/26 | 100,000 | 105,810.00 | |
| FRTR 0 1/2 05/25/40 | 100,000 | 106,530.00 | |
| FRTR 0 11/25/29 | 200,000 | 206,300.00 | |
| FRTR 0 11/25/30 | 100,000 | 102,190.00 | |
| FRTR 0 3/4 05/25/52 | 100,000 | 107,210.00 | |
| FRTR 0 3/4 11/25/28 | 300,000 | 324,480.00 | |
| FRTR 1 05/25/27 | 300,000 | 329,505.00 | |
| FRTR 1 1/2 05/25/31 | 200,000 | 237,000.00 | |
| FRTR 1 1/2 05/25/50 | 100,000 | 130,840.00 | |
| FRTR 1 1/4 05/25/34 | 200,000 | 234,200.00 | |
| FRTR 1 1/4 05/25/36 | 100,000 | 119,030.00 | |
| FRTR 1 11/25/25 | 100,000 | 107,890.00 | |
| FRTR 1 3/4 05/25/23 | 100,000 | 105,645.00 | |
| FRTR 1 3/4 06/25/39 | 100,000 | 129,190.00 | |
| FRTR 1 3/4 11/25/24 | 200,000 | 218,550.00 | |
| FRTR 2 05/25/48 | 100,000 | 141,580.00 | |
| FRTR 2 1/2 05/25/30 | 200,000 | 253,840.00 | |
| FRTR 2 1/4 10/25/22 | 300,000 | 315,363.00 | |
| FRTR 3 1/2 04/25/26 | 200,000 | 243,570.00 | |
| FRTR 3 1/4 05/25/45 | 100,000 | 170,370.00 | |
| FRTR 4 04/25/55 | 100,000 | 213,200.00 | |
| FRTR 4 10/25/38 | 100,000 | 170,240.00 | |
| FRTR 4 3/4 04/25/35 | 100,000 | 169,910.00 | |
| FRTR 4.25 10/23 | 100,000 | 113,710.00 | |
| FRTR 5 1/2 04/25/29 | 200,000 | 299,660.00 | |
| FRTR 5 3/4 10/25/32 | 100,000 | 171,300.00 | |
| FRTR 6 10/25/25 | 100,000 | 132,080.00 | |
| FRTR4.5 04/25/41 | 100,000 | 187,480.00 | |
| IRISH 0.2 10/18/30 | 100,000 | 104,440.00 | |
| IRISH 1.3 05/15/33 | 100,000 | 117,420.00 | |
| IRISH 1.35 03/18/31 | 100,000 | 116,510.00 | |
| IRISH 5.4 03/13/25 | 100,000 | 125,090.00 | |
| NETHER 0 01/15/27 | 100,000 | 102,260.00 | |
| NETHER 0 1/2 07/15/26 | 100,000 | 106,420.00 | |
| NETHER 2 07/15/24 | 100,000 | 109,495.00 | |
| NETHER 2 1/2 01/15/33 | 100,000 | 135,230.00 | |

| | | | |
|-----------------------|---------|------------|--|
| NETHER 2 3/4 01/15/47 | 100,000 | 175,720.00 | |
| NETHER 3 3/4 01/15/42 | 100,000 | 183,710.00 | |
| NETHER 4 01/15/37 | 100,000 | 169,820.00 | |
| NETHER 5 1/2 01/15/28 | 100,000 | 143,390.00 | |
| NETHER 7 1/2 01/15/23 | 100,000 | 116,370.00 | |
| OBL 0 04/05/24 | 200,000 | 204,848.00 | |
| OBL 0 04/11/25 | 200,000 | 206,360.00 | |
| OBL 0 10/13/23 | 200,000 | 204,140.00 | |
| OBL 0 10/18/24 | 200,000 | 205,636.00 | |
| RAGB 0 09/20/22 | 100,000 | 101,098.00 | |
| RAGB 0 1/2 02/20/29 | 100,000 | 107,770.00 | |
| RAGB 0 3/4 10/20/26 | 100,000 | 107,835.00 | |
| RAGB 1 1/2 02/20/47 | 100,000 | 135,980.00 | |
| RAGB 1 3/4 10/20/23 | 100,000 | 106,680.00 | |
| RAGB 3.15 06/20/44 | 100,000 | 172,750.00 | |
| RAGB 4.15 03/37 | 100,000 | 169,680.00 | |
| RFGB 0 1/2 09/15/28 | 100,000 | 107,670.00 | |
| RFGB 1 1/8 04/15/34 | 100,000 | 117,510.00 | |
| RFGB 4 07/04/25 | 100,000 | 121,120.00 | |
| SPGB 0 01/31/25 | 200,000 | 203,180.00 | |
| SPGB 0 04/30/23 | 100,000 | 101,110.00 | |
| SPGB 0.45 10/31/22 | 100,000 | 101,745.00 | |
| SPGB 0.6 10/31/29 | 100,000 | 105,030.00 | |
| SPGB 0.8 07/30/27 | 200,000 | 212,630.00 | |
| SPGB 1 1/4 10/31/30 | 100,000 | 110,710.00 | |
| SPGB 1.2 10/31/40 | 100,000 | 108,800.00 | |
| SPGB 1.3 10/31/26 | 100,000 | 109,155.00 | |
| SPGB 1.4 07/30/28 | 100,000 | 111,300.00 | |
| SPGB 1.45 10/31/27 | 100,000 | 110,895.00 | |
| SPGB 1.85 07/30/35 | 100,000 | 119,680.00 | |
| SPGB 1.95 04/30/26 | 100,000 | 112,065.00 | |
| SPGB 1.95 07/30/30 | 200,000 | 235,060.00 | |
| SPGB 2 3/4 10/31/24 | 100,000 | 112,070.00 | |
| SPGB 2.15 10/31/25 | 100,000 | 111,930.00 | |
| SPGB 2.35 07/30/33 | 100,000 | 124,870.00 | |
| SPGB 2.9 10/31/46 | 100,000 | 147,510.00 | |
| SPGB 4.2 01/31/37 | 100,000 | 157,310.00 | |
| SPGB 4.4 10/31/23 | 100,000 | 113,630.00 | |
| SPGB 4.7 07/30/41 | 100,000 | 176,860.00 | |
| SPGB 4.8 01/31/24 | 100,000 | 116,050.00 | |
| SPGB 4.9 07/30/40 | 100,000 | 178,510.00 | |
| SPGB 5 3/4 07/30/32 | 100,000 | 162,790.00 | |
| SPGB 5.15 10/31/28 | 100,000 | 140,460.00 | |
| SPGB 5.85 01/31/22 | 100,000 | 106,470.00 | |
| SPGB 6 01/31/29 | 100,000 | 148,590.00 | |

| | | | | |
|--------|--------------------|------------|----------------------------------|--|
| ユーロ小計 | | 19,700,000 | 24,050,815.00 (3,039,301,491) | |
| | 銘柄数 | 161 | | |
| | 比率 | 41.1% | 41.6% | |
| 英ポンド | | | 英ポンド | |
| | UKT 0 1/8 01/30/26 | 100,000 | 100,470.00 | |
| | UKT 0 1/8 01/31/23 | 100,000 | 100,380.00 | |
| | UKT 0 5/8 06/07/25 | 100,000 | 102,880.00 | |
| | UKT 0 5/8 10/22/50 | 100,000 | 93,065.00 | |
| | UKT 1 04/22/24 | 100,000 | 103,490.00 | |
| | UKT 1 1/2 07/22/47 | 100,000 | 114,790.00 | |
| | UKT 1 1/4 07/22/27 | 100,000 | 107,420.00 | |
| | UKT 1 1/4 10/22/41 | 100,000 | 108,070.00 | |
| | UKT 1 3/4 09/07/22 | 200,000 | 206,080.00 | |
| | UKT 1 3/4 09/07/37 | 100,000 | 116,210.00 | |
| | UKT 1 5/8 10/22/28 | 100,000 | 111,250.00 | |
| | UKT 2 09/07/25 | 100,000 | 109,400.00 | |
| | UKT 2 1/4 09/07/23 | 100,000 | 106,105.00 | |
| | UKT 3 1/2 01/22/45 | 100,000 | 157,090.00 | |
| | UKT 3 1/2 07/22/68 | 100,000 | 206,650.00 | |
| | UKT 3 1/4 01/22/44 | 100,000 | 149,820.00 | |
| | UKT 3 3/4 07/22/52 | 100,000 | 179,550.00 | |
| | UKT 4 1/2 12/07/42 | 100,000 | 173,770.00 | |
| | UKT 4 1/4 03/07/36 | 100,000 | 152,230.00 | |
| | UKT 4 1/4 09/07/39 | 100,000 | 160,980.00 | |
| | UKT 4 1/4 12/07/27 | 30,000 | 38,526.00 | |
| | UKT 4 1/4 12/07/40 | 100,000 | 163,790.00 | |
| | UKT 4 1/4 12/07/46 | 100,000 | 178,160.00 | |
| | UKT 4 1/4 12/07/49 | 100,000 | 186,230.00 | |
| | UKT 4 3/4 12/07/30 | 100,000 | 143,110.00 | |
| | UKT 4.25 06/07/32 | 100,000 | 142,540.00 | |
| | UKT 6 12/07/28 | 10,000 | 14,529.00 | |
| 英ポンド小計 | | 2,640,000 | 3,526,585.00 (501,162,994) | |
| | 銘柄数 | 27 | | |
| | 比率 | 6.8% | 6.9% | |

| | | | | |
|----------------|--------------------------|-----------|------------------------------|--|
| スウェーデン クローネ | | | スウェーデン クローネ | |
| | SGB 0 1/8 05/12/31 | 100,000 | 100,317.00 | |
| | SGB 0 3/4 05/12/28 #1060 | 200,000 | 212,224.00 | |
| | SGB 0 3/4 11/12/29 #1061 | 200,000 | 213,302.00 | |
| | SGB 1 1/2 11/13/23 | 300,000 | 315,657.00 | |
| | SGB 1 11/12/26 #1059 | 200,000 | 213,760.00 | |
| | SGB 2 1/2 05/12/25 #1058 | 200,000 | 224,056.00 | |
| | SGB 3 1/2 03/30/39 | 100,000 | 154,517.00 | |
| | SGB 3 1/2 06/01/22 | 300,000 | 315,606.00 | |
| スウェーデンクローネ小計 | | 1,600,000 | 1,749,439.00 (21,885,481) | |
| | 銘柄数 | 8 | | |
| | 比率 | 0.3% | 0.3% | |
| ノルウェー クローネ | | | ノルウェー クローネ | |
| | NGB 1 1/2 02/19/26 | 100,000 | 103,830.00 | |
| | NGB 1 3/4 02/17/27 | 100,000 | 105,560.00 | |
| | NGB 1 3/4 03/13/25 | 100,000 | 104,470.00 | |
| | NGB 1 3/4 09/06/29 | 100,000 | 106,080.00 | |
| | NGB 1 3/8 08/19/30 | 100,000 | 102,930.00 | |
| | NGB 2 04/26/28 | 100,000 | 107,540.00 | |
| | NGB 2 05/24/23 | 300,000 | 311,400.00 | |
| | NGB 3 03/14/24 | 200,000 | 215,280.00 | |
| ノルウェークローネ小計 | | 1,100,000 | 1,157,090.00 (14,139,639) | |
| | 銘柄数 | 8 | | |
| | 比率 | 0.2% | 0.2% | |
| デンマーク クローネ | | | デンマーク クローネ | |
| | DGB 0 1/2 11/15/27 | 300,000 | 320,850.00 | |
| | DGB 0 1/2 11/15/29 | 400,000 | 432,880.00 | |
| | DGB 0 1/4 11/15/22 | 200,000 | 203,014.00 | |
| | DGB 1 1/2 11/15/23 | 200,000 | 212,000.00 | |
| | DGB 1 3/4 11/15/25 | 200,000 | 222,500.00 | |
| | DGB 4 1/2 11/15/39 | 400,000 | 752,520.00 | |
| デンマーククローネ小計 | | 1,700,000 | 2,143,764.00 (36,422,550) | |
| | 銘柄数 | 6 | | |
| | 比率 | 0.5% | 0.5% | |

| | | | | |
|----------------------|----------------------|------------|-------------------------------|--|
| ポーランドズロチ | | | ポーランドズロチ | |
| | POLGB 0 07/25/22 | 200,000 | 199,300.00 | |
| | POLGB 0 3/4 04/25/25 | 100,000 | 101,570.00 | |
| | POLGB 2 1/2 01/25/23 | 200,000 | 209,720.00 | |
| | POLGB 2 1/2 04/25/24 | 100,000 | 107,300.00 | |
| | POLGB 2 1/2 07/25/26 | 200,000 | 220,960.00 | |
| | POLGB 2 1/2 07/25/27 | 100,000 | 111,210.00 | |
| | POLGB 2 1/4 10/25/24 | 100,000 | 107,600.00 | |
| | POLGB 2 3/4 04/25/28 | 100,000 | 113,050.00 | |
| | POLGB 2 3/4 10/25/29 | 200,000 | 227,400.00 | |
| | POLGB 3 1/4 07/25/25 | 100,000 | 112,610.00 | |
| POLGB 5 3/4 09/23/22 | 100,000 | 109,560.00 | | |
| ポーランドズロチ小計 | | 1,500,000 | 1,620,280.00 (45,108,595) | |
| | 銘柄数 | 11 | | |
| | 比率 | 0.6% | 0.6% | |
| 豪ドル | | | 豪ドル | |
| | ACGB 0 1/2 09/21/26 | 100,000 | 99,955.30 | |
| | ACGB 0 1/4 11/21/25 | 100,000 | 99,432.40 | |
| | ACGB 1 1/2 06/21/31 | 200,000 | 207,600.00 | |
| | ACGB 1 1/4 05/21/32 | 100,000 | 100,395.40 | |
| | ACGB 1 12/21/30 | 100,000 | 99,200.20 | |
| | ACGB 1 3/4 06/21/51 | 100,000 | 90,998.50 | |
| | ACGB 2 1/2 05/21/30 | 100,000 | 113,340.00 | |
| | ACGB 2 1/4 05/21/28 | 100,000 | 110,700.00 | |
| | ACGB 2 3/4 04/21/24 | 200,000 | 217,092.20 | |
| | ACGB 2 3/4 11/21/27 | 200,000 | 227,760.00 | |
| | ACGB 2 3/4 11/21/28 | 200,000 | 229,420.00 | |
| | ACGB 2 3/4 11/21/29 | 100,000 | 115,310.00 | |
| | ACGB 3 03/21/47 | 100,000 | 118,980.00 | |
| | ACGB 3 1/4 04/21/25 | 100,000 | 112,570.00 | |
| | ACGB 3 1/4 04/21/29 | 100,000 | 118,889.90 | |
| | ACGB 4 1/2 04/21/33 | 100,000 | 137,030.00 | |
| ACGB 4 1/4 04/21/26 | 100,000 | 119,820.00 | | |
| ACGB 5 1/2 04/21/23 | 100,000 | 112,020.00 | | |
| ACGB 5 3/4 07/15/22 | 100,000 | 108,350.00 | | |
| 豪ドル小計 | | 2,300,000 | 2,538,863.90 (203,616,884) | |
| | 銘柄数 | 19 | | |
| | 比率 | 2.8% | 2.8% | |

| | | | | |
|----------------------|----------------------|------------|---------------------------------------|--|
| シンガポールドル | | | シンガポールドル | |
| | SIGB 2 1/4 08/01/36 | 100,000 | 113,340.00 | |
| | SIGB 2 1/8 06/01/26 | 100,000 | 108,130.00 | |
| | SIGB 3 1/2 03/01/27 | 200,000 | 233,340.00 | |
| シンガポールドル小計 | | 400,000 | 454,810.00 (35,588,882) | |
| | 銘柄数 | 3 | | |
| | 比率 | 0.5% | 0.5% | |
| マレーシアリングット | | | マレーシアリングット | |
| | MGS 2.632 04/15/31 | 100,000 | 99,174.80 | |
| | MGS 3.48 03/15/23 | 100,000 | 103,218.75 | |
| | MGS 3.502 05/31/27 | 100,000 | 106,523.60 | |
| | MGS 3.828 07/05/34 | 100,000 | 105,450.10 | |
| | MGS 3.844 04/15/33 | 100,000 | 104,012.30 | |
| | MGS 3.882 03/10/22 | 100,000 | 102,359.80 | |
| | MGS 3.885 08/15/29 | 100,000 | 108,894.40 | |
| | MGS 3.955 09/15/25 | 100,000 | 108,093.75 | |
| | MGS 4.181 07/15/24 | 100,000 | 107,125.00 | |
| | MGS 4.392 04/15/26 | 100,000 | 110,699.20 | |
| | MGS 4.498 04/15/30 | 100,000 | 114,003.20 | |
| | MGS 4.736 03/15/46 | 100,000 | 111,350.00 | |
| | MGS 4.762 04/07/37 | 100,000 | 114,125.00 | |
| MGS 5.248 09/28 | 100,000 | 118,400.70 | | |
| マレーシアリングット小計 | | 1,400,000 | 1,513,430.60 (38,834,629) | |
| | 銘柄数 | 14 | | |
| | 比率 | 0.5% | 0.5% | |
| イスラエルシュケル | | | イスラエルシュケル | |
| | ILGOV 1 03/31/30 | 100,000 | 102,350.00 | |
| | ILGOV 1 3/4 08/31/25 | 100,000 | 107,450.00 | |
| | ILGOV 2 03/31/27 | 200,000 | 222,440.00 | |
| | ILGOV 2 1/4 09/28/28 | 100,000 | 112,990.00 | |
| | ILGOV 3 3/4 03/31/47 | 100,000 | 140,550.00 | |
| | ILGOV 4 1/4 03/31/23 | 100,000 | 112,570.00 | |
| | ILGOV 5 1/2 01/31/22 | 100,000 | 105,500.00 | |
| ILGOV 5 1/2 01/31/42 | 100,000 | 169,310.00 | | |
| イスラエルシュケル小計 | | 900,000 | 1,073,160.00 (34,051,366) | |
| | 銘柄数 | 8 | | |
| | 比率 | 0.5% | 0.5% | |
| 国債証券合計 | | | 円 7,306,175,386 (7,306,175,386) | |

| | | | |
|-----|--|---------------------------------------|--|
| 合 計 | | 円 7,306,175,386 (7,306,175,386) | |
|-----|--|---------------------------------------|--|

