

【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】	2022年3月18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】	東京海上セレクション・日本株TOPIX
【届出の対象とした募集（売出）内国投資信託受益証券の金額】	上限 1兆円
【縦覧に供する場所】	該当なし

第一部【証券情報】

(1)【ファンドの名称】

東京海上セレクション・日本株TOPIX（以下「当ファンド」ということがあります。）

(2)【内国投資信託受益証券の形態等】

追加型証券投資信託の受益権です。

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

当初の1口当たり元本は1円です。

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

(3)【発行（売出）価額の総額】

1兆円を上限とします。

(4)【発行（売出）価格】

取得申込受付日の基準価額

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

委託会社のお問い合わせ先（以下「委託会社サービスデスク」といいます。）

東京海上アセットマネジメント サービスデスク

0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）

(5)【申込手数料】

申込時の手数料はありません。

(6)【申込単位】

販売会社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。

上記にかかわらず、自動けいぞく（累積）投資に基づく収益分配金の再投資に際しては、1口の整数倍をもって取得できます。

(7)【申込期間】

2022年3月19日から2022年9月20日まで

上記申込期間中の毎営業日にお申込みを受け付けます。

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

(8)【申込取扱場所】

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

(9)【払込期日】

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

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

(10)【払込取扱場所】

申込金は、お申込みの販売会社にお支払いください。

(11)【振替機関に関する事項】

当ファンドの受益権の振替機関は下記の通りです。

株式会社証券保管振替機構

(12)【その他】

申込の方法

- a. 受益権の取得申込は、販売会社において申込期間中の毎営業日に受け付けます。
- b. 取得申込者は、申込金額相当額の申込金を販売会社に支払うものとします。ただし、当ファンドは上記「(9)払込期日」にしたがい受託会社に払込まれた時点で初めて設定がなされ、取得申込者はその時点から当ファンドの当該設定にかかる受益者となります。申込金には利息を付けません。
- c. 取得申込の受付は、原則として午後3時までの受付分を当日分とし、この受付時間を過ぎてからの申込分は翌営業日の受付分とします。
- d. 上記にかかわらず、証券取引所（ ）における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
（ ）金融商品取引法第2条第16項に規定する金融商品取引所および金融商品取引法第2条第8項第3号口に規定する外国金融商品市場を「取引所」といい、取引所のうち、有価証券の売買または金融商品取引法第2条第8項第3号もしくは同項第5号の取引を行う市場および当該市場を開設するものを「証券取引所」といいます（以下、本書において同じ。 ）。
- e. 取得申込者は、販売会社に取引口座を開設のうえ、申込を行うものとします。（ただし、既に取引口座をお持ちの場合を除きます。 ）
- f. 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を再投資する自動けいぞく（累積）投資専用ファンドです。このため申込の際、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく（累積）投資に関する契約を締結する必要があります。
上記の契約について、別の名称で同様の権利義務関係を規定する契約等が用いられることがあります。この場合、当該別の名称に読替えるものとします（以下同じ。 ）。

日本以外の地域における発行

該当ありません。

振替受益権について

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

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

第二部【ファンド情報】

第1【ファンドの状況】

1【ファンドの性格】

(1)【ファンドの目的及び基本的性格】

ファンドの目的

当ファンドは、東京証券取引所第一部^(注)の上場銘柄全体の値動きをあらわすTOPIX（東証株価指数）に連動する投資成果を目標とし、同様の運用目標を持つ「TMA日本株TOPIXマザーファンド」（以下「マザーファンド」ということがあります。）受益証券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。

(注)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に連動する投資成果を目標とする」当ファンドの基本方針に変更はありません。

基本的性格

当ファンドは、追加型投信/国内/株式/インデックス型に属します。

当ファンドの商品分類表および属性区分表は、以下の通りです。

商品分類表

単位型投信・追加型投信	投資対象地域	投資対象資産 (収益の源泉)	補足分類
単位型投信	国内	株式	インデックス型
	海外	債券	
追加型投信	内外	不動産投信	特殊型
		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	対象インデックス
株式	年1回	グローバル	ファミリーファンド	日経225
一般				
大型株	年2回	日本		
中小型株	年4回	北米		
債券			ファンド・オブ・ファンズ	TOPIX
一般	年6回	欧州		
公債	(隔月)	アジア		
社債				
その他債券	年12回	オセアニア	ファンド・オブ・ファンズ	その他 ()
クレジット属性	(毎月)	中南米		
()	日々	アフリカ		
	その他	中近東 (中東)		
不動産投信	()			
その他資産 (投資信託証券(株式(一般)))		エマージング		
資産複合 ()				
資産配分固定型				
資産配分変更型				

当ファンドが該当する商品分類・属性区分を網掛け表示しています。

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

商品分類の定義

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

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

属性区分の定義

投資対象資産	株式	一般	次の大型株、中小型株属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		大型株	目論見書または投資信託約款において、主として大型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
		中小型株	目論見書または投資信託約款において、主として中小型株に投資する旨の記載があるものをいいます。
	債券	一般	次の公債、社債、その他債券属性にあてはまらない全てのものをいいます。
		公債	目論見書または投資信託約款において、日本国または各国の政府の発行する国債（地方債、政府保証債、政府機関債、国際機関債を含みます。以下同じ。）に主として投資する旨の記載があるものをいいます。

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

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

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

信託金の限度額

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

ファンドの特色

1

主に東京証券取引所第一部に上場されている銘柄[※]に投資します。

※東京証券取引所の市場再編に伴って2022年4月に約款変更を行い、「東京証券取引所第一部に上場されている銘柄」を「TOPIXに採用されている銘柄」に変更する予定です。(以下同じ)

- 主に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て運用する「TMA日本株TOPIXマザーファンド」(以下「マザーファンド」ということがあります。)に投資します。
- 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。

2

TOPIXに連動する投資成果を目標とします。

- TOPIXをベンチマークとします。
投資成果はTOPIXの動きに連動することを目標としますが、両者は正確に連動するものではなく、いくつかの要因により乖離が生じることがあります。

3

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

<マザーファンドが対象とする指数について>

- TOPIXの指数値及びTOPIXの商標は、株式会社東京証券取引所(以下「(株)東京証券取引所」という。)の知的財産であり、株価指数の算出、指数値の公表、利用等TOPIXに関するすべての権利・ノウハウ及びTOPIXの商標に関するすべての権利は(株)東京証券取引所が有しています。
- (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の方法の変更、TOPIXの指数値の算出若しくは公表の停止又はTOPIXの商標の変更若しくは使用の停止を行うことができます。
- (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びTOPIXの商標の使用に関して得られる結果並びに特定日のTOPIXの指数値について、何ら保証、言及をするものではありません。
- (株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値及びそこに含まれるデータの正確性、完全性を保証するものではありません。また、(株)東京証券取引所は、TOPIXの指数値の算出又は公表の誤謬、遅延又は中断に対し、責任を負いません。
- ファンドは、(株)東京証券取引所により提供、保証又は販売されるものではありません。
- (株)東京証券取引所は、ファンドの購入者又は公衆に対し、ファンドの説明、投資のアドバイスをする義務を負いません。
- (株)東京証券取引所は、委託会社又はファンドの購入者のニーズを、TOPIXの指数値を算出する銘柄構成、計算に考慮するものではありません。
- 以上の項目に限らず、(株)東京証券取引所はファンドの設定、販売及び販売促進活動に起因するいかなる損害に対しても、責任を有しません。

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は、信託財産の純資産総額の20%以下とします。
デリバティブ	デリバティブ取引等は、投資の対象とする資産を保有した場合と同様の損益を実現する目的、価格変動リスクおよび金利変動リスクを回避する目的以外には利用しません。

分配方針

◎年1回決算を行います。

- 6月20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、繰越分を含めた利子・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。

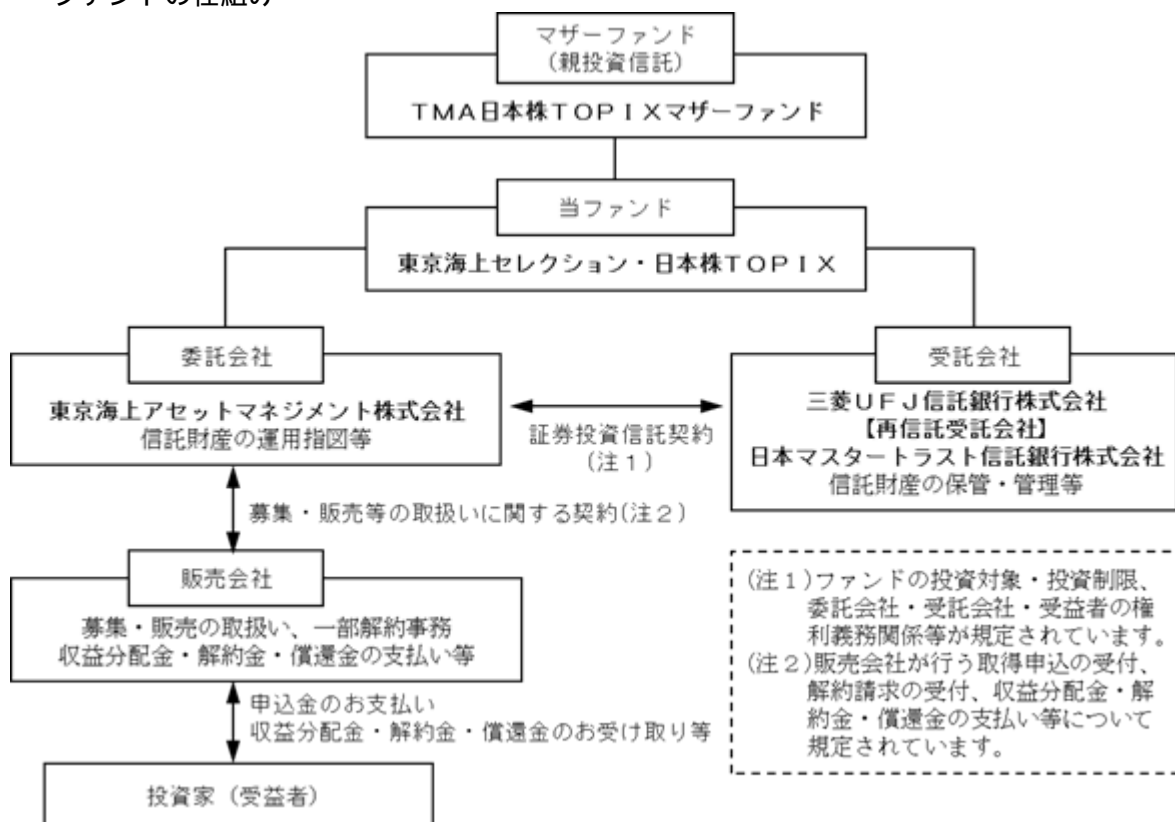
資金動向および市況動向等によっては、上記のような運用ができない場合があります。

(2) 【ファンドの沿革】

2001年9月25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12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12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

TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とし、主として同じ目標で運用を行うマザーファンド受益証券に投資します。

2．運用方法

(1) 主要投資対象

主としてマザーファンド受益証券に投資し、高位の組入比率を維持します。なお、このほか内外の株式等に直接投資することがあります。

(2) 投資態度

主として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て運用するマザーファンド受益証券に投資します。()

TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

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。

株式以外の資産（マザーファンド受益証券を通じて投資する場合は、当該マザーファンドの信託財産に属する株式以外の資産のうち、当ファンドの信託財産に属するとみなした部分を含みます。）への投資は、原則として信託財産総額の50%以下とします。

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

() 2022年4月に約款変更を行い、 を次の通り変更する予定です。

主としてTOPIXに採用されている銘柄を主要投資対象として運用するマザーファンド受益証券に投資します。

<参考情報> マザーファンドの投資方針、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

<基本方針> TOPIXに連動する投資成果の達成を目標とします。

(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。(1)

(1) 東京証券取引所の市場再編に伴って2022年4月に約款変更を行い、次の通り変更する予定です。

TOPIXに採用されている銘柄を主要投資対象とします。

(2)運用方針

東京証券取引所第一部に上場されている銘柄を中心に、TOPIXとの連動性を考慮し組入を行います。組入銘柄の選択に際しては、流動性その他を考慮し、東京証券取引所第一部上場銘柄であっても組入れない、あるいは東京証券取引所第一部上場以外の銘柄を組入れることもあります。(2)

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

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、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。

(2) 2022年4月に約款変更を行い、 を次の通り変更する予定です。

TOPIXに採用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。

<投資制限>

(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。

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

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

(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（先物取引等の運用指図）、第23条（スワップ取引の運用指図）および第24条（金利先渡取引および為替先渡取引の運用指図）に定めるものに限り。）

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TOPIX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

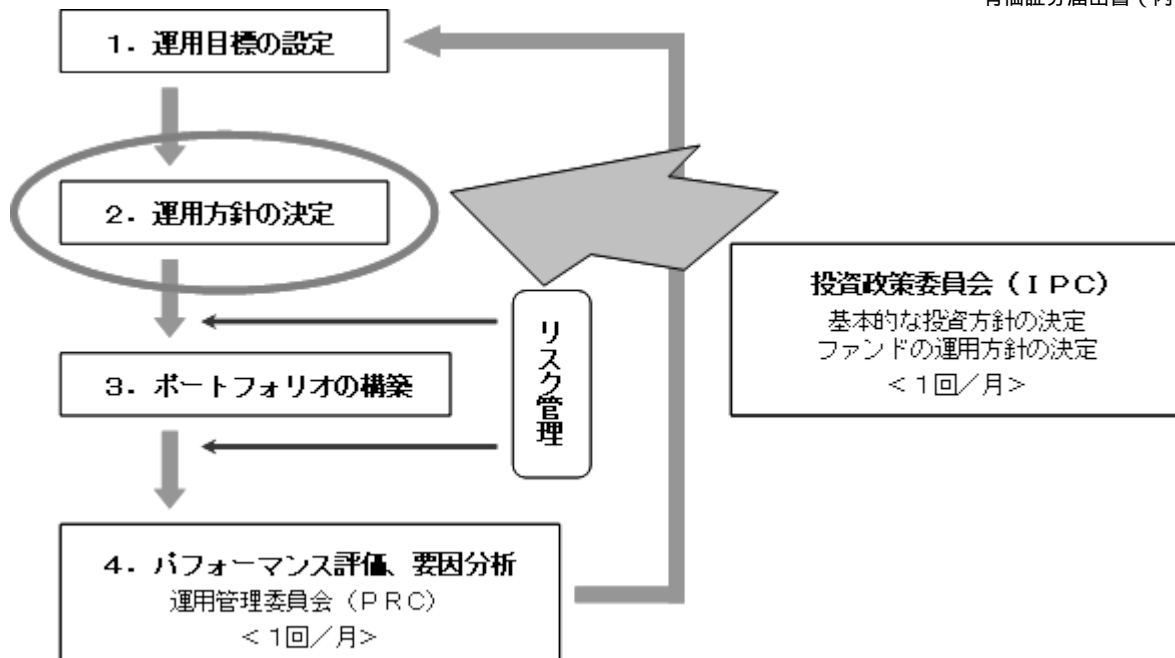
(2) 国債証券

(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。)
 - (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。)
 - (20) 抵当証券(金融商品取引法第2条第1項第16号で定めるものをいいます。)
 - (21) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第1項第14号で定める受益証券発行信託の受益証券に表示されるべきもの
 - (22) 外国の者に対する権利で上記(21)の有価証券の性質を有するもの
- なお、(1)の証券または証書、(12)および(17)の証券または証書のうち(1)の証券または証書の性質を有するものを以下「株式」といい、(2)から(6)までの証券、(12)および(17)の証券または証書のうち(2)から(6)までの証券の性質を有するものならびに(14)の投資法人債券を以下「公社債」といい、(13)の証券および(14)の証券(投資法人債券を除きます。)を以下「投資信託証券」といいます。
3. 委託会社は、信託金を、上記2. に掲げる有価証券のほか、次に掲げる金融商品(金融商品取引法第2条第2項の規定により有価証券とみなされる同項各号に掲げる権利を含みます。)により運用することを指図することができます。
 - (1) 預金
 - (2) 指定金銭信託(金融商品取引法第2条第1項第14号に規定する受益証券発行信託を除きます。)
 - (3) コール・ローン
 - (4) 手形割引市場において売買される手形
 - (5) 貸付債権信託受益権であって金融商品取引法第2条第2項第1号で定めるもの
 - (6) 外国の者に対する権利で上記(5)の権利の性質を有するもの
 4. 上記2. の規定にかかわらず、当ファンドの設定、解約、償還、投資環境の変動等への対応等、委託会社が運用上必要と認めるときは、委託会社は、信託金を、上記3. に掲げる金融商品により運用することの指図ができます。

(3) 【運用体制】

当ファンドの運用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12月末日現在）

(4)【分配方針】

年1回（原則として6月20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、繰越分を含めた利子・配当等収益および売買益（評価益を含みません。）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、分配対象収益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。なお、収益の分配に充当せず、信託財産内に留保した利益については、投資方針に基づいて運用を行います。信託財産から生ずる毎計算期末における利益は、次の方法により処理します。

a. 配当金、利子、貸付有価証券にかかる品貸料およびこれらに類する収益から支払利息を控除した額（「配当等収益」といいます。）は、諸経費（ ）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税および地方消費税（以下「消費税等」といいます。）に相当する金額を控除した後、その残額を受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配金にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

b. 売買損益に評価損益を加減した利益金額（以下「売買益」といいます。）は、諸経費（ ）、信託報酬および当該信託報酬にかかる消費税等に相当する金額を控除し、繰越欠損金のあるときは、その全額を売買益をもって補てんした後、受益者に分配することができます。なお、次期以降の分配にあてるため、その一部を分配準備積立金として積み立てることができます。

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

計算期末において信託財産に損失が生じた場合は、次期に繰越します。

分配金は、自動けいぞく（累積）投資に関する契約に基づき、自動的に無手数料で再投資されます。なお、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. 株式への投資割合には、制限を設けません。