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表
該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表
「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 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 | | | |
| 預金 | | 295,369,817 | 379,927,458 |
| コール・ローン | | 48,982,961 | 65,990,146 |
| 株式 | | 15,879,805,238 | 30,913,475,854 |
| 投資証券 | | 442,360,030 | 679,011,304 |
| 派生商品評価勘定 | | 2,802,044 | 18,462,409 |
| 未収配当金 | | 12,298,775 | 19,814,716 |
| 差入委託証拠金 | | 134,580,232 | 470,990,626 |
| 流動資産合計 | | 16,816,199,097 | 32,547,672,513 |
| 資産合計 | | 16,816,199,097 | 32,547,672,513 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 1,771,670 | 221,707 |
| 未払解約金 | | 13,272,370 | 27,432,107 |
| 未払利息 | | 28 | 36 |
| 流動負債合計 | | 15,044,068 | 27,653,850 |
| 負債合計 | | 15,044,068 | 27,653,850 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 5,970,420,435 | 10,389,370,150 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 10,830,734,594 | 22,130,648,513 |
| 元本等合計 | | 16,801,155,029 | 32,520,018,663 |
| 純資産合計 | | 16,801,155,029 | 32,520,018,663 |
| 負債純資産合計 | | 16,816,199,097 | 32,547,672,513 |

(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 | 株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | [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 | 5,030,956,418円 | 5,970,420,435円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 1,276,800,070円 | 6,045,309,007円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 337,336,053円 | 1,626,359,292円 |
| 同期末における元本額 | 5,970,420,435円 | 10,389,370,150円 |
| 元本の内訳* | | |
| L P S 4 資産分散ファンド（慎重型） | 2,088,168円 | 2,214,429円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（安定重視型） | 4,016,661円 | 3,755,213円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（バランス型） | 12,211,022円 | 11,713,332円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（成長重視型） | 15,513,019円 | 16,489,454円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（積極型） | 18,417,393円 | 16,932,119円 |

| | | |
|--|----------------|-----------------|
| 東京海上セレクション・外国株式 インデックス | 5,286,359,643円 | 9,195,684,892円 |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド (年1回決算型) | 56,682,934円 | 69,303,074円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035 | 527,485円 | 15,384,415円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045 | 247,790円 | 5,372,042円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055 | 138,543円 | 4,875,425円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065 | 199,768円 | 9,000,136円 |
| TMA外国株式インデックスVA <適格機関投資家限定> | 77,687,159円 | 62,744,659円 |
| TMA世界バランスファンド35VA <適格機関投資家限定> | 2,884,211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> | 52,569,417円 | 108,063,480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> | 440,877,222円 | 867,837,480円 |
| 計 | 5,970,420,435円 | 10,389,370,150円 |
| 2. 1 本書における開示対象ファンドの計算期間 末日における当該親投資信託の受益権の総 数 | 5,970,420,435口 | 10,389,370,150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 9月20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、先物取引及び為替予約取引が含まれております。当該有価証券及びデリバティブ取引には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。 | 同左 |

| | | |
|-------------------|---|----|
| 3. 金融商品に係るリスク管理体制 | <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9月20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 | 818,871,726円 |
| 投資証券 | 21,952,875円 |
| 合計 | 840,824,601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 |
|------|-----------------|
| 株式 | 2,413,958,612円 |
| 投資証券 | 13,288,035円 |
| 合計 | 2,427,246,647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。

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(1) 株式関連

(2020年1月27日現在)

(単位：円)

| 区 分 | 種 類 | 契約額等 | うち | 時 価 | 評価損益 |
|------|--------------|-------------|-----|-------------|-----------|
| | | | 1年超 | | |
| 市場取引 | 株価指数先物取引 | | | | |
| | 買建 | 476,973,951 | | 478,092,957 | 1,119,006 |
| | S&P 500 EMIN | 339,727,350 | | 341,229,651 | 1,502,301 |
| | DJ EU STX 50 | 72,576,990 | | 72,507,216 | 69,774 |
| | FTSE 100 IDX | 64,669,611 | | 64,356,090 | 313,521 |

| | | | | |
|----|-------------|--|-------------|-----------|
| 合計 | 476,973,951 | | 478,092,957 | 1,119,006 |
|----|-------------|--|-------------|-----------|

(2021年1月25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 | 897,504,005 | | 915,704,407 | 18,200,402 |
| | S&P 500 EMIN | 640,187,878 | | 656,936,492 | 16,748,614 |
| | DJ EU STX 50 | 135,483,804 | | 136,024,667 | 540,863 |
| | FTSE 100 IDX | 121,832,323 | | 122,743,248 | 910,925 |
| 合計 | | 897,504,005 | | 915,704,407 | 18,200,402 |

(注)1.時価の算定方法

株価指数先物取引の時価については、以下のように評価しております。

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

2. 株価指数先物取引の残高は、契約額ベースで表示しております。

3. 契約額等には手数料相当額を含んでおりません。

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

4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2) 通貨関連

(2020年1月27日現在)

(単位:円)

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

(2021年1月25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 以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 13,457,600 | | 13,497,900 | 40,300 |
| | 米ドル | 13,457,600 | | 13,497,900 | 40,300 |
| 合計 | | 13,457,600 | | 13,497,900 | 40,300 |

(注)1.時価の算定方法

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

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

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

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

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

2.換算において円未満の端数は切り捨てております。

3.契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報に関する注記)

| [2020年 1月27日現在] | | [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) | 2.8141円 28,141円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 3.1301円 31,301円) |

(3) 附属明細表

第1 有価証券明細表

(1)株式

| 銘柄 | 株式数 | 評価額 | | 備考 |
|------------------------------|--------|--------|--------------|----|
| | | 単価 | 金額 | |
| 米ドル | 株 | 米ドル | 米ドル | |
| BAKER HUGHES COMPANY | 6,103 | 22.17 | 135,303.51 | |
| CABOT OIL & GAS CORP | 2,441 | 18.54 | 45,256.14 | |
| CHEVRONTEXACO CORP | 11,787 | 91.73 | 1,081,221.51 | |
| CONOCOPHILLIPS | 8,432 | 42.69 | 359,962.08 | |
| EOG RESOURCES INC | 3,337 | 54.86 | 183,067.82 | |
| EXXON MOBIL CORPORATION | 25,581 | 47.43 | 1,213,306.83 | |
| HALLIBURTON CO | 6,770 | 19.24 | 130,254.80 | |
| HESS CORP | 2,520 | 59.93 | 151,023.60 | |
| KINDER MORGAN INC | 10,170 | 15.32 | 155,804.40 | |
| MARATHON PETROLEUM CORP | 4,506 | 45.75 | 206,149.50 | |
| ONEOK INC | 3,335 | 42.84 | 142,871.40 | |
| PHILLIPS 66 | 2,455 | 72.55 | 178,110.25 | |
| PIONEER NATURAL RESOURCES CO | 1,151 | 131.16 | 150,965.16 | |
| SCHLUMBERGER LTD | 8,443 | 24.41 | 206,093.63 | |
| VALERO ENERGY CORP | 2,734 | 59.45 | 162,536.30 | |
| WILLIAMS COS INC | 7,798 | 21.60 | 168,436.80 | |
| AIR PRODUCTS & CHEMICALS INC | 1,322 | 283.60 | 374,919.20 | |
| ALBEMARLE CORP | 945 | 173.71 | 164,155.95 | |
| AMCOR PLC | 11,924 | 11.09 | 132,237.16 | |
| AVERY DENNISON CORP | 661 | 156.68 | 103,565.48 | |
| BALL CORP | 2,259 | 90.74 | 204,981.66 | |
| CELANESE CORP-SERIES A | 1,049 | 131.40 | 137,838.60 | |
| CF INDUSTRIES HOLDINGS INC | 1,966 | 43.40 | 85,324.40 | |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|------------|
| CORTEVA INC | 4,901 | 42.06 | 206,136.06 |
| CROWN HOLDINGS INC | 1,306 | 93.74 | 122,424.44 |
| DOW INC | 4,857 | 57.50 | 279,277.50 |
| DUPONT DE NEMOURS INC | 4,749 | 81.09 | 385,096.41 |
| EASTMAN CHEMICAL COMPANY | 1,256 | 106.22 | 133,412.32 |
| ECOLAB INC | 1,466 | 212.39 | 311,363.74 |
| FREEMPORT-MCMORAN INC | 10,572 | 30.49 | 322,340.28 |
| INTERNATIONAL PAPER CO | 2,656 | 51.63 | 137,129.28 |
| INTL FLAVORS & FRAGRANCES | 591 | 115.81 | 68,443.71 |
| LINDE PLC | 3,256 | 251.48 | 818,818.88 |
| LyondellBasell Industries NV | 1,619 | 91.48 | 148,106.12 |
| MARTIN MARIETTA MATERIALS | 440 | 309.60 | 136,224.00 |
| MOSAIC CO/THE | 4,114 | 28.33 | 116,549.62 |
| NEWMONT CORPORATION | 5,653 | 61.75 | 349,072.75 |
| NUCOR CORP | 2,336 | 54.78 | 127,966.08 |
| PACKAGING CORP OF AMERICA | 794 | 140.40 | 111,477.60 |
| PPG INDUSTRIES INC | 1,272 | 137.82 | 175,307.04 |
| RPM INTERNATIONAL INC | 963 | 86.97 | 83,752.11 |
| SEALED AIR CORP | 1,449 | 45.50 | 65,929.50 |
| SHERWIN-WILLIAMS CO/THE | 530 | 732.17 | 388,050.10 |
| VULCAN MATERIALS CO | 855 | 158.37 | 135,406.35 |
| WESTROCK CO | 2,323 | 46.67 | 108,414.41 |
| 3M CO | 3,393 | 169.04 | 573,552.72 |
| AMETEK INC | 1,040 | 117.35 | 122,044.00 |
| BOEING CO | 3,481 | 205.84 | 716,529.04 |
| CARRIER GLOBAL CORP | 6,052 | 39.51 | 239,114.52 |
| CATERPILLAR INC | 3,446 | 191.94 | 661,425.24 |
| CUMMINS INC | 779 | 247.00 | 192,413.00 |
| DEERE & CO | 1,956 | 305.17 | 596,912.52 |
| DOVER CORP | 959 | 125.32 | 120,181.88 |
| EATON CORP PLC | 2,215 | 124.43 | 275,612.45 |
| EMERSON ELECTRIC CO | 3,290 | 83.73 | 275,471.70 |
| FASTENAL CO | 3,181 | 47.72 | 151,797.32 |
| FORTIVE CORP | 1,793 | 69.32 | 124,290.76 |
| FORTUNE BRANDS HOME & SECURI | 1,331 | 92.57 | 123,210.67 |
| GENERAC HOLDINGS INC | 594 | 277.61 | 164,900.34 |
| GENERAL DYNAMICS CORP | 1,288 | 152.77 | 196,767.76 |
| GENERAL ELECTRIC CO | 57,276 | 11.11 | 636,336.36 |
| HONEYWELL INTERNATIONAL INC | 4,383 | 202.25 | 886,461.75 |
| HUNTINGTON INGALLS INDUSTRIE | 280 | 167.64 | 46,939.20 |
| IDEX CORP | 535 | 196.54 | 105,148.90 |
| ILLINOIS TOOL WORKS INC | 1,774 | 203.46 | 360,938.04 |

| | | | |
|------------------------------|-------|--------|------------|
| INGERSOLL-RAND INC | 2,962 | 45.23 | 133,971.26 |
| JACOBS ENGINEERING GROUP INC | 1,126 | 111.01 | 124,997.26 |
| JOHNSON CONTROLS INTERNATION | 4,253 | 52.35 | 222,644.55 |
| L3HARRIS TECHNOLOGIES INC | 1,342 | 183.80 | 246,659.60 |
| LENNOX INTERNATIONAL INC | 270 | 293.15 | 79,150.50 |
| LOCKHEED MARTIN CORP | 1,439 | 339.88 | 489,087.32 |
| MASCO CORP | 2,057 | 57.52 | 118,318.64 |
| NORDSON CORP | 502 | 191.99 | 96,378.98 |
| NORTHROP GRUMMAN CORP | 898 | 298.16 | 267,747.68 |
| OTIS WORLDWIDE CORP | 2,227 | 64.88 | 144,487.76 |
| PACCAR INC | 1,958 | 98.85 | 193,548.30 |
| PARKER HANNIFIN CORP | 904 | 275.17 | 248,753.68 |
| PENTAIR PLC | 1,490 | 57.98 | 86,390.20 |
| RAYTHEON TECHNOLOGIES CORP | 9,620 | 67.58 | 650,119.60 |
| ROCKWELL AUTOMATION INC | 666 | 265.97 | 177,136.02 |
| ROPER TECHNOLOGIES INC | 642 | 419.22 | 269,139.24 |
| SENSATA TECHNOLOGIES HOLDING | 1,538 | 57.84 | 88,957.92 |
| SMITH (A.O.) CORP | 962 | 57.76 | 55,565.12 |
| SNAP-ON INC | 469 | 177.98 | 83,472.62 |
| STANLEY BLACK & DECKER INC | 940 | 175.21 | 164,697.40 |
| TELEDYNE TECHNOLOGIES INC | 330 | 389.17 | 128,426.10 |
| TEXTRON INC | 1,994 | 49.73 | 99,161.62 |
| TRANE TECHNOLOGIES PLC | 1,545 | 152.67 | 235,875.15 |
| TRANSDIGM GROUP INC | 394 | 576.40 | 227,101.60 |
| UNITED RENTALS INC | 648 | 258.59 | 167,566.32 |
| WABTEC CORP/DE | 1,552 | 80.47 | 124,889.44 |
| WW GRAINGER INC | 294 | 393.49 | 115,686.06 |
| XYLEM INC | 1,434 | 102.60 | 147,128.40 |
| CINTAS CORP | 593 | 324.48 | 192,416.64 |
| COPART INC | 1,534 | 114.59 | 175,781.06 |
| COSTAR GROUP INC | 283 | 896.05 | 253,582.15 |
| EQUIFAX INC | 903 | 178.74 | 161,402.22 |
| IHS MARKIT LTD | 2,710 | 88.09 | 238,723.90 |
| REPUBLIC SERVICES INC | 944 | 94.40 | 89,113.60 |
| ROBERT HALF INTL INC | 1,113 | 68.31 | 76,029.03 |
| ROLLINS INC | 2,410 | 37.02 | 89,218.20 |
| TRANSUNION | 1,546 | 91.91 | 142,092.86 |
| VERISK ANALYTICS INC | 918 | 192.76 | 176,953.68 |
| WASTE CONNECTIONS INC | 1,546 | 102.96 | 159,176.16 |
| WASTE MANAGEMENT INC | 2,276 | 115.36 | 262,559.36 |
| C.H. ROBINSON WORLDWIDE INC | 952 | 97.80 | 93,105.60 |
| CSX CORP | 4,317 | 87.64 | 378,341.88 |

| | | | |
|-------------------------------|--------|----------|--------------|
| EXPEDITORS INTL WASH INC | 1,086 | 93.77 | 101,834.22 |
| FEDEX CORP | 1,692 | 254.08 | 429,903.36 |
| HUNT (JB) TRANSPRT SVCS INC | 598 | 146.14 | 87,391.72 |
| KANSAS CITY SOUTHERN | 675 | 217.58 | 146,866.50 |
| KNIGHT-SWIFT TRANSPORTATION | 1,395 | 43.71 | 60,975.45 |
| NORFOLK SOUTHERN CORP | 1,489 | 244.22 | 363,643.58 |
| OLD DOMINION FREIGHT LINE INC | 734 | 204.61 | 150,183.74 |
| SOUTHWEST AIRLINES CO | 1,796 | 47.39 | 85,112.44 |
| UBER TECHNOLOGIES INC | 6,655 | 54.31 | 361,433.05 |
| UNION PACIFIC CORP | 4,060 | 207.13 | 840,947.80 |
| UNITED PARCEL SERVICE CL B | 4,506 | 158.99 | 716,408.94 |
| APTIV PLC | 1,917 | 139.49 | 267,402.33 |
| AUTOLIV INC | 767 | 88.50 | 67,879.50 |
| BORGWARNER INC | 1,944 | 42.80 | 83,203.20 |
| FORD MOTOR CO | 25,195 | 11.52 | 290,246.40 |
| GENERAL MOTORS CO | 8,381 | 55.40 | 464,307.40 |
| LEAR CORP | 429 | 167.08 | 71,677.32 |
| TESLA INC | 4,741 | 846.64 | 4,013,920.24 |
| DR HORTON INC | 2,579 | 77.71 | 200,414.09 |
| GARMIN LTD | 1,120 | 123.83 | 138,689.60 |
| HASBRO INC | 983 | 97.48 | 95,822.84 |
| LENNAR CORP-CL A | 2,218 | 84.62 | 187,687.16 |
| LULULEMON ATHLETICA INC | 852 | 346.37 | 295,107.24 |
| MOHAWK INDUSTRIES INC | 453 | 149.77 | 67,845.81 |
| NEWELL BRANDS INC | 3,978 | 24.80 | 98,654.40 |
| NIKE INC -CL B | 7,926 | 139.35 | 1,104,488.10 |
| NVR INC | 26 | 4,485.91 | 116,633.66 |
| PULTE HOMES INC | 2,335 | 48.89 | 114,158.15 |
| VF CORP | 2,158 | 83.86 | 180,969.88 |
| WHIRLPOOL CORP | 589 | 198.21 | 116,745.69 |
| ARAMARK | 2,613 | 35.46 | 92,656.98 |
| CHIPOTLE MEXICAN GRILL-CL A | 201 | 1,494.18 | 300,330.18 |
| DARDEN RESTAURANTS INC | 1,202 | 121.98 | 146,619.96 |
| DOMINO'S PIZZA INC | 314 | 380.37 | 119,436.18 |
| HILTON WORLDWIDE HOLDINGS IN | 2,148 | 104.96 | 225,454.08 |
| LAS VEGAS SANDS CORP | 2,749 | 54.18 | 148,940.82 |
| MARRIOTT INTERNATIONAL-CL A | 2,094 | 122.90 | 257,352.60 |
| MCDONALD'S CORP | 4,613 | 213.38 | 984,321.94 |
| STARBUCKS CORP | 7,783 | 103.91 | 808,731.53 |
| VAIL RESORTS INC | 393 | 271.59 | 106,734.87 |
| YUM! BRANDS INC | 1,698 | 107.09 | 181,838.82 |
| ACTIVISION BLIZZARD INC | 5,273 | 94.43 | 497,929.39 |