- b. 委託会社は、信託財産に属する外貨建資産の時価総額とマザーファンドに属する外貨建資産の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、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。）
- 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の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の20を超えることとなる投資の指図をしません。
- d. 委託会社は、信託財産に属する投資信託証券（マザーファンド受益証券を除きます。）の時価総額とマザーファンドに属する投資信託証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額の合計額が、信託財産の純資産総額の100分の5を超えることとなる投資の指図をしません。
- e. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の新株引受権証券および新株予約権証券の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- f. 委託会社は、信託財産に属する同一銘柄の転換社債ならびに新株予約権付社債のうち会社法第236条第1項第3号の財産が当該新株予約権付社債についての社債であって当該社債と当該新株予約権がそれぞれ単独で存在し得ないことをあらかじめ明確にしているもの（会社法施行前の旧商法第341条ノ3第1項第7号および第8号の定めがある新株予約権付社債を含め「転換社債型新株予約権付社債」といいます。）の時価総額とマザーファンドに属する当該同一銘柄の転換社債ならびに転換社債型新株予約権付社債の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が、信託財産の純資産総額の100分の10を超えることとなる投資の指図をしません。
- g. 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、価格変動および金利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。
- 投資する株式等の範囲（約款第19条）
- a. 委託会社が投資することを指図する株式、新株引受権証券および新株予約権証券は、証券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証券取引所に準ずる市場において取引されている株式の発行会社の発行するものとします。ただし、株主割当または社債権者割当により取得する株式、新株引受権証券および新株予約権証券については、この限りではありません。
- b. 上記a.の規定にかかわらず、上場予定または登録予定の株式、新株引受権証券および新株予約権証券で目論見書等において上場または登録されることが確認できるものについては、委託会社が投資することを指図することができるものとします。
- 信用取引（約款第21条）
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信用取引により株券を売付けることの指図をすることができます。なお、当該売付の決済については、株券の引渡または買戻により行うことの指図をすることができるものとします。
- b. 上記a.の信用取引の指図は、当該売付にかかる建玉の時価総額とマザーファンドの信託財産に属する当該売付にかかる建玉の時価総額のうち信託財産に属するとみなした額との合計額が信託財産の純資産総額の範囲内とします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により、上記b.の売付にかかる建玉の時価総額の合計額が信託財産の純資産総額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する売付の一部を決済するための指図をするものとします。
- 先物取引等（約款第22条）
- a. 委託会社は、日本国内の証券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。本書において同じ。）、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。本書において同じ。）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。本書において同じ。）ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。なお、選択権取引は、オプション取引に含めるものとします（以下同じ。）。
- b. 委託会社は、日本国内の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所における通貨にかかる先物取引およびオプション取引を行うことの指図をすることができます。
- c. 委託会社は、日本国内の取引所における金利にかかる先物取引およびオプション取引ならびに外国の取引所におけるこれらの取引と類似の取引を行うことの指図をすることができます。
- スワップ取引（約款第23条）
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、異なった通貨、異なった受取金利または異なった受取金利とその元本を一定の条件のもとに交換する取引（以下「スワップ取引」といいます。）を行うことの指図をすることができます。

- b. スワップ取引の指図にあたっては、当該取引の契約期限が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. スワップ取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、スワップ取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。
- 金利先渡取引および為替先渡取引(約款第24条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、金利先渡取引および為替先渡取引を行うことの指図をすることができます。
- b. 金利先渡取引および為替先渡取引の指図にあたっては、当該取引の決済日が、原則として信託期間を超えないものとします。ただし、当該取引が信託期間内で全部解約が可能なものについてはこの限りではありません。
- c. 金利先渡取引および為替先渡取引の評価は、当該取引契約の相手方が市場実勢金利等をもとに算出した価額で行うものとします。
- d. 委託会社は、金利先渡取引および為替先渡取引を行うにあたり担保の提供あるいは受入が必要と認めるときは、担保の提供あるいは受入の指図を行うものとします。
- デリバティブ取引等に係る投資制限(約款第24条の2)
- デリバティブ取引等について、一般社団法人投資信託協会規則の定めるところにしたがい、合理的な方法により算出した額が信託財産の純資産総額を超えないものとします。
- 有価証券の貸付(約款第25条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産に属する株式および公社債を次の範囲内で貸付の指図をすることができます。
- ・株式の貸付は、貸付時点において、貸付株式の時価合計額が、信託財産で保有する株式の時価合計額を超えないものとします。
 - ・公社債の貸付は、貸付時点において、貸付公社債の額面金額の合計額が、信託財産で保有する公社債の額面金額の合計額を超えないものとします。
- b. 上記a. に定める限度額を超えることとなった場合には、委託会社は速やかに、その超える額に相当する契約の一部の解約を指図するものとします。
- c. 委託会社は、有価証券の貸付にあたって必要と認めるときは、担保の受入の指図を行うものとします。
- 公社債の空売(約款第26条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、信託財産の計算においてする信託財産に属さない公社債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、公社債(信託財産において借入れた公社債を含みます。)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、当該売付にかかる公社債の時価総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. の売付にかかる公社債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売付の一部を決済するための指図をするものとします。
- 公社債の借入(約款第27条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、公社債の借入の指図をすることができます。なお、当該公社債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、当該借入にかかる公社債の時価総額が信託財産の純資産総額の範囲内で行えるものとします。
- c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b. の借入にかかる公社債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公社債の一部を返還するための指図をするものとします。
- d. 上記a. の借入にかかる品借料は信託財産中から支弁します。
- 特別な場合の外貨建有価証券への投資制限(約款第28条)
- 外貨建有価証券への投資については、日本の国際収支上の理由等により特に必要と認められる場合には、制約されることがあります。
- 外国為替予約取引(約款第29条)
- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用に資するため、外国為替の売買の予約取引の指図をすることができます。
- b. 上記a. の指図は、信託財産にかかる為替の買予約の合計額と売予約の合計額との差額につき円換算した額が、信託財産の純資産総額を超えないものとします。ただし、信託財産に属する外貨建資産(マザーファンドの信託財産に属する外貨建資産のうち信託財産に属するとみなした額を含みま

す。)の為替変動リスクを回避するためにする当該予約取引の指図については、この限りではありません。

- c. 信託財産の一部解約等の事由により上記b.の限度額を超えることとなった場合には、委託会社は所定の期間内にその超える額に相当する為替予約の一部を解消するための外国為替の売買の予約取引の指図をするものとします。

信用リスク集中回避のための投資制限(約款第29条の2)

一般社団法人投資信託協会規則に定める一の者に対する株式等エクスポージャー、債券等エクスポージャーおよびデリバティブ等エクスポージャーの信託財産の純資産総額に対する比率は、原則として、それぞれ100分の10、合計で100分の20を超えないものとし、当該比率を超えることとなった場合には、委託会社は、一般社団法人投資信託協会規則にしたがい当該比率以内となるよう調整を行うこととします。

資金の借入(約款第37条)

- a. 委託会社は、信託財産の効率的な運用ならびに運用の安定性に資するため、一部解約に伴う支払資金の手当て(一部解約に伴う支払資金の手当てのために借入れた資金の返済を含みます。)を目的として、または再投資にかかる収益分配金の支払資金の手当てを目的として、資金借入れ(コール市場を通じる場合を含みます。)の指図をすることができます。なお、当該借入金をもって有価証券等の運用は行わないものとします。
- b. 一部解約に伴う支払資金の手当てにかかる借入期間は、受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の売却代金の受渡日までの間または受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の解約代金入金日までの間もしくは受益者への解約代金支払開始日から信託財産で保有する有価証券等の償還金の入金日までの期間が5営業日以内である場合の当該期間とし、資金借入額は当該有価証券等の売却代金、解約代金および償還金の合計額を限度とします。
- c. 収益分配金の再投資にかかる借入期間は信託財産から収益分配金が支弁される日からその翌営業日までとし、資金借入額は収益分配金の再投資額を限度とします。
- d. 借入金の利息は信託財産中から支弁します。

3【投資リスク】

1. 投資リスク

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

(1) 価格変動リスク

当ファンドは、主に株式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、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。）。組入銘柄の株価が大きく下落した場合には、基準価額が下落する要因となります。

流動性リスク

受益者から短期間に相当金額の解約申込があった場合、ファンドは組入資産を売却することで解約金額の手当てを行います。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。これに伴い基準価額が大きく下落することがあります。

(2) TOPIXとの乖離リスク

当ファンドの投資成果はTOPIXの動きに連動することを目標としますが、両者は正確に連動するのではなく、いくつかの要因により乖離が生じます。乖離が生じる主な要因は次の通りです。

- ・流動性の確保その他の理由で現預金等を保有すること
- ・東京証券取引所第一部上場銘柄を必ずしも全銘柄保有しないこと、あるいは、保有ウェイトがTOPIXにおけるウェイトと異なること
- ・株式売買手数料等の取引コストを負担すること
- ・信託報酬等の管理報酬を負担すること

(3) デリバティブ取引のリスク

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

2. その他の留意事項

(1) 一般的な留意事項

投資信託は、その商品性格から次の特徴をご理解のうえご購入ください。

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

(2) 法令・税制・会計等の変更可能性

法令・税制・会計方法等は今後変更される可能性があります。

(3) その他の留意点

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

一部解約金、収益分配金および償還金の支払は全て販売会社を通じて行われます。

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

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

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

当ファンドは、大量の解約申込が発生し短期間で解約資金を手当てする必要が生じた場合や主たる取引市場において市場環境が急変した場合等に、一時的に組入資産の流動性が低下し、市場実勢から期待できる価格で取引できないリスク、取引量が限られてしまうリスクがあります。これにより、基準価額が下落する可能性や、換金のお申込みの受付が中止となる可能性、換金代金のお支払いが遅延する可能性があります。

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

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

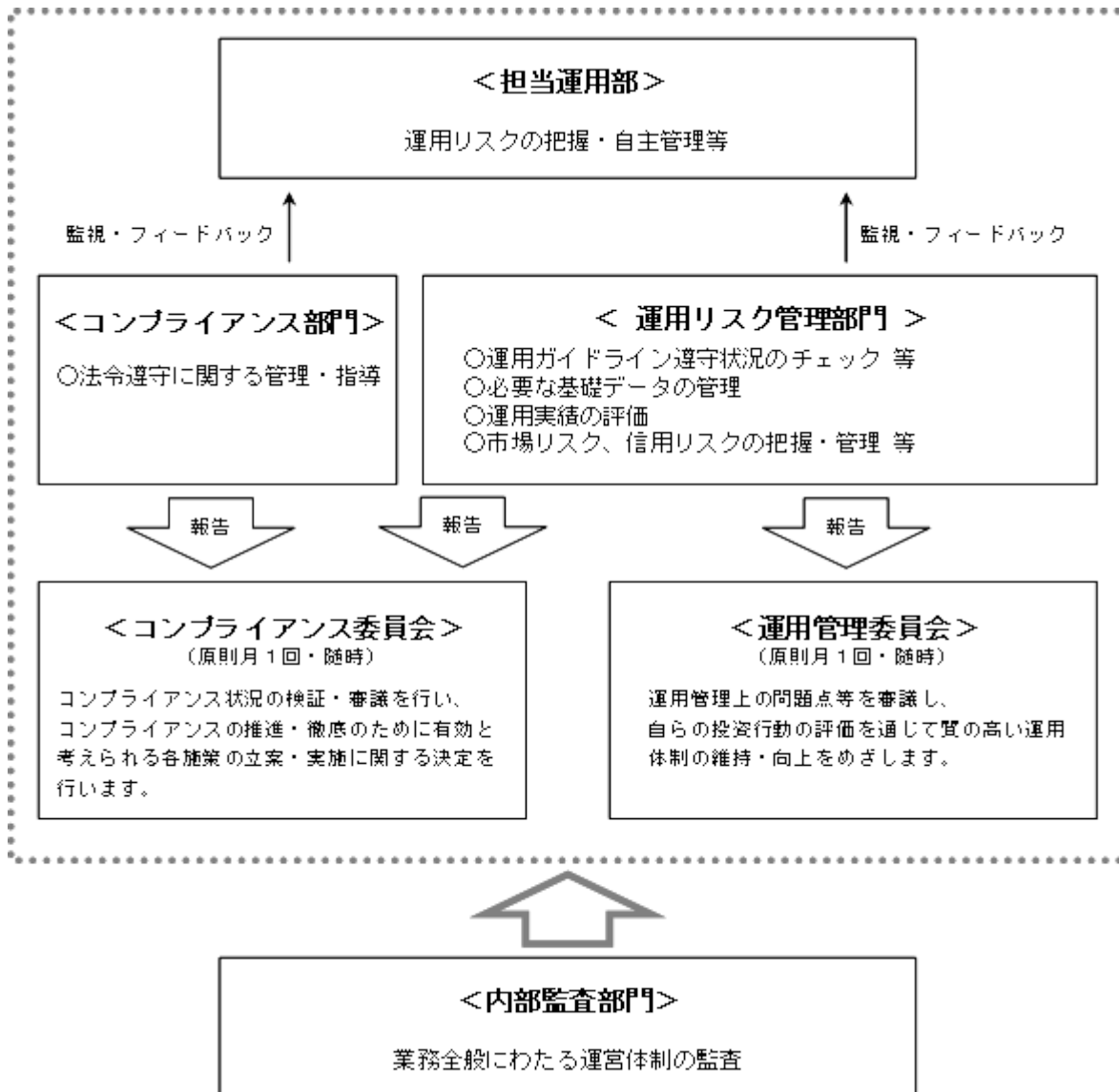
3. 管理体制

<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。



<流動性リスク管理>

委託会社では、流動性リスク管理に関する規程を定め、ファンドの組入資産の流動性リスクのモニタリング等を実施するとともに、緊急時対応策の策定・検証等を行います。

取締役会等は、流動性リスク管理の適切な実施の確保や流動性リスク管理態勢について、監督します。

参考情報

2017年1月～2021年12月

ファンドの年間騰落率および
分配金再投資基準価額の推移

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



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

ファンドと代表的な資産クラスとの
騰落率の比較

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



※全ての資産クラスがファンドの投資対象とは限りません。

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

代表的な資産クラスと指数名

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、誤脱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、年率0.154%（税抜0.14%）を乗じて得た金額とし、計算期間を通じて、毎日計上します。

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

信託報酬の配分（税抜）については以下の通りとします。

委託会社 ^{*1}	販売会社 ^{*2}	受託会社 ^{*3}
年率0.06%	年率0.06%	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0.0055%（税抜0.005%）を乗じて得た金額（ただし、年49.5万円（税抜45万円）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。配当控除は、総合課税を選択した場合には適用がありますが、申告不要制度の適用を受けた場合または申告分離課税を選択した場合には適用がありません。申告分離課税を選択した場合の税率は、20.315%（所得税15%、復興特別所得税0.315%および地方税5%）となります。収益分配金のうち課税対象となるのは普通分配金のみであり、元本払戻金（特別分配金）（1）は課税されません。

2037年12月31日までの間、復興特別所得税（所得税15%×2.1%）が付加されます。

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

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

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

少額投資非課税制度「NISA(ニーサ)」、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12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12月30日現在の運用状況です。

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

(1)【投資状況】

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
親投資信託受益証券	日本	27,426,982,674	100.00
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		1,046,662	0.00
合計(純資産総額)		27,425,936,012	100.00

(ご参考：親投資信託の投資状況)

当ファンドが主要投資対象とする親投資信託の投資状況は以下の通りです。

TMA日本株TOPIXマザーファンド

資産の種類	地域	時価合計(円)	投資比率(%)
株式	日本	39,441,885,290	96.09
コール・ローン等、その他の資産(負債控除後)		1,600,662,161	3.90
合計(純資産総額)		41,042,547,451	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	1,633,440,000	3.97

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

(2)【投資資産】**【投資有価証券の主要銘柄】**

a. 主要銘柄の明細

順位	銘柄名	地域	種類	口数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
					単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	TMA日本株TOPIXマザーファンド	日本	親投資信託受益証券	15,805,326,269	1.6397	25,916,370,775	1.7353	27,426,982,674	100.00

b. 投資有価証券の種類

種類	投資比率(%)
親投資信託受益証券	100.00
合計	100.00

【投資不動産物件】

該当事項はありません。

【その他投資資産の主要なもの】

該当事項はありません。

(ご参考：親投資信託の投資資産)

投資有価証券の主要銘柄

a. 主要銘柄の明細

TMA日本株TOPIXマザーファンド

順位	銘柄名	地域	業種	種類	株式数	帳簿価額		評価額		投資比率(%)
						単価(円)	金額(円)	単価(円)	金額(円)	
1	トヨタ自動車	日本	輸送用機器	株式	734,100	1,695.40	1,244,593,140	2,105.50	1,545,647,550	3.76
2	ソニーグループ	日本	電気機器	株式	89,700	11,586.67	1,039,324,299	14,475.00	1,298,407,500	3.16
3	キーエンス	日本	電気機器	株式	13,100	51,440.76	673,873,956	72,280.00	946,868,000	2.30
4	リクルートホールディングス	日本	サービス業	株式	106,800	5,379.76	574,558,368	6,972.00	744,609,600	1.81
5	東京エレクトロン	日本	電気機器	株式	9,200	43,854.83	403,464,436	66,280.00	609,776,000	1.48
6	三菱UFJフィナンシャル・グループ	日本	銀行業	株式	898,400	648.58	582,684,272	624.90	561,410,160	1.36
7	日本電産	日本	電気機器	株式	37,600	13,227.08	497,338,208	13,520.00	508,352,000	1.23
8	信越化学工業	日本	化学	株式	24,400	18,404.01	449,057,844	19,920.00	486,048,000	1.18
9	HOYA	日本	精密機器	株式	28,300	13,073.09	369,968,447	17,110.00	484,213,000	1.17
10	ダイキン工業	日本	機械	株式	18,400	22,405.67	412,264,328	26,090.00	480,056,000	1.16
11	日本電信電話	日本	情報・通信業	株式	148,800	2,952.24	439,293,312	3,150.00	468,720,000	1.14
12	ソフトバンクグループ	日本	情報・通信業	株式	85,100	9,589.03	816,026,453	5,434.00	462,433,400	1.12
13	任天堂	日本	その他製品	株式	8,100	62,796.58	508,652,298	53,650.00	434,565,000	1.05
14	日立製作所	日本	電気機器	株式	69,700	5,447.42	379,685,174	6,230.00	434,231,000	1.05
15	三菱商事	日本	卸売業	株式	107,100	3,326.43	356,260,653	3,652.00	391,129,200	0.95
16	三井住友フィナンシャルグループ	日本	銀行業	株式	99,000	4,249.54	420,704,460	3,943.00	390,357,000	0.95
17	村田製作所	日本	電気機器	株式	42,600	9,018.59	384,191,934	9,157.00	390,088,200	0.95
18	本田技研工業	日本	輸送用機器	株式	114,200	3,330.74	380,370,508	3,230.00	368,866,000	0.89
19	武田薬品工業	日本	医薬品	株式	114,000	4,201.18	478,934,520	3,137.00	357,618,000	0.87
20	伊藤忠商事	日本	卸売業	株式	100,000	3,556.34	355,634,000	3,518.00	351,800,000	0.85
21	KDDI	日本	情報・通信業	株式	103,800	3,490.28	362,291,064	3,362.00	348,975,600	0.85
22	第一三共	日本	医薬品	株式	114,000	3,179.64	362,478,960	2,925.00	333,450,000	0.81
23	S M C	日本	機械	株式	4,200	64,370.96	270,358,032	77,590.00	325,878,000	0.79
24	オリエンタルランド	日本	サービス業	株式	16,300	17,101.96	278,761,948	19,395.00	316,138,500	0.77
25	ソフトバンク	日本	情報・通信業	株式	215,500	1,506.55	324,661,525	1,454.50	313,444,750	0.76
26	ファナック	日本	電気機器	株式	12,700	25,813.47	327,831,069	24,380.00	309,626,000	0.75
27	デンソー	日本	輸送用機器	株式	31,900	7,415.32	236,548,708	9,529.00	303,975,100	0.74
28	東京海上ホールディングス	日本	保険業	株式	47,100	5,396.03	254,153,013	6,392.00	301,063,200	0.73
29	三井物産	日本	卸売業	株式	110,500	2,385.63	263,612,115	2,723.50	300,946,750	0.73
30	セブン&アイ・ホールディングス	日本	小売業	株式	55,900	4,510.01	252,109,559	5,056.00	282,630,400	0.68

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	0.21
		建設業	2.07
		食料品	3.18
		繊維製品	0.47
		パルプ・紙	0.21
		化学	6.47