| | | | |
|-------------------------------|--------|----------|--------------|
| ALPHABET INC-CL A | 1,912 | 1,892.56 | 3,618,574.72 |
| ALPHABET INC-CL C | 1,889 | 1,901.05 | 3,591,083.45 |
| CHARTER COMMUNICATIONS INC-A | 973 | 646.69 | 629,229.37 |
| COMCAST CORP-CL A | 28,493 | 48.68 | 1,387,039.24 |
| DISCOVERY INC-A | 2,388 | 37.49 | 89,526.12 |
| DISCOVERY INC-C | 3,006 | 32.89 | 98,867.34 |
| DISH NETWORK CORPORATION | 2,098 | 30.72 | 64,450.56 |
| ELECTRONIC ARTS INC | 1,920 | 146.00 | 280,320.00 |
| FACEBOOK INC-A | 15,280 | 274.50 | 4,194,360.00 |
| FOX CORP-CLASS A | 2,638 | 30.16 | 79,562.08 |
| FOX CORP-CLASS B | 2,295 | 29.17 | 66,945.15 |
| IAC/INTERACTIVECORP | 743 | 200.52 | 148,986.36 |
| INTERPUBLIC GROUP COS INC | 4,164 | 24.58 | 102,351.12 |
| LIBERTY BROADBAND-C | 1,288 | 154.57 | 199,086.16 |
| LIBERTY MEDIA COR-SIRIUSXM C | 2,143 | 40.38 | 86,534.34 |
| MATCH GROUP INC | 1,853 | 141.00 | 261,273.00 |
| NETFLIX INC | 2,840 | 565.17 | 1,605,082.80 |
| NEWS CORP/NEW-CL A-W/I | 4,634 | 18.57 | 86,053.38 |
| PINTEREST INC- CLASS A | 3,542 | 73.08 | 258,849.36 |
| ROKU INC | 799 | 422.85 | 337,857.15 |
| SNAP INC - A | 6,621 | 53.57 | 354,686.97 |
| TAKE-TWO INTERACTIVE SOFTWARE | 918 | 204.66 | 187,877.88 |
| THE WALT DISNEY CO | 11,640 | 172.78 | 2,011,159.20 |
| TWITTER INC | 5,800 | 48.06 | 278,748.00 |
| VIACOMCBS INC-CLASS B | 4,597 | 45.58 | 209,531.26 |
| ADVANCE AUTO PARTS | 585 | 163.76 | 95,799.60 |
| AMAZON.COM INC | 2,688 | 3,292.23 | 8,849,514.24 |
| AUTOZONE INC | 142 | 1,227.16 | 174,256.72 |
| BEST BUY COMPANY INC | 1,761 | 114.93 | 202,391.73 |
| BOOKING HOLDINGS INC | 262 | 2,066.24 | 541,354.88 |
| CARMAX INC | 1,504 | 118.64 | 178,434.56 |
| Dollar General Corp | 1,623 | 206.21 | 334,678.83 |
| DOLLAR TREE INC | 1,671 | 107.88 | 180,267.48 |
| EBAY INC | 4,593 | 56.46 | 259,320.78 |
| EXPEDIA GROUP INC | 1,145 | 136.52 | 156,315.40 |
| GENUINE PARTS CO | 1,224 | 101.64 | 124,407.36 |
| HOME DEPOT INC | 6,729 | 284.00 | 1,911,036.00 |
| LKQ CORP | 2,886 | 37.15 | 107,214.90 |
| LOWE'S COMPANIES | 4,952 | 172.40 | 853,724.80 |
| MERCADOLIBRE INC | 309 | 1,965.05 | 607,200.45 |
| O'REILLY AUTOMOTIVE INC | 459 | 457.31 | 209,905.29 |
| ROSS STORES INC | 2,378 | 113.33 | 269,498.74 |

| | | | |
|---------------------------------|--------|--------|--------------|
| TARGET CORP | 3,240 | 191.91 | 621,788.40 |
| TJX COMPANIES INC | 7,780 | 66.91 | 520,559.80 |
| TRACTOR SUPPLY COMPANY | 1,051 | 155.62 | 163,556.62 |
| ULTA BEAUTY INC | 443 | 299.92 | 132,864.56 |
| COSTCO WHOLESALE CORP | 2,767 | 362.30 | 1,002,484.10 |
| KROGER CO | 4,503 | 33.56 | 151,120.68 |
| SYSCO CORP | 3,231 | 75.19 | 242,938.89 |
| WALGREENS BOOTS ALLIANCE INC | 4,386 | 47.45 | 208,115.70 |
| WALMART INC | 8,849 | 146.33 | 1,294,874.17 |
| ALTRIA GROUP INC | 11,054 | 41.83 | 462,388.82 |
| ARCHER-DANIELS-MIDLAND CO | 2,832 | 52.82 | 149,586.24 |
| BROWN-FORMAN CORP-CLASS B | 1,817 | 72.84 | 132,350.28 |
| BUNGE LIMITED | 1,508 | 68.60 | 103,448.80 |
| CAMPBELL SOUP CO | 1,620 | 46.58 | 75,459.60 |
| COCA-COLA COMPANY | 24,879 | 48.49 | 1,206,382.71 |
| COCA-COLA EUROPEAN PARTNERS | 1,516 | 47.85 | 72,540.60 |
| CONAGRA BRANDS INC | 3,627 | 34.38 | 124,696.26 |
| CONSTELLATION BRANDS INC-A | 1,035 | 226.91 | 234,851.85 |
| GENERAL MILS INC | 3,494 | 55.97 | 195,559.18 |
| HERSHEY CO/THE | 894 | 148.20 | 132,490.80 |
| HORMEL FOODS CORP | 2,167 | 45.41 | 98,403.47 |
| JM SMUCKER CO/THE-NEW COM | 830 | 114.24 | 94,819.20 |
| KELLOGG CO | 1,621 | 58.30 | 94,504.30 |
| KEURIG DR PEPPER INC | 4,747 | 31.47 | 149,388.09 |
| KRAFT HEINZ CO/THE | 4,438 | 32.91 | 146,054.58 |
| LAMB WESTON HOLDING INC | 1,227 | 78.15 | 95,890.05 |
| MCCORMICK & CO-NON VTG SHRS | 1,811 | 91.87 | 166,376.57 |
| MOLSON COORS BEVERAGE COMPANY-B | 1,742 | 50.52 | 88,005.84 |
| MONDELEZ INTERNATIONAL INC | 8,236 | 56.25 | 463,275.00 |
| MONSTER BEVERAGE CORP | 2,314 | 88.20 | 204,094.80 |
| PEPSICO INC | 8,420 | 138.59 | 1,166,927.80 |
| PHILIP MORRIS INTERNATIONAL | 9,561 | 80.68 | 771,381.48 |
| TYSON FOODS INC-CL A | 2,005 | 66.52 | 133,372.60 |
| CHURCH & DWIGHT CO INC | 1,936 | 84.92 | 164,405.12 |
| CLOROX COMPANY | 842 | 202.35 | 170,378.70 |
| COLGATE-PALMOLIVE CO | 4,710 | 78.19 | 368,274.90 |
| ESTEE LAUDER COMPANIES-CL A | 1,470 | 249.83 | 367,250.10 |
| KIMBERLY-CLARK CORP | 1,952 | 132.21 | 258,073.92 |
| PROCTER & GAMBLE CO | 15,461 | 130.00 | 2,009,930.00 |
| ABBOTT LABORATORIES | 11,475 | 112.84 | 1,294,839.00 |
| ABIOMED INC | 422 | 347.90 | 146,813.80 |
| ALIGN TECHNOLOGY INC | 533 | 534.08 | 284,664.64 |

| | | | |
|----------------------------------|--------|--------|--------------|
| AMERISOURCEBERGEN CORP | 1,425 | 107.76 | 153,558.00 |
| ANTHEM INC | 1,596 | 314.09 | 501,287.64 |
| BAXTER INTL INC | 2,847 | 79.51 | 226,364.97 |
| BECTON DICKINSON & CO | 1,830 | 258.75 | 473,512.50 |
| BOSTON SCIENTIFIC CORP | 8,313 | 37.03 | 307,830.39 |
| CARDINAL HEALTH INC | 2,527 | 55.39 | 139,970.53 |
| CENTENE CORP | 3,873 | 61.51 | 238,228.23 |
| CERNER CORP | 1,495 | 79.90 | 119,450.50 |
| CIGNA CORP | 2,424 | 223.42 | 541,570.08 |
| COOPER COS INC/THE | 367 | 380.00 | 139,460.00 |
| CVS HEALTH CORPORATION | 8,347 | 74.12 | 618,679.64 |
| DANAHER CORP | 4,223 | 238.04 | 1,005,242.92 |
| DAVITA INC | 853 | 119.59 | 102,010.27 |
| DENTSPLY SIRONA INC | 2,102 | 57.23 | 120,297.46 |
| DEXCOM INC | 702 | 370.12 | 259,824.24 |
| Edwards Lifesciences Corp | 3,997 | 85.52 | 341,823.44 |
| HCA HEALTHCARE INC | 1,782 | 166.97 | 297,540.54 |
| HUMANA INC | 836 | 405.18 | 338,730.48 |
| IDEXX LABORATORIES INC | 626 | 492.86 | 308,530.36 |
| INTUITIVE SURGICAL INC | 769 | 744.08 | 572,197.52 |
| LABORATORY CRP OF AMER HLDGS | 743 | 228.90 | 170,072.70 |
| MASIMO CORP | 478 | 263.68 | 126,039.04 |
| MCKESSON CORP | 1,102 | 185.01 | 203,881.02 |
| MEDTRONIC PLC | 8,224 | 116.58 | 958,753.92 |
| QUEST DIAGNOSTICS | 998 | 124.46 | 124,211.08 |
| RESMED INC | 1,067 | 215.52 | 229,959.84 |
| STERIS PLC | 772 | 188.76 | 145,722.72 |
| STRYKER CORP | 2,171 | 239.93 | 520,888.03 |
| TELEFLEX INC | 363 | 386.44 | 140,277.72 |
| UNITEDHEALTH GROUP INC | 6,018 | 347.55 | 2,091,555.90 |
| UNIVERSAL HEALTH SERVICES INC | 544 | 129.10 | 70,230.40 |
| VARIAN MEDICAL SYSTEMS INC | 705 | 175.47 | 123,706.35 |
| VEEVA SYSTEMS INC-CLASS A | 1,013 | 288.69 | 292,442.97 |
| WEST PHARMACEUTICAL SERVICES INC | 597 | 300.09 | 179,153.73 |
| ZIMMER BIOMET HOLDINGS INC | 1,284 | 161.01 | 206,736.84 |
| ABBVIE INC | 11,322 | 110.86 | 1,255,156.92 |
| AGILENT TECHNOLOGIES INC | 2,159 | 126.33 | 272,746.47 |
| ALEXION PHARMACEUTICALS INC | 1,567 | 159.73 | 250,296.91 |
| ALNYLAM PHARMACEUTICALS INC | 1,078 | 172.38 | 185,825.64 |
| AMGEN INC | 3,642 | 253.50 | 923,247.00 |
| BIOGEN INC | 978 | 269.44 | 263,512.32 |
| BIOMARIN PHARMACEUTICAL INC | 1,635 | 87.99 | 143,863.65 |

| | | | |
|----------------------------------|--------|----------|--------------|
| BRISTOL-MYERS SQUIBB CO | 14,674 | 64.56 | 947,353.44 |
| ELI LILLY & CO | 5,694 | 206.14 | 1,173,761.16 |
| GILEAD SCIENCES INC | 7,616 | 66.94 | 509,815.04 |
| ILLUMINA INC | 988 | 406.25 | 401,375.00 |
| INCYTE CORP | 1,603 | 97.89 | 156,917.67 |
| IQVIA HOLDINGS INC | 1,393 | 185.59 | 258,526.87 |
| JOHNSON & JOHNSON | 16,393 | 163.55 | 2,681,075.15 |
| MERCK & CO. INC. | 15,753 | 80.98 | 1,275,677.94 |
| METTLER-TOLEDO INTERNATIONAL INC | 180 | 1,234.72 | 222,249.60 |
| MODERNA INC | 2,056 | 131.02 | 269,377.12 |
| NEUROCRINE BIOSCIENCES INC | 970 | 116.91 | 113,402.70 |
| PERKINELMER INC | 1,010 | 151.91 | 153,429.10 |
| PERRIGO CO PLC | 1,378 | 43.29 | 59,653.62 |
| PFIZER INC | 35,881 | 36.55 | 1,311,450.55 |
| Regeneron Pharmaceuticals Inc | 707 | 537.78 | 380,210.46 |
| SEAGEN INC | 1,031 | 182.75 | 188,415.25 |
| THERMO FISHER SCIENTIFIC INC | 2,588 | 514.60 | 1,331,784.80 |
| VERTEX PHARMACEUTICALS INC | 1,835 | 237.59 | 435,977.65 |
| VIATRIS INC | 8,529 | 17.43 | 148,660.47 |
| WATERS CORP | 483 | 273.62 | 132,158.46 |
| ZOETIS INC | 3,189 | 163.33 | 520,859.37 |
| BANK OF AMERICA CORP | 48,277 | 31.55 | 1,523,139.35 |
| CITIGROUP INC | 12,956 | 61.33 | 794,591.48 |
| CITIZENS FINANCIAL GROUP | 3,494 | 38.39 | 134,134.66 |
| FIFTH THIRD BANCORP | 5,086 | 30.90 | 157,157.40 |
| FIRST REPUBLIC BANK/CA | 951 | 156.53 | 148,860.03 |
| HUNTINGTON BANCSHARES INC | 9,949 | 13.84 | 137,694.16 |
| JPMORGAN CHASE & CO | 18,921 | 133.79 | 2,531,440.59 |
| KEYCORP | 7,712 | 18.20 | 140,358.40 |
| M & T BANK CORP | 645 | 143.16 | 92,338.20 |
| PNC FINANCIAL SERVICES GROUP | 2,378 | 152.57 | 362,811.46 |
| REGIONS FINANCIAL CORP | 7,445 | 17.74 | 132,074.30 |
| SVB FINANCIAL GROUP | 384 | 480.15 | 184,377.60 |
| TRUIST FINANCIAL CORP | 7,877 | 51.18 | 403,144.86 |
| US BANCORP | 8,521 | 45.86 | 390,773.06 |
| WELLS FARGO & COMPANY | 23,484 | 31.90 | 749,139.60 |
| AMERICAN EXPRESS COMPANY | 4,238 | 126.14 | 534,581.32 |
| AMERIPRISE FINANCIAL INC | 941 | 211.79 | 199,294.39 |
| APOLLO GLOBAL MANAGEMENT INC | 1,948 | 46.43 | 90,445.64 |
| BANK OF NEW YORK MELLON CORP | 4,368 | 41.93 | 183,150.24 |
| BERKSHIRE HATHAWAY INC-CL B | 8,639 | 232.92 | 2,012,195.88 |
| BLACKROCK INC | 948 | 735.05 | 696,827.40 |

| | | | |
|-------------------------------|--------|--------|------------|
| BLACKSTONE GROUP INC/THE-A | 4,243 | 65.03 | 275,922.29 |
| CAPITAL ONE FINANCIAL CORP | 2,934 | 105.34 | 309,067.56 |
| CBOE GLOBAL MARKETS INC | 842 | 95.20 | 80,158.40 |
| CME GROUP INC | 2,136 | 184.04 | 393,109.44 |
| DISCOVER FINANCIAL SERVICES | 2,313 | 92.27 | 213,420.51 |
| EQUITABLE HOLDINGS INC | 4,005 | 26.92 | 107,814.60 |
| FACTSET RESEARCH SYSTEMS INC | 283 | 320.23 | 90,625.09 |
| FRANKLIN RESOURCES INC | 2,352 | 26.47 | 62,257.44 |
| GOLDMAN SACHS GROUP INC | 1,974 | 289.39 | 571,255.86 |
| INTERCONTINENTAL EXCHANGE INC | 3,259 | 111.92 | 364,747.28 |
| INVESCO LTD | 4,866 | 20.97 | 102,040.02 |
| KKR & CO INC | 4,288 | 40.20 | 172,377.60 |
| MARKETAXESS HOLDINGS INC | 304 | 509.70 | 154,948.80 |
| MOODY'S CORP | 1,019 | 266.70 | 271,767.30 |
| MORGAN STANLEY | 8,745 | 74.13 | 648,266.85 |
| MSCI INC | 589 | 411.88 | 242,597.32 |
| NASDAQ INC | 976 | 140.42 | 137,049.92 |
| NORTHERN TRUST CORP | 1,426 | 94.60 | 134,899.60 |
| RAYMOND JAMES FINANCIAL INC | 1,066 | 102.04 | 108,774.64 |
| S&P GLOBAL INC | 1,418 | 315.14 | 446,868.52 |
| SCHWAB (CHARLES) CORP | 10,013 | 58.40 | 584,759.20 |
| SEI INVESTMENTS COMPANY | 754 | 59.40 | 44,787.60 |
| STATE STREET CORP | 2,059 | 74.17 | 152,716.03 |
| SYNCHRONY FINANCIAL | 4,352 | 37.37 | 162,634.24 |
| T ROWE PRICE GROUP INC | 1,298 | 156.21 | 202,760.58 |
| VOYA FINANCIAL INC | 1,252 | 57.78 | 72,340.56 |
| AFLAC INC | 3,240 | 46.43 | 150,433.20 |
| ALLEGHANY CORP | 84 | 585.38 | 49,171.92 |
| ALLSTATE CORP | 1,558 | 110.43 | 172,049.94 |
| AMERICAN FINANCIAL GROUP INC | 776 | 84.84 | 65,835.84 |
| AMERICAN INTERNATIONAL GROUP | 5,516 | 40.08 | 221,081.28 |
| AON PLC | 1,307 | 206.46 | 269,843.22 |
| ARTHUR J GALLAGHER & CO | 1,414 | 117.84 | 166,625.76 |
| ASSURANT INC | 636 | 134.90 | 85,796.40 |
| ATHENE HOLDING LTD-CLASS A | 1,628 | 43.29 | 70,476.12 |
| CHUBB LTD | 2,759 | 152.53 | 420,830.27 |
| CINCINNATI FINANCIAL CORP | 1,137 | 87.32 | 99,282.84 |
| EVEREST RE GROUP LTD | 314 | 228.92 | 71,880.88 |
| FIDELITY NATIONAL FINANCIAL | 1,746 | 39.44 | 68,862.24 |
| GLOBE LIFE INC | 632 | 94.34 | 59,622.88 |
| HARTFORD FINANCIAL SVCS GRP | 2,281 | 50.37 | 114,893.97 |
| LINCOLN NATIONAL CORP | 1,993 | 50.70 | 101,045.10 |