	医薬品	4.65
	石油・石炭製品	0.38
	ゴム製品	0.67
	ガラス・土石製品	0.73
	鉄鋼	0.78
	非鉄金属	0.64
	金属製品	0.63
	機械	5.26
	電気機器	19.27
	輸送用機器	7.87
	精密機器	2.80
	その他製品	2.12
	電気・ガス業	1.03
	陸運業	2.77
	海運業	0.49
	空運業	0.37
	倉庫・運輸関連業	0.18
	情報・通信業	7.44
	卸売業	5.10
	小売業	3.98
	銀行業	4.85
	証券、商品先物取引業	0.75
	保険業	1.89
	その他金融業	1.08
	不動産業	1.68
	サービス業	5.82
合 計		96.09

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。

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	82	1,629,830,200.00	1,633,440,000	3.97

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

(3) 【運用実績】

【純資産の推移】

期	年月日	純資産総額 (百万円) (分配落)	純資産総額 (百万円) (分配付)	1口当たり 純資産額(円) (分配落)	1口当たり 純資産額(円) (分配付)
第11計算期間末	(2012年 6月20日)	7,655	7,655	0.8081	0.8081
第12計算期間末	(2013年 6月20日)	12,168	12,168	1.1995	1.1995
第13計算期間末	(2014年 6月20日)	14,692	14,692	1.4138	1.4138
第14計算期間末	(2015年 6月22日)	18,678	18,678	1.8608	1.8608
第15計算期間末	(2016年 6月20日)	16,163	16,163	1.4627	1.4627
第16計算期間末	(2017年 6月20日)	20,048	20,048	1.8792	1.8792
第17計算期間末	(2018年 6月20日)	22,536	22,536	2.0657	2.0657
第18計算期間末	(2019年 6月20日)	20,905	20,905	1.8718	1.8718
第19計算期間末	(2020年 6月22日)	21,221	21,221	1.9315	1.9315
第20計算期間末	(2021年 6月21日)	25,283	25,283	2.3669	2.3669
	2020年12月末日	23,809		2.2254	
	2021年 1月末日	23,753		2.2305	
	2月末日	24,339		2.3025	
	3月末日	25,979		2.4333	
	4月末日	25,284		2.3644	
	5月末日	25,667		2.3969	
	6月末日	25,970		2.4234	
	7月末日	25,462		2.3713	
	8月末日	26,326		2.4455	
	9月末日	27,436		2.5515	
	10月末日	27,299		2.5149	
	11月末日	26,260		2.4203	
	12月末日	27,425		2.5090	

【分配の推移】

該当事項はありません。

【収益率の推移】

期	計算期間	収益率(%) (分配付)
第11計算期間	2011年 6月21日～2012年 6月20日	5.9
第12計算期間	2012年 6月21日～2013年 6月20日	48.4
第13計算期間	2013年 6月21日～2014年 6月20日	17.9
第14計算期間	2014年 6月21日～2015年 6月22日	31.6
第15計算期間	2015年 6月23日～2016年 6月20日	21.4
第16計算期間	2016年 6月21日～2017年 6月20日	28.5
第17計算期間	2017年 6月21日～2018年 6月20日	9.9
第18計算期間	2018年 6月21日～2019年 6月20日	9.4
第19計算期間	2019年 6月21日～2020年 6月22日	3.2
第20計算期間	2020年 6月23日～2021年 6月21日	22.5
第21中間計算期間	2021年 6月22日～2021年12月21日	4.7

(4) 【設定及び解約の実績】

期	計算期間	設定口数(口)	解約口数(口)	発行済み口数(口)
第11計算期間	2011年 6月21日 ~ 2012年 6月20日	2,442,001,879	1,047,853,864	9,473,549,689
第12計算期間	2012年 6月21日 ~ 2013年 6月20日	3,297,692,954	2,626,632,560	10,144,610,083
第13計算期間	2013年 6月21日 ~ 2014年 6月20日	2,996,270,753	2,748,858,351	10,392,022,485
第14計算期間	2014年 6月21日 ~ 2015年 6月22日	3,281,969,577	3,636,319,417	10,037,672,645
第15計算期間	2015年 6月23日 ~ 2016年 6月20日	3,329,100,805	2,315,993,314	11,050,780,136
第16計算期間	2016年 6月21日 ~ 2017年 6月20日	2,809,980,837	3,191,761,975	10,668,998,998
第17計算期間	2017年 6月21日 ~ 2018年 6月20日	2,645,609,805	2,404,774,151	10,909,834,652
第18計算期間	2018年 6月21日 ~ 2019年 6月20日	2,195,161,064	1,936,232,010	11,168,763,706
第19計算期間	2019年 6月21日 ~ 2020年 6月22日	2,536,213,271	2,717,849,918	10,987,127,059
第20計算期間	2020年 6月23日 ~ 2021年 6月21日	1,920,672,417	2,225,686,385	10,682,113,091
第21中間計算期間	2021年 6月22日 ~ 2021年12月21日	1,106,613,574	880,998,239	10,907,728,426

< 参考情報 >

基準日：2021年12月30日

基準価額・純資産の推移



※基準価額は信託報酬控除後のものです。後述の信託報酬に関する記載をご覧ください。
※基準価額は1万口当たりで表示しています。※設定日は2001年9月25日です。

分配の推移

(1万口当たり、税引前)

決算期	決算日	分配金
第16期	2017/06/20	0円
第17期	2018/06/20	0円
第18期	2019/06/20	0円
第19期	2020/06/22	0円
第20期	2021/06/21	0円
設定来累計		分配実績なし

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

主要な資産の状況

ファンドは、ファミリーファンド方式により運用を行っており、マザーファンドの資産の状況を記載しています。

● 資産構成

資産	比率
株式	96.1%
株式先物	4.0%
短期金融資産等	-0.1%
合計	100.0%

● 組入上位10業種

業種	比率
1 電気機器	19.3%
2 輸送用機器	7.9%
3 情報・通信業	7.4%
4 化学	6.5%
5 サービス業	5.8%
6 機械	5.3%
7 卸売業	5.1%
8 銀行業	4.9%
9 医薬品	4.7%
10 小売業	4.0%

● 組入上位10銘柄

組入銘柄数：1,078銘柄

銘柄	業種	比率
1 トヨタ自動車	輸送用機器	3.8%
2 ソニーグループ	電気機器	3.2%
3 キーエンス	電気機器	2.3%
4 リクルートホールディングス	サービス業	1.8%
5 東京エレクトロン	電気機器	1.5%
6 三菱UFJフィナンシャル・グループ	銀行業	1.4%
7 日本電産	電気機器	1.2%
8 信越化学工業	化学	1.2%
9 HOYA	精密機器	1.2%
10 ダイキン工業	機械	1.2%

※短期金融資産等は、組入有価証券以外のものです。
※比率は純資産総額に占める割合です。

年間収益率の推移



※ファンドの収益率は、税引前分配金を再投資したものと計算しています。
※当年は昨年末と基準日の騰落率です。

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

第2【管理及び運営】

1【申込（販売）手続等】

- a. 毎営業日にお申込みを受け付けます。
- b. 当ファンドは、収益の分配がなされた場合、分配金を自動的に無手数料で再投資する自動けいぞく（累積）投資専用ファンドです。このため、取得申込者と販売会社の間で、自動けいぞく（累積）投資に関する契約を締結する必要があります。
- c. 販売会社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、自動けいぞく（累積）投資に基づく収益分配金の再投資に際しては、1口の整数倍をもって取得できます。
- d. 取得申込の受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みについては翌営業日受付の取扱いとなります。
- e. 受益権の取得申込価額は以下の通りです。
取得申込受付日の基準価額
基準価額は原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクにお問い合わせることにより知ることができます。
委託会社のお問い合わせ先（委託会社サービスデスク）
東京海上アセットマネジメント サービスデスク
0120-712-016（土日祝日・年末年始を除く9時～17時）
- f. 取得申込にかかる手数料はありません。
- g. 上記にかかわらず、証券取引所における取引の停止、外国為替取引の停止その他やむを得ない事情が発生し、委託会社が追加設定を制限する措置を取った場合には、販売会社は、受益権の取得申込の受付を中止すること、および既に受け付けた取得申込の受付を取り消すことができます。
- h. 取得申込者は販売会社に、取得申込と同時にまたはあらかじめ当該取得申込者が受益権の振替を行うための振替機関等の口座を申し出るものとし、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録が行われます。なお、販売会社は、当該取得申込の代金の支払いと引き換えに、当該口座に当該取得申込者にかかる口数の増加の記載または記録を行うことができます。委託会社は、追加信託により分割された受益権について、振替機関等の振替口座簿への新たな記載または記録をするため社振法に定める事項の振替機関等への通知を行うものとし、振替機関等は、委託会社から振替機関等への通知があった場合、社振法の規定にしたがい、その備える振替口座簿への新たな記載または記録を行います。委託会社は、追加信託により生じた受益権については追加信託のつど、振替機関等の定める方法により、振替機関等へ当該受益権にかかる信託を設定した旨の通知を行います。

2【換金（解約）手続等】

- a. 受益者は、自己に帰属する受益権につき、一部解約の実行請求（解約請求）の方法によりご換金の請求を行うことができます。
- b. ご換金のお申込みは販売会社で受け付けます。なお、販売会社の買取りによるご換金の請求については、販売会社にお問い合わせください。
- c. 解約請求による換金のお申込みは、毎営業日に行うことができます。
- d. 解約単位は、販売会社によって異なります。詳しくは販売会社にお問い合わせください。
- e. 解約請求のお申込みの受付は、原則として午後3時までとします。受付時間を過ぎてからのお申込みは翌営業日受付としてお取扱いします。
- f. 解約時の価額（解約価額）は、解約請求受付日の基準価額とします。
信託財産留保額はありません。
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ん。
- g. 解約価額は、原則として委託会社の毎営業日に算出され、販売会社または委託会社サービスデスクに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ん。
- i. 解約代金は、原則として解約請求受付日から起算して5営業日目から、お支払いします。
- j. 委託会社は、証券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ができます。その場合には、受益者は当該受付中止以前に行った当日を解約請求受付日とする解約請求を撤回できます。ただし、受益者がその解約請求を撤回しない場合には、当該受付中止を解除した後の最初の基準価額の計算日にその請求を受け付けたものとして取扱います。
- k. 信託財産の資金管理を円滑に行うため、大口解約には制限を設ける場合があります。ただし、確定拠出年金制度に基づく受益者である場合には制限はありません。
- l. 受益者が解約の請求をするときは、振替受益権をもって行うものとし、その口座が開設されている振替機関等に対して当該受益者の請求にかかる信託契約の一部解約を委託会社が行うのと引き換えに、当該一部解約にかかる受益権の口数と同口数の抹消の申請が行われ、社振法の規定にしたがい当該振替機関等の口座において当該口数の減少の記載または記録が行われます。

3【資産管理等の概要】

(1)【資産の評価】

- a. 基準価額は、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。
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、2001年9月25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6月21日から翌年6月20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、あらかじめ、解約しようとする旨を公告し、かつ、その旨を記載した書面を信託契約にかかる知られたる受益者に対して交付します。ただし、信託契約にかかる全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は、1ヵ月以上の一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。
- d. 上記c.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記a.の信託契約の解約をしません。
- e. 委託会社は、信託契約を解約しないこととしたときは、解約をしない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- f. 上記c.からe.の規定は、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c.の一定の期間が1ヵ月を下らずにその公告および書面の交付を行うことが困難な場合は適用しません。
- g. 信託契約を解約する場合において、上記c.の一定の期間内に異議を申し出た受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

- h. 委託会社は、監督官庁より信託契約の解約の命令を受けたときは、その命令にしたがい、信託契約を解約し、信託を終了させます。
- i. 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。ただし、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、下記「信託約款の変更」d.に該当する場合を除き、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。
- j. 委託会社は、受託会社が委託会社の承諾を受けてその任務を辞任した後、あるいは裁判所が受託会社を解任した後、委託会社が新受託会社を選任できないときは、あらかじめ、監督官庁に届出のうえ、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、あらかじめ監督官庁に届出ることにより、信託約款を変更することができます。
- b. 変更事項のうち、その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当するときは、内閣府令で定めるところにより、あらかじめ変更しようとする旨およびその内容を公告し、かつこれらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- c. 上記b.の公告および書面には、受益者で異議のある者は、1ヵ月以上の一定の期間内に委託会社に対し異議を述べるべき旨を付記します。
- d. 上記c.の一定の期間内に異議を述べた受益者の受益権の口数が受益権の総口数の二分の一を超えるときは、上記a.の約款変更を行いません。その場合には、委託会社は、内閣府令で定めるところにより、変更しない旨およびその理由を公告し、かつ、これらの事項を記載した書面を知られたる受益者に対して交付します。ただし、全ての受益者に対して書面を交付したときは、原則として公告を行いません。
- e. その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当する信託約款の変更を行う場合において、上記c.の一定の期間内に異議を申し出た受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。
- f. 委託会社は、監督官庁の命令に基づいて信託約款を変更しようとするときは、上記b.からd.の規定にしたがいます。

関係会社との契約の更改等

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

運用報告書

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

公告

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

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

4【受益者の権利等】

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

収益分配金の請求権

収益分配金は、自動けいぞく（累積）投資に関する契約に基づき、自動的に無手数料で当ファンドに再投資されます。なお、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

信託契約を解約して信託を終了させるとき、および信託約款の変更を行う場合において、その内容が重大なものとして内閣府令で定めるものに該当するときは、委託会社によって定められた期間内に異議を述べた受益者は、受託会社に対し、自己に帰属する受益権を、信託財産をもって買取るべき旨を請求することができます。

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20期計算期間(2020年6月23日から2021年6月21日まで)の財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人により監査を受けております。

1【財務諸表】

【東京海上セレクション・日本株TOPIX】

(1)【貸借対照表】

(単位：円)

	第19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	21,221,434,727	25,283,651,372
未収入金	108,334,209	83,394,902
流動資産合計	21,329,768,936	25,367,046,274
資産合計	21,329,768,936	25,367,046,274
負債の部		
流動負債		
未払解約金	38,769,075	63,913,955
未払受託者報酬	10,397,655	2,747,998
未払委託者報酬	58,919,979	16,487,905
その他未払費用	247,500	245,044
流動負債合計	108,334,209	83,394,902
負債合計	108,334,209	83,394,902
純資産の部		
元本等		
元本	10,987,127,059	10,682,113,091
剰余金		
期末剰余金又は期末欠損金（ ）	10,234,307,668	14,601,538,281
（分配準備積立金）	4,227,252,875	6,368,244,980
元本等合計	21,221,434,727	25,283,651,372
純資産合計	21,221,434,727	25,283,651,372
負債純資産合計	21,329,768,936	25,367,046,274

(2)【損益及び剰余金計算書】

(単位:円)

	第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	903,830,900	4,756,315,056
営業収益合計	903,830,900	4,756,315,056
営業費用		
受託者報酬	20,957,164	9,647,423
委託者報酬	118,757,170	55,961,280
その他費用	492,491	492,544
営業費用合計	140,206,825	66,101,247
営業利益又は営業損失()	763,624,075	4,690,213,809
経常利益又は経常損失()	763,624,075	4,690,213,809
当期純利益又は当期純損失()	763,624,075	4,690,213,809
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()	85,812,606	542,274,063
期首剰余金又は期首欠損金()	9,737,099,934	10,234,307,668
剰余金増加額又は欠損金減少額	2,195,025,736	2,319,955,172
当期一部解約に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	-	-
当期追加信託に伴う剰余金増加額又は欠損金減少額	2,195,025,736	2,319,955,172
剰余金減少額又は欠損金増加額	2,375,629,471	2,100,664,305
当期一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	2,375,629,471	2,100,664,305
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()	10,234,307,668	14,601,538,281

(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20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
1. 有価証券の評価基準及び評価方法	親投資信託受益証券 移動平均法に基づき、原則として時価で評価しております。時価評価にあたっては、親投資信託受益証券の基準価額に基づいて評価しております。
2. その他財務諸表作成のための基本となる重要な事項	計算期間末日の取扱い 2020年6月20日及び2021年6月20日が休日のため、前計算期間末日を2020年6月22日とし、当計算期間末日を2021年6月21日としております。このため、当計算期間は364日となっております。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、翌計算期間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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	第19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
1. 1 期首元本額	11,168,763,706円	10,987,127,059円
期中追加設定元本額	2,536,213,271円	1,920,672,417円
期中一部解約元本額	2,717,849,918円	2,225,686,385円
2. 1 計算期間末日における受益権の総数	10,987,127,059口	10,682,113,091口

(損益及び剰余金計算書に関する注記)

第19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21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（409,044,475円）、解約に伴う当期純利益金額分配後の有価証券売買等損益から費用を控除し、繰越欠損金を補填した額（0円）、投資信託約款に規定される収益調整金（12,520,786,637円）及び分配準備積立金（3,818,208,400円）より、分配対象額は16,748,039,512円（1万口当たり15,243.31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（476,036,724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（2,455,046,745円）、投資信託約款に規定される収益調整金（12,853,355,312円）及び分配準備積立金（3,437,161,511円）より、分配対象額は19,221,600,292円（1万口当たり17,994.16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19期 自 2019年 6月21日 至 2020年 6月22日	第20期 自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び投資法人に関する法律」(昭和26年法律第198号)第2条第4項に定める証券投資信託であり、有価証券等の金融商品への投資を信託約款に定める「運用の基本方針」に基づき行なっております。	同左
2. 金融商品の内容及びそのリスク	当ファンドが運用する主な金融商品は「重要な会計方針に係る事項に関する注記」の「有価証券の評価基準及び評価方法」に記載の有価証券であります。当該有価証券には、性質に応じてそれぞれ価格変動リスク、流動性リスク、信用リスク等があります。	同左
3. 金融商品に係るリスク管理体制	委託会社のリスク管理体制は、担当運用部が自主管理を行うと同時に、担当運用部とは独立した部門において厳格に実施される体制としています。 法令等の遵守状況についてはコンプライアンス部門が、運用リスクの各項目および運用ガイドラインの遵守状況については運用リスク管理部門が、それぞれ適切な運用が行われるよう監視し、担当運用部へのフィードバックおよび所管の委員会への報告・審議を行っています。 これらの内容については、社長をはじめとする関係役員に随時報告が行われるとともに、内部監査部門がこれらの業務全般にわたる運営体制の監査を行うことで、より実効性の高いリスク管理体制を構築しております。	同左

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	第19期 [2020年 6月22日現在]	第20期 [2021年 6月21日現在]
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。 (2)デリバティブ取引 該当事項はありません。 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。	(1)有価証券 同左 (2)デリバティブ取引 同左 (3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。	同左

（有価証券に関する注記）

第19期（自 2019年6月21日 至 2020年6月22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	946,620,299円
合計	946,620,299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20期（自 2020年6月23日 至 2021年6月21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	4,348,286,122円
合計	4,348,286,122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19期 [2020年 6月22日現在]		第20期 [2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	1.9315円	1口当たり純資産額	2.3669円
（1万口当たり純資産額	19,315円）	（1万口当たり純資産額	23,669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	15,457,389,113	25,283,651,372	
親投資信託受益証券 合計		15,457,389,113	25,283,651,372	
合計		15,457,389,113	25,283,651,372	

第2 信用取引契約残高明細表

該当事項はありません。

第3 デリバティブ取引及び為替予約取引の契約額等及び時価の状況表

該当事項はありません。

(ご参考)

当ファンドは、「TMA日本株TOPIXマザーファンド」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 6月22日現在]	[2021年 6月21日現在]
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		1,249,529,057	2,101,780,295
株式	2	27,869,403,190	37,227,636,700
派生商品評価勘定		1,404,100	
未収配当金		167,944,303	198,164,489
前払金		7,815,000	17,697,500
流動資産合計		29,296,095,650	39,545,278,984
資産合計		29,296,095,650	39,545,278,984
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		20,651,500	65,269,600
未払解約金		108,453,816	87,523,431
未払利息		2,198	1,997
流動負債合計		129,107,514	152,795,028
負債合計		129,107,514	152,795,028
純資産の部			
元本等			
元本	1	21,910,325,926	24,083,433,879
剰余金			
剰余金又は欠損金()		7,256,662,210	15,309,050,077
元本等合計		29,166,988,136	39,392,483,956
純資産合計		29,166,988,136	39,392,483,956
負債純資産合計		29,296,095,650	39,545,278,984

(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 6月23日 至 2021年 6月21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。

(重要な会計上の見積りに関する注記)

自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
本書における開示対象ファンドの当計算期間の財務諸表の作成にあたって行った会計上の見積りが、本書における開示対象ファンドの翌計算期間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。

(貸借対照表に関する注記)

区 分	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21日現在]
1. 1 本書における開示対象ファンドの期首における当該親投資信託の元本額	29,907,678,072円	21,910,325,926円
同期中における追加設定元本額	9,164,075,846円	14,515,077,219円
同期中における一部解約元本額	17,161,427,992円	12,341,969,266円
同期末における元本額	21,910,325,926円	24,083,433,879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>	59,846,229円	107,026,499円
円資産バランスファンド2019-05<適格機関投資家限定>	205,638,623円	371,256,017円
円資産バランスファンド2019-09<適格機関投資家限定>	166,535,938円	268,817,509円
円資産バランスファンド2019-12<適格機関投資家限定>	231,894,907円	369,366,104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)	15,941,582,578円	15,457,389,113円
LPS4資産分散ファンド(安定重視型)	6,977,985円	円
LPS4資産分散ファンド(バランス型)	12,444,571円	円
LPS4資産分散ファンド(成長重視型)	38,681,000円	円
LPS4資産分散ファンド(積極型)	54,074,609円	円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	58,417,005円	円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド2035	1,348,680円	7,732,114円
	9,260,925円	70,352,669円

東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	2,709,111円	34,347,610円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	2,467,641円	20,673,612円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	4,064,833円	50,346,152円
TMA日本株式インデックスVA<適格機 関投資家限定>	390,934,495円	535,245,422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>	95,742,617円	155,680,608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>	633,611,439円	1,035,235,645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>	3,960,294,944円	5,379,384,381円
円資産バランスオープン<適格機関投資家 限定>	33,797,796円	220,288,608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	291,816円
計	21,910,325,926円	24,083,433,879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	21,910,325,926口	24,083,433,879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 608,510,000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 850,520,000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 6月21日 至 2020年 6月22日	自 2020年 6月23日 至 2021年 6月21日
1. 金融商品に対する取組方針	当ファンドは、「投資信託及び 投資法人に関する法律」（昭和 26年法律第198号）第2条第4項に 定める証券投資信託であり、有 価証券等の金融商品への投資を 信託約款に定める「運用の基本 方針」に基づき行なっておりま す。	同左

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

・金融商品の時価等に関する事項

区 分	[2020年 6月22日現在]	[2021年 6月21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6月21日 至 2020年6月22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	4,754,823,510円
合計	4,754,823,510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2020年6月22日まで)を指しております。

(自 2020年6月23日 至 2021年6月21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	1,696,325,405円
合計	1,696,325,405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(2021年3月23日から2021年6月21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6月22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	1,340,055,000		1,320,900,000	19,155,000
	東証株価指数先物	1,340,055,000		1,320,900,000	19,155,000
	合 計	1,340,055,000		1,320,900,000	19,155,000

(2021年6月21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	2,269,257,500		2,204,000,000	65,257,500
	東証株価指数先物	2,269,257,500		2,204,000,000	65,257,500
	合 計	2,269,257,500		2,204,000,000	65,257,500

(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 6月22日現在]		[2021年 6月21日現在]	
1口当たり純資産額	1.3312円	1口当たり純資産額	1.6357円
(1万口当たり純資産額	13,312円)	(1万口当たり純資産額	16,357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	19,800	521.00	10,315,800	
マルハニチロ	3,200	2,328.00	7,449,600	
サカタのタネ	2,100	3,690.00	7,749,000	
ホクト	2,400	1,905.00	4,572,000	
I N P E X	72,800	803.00	58,458,400	
石油資源開発	3,400	1,916.00	6,514,400	
K & O エナジーグループ	2,800	1,335.00	3,738,000	
ショーボンドホールディングス	2,600	4,650.00	12,090,000	

ミライト・ホールディングス	5,700	1,878.00	10,704,600
ベステラ	3,000	1,585.00	4,755,000
安藤・間	12,600	791.00	9,966,600
東急建設	7,500	759.00	5,692,500
コムシスホールディングス	7,000	3,025.00	21,175,000
東建コーポレーション	600	9,940.00	5,964,000
ヤマウラ	4,800	895.00	4,296,000
オリエンタル白石	21,500	278.00	5,977,000
大成建設	14,100	3,510.00	49,491,000
大林組	45,500	876.00	39,858,000
清水建設	43,100	839.00	36,160,900
長谷工コーポレーション	14,900	1,454.00	21,664,600
鹿島建設	33,200	1,401.00	46,513,200
西松建設	2,900	3,375.00	9,787,500
三井住友建設	12,700	469.00	5,956,300
前田建設工業	11,900	944.00	11,233,600
奥村組	2,700	2,815.00	7,600,500
東鉄工業	2,800	2,243.00	6,280,400
戸田建設	19,300	735.00	14,185,500
熊谷組	2,800	2,715.00	7,602,000
大東建託	4,900	11,770.00	57,673,000
N I P P O	4,000	3,155.00	12,620,000
前田道路	2,300	2,125.00	4,887,500
東亜建設工業	2,800	2,465.00	6,902,000
五洋建設	20,100	763.00	15,336,300
住友林業	11,100	2,106.00	23,376,600
日本基礎技術	5,700	504.00	2,872,800
大和ハウス工業	41,500	3,136.00	130,144,000
積水ハウス	48,900	2,159.00	105,575,100
北陸電気工事	4,000	1,226.00	4,904,000
中電工	2,400	2,251.00	5,402,400
関電工	7,300	851.00	6,212,300
きんでん	8,800	1,786.00	15,716,800
日本電設工業	4,200	1,797.00	7,547,400
協和エクシオ	6,500	2,679.00	17,413,500
新日本空調	1,800	1,977.00	3,558,600
九電工	2,700	3,385.00	9,139,500
三機工業	4,200	1,395.00	5,859,000
日揮ホールディングス	14,600	1,012.00	14,775,200
中外炉工業	2,200	1,985.00	4,367,000
ヤマト	6,500	798.00	5,187,000
高砂熱学工業	4,700	1,839.00	8,643,300
三晃金属工業	1,200	2,367.00	2,840,400
大気社	3,400	3,355.00	11,407,000
日比谷総合設備	3,500	1,828.00	6,398,000
レイズネクスト	3,100	1,097.00	3,400,700
ニッポン	4,000	1,546.00	6,184,000
日清製粉グループ本社	16,900	1,621.00	27,394,900

鳥越製粉	6,000	780.00	4,680,000
日本甜菜製糖	3,000	1,615.00	4,845,000
DM三井製糖ホールディングス	2,000	1,829.00	3,658,000
森永製菓	3,400	3,405.00	11,577,000
江崎グリコ	4,000	4,250.00	17,000,000
山崎製パン	11,600	1,563.00	18,130,800
亀田製菓	2,000	4,365.00	8,730,000
寿スピリッツ	1,100	7,370.00	8,107,000
カルビー	6,600	2,565.00	16,929,000
森永乳業	2,600	5,780.00	15,028,000
ヤクルト本社	10,000	6,480.00	64,800,000
明治ホールディングス	9,500	6,690.00	63,555,000
雪印メグミルク	3,000	2,099.00	6,297,000
プリマハム	2,300	2,877.00	6,617,100
日本ハム	5,500	4,255.00	23,402,500
丸大食品	2,900	1,682.00	4,877,800
S Foods	2,500	3,260.00	8,150,000
伊藤ハム米久ホールディングス	10,900	680.00	7,412,000
サッポロホールディングス	5,000	2,290.00	11,450,000
アサヒグループホールディングス	31,400	5,280.00	165,792,000
キリンホールディングス	61,100	2,196.00	134,175,600
宝ホールディングス	11,200	1,358.00	15,209,600
オエノンホールディングス	10,500	370.00	3,885,000
コカ・コーラ ボトラーズジャパンホールディングス	10,900	1,770.00	19,293,000
サントリー食品インターナショナル	9,700	4,115.00	39,915,500
ダイドーグループホールディングス	1,100	4,970.00	5,467,000
伊藤園	4,300	6,590.00	28,337,000
キーコーヒー	3,700	2,090.00	7,733,000
ユニカフェ	3,600	997.00	3,589,200
ジャパンフーズ	3,800	1,204.00	4,575,200
日清オイリオグループ	2,000	3,045.00	6,090,000
不二製油グループ本社	3,200	2,651.00	8,483,200
J - オイルミルズ	5,200	1,892.00	9,838,400
キッコーマン	10,400	7,090.00	73,736,000
味の素	34,300	2,696.00	92,472,800
キューピー	8,200	2,434.00	19,958,800
ハウス食品グループ本社	5,000	3,265.00	16,325,000
カゴメ	5,500	2,913.00	16,021,500
アリアケジャパン	1,000	6,540.00	6,540,000
ニチレイ	7,400	2,841.00	21,023,400
東洋水産	7,400	4,305.00	31,857,000
日清食品ホールディングス	5,600	7,970.00	44,632,000
フジッコ	3,500	1,899.00	6,646,500
ロック・フィールド	3,100	1,513.00	4,690,300
日本たばこ産業	76,400	2,176.50	166,284,600
ユーグレナ	6,100	874.00	5,331,400
片倉工業	4,400	1,451.00	6,384,400

グンゼ	1,400	4,405.00	6,167,000
東洋紡	5,800	1,298.00	7,528,400
倉敷紡績	1,900	1,893.00	3,596,700
日本毛織	7,200	961.00	6,919,200
帝国繊維	2,200	2,139.00	4,705,800
帝人	13,400	1,691.00	22,659,400
東レ	103,400	733.20	75,812,880
日本フェルト	8,000	434.00	3,472,000
セーレン	3,700	2,111.00	7,810,700
小松マテール	8,800	926.00	8,148,800
ワコールホールディングス	3,600	2,407.00	8,665,200
ホギメディカル	2,300	3,400.00	7,820,000
T S Iホールディングス	13,000	316.00	4,108,000
ゴールドウイン	2,200	6,370.00	14,014,000
デサント	3,600	2,646.00	9,525,600
特種東海製紙	1,100	4,330.00	4,763,000
王子ホールディングス	63,900	625.00	39,937,500
日本製紙	6,400	1,213.00	7,763,200
三菱製紙	8,300	347.00	2,880,100
北越コーポレーション	13,400	571.00	7,651,400
大王製紙	6,600	1,786.00	11,787,600
レンゴー	15,000	916.00	13,740,000
ザ・パック	2,000	2,709.00	5,418,000
クラレ	23,000	1,052.00	24,196,000
旭化成	93,300	1,177.00	109,814,100
共和レザー	4,200	704.00	2,956,800
昭和電工	10,600	3,295.00	34,927,000
住友化学	113,000	569.00	64,297,000
日産化学	7,800	5,240.00	40,872,000
クレハ	1,000	6,020.00	6,020,000
石原産業	10,800	1,131.00	12,214,800
片倉コープアグリ	3,600	1,200.00	4,320,000
日本曹達	1,900	3,285.00	6,241,500
東ソー	21,800	1,856.00	40,460,800
トクヤマ	3,700	2,218.00	8,206,600
セントラル硝子	2,800	2,080.00	5,824,000
東亜合成	9,100	1,117.00	10,164,700
大阪ソーダ	2,800	2,423.00	6,784,400
デンカ	5,100	3,615.00	18,436,500
信越化学工業	25,900	18,060.00	467,754,000
堺化学工業	2,600	1,815.00	4,719,000
エア・ウォーター	13,600	1,668.00	22,684,800
日本酸素ホールディングス	11,000	2,104.00	23,144,000
日本パーカライジング	7,400	1,060.00	7,844,000
ステラ ケミファ	1,200	2,907.00	3,488,400
日本触媒	2,300	5,280.00	12,144,000
カネカ	3,300	4,220.00	13,926,000
三菱瓦斯化学	14,100	2,289.00	32,274,900

三井化学	12,300	3,645.00	44,833,500
J S R	14,200	3,235.00	45,937,000
東京応化工業	2,200	6,810.00	14,982,000
三菱ケミカルホールディングス	95,300	887.20	84,550,160
K Hネオケム	2,100	2,542.00	5,338,200
ダイセル	19,900	873.00	17,372,700
住友ベークライト	1,800	4,620.00	8,316,000
積水化学工業	30,000	1,789.00	53,670,000
日本ゼオン	13,400	1,459.00	19,550,600
アイカ工業	3,800	3,845.00	14,611,000
宇部興産	7,100	2,212.00	15,705,200
旭有機材	2,800	1,323.00	3,704,400
タイガースポリマー	5,600	433.00	2,424,800
ミライアル	2,800	1,339.00	3,749,200
日本化薬	8,600	1,049.00	9,021,400
A D E K A	6,500	1,913.00	12,434,500
日油	5,200	5,710.00	29,692,000
ハリマ化成グループ	4,700	880.00	4,136,000
花王	34,200	6,554.00	224,146,800
ニイタカ	1,700	2,314.00	3,933,800
三洋化成工業	1,100	5,400.00	5,940,000
日本ペイントホールディングス	58,200	1,582.00	92,072,400
関西ペイント	15,800	2,811.00	44,413,800
中国塗料	6,400	830.00	5,312,000
太陽ホールディングス	1,200	5,210.00	6,252,000
D I C	6,200	2,761.00	17,118,200
サカタインクス	4,400	1,018.00	4,479,200
東洋インキ S C ホールディングス	2,800	2,043.00	5,720,400
富士フイルムホールディングス	25,200	7,686.00	193,687,200
資生堂	28,400	7,683.00	218,197,200
ライオン	18,900	1,886.00	35,645,400
高砂香料工業	2,100	2,700.00	5,670,000
マンダム	3,000	2,021.00	6,063,000
ミルボン	1,600	6,020.00	9,632,000
ファンケル	4,500	3,540.00	15,930,000
コーセー	2,700	17,270.00	46,629,000
コタ	4,500	1,414.00	6,363,000
ポーラ・オルビスホールディングス	5,900	2,903.00	17,127,700
ノエビアホールディングス	1,800	5,390.00	9,702,000
エステー	2,800	1,738.00	4,866,400
長谷川香料	2,900	2,222.00	6,443,800
小林製薬	4,100	9,490.00	38,909,000
荒川化学工業	4,000	1,181.00	4,724,000
メック	1,900	3,170.00	6,023,000
タカラバイオ	3,300	2,883.00	9,513,900
アース製薬	1,100	6,540.00	7,194,000
大成ラミック	1,500	2,681.00	4,021,500
クミアイ化学工業	7,300	838.00	6,117,400

日本農薬	9,400	501.00	4,709,400
日東電工	8,600	8,150.00	70,090,000
レック	3,300	1,133.00	3,738,900
前澤化成工業	3,800	1,245.00	4,731,000
エフピコ	2,500	4,085.00	10,212,500
天馬	2,600	2,414.00	6,276,400
信越ポリマー	5,000	1,002.00	5,010,000
ニフコ	5,300	3,830.00	20,299,000
バルカー	1,700	2,100.00	3,570,000
ユニ・チャーム	30,200	4,365.00	131,823,000
協和キリン	14,600	3,780.00	55,188,000
武田薬品工業	119,200	3,657.00	435,914,400
アステラス製薬	124,300	1,904.00	236,667,200
大日本住友製薬	10,900	2,169.00	23,642,100
塩野義製薬	17,900	5,518.00	98,772,200
日本新薬	4,000	8,980.00	35,920,000
中外製薬	44,800	4,121.00	184,620,800
科研製薬	2,300	4,620.00	10,626,000
エーザイ	15,900	12,150.00	193,185,000
ロート製薬	7,200	2,781.00	20,023,200
小野薬品工業	33,000	2,430.00	80,190,000
久光製薬	4,100	5,430.00	22,263,000
持田製薬	2,000	3,575.00	7,150,000
参天製薬	25,500	1,491.00	38,020,500
ツムラ	4,300	3,470.00	14,921,000
日医工	7,900	903.00	7,133,700
キッセイ薬品工業	3,700	2,087.00	7,721,900
生化学工業	3,600	1,067.00	3,841,200
栄研化学	3,500	2,110.00	7,385,000
鳥居薬品	2,100	2,376.00	4,989,600
JCRファーマ	3,700	3,510.00	12,987,000
東和薬品	2,700	2,589.00	6,990,300
ゼリア新薬工業	3,200	2,048.00	6,553,600
第一三共	112,700	2,440.00	274,988,000
キョーリン製薬ホールディングス	3,000	1,706.00	5,118,000
大幸薬品	4,200	1,050.00	4,410,000
大塚ホールディングス	29,800	4,555.00	135,739,000
大正製薬ホールディングス	3,100	5,950.00	18,445,000
ペプチドリーム	7,400	5,300.00	39,220,000
あすか製薬ホールディングス	3,700	977.00	3,614,900
サワイグループホールディングス	2,800	4,850.00	13,580,000
ニチレキ	2,400	1,285.00	3,084,000
出光興産	16,100	2,596.00	41,795,600
ENEOSホールディングス	216,400	454.80	98,418,720
コスモエネルギーホールディングス	4,000	2,337.00	9,348,000
横浜ゴム	8,400	2,329.00	19,563,600
TOYO TIRE	7,700	2,286.00	17,602,200
ブリヂストン	38,100	4,876.00	185,775,600