| | | | |
|--|--------|--------|---------------|
| LOEWS CORP | 1,994 | 46.49 | 92,701.06 |
| MARSH & MCLENNAN COS | 2,883 | 111.52 | 321,512.16 |
| METLIFE INC | 4,074 | 50.86 | 207,203.64 |
| PRINCIPAL FINANCIAL GROUP | 2,370 | 53.46 | 126,700.20 |
| PROGRESSIVE CORP | 3,606 | 92.31 | 332,869.86 |
| PRUDENTIAL FINANCIAL INC | 2,110 | 82.62 | 174,328.20 |
| REINSURANCE GROUP OF AMERICA | 587 | 110.18 | 64,675.66 |
| RENAISSANCERE HOLDINGS LTD | 421 | 155.04 | 65,271.84 |
| TRAVELERS COS INC/THE | 1,314 | 145.84 | 191,633.76 |
| WILLIS TOWERS WATSON PLC | 743 | 206.50 | 153,429.50 |
| WR BERKLEY CORP | 1,001 | 65.88 | 65,945.88 |
| CBRE GROUP INC - A | 2,401 | 66.02 | 158,514.02 |
| ACCENTURE PLC-CL A | 3,995 | 254.77 | 1,017,806.15 |
| ADOBE INC | 3,115 | 472.44 | 1,471,650.60 |
| AKAMA I TECHNOLOGIES | 1,376 | 109.06 | 150,066.56 |
| ANSYS INC | 638 | 374.57 | 238,975.66 |
| AUTODESK INC | 1,531 | 299.17 | 458,029.27 |
| AUTOMATIC DATA PROCESSING | 2,672 | 161.98 | 432,810.56 |
| BLACK KNIGHT INC | 1,493 | 82.30 | 122,873.90 |
| BROADRIDGE FINANCIAL SOLUTIONS | 972 | 148.94 | 144,769.68 |
| CADENCE DESIGN SYS INC | 2,035 | 137.42 | 279,649.70 |
| CHECK POINT SOFTWARE TECH | 960 | 129.40 | 124,224.00 |
| CITRIX SYSTEMS INC | 890 | 126.75 | 112,807.50 |
| COGNIZANT TECH SOLUTIONS-A | 3,394 | 80.56 | 273,420.64 |
| COUPA SOFTWARE INC | 555 | 341.90 | 189,754.50 |
| CROWDSTRIKE HOLDINGS INC-A | 1,145 | 223.52 | 255,930.40 |
| DOCUSIGN INC | 1,299 | 255.15 | 331,439.85 |
| EPAM SYSTEMS INC | 462 | 359.69 | 166,176.78 |
| FIDELITY NATIONAL INFORMATION SERVICES | 3,958 | 129.08 | 510,898.64 |
| FISERV INC | 3,718 | 107.28 | 398,867.04 |
| FLEETCOR TECHNOLOGIES INC | 661 | 267.41 | 176,758.01 |
| FORTINET INC | 1,165 | 151.23 | 176,182.95 |
| GARTNER INC | 843 | 160.41 | 135,225.63 |
| GLOBAL PAYMENTS INC | 2,011 | 187.52 | 377,102.72 |
| GODADDY INC - CLASS A | 1,595 | 83.75 | 133,581.25 |
| INTL BUSINESS MACHINES CORP | 5,255 | 118.61 | 623,295.55 |
| INTUIT INC | 1,730 | 374.85 | 648,490.50 |
| JACK HENRY & ASSOCIATES INC | 556 | 151.50 | 84,234.00 |
| LEIDOS HOLDINGS INC | 1,220 | 112.05 | 136,701.00 |
| MASTERCARD INC-CLASS A | 5,642 | 328.99 | 1,856,161.58 |
| MICROSOFT CORP | 45,369 | 225.95 | 10,251,125.55 |

| | | | |
|------------------------------|---------|--------|---------------|
| NORTONLIFELOCK INC | 4,947 | 20.67 | 102,254.49 |
| OKTA INC | 933 | 264.00 | 246,312.00 |
| ORACLE CORPORATION | 12,449 | 60.36 | 751,421.64 |
| PALO ALTO NETWORKS INC | 721 | 364.62 | 262,891.02 |
| PAYCHEX INC | 1,841 | 86.87 | 159,927.67 |
| PAYCOM SOFTWARE INC | 417 | 409.80 | 170,886.60 |
| PAYPAL HOLDINGS INC | 7,222 | 252.00 | 1,819,944.00 |
| RINGCENTRAL INC-CLASS A | 582 | 384.52 | 223,790.64 |
| SALESFORCE.COM INC | 5,937 | 225.77 | 1,340,396.49 |
| SERVICENOW INC | 1,293 | 541.09 | 699,629.37 |
| SPLUNK INC | 1,254 | 170.90 | 214,308.60 |
| SQUARE INC - A | 2,541 | 222.88 | 566,338.08 |
| SS&C TECHNOLOGIES HOLDINGS | 2,089 | 67.51 | 141,028.39 |
| SYNOPSYS INC | 1,131 | 270.14 | 305,528.34 |
| TRADE DESK INC/THE -CLASS A | 320 | 812.96 | 260,147.20 |
| TWILIO INC - A | 956 | 392.01 | 374,761.56 |
| VERISIGN INC | 828 | 194.75 | 161,253.00 |
| VISA INC-CLASS A SHARES | 10,489 | 202.02 | 2,118,987.78 |
| VMWARE INC-CLASS A | 719 | 134.50 | 96,705.50 |
| WESTERN UNION CO | 3,375 | 22.06 | 74,452.50 |
| WORKDAY INC-CLASS A | 1,310 | 235.53 | 308,544.30 |
| ZOOM VIDEO COMMUNICATIONS-A | 1,214 | 383.40 | 465,447.60 |
| AMPHENOL CORP-CL A | 1,656 | 132.24 | 218,989.44 |
| APPLE INC | 107,792 | 139.07 | 14,990,633.44 |
| ARISTA NETWORKS INC | 460 | 311.21 | 143,156.60 |
| CDW CORP/DE | 1,024 | 135.32 | 138,567.68 |
| CISCO SYSTEMS INC | 25,603 | 44.77 | 1,146,246.31 |
| COGNEX CORP | 1,542 | 84.37 | 130,098.54 |
| CORNING INC | 4,607 | 37.60 | 173,223.20 |
| F5 NETWORKS INC | 475 | 204.32 | 97,052.00 |
| HEWLETT PACKARD ENTERPRISE | 10,005 | 12.14 | 121,460.70 |
| HP INC | 9,017 | 25.27 | 227,859.59 |
| JUNIPER NETWORKS INC | 1,951 | 25.04 | 48,853.04 |
| KEYSIGHT TECHNOLOGIES INC | 1,294 | 145.16 | 187,837.04 |
| MOTOROLA SOLUTIONS INC | 1,005 | 173.71 | 174,578.55 |
| NETAPP INC | 1,685 | 64.76 | 109,120.60 |
| SEAGATE TECHNOLOGY | 1,744 | 60.00 | 104,640.00 |
| TE CONNECTIVITY LTD | 1,993 | 128.39 | 255,881.27 |
| TRIMBLE INC | 2,188 | 70.76 | 154,822.88 |
| WESTERN DIGITAL CORP | 2,254 | 50.71 | 114,300.34 |
| ZEBRA TECHNOLOGIES CORP-CL A | 432 | 408.84 | 176,618.88 |
| AT&T INC | 43,401 | 28.93 | 1,255,590.93 |

| | | | |
|------------------------------|--------|--------|--------------|
| T-MOBILE US INC | 3,789 | 130.36 | 493,934.04 |
| VERIZON COMMUNICATIONS INC | 25,328 | 57.47 | 1,455,600.16 |
| ALLIANT ENERGY CORP | 2,154 | 49.41 | 106,429.14 |
| AMEREN CORPORATION | 1,516 | 72.88 | 110,486.08 |
| AMERICAN ELECTRIC POWER | 2,647 | 82.08 | 217,265.76 |
| AMERICAN WATER WORKS CO INC | 1,268 | 160.91 | 204,033.88 |
| ATMOS ENERGY CORP | 1,131 | 89.09 | 100,760.79 |
| CENTERPOINT ENERGY INC | 4,636 | 21.44 | 99,395.84 |
| CMS ENERGY CORP | 2,295 | 58.41 | 134,050.95 |
| CONSOLIDATED EDISON INC | 1,834 | 68.83 | 126,234.22 |
| DOMINION ENERGY INC | 4,816 | 72.29 | 348,148.64 |
| DTE ENERGY COMPANY | 1,319 | 121.91 | 160,799.29 |
| DUKE ENERGY CORP | 4,352 | 90.29 | 392,942.08 |
| EDISON INTERNATIONAL | 2,669 | 59.30 | 158,271.70 |
| ENERGY CORP | 1,494 | 93.97 | 140,391.18 |
| ESSENTIAL UTILITIES INC | 2,195 | 45.46 | 99,784.70 |
| EVERGY INC | 2,221 | 53.80 | 119,489.80 |
| EVERSOURCE ENERGY | 2,137 | 87.41 | 186,795.17 |
| EXELON CORP | 5,157 | 42.54 | 219,378.78 |
| FIRSTENERGY CORP | 4,245 | 31.27 | 132,741.15 |
| NEXTERA ENERGY INC | 12,598 | 84.21 | 1,060,877.58 |
| NISOURCE INC | 4,019 | 21.93 | 88,136.67 |
| NRG ENERGY INC | 1,629 | 41.53 | 67,652.37 |
| OGE ENERGY CORP | 1,777 | 31.36 | 55,726.72 |
| PINNACLE WEST CAPITAL | 885 | 77.09 | 68,224.65 |
| PPL CORPORATION | 4,834 | 27.82 | 134,481.88 |
| PUBLIC SERVICE ENTERPRISE GP | 2,837 | 58.36 | 165,567.32 |
| SEMPRA ENERGY | 1,679 | 121.45 | 203,914.55 |
| SOUTHERN CO | 6,567 | 60.14 | 394,939.38 |
| WEC ENERGY GROUP INC | 1,933 | 87.38 | 168,905.54 |
| XCEL ENERGY INC | 2,986 | 64.76 | 193,373.36 |
| ADVANCED MICRO DEVICES | 7,783 | 92.79 | 722,184.57 |
| ANALOG DEVICES | 2,358 | 155.58 | 366,857.64 |
| APPLIED MATERIALS INC | 6,268 | 106.33 | 666,476.44 |
| BROADCOM INC | 2,639 | 465.02 | 1,227,187.78 |
| INTEL CORP | 26,350 | 56.66 | 1,492,991.00 |
| KLA CORPORATION | 1,151 | 305.01 | 351,066.51 |
| LAM RESEARCH CORP | 1,011 | 563.85 | 570,052.35 |
| MARVELL TECHNOLOGY GROUP LTD | 4,920 | 52.62 | 258,890.40 |
| MAXIM INTEGRATED PRODUCTS | 2,071 | 93.62 | 193,887.02 |
| MICROCHIP TECHNOLOGY INC | 1,853 | 150.13 | 278,190.89 |
| MICRON TECHNOLOGY INC | 7,420 | 82.28 | 610,517.60 |

| | | | |
|------------------------------|-----------|--------|------------------------------------|
| NVIDIA CORP | 3,974 | 548.50 | 2,179,739.00 |
| NXP SEMICONDUCTORS NV | 1,905 | 172.30 | 328,231.50 |
| QUALCOMM INC | 7,338 | 162.42 | 1,191,837.96 |
| SKYWORKS SOLUTIONS INC | 1,085 | 161.27 | 174,977.95 |
| TEXAS INSTRUMENTS | 5,638 | 172.81 | 974,302.78 |
| XILINX INC | 1,763 | 142.94 | 252,003.22 |
| 米ドル小計 | 1,912,606 | | 213,056,290.44 (22,123,765,199) |
| | 銘柄数 | 490 | |
| | 比率 | 68.0% | 71.6% |
| 加ドル | 株 | 加ドル | 加ドル |
| CAMECO CORP | 6,066 | 15.75 | 95,539.50 |
| CANADIAN NATURAL RESOURCES | 8,154 | 30.96 | 252,447.84 |
| CENOVUS ENERGY INC | 14,587 | 7.47 | 108,964.89 |
| ENBRIDGE INC | 12,756 | 44.16 | 563,304.96 |
| IMPERIAL OIL LTD | 3,892 | 25.61 | 99,674.12 |
| INTER PIPELINE LTD | 6,496 | 13.29 | 86,331.84 |
| KEYERA CORP | 3,726 | 25.23 | 94,006.98 |
| PEMBINA PIPELINE CORP | 4,889 | 35.33 | 172,728.37 |
| SUNCOR ENERGY INC | 10,573 | 22.53 | 238,209.69 |
| TC ENERGY CORP | 5,425 | 56.39 | 305,915.75 |
| AGNICO EAGLE MINES LTD | 2,057 | 89.94 | 185,006.58 |
| BARRICK GOLD CORP | 12,484 | 29.85 | 372,647.40 |
| CCL INDUSTRIES INC - CL B | 1,641 | 60.44 | 99,182.04 |
| FRANCO-NEVADA CORP | 1,432 | 157.07 | 224,924.24 |
| KIRKLAND LAKE GOLD LTD | 2,424 | 51.10 | 123,866.40 |
| NUTRIEN LTD | 3,764 | 67.06 | 252,413.84 |
| WHEATON PRECIOUS METALS CORP | 3,710 | 51.47 | 190,953.70 |
| CAE INC | 3,268 | 29.92 | 97,778.56 |
| THOMSON REUTERS CORP | 1,365 | 103.72 | 141,577.80 |
| CANADIAN NATL RAILWAY CO | 4,070 | 136.00 | 553,520.00 |
| CANADIAN PACIFIC RAILWAY LTD | 770 | 431.71 | 332,416.70 |
| MAGNA INTERNATIONAL INC | 2,082 | 96.79 | 201,516.78 |
| GILDAN ACTIVEWEAR INC | 2,535 | 33.34 | 84,516.90 |
| RESTAURANT BRANDS INTERN | 2,560 | 76.44 | 195,686.40 |
| SHAW COMMUNICATIONS INC-B | 4,547 | 22.27 | 101,261.69 |
| CANADIAN TIRE CORP -CL A | 672 | 170.88 | 114,831.36 |
| DOLLARAMA INC | 2,773 | 51.57 | 143,003.61 |
| ALIMENTATION COUCHE-TARD INC | 5,217 | 37.95 | 197,985.15 |
| LOBLAW COMPANIES LTD | 1,545 | 63.35 | 97,875.75 |
| METRO INC | 2,211 | 57.06 | 126,159.66 |
| WESTON (GEORGE) LTD | 737 | 93.26 | 68,732.62 |

| | | | | |
|------------------------------|---------|----------|----------------------------------|--|
| SAPUTO INC | 1,930 | 35.86 | 69,209.80 | |
| BANK OF MONTREAL | 3,815 | 97.60 | 372,344.00 | |
| BANK OF NOVA SCOTIA | 6,800 | 69.40 | 471,920.00 | |
| CAN IMPERIAL BK OF COMMERCE | 2,390 | 111.06 | 265,433.40 | |
| NATIONAL BANK OF CANADA | 2,431 | 73.55 | 178,800.05 | |
| ROYAL BANK OF CANADA | 8,429 | 107.36 | 904,937.44 | |
| TORONTO-DOMINION BANK | 10,578 | 73.58 | 778,329.24 | |
| BROOKFIELD ASSET MANAGE-CL A | 8,789 | 48.91 | 429,869.99 | |
| IGM FINANCIAL INC | 1,880 | 35.37 | 66,495.60 | |
| FAIRFAX FINANCIAL HLDGS LTD | 205 | 451.53 | 92,563.65 | |
| GREAT-WEST LIFECO INC | 2,531 | 30.31 | 76,714.61 | |
| INTACT FINANCIAL CORP | 1,196 | 145.24 | 173,707.04 | |
| MANULIFE FINANCIAL CORP | 11,129 | 24.15 | 268,765.35 | |
| POWER CORP OF CANADA | 5,156 | 30.89 | 159,268.84 | |
| SUN LIFE FINANCIAL INC | 2,997 | 60.73 | 182,007.81 | |
| CGI INC | 1,613 | 100.53 | 162,154.89 | |
| CONSTELLATION SOFTWARE INC | 149 | 1,624.05 | 241,983.45 | |
| OPEN TEXT CORP | 2,689 | 59.59 | 160,237.51 | |
| SHOPIFY INC - CLASS A | 723 | 1,522.54 | 1,100,796.42 | |
| BCE INC | 1,581 | 54.74 | 86,543.94 | |
| ROGERS COMMUNICATIONS -CL B | 2,811 | 61.51 | 172,904.61 | |
| TELUS CORP | 1,600 | 26.44 | 42,304.00 | |
| CANADIAN UTILITIES LTD-A | 2,440 | 32.11 | 78,348.40 | |
| EMERA INC | 2,485 | 53.25 | 132,326.25 | |
| FORTIS INC | 3,434 | 52.11 | 178,945.74 | |
| HYDRO ONE LTD | 4,027 | 30.13 | 121,333.51 | |
| 加ドル小計 | 232,236 | | 12,891,226.66 (1,052,826,481) | |
| | 銘柄数 | 57 | | |
| | 比率 | 3.2% | 3.4% | |
| ユーロ | 株 | ユーロ | ユーロ | |
| ENI SPA | 15,808 | 8.54 | 135,031.93 | |
| Galp Energia SGPS SA | 4,353 | 8.80 | 38,306.40 | |
| Koninklijke Vopak NV | 567 | 42.06 | 23,848.02 | |
| NESTE OYJ | 2,954 | 62.18 | 183,679.72 | |
| OMV AG | 2,137 | 36.54 | 78,085.98 | |
| REPSOL SA | 11,970 | 8.45 | 101,170.44 | |
| TENARIS SA | 6,446 | 6.29 | 40,545.34 | |
| TOTAL SE | 15,351 | 36.22 | 556,013.22 | |
| AIR LIQUIDE | 2,719 | 132.05 | 359,043.95 | |
| AKZO NOBEL | 1,099 | 86.06 | 94,579.94 | |
| ARCELORMITTAL | 6,163 | 18.64 | 114,890.64 | |