住友ゴム工業	13,200	1,486.00	19,615,200
オカモト	1,200	4,135.00	4,962,000
ニッタ	2,100	2,602.00	5,464,200
住友理工	11,600	690.00	8,004,000
バンドー化学	8,900	883.00	7,858,700
日東紡績	2,100	3,460.00	7,266,000
A G C	13,200	4,675.00	61,710,000
日本山村硝子	3,200	925.00	2,960,000
日本電気硝子	5,700	2,577.00	14,688,900
住友大阪セメント	2,500	3,015.00	7,537,500
太平洋セメント	8,900	2,385.00	21,226,500
日本ヒューム	6,400	713.00	4,563,200
東海カーボン	14,400	1,528.00	22,003,200
東洋炭素	2,600	2,715.00	7,059,000
T O T O	10,300	5,710.00	58,813,000
日本碍子	16,400	1,886.00	30,930,400
日本特殊陶業	11,600	1,625.00	18,850,000
ニチアス	3,500	2,686.00	9,401,000
ニチハ	1,900	2,888.00	5,487,200
日本製鉄	67,700	1,777.50	120,336,750
神戸製鋼所	27,300	674.00	18,400,200
ジェイ エフ イー ホールディングス	41,200	1,235.00	50,882,000
東京製鐵	8,900	1,054.00	9,380,600
共英製鋼	3,400	1,408.00	4,787,200
大和工業	2,500	3,465.00	8,662,500
大阪製鐵	3,200	1,078.00	3,449,600
淀川製鋼所	5,100	2,151.00	10,970,100
丸一鋼管	4,800	2,640.00	12,672,000
大同特殊鋼	2,100	5,270.00	11,067,000
山陽特殊製鋼	4,900	1,548.00	7,585,200
愛知製鋼	1,300	3,020.00	3,926,000
日立金属	13,000	2,121.00	27,573,000
大平洋金属	3,300	1,630.00	5,379,000
新日本電工	26,800	286.00	7,664,800
三菱製鋼	3,500	845.00	2,957,500
シンニッタン	12,400	245.00	3,038,000
日本軽金属ホールディングス	4,100	1,806.00	7,404,600
三井金属鉱業	3,700	2,953.00	10,926,100
東邦亜鉛	2,300	1,807.00	4,156,100
三菱マテリアル	9,300	2,139.00	19,892,700
住友金属鉱山	18,000	4,292.00	77,256,000
D O W A ホールディングス	3,500	4,185.00	14,647,500
古河機械金属	4,000	1,200.00	4,800,000
U A C J	2,800	2,755.00	7,714,000
古河電気工業	3,800	2,706.00	10,282,800
住友電気工業	49,700	1,597.00	79,370,900
フジクラ	17,500	456.00	7,980,000
タツタ電線	7,100	542.00	3,848,200

リョービ	4,500	1,510.00	6,795,000
アサヒホールディングス	4,300	2,158.00	9,279,400
トーカコ	4,600	1,384.00	6,366,400
SUMCO	18,300	2,615.00	47,854,500
東洋製罐グループホールディングス	9,000	1,512.00	13,608,000
コロナ	3,400	917.00	3,117,800
横河ブリッジホールディングス	2,900	2,011.00	5,831,900
駒井ハルテック	1,700	1,713.00	2,912,100
三和ホールディングス	12,700	1,323.00	16,802,100
文化シャッター	6,200	1,072.00	6,646,400
三協立山	4,700	788.00	3,703,600
LIXIL	19,500	2,884.00	56,238,000
ノーリツ	4,900	1,870.00	9,163,000
長府製作所	2,000	2,001.00	4,002,000
リンナイ	2,700	10,280.00	27,756,000
日東精工	9,100	557.00	5,068,700
東プレ	4,500	1,529.00	6,880,500
高周波熱錬	7,000	557.00	3,899,000
バイオラックス	4,500	1,457.00	6,556,500
日本発條	15,200	878.00	13,345,600
三益半導体工業	1,700	2,735.00	4,649,500
日本製鋼所	4,200	2,754.00	11,566,800
三浦工業	6,100	4,750.00	28,975,000
タクマ	5,200	1,684.00	8,756,800
オークマ	1,400	5,210.00	7,294,000
芝浦機械	2,700	2,428.00	6,555,600
アマダ	21,900	1,094.00	23,958,600
アイダエンジニアリング	6,000	844.00	5,064,000
FUJ I	5,200	2,468.00	12,833,600
牧野フライス製作所	1,400	4,240.00	5,936,000
オーエスジー	7,000	1,793.00	12,551,000
旭ダイヤモンド工業	12,400	512.00	6,348,800
DMG森精機	8,900	1,913.00	17,025,700
ディスコ	1,900	34,200.00	64,980,000
日東工器	2,500	1,791.00	4,477,500
島精機製作所	2,800	1,917.00	5,367,600
日阪製作所	4,600	798.00	3,670,800
ナブテスコ	8,500	4,215.00	35,827,500
S M C	4,100	63,010.00	258,341,000
ユニオンツール	1,300	3,795.00	4,933,500
オイレス工業	4,100	1,539.00	6,309,900
サトーホールディングス	3,900	2,569.00	10,019,100
小松製作所	65,000	2,809.50	182,617,500
住友重機械工業	8,300	3,005.00	24,941,500
日立建機	6,400	3,250.00	20,800,000
巴工業	2,300	2,267.00	5,214,100
井関農機	3,700	1,482.00	5,483,400
タカキタ	5,500	614.00	3,377,000

クボタ	75,300	2,235.50	168,333,150
月島機械	4,200	1,169.00	4,909,800
帝国電機製作所	3,300	1,261.00	4,161,300
新東工業	10,200	765.00	7,803,000
小森コーポレーション	4,900	802.00	3,929,800
鶴見製作所	3,200	1,713.00	5,481,600
荏原製作所	6,100	5,360.00	32,696,000
西島製作所	5,900	843.00	4,973,700
ダイキン工業	18,200	20,505.00	373,191,000
栗田工業	7,700	5,170.00	39,809,000
椿本チエイン	2,200	3,055.00	6,721,000
ダイフク	7,900	9,630.00	76,077,000
タダノ	5,100	1,070.00	5,457,000
フジテック	5,600	2,397.00	13,423,200
C K D	3,700	2,318.00	8,576,600
平和	3,900	1,909.00	7,445,100
S A N K Y O	3,300	2,763.00	9,117,900
日本金銭機械	7,900	551.00	4,352,900
フクシマガリレイ	1,400	4,465.00	6,251,000
竹内製作所	2,600	2,675.00	6,955,000
アマノ	3,600	2,729.00	9,824,400
グローリー	4,100	2,269.00	9,302,900
大和冷機工業	8,600	1,043.00	8,969,800
セガサミーホールディングス	13,900	1,428.00	19,849,200
リケン	1,900	2,460.00	4,674,000
ホシザキ	4,500	9,480.00	42,660,000
大豊工業	4,200	978.00	4,107,600
日本精工	29,900	955.00	28,554,500
N T N	37,300	285.00	10,630,500
ジェイテクト	14,700	1,120.00	16,464,000
不二越	1,700	4,100.00	6,970,000
日本トムソン	13,700	568.00	7,781,600
T H K	8,800	3,245.00	28,556,000
ユーシン精機	4,100	795.00	3,259,500
キッツ	7,200	775.00	5,580,000
マキタ	18,800	4,960.00	93,248,000
日立造船	13,300	674.00	8,964,200
三菱重工業	22,600	3,229.00	72,975,400
I H I	9,100	2,589.00	23,559,900
スター精密	3,500	1,763.00	6,170,500
日清紡ホールディングス	8,700	914.00	7,951,800
イビデン	7,000	5,890.00	41,230,000
コニカミノルタ	31,800	615.00	19,557,000
ブラザー工業	17,600	2,242.00	39,459,200
ミネベアミツミ	24,800	2,764.00	68,547,200
日立製作所	68,900	5,887.00	405,614,300
東芝	28,200	4,725.00	133,245,000
三菱電機	143,300	1,641.50	235,226,950

富士電機	8,700	5,090.00	44,283,000
安川電機	15,400	5,090.00	78,386,000
明電舎	3,100	2,198.00	6,813,800
東芝テック	1,600	4,670.00	7,472,000
マブチモーター	3,800	4,205.00	15,979,000
日本電産	34,500	12,380.00	427,110,000
東光高岳	3,200	1,347.00	4,310,400
ダイヘン	1,400	4,535.00	6,349,000
日新電機	4,400	1,304.00	5,737,600
オムロン	11,900	8,470.00	100,793,000
日東工業	2,800	1,769.00	4,953,200
ジーエス・ユアサ コーポレーション	5,100	2,691.00	13,724,100
メルコホールディングス	1,300	5,150.00	6,695,000
テクノメディカ	1,800	1,601.00	2,881,800
日本電気	18,300	5,400.00	98,820,000
富士通	12,800	19,060.00	243,968,000
沖電気工業	5,600	989.00	5,538,400
サンケン電気	1,700	4,875.00	8,287,500
アイホン	2,800	2,063.00	5,776,400
ルネサスエレクトロニクス	62,300	1,144.00	71,271,200
セイコーエプソン	18,400	1,948.00	35,843,200
ワコム	7,800	670.00	5,226,000
アルバック	2,700	5,420.00	14,634,000
E I Z O	1,500	4,780.00	7,170,000
日本信号	5,100	912.00	4,651,200
能美防災	2,500	2,032.00	5,080,000
ホーチキ	3,500	1,146.00	4,011,000
エレコム	3,000	1,969.00	5,907,000
パナソニック	153,000	1,204.50	184,288,500
シャープ	17,300	1,824.00	31,555,200
アンリツ	8,100	2,035.00	16,483,500
富士通ゼネラル	4,300	2,842.00	12,220,600
ソニーグループ	89,600	10,540.00	944,384,000
T D K	7,000	13,120.00	91,840,000
アルプスアルパイン	12,100	1,152.00	13,939,200
日本トリム	1,100	3,825.00	4,207,500
フォスター電機	3,400	968.00	3,291,200
ヨコオ	2,100	2,287.00	4,802,700
ホシデン	8,800	965.00	8,492,000
ヒロセ電機	2,200	15,540.00	34,188,000
日本航空電子工業	3,700	1,841.00	6,811,700
アイコム	1,900	2,379.00	4,520,100
船井電機	5,600	916.00	5,129,600
横河電機	14,100	1,640.00	23,124,000
アズビル	9,700	4,560.00	44,232,000
日本光電工業	6,200	3,055.00	18,941,000
堀場製作所	2,600	7,050.00	18,330,000
アドバンテスト	10,600	9,780.00	103,668,000

キーエンス	14,000	55,110.00	771,540,000	
日置電機	900	5,650.00	5,085,000	
シスメックス	11,200	11,655.00	130,536,000	
O B A R A G R O U P	900	3,760.00	3,384,000	
コーセル	3,400	1,076.00	3,658,400	
イリソ電子工業	1,000	5,040.00	5,040,000	
オプテックスグループ	3,200	1,858.00	5,945,600	
千代田インテグレ	2,600	1,743.00	4,531,800	
レーザーテック	6,200	21,440.00	132,928,000	
スタンレー電気	10,400	3,130.00	32,552,000	
ウシオ電機	8,400	1,778.00	14,935,200	
日本セラミック	1,900	2,861.00	5,435,900	
図研	2,100	3,075.00	6,457,500	
日本電子	2,700	6,430.00	17,361,000	
カシオ計算機	11,800	1,812.00	21,381,600	
ファナック	12,500	25,865.00	323,312,500	
ローム	6,000	10,010.00	60,060,000	
浜松ホトニクス	10,400	6,600.00	68,640,000	
三井ハイテック	1,600	6,430.00	10,288,000	
新光電気工業	5,200	3,845.00	19,994,000	
京セラ	21,700	6,640.00	144,088,000	
太陽誘電	6,300	5,330.00	33,579,000	
村田製作所	42,100	8,315.00	350,061,500	
双葉電子工業	7,600	779.00	5,920,400	
ニチコン	5,500	1,125.00	6,187,500	
日本ケミコン	2,300	2,440.00	5,612,000	
K O A	2,900	1,568.00	4,547,200	
小糸製作所	8,600	6,520.00	56,072,000	
ミツバ	10,900	819.00	8,927,100	
S C R E E Nホールディングス	2,700	10,530.00	28,431,000	
キヤノン電子	3,400	1,718.00	5,841,200	
キヤノン	70,800	2,545.50	180,221,400	
リコー	37,100	1,308.00	48,526,800	
象印マホービン	3,800	1,617.00	6,144,600	
東京エレクトロン	8,300	47,570.00	394,831,000	
トヨタ紡織	4,200	2,196.00	9,223,200	
ユニプレス	9,400	892.00	8,384,800	
豊田自動織機	11,600	9,360.00	108,576,000	
モリタホールディングス	5,900	1,553.00	9,162,700	
デンソー	31,500	7,289.00	229,603,500	
東海理化電機製作所	3,600	1,675.00	6,030,000	
川崎重工業	11,600	2,280.00	26,448,000	
日産自動車	169,700	523.10	88,770,070	
いすゞ自動車	41,200	1,433.00	59,039,600	
トヨタ自動車	144,700	9,638.00	1,394,618,600	70,000株
日野自動車	19,000	921.00	17,499,000	
三菱自動車工業	56,200	293.00	16,466,600	
武蔵精密工業	4,000	2,268.00	9,072,000	

日産車体	4,700	736.00	3,459,200
新明和工業	5,200	942.00	4,898,400
極東開発工業	6,100	1,596.00	9,735,600
トピー工業	2,800	1,276.00	3,572,800
ティラド	2,400	2,699.00	6,477,600
NOK	7,400	1,254.00	9,279,600
フタバ産業	11,300	500.00	5,650,000
K Y B	2,700	3,590.00	9,693,000
プレス工業	21,000	333.00	6,993,000
アイシン	10,600	4,585.00	48,601,000
マツダ	45,400	943.00	42,812,200
今仙電機製作所	6,000	701.00	4,206,000
本田技研工業	112,700	3,396.00	382,729,200
スズキ	28,200	4,343.00	122,472,600
S U B A R U	41,200	2,147.50	88,477,000
ヤマハ発動機	20,400	3,120.00	63,648,000
エクセディ	4,100	1,584.00	6,494,400
豊田合成	4,400	2,611.00	11,488,400
愛三工業	7,200	847.00	6,098,400
ヨロズ	3,800	1,168.00	4,438,400
エフ・シー・シー	3,100	1,556.00	4,823,600
シマノ	5,300	25,075.00	132,897,500
テイ・エス テック	6,300	1,560.00	9,828,000
テルモ	43,900	4,371.00	191,886,900
クリエートメディック	4,000	1,005.00	4,020,000
島津製作所	18,500	4,060.00	75,110,000
バイ・テクノロジー	900	5,450.00	4,905,000
東京精密	2,300	4,990.00	11,477,000
マニー	5,400	2,445.00	13,203,000
ニコン	23,300	1,176.00	27,400,800
トプコン	7,400	1,647.00	12,187,800
オリンパス	79,300	2,260.00	179,218,000
理研計器	2,300	2,707.00	6,226,100
タムロン	2,700	2,398.00	6,474,600
HOYA	28,100	14,410.00	404,921,000
朝日インテック	15,200	2,523.00	38,349,600
シチズン時計	20,200	406.00	8,201,200
メニコン	2,000	7,280.00	14,560,000
セイコーホールディングス	5,600	2,200.00	12,320,000
ニプロ	10,200	1,309.00	13,351,800
パラマウントベッドホールディングス	2,800	1,914.00	5,359,200
バンダイナムコホールディングス	11,900	7,566.00	90,035,400
アイフイスジャパン	4,400	685.00	3,014,000
パイロットコーポレーション	2,000	3,580.00	7,160,000
トッパン・フォームズ	5,200	1,067.00	5,548,400
フジシールインターナショナル	3,000	2,224.00	6,672,000
タカラトミー	6,900	949.00	6,548,100
タカノ	4,100	630.00	2,583,000

大建工業	3,200	2,023.00	6,473,600
凸版印刷	22,000	1,775.00	39,050,000
大日本印刷	17,400	2,325.00	40,455,000
N I S S H A	4,200	1,639.00	6,883,800
アシックス	12,900	2,542.00	32,791,800
小松ウオール工業	2,200	1,953.00	4,296,600
ヤマハ	8,600	6,010.00	51,686,000
クリナップ	10,100	506.00	5,110,600
ビジョン	9,300	3,165.00	29,434,500
キングジム	5,800	899.00	5,214,200
リンテック	2,800	2,335.00	6,538,000
イトーキ	9,700	360.00	3,492,000
任天堂	8,200	64,730.00	530,786,000
三菱鉛筆	5,400	1,414.00	7,635,600
タカラスタンダード	3,800	1,516.00	5,760,800
コクヨ	6,600	1,750.00	11,550,000
オカムラ	6,700	1,488.00	9,969,600
美津濃	2,300	2,201.00	5,062,300
東京電力ホールディングス	125,300	333.00	41,724,900
中部電力	44,200	1,351.00	59,714,200
関西電力	54,800	1,057.50	57,951,000
中国電力	21,400	1,011.00	21,635,400
北陸電力	14,600	612.00	8,935,200
東北電力	34,500	880.00	30,360,000
四国電力	13,600	751.00	10,213,600
九州電力	32,100	858.00	27,541,800
北海道電力	14,700	507.00	7,452,900
沖縄電力	3,500	1,401.00	4,903,500
電源開発	11,900	1,585.00	18,861,500
レノバ	2,100	3,880.00	8,148,000
東京瓦斯	27,700	2,089.00	57,865,300
大阪瓦斯	26,100	2,052.00	53,557,200
東邦瓦斯	7,000	5,570.00	38,990,000
北海道瓦斯	3,200	1,546.00	4,947,200
西部ガスホールディングス	2,100	2,417.00	5,075,700
静岡ガス	5,600	949.00	5,314,400
東武鉄道	15,100	2,864.00	43,246,400
相鉄ホールディングス	4,800	2,146.00	10,300,800
東急	36,500	1,525.00	55,662,500
京浜急行電鉄	19,100	1,365.00	26,071,500
小田急電鉄	23,100	2,784.00	64,310,400
京王電鉄	8,100	6,550.00	53,055,000
京成電鉄	10,800	3,515.00	37,962,000
富士急行	2,100	5,270.00	11,067,000
東日本旅客鉄道	25,100	8,011.00	201,076,100
西日本旅客鉄道	12,800	6,476.00	82,892,800
東海旅客鉄道	11,900	17,020.00	202,538,000
西武ホールディングス	17,800	1,335.00	23,763,000

西日本鉄道	3,500	2,664.00	9,324,000
近鉄グループホールディングス	13,600	3,885.00	52,836,000
阪急阪神ホールディングス	18,200	3,450.00	62,790,000
南海電気鉄道	6,100	2,346.00	14,310,600
京阪ホールディングス	6,100	3,290.00	20,069,000
名古屋鉄道	11,600	2,037.00	23,629,200
日本通運	4,700	8,380.00	39,386,000
ヤマトホールディングス	19,100	2,948.00	56,306,800
山九	3,600	4,650.00	16,740,000
丸運	12,500	263.00	3,287,500
センコーグループホールディングス	8,800	1,029.00	9,055,200
トナミホールディングス	600	4,625.00	2,775,000
ニッコンホールディングス	4,800	2,342.00	11,241,600
日本石油輸送	900	2,550.00	2,295,000
福山通運	1,500	4,035.00	6,052,500
セイノーホールディングス	10,600	1,412.00	14,967,200
日立物流	2,600	4,450.00	11,570,000
C & F ロジホールディングス	3,400	1,587.00	5,395,800
九州旅客鉄道	9,600	2,497.00	23,971,200
S Gホールディングス	25,800	2,743.00	70,769,400
日本郵船	11,400	5,140.00	58,596,000
商船三井	8,100	4,810.00	38,961,000
川崎汽船	4,100	3,495.00	14,329,500
飯野海運	15,200	424.00	6,444,800
日本航空	33,200	2,487.00	82,568,400
A N Aホールディングス	36,700	2,713.00	99,567,100
三菱倉庫	4,300	3,285.00	14,125,500
三井倉庫ホールディングス	2,200	2,368.00	5,209,600
住友倉庫	5,000	1,474.00	7,370,000
東陽倉庫	13,800	319.00	4,402,200
安田倉庫	4,900	938.00	4,596,200
上組	7,900	2,145.00	16,945,500
キムラユニティー	3,500	1,314.00	4,599,000
キューソー流通システム	1,800	1,700.00	3,060,000
近鉄エクスプレス	3,100	2,278.00	7,061,800
エーアイティー	4,400	1,004.00	4,417,600
N E C ネットズエスアイ	4,400	1,726.00	7,594,400
システナ	5,400	1,900.00	10,260,000
デジタルアーツ	800	8,550.00	6,840,000
日鉄ソリューションズ	1,700	3,470.00	5,899,000
T I S	14,200	2,743.00	38,950,600
J N Sホールディングス	6,900	581.00	4,008,900
電算システム	1,100	3,010.00	3,311,000
グリー	10,700	604.00	6,462,800
コーエーテクモホールディングス	3,900	5,140.00	20,046,000
ブレインパッド	700	4,590.00	3,213,000
K L a b	7,700	696.00	5,359,200
ネクソン	35,000	2,424.00	84,840,000