| | | | |
|------------------------------|-------|--------|------------|
| BASF SE | 5,231 | 66.28 | 346,710.68 |
| COVESTRO AG | 1,594 | 55.76 | 88,881.44 |
| CRH PLC(DUBLIN) | 3,929 | 36.12 | 141,915.48 |
| EVONIK INDUSTRIES AG | 1,199 | 26.89 | 32,241.11 |
| FUCHS PETROLUB SE -PREF | 932 | 47.92 | 44,661.44 |
| HEIDELBERGCEMENT AG | 1,098 | 64.62 | 70,952.76 |
| KONINKLIJKE DSM NV | 998 | 147.00 | 146,706.00 |
| LANXESS | 792 | 64.06 | 50,735.52 |
| SOLVAY SA | 641 | 98.28 | 62,997.48 |
| STORA ENSO OYJ-R SHS | 4,118 | 16.13 | 66,443.93 |
| SYMRISE AG | 938 | 101.15 | 94,878.70 |
| UMICORE | 1,549 | 47.56 | 73,670.44 |
| UPM-KYMMENE OYJ | 2,668 | 31.18 | 83,188.24 |
| ACS ACTIVIDADES CONS Y SERV | 2,264 | 27.00 | 61,128.00 |
| ACS ACTIVIDADES DE CONST-RTS | 2,264 | 0.42 | 964.69 |
| AIRBUS SE | 3,912 | 88.83 | 347,502.96 |
| ALSTOM | 2,217 | 47.62 | 105,573.54 |
| BOUYGUES | 1,557 | 34.09 | 53,078.13 |
| BRENNTAG AG | 1,423 | 67.46 | 95,995.58 |
| CNH INDUSTRIAL NV | 9,121 | 11.20 | 102,155.20 |
| COMPAGNIE DE SAINT-GOBAIN | 3,055 | 42.60 | 130,143.00 |
| Eiffage SA | 690 | 76.50 | 52,785.00 |
| FERROVIAL SA | 4,041 | 20.18 | 81,547.38 |
| GEA GROUP AG | 1,851 | 30.23 | 55,955.73 |
| KINGSPAN GROUP PLC | 1,385 | 62.95 | 87,185.75 |
| KONE OYJ-B | 1,818 | 65.14 | 118,424.52 |
| Legrand SA | 1,341 | 79.84 | 107,065.44 |
| MTU AERO ENGINES AG | 472 | 205.10 | 96,807.20 |
| SAFRAN SA | 2,127 | 110.55 | 235,139.85 |
| SCHNEIDER ELECTRIC SE | 3,098 | 125.35 | 388,334.30 |
| SIEMENS AG | 4,784 | 132.80 | 635,315.20 |
| SIEMENS ENERGY AG | 3,702 | 31.89 | 118,056.78 |
| THALES SA | 718 | 75.50 | 54,209.00 |
| VINCI S.A. | 3,021 | 80.46 | 243,069.66 |
| WARTSILA | 4,537 | 8.70 | 39,490.04 |
| Bureau Veritas SA | 2,338 | 22.27 | 52,067.26 |
| RANDSTAD NV | 1,150 | 53.66 | 61,709.00 |
| TELEPERFORMANCE | 478 | 289.80 | 138,524.40 |
| WOLTERS KLUWER | 1,274 | 69.74 | 88,848.76 |
| AENA SME SA | 421 | 130.70 | 55,024.70 |
| Aeroports de Paris | 367 | 94.05 | 34,516.35 |
| DEUTSCHE POST AG | 5,732 | 42.82 | 245,444.24 |

| | | | |
|-------------------------------------|-------|--------|------------|
| GETLINK SE | 4,012 | 13.01 | 52,196.12 |
| BAYERISCHE MOTOREN WERKE AG | 1,995 | 71.25 | 142,143.75 |
| CONTINENTAL AG | 752 | 118.55 | 89,149.60 |
| DAIMLER AG | 5,702 | 59.07 | 336,817.14 |
| FERRARI NV | 819 | 174.85 | 143,202.15 |
| MICHELIN (CGDE)-B | 753 | 111.45 | 83,921.85 |
| PORSCHE AUTOMOBIL HOLDING SE | 1,161 | 60.00 | 69,660.00 |
| STELLANTIS NV | 8,124 | 13.20 | 107,236.80 |
| VALEO SA | 2,142 | 31.63 | 67,751.46 |
| VOLKSWAGEN AG | 367 | 179.50 | 65,876.50 |
| VOLKSWAGEN AG PFD | 926 | 165.08 | 152,864.08 |
| ADIDAS AG | 1,138 | 278.00 | 316,364.00 |
| ESSILORLUXOTTICA | 1,713 | 122.50 | 209,842.50 |
| HERMES INTERNATIONAL | 169 | 875.60 | 147,976.40 |
| KERING | 456 | 544.00 | 248,064.00 |
| LVMH MOET HENNESSY LOUIS VUITTON SE | 1,752 | 511.50 | 896,148.00 |
| MONCLER SPA | 1,864 | 48.67 | 90,720.88 |
| PUMA AG | 755 | 85.14 | 64,280.70 |
| ACCOR SA | 2,152 | 29.57 | 63,634.64 |
| FLUTTER ENTERTAINMENT PLC | 1,226 | 160.80 | 197,140.80 |
| SODEXO | 1,004 | 76.80 | 77,107.20 |
| SCOUT24 AG | 1,086 | 66.15 | 71,838.90 |
| SES SA | 6,510 | 7.30 | 47,549.04 |
| UBISOFT ENTERTAINMENT | 989 | 85.18 | 84,243.02 |
| VIVENDI SA | 4,328 | 26.56 | 114,951.68 |
| DELIVERY HERO SE | 1,125 | 137.20 | 154,350.00 |
| INDITEX | 6,068 | 25.59 | 155,280.12 |
| PROSUS NV | 3,407 | 99.16 | 337,838.12 |
| ZALANDO SE | 1,339 | 98.48 | 131,864.72 |
| CARREFOUR SA | 3,987 | 14.71 | 58,668.70 |
| COLRUYT SA | 601 | 50.40 | 30,290.40 |
| JERONIMO MARTINS | 1,856 | 14.40 | 26,726.40 |
| KONINKLIJKE AHOLD DELHAIZE NV | 6,130 | 23.64 | 144,913.20 |
| ANHEUSER-BUSCH INBEV SA/NV | 4,947 | 54.78 | 270,996.66 |
| DANONE | 3,230 | 54.56 | 176,228.80 |
| DAVIDE CAMPARI-MILANO NV | 6,728 | 8.81 | 59,300.59 |
| HEINEKEN HOLDING NV | 770 | 75.90 | 58,443.00 |
| HEINEKEN NV | 1,368 | 88.08 | 120,493.44 |
| KERRY GROUP PLC-A | 862 | 113.60 | 97,923.20 |
| PERNOD-RICARD | 1,080 | 153.10 | 165,348.00 |
| BEIERSDORF AG | 725 | 91.42 | 66,279.50 |
| HENKEL AG & CO KGAA | 942 | 78.15 | 73,617.30 |

| | | | |
|--------------------------------|---------|--------|------------|
| HENKEL AG AND CO KGAA VORZUG | 731 | 88.78 | 64,898.18 |
| L'OREAL | 1,470 | 296.30 | 435,561.00 |
| FRESENIUS MEDICAL CARE AG & Co | 1,410 | 69.22 | 97,600.20 |
| Fresenius SE & CO KG | 2,360 | 38.18 | 90,104.80 |
| KONINKLIJKE PHILIPS NV | 5,347 | 45.63 | 244,010.34 |
| ORPEA | 593 | 117.45 | 69,647.85 |
| SARTORIUS AG-VORZUG | 328 | 383.00 | 125,624.00 |
| BAYER AG | 6,161 | 52.36 | 322,589.96 |
| EUROFINS SCIENTIFIC | 1,320 | 78.00 | 102,960.00 |
| GRIFOLS SA | 2,483 | 24.60 | 61,081.80 |
| MERCK KGAA | 1,018 | 141.10 | 143,639.80 |
| ORION OYJ | 1,379 | 38.58 | 53,201.82 |
| QIAGEN N V | 2,118 | 44.90 | 95,098.20 |
| RECORDATI INDUSTRIA CHIMICA | 1,416 | 42.93 | 60,788.88 |
| SANOFI | 7,013 | 81.46 | 571,278.98 |
| SARTORIUS STEDIM BIOTECH | 284 | 329.80 | 93,663.20 |
| UCB SA | 1,123 | 87.58 | 98,352.34 |
| BANCO BILBAO VIZCAYA ARGENTA | 44,079 | 4.00 | 176,404.15 |
| BANCO SANTANDER S.A | 112,844 | 2.58 | 291,250.36 |
| BNP PARIBAS | 6,936 | 43.08 | 298,837.56 |
| CaixaBank SA | 25,371 | 2.05 | 52,061.29 |
| COMMERZBANK AG | 10,758 | 5.80 | 62,439.43 |
| CREDIT AGRICOLE SA | 9,485 | 9.92 | 94,110.17 |
| ERSTE GROUP BANK AG | 3,027 | 26.03 | 78,792.81 |
| FINECOBANK SPA | 6,231 | 13.30 | 82,903.45 |
| ING GROEP NV-CVA | 24,720 | 7.71 | 190,591.20 |
| INTESA SANPAOLO | 99,255 | 1.88 | 187,016.27 |
| KBC GROEP NV | 2,159 | 59.30 | 128,028.70 |
| MEDIOBANCA SPA | 8,075 | 7.41 | 59,851.90 |
| SOCIETE GENERALE-A | 6,338 | 16.34 | 103,562.92 |
| UNICREDIT SPA | 17,156 | 7.74 | 132,941.84 |
| DEUTSCHE BANK AG -REG | 15,419 | 8.90 | 137,229.10 |
| DEUTSCHE BOERSE AG | 1,004 | 132.90 | 133,431.60 |
| GROUPE BRUXELLES LAMBERT SA | 899 | 84.38 | 75,857.62 |
| Natixis | 12,521 | 3.15 | 39,441.15 |
| Wendel | 380 | 99.35 | 37,753.00 |
| AEGON NV | 18,771 | 3.49 | 65,623.41 |
| AGEAS | 1,337 | 43.86 | 58,640.82 |
| ALLIANZ SE | 2,447 | 195.28 | 477,850.16 |
| ASSICURAZIONI GENERALI | 6,868 | 14.51 | 99,654.68 |
| AXA SA | 10,329 | 19.21 | 198,440.74 |
| CNP ASSURANCES | 2,537 | 13.40 | 33,995.80 |

| | | | |
|------------------------------|--------|----------|------------|
| HANNOVER RUECK SE | 457 | 132.80 | 60,689.60 |
| MUENCHENER RUECKVER AG-REG | 752 | 228.50 | 171,832.00 |
| NN GROUP NV | 2,486 | 35.68 | 88,700.48 |
| POSTE ITALIANE SPA | 7,632 | 8.26 | 63,101.37 |
| SAMPO OYJ-A SHS | 2,816 | 35.69 | 100,503.04 |
| SCOR SE | 1,675 | 26.78 | 44,856.50 |
| AROUNDTOWN SA | 9,346 | 5.82 | 54,468.48 |
| DEUTSCHE WOHNEN AG-BR | 2,435 | 41.72 | 101,588.20 |
| LEG IMMOBILIEN AG | 557 | 120.26 | 66,984.82 |
| VONOVIA SE | 3,194 | 55.06 | 175,861.64 |
| ADYEN NV /WI | 131 | 1,919.00 | 251,389.00 |
| AMADEUS IT GROUP SA-A SHS | 2,912 | 54.84 | 159,694.08 |
| ATOS SE | 765 | 63.44 | 48,531.60 |
| CAPGEMINI | 1,178 | 123.40 | 145,365.20 |
| DASSAULT SYSTEMES SA | 831 | 165.00 | 137,115.00 |
| EDENRED | 2,098 | 46.60 | 97,766.80 |
| SAP SE | 6,304 | 104.70 | 660,028.80 |
| TEAMVIEWER AG | 1,780 | 43.00 | 76,540.00 |
| WORLDLINE SA | 1,889 | 72.98 | 137,859.22 |
| NOKIA OYJ | 33,875 | 3.39 | 114,853.18 |
| CELLNEX TELECOM SAU | 2,702 | 50.32 | 135,964.64 |
| DEUTSCHE TELEKOM AG-REG | 18,621 | 15.06 | 280,525.36 |
| ELISA OYJ | 1,072 | 47.12 | 50,512.64 |
| KONIKLIJKE KPN NV | 31,980 | 2.63 | 84,107.40 |
| ORANGE | 9,233 | 9.58 | 88,526.00 |
| TELEFONICA DEUTSCHLAND HOLDI | 19,158 | 2.29 | 44,005.92 |
| TELEFONICA SA | 32,348 | 3.63 | 117,649.67 |
| UNITED INTERNET AG-REG SHARE | 1,680 | 36.83 | 61,874.40 |
| E.ON SE | 12,093 | 8.70 | 105,257.47 |
| ELECTRICITE DE FRANCE | 5,196 | 12.38 | 64,352.46 |
| ENAGAS SA | 1,353 | 17.90 | 24,218.70 |
| ENDESA SA | 2,300 | 21.92 | 50,416.00 |
| ENEL SPA | 54,554 | 8.34 | 455,253.13 |
| ENERGIAS DE PORTUGAL SA | 24,513 | 5.30 | 130,115.00 |
| ENGIE | 10,644 | 13.11 | 139,596.06 |
| FORTUM OYJ | 2,826 | 21.14 | 59,741.64 |
| IBERDROLA SA | 35,147 | 11.66 | 409,814.02 |
| NATURGY ENERGY GROUP SA | 2,783 | 19.28 | 53,656.24 |
| RED ELECTRICA CORPORACION SA | 2,522 | 15.89 | 40,087.19 |
| RWE AG | 4,327 | 36.87 | 159,536.49 |
| SUEZ | 4,222 | 17.03 | 71,921.77 |
| TERNA SPA | 12,814 | 5.98 | 76,678.97 |

| | | | |
|-----------------------------------|-----------|--------|----------------------------------|
| UNIPER SE | 1,597 | 29.90 | 47,750.30 |
| VEOLIA ENVIRONNEMENT | 3,764 | 22.35 | 84,125.40 |
| ASML HOLDING NV | 2,772 | 462.90 | 1,283,158.80 |
| INFINEON TECHNOLOGIES AG | 9,027 | 34.64 | 312,695.28 |
| STMICROELECTRONICS NV | 4,521 | 32.60 | 147,384.60 |
| ユーロ小計 | 1,145,854 | | 26,347,949.86 (3,329,590,423) |
| | 銘柄数 | 184 | |
| | 比率 | 10.2% | 10.8% |
| 英ポンド | 株 | 英ポンド | 英ポンド |
| BP PLC | 122,694 | 2.90 | 355,812.60 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-A SHS | 26,813 | 14.20 | 380,744.60 |
| ROYAL DUTCH SHELL PLC-B SHS | 22,094 | 13.59 | 300,390.02 |
| ANGLO AMERICAN PLC | 8,738 | 26.27 | 229,590.95 |
| BHP GROUP PLC | 12,741 | 21.13 | 269,217.33 |
| CRODA INTERNATIONAL PLC | 1,094 | 64.24 | 70,278.56 |
| GLENCORE PLC | 69,069 | 2.70 | 187,038.85 |
| JOHNSON MATTHEY PLC | 1,311 | 29.95 | 39,264.45 |
| MONDI PLC | 3,298 | 18.30 | 60,353.40 |
| RIO TINTO PLC | 7,319 | 58.76 | 430,064.44 |
| ASHTAD GROUP PLC | 3,567 | 38.32 | 136,687.44 |
| BAE SYSTEMS PLC | 19,308 | 4.79 | 92,504.62 |
| BUNZL PLC | 2,710 | 24.08 | 65,256.80 |
| FERGUSON PLC | 1,371 | 91.28 | 125,144.88 |
| MELROSE INDUSTRIES PLC | 43,705 | 1.75 | 76,680.42 |
| SMITHS GROUP PLC | 3,408 | 14.95 | 50,949.60 |
| SPIRAX-SARCO ENGINEERING PLC | 680 | 116.65 | 79,322.00 |
| EXPERIAN PLC | 5,492 | 26.36 | 144,769.12 |
| INTERTEK GROUP PLC | 1,196 | 55.94 | 66,904.24 |
| RELX PLC | 10,396 | 18.69 | 194,353.22 |
| RENTOKIL INITIAL PLC | 16,611 | 5.26 | 87,373.86 |
| BURBERRY GROUP PLC | 2,354 | 17.59 | 41,418.63 |
| PERSIMMON PLC | 2,180 | 27.16 | 59,208.80 |
| COMPASS GROUP PLC | 11,682 | 13.94 | 162,905.49 |
| INTERCONTINENTAL HOTELS GROUP PLC | 1,794 | 47.47 | 85,161.18 |
| Whitbread PLC | 2,262 | 31.21 | 70,597.02 |
| INFORMA PLC | 15,134 | 5.15 | 78,061.17 |
| WPP PLC | 11,477 | 7.94 | 91,127.38 |
| KINGFISHER PLC | 23,699 | 2.73 | 64,698.27 |
| NEXT PLC | 1,104 | 79.14 | 87,370.56 |
| OCADO GROUP PLC | 4,405 | 26.90 | 118,494.50 |
| MORRISON <WM.> SUPERMARKETS | 19,300 | 1.86 | 36,052.40 |