エイチーム	5,900	1,445.00	8,525,500
コロプラ	6,700	811.00	5,433,700
サイバーリンクス	4,700	1,642.00	7,717,400
CARTA HOLDINGS	1,800	1,695.00	3,051,000
SHIFT	500	16,110.00	8,055,000
ティーガイア	2,000	1,933.00	3,866,000
ガンホー・オンライン・エンターテイメント	3,900	2,206.00	8,603,400
GMOペイメントゲートウェイ	2,900	13,950.00	40,455,000
ザッパラス	9,800	512.00	5,017,600
インターネットイニシアティブ	4,200	3,145.00	13,209,000
チェンジ	1,800	2,881.00	5,185,800
フェイス	4,000	731.00	2,924,000
野村総合研究所	25,100	3,545.00	88,979,500
CEホールディングス	8,800	526.00	4,628,800
インテージホールディングス	4,500	1,530.00	6,885,000
ヒト・コミュニケーションズ・ホールディングス	2,300	2,150.00	4,945,000
Sansan	1,200	9,640.00	11,568,000
フジ・メディア・ホールディングス	15,000	1,188.00	17,820,000
オービック	4,300	20,240.00	87,032,000
ジャストシステム	2,100	6,250.00	13,125,000
Zホールディングス	191,100	524.60	100,251,060
トレンドマイクロ	7,500	5,670.00	42,525,000
日本オラクル	2,700	9,650.00	26,055,000
フューチャー	3,700	1,958.00	7,244,600
CAC Holdings	3,900	1,428.00	5,569,200
SBテクノロジー	1,700	2,992.00	5,086,400
オービックビジネスコンサルタント	1,400	6,300.00	8,820,000
伊藤忠テクノソリューションズ	6,200	3,325.00	20,615,000
大塚商会	7,600	5,770.00	43,852,000
サイボウズ	2,000	2,501.00	5,002,000
電通国際情報サービス	1,500	4,035.00	6,052,500
デジタルガレージ	2,300	4,630.00	10,649,000
ウェザーニューズ	600	5,480.00	3,288,000
日本エンタープライズ	22,700	204.00	4,630,800
ネットワンシステムズ	5,400	3,490.00	18,846,000
アルゴグラフィックス	1,400	3,245.00	4,543,000
エイベックス	4,200	1,554.00	6,526,800
日本ユニシス	4,300	3,165.00	13,609,500
兼松エレクトロニクス	1,600	3,600.00	5,760,000
TBSホールディングス	9,200	1,693.00	15,575,600
日本テレビホールディングス	12,700	1,249.00	15,862,300
テレビ朝日ホールディングス	3,800	1,717.00	6,524,600
スカパーJ S A Tホールディングス	14,100	413.00	5,823,300
テレビ東京ホールディングス	2,300	2,091.00	4,809,300
日本電信電話	163,900	2,824.00	462,853,600
KDDI	112,600	3,400.00	382,840,000

ソフトバンク	128,000	1,407.00	180,096,000
光通信	1,600	19,560.00	31,296,000
GMOインターネット	5,300	3,010.00	15,953,000
KADOKAWA	3,500	4,455.00	15,592,500
ゼンリン	3,200	1,118.00	3,577,600
松竹	800	12,680.00	10,144,000
東宝	8,600	4,500.00	38,700,000
東映	400	19,900.00	7,960,000
エヌ・ティ・ティ・データ	37,600	1,685.00	63,356,000
ビジネスブレイン太田昭和	2,400	1,693.00	4,063,200
D T S	3,200	2,575.00	8,240,000
スクウェア・エニックス・ホールディングス	6,100	5,440.00	33,184,000
カプコン	12,200	3,125.00	38,125,000
S C S K	3,400	6,350.00	21,590,000
アイネス	3,100	1,317.00	4,082,700
T K C	1,800	3,215.00	5,787,000
富士ソフト	1,600	5,560.00	8,896,000
N S D	4,700	1,754.00	8,243,800
コナミホールディングス	5,200	6,700.00	34,840,000
ソフトバンクグループ	111,200	7,559.00	840,560,800
伊藤忠食品	1,600	5,140.00	8,224,000
エレマテック	4,800	1,277.00	6,129,600
J A L U X	2,000	1,779.00	3,558,000
双日	81,600	329.00	26,846,400
アルフレッサ ホールディングス	15,200	1,643.00	24,973,600
横浜冷凍	6,400	880.00	5,632,000
神戸物産	9,700	3,205.00	31,088,500
あい ホールディングス	2,800	2,119.00	5,933,200
ダイワボウホールディングス	5,600	1,762.00	9,867,200
マクニカ・富士エレホールディングス	3,500	2,583.00	9,040,500
バイタルケーエスケー・ホールディングス	7,000	741.00	5,187,000
レスターホールディングス	2,200	1,889.00	4,155,800
O C H I ホールディングス	3,100	1,258.00	3,899,800
T O K A I ホールディングス	7,900	876.00	6,920,400
シップヘルスケアホールディングス	4,900	2,561.00	12,548,900
明治電機工業	2,800	1,350.00	3,780,000
コメダホールディングス	3,200	2,035.00	6,512,000
エコートレーディング	7,400	599.00	4,432,600
ナガイレーベン	2,900	2,535.00	7,351,500
三菱食品	2,000	2,930.00	5,860,000
松田産業	2,100	2,062.00	4,330,200
第一興商	2,300	4,150.00	9,545,000
メディパルホールディングス	14,500	2,107.00	30,551,500
アズワン	900	13,490.00	12,141,000
尾家産業	3,200	1,213.00	3,881,600
ドウシシャ	2,900	1,652.00	4,790,800
丸文	6,100	629.00	3,836,900

橋本総業ホールディングス	2,300	2,916.00	6,706,800
日本ライフライン	4,000	1,345.00	5,380,000
進和	1,900	2,132.00	4,050,800
オーハシテクニカ	3,300	1,494.00	4,930,200
白銅	2,400	2,074.00	4,977,600
伊藤忠商事	98,700	3,154.00	311,299,800
丸紅	137,800	931.40	128,346,920
長瀬産業	8,300	1,603.00	13,304,900
豊田通商	14,300	5,060.00	72,358,000
兼松	5,900	1,406.00	8,295,400
三井物産	113,800	2,418.50	275,225,300
日本紙パルプ商事	2,800	3,515.00	9,842,000
山善	5,400	970.00	5,238,000
住友商事	89,300	1,440.50	128,636,650
内田洋行	1,000	4,715.00	4,715,000
三菱商事	85,900	2,909.50	249,926,050
キヤノンマーケティングジャパン	3,300	2,551.00	8,418,300
西華産業	3,500	1,766.00	6,181,000
菱洋エレクトロ	1,800	2,534.00	4,561,200
東京産業	4,700	600.00	2,820,000
阪和興業	2,400	3,130.00	7,512,000
岩谷産業	3,200	6,270.00	20,064,000
アステナホールディングス	9,200	648.00	5,961,600
三愛石油	5,500	1,226.00	6,743,000
稲畑産業	4,000	1,658.00	6,632,000
ワキタ	6,300	1,076.00	6,778,800
東邦ホールディングス	3,900	1,700.00	6,630,000
サンゲツ	3,900	1,523.00	5,939,700
シナネンホールディングス	2,300	2,942.00	6,766,600
伊藤忠エネクス	5,700	1,004.00	5,722,800
サンリオ	4,100	1,906.00	7,814,600
リョーサン	3,700	1,991.00	7,366,700
三信電気	3,000	2,153.00	6,459,000
モスフードサービス	2,200	3,030.00	6,666,000
加賀電子	2,400	2,982.00	7,156,800
立花エレテック	2,500	1,442.00	3,605,000
フォーバル	4,600	859.00	3,951,400
PALTA C	2,100	5,600.00	11,760,000
日鉄物産	1,400	4,165.00	5,831,000
トラスコ中山	2,800	2,837.00	7,943,600
オートバックスセブン	5,500	1,440.00	7,920,000
加藤産業	2,100	3,295.00	6,919,500
イノテック	4,300	1,339.00	5,757,700
杉本商事	2,300	2,179.00	5,011,700
因幡電機産業	3,600	2,544.00	9,158,400
ミスミグループ本社	17,700	3,640.00	64,428,000
スズケン	6,300	3,270.00	20,601,000
ジェコス	5,300	873.00	4,626,900

ローソン	3,200	4,925.00	15,760,000
サンエー	1,800	4,195.00	7,551,000
エービーシー・マート	1,900	6,190.00	11,761,000
ハードオフコーポレーション	4,200	751.00	3,154,200
アスクル	3,600	1,801.00	6,483,600
ゲオホールディングス	4,700	1,175.00	5,522,500
アダストリア	2,500	1,920.00	4,800,000
ジーフット	6,800	411.00	2,794,800
エディオン	6,000	1,034.00	6,204,000
あみやき亭	2,000	2,942.00	5,884,000
ハニーズホールディングス	5,600	999.00	5,594,400
ジンスホールディングス	1,100	7,910.00	8,701,000
ビックカメラ	8,200	1,110.00	9,102,000
DCMホールディングス	7,900	1,027.00	8,113,300
Monotaro	20,200	2,518.00	50,863,600
J.フロント リテイリング	17,500	1,054.00	18,445,000
ドトール・日レスホールディングス	5,400	1,728.00	9,331,200
マツモトキヨシホールディングス	5,700	4,950.00	28,215,000
ZOZO	7,800	3,650.00	28,470,000
トレジャー・ファクトリー	4,100	926.00	3,796,600
ココカラファイン	900	8,310.00	7,479,000
三越伊勢丹ホールディングス	26,000	800.00	20,800,000
ウエルシアホールディングス	7,000	3,630.00	25,410,000
クリエイトSDホールディングス	2,000	3,200.00	6,400,000
シュッピン	8,100	1,049.00	8,496,900
ジョイフル本田	3,900	1,306.00	5,093,400
すかいらーくホールディングス	16,500	1,544.00	25,476,000
ユナイテッド・スーパーマーケット・ホールディングス	5,900	1,083.00	6,389,700
ゴルフダイジェスト・オンライン	4,500	1,391.00	6,259,500
あさひ	3,300	1,423.00	4,695,900
コスモス薬品	1,300	16,800.00	21,840,000
トーエル	3,900	801.00	3,123,900
セブン&アイ・ホールディングス	55,200	4,972.00	274,454,400
クリエイト・レストランツ・ホールディングス	9,000	867.00	7,803,000
ツルハホールディングス	3,000	13,800.00	41,400,000
サンマルクホールディングス	2,800	1,580.00	4,424,000
トリドールホールディングス	4,500	1,865.00	8,392,500
クスリのアオキホールディングス	1,100	8,300.00	9,130,000
FOOD & LIFE COMPANIE	8,200	4,720.00	38,704,000
ノジマ	2,300	2,865.00	6,589,500
カップ・クリエイト	3,900	1,463.00	5,705,700
ライトオン	5,200	678.00	3,525,600
良品計画	15,600	2,032.00	31,699,200
三城ホールディングス	9,500	266.00	2,527,000
アドヴァン	4,700	914.00	4,295,800
G-7ホールディングス	2,300	3,070.00	7,061,000

コーナン商事	2,600	3,605.00	9,373,000
エコス	2,900	1,859.00	5,391,100
マルシェ	5,300	508.00	2,692,400
パン・パシフィック・インターナショナル ホールディングス	28,400	2,275.00	64,610,000
西松屋チェーン	4,100	1,455.00	5,965,500
ゼンショーホールディングス	7,000	2,727.00	19,089,000
サイゼリヤ	3,200	2,631.00	8,419,200
魚力	2,500	1,983.00	4,957,500
ユナイテッドアローズ	2,900	2,102.00	6,095,800
ハイデイ日高	2,600	1,778.00	4,622,800
京都きもの友禅	12,200	265.00	3,233,000
コロワイド	4,500	1,954.00	8,793,000
壱番屋	1,000	4,790.00	4,790,000
スギホールディングス	2,700	8,650.00	23,355,000
薬王堂ホールディングス	1,800	2,382.00	4,287,600
スクロール	4,600	813.00	3,739,800
木曽路	2,300	2,330.00	5,359,000
千趣会	13,800	400.00	5,520,000
ケーヨー	10,900	762.00	8,305,800
上新電機	1,900	2,658.00	5,050,200
日本瓦斯	5,800	1,770.00	10,266,000
ロイヤルホールディングス	4,100	2,215.00	9,081,500
いなげや	3,500	1,490.00	5,215,000
チヨダ	4,000	868.00	3,472,000
ライフコーポレーション	2,100	3,410.00	7,161,000
AOKIホールディングス	10,600	653.00	6,921,800
コメリ	2,200	2,532.00	5,570,400
青山商事	7,000	767.00	5,369,000
しまむら	1,500	9,300.00	13,950,000
高島屋	11,300	1,284.00	14,509,200
松屋	5,100	929.00	4,737,900
エイチ・ツー・オー リテイリング	7,600	890.00	6,764,000
丸井グループ	11,300	2,086.00	23,571,800
アクシアル リテイリング	2,000	3,735.00	7,470,000
イオン	54,300	2,913.00	158,175,900
イズミ	2,400	4,060.00	9,744,000
平和堂	3,000	2,225.00	6,675,000
フジ	2,200	1,932.00	4,250,400
ヤオコー	1,300	6,270.00	8,151,000
ゼビオホールディングス	4,200	952.00	3,998,400
ケーズホールディングス	12,700	1,236.00	15,697,200
Genky Drug Stores	1,100	3,750.00	4,125,000
ブックオフグループホールディングス	3,200	925.00	2,960,000
アインホールディングス	1,800	6,780.00	12,204,000
ヤマダホールディングス	46,800	502.00	23,493,600
ニトリホールディングス	5,600	18,290.00	102,424,000
吉野家ホールディングス	4,900	2,052.00	10,054,800

王将フードサービス	1,700	5,610.00	9,537,000	
ブレナス	2,900	2,013.00	5,837,700	
ミニストップ	3,100	1,395.00	4,324,500	
アークス	3,200	2,383.00	7,625,600	
バローホールディングス	2,600	2,220.00	5,772,000	
ファーストリテイリング	1,800	78,880.00	141,984,000	
サンドラッグ	4,800	3,575.00	17,160,000	
ヤマザワ	2,400	1,710.00	4,104,000	
ペルーナ	5,300	930.00	4,929,000	
めぶきフィナンシャルグループ	78,400	227.00	17,796,800	
東京きらぼしフィナンシャルグループ	3,800	1,453.00	5,521,400	
九州フィナンシャルグループ	29,500	380.00	11,210,000	
ゆうちょ銀行	40,600	902.00	36,621,200	
コンコルディア・フィナンシャルグループ	88,300	401.00	35,408,300	
西日本フィナンシャルホールディングス	9,300	628.00	5,840,400	
三十三フィナンシャルグループ	3,800	1,315.00	4,997,000	
第四北越フィナンシャルグループ	2,900	2,350.00	6,815,000	
ひろぎんホールディングス	22,000	566.00	12,452,000	
新生銀行	10,800	1,463.00	15,800,400	
あおぞら銀行	8,200	2,418.00	19,827,600	
三菱UFJフィナンシャル・グループ	961,100	586.20	563,396,820	300,000株
りそなホールディングス	170,600	429.40	73,255,640	
三井住友トラスト・ホールディングス	26,800	3,481.00	93,290,800	
三井住友フィナンシャルグループ	97,700	3,795.00	370,771,500	
千葉銀行	48,600	660.00	32,076,000	
群馬銀行	31,100	343.00	10,667,300	
武蔵野銀行	4,400	1,639.00	7,211,600	
七十七銀行	4,000	1,221.00	4,884,000	
青森銀行	1,500	2,068.00	3,102,000	
秋田銀行	2,800	1,388.00	3,886,400	
山形銀行	4,100	844.00	3,460,400	
岩手銀行	2,000	1,682.00	3,364,000	
東邦銀行	18,400	204.00	3,753,600	
東北銀行	2,600	1,004.00	2,610,400	
ふくおかフィナンシャルグループ	12,700	1,889.00	23,990,300	
静岡銀行	34,900	862.00	30,083,800	
十六銀行	2,500	1,923.00	4,807,500	
スルガ銀行	14,600	341.00	4,978,600	
八十二銀行	34,200	354.00	12,106,800	
山梨中央銀行	6,000	787.00	4,722,000	
大垣共立銀行	2,700	1,829.00	4,938,300	
福井銀行	2,100	1,362.00	2,860,200	
北國銀行	2,000	2,088.00	4,176,000	
滋賀銀行	3,500	1,982.00	6,937,000	
南都銀行	5,200	1,804.00	9,380,800	
百五銀行	16,700	299.00	4,993,300	
京都銀行	4,900	4,925.00	24,132,500	
紀陽銀行	4,700	1,420.00	6,674,000	

ほくほくフィナンシャルグループ	9,100	815.00	7,416,500	
山陰合同銀行	10,400	535.00	5,564,000	
中国銀行	11,900	838.00	9,972,200	
鳥取銀行	3,100	1,114.00	3,453,400	
伊予銀行	19,900	529.00	10,527,100	
百十四銀行	2,100	1,446.00	3,036,600	
四国銀行	5,700	696.00	3,967,200	
阿波銀行	3,200	2,007.00	6,422,400	
大分銀行	1,900	1,647.00	3,129,300	
宮崎銀行	2,000	1,986.00	3,972,000	
佐賀銀行	3,400	1,351.00	4,593,400	
沖縄銀行	2,200	2,500.00	5,500,000	
琉球銀行	8,300	713.00	5,917,900	
セブン銀行	51,800	228.00	11,810,400	
みずほフィナンシャルグループ	191,100	1,564.50	298,975,950	
山口フィナンシャルグループ	18,400	632.00	11,628,800	
長野銀行	3,900	1,092.00	4,258,800	
名古屋銀行	1,700	2,482.00	4,219,400	
北洋銀行	21,500	234.00	5,031,000	
中京銀行	1,800	1,478.00	2,660,400	
愛媛銀行	4,800	783.00	3,758,400	
トマト銀行	3,200	1,036.00	3,315,200	
京葉銀行	11,300	401.00	4,531,300	
栃木銀行	20,400	167.00	3,406,800	
トモニホールディングス	16,800	292.00	4,905,600	
フィデアホールディングス	28,300	116.00	3,282,800	
池田泉州ホールディングス	31,900	158.00	5,040,200	
F P G	10,600	720.00	7,632,000	
S B Iホールディングス	17,500	2,644.00	46,270,000	
ジャフコグループ	1,900	6,740.00	12,806,000	
大和証券グループ本社	106,500	608.20	64,773,300	
野村ホールディングス	214,000	558.40	119,497,600	
岡三証券グループ	12,900	406.00	5,237,400	
丸三証券	10,400	601.00	6,250,400	
東海東京フィナンシャル・ホールディングス	20,500	390.00	7,995,000	
水戸証券	12,300	285.00	3,505,500	
いちよし証券	7,000	558.00	3,906,000	
松井証券	7,700	799.00	6,152,300	
マネックスグループ	12,500	739.00	9,237,500	
極東証券	5,600	788.00	4,412,800	
藍澤証券	8,900	999.00	8,891,100	
かんぽ生命保険	17,600	2,013.00	35,428,800	
S O M P Oホールディングス	25,000	4,031.00	100,775,000	
M S & A Dインシュアランスグループホールディングス	34,400	3,141.00	108,050,400	
第一生命ホールディングス	74,700	2,016.00	150,595,200	
東京海上ホールディングス	46,500	4,919.00	228,733,500	

T & Dホールディングス	42,500	1,390.00	59,075,000
全国保証	3,600	4,705.00	16,938,000
クレディセゾン	8,300	1,343.00	11,146,900
芙蓉総合リース	1,600	6,850.00	10,960,000
みずほリース	2,200	3,515.00	7,733,000
東京センチュリー	3,100	5,530.00	17,143,000
日本証券金融	9,800	809.00	7,928,200
アイフル	22,400	384.00	8,601,600
リコーリース	1,600	3,355.00	5,368,000
イオンフィナンシャルサービス	9,400	1,281.00	12,041,400
アコム	30,400	503.00	15,291,200
オリエントコーポレーション	40,800	148.00	6,038,400
オリックス	85,800	1,865.00	160,017,000
三菱HCキャピタル	51,800	582.00	30,147,600
日本取引所グループ	38,300	2,528.50	96,841,550
アサックス	5,500	685.00	3,767,500
NECキャピタルソリューション	1,900	2,157.00	4,098,300
いちご	19,100	362.00	6,914,200
ヒューリック	31,300	1,261.00	39,469,300
野村不動産ホールディングス	9,100	2,823.00	25,689,300
オープンハウス	4,100	5,110.00	20,951,000
東急不動産ホールディングス	40,100	696.00	27,909,600
飯田グループホールディングス	12,100	2,842.00	34,388,200
パーク24	8,200	2,040.00	16,728,000
三井不動産	64,500	2,608.00	168,216,000
三菱地所	92,300	1,840.00	169,832,000
平和不動産	2,400	4,150.00	9,960,000
東京建物	14,400	1,607.00	23,140,800
ダイビル	5,300	1,400.00	7,420,000
京阪神ビルディング	3,800	1,362.00	5,175,600
住友不動産	31,800	3,926.00	124,846,800
テーオーシー	9,300	670.00	6,231,000
スターツコーポレーション	2,300	2,614.00	6,012,200
空港施設	5,500	638.00	3,509,000
ゴールドクレスト	3,400	1,741.00	5,919,400
エスリード	2,000	1,569.00	3,138,000
A V A N T I A	4,300	884.00	3,801,200
イオンモール	7,400	1,757.00	13,001,800
カチタス	3,700	2,990.00	11,063,000
日本空港ビルデング	4,600	5,270.00	24,242,000
ミクシィ	2,600	2,838.00	7,378,800
日本M & Aセンター	22,600	2,657.00	60,048,200
UTグループ	2,200	3,085.00	6,787,000
パソナグループ	2,300	2,211.00	5,085,300
G C A	7,300	981.00	7,161,300
エス・エム・エス	4,500	3,135.00	14,107,500
パーソルホールディングス	13,900	2,154.00	29,940,600
クックパッド	13,300	245.00	3,258,500

学情	2,600	1,352.00	3,515,200	
スタジオアリス	1,700	2,382.00	4,049,400	
シミックホールディングス	3,700	1,527.00	5,649,900	
N J S	2,500	1,989.00	4,972,500	
総合警備保障	5,400	4,915.00	26,541,000	
カカクコム	10,700	3,280.00	35,096,000	
アイロムグループ	2,000	1,980.00	3,960,000	
ディップ	2,600	3,340.00	8,684,000	
キャリアデザインセンター	2,500	1,026.00	2,565,000	
ベネフィット・ワン	4,300	3,445.00	14,813,500	
エムスリー	24,000	7,304.00	175,296,000	
アウトソーシング	6,600	1,983.00	13,087,800	
ディー・エヌ・エー	6,400	2,178.00	13,939,200	
博報堂D Yホールディングス	19,600	1,688.00	33,084,800	
ぐるなび	8,400	541.00	4,544,400	
ファンコミュニケーションズ	10,500	394.00	4,137,000	
WDBホールディングス	1,500	2,767.00	4,150,500	
インフォマート	15,000	915.00	13,725,000	
E P Sホールディングス	4,600	1,796.00	8,261,600	
クイック	3,700	1,198.00	4,432,600	
電通グループ	15,400	3,765.00	57,981,000	
H . U . グループホールディングス	3,500	2,858.00	10,003,000	
ダイオーズ	3,400	1,014.00	3,447,600	
日本空調サービス	7,100	709.00	5,033,900	
オリエンタルランド	14,500	15,990.00	231,855,000	
ダスキン	3,300	2,515.00	8,299,500	
ラウンドワン	5,800	1,387.00	8,044,600	
リゾートトラスト	5,900	1,783.00	10,519,700	
ビー・エム・エル	1,700	3,690.00	6,273,000	
りらいあコミュニケーションズ	4,600	1,322.00	6,081,200	
リソー教育	16,700	312.00	5,210,400	
早稲田アカデミー	7,600	921.00	6,999,600	
ユー・エス・エス	15,800	1,816.00	28,692,800	
サイバーエージェント	34,000	2,294.00	77,996,000	
楽天グループ	64,100	1,247.00	79,932,700	
テー・オー・ダブリュー	13,200	323.00	4,263,600	
エン・ジャパン	2,200	3,890.00	8,558,000	
テクノプロ・ホールディングス	2,600	7,490.00	19,474,000	
インターワークス	6,800	410.00	2,788,000	
アイ・アールジャパンホールディングス	600	14,040.00	8,424,000	
ジャパンマテリアル	6,600	1,276.00	8,421,600	
キャリアリンク	1,500	2,105.00	3,157,500	
ライドオンエクスプレスホールディングス	3,800	1,447.00	5,498,600	
リクルートホールディングス	98,000	5,390.00	528,220,000	
エラン	4,000	1,263.00	5,052,000	
日本郵政	100,900	898.20	90,628,380	
ベイカレント・コンサルティング	900	35,250.00	31,725,000	
M S - J a p a n	3,600	1,233.00	4,438,800	

ジャパンエレベーターサービスホールディングス	3,100	2,457.00	7,616,700	
リログループ	7,700	2,589.00	19,935,300	
エイチ・アイ・エス	4,000	2,510.00	10,040,000	
共立メンテナンス	1,700	3,870.00	6,579,000	
建設技術研究所	2,000	2,403.00	4,806,000	
東京都競馬	1,300	4,610.00	5,993,000	
カナモト	2,700	2,498.00	6,744,600	
トランス・コスモス	1,700	2,864.00	4,868,800	
乃村工藝社	7,800	925.00	7,215,000	
日本管財	3,200	2,327.00	7,446,400	
白洋舎	1,100	2,325.00	2,557,500	
セコム	13,500	8,242.00	111,267,000	
セントラル警備保障	1,700	3,020.00	5,134,000	
メイテック	1,300	6,090.00	7,917,000	
応用地質	4,700	1,258.00	5,912,600	
船井総研ホールディングス	2,700	2,396.00	6,469,200	
ベネッセホールディングス	4,900	2,657.00	13,019,300	
イオンディライト	2,000	3,335.00	6,670,000	
ダイセキ	2,100	4,525.00	9,502,500	
ステップ	3,000	1,584.00	4,752,000	
合 計	15,252,600	-	37,227,636,700	

(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。

- (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6月22日から2021年12月21日まで)の中間財務諸表について、P w C あらた有限責任監査法人により中間監査を受けております。

中間財務諸表

【東京海上セレクション・日本株TOPIX】

(1)【中間貸借対照表】

(単位:円)

	前期 2021年 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
資産の部		
流動資産		
親投資信託受益証券	25,283,651,372	27,027,346,944
未収入金	83,394,902	48,219,201
流動資産合計	25,367,046,274	27,075,566,145
資産合計	25,367,046,274	27,075,566,145
負債の部		
流動負債		
未払解約金	63,913,955	27,316,842
未払受託者報酬	2,747,998	2,950,718
未払委託者報酬	16,487,905	17,704,225
その他未払費用	245,044	247,416
流動負債合計	83,394,902	48,219,201
負債合計	83,394,902	48,219,201
純資産の部		
元本等		
元本	10,682,113,091	10,907,728,426
剰余金		
中間剰余金又は中間欠損金()	14,601,538,281	16,119,618,518
(分配準備積立金)	6,368,244,980	5,867,653,244
元本等合計	25,283,651,372	27,027,346,944
純資産合計	25,283,651,372	27,027,346,944
負債純資産合計	25,367,046,274	27,075,566,145

(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 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21日
営業収益		
有価証券売買等損益	2,641,362,979	1,203,066,372
営業収益合計	2,641,362,979	1,203,066,372
営業費用		
受託者報酬	6,899,425	2,950,718
委託者報酬	39,473,375	17,704,225
その他費用	247,500	247,416
営業費用合計	46,620,300	20,902,359
営業利益又は営業損失()	2,594,742,679	1,182,164,013
経常利益又は経常損失()	2,594,742,679	1,182,164,013
中間純利益又は中間純損失()	2,594,742,679	1,182,164,013
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()	122,714,223	102,520,744
期首剰余金又は期首欠損金()	10,234,307,668	14,601,538,281
剰余金増加額又は欠損金減少額	903,404,425	1,646,860,612
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	903,404,425	1,646,860,612
剰余金減少額又は欠損金増加額	1,113,388,046	1,208,423,644
中間一部解約に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	1,113,388,046	1,208,423,644
中間追加信託に伴う剰余金減少額又は欠損金増加額	-	-
中間剰余金又は中間欠損金()	12,496,352,503	16,119,618,518

(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 6月22日 至 2021年12月21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 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21日現在
1. 1 期首元本額	10,987,127,059円	10,682,113,091円
期中追加設定元本額	1,920,672,417円	1,106,613,574円
期中一部解約元本額	2,225,686,385円	880,998,239円
2. 1 中間計算期間末日における受益権の総数	10,682,113,091口	10,907,728,426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 6月23日 至 2020年12月22日	当中間計算期間 自 2021年 6月22日 至 2021年12月21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 6月21日現在	当中間計算期間末 2021年12月21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。	金融商品の時価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。
----------------------------	---	--

(1口当たり情報に関する注記)

前期 2021年 6月21日現在		当中間計算期間末 2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.3669円 23,669円)	1口当たり純資産額 (1万口当たり純資産額)	2.4778円 24,778円)

(ご参考)

当ファンドは、「TMA日本株TOPIX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 6月21日現在	2021年12月21日現在
		金額(円)	金額(円)
資産の部			
流動資産			
コール・ローン		2,101,780,295	2,319,397,877
株式	2	37,227,636,700	40,806,485,730
未収配当金		198,164,489	3,181,450
前払金		17,697,500	12,035,000
流動資産合計		39,545,278,984	43,141,100,057
資産合計		39,545,278,984	43,141,100,057
負債の部			
流動負債			
派生商品評価勘定		65,269,600	1,905,400
未払金			2,058,000
未払解約金		87,523,431	1,727,634,997
未払利息		1,997	2,848
流動負債合計		152,795,028	1,731,601,245
負債合計		152,795,028	1,731,601,245
純資産の部			
元本等			
元本	1	24,083,433,879	24,164,367,098
剰余金			
剰余金又は欠損金()		15,309,050,077	17,245,131,714
元本等合計		39,392,483,956	41,409,498,812
純資産合計		39,392,483,956	41,409,498,812
負債純資産合計		39,545,278,984	43,141,100,057

(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 6月22日 至 2021年12月21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 6月21日現在	2021年12月21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	21,910,325,926円	24,083,433,879円
同期中における追加設定元本額	14,515,077,219円	4,033,517,186円
同期中における一部解約元本額	12,341,969,266円	3,952,583,967円
同中間期末における元本額	24,083,433,879円	24,164,367,098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 >	107,026,499円	97,798,257円
円資産バランスファンド2019 - 05 < 適格機関投資家限定 >	371,256,017円	357,194,107円
円資産バランスファンド2019 - 09 < 適格機関投資家限定 >	268,817,509円	263,755,379円
円資産バランスファンド2019 - 12 < 適格機関投資家限定 >	369,366,104円	362,419,262円
東京海上セレクション・日本株 T O P I X	15,457,389,113円	15,771,340,926円
東京海上・円資産インデックスバランスファンド	7,732,114円	10,918,313円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2035	70,352,669円	130,077,791円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2045	34,347,610円	65,683,750円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2055	20,673,612円	44,697,138円
東京海上ターゲット・イヤー・ファンド 2065	50,346,152円	96,348,555円
T M A 日本株式インデックス V A < 適格機関投資家限定 >	535,245,422円	598,487,001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 >	155,680,608円	189,277,560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 >	1,035,235,645円	1,257,767,318円
東京海上・ T O P I X インデックスファンド < 適格機関投資家限定 >	5,379,384,381円	4,650,839,011円

円資産バランスオープン＜適格機関投資家限定＞	220,288,608円	223,547,399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）	291,816円	44,215,331円
計	24,083,433,879円	24,164,367,098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	24,083,433,879口	24,164,367,098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 850,520,000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 808,050,000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 6月21日現在	2021年12月21日現在
1. 貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額	時価で計上しているため、その差額はありません。	同左
2. 時価の算定方法並びに有価証券及びデリバティブ取引に関する事項	<p>(1)有価証券 （重要な会計方針に係る事項に関する注記）に記載しております。</p> <p>(2)デリバティブ取引 （デリバティブ取引等に関する注記）に記載しております。</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品については、短期間で決済され、時価は帳簿価額と近似しているため、当該帳簿価額を時価としております。</p>	<p>(1)有価証券 同左</p> <p>(2)デリバティブ取引 同左</p> <p>(3)有価証券及びデリバティブ取引以外の金融商品 同左</p>
3. 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明	<p>金融商品の時価には、市場価格に基づく価額のほか、市場価格がない場合には合理的に算定された価額が含まれております。当該価額の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>	<p>金融商品の時価の算定においては一定の前提条件等を採用しているため、異なる前提条件等によった場合、当該価額が異なることもあります。また、デリバティブ取引に関する契約額等は、あくまでもデリバティブ取引における名目的な契約額又は計算上の想定元本であり、当該金額自体がデリバティブ取引のリスクの大きさを示すものではありません。</p>

(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6月21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	2,269,257,500		2,204,000,000	65,257,500
	東証株価指数先物	2,269,257,500		2,204,000,000	65,257,500
合計		2,269,257,500		2,204,000,000	65,257,500

(2021年12月21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	277,340,000		275,450,000	1,890,000
	東証株価指数先物	277,340,000		275,450,000	1,890,000
合計		277,340,000		275,450,000	1,890,000

(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 6月21日現在		2021年12月21日現在	
1口当たり純資産額	1.6357円	1口当たり純資産額	1.7137円
(1万口当たり純資産額)	16,357円)	(1万口当たり純資産額)	17,137円)

2【ファンドの現況】

【純資産額計算書】

2021年12月30日 現在

種類	金額
資産総額	27,464,880,168 円
負債総額	38,944,156 円
純資産総額(-)	27,425,936,012 円
発行済数量	10,931,234,268 口
1 単位当たり純資産額(/)	2.5090 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12月30日 現在

種類	金額
資産総額	41,100,477,519 円
負債総額	57,930,068 円
純資産総額(-)	41,042,547,451 円
発行済数量	23,650,981,941 口
1 単位当たり純資産額(/)	1.7353 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。

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、
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、
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、
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、
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、）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12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12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	172	2,911,704
単位型公社債投資信託	2	5,158
単位型株式投資信託	11	39,539
合計	185	2,956,401

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。
また、当社の中間財務諸表は、「中間財務諸表等の用語、様式及び作成方法に関する規則」(昭和52年大蔵省令第38号)並びに同規則第38条及び第57条により、「金融商品取引業等に関する内閣府令」(平成19年内閣府令第52号)に基づいて作成しております。
2. 当社は、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、第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。
また、金融商品取引法第193条の2第1項の規定に基づき、当中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の中間財務諸表について、PwCあらた有限責任監査法人による中間監査を受けております。

(1)【貸借対照表】

(単位：千円)

	第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 器具備品 364,003千円	建物 148,089千円 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 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
(1) 金融商品に対する取組方針 当社の資本は本来の事業目的のために使用することを基本とし、資産の運用に際しては、資産運用リスクを極力最小限に留めることを基本方針としております。	(1) 金融商品に対する取組方針 同左
(2) 金融商品の内容及びそのリスク 営業債権である未収収益は顧客の信用リスクに晒されており、未収委託者報酬は市場リスクに晒されております。投資有価証券は、主にファンドの自己設定に関連する投資信託であり、基準価額の変動リスクに晒されております。 営業債務である未払金は、ほとんど1年以内の支払期日であり、流動性リスクに晒されております。	(2) 金融商品の内容及びそのリスク 同左
(3) 金融商品に係るリスク管理体制 信用リスク 未収収益については、管理部門において取引先ごとに期日及び残高を把握することで、回収懸念の早期把握や軽減を図っております。 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。	(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

2. 金融商品の時価等に関する事項

第35期(2020年3月31日現在)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

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

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

第36期(2021年3月31日現在)における貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。なお、時価を把握することが極めて困難と認められるものは次表には含めておりません(注2)参照)。

(単位:千円)

	貸借対照表計上額(*)	時価(*)	差額
(1)現金・預金	22,550,090	22,550,090	-
(2)未収委託者報酬	2,973,733	2,973,733	-
(3)未収収益	2,375,688	2,375,688	-
(4)未収入金	3,865	3,865	-
(5)投資有価証券 その他有価証券	49,477	49,477	-
(6)預り金	(45,524)	(45,524)	-
(7)未払金	(2,979,963)	(2,979,963)	-
(8)未払費用	(429,654)	(429,654)	-
(9)未払消費税等	(468,610)	(468,610)	-
(10)未払法人税等	(1,378,000)	(1,378,000)	-

(*)負債に計上されているものについては、()で示しております。

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

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在
(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(6)預り金、(7)未払金、(8)未払費用、(9)未払消費税等及び(10)未払法人税等 これらは短期間で決済されるため、時価は帳簿価額にほぼ等しいことから、当該帳簿価額によっております。	(1)現金・預金、(2)未収委託者報酬、(3)未収収益、(4)未収入金、(6)預り金、(7)未払金、(8)未払費用、(9)未払消費税等及び(10)未払法人税等 同左
(5)投資有価証券 時価の算定方法につきましては「重要な会計方針」の「1.有価証券の評価基準及び評価方法」に記載しております。	(5)投資有価証券 同左