| | | | | |
|---------------------------------|-----------|----------|----------------------------------|--|
| TESCO PLC | 49,546 | 2.41 | 119,851.77 | |
| Associated British Foods PLC | 2,164 | 22.54 | 48,776.56 | |
| BRITISH AMERICAN TOBACCO PLC | 14,151 | 27.38 | 387,525.13 | |
| DIAGEO PLC | 13,883 | 29.08 | 403,787.05 | |
| IMPERIAL BRANDS PLC | 5,793 | 16.49 | 95,555.53 | |
| RECKITT BENCKISER GROUP PLC | 4,576 | 62.74 | 287,098.24 | |
| UNILEVER PLC | 16,136 | 43.78 | 706,434.08 | |
| SMITH & NEPHEW PLC | 5,079 | 16.53 | 83,981.26 | |
| ASTRAZENECA PLC | 8,630 | 77.77 | 671,155.10 | |
| GLAXOSMITHKLINE PLC | 30,354 | 13.80 | 418,945.90 | |
| BARCLAYS PLC | 107,628 | 1.43 | 153,972.61 | |
| HSBC HOLDINGS PLC | 125,926 | 4.07 | 512,959.56 | |
| LLOYDS BANKING GROUP PLC | 413,188 | 0.34 | 143,665.46 | |
| NATWEST GROUP PLC | 43,311 | 1.55 | 67,348.60 | |
| STANDARD CHARTERED PLC | 19,013 | 4.61 | 87,821.04 | |
| 3I GROUP PLC | 8,641 | 11.44 | 98,853.04 | |
| HARGREAVES LANSDOWN PLC | 2,152 | 16.50 | 35,508.00 | |
| London Stock Exchange Group PLC | 1,985 | 91.20 | 181,032.00 | |
| M&G PLC | 22,085 | 1.95 | 43,065.75 | |
| SCHRODERS PLC | 1,268 | 34.80 | 44,126.40 | |
| ST JAMES'S PLACE PLC | 5,648 | 11.88 | 67,098.24 | |
| STANDARD LIFE ABERDEEN PLC | 19,207 | 3.07 | 59,138.35 | |
| ADMIRAL GROUP PLC | 2,106 | 29.55 | 62,232.30 | |
| AVIVA PLC | 22,917 | 3.49 | 80,003.24 | |
| DIRECT LINE INSURANCE GROUP | 8,163 | 3.20 | 26,178.74 | |
| LEGAL & GENERAL GROUP PLC | 44,034 | 2.65 | 116,734.13 | |
| PRUDENTIAL PLC | 15,549 | 13.95 | 216,908.55 | |
| RSA INSURANCE GROUP PLC | 10,806 | 6.76 | 73,135.00 | |
| SAGE GROUP PLC/THE | 8,391 | 6.07 | 50,933.37 | |
| HALMA PLC | 2,976 | 25.78 | 76,721.28 | |
| BT GROUP PLC | 62,322 | 1.34 | 84,103.53 | |
| VODAFONE GROUP PLC | 161,189 | 1.27 | 205,258.07 | |
| NATIONAL GRID PLC | 19,524 | 8.75 | 170,991.19 | |
| SEVERN TRENT PLC | 1,971 | 23.40 | 46,121.40 | |
| SSE PLC | 7,529 | 15.47 | 116,473.63 | |
| 英ポンド小計 | 1,766,847 | | 10,381,290.90 (1,475,285,249) | |
| | 銘柄数 | 67 | | |
| | 比率 | 4.5% | 4.8% | |
| スイスフラン | 株 | スイスフラン | スイスフラン | |
| CLARIANT AG-REG | 2,135 | 19.46 | 41,557.77 | |
| GIVAUDAN-REG | 52 | 3,605.00 | 187,460.00 | |

| | | | | |
|-----------------------------|---------|----------------|---------------------------------|--|
| LAFARGEHOLCIM LTD | 2,500 | 50.18 | 125,450.00 | |
| SIKA AG-REG | 937 | 247.60 | 232,001.20 | |
| ABB LTD | 10,058 | 26.71 | 268,649.18 | |
| GEBERIT AG-REG | 182 | 557.00 | 101,374.00 | |
| Schindler Holding AG | 279 | 237.20 | 66,178.80 | |
| Schindler Holding AG | 185 | 235.70 | 43,604.50 | |
| ADECCO GROUP AG(REG) | 1,356 | 58.32 | 79,081.92 | |
| SGS SA | 33 | 2,739.00 | 90,387.00 | |
| KUEHNE & NAGEL INTL AG-REG | 533 | 205.40 | 109,478.20 | |
| CIE FINANCIERE RICHEMON-REG | 3,342 | 85.46 | 285,607.32 | |
| THE SWATCH GROUP AG-B | 243 | 257.20 | 62,499.60 | |
| BARRY CALLEBAUT AG-REG | 27 | 2,026.00 | 54,702.00 | |
| Lindt & Spruengli AG | 11 | 8,010.00 | 88,110.00 | |
| NESTLE SA-REGISTERED | 17,785 | 101.02 | 1,796,640.70 | |
| ALCON INC | 3,083 | 65.46 | 201,813.18 | |
| SONOVA HOLDING AG | 454 | 224.40 | 101,877.60 | |
| STRAUMANN HOLDING AG-REG | 98 | 1,038.50 | 101,773.00 | |
| LONZA GROUP AG-REG | 538 | 599.20 | 322,369.60 | |
| NOVARTIS AG-REG SHS | 13,808 | 85.93 | 1,186,521.44 | |
| ROCHE HOLDING AG-GENUSSS | 4,420 | 318.45 | 1,407,549.00 | |
| CREDIT SUISSE GROUP AG | 14,623 | 12.18 | 178,108.14 | |
| JULIUS BAER GROUP LTD | 2,170 | 55.84 | 121,172.80 | |
| PARTNERS GROUP HOLDING AG | 137 | 1,077.50 | 147,617.50 | |
| UBS GROUP AG | 22,868 | 13.15 | 300,714.20 | |
| Baloise Holding AG | 406 | 154.90 | 62,889.40 | |
| SWISS LIFE HOLDING AG | 230 | 426.10 | 98,003.00 | |
| SWISS RE AG | 1,649 | 81.34 | 134,129.66 | |
| ZURICH INSURANCE GROUP AG | 844 | 369.20 | 311,604.80 | |
| SWISS PRIME SITE | 654 | 86.15 | 56,342.10 | |
| TEMENOS GROUP AG-REG | 547 | 112.90 | 61,756.30 | |
| Logitech International SA | 1,484 | 91.94 | 136,438.96 | |
| SWISSCOM AG-REG | 185 | 469.40 | 86,839.00 | |
| スイスフラン小計 | 107,856 | | 8,650,301.87 (1,014,766,912) | |
| | 銘柄数 | 34 | | |
| | 比率 | 3.1% | 3.3% | |
| スウェーデンクローネ | 株 | スウェーデン クローネ | スウェーデン クローネ | |
| LUNDIN ENERGY AB | 1,592 | 239.00 | 380,488.00 | |
| BOLIDEN AB | 2,777 | 297.00 | 824,769.00 | |
| ALFA LAVAL AB | 2,092 | 236.40 | 494,548.80 | |
| ASSA ABLOY AB-B | 4,863 | 210.10 | 1,021,716.30 | |
| ATLAS COPCO AB-A SHS | 3,391 | 470.50 | 1,595,465.50 | |

| | | | | |
|------------------------------|---------|-----------|--------------------------------|--|
| ATLAS COPCO AB-B SHS | 3,420 | 409.60 | 1,400,832.00 | |
| EPIROC AB-A | 4,724 | 163.30 | 771,429.20 | |
| EPIROC AB-B | 3,996 | 151.00 | 603,396.00 | |
| NIBE INDUSTRIER AB-B SHS | 3,339 | 294.20 | 982,333.80 | |
| SANDVIK AB | 5,708 | 219.00 | 1,250,052.00 | |
| SKANSKA AB-B SHS | 2,998 | 225.50 | 676,049.00 | |
| SKF AB-B SHARES | 2,493 | 234.80 | 585,356.40 | |
| VOLVO AB-B SHS | 8,081 | 217.40 | 1,756,809.40 | |
| SECURITAS AB-B SHS | 2,617 | 130.55 | 341,649.35 | |
| Husqvarna AB | 6,445 | 108.85 | 701,538.25 | |
| EVOLUTION AB | 1,448 | 872.00 | 1,262,656.00 | |
| HENNES & MAURITZ AB-B | 6,184 | 182.65 | 1,129,507.60 | |
| SWEDISH MATCH AB | 1,400 | 621.20 | 869,680.00 | |
| ESSITY AKTIEBOLAG-B | 3,388 | 261.60 | 886,300.80 | |
| NORDEA BANK ABP | 15,750 | 70.92 | 1,116,990.00 | |
| SKANDINAVISKA ENSKILDA BAN-A | 10,852 | 92.80 | 1,007,065.60 | |
| SVENSKA HANDELSBANKEN-A SHS | 9,775 | 86.70 | 847,492.50 | |
| Swedbank AB | 6,152 | 164.20 | 1,010,158.40 | |
| Industrivarden AB | 2,311 | 275.10 | 635,756.10 | |
| INVESTOR AB-B SHS | 2,272 | 625.00 | 1,420,000.00 | |
| KINNEVIK AB-B | 2,326 | 417.15 | 970,290.90 | |
| ERICSSON LM-B SHS | 18,526 | 97.30 | 1,802,579.80 | |
| HEXAGON AB-B SHS | 1,733 | 766.40 | 1,328,171.20 | |
| TELE2 AB-B SHS | 4,843 | 115.10 | 557,429.30 | |
| TELIA COMPANY AB | 18,935 | 36.30 | 687,340.50 | |
| スウェーデンクローネ小計 | 164,431 | | 28,917,851.70 (361,762,324) | |
| | 銘柄数 | 30 | | |
| | 比率 | 1.1% | 1.2% | |
| ノルウェークローネ | 株 | ノルウェークローネ | ノルウェークローネ | |
| EQUINOR ASA | 6,289 | 163.00 | 1,025,107.00 | |
| NORSK HYDRO ASA | 17,981 | 39.39 | 708,271.59 | |
| YARA INTERNATIONAL ASA | 961 | 387.60 | 372,483.60 | |
| SCHIBSTED ASA-B SHS | 1,823 | 280.00 | 510,440.00 | |
| MOWI ASA | 3,074 | 188.40 | 579,141.60 | |
| ORKLA ASA | 5,635 | 83.94 | 473,001.90 | |
| GJENSIDIGE FORSIKRING ASA | 2,924 | 208.00 | 608,192.00 | |
| TELENOR ASA | 5,179 | 144.95 | 750,696.05 | |
| ノルウェークローネ小計 | 43,866 | | 5,027,333.74 (61,434,018) | |
| | 銘柄数 | 8 | | |
| | 比率 | 0.2% | 0.2% | |

| デンマーククローネ | 株 | デンマーク クローネ | デンマーク クローネ |
|------------------------------|--------|---------------|--------------------------------|
| CHRISTIAN HANSEN HOLDING A/S | 911 | 529.40 | 482,283.40 |
| NOVOZYMES A/S-B SHARES | 1,320 | 356.60 | 470,712.00 |
| VESTAS WIND SYSTEMS A/S | 1,424 | 1,463.00 | 2,083,312.00 |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-A | 26 | 13,240.00 | 344,240.00 |
| AP MOLLER-MAERSK A/S-B | 56 | 14,335.00 | 802,760.00 |
| DSV PANALPINA A/S | 1,503 | 980.80 | 1,474,142.40 |
| PANDORA A/S | 884 | 630.00 | 556,920.00 |
| CARLSBERG AS-B | 719 | 931.00 | 669,389.00 |
| COLOPLAST-B | 717 | 916.00 | 656,772.00 |
| DEMANT A/S | 1,791 | 239.80 | 429,481.80 |
| GENMAB A/S | 521 | 2,643.00 | 1,377,003.00 |
| H LUNDBECK A/S | 1,570 | 224.40 | 352,308.00 |
| NOVO NORDISK A/S-B | 10,764 | 444.50 | 4,784,598.00 |
| DANSKE BANK A/S | 4,822 | 113.45 | 547,055.90 |
| ORSTED A/S | 1,367 | 1,253.50 | 1,713,534.50 |
| デンマーククローネ小計 | 28,395 | | 16,744,512.00 (284,489,258) |
| | 銘柄数 | 15 | |
| | 比率 | 0.9% | 0.9% |
| 豪ドル | 株 | 豪ドル | 豪ドル |
| AMPOL LTD | 2,516 | 30.75 | 77,367.00 |
| ORIGIN ENERGY LIMITED | 13,406 | 5.11 | 68,504.66 |
| SANTOS LTD | 17,248 | 7.21 | 124,358.08 |
| WOODSIDE PETROLEUM LTD | 5,884 | 26.56 | 156,279.04 |
| BHP GROUP LIMITED | 18,256 | 46.13 | 842,149.28 |
| EVOLUTION MINING LTD | 18,610 | 4.62 | 85,978.20 |
| FORTESCUE METALS GROUP LTD | 13,246 | 24.32 | 322,142.72 |
| NEWCREST MINING LIMITED | 5,673 | 26.76 | 151,809.48 |
| NORTHERN STAR RESOURCES LTD | 8,573 | 13.43 | 115,135.39 |
| ORICA LTD | 3,165 | 15.86 | 50,196.90 |
| RIO TINTO LIMITED | 2,384 | 119.32 | 284,458.88 |
| SOUTH32 LTD | 46,937 | 2.77 | 130,015.49 |
| BRAMBLES LTD | 10,710 | 10.68 | 114,382.80 |
| SYDNEY AIRPORT | 10,051 | 5.89 | 59,200.39 |
| TRANSURBAN GROUP | 17,538 | 13.40 | 235,009.20 |
| TABCORP HOLDINGS LIMITED | 28,444 | 4.18 | 118,895.92 |
| SEEK LTD | 4,148 | 28.47 | 118,093.56 |
| WESFARMERS LIMITED | 6,615 | 53.41 | 353,307.15 |
| COLES GROUP LTD | 9,854 | 18.16 | 178,948.64 |
| WOOLWORTHS GROUP LTD | 7,604 | 40.76 | 309,939.04 |
| COCA-COLA AMATIL LIMITED | 7,496 | 13.03 | 97,672.88 |

| | | | | |
|------------------------------------|---------|----------------|-------------------------------|--|
| TREASURY WINE ESTATES LTD | 7,735 | 9.32 | 72,090.20 | |
| COCHLEAR LIMITED | 612 | 197.90 | 121,114.80 | |
| SONIC HEALTHCARE LTD | 4,417 | 35.10 | 155,036.70 | |
| GSL LIMITED | 2,867 | 274.60 | 787,278.20 | |
| AUST AND NZ BANKING GROUP LTD | 16,923 | 24.64 | 416,982.72 | |
| COMMONWEALTH BANK OF AUSTRALIA | 10,969 | 85.09 | 933,352.21 | |
| NATIONAL AUSTRALIA BANK LTD | 21,734 | 24.12 | 524,224.08 | |
| WESTPAC BANKING CORPORATION | 20,887 | 21.78 | 454,918.86 | |
| AMP LIMITED | 49,564 | 1.55 | 77,072.02 | |
| AUSTRALIAN STOCK EXCHANGE | 1,539 | 71.61 | 110,207.79 | |
| MACQUARIE GROUP LTD | 2,203 | 137.10 | 302,031.30 | |
| INSURANCE AUSTRALIA GROUP | 16,462 | 5.00 | 82,310.00 | |
| QBE INSURANCE GROUP LIMITED | 10,561 | 8.45 | 89,240.45 | |
| SUNCORP GROUP LTD | 10,305 | 10.45 | 107,687.25 | |
| LENDLEASE GROUP | 6,761 | 12.50 | 84,512.50 | |
| AFTERPAY LTD | 1,852 | 141.33 | 261,743.16 | |
| COMPUTERSHARE LIMITED | 6,880 | 14.49 | 99,691.20 | |
| TELSTRA CORP LTD | 28,601 | 3.20 | 91,523.20 | |
| AGL ENERGY LTD | 3,070 | 11.78 | 36,164.60 | |
| 豪ドル小計 | 482,300 | | 8,801,025.94 (705,842,280) | |
| | 銘柄数 | 40 | | |
| | 比率 | 2.2% | 2.3% | |
| ニュージーランドドル | 株 | ニュージーランド ドル | ニュージーランド ドル | |
| AUCKLAND INTL AIRPORT LTD | 8,471 | 7.36 | 62,346.56 | |
| A2 MILK CO LTD | 5,350 | 10.90 | 58,315.00 | |
| FISHER & PAYKEL HEALTHCARE C | 4,944 | 35.10 | 173,534.40 | |
| RYMAN HEALTHCARE LTD | 6,184 | 15.71 | 97,150.64 | |
| SPARK NEW ZEALAND LTD | 11,286 | 4.83 | 54,567.81 | |
| MERIDIAN ENERGY LTD | 16,831 | 8.08 | 135,994.48 | |
| ニュージーランドドル小計 | 53,066 | | 581,908.89 (43,474,413) | |
| | 銘柄数 | 6 | | |
| | 比率 | 0.1% | 0.1% | |
| 香港ドル | 株 | 香港ドル | 香港ドル | |
| CK HUTCHISON HOLDINGS LTD | 14,328 | 56.50 | 809,532.00 | |
| TECHTRONIC INDUSTRIES CO | 11,500 | 121.60 | 1,398,400.00 | |
| MTR CORPORATION | 12,500 | 43.60 | 545,000.00 | |
| Galaxy Entertainment Group Limited | 19,000 | 59.05 | 1,121,950.00 | |
| Sands China Ltd | 24,000 | 30.65 | 735,600.00 | |
| WH Group Limited | 65,500 | 6.52 | 427,060.00 | |
| BANK OF EAST ASIA | 17,440 | 16.84 | 293,689.60 | |

| | | | | |
|--------------------------------------|---------|---------------|--------------------------------|--|
| BOC HONG KONG HOLDINGS LTD | 32,000 | 24.30 | 777,600.00 | |
| HANG SENG BANK | 4,400 | 143.90 | 633,160.00 | |
| HONG KONG EXCHANGES & CLEAR | 8,300 | 510.50 | 4,237,150.00 | |
| AIA GROUP LTD | 78,000 | 100.40 | 7,831,200.00 | |
| CK ASSET HOLDINGS LIMITED | 17,828 | 40.75 | 726,491.00 | |
| HENDERSON LAND DEVELOPMENT | 15,403 | 32.30 | 497,516.90 | |
| SINO LAND CO | 47,800 | 10.42 | 498,076.00 | |
| SUN HUNG KAI PROPERTIES | 7,500 | 109.00 | 817,500.00 | |
| SWIRE PACIFIC LTD A | 7,000 | 49.50 | 346,500.00 | |
| SWIRE PROPERTIES LTD | 20,600 | 23.50 | 484,100.00 | |
| HKT Trust / HKT Ltd | 37,000 | 10.16 | 375,920.00 | |
| CK Infrastructure Holdings Ltd (CKI) | 7,000 | 43.35 | 303,450.00 | |
| CLP HOLDINGS LIMITED | 10,500 | 72.70 | 763,350.00 | |
| HONG KONG & CHINA GAS | 77,371 | 11.28 | 872,744.88 | |
| POWER ASSETS HOLDINGS LIMITED | 9,000 | 41.35 | 372,150.00 | |
| ASM PACIFIC TECHNOLOGY | 5,300 | 124.90 | 661,970.00 | |
| 香港ドル小計 | 549,270 | | 25,530,110.38 (342,103,479) | |
| | 銘柄数 | 23 | | |
| | 比率 | 1.1% | 1.1% | |
| シンガポールドル | 株 | シンガポールドル | シンガポール ドル | |
| KEPPEL CORP LTD | 15,900 | 5.64 | 89,676.00 | |
| SINGAPORE TECH ENGINEERING | 23,500 | 3.84 | 90,240.00 | |
| GENTING SINGAPORE LTD | 102,400 | 0.88 | 90,112.00 | |
| DBS GROUP HOLDINGS LTD | 9,900 | 26.17 | 259,083.00 | |
| OVERSEA-CHINESE BANKING CORP | 14,300 | 10.62 | 151,866.00 | |
| UNITED OVERSEAS BANK | 5,600 | 23.70 | 132,720.00 | |
| CITY DEVELOPMENTS | 8,600 | 7.51 | 64,586.00 | |
| UNITED OVERSEAS LAND LTD | 9,600 | 7.60 | 72,960.00 | |
| SINGAPORE TELECOMMUNICATIONS | 57,900 | 2.48 | 143,592.00 | |
| シンガポールドル小計 | 247,700 | | 1,094,835.00 (85,670,838) | |
| | 銘柄数 | 9 | | |
| | 比率 | 0.3% | 0.3% | |
| イスラエルシュケル | 株 | イスラエル シュケル | イスラエル シュケル | |
| ICL GROUP LTD | 3,551 | 17.45 | 61,964.95 | |
| BANK HAPOLIM BM | 8,608 | 23.90 | 205,731.20 | |
| BANK LEUMI LE-ISRAEL | 10,216 | 20.87 | 213,207.92 | |
| MIZRAHI TEFAHOT BANK LTD | 1,800 | 80.10 | 144,180.00 | |
| NICE LTD | 455 | 874.90 | 398,079.50 | |
| イスラエルシュケル小計 | 24,630 | | 1,023,163.57 | |

| | | | | |
|----|-----|-----------|--------------|------------------------------------|
| | | | (32,464,980) | |
| | 銘柄数 | 5 | | |
| | 比率 | 0.1% | 0.1% | |
| 合計 | 株 | 6,759,057 | 円 | 30,913,475,854 (30,913,475,854) |