(注2) 時価を把握することが極めて困難と認められる金融商品

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在

以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

(単位：千円)

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

以下については、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められるため、上表には含めておりません。

(単位：千円)

	貸借対照表計上額
子会社株式	1,640,302
関連会社株式	32,747
その他の関係会社 有価証券	71,200
敷金	474,324
その他長期差入保証金	10,030

(注3) 金融商品の時価等に関する事項についての補足説明

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在
該当事項はありません。	同左

(注4) 金銭債権及び満期がある有価証券の決算日後の償還予定額

第35期(2020年3月31日現在)

(単位：千円)

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

第36期(2021年3月31日現在)

(単位：千円)

	1年以内	1年超 5年以内	5年超 10年以内	10年超
預金	22,549,627	-	-	-
未収委託者報酬	2,973,733	-	-	-
未収収益	2,375,688	-	-	-
未収入金	3,865	-	-	-
投資有価証券 その他有価証券のうち満期があ るもの	8,474	16,416	5,279	-
合計	27,911,389	16,416	5,279	-

(有価証券関係)

第35期 2020年3月31日現在	第36期 2021年3月31日現在

<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 31,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p> <p>2. その他有価証券 (単位:千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託</td> <td>32,071</td> <td>27,816</td> <td>4,254</td> </tr> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託</td> <td>33,538</td> <td>42,372</td> <td>8,834</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>65,610</td> <td>70,189</td> <td>4,579</td> </tr> </tbody> </table> <p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 該当事項はありません。</p>	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ないもの証券投資信託	33,538	42,372	8,834	合計	65,610	70,189	4,579	<p>1. 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券</p> <p>子会社株式及び関連会社株式(貸借対照表計上額 子会社株式1,640,302千円、関連会社株式32,747千円)並びにその他の関係会社有価証券(貸借対照表計上額 71,200千円)は、市場価格がなく、かつ将来キャッシュ・フローを見積ること等ができず、時価を把握することが極めて困難と認められることから、記載しておりません。</p> <p>2. その他有価証券 (単位:千円)</p> <table border="1"> <thead> <tr> <th>区分</th> <th>貸借対照表計上額</th> <th>取得原価</th> <th>差額</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの証券投資信託</td> <td>37,407</td> <td>27,442</td> <td>9,964</td> </tr> <tr> <td>貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの証券投資信託</td> <td>12,070</td> <td>12,820</td> <td>749</td> </tr> <tr> <td>合計</td> <td>49,477</td> <td>40,262</td> <td>9,214</td> </tr> </tbody> </table> <p>3. 当事業年度中に売却したその他有価証券 同左</p>	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	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	12,070	12,820	749	合計	49,477	40,262	9,214
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ないもの証券投資信託	33,538	42,372	8,834																														
合計	65,610	70,189	4,579																														
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	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	12,070	12,820	749																														
合計	49,477	40,262	9,214																														

(退職給付関係)

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

(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的主要原因別の内訳

	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</p> <p style="text-align: right;">(単位：千円)</p> <table border="1" style="width: 100%; border-collapse: collapse;"> <thead> <tr> <th style="width: 33%;">日本</th> <th style="width: 33%;">その他</th> <th style="width: 33%;">合計</th> </tr> </thead> <tbody> <tr> <td style="text-align: center;">23,387,535</td> <td style="text-align: center;">2,699,004</td> <td style="text-align: center;">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おりません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	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おりません。

(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
貸借対照表の純資産の部の合計額	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

中間財務諸表
中間貸借対照表

(単位：千円)

当中間会計期間 (2021年9月30日現在)		
資産の部		
流動資産		
現金・預金		18,650,313
前払費用		181,371
未収委託者報酬		3,092,025
未収収益		3,209,267
未収入金		25,743
その他の流動資産		21,944
流動資産計		25,180,666
固定資産		
有形固定資産	* 1	471,105
建物		337,674
器具備品		133,430
無形固定資産		156,859
電話加入権		3,795
ソフトウェア		140,315
ソフトウェア仮勘定		12,748
投資その他の資産		3,287,429
投資有価証券		46,790
関係会社株式		1,673,049
その他の関係会社有価証券		71,200
長期前払費用		36,955
敷金		474,324
その他長期差入保証金		20,230
繰延税金資産		964,879
固定資産計		3,915,393
資産合計		29,096,059
負債の部		
流動負債		
未払金		2,741,875
未払手数料		1,400,568
その他未払金		1,341,306
未払費用		484,629
未払消費税等	* 2	247,866
未払法人税等		1,306,000
預り金		51,203
前受収益		13,273
賞与引当金		599,058
流動負債計		5,443,908
固定負債		
退職給付引当金		828,932
固定負債計		828,932
負債合計		6,272,841
純資産の部		
株主資本		22,817,163
資本金		2,000,000
資本剰余金		400,000

その他資本剰余金	400,000
利益剰余金	20,417,163
利益準備金	500,000
その他利益剰余金	19,917,163
特別償却準備金	0
繰越利益剰余金	19,917,163
評価・換算差額等	6,054
その他有価証券評価差額金	6,054
純資産合計	22,823,218
負債・純資産合計	29,096,059

中間損益計算書

(単位：千円)

当中間会計期間	
(自 2021年4月1日	
至 2021年9月30日)	
営業収益	
委託者報酬	9,246,109
運用受託報酬	4,955,773
投資助言報酬	31,414
その他営業収益	258,494
営業収益計	14,491,792
営業費用	
支払手数料	4,296,414
広告宣伝費	114,331
調査費	3,418,391
調査費	1,425,657
委託調査費	1,992,734
委託計算費	57,490
営業雑経費	138,868
通信費	18,011
印刷費	91,047
協会費	14,604
諸会費	8,337
図書費	6,867
営業費用計	8,025,496
一般管理費	
給料	1,589,022
役員報酬	63,507
給料・手当	1,397,094
賞与	128,421
交際費	1,934
旅費交通費	5,113
租税公課	87,309
不動産賃借料	234,046
退職給付費用	82,426
賞与引当金繰入	599,058
固定資産減価償却費	* 1 74,067
法定福利費	313,891
福利厚生費	8,484
諸経費	199,635
一般管理費計	3,194,992
営業利益	3,271,303

営業外収益	
受取利息	79
受取配当金	3,240
雑益	7,390
営業外収益計	10,711
営業外費用	
為替差損	7,160
雑損	22,194
営業外費用計	29,355
経常利益	3,252,659
特別損失	
器具備品除却損	25
特別損失計	25
税引前中間純利益	3,252,634
法人税、住民税及び事業税	1,227,848
法人税等調整額	230,270
法人税等合計	997,578
中間純利益	2,255,055

中間株主資本等変動計算書

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

（単位：千円）

	株主資本					
	資本金	資本剰余金		利益準備金	利益剰余金	
		その他資本 剰余金	資本剰余金 合計		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	22,599,322
当中間期変動額						
剰余金の配当						4,937,214
特別償却準備金の取崩					0	0
中間純利益						2,255,055
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）						
当中間期変動額合計	-	-	-	-	0	2,682,158
当中間期末残高	2,000,000	400,000	400,000	500,000	0	19,917,163

	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	23,099,322	25,499,322	6,393	6,393	25,505,715
当中間期変動額					
剰余金の配当	4,937,214	4,937,214			4,937,214
特別償却準備金の取崩	-	-			-
中間純利益	2,255,055	2,255,055			2,255,055
株主資本以外の項目の 当中間期変動額（純額）			338	338	338

当中間期変動額合計	2,682,159	2,682,159	338	338	2,682,497
当中間期末残高	20,417,163	22,817,163	6,054	6,054	22,823,218

注記事項

(重要な会計方針)

当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日
<p>1. 有価証券の評価基準及び評価方法</p> <p>(1) 子会社株式及び関連会社株式並びにその他の関係会社有価証券 移動平均法による原価法</p> <p>(2) その他有価証券 市場価格のない株式等以外のもの 中間会計期間末日の市場価格等に基づく時価法 (評価差額は、全部純資産直入法により処理し、売却原価は移動平均法により算定) 市場価格のない株式等 移動平均法による原価法</p> <p>2. 固定資産の減価償却の方法</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>3. 引当金の計上基準</p> <p>(1) 賞与引当金 従業員賞与の支給に充てるため、支給見込額の当中間会計期間負担額を計上しております。</p> <p>(2) 退職給付引当金 従業員の退職給付に備えるため、当中間会計期間末における退職給付債務の見込額に基づき計上しております。 退職給付見込額の期間帰属方法 退職給付債務の算定にあたり、退職給付見込額を当中間会計期間末までの期間に帰属させる方法については給付算定式基準によっております。 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。</p> <p>4. 収益及び費用の計上基準</p> <p>当社は、顧客への投資運用業及び投資助言・代理業に関するサービスから生じる委託者報酬、運用受託報酬等により収益を獲得しております。これらには成功報酬が含まれる場合があります。</p> <p>(1) 運用報酬</p>

投資運用・助言サービスのうち運用資産残高等を基礎として算定される報酬（運用報酬）については、当該サービスに係る履行義務は日々充足されると判断し、運用期間にわたり収益として認識しております。確定した報酬は、月次、年4回、年2回もしくは年1回受け取ります。

(2) 成功報酬

成功報酬は、契約上定められる超過収益の達成等により履行義務を充足し、報酬額及び支払われることが確定した時点で収益として認識しております。確定した報酬は、履行義務充足時点から短期間で支払いを受けます。

5. 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。

(会計方針の変更)

当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日
「収益認識に関する会計基準」（企業会計基準第29号 2020年3月31日）等を当中間会計期間の期首から適用し、約束した又はサービスの支配が顧客に移転した時点で、当該財又はサービスと交換に受け取ると見込まれる金額で収益を認識することとしております。なお、当該変更による影響額は軽微であります。
「時価の算定に関する会計基準」（企業会計基準第30号 2019年7月4日）等を当中間会計期間の期首から適用するとともに、「時価の算定に関する会計基準の適用指針（企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日改正）」を当中間会計期間の期首から早期適用しております。なお、当該変更による中間財務諸表に与える影響はございません。

(中間貸借対照表関係)

	当中間会計期間 (2021年9月30日現在)
1 有形固定資産の減価償却累計額	建物 164,970千円 器具備品 452,358千円
2 消費税等の取扱い	仮払消費税等及び仮受消費税等は相殺のうえ、未払消費税等として表示しております。

(中間損益計算書関係)

	当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日
1 減価償却実施額	有形固定資産 59,491千円 無形固定資産 14,575千円

(中間株主資本等変動計算書関係)

	当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日			
1. 発行済株式の種類及び総数に関する事項				
株式の種類	当事業年度期首 (株)	当中間会計期間 増加 (株)	当中間会計期間 減少 (株)	当中間会計期間末 (株)
普通株式	38,300	-	-	38,300
2. 配当に関する事項				

配当金支払額

2021年6月30日の定時株主総会において、次のとおり決議しております。

・普通株式の配当に関する事項

- (イ) 配当金の総額・・・・・・・・・・4,937,214千円
- (ロ) 1株当たり配当額・・・・・・・・・・128,909円
- (ハ) 基準日・・・・・・・・・・2021年3月31日
- (ニ) 効力発生日・・・・・・・・・・2021年6月30日

(金融商品関係)

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

1. 金融商品の時価等に関する事項

2021年9月30日現在における中間貸借対照表計上額、時価及びこれらの差額については、次のとおりであります。

(単位：千円)

	中間貸借対照表計上額	時価	差額
投資有価証券			
その他有価証券	46,790	46,790	-
敷金	474,324	476,269	1,945
資産計	521,114	523,060	1,945

(*1) 以下の金融商品については、現金であること、及び短期で決済されるため時価が帳簿価額に近似するものであることから、記載を省略しております。

- 現金・預金
- 未収委託者報酬
- 未収収益
- 未収入金
- 預り金
- 未払金
- 未払費用

(*2) 関係会社株式及びその他の関係会社有価証券(持分相当額を純額で計上する組合等への出資1,200千円を除く)については、市場価格のない株式等に該当することから、時価を注記しておりません。これらの中間貸借対照表計上額は、それぞれ以下のとおりです。

関係会社株式	
子会社株式	1,640,302千円
関連会社株式	32,747千円
その他の関係会社有価証券	70,000千円

(*3) その他の関係会社有価証券のうち1,200千円については、中間貸借対照表に持分相当額を純額で計上する組合等への出資に該当するため、「時価の算定に関する会計基準の適用指針」(企業会計基準適用指針第31号 2021年6月17日改正)の第24-16項を適用し、時価に関する注記を省略しております。

2. 金融商品の時価のレベルごとの内訳等に関する事項

金融商品の時価を時価の算定に係るインプットの観察可能性及び重要性に応じて、以下の3つのレベルに分類しております。

- レベル1の時価 : 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、活発な市場において形成される当該時価の算定の対象となる資産又は負債に関する相場価格により算定した時価
- レベル2の時価 : 観察可能な時価の算定に係るインプットのうち、レベル1のインプット以外の時価の算定に係るインプットを用いて算定した時価
- レベル3の時価 : 観察できない時価の算定に係るインプットを使用して算定した時価

(1)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品

(単位：千円)

	時価			合計
	レベル1	レベル2	レベル3	
投資有価証券				
その他有価証券	-	46,790	-	46,790

資産計	-	46,790	-	46,790
-----	---	--------	---	--------

(2)時価で中間貸借対照表に計上している金融商品以外の金融商品

(単位：千円)

	時価			
	レベル1	レベル2	レベル3	合計
敷金	-	476,269	-	476,269
資産計	-	476,269	-	476,269

(注)時価の算定に用いた評価技法及び時価の算定に係るインプットの説明

投資有価証券

投資信託は基準価額を用いて評価しており、活発な市場における相場価格とはいえないことから、レベル2の時価に分類しております。

敷金

敷金は、回収可能性を反映した将来キャッシュ・フローを残存期間に対応する国債の利回り等で割り引いた現在価値により算定しており、レベル2の時価に分類しております。

(有価証券関係)

当中間会計期間(2021年9月30日現在)

その他有価証券

	種類	中間貸借対照表 計上額(千円)	取得原価 (千円)	差額(千円)
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えるもの	証券投資信託	43,583	34,357	9,226
中間貸借対照表計上額が取得原価を超えないもの	証券投資信託	3,206	3,706	499
合計		46,790	38,063	8,727

(収益認識関係)

1.顧客との契約から生じる収益を分解した情報

当中間会計期間(自2021年4月1日至2021年9月30日)

(単位：千円)

	運用報酬	成功報酬	合計
委託者報酬	9,246,109	-	9,246,109
運用受託報酬	4,955,773	-	4,955,773
投資助言報酬	31,414	-	31,414
その他営業収益	258,494	-	258,494
合計	14,491,792	-	14,491,792

2.顧客との契約に基づく履行義務の充足と当該契約から生じるキャッシュ・フローとの関係並びに当中間会計期間末において存在する顧客との契約から当中間会計期間の末日後に認識すると見込まれる収益の金額及び時期に関する情報

顧客との契約から生じた債権等

(単位：千円)

	当中間会計期間 自2021年4月1日 至2021年9月30日
顧客との契約から生じた債権(期首残高)	5,349,421
顧客との契約から生じた債権(期末残高)	6,301,292

(*)なお、当中間会計期間の期首及び期末において、顧客との契約から生じた契約資産及び契約負債はありません。

（セグメント情報等）

[セグメント情報]

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

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

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

[関連情報]

当中間会計期間（自 2021年4月1日 至 2021年9月30日）

1．製品及びサービスごとの情報

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

2．地域ごとの情報

(1) 営業収益

（単位：千円）

日本	その他	合計
13,030,226	1,461,565	14,491,791

(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。

(2) 有形固定資産

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

3．主要な顧客ごとの情報

投資信託の名称	委託者報酬 (単位：千円)	関連するセグメント名
東京海上・円資産バランスファンド (毎月決算型)	2,554,248	投資運用業及び投資助言・代理業にこれらの附帯業務を集約した単一セグメント

(1株当たり情報)

当中間会計期間 自 2021年4月1日 至 2021年9月30日	
1株当たり純資産額	595,906円49銭
1株当たり中間純利益金額	58,878円73銭
なお、潜在株式調整後1株当たり中間純利益金額については、潜在株式が存在しないため記載していません。	
(注) 1株当たり純資産額の算定上の基礎	
中間貸借対照表の純資産の部の合計額	22,823,218千円
純資産の部の合計額から控除する金額	-
普通株式に係る中間会計期間末の純資産額	22,823,218千円
1株当たり純資産額の算定に用いられた中間会計期間末の普通株式の数	38,300株
1株当たり中間純利益金額の算定上の基礎	
中間損益計算書上の中間純利益金額	2,255,055千円
普通株主に帰属しない金額	-
普通株式に係る中間純利益金額	2,255,055千円
普通株式の期中平均株式数	38,300株

4【利害関係人との取引制限】

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

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

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

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

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

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

5【その他】

(1) 定款の変更

委託会社の定款の変更に関しては、株主総会の決議が必要です。

(2) 訴訟事件その他の重要事項

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

第2【その他の関係法人の概況】

1【名称、資本金の額及び事業の内容】

(1) 受託会社

- ・ 名称 三菱UFJ信託銀行株式会社
(再信託受託会社：日本マスタートラスト信託銀行株式会社)
- ・ 資本金の額 324,279百万円(2021年9月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律(兼営法)に基づき信託業務を営んでいます。

<参考情報：再信託受託会社の概要>

- ・ 名称 日本マスタートラスト信託銀行株式会社
- ・ 資本金の額 10,000百万円(2021年9月末日現在)
- ・ 事業の内容 銀行法に基づき銀行業を営むとともに、金融機関の信託業務の兼営等に関する法律に基づき信託業務を営んでいます。

(2) 販売会社

名称	資本金の額()	事業の内容
auカブコム証券株式会社	7,196百万円	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。
S M B C 日興証券株式会社	10,000百万円	
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	
株式会社八十二銀行	52,243百万円	銀行法に基づき銀行業を営んでいます。
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9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8月4日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会御中

PwCあらた有限責任監査法人

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セレクション・日本株TOPIXの2020年6月23日から2021年6月21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、東京海上セレクション・日本株TOPIXの2021年6月21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、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、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12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**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、「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2021年4月1日から2022年3月31日までの第37期事業年度の中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)に係る中間財務諸表、すなわち、中間貸借対照表、中間損益計算書、中間株主資本等変動計算書、重要な会計方針及びその他の注記について中間監査を行った。

当監査法人は、上記の中間財務諸表が、我が国において一般に公正妥当と認められる中間財務諸表の作成基準に準拠して、東京海上アセットマネジメント株式会社の2021年9月30日現在の財政状態及び同日をもって終了する中間会計期間(2021年4月1日から2021年9月30日まで)の経営成績に関する有用な情報を表示しているものと認める。

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、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、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、継続企業的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。

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。

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、企業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、監査役に対して、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

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

以 上

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

2. XBRLデータは中間監査の対象には含まれていません。

独立監査人の中間監査報告書

2022年2月2日

東京海上アセットマネジメント株式会社

取締役会 御中

PwCあらた有限責任監査法人

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セレクション・日本株TOPIXの2021年6月22日から2021年12月21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、東京海上セレクション・日本株TOPIXの2021年12月21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6月22日から2021年12月21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。