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

(2)株式以外の有価証券

| 種類 | 通貨 | 銘柄 | 券面総額 | 評価額 | 備考 |
|--------------------------|-------|---------------------------------------|-------|------------|----|
| 投資証券 | 米ドル | | | 米ドル | |
| | | ALEXANDRIA REAL ESTATE EQUITIES INC | 876 | 147,903.84 | |
| | | AMERICAN TOWER CORP | 2,702 | 605,031.84 | |
| | | AVALONBAY COMMUNITIES INC | 760 | 125,194.80 | |
| | | BOSTON PROPERTIES INC | 1,122 | 102,438.60 | |
| | | CAMDEN PROPERTY TRUST | 660 | 67,683.00 | |
| | | CROWN CASTLE INTL CORP | 2,701 | 429,242.92 | |
| | | DIGITAL REALTY TRUST INC | 1,659 | 233,023.14 | |
| | | DUKE REALTY CORP | 3,036 | 122,168.64 | |
| | | EQUINIX INC | 577 | 416,109.32 | |
| | | EQUITY LIFESTYLE PROPERTIES INC | 1,368 | 86,567.04 | |
| | | EQUITY RESIDENTIAL | 2,231 | 137,340.36 | |
| | | ESSEX PROPERTY TRUST INC | 423 | 102,979.35 | |
| | | EXTRA SPACE STORAGE INC | 1,103 | 127,297.23 | |
| | | HEALTHPEAK PROPERTIES INC | 3,961 | 119,542.98 | |
| | | HOST HOTELS & RESORTS INC | 6,469 | 93,282.98 | |
| | | IRON MOUNTAIN INC | 2,547 | 76,792.05 | |
| | | MEDICAL PROPERTIES TRUST INC | 5,284 | 113,447.48 | |
| | | MID-AMERICA APARTMENT COMMUNITIES INC | 834 | 111,906.12 | |
| | | PROLOGIS INC | 4,440 | 449,416.80 | |
| | | PUBLIC STORAGE | 842 | 187,589.18 | |
| | | REALTY INCOME CORP | 1,954 | 116,927.36 | |
| | | REGENCY CENTERS CORP | 1,911 | 89,683.23 | |
| | | SBA COMMUNICATIONS CORP | 740 | 201,805.40 | |
| SIMON PROPERTY GROUP INC | 2,132 | 203,584.68 | | | |
| SUN COMMUNITIES INC | 761 | 111,821.34 | | | |
| UDR INC | 2,076 | 81,192.36 | | | |
| VENTAS INC | 2,943 | 144,589.59 | | | |
| VORNADO REALTY TRUST | 1,792 | 67,916.80 | | | |
| WELLTOWER INC | 2,741 | 172,874.87 | | | |

| | | | | |
|--------|-------------------------------------|---------|-------------------------------|--|
| | WEYERHAEUSER CO | 5,541 | 184,016.61 | |
| | WP CAREY INC | 1,371 | 92,227.17 | |
| 米ドル小計 | | 67,557 | 5,321,597.08 (552,594,640) | |
| | 銘柄数 | 31 | | |
| | 比率 | 1.7% | 81.4% | |
| 加ドル | RIOCAN REAL ESTATE INVESTMENT TRUST | 3,357 | 加ドル 58,915.35 | |
| 加ドル小計 | | 3,357 | 58,915.35 (4,811,616) | |
| | 銘柄数 | 1 | | |
| | 比率 | 0.0% | 0.7% | |
| ユーロ | COVIVIO | 548 | ユーロ 37,483.20 | |
| | GECINA SA | 267 | 31,265.70 | |
| | KLEPIERRE | 2,092 | 35,480.32 | |
| | UNIBAIL-RODAMCO-WESTFIELD | 1,188 | 67,644.72 | |
| ユーロ小計 | | 4,095 | 171,873.94 (21,719,709) | |
| | 銘柄数 | 4 | | |
| | 比率 | 0.1% | 3.2% | |
| 英ポンド | BRITISH LAND CO PLC | 10,935 | 英ポンド 48,114.00 | |
| | LAND SECURITIES GROUP PLC | 6,225 | 39,485.17 | |
| | SEGRO PLC | 8,594 | 83,722.74 | |
| 英ポンド小計 | | 25,754 | 171,321.91 (24,346,556) | |
| | 銘柄数 | 3 | | |
| | 比率 | 0.1% | 3.6% | |
| 豪ドル | DEXUS | 7,207 | 豪ドル 66,160.26 | |
| | GOODMAN GROUP | 11,135 | 197,646.25 | |
| | GPT GROUP | 14,906 | 65,139.22 | |
| | MIRVAC GROUP | 39,431 | 99,760.43 | |
| | SCENTRE GROUP | 39,712 | 113,576.32 | |
| | STOCKLAND | 24,415 | 110,844.10 | |
| 豪ドル小計 | | 136,806 | 653,126.58 (52,380,751) | |
| | 銘柄数 | 6 | | |
| | 比率 | 0.2% | 7.7% | |

| | | | |
|------------|---|--------|-----------------------------------|
| 香港ドル | LINK REIT | 15,900 | 香港ドル 1,093,125.00 |
| 香港ドル小計 | | 15,900 | 1,093,125.00 (14,647,875) |
| | 銘柄数 | 1 | |
| | 比率 | 0.0% | 2.2% |
| シンガポールドル | CAPITALAND INTEGRATED COMMERCIAL TRUST | 47,700 | シンガポール ドル 108,756.00 |
| シンガポールドル小計 | | 47,700 | 108,756.00 (8,510,157) |
| | 銘柄数 | 1 | |
| | 比率 | 0.0% | 1.3% |
| 投資証券合計 | | | 円 679,011,304 (679,011,304) |
| 合計 | | | 円 679,011,304 (679,011,304) |

(注1) 通貨種類毎の小計欄の()内は、邦貨換算額(単位:円)であります。

(注2) 合計金額欄の()内は、外貨建有価証券に係わるもので、内書であります。

(注3) 比率は左より組入時価の純資産に対する比率、および各小計欄の合計金額に対する比率であります。

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

「注記表(デリバティブ取引等に関する注記)」に記載しております。

「TMA日本債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 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 | 9,480,647,072円 | 13,281,789,429円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 4,300,013,084円 | 3,906,123,892円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 498,870,727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バラン 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 |
| T M A 世界バランスファンド 35 V A <適格機関投資家限定> | 4,397,223円 | 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＞ 円資産バランスオープン ＜適格機関投資家限定＞ 計 | 468,013,411円 円 13,281,789,429円 | 999,061,353円 1,322,313,913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 9月20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9月20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 | 1.3112円 | 1口当たり純資産額 | 1.2947円 |
| (1万口当たり純資産額) | 13,112円) | (1万口当たり純資産額) | 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88回利付国債(20年) | 20,000,000 | 22,623,000 |
| 第89回利付国債(20年) | 10,000,000 | 11,257,200 |
| 第90回利付国債(20年) | 65,000,000 | 73,535,150 |
| 第95回利付国債(20年) | 6,000,000 | 6,927,120 |
| 第99回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,032,400 |
| 第100回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,268,400 |
| 第105回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,319,600 |
| 第112回利付国債(20年) | 7,000,000 | 8,262,100 |
| 第113回利付国債(20年) | 20,000,000 | 23,694,000 |
| 第116回利付国債(20年) | 50,000,000 | 60,087,000 |
| 第117回利付国債(20年) | 92,000,000 | 109,718,280 |
| 第123回利付国債(20年) | 113,000,000 | 136,018,100 |
| 第124回利付国債(20年) | 40,000,000 | 47,753,200 |
| 第126回利付国債(20年) | 31,000,000 | 37,120,330 |
| 第127回利付国債(20年) | 50,000,000 | 59,366,500 |
| 第130回利付国債(20年) | 55,000,000 | 65,091,950 |
| 第132回利付国債(20年) | 64,000,000 | 75,242,240 |
| 第133回利付国債(20年) | 90,000,000 | 106,782,300 |
| 第135回利付国債(20年) | 90,000,000 | 106,047,000 |
| 第136回利付国債(20年) | 77,000,000 | 89,879,020 |
| 第137回利付国債(20年) | 12,000,000 | 14,171,520 |
| 第138回利付国債(20年) | 25,000,000 | 28,960,250 |
| 第139回利付国債(20年) | 50,000,000 | 58,484,500 |
| 第140回利付国債(20年) | 72,000,000 | 85,216,320 |
| 第141回利付国債(20年) | 50,000,000 | 59,302,000 |
| 第142回利付国債(20年) | 10,000,000 | 11,977,800 |
| 第143回利付国債(20年) | 60,000,000 | 70,587,600 |
| 第144回利付国債(20年) | 75,000,000 | 87,336,750 |
| 第145回利付国債(20年) | 105,000,000 | 125,036,100 |
| 第146回利付国債(20年) | 90,000,000 | 107,383,500 |
| 第147回利付国債(20年) | 82,000,000 | 96,983,860 |
| 第148回利付国債(20年) | 95,000,000 | 111,317,200 |
| 第150回利付国債(20年) | 123,000,000 | 142,895,250 |
| 第151回利付国債(20年) | 100,000,000 | 113,522,000 |
| 第152回利付国債(20年) | 91,000,000 | 103,375,090 |
| 第153回利付国債(20年) | 112,000,000 | 128,879,520 |
| 第154回利付国債(20年) | 92,000,000 | 104,646,320 |
| 第155回利付国債(20年) | 115,000,000 | 127,479,800 |

| | | | | |
|-------|----------------------------|----------------|----------------|--|
| | 第156回利付国債(20年) | 99,000,000 | 100,945,350 | |
| | 第157回利付国債(20年) | 100,000,000 | 98,819,000 | |
| | 第158回利付国債(20年) | 119,000,000 | 122,831,800 | |
| | 第159回利付国債(20年) | 92,000,000 | 96,260,520 | |
| | 第160回利付国債(20年) | 90,000,000 | 95,470,200 | |
| | 第161回利付国債(20年) | 93,000,000 | 97,131,990 | |
| | 第162回利付国債(20年) | 105,000,000 | 109,560,150 | |
| | 第163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。

【中間財務諸表】

- (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、PwCあらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035】

(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 |
|-----------------|---------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 4,150,997 |
| 親投資信託受益証券 | 153,355,223 | 427,685,799 |
| 未収入金 | 252,426 | 467,741 |
| 流動資産合計 | 153,607,649 | 432,304,537 |
| 資産合計 | | |
| | 153,607,649 | 432,304,537 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 110,252 | 42,403 |
| 未払受託者報酬 | 9,370 | 30,753 |
| 未払委託者報酬 | 121,714 | 399,685 |
| その他未払費用 | 4,596 | 15,284 |
| 流動負債合計 | 245,932 | 488,125 |
| 負債合計 | | |
| | 245,932 | 488,125 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 135,662,700 | 1 357,307,226 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 17,699,017 | 74,509,186 |
| （分配準備積立金） | 10,472,541 | 9,397,079 |
| 元本等合計 | 153,361,717 | 431,816,412 |
| 純資産合計 | | |
| | 153,361,717 | 431,816,412 |
| 負債純資産合計 | | |
| | 153,607,649 | 432,304,537 |

(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 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 1,099,670 | 15,023,547 |
| 営業収益合計 | 1,099,670 | 15,023,547 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,992 | 30,753 |
| 委託者報酬 | 25,814 | 399,685 |
| その他費用 | 908 | 15,284 |
| 営業費用合計 | 28,714 | 445,722 |
| 営業利益又は営業損失() | 1,070,956 | 14,577,825 |
| 経常利益又は経常損失() | 1,070,956 | 14,577,825 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 1,070,956 | 14,577,825 |
| 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() | 72,561 | 1,052,142 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 229,655 | 17,699,017 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 8,040 | 46,921,546 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 8,040 | - |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 46,921,546 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 611,540 | 3,637,060 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 3,637,060 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 611,540 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 769,672 | 74,509,186 |

(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 | 4,514,529円 | 135,662,700円 |
| 期中追加設定元本額 | 147,556,612円 | 245,967,893円 |
| 期中一部解約元本額 | 16,408,441円 | 24,323,367円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数 | 135,662,700口 | 357,307,226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 | 1.1305円 11,305円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 | 1.2085円 12,085円) |

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045】

(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 |
|-----------------|---------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 93,362 |
| 親投資信託受益証券 | 51,909,763 | 205,740,048 |
| 未収入金 | 165,332 | 198,569 |
| 流動資産合計 | 52,075,095 | 206,031,979 |
| 資産合計 | 52,075,095 | 206,031,979 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 119,618 | 27,019 |
| 未払受託者報酬 | 2,930 | 13,081 |
| 未払委託者報酬 | 38,154 | 170,033 |
| その他未払費用 | 1,382 | 6,459 |
| 流動負債合計 | 162,084 | 216,592 |
| 負債合計 | 162,084 | 216,592 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 45,732,607 | 1 169,280,092 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 6,180,404 | 36,535,295 |
| （分配準備積立金） | 3,415,517 | 3,069,315 |
| 元本等合計 | 51,913,011 | 205,815,387 |
| 純資産合計 | 51,913,011 | 205,815,387 |
| 負債純資産合計 | 52,075,095 | 206,031,979 |

(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 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 323,738 | 5,620,260 |
| 営業収益合計 | 323,738 | 5,620,260 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 728 | 13,081 |
| 委託者報酬 | 9,519 | 170,033 |
| その他費用 | 254 | 6,459 |
| 営業費用合計 | 10,501 | 189,573 |
| 営業利益又は営業損失() | 313,237 | 5,430,687 |
| 経常利益又は経常損失() | 313,237 | 5,430,687 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 313,237 | 5,430,687 |
| 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() | - | 281,454 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 108,092 | 6,180,404 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 26,733,647 |
| 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 | - | 26,733,647 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 212,098 | 1,527,989 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 1,527,989 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 212,098 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 209,231 | 36,535,295 |

(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 | 2,051,072円 | 45,732,607円 |
| 期中追加設定元本額 | 47,146,627円 | 132,932,208円 |
| 期中一部解約元本額 | 3,465,092円 | 9,384,723円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数 | 45,732,607口 | 169,280,092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 | 1.1351円 11,351円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額 | 1.2158円 12,158円) |

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055】

(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 |
|-----------------|---------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 2,415,626 |
| 親投資信託受益証券 | 44,397,345 | 124,370,093 |
| 未収入金 | 112,450 | 166,984 |
| 流動資産合計 | 44,509,795 | 126,952,703 |
| 資産合計 | 44,509,795 | 126,952,703 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 73,727 | 59,110 |
| 未払受託者報酬 | 2,491 | 8,711 |
| 未払委託者報酬 | 32,316 | 113,240 |
| その他未払費用 | 1,141 | 4,265 |
| 流動負債合計 | 109,675 | 185,326 |
| 負債合計 | 109,675 | 185,326 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 38,795,715 | 1 103,042,357 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 5,604,405 | 23,725,020 |
| （分配準備積立金） | 3,365,099 | 2,990,405 |
| 元本等合計 | 44,400,120 | 126,767,377 |
| 純資産合計 | 44,400,120 | 126,767,377 |
| 負債純資産合計 | 44,509,795 | 126,952,703 |

(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 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 656,370 | 4,589,024 |
| 営業収益合計 | 656,370 | 4,589,024 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 733 | 8,711 |
| 委託者報酬 | 9,470 | 113,240 |
| その他費用 | 272 | 4,265 |
| 営業費用合計 | 10,475 | 126,216 |
| 営業利益又は営業損失() | 645,895 | 4,462,808 |
| 経常利益又は経常損失() | 645,895 | 4,462,808 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 645,895 | 4,462,808 |
| 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() | 25,896 | 280,275 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 60,743 | 5,604,405 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | 59,137 | 15,034,413 |
| 中間一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | 59,137 | - |
| 中間追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 15,034,413 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 531,265 | 1,096,331 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | - | 1,096,331 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 531,265 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 208,614 | 23,725,020 |

(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 | 1,075,709円 | 38,795,715円 |
| 期中追加設定元本額 | 42,994,246円 | 71,112,806円 |
| 期中一部解約元本額 | 5,274,240円 | 6,866,164円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数 | 38,795,715口 | 103,042,357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) | 1.1445円 11,445円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.2302円 12,302円) |

【東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065】

(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 |
|-----------------|---------------------|---------------------------|
| 資産の部 | | |
| 流動資産 | | |
| 金銭信託 | - | 1,841,074 |
| 親投資信託受益証券 | 79,672,088 | 283,862,868 |
| 未収入金 | 143,577 | 1,109,404 |
| 流動資産合計 | 79,815,665 | 286,813,346 |
| 資産合計 | 79,815,665 | 286,813,346 |
| 負債の部 | | |
| 流動負債 | | |
| 未払解約金 | 76,419 | 825,687 |
| 未払受託者報酬 | 4,427 | 18,681 |
| 未払委託者報酬 | 57,458 | 242,753 |
| その他未払費用 | 2,115 | 9,244 |
| 流動負債合計 | 140,419 | 1,096,365 |
| 負債合計 | 140,419 | 1,096,365 |
| 純資産の部 | | |
| 元本等 | | |
| 元本 | 1 69,341,722 | 1 230,850,513 |
| 剰余金 | | |
| 中間剰余金又は中間欠損金（ ） | 10,333,524 | 54,866,468 |
| （分配準備積立金） | 5,161,118 | 3,527,894 |
| 元本等合計 | 79,675,246 | 285,716,981 |
| 純資産合計 | 79,675,246 | 285,716,981 |
| 負債純資産合計 | 79,815,665 | 286,813,346 |

(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 |
|---|---|---|
| 営業収益 | | |
| 有価証券売買等損益 | 490,577 | 9,210,664 |
| 営業収益合計 | 490,577 | 9,210,664 |
| 営業費用 | | |
| 受託者報酬 | 1,051 | 18,681 |
| 委託者報酬 | 13,609 | 242,753 |
| その他費用 | 414 | 9,244 |
| 営業費用合計 | 15,074 | 270,678 |
| 営業利益又は営業損失() | 475,503 | 8,939,986 |
| 経常利益又は経常損失() | 475,503 | 8,939,986 |
| 中間純利益又は中間純損失() | 475,503 | 8,939,986 |
| 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() | 136,339 | 1,945,552 |
| 期首剰余金又は期首欠損金() | 87,765 | 10,333,524 |
| 剰余金増加額又は欠損金減少額 | - | 46,384,496 |
| 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 | - | 46,384,496 |
| 剰余金減少額又は欠損金増加額 | 400,136 | 8,845,986 |
| 中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 35,556 | 8,845,986 |
| 中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額 | 364,580 | - |
| 中間剰余金又は中間欠損金() | 299,471 | 54,866,468 |

(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 | 1,503,582円 | 69,341,722円 |
| 期中追加設定元本額 | 88,824,986円 | 211,033,933円 |
| 期中一部解約元本額 | 20,986,846円 | 49,525,142円 |
| 2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数 | 69,341,722口 | 230,850,513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つた場合、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) | 1.1490円 11,490円) | 1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額) | 1.2377円 12,377円) |

(ご参考)

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065は、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」、「TMA外国債券インデックスマザーファンド」、「TMA外国株式インデックスマザーファンド」、「TMA日本債券インデックスマザーファンド」を主要な投資対象としており、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) |
| 資産の部 | | | |
| 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 |
| 負債の部 | | | |
| 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 |
| 純資産の部 | | | |
| 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 | <p>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。</p> <p>株式 681,390,000円</p> | <p>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。</p> <p>株式 852,050,000円</p> |

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

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

(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外国債券インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 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 | | | |
| 預金 | | 57,136,610 | 30,736,117 |
| コール・ローン | | 23,741,347 | 34,449,897 |
| 国債証券 | | 7,306,175,386 | 8,782,658,292 |
| 派生商品評価勘定 | | | 56,810 |
| 未収利息 | | 44,612,459 | 47,168,278 |
| 前払費用 | | 2,144,783 | 2,124,785 |
| 流動資産合計 | | 7,433,810,585 | 8,897,194,179 |
| 資産合計 | | 7,433,810,585 | 8,897,194,179 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 未払金 | | 33,863,397 | 35,586,578 |
| 未払解約金 | | 9,137,293 | 12,270,655 |
| 未払利息 | | 13 | 36 |
| 流動負債合計 | | 43,000,703 | 47,857,269 |
| 負債合計 | | 43,000,703 | 47,857,269 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 4,412,965,149 | 5,098,779,563 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 2,977,844,733 | 3,750,557,347 |
| 元本等合計 | | 7,390,809,882 | 8,849,336,910 |
| 純資産合計 | | 7,390,809,882 | 8,849,336,910 |
| 負債純資産合計 | | 7,433,810,585 | 8,897,194,179 |

(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 | <p>国債証券</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引業者、銀行等の提示する価額（但し、売気配相場は使用しない）、又は価格情報会社の提供する価額で評価しております。</p> |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | <p>為替予約取引</p> <p>個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。</p> |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | <p>外貨建取引等の処理基準</p> <p>外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。</p> |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 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 | 3,109,800,387円 | 4,412,965,149円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 2,186,532,672円 | 1,189,340,964円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 883,367,910円 | 503,526,550円 |
| 同中間期末における元本額 | 4,412,965,149円 | 5,098,779,563円 |
| 元本の内訳* | | |
| L P S 4 資産分散ファンド（慎重型） | 6,827,561円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（安定重視型） | 9,005,984円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（バランス型） | 27,649,249円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（成長重視型） | 24,263,464円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（積極型） | 14,661,934円 | 円 |
| 東京海上セレクション・外国債券インデックス | 3,071,524,638円 | 3,442,978,185円 |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド（年1回決算型） | 124,630,973円 | 148,831,481円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035 | 8,924,996円 | 24,950,209円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045 | 3,019,097円 | 12,006,850円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055 | 2,578,756円 | 7,260,839円 |

| | | |
|--|----------------|----------------|
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065 | 4,624,808円 | 16,584,783円 |
| TMA外国債券インデックスVA <適格機関投資家限定> | 112,726,445円 | 86,211,263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> | 230,644,001円 | 315,058,732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> | 771,883,243円 | 1,044,897,221円 |
| 計 | 4,412,965,149円 | 5,098,779,563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 | 4,412,965,149口 | 5,098,779,563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 (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 |

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

通貨関連

(2021年1月25日現在)
該当事項はありません。

(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 以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 12,900,800 | | 12,957,610 | 56,810 |
| | ユーロ | 12,900,800 | | 12,957,610 | 56,810 |
| 合 計 | | 12,900,800 | | 12,957,610 | 56,810 |

(注)1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。

3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(1口当たり情報に関する注記)

| 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 | 1.6748円 | 1口当たり純資産額 | 1.7356円 |
| (1万口当たり純資産額 | 16,748円) | (1万口当たり純資産額 | 17,356円) |

「TMA外国株式インデックスマザーファンド」の状況

(1) 貸借対照表

| 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 | | | |
| 預金 | | 379,927,458 | 461,819,859 |
| コール・ローン | | 65,990,146 | 116,355,891 |
| 株式 | | 30,913,475,854 | 46,268,104,404 |
| 投資証券 | | 679,011,304 | 1,115,764,407 |
| 派生商品評価勘定 | | 18,462,409 | 8,519,876 |
| 未収配当金 | | 19,814,716 | 31,193,902 |
| 差入委託証拠金 | | 470,990,626 | 654,354,334 |
| 流動資産合計 | | 32,547,672,513 | 48,656,112,673 |
| 資産合計 | | 32,547,672,513 | 48,656,112,673 |
| 負債の部 | | | |
| 流動負債 | | | |
| 派生商品評価勘定 | | 221,707 | 12,721,785 |
| 未払金 | | | 23,065,342 |
| 未払解約金 | | 27,432,107 | 51,114,968 |
| 未払利息 | | 36 | 124 |
| 流動負債合計 | | 27,653,850 | 86,902,219 |
| 負債合計 | | 27,653,850 | 86,902,219 |
| 純資産の部 | | | |
| 元本等 | | | |
| 元本 | 1 | 10,389,370,150 | 13,146,701,429 |
| 剰余金 | | | |
| 剰余金又は欠損金() | | 22,130,648,513 | 35,422,509,025 |
| 元本等合計 | | 32,520,018,663 | 48,569,210,454 |
| 純資産合計 | | 32,520,018,663 | 48,569,210,454 |
| 負債純資産合計 | | 32,547,672,513 | 48,656,112,673 |

(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 | 株式及び投資証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、金融商品取引所等における最終相場（最終相場のないものについては、それに準ずる価額）、又は金融商品取引業者等から提示される気配相場に基づいて評価しております。 |
| 2. デリバティブ等の評価基準及び評価方法 | (1)先物取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として、計算日に知りうる直近の日の主たる取引所の発表する清算値段又は最終相場によっております。 (2)為替予約取引 個別法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、原則として本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客先物売買相場において為替予約の受渡日の仲値が発表されている場合には当該仲値、受渡日の仲値が発表されていない場合には、発表されている受渡日に最も近い前後二つの日の仲値をもとに計算しております。 |
| 3. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項 | 外貨建取引等の処理基準 外貨建取引については、「投資信託財産の計算に関する規則」（平成12年総理府令第133号）第60条に基づき、取引発生時の外国通貨の額をもって記録する方法を採用しております。但し、同第61条に基づき、外国通貨の売却時において、当該外国通貨に加えて、外貨建資産等の外貨基金勘定及び外貨建各損益勘定の前日の外貨建純資産額に対する当該売却外国通貨の割合相当額を当該外国通貨の売却時の外国為替相場等で円換算し、前日の外貨基金勘定に対する円換算した外貨基金勘定の割合相当の邦貨建資産等の外国投資勘定と、円換算した外貨基金勘定を相殺した差額を為替差損益とする計理処理を採用しております。 |

(貸借対照表に関する注記)

| 区 分 | 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 | 5,970,420,435円 | 10,389,370,150円 |
| 同期中における追加設定元本額 | 6,045,309,007円 | 3,482,155,484円 |
| 同期中における一部解約元本額 | 1,626,359,292円 | 724,824,205円 |
| 同中間期末における元本額 | 10,389,370,150円 | 13,146,701,429円 |
| 元本の内訳* | | |
| L P S 4 資産分散ファンド（慎重型） | 2,214,429円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（安定重視型） | 3,755,213円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（バランス型） | 11,713,332円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（成長重視型） | 16,489,454円 | 円 |
| L P S 4 資産分散ファンド（積極型） | 16,932,119円 | 円 |

| | | |
|--|-----------------|-----------------|
| 東京海上セレクション・外国株式インデックス | 9,195,684,892円 | 11,809,902,632円 |
| 東京海上・年金運用型戦略ファンド （年1回決算型） | 69,303,074円 | 68,950,265円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035 | 15,384,415円 | 35,837,368円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045 | 5,372,042円 | 17,802,403円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055 | 4,875,425円 | 11,102,049円 |
| 東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065 | 9,000,136円 | 26,894,809円 |
| TMA外国株式インデックスVA ＜適格機関投資家限定＞ | 62,744,659円 | 41,279,093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＞ | 108,063,480円 | 122,712,681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＞ | 867,837,480円 | 976,777,186円 |
| 先進国株式インデックス （適格機関投資家専用） | 円 | 35,174,558円 |
| 東京海上セレクション・外国株式インデックス2 ＜適格機関投資家限定＞ | 円 | 268,385円 |
| 計 | 10,389,370,150円 | 13,146,701,429円 |
| 2. 1 本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日における当該親投資信託の受益権の総数 | 10,389,370,150口 | 13,146,701,429口 |

（注）*は当該親投資信託受益証券を投資対象とする証券投資信託ごとの元本額

（金融商品に関する注記）

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

(デリバティブ取引等に関する注記)

取引の時価等に関する事項

(1) 株式関連

(2021年1月25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 | 897,504,005 | | 915,704,407 | 18,200,402 |
| | S&P 500 EMIN | 640,187,878 | | 656,936,492 | 16,748,614 |
| | DJ EU STX 50 | 135,483,804 | | 136,024,667 | 540,863 |
| | FTSE 100 IDX | 121,832,323 | | 122,743,248 | 910,925 |
| | 合計 | 897,504,005 | | 915,704,407 | 18,200,402 |

(2021年7月25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 | 1,165,374,586 | | 1,161,172,677 | 4,201,909 |
| | S&P 500 EMIN | 848,108,565 | | 854,333,432 | 6,224,867 |
| | DJ EU STX 50 | 169,894,771 | | 163,755,745 | 6,139,026 |
| | FTSE 100 IDX | 147,371,250 | | 143,083,500 | 4,287,750 |
| | 合計 | 1,165,374,586 | | 1,161,172,677 | 4,201,909 |

(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。
また契約額等及び時価の邦貨換算は本書における開示対象ファンドの中間計算期間末日の対顧客電信売買相場の仲値で行っております。
4. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2) 通貨関連

(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 以外の取引 | 為替予約取引 | | | | |
| | 買建 | 13,457,600 | | 13,497,900 | 40,300 |
| | 米ドル | 13,457,600 | | 13,497,900 | 40,300 |
| | 合 計 | 13,457,600 | | 13,497,900 | 40,300 |

(注)1. 時価の算定方法

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

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

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

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

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

2. 換算において円未満の端数は切り捨てております。
3. 契約額等及び時価の合計欄の金額は、各々の合計金額であります。

(2021年7月25日現在)

該当事項はありません。

(1口当たり情報に関する注記)

| 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 | 3.1301円 | 1口当たり純資産額 | 3.6944円 |
| (1万口当たり純資産額) | (31,301円) | (1万口当たり純資産額) | (36,944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) |

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035

2021年7月30日 現在

| 種類 | 金額 |
|-------------------|---------------|
| 資産総額 | 441,042,970 円 |
| 負債総額 | 555,973 円 |
| 純資産総額 (-) | 440,486,997 円 |
| 発行済数量 | 361,921,186 口 |
| 1 単位当たり純資産額 (/) | 1.2171 円 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045

2021年7月30日 現在

| 種類 | 金額 |
|-------------------|---------------|
| 資産総額 | 212,912,693 円 |
| 負債総額 | 11,507 円 |
| 純資産総額 (-) | 212,901,186 円 |
| 発行済数量 | 173,841,168 口 |
| 1 単位当たり純資産額 (/) | 1.2247 円 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055

2021年7月30日 現在

| 種類 | 金額 |
|-------------------|---------------|
| 資産総額 | 134,533,322 円 |
| 負債総額 | 8,140 円 |
| 純資産総額 (-) | 134,525,182 円 |
| 発行済数量 | 108,534,098 口 |
| 1 単位当たり純資産額 (/) | 1.2395 円 |

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065

2021年7月30日 現在

| 種類 | 金額 |
|-------------------|---------------|
| 資産総額 | 296,649,595 円 |
| 負債総額 | 198,422 円 |
| 純資産総額 (-) | 296,451,173 円 |
| 発行済数量 | 237,639,756 口 |
| 1 単位当たり純資産額 (/) | 1.2475 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 |

T M A 外国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 | 8,879,597,582 円 |
| 負債総額 | 3,103,104 円 |
| 純資産総額(-) | 8,876,494,478 円 |
| 発行済数量 | 5,107,883,649 口 |
| 1 単位当たり純資産額(/) | 1.7378 円 |

T M A 外国株式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 | 49,972,438,572 円 |
| 負債総額 | 54,863,371 円 |
| 純資産総額(-) | 49,917,575,201 円 |
| 発行済数量 | 13,199,459,826 口 |
| 1 単位当たり純資産額(/) | 3.7818 円 |

T M A 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 |

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します。）にお支払いします。

8. 質権口記載又は記録の受益権の取り扱いについて

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

第三部【委託会社等の情報】

第1【委託会社等の概況】

1【委託会社等の概況】

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) |
|--------------|------------------------|------------------------|
| 資産の部 | | |
| 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 |
| 負債の部 | | |
| 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 |
| 純資産の部 | | |
| 株主資本 | | |
| 資本金 | 2,000,000 | 2,000,000 |
| 資本剰余金 | 400,000 | 400,000 |
| その他資本剰余金 | 400,000 | 400,000 |
| 利益剰余金 | 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>(1) 金融商品に対する取組方針 同左</p> |
| <p>(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスク に晒されており、未収委託者報酬は市場リス クに晒されております。投資有価証券は、主 にファンドの自己設定に関連する投資信託で あり、基準価額の変動リスクに晒されてあり ます。 営業債務である未払金は、ほとんど1年以内 の支払期日であり、流動性リスクに晒されて おります。</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 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。 市場リスク 未収委託者報酬には、運用資産の悪化から回 収できず当社が損失を被るリスクが存在しま すが、過去の回収実績からリスクは僅少であ ると判断しております。 投資有価証券については、管理部門において 定期的に時価を把握する体制としておりま す。 流動性リスク 当社は、日々資金残高管理を行っており流動 性リスクを管理しております。</p> | <p>(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 同左 市場リスク 同左 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 其他有価証券 | 65,610 | 65,610 | - |
| (6)預り金 | (43,576) | (43,576) | - |
| (7)未払金 | (2,555,940) | (2,555,940) | - |
| (8)未払費用 | (544,639) | (544,639) | - |
| (9)未払消費税等 | (367,506) | (367,506) | - |
| (10)未払法人税等 | (1,347,000) | (1,347,000) | - |

（*）負債に計上されているものについては、（ ）で示しております。

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 其他有価証券のうち満期があるもの | 2,247 | 21,678 | 22,121 | - |
| 合計 | 25,022,515 | 21,678 | 22,121 | - |

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 其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>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. 其他有価証券</p> <p>(単位:千円)</p> | <p>2. 其他有価証券</p> <p>(単位:千円)</p> |

| 区分 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 | 区分 | 貸借対照表 計上額 | 取得原価 | 差額 |
|--|--------------|--------|-------|--|--------------|--------|-------|
| 貸借対照 表計上額が 取得原価を 超えるもの 証券投資 信託 | 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 |
| 退職給付債務の期末残高 | 739,283千円 |

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

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

(3) 退職給付費用及びその内訳項目の金額

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

(4) 数理計算上の計算基礎に関する事項

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

| | |
|-----|------|
| 割引率 | 0.4% |
|-----|------|

3. 確定拠出制度

当社の確定拠出制度への要拠出額は、66,184千円であります。

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。)

通常の利用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 | |
| 株式会社伊予銀行 | 20,948百万円 | 銀行法に基づき銀行業を営んでいます。 |
| 株式会社群馬銀行 | 48,652百万円 | |
| 株式会社八十二銀行 | 52,243百万円 | |
| 株式会社北洋銀行 | 121,101百万円 | |
| 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ターゲット・イヤー・ファンド2035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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035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ターゲット・イヤー・ファンド2045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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2045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ターゲット・イヤー・ファンド2055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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2055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ターゲット・イヤー・ファンド2065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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2065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ターゲット・イヤー・ファンド2035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、東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035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。

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

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

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